



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

跨银行间实物债券 ETF 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
二〇二二年九月

关于本文档

文档名称		跨银行间实物债券ETF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
2022-08-09	1.00	创建文档	技术开发版

目 录

一、	说明.....	3
二、	变更范围汇总.....	3
三、	业务简介.....	3
四、	技术实现概况.....	4
五、	交易参考信息.....	4
5.1	申购赎回清单.....	4
六、	交易接口.....	8
6.1	成交委托申报和订单响应执行报告.....	8
6.2	订单响应执行报告.....	12
七、	清算交收.....	14
7.1	接口修订概述.....	14
7.2	清算明细库 SJSMX1.DBF	15
7.3	明细结果库 SJSJG.DBF	17
7.4	广播类信息库 SJSGB.DBF	18

跨银行间实物债券 ETF 业务之券商技术系统变更指南

一、说明

为了会员、基金公司和其他交易、结算参与人在深圳证券交易所（以下简称“本所”或“深交所”）市场上更好地开展跨银行间实物债券 ETF 业务，本所会同中国证券登记结算有限责任公司（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、结算参与人及其 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、变更范围汇总

新增跨银行间实物债券 ETF 证券类别，非交易平台新增跨银行间实物债券 ETF 实物申购和赎回业务，具体技术实施细节参见第四章。

三、业务简介

跨银行间实物债券 ETF，是指以在银行间市场交易、由中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中央结算”）登记托管的债券为指数标的基础资产，基金份额在深交所上市交易、由中国结算办理登记结算、采用实物方式申赎的 ETF 产品。

跨银行间实物债券 ETF 所涉及的业务，除实物认购、实物申赎外，其他业务处理方式与跨境 ETF 类似。

实物认购业务中，投资者向中央结算申请，使用其持有的债券份额认购跨银行间实物债券 ETF。

实物申赎业务主要流程如下：

（1）投资者向中央结算发送 ETF 实物申赎申报。中央结算校验申赎申报，生成业务标识号反馈给投资者。

（2）投资者通过代办券商向深交所发送 ETF 实物申赎申报，提交业务标识号等信息。深交所校验申赎申报并反馈给代办券商。对于赎回申报，深交所冻结

拟赎回的 ETF 份额。

(3) 日间，中央结算冻结申赎涉及的债券份额。

(4) 日终，中国结算深圳分公司完成投资者 ETF 份额的记增、记减，中央结算完成对应债券的过户和解冻。

当日实物申购得到的 ETF 份额，次一交易日可以卖出或赎回；当日买入的 ETF 份额，次一交易日可以实物赎回。

四、 技术实现概况

在非交易平台新增跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务（业务类别‘47’），交易时间为每个深市交易日的 9：15 至 11：30，13：00 至 15：00。该业务的委托及回报对应的关系如下所示。

表 4-1 委托及回报对应关系说明

业务	ApplID	委托申报		成交回报	
		MsgType (Binary)	MsgType (STEP)	MsgType (Binary)	MsgType (STEP)
跨银行间 实物债券 ETF 实物申 购赎回业 务	470	104701	D	204702	8

五、 交易参考信息

交易参考信息的 securities 文件中跨银行间实物债券 ETF 的证券类别 (SecurityType) 为 40 (跨银行间实物债券 ETF)。ETF 实时申购赎回业务参考信息 (pcf 文件信息) 新增包含跨银行间实物债券 ETF 对应 PCF 文件。

5.1 申购赎回清单

跨银行间实物债券 ETF 申购赎回清单文件同所有申购赎回的 ETF 一样都使

用统一的 PCF 清单格式。PCF 清单格式增加以下修改：

- 调整 PCF 文件中成份股的证券代码长度改为 30
- PCF 文件中证券代码源新增枚举值“外汇交易中心=105”

