



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

债券质押式协议回购业务之

券商技术系统变更指南

(Ver1.10)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司
二〇一五年六月

关于本文档

文档名称		债券质押式协议回购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
2015-05-26	1.00	创建文档	技术开发版
2015-06-26	1.10	修订文档	1. 购回交易指令中的数量由0改为填写初始交易的质押数量 2. 明确投资者适当性管理要求

本次修订部分以红色字体标出。

目 录

一、	说明.....	1
二、	业务简介.....	1
2.1	交易流程	1
2.2	交易要素	2
2.3	其他说明	2
三、	交易指令申报.....	3
四、	交易数据回报.....	7
4.1	确认记录	8
4.2	撤单记录	9
五、	清算和交收.....	10
六、	开展债券质押式协议回购业务的券商系统注意事项	10
6.1	行情相关说明	10
6.2	委托相关说明	10
6.3	回报相关说明	10
6.4	关于客户委托服务渠道	11
6.5	关于券商柜台系统	11
七、	联系方式.....	11
附件一、	债券质押式协议回购业务的交易数据接口修订说明.....	12
1、	综合委托库 SJSZHW.T.dbf.....	12
2、	综合回报库 SJSZH.HB.dbf.....	12
附件二、	债券质押式协议回购业务的结算数据接口修订说明.....	14
1、	接口修订简要说明	14
2、	清算明细库 SJS.MX0.DBF	14
3、	实时交收明细结果库 SJSJG0.DBF	18
4、	交收明细结果库 SJSJG.DBF	19
5、	综合数据服务库 SJSFW.DBF	24
6、	其它信息	26

债券质押式协议回购业务之券商技术系统 变更指南

一、 说明

为了证券公司在深圳证券交易所（以下简称“本所”）交易系统上更好地开展债券质押式协议回购（以下简称“协议回购”）业务，本所会同中国结算深圳分公司专门编制和发布本指南，供相关证券公司及其 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证券公司带来的影响。

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

协议回购指交易双方自主协议成交，以债券或资产支持证券为权利质押的短期资金融通业务。资金融入方在将债券或资产支持证券出质给资金融出方融入资金的同时，双方约定在将来某一时期由资金融入方按约定回购利率计算的资金额向资金融出方返还资金，向资金融出方解除出质债券或资产支持证券上质权的融资行为。

2.1 交易流程

(1) 资金融入方、资金融出方签署债券质押式协议回购协议；

(2) 资金融入方、资金融出方分别委托自己的证券公司或自行申报，按照规定格式提交初始交易指令；

(3) 深交所交易系统对初始交易指令进行即时配对，确认成交后向证券公司与中国结算深圳分公司即时发送成交回报；

(4) 购回交易日（可以是到期购回日，或是双方协商一致的提前购回日或延期购回日），资金融入方、资金融出方各自委托自己的证券公司或自行申报，按照规定格式提交购回交易指令；

(5) 深交所交易系统对购回交易指令进行即时配对，确认成交后向证券公司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质押式协议回购

提供相应的证券质押登记和资金清算交收等服务。

2.2 交易要素

◆ 证券代码

标的证券应符合《债券交易实施细则》相关规定，并由融入方和融出方协商确定。目前标的证券仅包括如下种类：国债、地方债、企业债、公司债、分离债、资产支持证券、证券公司次级债、证券公司短期债、中小企业私募债（含并购债），不包括可转债和中小企业可交换私募债（证券代码区间【117000，117499】），且不处于发行、分销阶段，也不得为已暂停上市提供协议转让服务的债券。

特别的，全天停牌的标的证券，仅允许购回交易，禁止初始交易。盘中临时停牌证券（包括盘中临时停牌至全天收市的证券），允许初始交易与购回交易。

◆ 交易单元

初始交易的申报交易单元需具备相应标的证券的经营权限。

◆ 证券账户

为有效防控风险，协议回购实行投资者适当性管理制度。协议回购推出初期，合格投资者范围包括：证券公司、基金公司、保险公司、商业银行等金融机构及其发行的理财产品和其他符合投资者适当性要求的机构投资者。相应质押券品种有投资者适当性要求的，参与其债券协议回购的投资者需满足其对应券种的合格投资者资格并按相关要求及时完成对应券种的合格投资者申报。投资者适当性进行事后监控。

◆ 初始合约号

当投资者申报的初始交易达成成交后，交易系统会为该笔初始交易成交生成对应的初始合约号并回报给券商。初始合约号由初始交易的成交日期加交易系统生成的交易编号组成。购回时，需将该初始合约号信息填入购回委托。

