

深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

深圳证券交易所债券回售转售业务之 券商技术系统变更指南

(Ver1.00)



深圳证券交易所 中国结算深圳分公司 二〇二一年七月



关于本文档

文档名	称	深圳证券交易所任	债券回售转售业务之券商技术系统变更指南				
说明							
	修订历史						
日期	版本	操作	说明				
2021-7-15	1.00	创建文档					



目录

一、	说明	1
二、	业务简介	1
三、	技术实现概况	2
四、	交易参考信息	2
五、	交易接口	3
5.1	委托申报	3
5.2	转发成交申报	13
六、	债券回售转售清算和交收	20
七、	开展债券回售转售业务的券商系统注意事项	21
7.1	委托相关说明	21
7.2	关于客户委托服务渠道	21
7.3	关于券商柜台系统	21
八、	联系方式	21



深圳证券交易所债券回售转售业务之券商技术系统 变更指南

一、 说明

为了会员和其他交易参与人在深圳证券交易所(以下简称"本所")交易系统上更好地开展债券回售转售业务,本所会同中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司(以下简称"中国结算深圳分公司")专门编制和发布本指南,供相关交易参与人及其IT提供商参考。

本所改造系统的宗旨: 从技术上保障证券市场安全运行, 同时尽量减少系统改造对会员和其他交易参与人带来的影响。

特别提示:如果业务规则及业务方案有所变更,本文档将做相应变更。

二、 业务简介

债券回售、回售撤销期结束后,如回售资金到帐日(T日)前或T日至T+20日内债券回售资金足额到账,发行人可向本所固定收益部申请进行回售转售。

发行人可在回售转售期内,作为券商的经纪客户向交易系统提交回售转售申报,经受让方确认后达成交易。

回售转售期内每个交易日的 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30 为债券回售转售业务的委托申报时间。

2.1.1 交易流程

- (1) 发行人按照规定格式提交债券回售转售成交请求委托,委托中包含价格、数量、证券代码、受让方交易单元等信息;
- (2) 交易系统对发行人的成交请求委托进行即时确认,并将债券回售转售成 交请求委托转发给受让方;
- (3) 受让方对交易系统转发的债券回售转售成交请求委托中的价格、数量、证券代码等要素进行确认,若拒绝达成成交,则申报拒绝的响应委托,申报委托中需要填写与发行人商定的约定号;若同意达成成交,则申报接受的响应委托,委托中需填写与发行人商定的约定号及本方证券账户;



- (4) 交易系统对于受让方申报的拒绝成交申报委托进行即时确认,并生成转 发成交申报发送给发行人委托的申报交易单元,以通知发行人申报的债 券回售转售成交请求委托被受让方拒绝。
- (5) 交易系统对于受让方申报的接受成交申报委托与发行人申报的债券回售转售成交请求委托进行配对撮合,向交易双方与中国结算深圳分公司即时发送成交回报。
- (6) 中国结算深圳分公司依据深交所确认的成交结果为债券回售转售提供 相应的清算交收等服务, 受让方的受让债券次一交易日达到可交易状态。

三、 技术实现概况

债券回售转售业务采用成交请求模式,成交请求模式消息处理流程请参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》"成交请求申报模式 (one party report for pass through)"一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》"成交请求申报模式 (one party report for pass through)"一节。

四、 交易参考信息

证券信息(securities) 文件的债券特有字段 BondParams 及资产支持证券特有字段 ReitsParams 新增"是否处于回售转售期"字段。

证券业务开关信息(securityswitch)文件新增开关类型"债券回售转售"。 上述内容详见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。



五、 交易接口

5.1 委托申报

5.1.1 Binary 接口委托申报

表 5-1 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	发行人成交请求 字段取值	发行人主动撤单 委托字段取值	受让方点击成交 申报(同意成交) 字段取值	受让方点击成交 申报(拒绝成交) 字段取值
Standard Header	消息头				
	MsgType=104303				
ApplID	应用标识	430	430	430	430
SubmittingDDLUD	申报交易单元, 需与本方	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SubmittingPBUID	交易单元一致				
SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	102	102	102	102
	102=深圳证券交易所				
	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
	1=个人投资者发起				
OwnerType	102=会员发起				
	103=机构投资者发起				
	104=自营交易发起				



