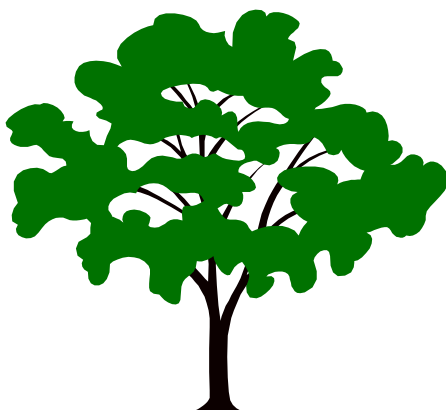




深圳证券交易所工程技术文档

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，供相关交易参与者及其 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者带来的影响。

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，如回售资金到账日（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
SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方 交易单元一致	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
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=深圳证券交易所	102	102	102	102
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

ClearingFirm	结算机构代码	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
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
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
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3=One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 接收方填写转发成交申报的	全空格	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

	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
TrdSubType	成交申报业务子类 预留，固定填 0	0	0	0	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
SubmittingInvestorType	申报方交易主体类型，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
SubmittingInvestorID	申报方交易主体代码，预留	全空格	全空格	全空格	全空格

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
InvestorType	本方交易主体类型, 预留 01=自营 02=资管 03=机构经纪 04=个人经纪	全空格	全空格	全空格	全空格
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 称	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 04=个人经纪	全空格	全空格	全空格	全空格

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=不指定 103=多边净额 104=逐笔全额	0	0	0	0
SettlPeriod	结算周期, 预留	0	0	0	0
LastParPx	成交价格二, 预留	0	0	0	0
CashMargin	信用标识, 预留 1=Cash, 普通交易 2=Open, 融资融券开仓 3=Close, 融券融券平仓	1	1	1	1
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(PBUID)	等于待匹配的发行人委托的对手方交易单元(CounterpartyPBUID)
受让方委托的对手方交易单元(CounterpartyPBUID)	等于待匹配的发行人委托的本方交易单元(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 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
	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

		1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求				
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用	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
60	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
组件<Instrument>						
48	SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	102	102	102
组件结束						
组件<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2	2	2	2
→	1117	RootPartyID	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, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致
	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

	1119	RootPartyRole	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
	1117	RootPartyID	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	RootPartyIDSource	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	RootPartyRole	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
组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>							
552	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	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
		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	发行人证券账户	发行人证券账户	受让方证券账户
		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
		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
		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

	447	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
	452	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
	448	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
	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	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							
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	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	情形一 字段取值	情形二 字段取值	情形三 字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=204320			
ReportIndex	回报记录号			
ApplID	应用标识	430: 债券 回售转售	430: 债券 回售转售	430: 债券 回售转售
ReportingPBUID	回报交易单元	原委托的 对手方交 易单元	原委托的 对手方交 易单元	被撤委托 对手方交 易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原委托的 申报交易 单元	原委托的 申报交易 单元	原委托的 申报交易 单元
SecurityID	证券代码	原委托的 证券代码	原委托的 证券代码	原委托的 证券代码

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

		数量	数量	数量
TrdType	成交申报业务类别	原委托的 成交申报 业务类别	原委托的 成交申报 业务类别	原委托的 成交申报 业务类别
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留	原委托的 成交申报 业务子类别	原委托的 成交申报 业务子类别	原委托的 成交申报 业务子类别
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格
ExecID	执行编号	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	交易系统 生成的当 日唯一编 号
Side	本方参与人买卖 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
PBUID	本方交易单元	原委托的 本方交易 单元	原委托的 本方交易 单元	原委托的 本方交易 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
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	原委托的 对手方交 易单元	原委托的 对手方交 易单元	填被撤委 托对手方 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
MemberID	本方交易商代 码, 预留	原委托的 本方交易 商代码	原委托的 本方交易 商代码	原委托的 本方交易 商代码