交易编号为 8 位字符串，由交易所生成且当日唯一。

2.3 其他说明

(1) 交易时间为每个交易日的 9:15 至 11:30，13:00 至 15:30。

- (2) 交易品种的回购期限不得超过 365 天，且不得超过质押债券的存续期间。
- (3) 初始交易和购回交易在未达成成交前允许撤单，达成成交后则不得撤单；

三、 交易指令申报

只能在综合协议交易网关的综合委托库 SJSZHWT.dbf 申报，不能通过综合协议交易终端申报。申报当日有效；初始交易和购回交易申报可以撤销，但在对手方提交匹配的初始交易申报后不得撤销。

通过综合协议交易网关的综合委托库 SJSZHW.T.dbf 的申报内容如下表。

序号	字段名	初始交易融入资金	初始交易融出资金	初始交易主动撤单	购回交易返回资金	购回交易收取资金	购回交易主动撤单
1	WTHTXH	券商申报合同序号	券商申报合同序号	券商申报合同序号	券商申报合同序号	券商申报合同序号	券商申报合同序号
2	WTZQDM	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
3	WTZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
4	WTWTSL	标的证券数量	标的证券数量		初始交易的标的证券数量	初始交易的标的证券数量	
5	WTWTJG	初定的百元资金年收益	初定的百元资金年收益	0.000	实际的百元资金年收益	实际的百元资金年收益	0.000
6	WTYWLB	04	04	04	04	04	04
7	WTZLLB	US	UB	UC	VB	VS	VC
8	WTDFDY	对方交易单元	对方交易单元	空格	对方交易单元	对方交易单元	空格
9	WTDFZH	0000000000	0000000000	0000000000	0000000000	0000000000	0000000000
10	WTWTSL2	0	0	0	0	0	0
11	WTWTJG2	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
12	WTYDH	约定号	约定号	0	约定号	约定号	0
13	WTQXLX	3	3	空格	空格	空格	空格
14	WTGHQX	回购天数	回购天数	0	0	0	0
15	WTJSJG	01	01	01	01	01	01
16	WTLXR	空格	空格	空格	空格	空格	空格
17	WTLXFS	空格	空格	空格	空格	空格	空格
18	WTYHTXH	空格	空格	拟撤销的原合同序号	前 6 个字符固定为空格 中间 8 个字符为初始交易成交日期 后 8 个字符为初始交易	前 6 个字符固定为空格 中间 8 个字符为初始交易成交日期	拟撤销的原合同序号

序号	字段名	初始交易融入资金	初始交易融出资金	初始交易主动撤单	购回交易返回资金	购回交易收取资金	购回交易主动撤单
					的交易编号	后 8 个字符为初始交易的交易编号	
19	WTWTSJ	委托写入时间	委托写入时间	委托写入时间	委托写入时间	委托写入时间	委托写入时间
20	WTCLBZ	z	z	z	z	z	z
21	WTBYBZ	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用
22	WTBYWB						
22.1	WTWTJE	融资金额	融资金额	0.000	结算金额	结算金额	0.000
22.2	WTWTJE2	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
22.3	WTYYB	空格	空格	空格	空格	空格	空格
22.4	WTBJLX	空格	空格	空格	空格	空格	空格
22.5	WTQTWB	空格	空格	空格	空格	空格	空格

说明：

(1) WTHTXH (字段 1: 合同序号) 的第 1 至第 6 位字符为申报交易单元代码, 第 7 至第 14 位为委托申报日期, 第 15 至第 22 位为委托申报流水号 (第 15、16 两位应当填写为发生交易时客户所在营业部的识别码)。

(2) 对于**初始交易和购回交易**指令, WTWTSL (字段 4: 委托数量) 字段值必须大于 0 ;

(3) WTYDH (字段 12: 约定号) 应当为【1, 999999】区间内的任意整数, 且当天在同一对交易单元之间不得重复。

(4) 对于初始交易指令, WTGHQX (字段 14: 购回期限) 应当填写为回购天数, 必须为【1, 365】区间内的任意整数, 且不得超过质押债券的存续期间。

(5) WTJSJG (字段 15: 结算机构代码) 的字段取值应当填写为“01”, 指中国证券登记结算公司深圳分公司负责清算、交收。

(6) 对于购回交易指令, WTYHTXH (字段 18: 原合同序号) 应当填写为初始合约号 (格式为: 前 6 个字符固定为空格, 中间 8 个字符为初始交易成交日期, 后 8 个字符为初始交易的交易编号)。

(7) 申报撤单指令时, 必须将拟撤销的原始委托所对应的合同序号正确地填写在 WTYHTXH (字段 18: 原合同序号), 还应当将本撤单指令所对应的合同序号正确地填写在 WTHTXH (字段 1: 合同序号)。撤单指令与原始委托必须在同一交易单元申报。