第 4 页 共 21 页

	结算机构代码	01=中国结算深圳	01=中国结算深圳	01=中国结算深圳	01=中国结算深圳
ClearingFirm		分公司	分公司	分公司	分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
	成交申报类型	0	0	2	3
T 1 D 4T	0=提交成交申报				
TradeReportType	2=接受成交申报				
	3=拒绝成交申报				
	成交申报事务类别	0	1	2	2
T. I.D. (T. T.	0=New				
TradeReportTransType	1=Cancel				
	2=Replace				
	成交申报模式	3	3	3	3
	1=Two-Party Report, 成交				
	报告				
TradeHandlingInstr	2=One-Party Report For				
	Matching, 协议配对				
	3=One-Party Report for				
	Pass Through,成交请求				
	原客户成交申报编号	全空格	被撤委托的客户订	受让方接收的转发	受让方接收的转发
TradaDanastDafID	撤销成交申报时使用		单编号	成交申报的客户成	成交申报的客户成
TradeReportRefID	对于成交请求模式,接收			交申报编号	交申报编号
	方填写转发成交申报的				



第 5 页 共 21 页

	客户成交申报编号				
LastPx	价格	委托价格	委托价格	委托价格	委托价格
LastQty	数量	委托数量	委托数量	委托数量	委托数量
TrdType	成交申报业务类别	0	0	0	0
TrdCuhTuna	成交申报业务子类别	0	0	0	0
TrdSubType	预留,固定填0				
ConfirmID	约定号	约定号	全空格	约定号	约定号
Side	本方参与人买卖方向	2=卖	2=卖	1=买	1=买
PBUID	本方交易单元	发行人交易单元	发行人交易单元	受让方交易单元	受让方交易单元
AccountID	本方证券账户	发行人证券账户	发行人证券账户	受让方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	发行人营业部代码	发行人营业部代码	受让方营业部代码	受让方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	受让方交易单元	受让方交易单元	发行人交易单元	发行人交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格
SubmittingMemberID	申报方交易商代码, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
	申报方交易主体类型,预	全空格	全空格	全空格	全空格
	留				
SubmittingInvestorType	01=自营				
	02=资管				
	03=机构经纪				
CubmittingInvestorID	申报方交易主体代码, 预	全空格	全空格	全空格	全空格
SubmittingInvestorID	留				



第 6 页 共 21 页

SubmittingInvestorName	申报方客户名称,预留	全空格	全空格	全空格	全空格
SubmittingTraderCode	申报方交易员代码, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
	本方交易主体类型,预留 01=自营	全空格	全空格	全空格	全空格
InvestorType	02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪				
InvestorID	本方交易主体代码, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
InvestorName	本方客户名称,预留 当本方交易主体类型为 03=机构经纪、04=个人经 纪时,需填写本方客户名	全空格	全空格	全空格	全空格
TraderCode	本方交易员代码, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型,预留 01=自营 02=资管 03=机构经纪	全空格	全空格	全空格	全空格
	04=个人经纪				



第7页共21页

CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码,预留	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称, 预留	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码,预留	全空格	全空格	全空格	全空格
SettlType	结算方式,预留	0	0	0	0
	0=不指定				
	103=多边净额				
	104=逐笔全额				
SettlPeriod	结算周期, 预留	0	0	0	0
LastParPx	成交价格二, 预留	0	0	0	0
	信用标识,预留	1	1	1	1
	1=Cash,普通交易				
CashMargin	2=Open,融资融券开仓				
	3=Close,融券融券平仓				
Memo	备注,预留	全空格	全空格	全空格	全空格



说明:

- (1) 当受让方拒绝回售转售成交请求时本方证券账户(AccountID)字段为选填字段。
- (2) 对发行人委托中的本方证券账户(AccountID)字段,需填为转售申请中的回售转售专用账户。
 - (3) 暂不支持融资融券交易, 信用标识字段固定填 1。
- (4) 发行人、受让方的委托需满足以下匹配条件, 受让方才能成功拒绝发行人委托, 或与发行人委托成交:

, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	
要素	检查方法
受让方委托的本方交易单元	等于待匹配的发行人委托的对手方交
(PBUID)	易单元(CounterpartyPBUID)
受让方委托的对手方方交易单元	等于待匹配的发行人委托的本方交易
(CounterpartyPBUID)	单元(PBUID)
证券代码(SecurityID)	一致
证券代码源(SecurityIDSource)	一致
价格(LastPx)	一致
数量(LastQty)	一致
买卖方向(Side)	相反