InvestorType	本方交易主体类型，预留	原委托的 本方交易 主体类型	原委托的 本方交易 主体类型	原委托的 本方交易 主体类型
InvestorID	本方交易主体代码，预留	原委托的 本方交易 主体代码	原委托的 本方交易 主体代码	原委托的 本方交易 主体代码
InvestorName	本方客户名称，预留	原委托的 本方客户 名称	原委托的 本方客户 名称	原委托的 本方客户 名称
TraderCode	本方交易员代码，预留	原委托的 本方交易 员代码	原委托的 本方交易 员代码	原委托的 本方交易 员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码，预留	原委托的 对手方交 易商代码	原委托的 对手方交 易商代码	原委托的 对手方交 易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型，预留	原委托的 对手方交 易主体类 型	原委托的 对手方交 易主体类 型	原委托的 对手方交 易主体类 型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码，预留	原委托的 对手方交 易主体代 码	原委托的 对手方交 易主体代 码	原委托的 对手方交 易主体代 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 户名称	对手方客 户名称	对手方客 户名称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代 码, 预留	原委托的 对手方交 易员代码	原委托的 对手方交 易员代码	原委托的 对手方交 易员代码
SettlType	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
SettlPeriod	结算周期, 预留	原委托的 结算周期	原委托的 结算周期	原委托的 结算周期
CashMargin	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
Memo	备注, 预留	原委托的 备注	原委托的 备注	原委托的 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 字段取值	情形二字 段取值	情形三字段 取值
	MessageHeader	MsgType=AE			
10179	ReportIndex	回报记录号			
1180	ApplID	应用标识	430: 债券 回售转售	430: 债券回 售转售	430: 债券回售 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 易所成交 申报编号	被拒绝的发 行人委托成 交申报响应 中的交易所 成交申报编	被撤委托成交 申报响应的交 易所成交申报 编号

				号	
571	TradeReportID	客户成交申报 编号	交易系统 生成编号, 当日唯一	发行人对应 委托的客户 成交申报编 号	交易系统生成 编号, 当日唯 一
522	OwnerType	成交申报所有 者类型	原委托的 订单所有 者类型	原委托的订 单所有者类 型	原委托的订单 所有者类型
856	TradeReportType	成交申报类型	1	3	1
487	TradeReportTransType	成交申报事务 类别	原委托的 成交申报 事务类别	1	原委托的成交 申报事务类别
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	原委托的 成交申报 模式	原委托的成 交申报模式	原委托的成交 申报模式
572	TradeReportRefID	原客户成交申 报编号	不需要填 写	不需要填写	填交易系统生 成的与原被撤 转发成交申报 对应的客户成 交申报编号
60	TransactTime	回报时间	转发成交 申报生成 时间	转发成交申 报生成时间	转发成交申报 生成时间
组件<Instrument>					
48	SecurityID	证券代码	原委托的 证券代码	原委托的证 券代码	原委托的证券 代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原委托的 证券代码 源	原委托的证 券代码源	原委托的证券 代码源
组件结束					
组件<RootParties>					
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个 数	3	3	3
→	1117	RootPartyID	参与人代码	原委托的 对手方交 易单元	原委托的对 手方交易单 元
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市 场参与者	C=通用市场 参与者标识

				标识		
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	27=回报交易单元	27=回报交易单元	27=回报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	申报方交易单元	申报方交易单元	申报方交易单元
	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
	1119	RootPartyRole	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	RootPartyID	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	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	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<TrdCapRptSideGrp>						
552	NoSides		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<Parties>					
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	2	2	2
	→	448	PartyID	发行人交易单元	受让方交易单元	发行人交易单元
		447	PartyIDSource	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	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
		448	PartyID	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	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
	组件结束						
组件结束							
17	ExecID			执行编号	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	交易系统生成的当日唯一编号
31	LastPx			成交价格	原委托的价格	原委托的价格	原委托的价格
32	LastQty			成交数量	原委托的数量	原委托的数量	原委托的数量
63	SettlType			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	SettlPeriod			结算周期，预留	原委托的结算周期	原委托的结算周期	原委托的结算周期
544	CashMargin			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 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