字段名称	字段英文名	类型	说明
版本号	Version	C8	固定值 1.0
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
基金名称	Symbol	C40	
基金公司名称	FundManagementCompany	C30	
拟合指数代码	UnderlyingSecurityID	C8	
拟合指数代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	101 = 上海证券交易所 102 = 深圳证券交易所 103 = 香港交易所 105 = 外汇交易中心 106 = 北京证券交易所 9999=其他
最小申购赎回单位	CreationRedemptionUnit	N15(2)	每个篮子（最小申购赎回单位）对应的 ETF 份数，目前只能为正整数
预估现金差额	EstimateCashComponent	N11(2)	T 日每个篮子的预估现金差额
最大现金替代比例	MaxCashRatio	N6(5)	最大现金替代比例，例如：5.551% 在文件中用 0.05551 表示
是否发布 IOPV	Publish	C1	Y=是 N=否
是否允许申购	Creation	C1	Y=是 N=否
是否允许赎回	Redemption	C1	Y=是 N=否
深市成份证券数目	RecordNum	N4	表示一个篮子中的深市成份证券数目（包含 159900 证券）
所有成份证券数目	TotalRecordNum	N4	表示一个篮子中的所有成份证券数目（包含 159900 证券）
交易日	TradingDay	N8	格式 YYYYMMDD
前交易日	PreTradingDay	N8	T-X 日日期，格式 YYYYMMDD，X 由基金公司根据基金估值时间确定
现金余额	CashComponent	N11(2)	T-X 日申购赎回基准单位的现金余额
申购赎回基准单位净值	NAVperCU	N12(2)	T-X 日申购赎回基准单位净值
单位净值	NAV	N8(4)	T-X 日基金的单位净值

字段名称		字段英文名	类型	说明
红利金额		DividendPerCU	N12(2)	T 日申购赎回基准单位的红利金额
累计申购总额限制		CreationLimit	N18(2)	当天累计可申购的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
累计赎回总额限制		Redemption Limit	N18(2)	当天累计可赎回的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
单个账户累计申购总额限制		CreationLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
单个账户累计赎回总额限制		RedemptionLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
净申购总额限制		NetCreationLimit	N18(2)	当天净申购的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
净赎回总额限制		NetRedemptionLimit	N18(2)	当天净赎回的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
单个账户净申购总额限制		NetCreationLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天净申购的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
单个账户净赎回总额限制		NetRedemptionLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天净赎回的基金份额上限, 为 0 表示没有限制, 目前只能为整数
成份股列表		Components		
→	成份股信息	Component		
→	→ 证券代码	UnderlyingSecurityID	C30	
→	→ 证券代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	101 = 上海证券交易所 102 = 深圳证券交易所 103 = 香港交易所 105 = 外汇交易中心 106 = 北京证券交易所 9999=其他
→	→ 证券简称	UnderlyingSymbol	C40	
→	→ 现金替代标志	SubstituteFlag	C1	0=禁止现金替代 (必须有证券) 1=可以进行现金替代 (先用证券, 证券不足时差额部分用现金替代) 2=必须用现金替代 对于深市成份证券, 该字段可以取值 0、1、2; 对于非深市成份证券, 可以取值 0、1、2。

字段名称			字段英文名	类型	说明
→	→	成份证券数	ComponentShare	N15(2)	每个申购篮子中该成份证券的数量。 此字段为可选字段，只有现金替代标志为‘0’或‘1’时才需要
→	→	溢价比例	PremiumRatio	N7(5)	申购 ETF，成份证券份额用现金进行替代的时候，计算替代价格增加的比例。例如：2.551%在文件中用 0.02551 表示；2.1%在文件中用 0.02100 表示。 此字段为可选字段，只有现金替代标志为‘1’时才需要
→	→	折价比例	DiscountRatio	N7(5)	赎回 ETF，成份证券份额用现金进行替代的时候，计算替代价格减少的比例。例如：2.551%在文件中用 0.02551 表示；2.1%在文件中用 0.02100 表示。 此字段为可选字段，只有现金替代标志为‘1’、且证券代码源不为‘102’时才需要。 该字段仅用于提示投资者，由 ETF 基金管理人根据业务需要填写，交易系统不检查该字段。
→	→	申购替代金额	CreationCashSubstitute	N18(4)	当某只证券必须用现金替代的时候，申购时该证券所需总金额 此字段为可选字段，只有当现金替代标志为‘2’时才需要
→	→	赎回替代金额	RedemptionCashSubstitute	N18(4)	当某只证券必须用现金替代的时候，赎回时该证券返还的总金额。 例如：2000 在文件中用 2000.0000 表示。 对于跨境 ETF、黄金 ETF、现金债券 ETF、商品期货 ETF 的虚拟成份证券 159900，该字段必须为 0.0000。 此字段为可选字段，只有当现金替代标志为‘2’时才需要