5.1.2 STEP 接口委托申报

表 5-2 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	发行人成交请求字段	发行人主动撤单委托	受让方点击成交申报	受让方点击成交申报
			取值	字段取值	(同意成交) 字段取值	(拒绝成交) 字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	430	430	430	430
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	3	3	3	3



第 10 页 共 21 页

4						·	T
			1=Two-Party Report, 成	<u> </u>	<u> </u>		
			交报告	1			
			2=One-Party Report For	1			
			Matching, 协议配对	1	1		
			3= One-Party Report	1			
			for Pass Through,成交	1	1		
			请求	<u> </u>	'		
572	TradeR	ReportRefID	原客户成交申报编号	不需要填写	被撤委托的客户订单编号	受让方接收的转发成交申 报的客户成交申报编号	受让方接收的转发成交申 报的客户成交申报编号
			撤销成交申报时使用				1K4447 MAX 1K-144 J
60	Transac	ctTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件 <ins< td=""><td colspan="2">组件<instrument></instrument></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></ins<>	组件 <instrument></instrument>						
48	Security	yID	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
22	Securit	yIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102	102	102
组件结束	-						
组件 <ro< td=""><td>otPartie</td><td>es></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></ro<>	otPartie	es>					
1116	NoRoo	otPartyIDs	参与人代码个数	2	2	2	2
→	1117	Doot Douts IID	参与人代码	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本	申报方交易单元, 需与本	申报方交易单元,需与本
	111/	RootPartyID			方交易单元一致	方交易单元一致	方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识

深圳证券交易所债券回售转售业务之券商技术系统变更指南

深圳证券交易所



第 11 页 共 21 页

1119 RootPartyRole 1117 RootPartyID		PartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
		PartyID	参与人代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
1118	RootI	PartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
1119	RootI	PartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件 <trdcaprptsidegrp></trdcaprptsidegrp>							
NoSides			side 个数	1	1	1	1
54	Side		买卖方向	2=卖	2=卖	1=买	1=买
组件<	Parties	>					
453	453 NoPartyIDs		参与人代码个数	4	4	4	3
→	448	PartyID	参与人代码	发行人交易单元	发行人交易单元	受让方交易单元	受让方交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
	448	PartyID	参与人代码	发行人证券账户	发行人证券账户	受让方证券账户	不需要填写
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	不需要填写
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	不需要填写
	448	PartyID	参与人代码	发行人营业部代码	发行人营业部代码	受让方营业部代码	受让方营业部代码
	1117 1118 1119 11CapRp NoSide 54 组件<1 453	1117 Roots 1118 Roots 1119 Root	1117 RootPartyID 1118 RootPartyIDSource 1119 RootPartyRole 1119 RootPartyIDs 1119 RootPartyRole 1119 RootPartyIDs 1119 RootPartyRole 1119 RootPartyIDs 11119 RootPartyIDs 11119 RootPartyIDs 11119 RootParty	1117 RootPartyID	1117 RootPartyID	NootPartyID	RootPartyID 参与人代码

深圳证券交易所债券回售转售业务之券商技术系统变更指南

深圳证券交易所



第 12 页 共 21 页

	44	47	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	45	52	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
	44	48	PartyID	参与人代码	受让方交易单元	受让方交易单元	发行人交易单元	发行人交易单元
	44	47	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	45	52	PartyRole	参与人代码角色	17: 对手方交易单元	17: 对手方交易单元	17: 对手方交易单元	17: 对手方交易单元
	组件结束							
组件结束	٤							
31	LastPx			价格	委托价格	委托价格	委托价格	委托价格
32	LastQty		数量	委托数量	委托数量	委托数量	委托数量	
664	ConfirmID 约定号		约定号	约定号	不需要填写	约定号	约定号	

说明:字段取值参见Binary接口说明部分。



5.2 转发成交申报

转发成交申报是由交易系统生成的回报类报文。交易系统在如下三种情形下会 生成转发成交申报报文:

情形一:接收到发行人发起的成交请求申报后,交易系统生成转发成交申报报 文并发送给受让方:

情形二:接收到受让方合法的点击成交申报且成交申报类型为"3=拒绝成交申报"后,交易系统生成转发成交申报报文并发送给发行人,通知发行人已发起的成交请求申报被受让方拒绝;

情形三:在受让方确认或拒绝之前,接收到发行人合法的成交请求主动撤单委托,交易系统生成对应的转发主动撤单报文并发送给受让方。

如下 Binary、STEP 取值描述中原委托,在情形一、三中指发行人的成交申报, 情形二中指受让方的成交申报。

5.2.1 Binary 转发成交申报

表 5-3 Binary 接口转发成交申报消息定义

域名	字段描述	情形	情形	情形
		一字段取	二字段取	三字段
		值	值	取值
Standard Header	消息头			
Standard Header	MsgType=204320			
ReportIndex	回报记录号			
	应用标识	430:债券	430:债券	430:债券
ApplID		回售转售	130.100.33	130.100.30
			回售转售	回售转售
	回报交易单元	原委托的	原委托的	被撤委托
ReportingPBUID	1,462,634,133	对手方交	对手方交	对手方交
		易单元	易单元	易单元
	申报交易单元	原委托的	原委托的	原委托的
SubmittingPBUID		申报交易	申报交易	申报交易
		单元	单元	单元
Sa annitari ID	证券代码	原委托的	原委托的	原委托的
SecurityID		证券代码	证券代码	证券代码



~ ~		F 6 1. 11	T 61.11	m e 1. 11
SecurityIDSource	and more an	原委托的	原委托的	原委托的
	证券代码源	证券代码	证券代码	证券代码
		源	源	源
	订单所有者类型	原委托的	原委托的	原委托的
OwnerType		订单所有	订单所有	订单所有
		者类型	者类型	者类型
	结算机构代码	原委托的	原委托的	原委托的
ClearingFirm		结算机构	结算机构	结算机构
		代码	代码	代码
	回报时间	转发成交	转发成交	转发成交
TransactTime		申报生成	申报生成	申报生成
		时间	时间	时间
UserInfo	用户私有信息	全空格	全空格	全空格
	交易所成交申报	原委托成	被拒绝的	被撤委托
	编号	交申报响	发行人委	成交申报
		应中的交	托成交申	响中的交
TradeID		易所成交	报响应中	易所成交
		申报编号	的交易所	申报编号
			成交申报	
			编号	
	客户成交申报编	交易系统	发行人对	交易系统
TradaDanartD	号	生成编	应委托的	生成编
TradeReportID		号, 当日	客户成交	号,当日
		唯一	申报编号	唯一
TradeReportType	成交申报类型	1	3	1
	成交申报事务类	原委托的	1	原委托的
TradeReportTransType		成交申报		成交申报
	别	事务类别		事务类别
		原委托的	原委托的	原委托的
TradeHandlingInstr	成交申报模式	成交申报	成交申报	成交申报
		模式	模式	模式
		全空格	全空格	填交易系
				统生成的
	原客户成交申报			与原被撤
TradeReportRefID				转发成交
	编号			申报对应
				的唯一编
				号
	15. 16	原委托的	原委托的	原委托的
LastPx	价格	价格	价格	价格
I (0)	业。旦			
LastQty	数量	原委托的	原委托的	原委托的



		lu se	lu E	lu si
		数量	数量	数量
	成交申报业务类 别	原委托的	原委托的	原委托的
TrdType		成交申报	成交申报	成交申报
		业务类别	业务类别	业务类别
	成交申报业务子	原委托的	原委托的	原委托的
TrdSubType	类别	成交申报	成交申报	成交申报
HusubType	预留	业务子类	业务子类	业务子类
		别	别	别
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格
	执行编号	交易系统	交易系统	交易系统
ExecID		生成的当	生成的当	生成的当
ExeciD		日唯一编	日唯一编	日唯一编
		号	号	号
Side	本方参与人买卖	原委托的	原委托的	原委托的
Side	方向	买卖方向 买卖方向		买卖方向
	本方交易单元	原委托的	原委托的	原委托的
PBUID		本方交易	本方交易	本方交易
		单元	单元	单元
AccountID	本方证券账户	全空格	全空格	全空格
BranchID	本方营业部代码	全空格	全空格	全空格
	对手方交易单元	原委托的	原委托的	填被撤委
CounterpartyPBUID		对手方交	对手方交	托对手方
		易单元	易单元	交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代 码	全空格	全空格	全空格
	本方交易商代 码, 预留	原委托的	原委托的	原委托的
MemberID	7, 7A 四	本方交易	本方交易	本方交易
		商代码	商代码	商代码