PCF 清单文件的成份股列表中，对于深市证券，证券代码长度不超过 8 位；

对于外汇交易中心等非深市成份券（例如跨银行间实物债券 ETF 等），证券代码长度不超过 30 位。

六、 交易接口

6.1 成交委托申报和订单响应执行报告

本次变更支持详细内容请参见《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》、《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》。

6.1.1 Binary 接口委托申报

表 6-1 Binary 接口委托消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104701	
ApplID	应用标识	470: 跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务
SubmittingPBUID	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102: 深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01: 中国结算深圳分公司
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
AccountID	证券账户	证券账户
BranchID	营业部代码	营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	全空格
Side	买卖方向 D=申购 E=赎回	D 或 E
OrdType	订单类别 1 表示市价 2 表示限价 U 本方最优	2

OrderQty	订单数量	委托数量
Price	价格	0
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	中央结算生成的唯一的业务标识号，由投资者在委托申报时填写

6.1.2 STEP 接口委托申报

表 6-2 STEP 接口委托消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=D	
1180	ApplID	应用标识	470：跨银行间实物债券 ETF 实物申购赎回业务
11	ClOrdID	客户订单编号	客户订单编号
40	OrdType	订单类型 1=市价 2=限价 U=本方最优	2
54	Side	买卖方向	D 或 E
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者 101=交易所 102=会员 103=机构投资者 104=自营交易 105=流动性服务提供商 106=结算公司	订单所有者类型
60	TransactTime	订单发起时间	委托时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
组件结束			
组件<Parties>			
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	3
→	448	PartyID	申报交易单元
	447	PartyIDSource	C：通用市场参与者标识

	452	PartyRole	参与人代码角色	1: 申报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	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
	448	PartyID	参与人代码	投资者所在营业部 识别码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D: 自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001: 营业部代码
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
38	OrderQty		订单数量	委托数量
组件结束				
198	SecondaryOrderID		第二交易所订单编号	中央结算生成的唯一的业务标识号, 由投资者在委托申报时填写

6.1.1 委托申报样例

某证券公司（008888 交易单元、0866666666 证券账户）在 20121123 日对证券 159450 发起申购。

6.1.1.1 Binary 消息示例

表 6-3 申报 BINARY 消息示例

域名	20121123 日申报初始交易
MsgType	104701
ApplID	470
SubmittingPBUID	008888
SecurityID	159450
SecurityIDSource	102
OwnerType	102
ClearingFirm	01
TransactTime	20121123-14:42:13:555
UserInfo	全空格
ClOrdID	A0000001
AccountID	0866666666
BranchID	A9
OrderRestrictions	全空格
Side	E
OrdType	2

OrderQty	10000.00
Price	0
SecondaryOrderID	6B4569CDNB009C03

6.1.1.2 STEP 消息示例

20121123 日发起申购：

Tag	域名	取值
	MsgType	D
1180	ApplID	470
11	ClOrdID	A0000001
40	OrdType	2
54	Side	E
522	OwnerType	102
60	TransacTime	20121123-14:42:13:555
48	SecurityID	159450
22	SecurityIDSource	102
453	NoPartyIDs	3
448	PartyID	008888
447	PartyIDSource	C
452	PartyRole	1
448	PartyID	0866666666
447	PartyIDSource	5
452	PartyRole	5
448	PartyID	A9
447	PartyIDSource	D
452	PartyRole	4001
38	OrderQty	10000.00
198	SecondaryOrderID	6B4569CDNB009C03

1180=470<SOH>11=A0000001<SOH>40=2<SOH>54=E<SOH>522=102<SOH>60
=20121123-14:42:13:555<SOH>48=159450<SOH>22=102<SOH>453=3<SOH>448
=008888<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>
452=5<SOH>448=A9<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>38=10000.00<SOH>1
98=6B4569CDNB009C03<SOH>