	本方交易主体类 型, 预留	原委托的	原委托的	原委托的
InvestorType		本方交易	本方交易	本方交易
		主体类型	主体类型	主体类型
	本方交易主体代 码,预留	原委托的	原委托的	原委托的
InvestorID	,,,	本方交易	本方交易	本方交易
		主体代码	主体代码	主体代码
	本方客户名称, 预留	原委托的	原委托的	原委托的
InvestorName		本方客户	本方客户	本方客户
		名称	名称	名称
	本方交易员代 码,预留	原委托的	原委托的	原委托的
TraderCode	,, ,, ,,	本方交易	本方交易	本方交易
		员代码	员代码	员代码
	对手方交易商代 码,预留	原委托的	原委托的	原委托的
CounterpartyMemberID		对手方交	对手方交	对手方交
		易商代码	易商代码	易商代码
	对手方交易主体 类型,预留	原委托的	原委托的	原委托的
		对手方交	对手方交	对手方交
CounterpartyInvestorType		易主体类	易主体类	易主体类
		型	型	型
	对手方交易主体 代码,预留	原委托的	原委托的	原委托的
CountamentyInvestorID		对手方交	对手方交	对手方交
CounterpartyInvestorID		易主体代	易主体代	易主体代
		码	码	码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名 称,预留	原委托的	原委托的	原委托的



		对手方客	对手方客	对手方客
		户名称	户名称	户名称
	对手方交易员代 码,预留	原委托的	原委托的	原委托的
CounterpartyTraderCode	7, 7, 4	对手方交	对手方交	对手方交
		易员代码	易员代码	易员代码
SettlType	结算方式, 预留	原委托的	原委托的	原委托的
		结算方式	结算方式	结算方式
SettlPeriod	结算周期, 预留	原委托的	原委托的	原委托的
		结算周期	结算周期	结算周期
	信用标识, 预留	原委托的	原委托的	原委托的
CashMargin		信用标识	信用标识	信用标识
	备注,预留	原委托的	原委托的	原委托的
Memo		备注	备注	备注

5.2.2 STEP 转发成交申报

表 5-4 STEP 接口转发成交申报消息定义

Tag	域名	字段描述	情形一	情形二字	情形三字段
			字段取值	段取值	取值
	MessageHeader	MsgType=AE			
10179	ReportIndex	回报记录号			
1180		应用标识	430:债券	430: 债券回	430: 债券回售
	ApplID		回售转售	售转售	转售
1003	TradeID	交易所成交申 报编号	原委托成 交申报响 应中的交	被拒绝的发 行人委托成 交申报响应	被撤委托成交 申报响中的交 易所成交申报
			易所成交 申报编号	中的交易所 成交申报编	编号

					_	
					号	
571			客户成交申报	交易系统	发行人对应	交易系统生成
	Tradal	ReportID	编号	生成编号,	委托的客户	编号, 当日唯
	Trade	KeporuD		当日唯一	成交申报编	_
					号	
			成交申报所有	原委托的	原委托的订	原委托的订单
522	Owne	rType	者类型	订单所有	单所有者类	所有者类型
				者类型	型	
856	Tradel	ReportType	成交申报类型	1	3	1
487			成交申报事务	原委托的	1	原委托的成交
	Tradel	ReportTransType	类别	成交申报		申报事务类别
				事务类别		
1123			成交申报模式	原委托的	原委托的成	原委托的成交
	Trade	HandlingInstr		成交申报	交申报模式	申报模式
				模式		
572			原客户成交申	不需要填	不需要填写	填交易系统生
			报编号	写		成的与原被撤
	Trade	ReportRefID				转发成交申报
						对应的客户成
						交申报编号
60			回报时间	转发成交	转发成交申	转发成交申报
	Transa	actTime		申报生成	报生成时间	生成时间
				时间		
组件 <i< td=""><td>nstrum</td><td>ent></td><td></td><td></td><td></td><td></td></i<>	nstrum	ent>				
48		. ID	证券代码	原委托的	原委托的证	原委托的证券
	Securi	ityID		证券代码	券代码	代码
22			证券代码源	原委托的	原委托的证	原委托的证券
	Securi	ityIDSource		证券代码	券代码源	代码源
				源		
组件结	束					
组件 <f< th=""><th>RootPar</th><th>rties></th><th></th><th></th><th></th><th></th></f<>	RootPar	rties>				
1116	N P	-4DID	参与人代码个	3	3	3
	NoKo	otPartyIDs	数			
→			参与人代码	原委托的	原委托的对	被撤委托对手
				对手方交	\(\frac{1}{2} \)	100 AIN X 4004 1
	1117	RootPartyID		易单元	手方交易单	方交易单元
					_	
					元	
	1440	D . D . TD	参与人代码源	C=通用市	C=通用市场	C=通用市场参
	1118	RootPartyIDSource		场参与者	参与者标识	与者标识

					标识		
				参与人代码角	27=回报交		
	1119	Post	Dosty Dolo	色	多单元	27=回报交易	27=回报交易
	1119	Koot	PartyRole		7 1 2	单元	单元
	1117	RootPartyID		参与人代码	申报方交 易单元	申报方交易	申报方交易单
						单元	元
	1118	Root	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市 场参与者 标识	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场参 与者标识
	1119	Root	PartyRole	参与人代码角 色	1=申报交 易单元	1=申报交易 单元	1=申报交易单 元
	1117	Root	PartyID	参与人代码	01=中国结 算深圳分 公司	01=中国结算 深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
	1118	Root	PartyIDSource	参与人代码源	F=交割机 构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	Root	PartyRole	参与人代码角色	4=结算机 构代码	4=结算机构 代码	4=结算机构代 码
组件结	束						
组件<]	ГrdСар	RptSi	deGrp>				
552	NoSic	les		side 个数	1	1	1
→	54	Side		买卖方向	原委托的 买卖方向	原委托的买 卖方向	原委托的买卖 方向
	组件<	<partic< th=""><th>es></th><th></th><th></th><th></th><th></th></partic<>	es>				
	453	NoPa	artyIDs	参与人代码个数	2	2	2
	→	448	PartyID	参与人代码	发行人交 易单元	受让方交易单元	发行人交易单元
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市 场参与者 标识	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场参 与者标识
		452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单 元	1=交易单元	1=交易单元
		448	PartyID	参与人代码	受让方交 易单元	发行人交易 单元	被撤委托对手 方交易单元
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市	C=通用市场	C=通用市场参

					场参与者 标识	参与者标识	与者标识
		452	PartyRole	参与人代码角 色	17=对手方 交易单元	17=对手方交 易单元	17=对手方交 易单元
	组件组	吉東					
组件结	束						
17	ExecI	D		执行编号	交易 生成 日 年 号	交易系统生 成的当日唯 一编号	交易系统生成 的当日唯一编 号
31	LastP	x		成交价格	原委托的 价格	原委托的价格	原委托的价格
32	LastQ	ty		成交数量	原委托的数量	原委托的数量	原委托的数量
63	SettlT	уре		结算方式, 预 留	原委托的结算方式	原委托的结算方式	原委托的结算方式
10216	SettlP	eriod		结算周期,预 留	原委托的结算周期	原委托的结	原委托的结算周期
544	CashN	Margin		信用标识,预留	原委托的信用标识	原委托的信用标识	原委托的信用标识
10198	Memo)		备注	原委托的备注	原委托的备注	原委托的备注

六、 债券回售转售清算和交收

在固定收益交易平台达成的债券转售业务,结算业务类别编码沿用现有普通交易的业务类别编码(其中采用担保交收模式的债券转售业务,业务类别编码为 JY01),仍使用为 JY00;采用非担保交收模式的债券转售业务,业务类别编码为 JY01),仍使用现有接口发送,交易方式使用"13"表示固定收益平台业务,接口填写内容与现有业务类别(JY00, JY01)相同。



七、 开展债券回售转售业务的券商系统注意事项

7.1 委托相关说明

可以通过交易网关或交易终端申报债券回售转售委托和接收成交。通过交易终端申报委托方式请参照交易终端用户手册。

7.2 关于客户委托服务渠道

建议证券公司根据该类业务的目标客户及业务风险属性,自行调整其柜台委托、 网上交易、自助委托、电话委托等客户委托渠道(可选择一种或多种渠道)中的 相应前端系统,以支持债券回售转售委托指令录入。

7.3 关于券商柜台系统

♦ 向深交所申报各类委托前的风险前端控制

柜台系统应对投资者委托的价格、数量、投资者资金、投资者股份等要素进行前端风险控制,对于不符合前端风险控制要求的委托予以拒绝,不要申报至深交所交易系统。

八、 联系方式

深圳证券交易所业务: 0755-88668966

深圳证券交易所技术: 0755-88668679

中国结算深圳分公司业务: 0755-21899306

中国结算深圳分公司技术: 0755-25946080