6.2 订单响应执行报告

6.2.1 Binary 订单响应及撤单成功执行报告

表 6-4 Binary 订单响应执行报告消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=2xxx02	204702
PartitionNo	平台分区号	
ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	原始委托的应用标识
ReportingPBUID	回报交易单元	原始委托的回报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	原始委托的申报交易单元
SecurityID	证券代码	原始委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原始委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原始委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	订单响应执行报告生成时间
UserInfo	用户私有信息	原始委托的用户私有信息
OrderID	交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
ClOrdID	客户订单编号	原始委托的客户订单编号
OrigClOrdID	原始订单客户订单编号	若为撤单成功执行报告则填写被撤销委托的 ClOrdID，否则为全空格
ExecID	执行编号	交易系统生成的执行编号
ExecType	执行类型	0、4 或 8
OrdStatus	订单状态	0、4 或 8
OrdRejReason	撤单/拒绝原因代码	拒绝原因代码
LeavesQty	订单剩余数量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
CumQty	累计执行数量	已成交数量
Side	买卖方向	原始委托的买卖方向
OrdType	订单类别	原始委托的订单类别
OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
Price	价格	原始委托的价格
AccountID	证券账户	原始委托的证券账户
BranchID	营业部代码	原始委托的营业部代码
OrderRestrictions	订单限定	原始委托的订单限定
SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	原始委托的第二交易所订单编号

6.2.2 STEP 订单响应及撤单成功执行报告

表 6-5 STEP 订单响应执行报告消息定义

Tag	域名		字段描述	字段取值
	MessageHeader		MsgType=8	8
10197	PartitionNo		平台分区号	
10179	ReportIndex		回报记录号	
1180	ApplID		应用标识	原始委托的应用标识
522	OwnerType		订单所有者类型	原始委托的订单所有者类型
529	OrderRestrictions		订单限定	原始委托的订单限定
17	ExecID		执行编号	交易系统生成的执行编号
37	OrderID		交易所订单编号	交易系统生成的交易所订单编号
150	ExecType		执行类型	0、4 或 8
39	OrdStatus		订单状态	0、4 或 8
31	LastPx		成交价	原始委托的价格
32	LastQty		成交数量	原始委托的订单数量
151	LeavesQty		剩余量	ExecType 为 0，则与原始委托数量一致，其它为 0
14	CumQty		累计成交数量	已成交数量
103	OrdRejReason		撤单/拒绝原因代码	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因代码
1328	RejectText		撤单/拒绝原因说明	执行类型为 4 或 8 时填写拒绝原因说明
54	Side		买卖方向	原始委托的买卖方向
60	TransactTime		执行报告时间	订单响应执行报告生成时间
11	ClOrdID		客户订单编号	原始委托的客户订单编号
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	原始委托的证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源	原始委托的证券代码源
组件结束				
组件<Parties>				
453	NoPartyIDs		参与人代码个数	4
→	448	PartyID	参与人代码	原始委托的回报交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C: 通用市场参与者标识

	452	PartyRole	参与人代码角色	27: 回报交易单元
	448	PartyID	参与人代码	原始委托的申报交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C: 通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1: 交易单元
	448	PartyID	参与人代码	原始委托的证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	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
	448	PartyID	参与人代码	原始委托的营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D: 自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001: 营业部代码
组件结束				
组件<OrderQtyData>				
38		OrderQty	订单数量	原始委托的订单数量
组件结束				
198		SecondaryOrderID	第二交易所订单编号	原始委托的第二交易所订单编号

七、清算交收

7.1 接口修订概述

(1) 跨银行间实物债券 ETF 产品新增一个 ETF 子类别, 证券类别编码为 ‘EF’, 证券子类别编码为 ‘9’。其中证券类别及证券子类别含义可查看《深市登记结算数据接口规范 (结算参与人版)》中附件二 “证券类别子类含义表”, 或查看 SJSGB.DBF 中 GBLB 为 ‘ZL’ 及 ‘ZZ’ 的数据。

证券类别子类含义表

证券类别	证券子类	子类简称
EF	9	跨银行间实物债券 ETF

(2) 跨银行间实物债券 ETF 认购的处理, 可采用网上现金认购、网下现金认购和实物认购三种方式。网上和网下现金认购流程与现有 ETF 一致。

(3) 跨银行间实物债券 ETF 交易的处理, 与现有 ETF 相同。

(4) 跨银行间实物债券 ETF 申赎的处理, 可采用实物申赎方式, 具体接口变更详细内容见 7.2~7.3 章节的说明。

(5) 跨银行间实物债券 ETF 申购赎回现金差额的处理, 与现有 ETF 相同。

(6) 跨银行间实物债券 ETF 登记及相关业务的处理 (如分红派息、股东名册、质押登记、非交易过户、司法协助等), 均与现有 ETF 相同。

7.2 清算明细库 SJSMX1.DBF

7.2.1 业务类别含义

跨银行间实物债券 ETF 实物申赎业务的清算明细在 SJSMX1.DBF 中体现, 涉及的业务类别含义参见下表:

SJSMX1.DBF 业务类别含义表

业务类别	业务类别含义
SGSF	实物申购份额, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、跨市场 ETF、跨银行间实物债券 ETF
SHSF	实物赎回份额, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、跨市场 ETF、跨银行间实物债券 ETF

7.2.2 接口数据含义

SJSMX1.DBF 中, 跨银行间债券 ETF 实物申购通过 SGSF 体现, 跨银行间债券 ETF 实物赎回通过 SHSF 体现, 含义如下表:

字段名	业务类别	
	SGSF(跨银行间实物债券 ETF 实物申购)	SHSF(跨银行间实物债券 ETF 实物赎回)
MXJSZH	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	'01'	'01'
MXYWLB	'SGSF'	'SHSF'
MXZQDM	ETF 代码	ETF 代码
MXJYDY	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号
MXYYB	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量	成交数量

MXQSSL	清算数量	清算数量
MXCJJG		
MXQSJG		
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	`EF'	`EF'
MXZQZL	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	`00'	`00'
MXJSFS	`N'	`N'
MXHBDH	货币代号	货币代号
MXQSBJ		
MXYHS		
MXJYJSF		
MXJGGF		
MXGHF		
MXJSF		
MXSXF		
MXQSYJ		
MXQTFY		
MXZJJE		
MXSFJE		
MXCJRQ	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日
MXJSRQ	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日
MXQTRQ		
MXSCDM		
MXJYFS	`03'	`03'
MXZQDM2		
MXTGDY2		
MXDDBH2		
MXCWDH		
MXPPHM		
MXFJSM	业务标识号	业务标识号
MXBYBZ		

注：

MXFJSM 字段（业务标识号）说明：跨银行间债券 ETF 实物申赎中，由中央国债登记结算公司在客户录入申报时生成业务标识号，是申购/赎回申报的唯一标识。

7.3 明细结果库 SJSJG.DBF

7.3.1 业务类别含义

跨银行间实物债券 ETF 实物申赎业务的交收结果在 SJSJG.DBF 中体现，涉及的业务类别含义如下表：

SJSJG.DBF 业务类别表

接口业务类别	业务类别含义
SGSF	跨银行间实物债券ETF实物申购
SHSF	跨银行间实物债券ETF实物赎回

7.3.2 接口数据含义

SJSJG.DBF 中，跨银行间实物债券 ETF 实物申购通过 SGSF 体现，跨银行间实物债券 ETF 实物赎回通过 SHSF 体现，含义如下表：

字段名	业务类别	
	SGSF（跨银行间实物债券 ETF 实物申购）	SHSF（跨银行间实物债券 ETF 实物赎回）
JGJSZH	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'SGSF'	'SHSF'
JGZQDM	ETF 代码	ETF 代码
JGJYDY	交易单元	交易单元
JGTGDY	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户
JGDDBH	订单编号	订单编号
JGYYB	营业部代码	营业部代码
JGZXBH	执行编号	执行编号
JGYWLSH	业务流水号	业务流水号
JGCJSL	成交数量	成交数量
JGQSSL	清算数量	清算数量
JGJSSL	实际交收数量	实际交收数量
JGCJJG		
JGQSJG		

JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	'EF'	'EF'
JGZQZL	证券子类别	证券子类别
JGGFXZ	'00'	'00'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS	'N'	'N'
JGHBHDH	货币代号	货币代号
JGQSBJS		
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE		
JGJSBZ	'Y' - 交收成功 'N' - 交收失败	'Y' - 交收成功 'N' - 交收失败
JGZYDH	若 JGJSBZ 为 'N', 则是 错误代号	若 JGJSBZ 为 'N', 则 是错误代号
JGCJRQ	T 日	T 日
JGQSRQ	T 日	T 日
JGJSRQ	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'03'	'03'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	业务标识号	业务标识号
JGBYBZ		

7.4 广播类信息库 SJSGB.DBF

SJSGB.DBF 中, 新增错误代码 M72 和 M73, 仅供跨银行间实物债券 ETF

实物申赎使用，含义如下表：其摘要代号及错误代码含义可查看《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版）》中附件三“摘要代号及错误代码含义汇编”，或查看 SJSGB.DBF 中 GBLB 为‘ZY’的数据。

错误代码	错误代码含义
M72	中央国债登记结算公司冻结组合券失败
M73	跨银行间实物债券 ETF 实物申赎失败（其他原因）