(8) WTWTJE (字段 22.1: 委托金额) 字段值必须为 0.01 的整数倍; 对于初始交易指令, WTWTJE (字段 22.1: 委托金额) 字段值必须大于 0, 且小于等于委托数量与面值的乘积; 对于购回交易指令, WTWTJE (字段 22.1: 委托金额) 字段值必须大于等于 0。

各类指令的申报要素举例如下：

20130307, 某融入方交易单元为 008888, 融出方交易单元为 006666, 融入方证券账户为 0866666666, 融出方证券账户为 0877777777, 20130307 日各提交一笔初始交易指令, 质押债券为 118003, 数量为 20 万股, 融资金额 1000 万, 初定每百元资金年收益为 6.000, 达成期限为 31 天的协议回购, 交易编号为 00000011。

到期日 20130407，双方又各自提交一笔购回交易指令，归还质押债券 118003，数量 15 万股（其中 5 万股债券发生提前兑付），归还资金 1005 万（其中 5 万为一个月的利息），实际每百元资金年收益为 6.000。

则双方的申报指令应当如下：

序号	字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
1	WTHTXH	00888820130307AA 000111	00666620130307BB 000222	00888820130407AA 000333	00666620130407AA 000444
2	WTZQDM	118003	118003	118003	118003
3	WTZQZH	0866666666	0877777777	0866666666	0877777777
4	WTWTSL	200000	200000	200000	200000
5	WTWTJG	6.000	6.000	6.000	6.000
6	WTYWLB	04	04	04	04
7	WTZLLB	US	UB	VB	VS
8	WTDFDY	006666	008888	006666	008888
9	WTDFZH	0000000000	0000000000	0000000000	0000000000
10	WTWTSL2	0	0	0	0
11	WTWTJG2	0.000	0.000	0.000	0.000
12	WTYDH	000101	000101	000102	000102
13	WTQXLX	3	3	空格	空格
14	WTGHQX	31	31	0	0
15	WTJSJG	01	01	01	01
16	WTLXR	空格	空格	空格	空格
17	WTLXFS	空格	空格	空格	空格
18	WTYHTXH	空格	空格	“ 20130307 00000011”	“ 20130307 00000011”
19	WTWTSJ	委托写入时间	委托写入时间	委托写入时间	委托写入时间
20	WTCLBZ	z	z	z	z
21	WTBYBZ	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用
22	WTBYWB				
22.1	WTWTJE	10000000.000	10000000.000	10050000.000	10050000.000
22.2	WTWTJE2	0.000	0.000	0.000	0.000
22.3	WTYYB	空格	空格	00	空格
22.4	WTBJLX	空格	空格	空格	空格
22.5	WTQTWB	空格	空格	空格	空格

四、 交易数据回报

初始交易和购回交易指令的确认记录或撤单记录一旦产生，即时通过综合协议

交易网关的综合回报库 SJSZHBB.dbf 回报，回报库 SJSBB.dbf 或从综合协议交易终端下载的综合回报库 SJSZHBB.dbf 中均不存在协议回购业务的任何回报记录。

券商技术系统应当使用综合回报库 SJSZHBB.dbf 完成股份前端监控、资金前端监控、委托查询、清算、交收等所有业务处理。

4.1 确认记录

确认记录通过综合协议交易网关的综合回报库 SJSZHBB.dbf 的回报内容见下表。

序号	字段名	资金融入方 初始交易回报	资金融出方 初始交易回报	资金融入方 购回交易回报	资金融出方 购回交易回报
1	HBCJHM	成交号码	成交号码	成交号码	成交号码
2	HBZQDM	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
3	HBQXLX	3	3	空格	空格
4	HBGHQX	回购天数	回购天数	0	0
5	HBHTXH	券商申报合同序号	券商申报合同序号	券商申报合同序号	券商申报合同序号
6	HBZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
7	HBCJSL	成交数量	成交数量	成交数量	成交数量
8	HBCJJG	初定的百元资金年 收益	初定的百元资金年 收益	实际的百元资金 年收益	实际的百元资金年 收益
9	HBDFDY	对方交易单元	对方交易单元	对方交易单元	对方交易单元
10	HBDFZH	空格	空格	空格	空格
11	HBCJSJ	成交时间	成交时间	成交时间	成交时间
12	HBCJRQ	成交日期	成交日期	成交日期	成交日期
13	HBYWLB	04	04	04	04
14	HBZLLB	US	UB	VB	VS
15	HBVDH	约定号	约定号	约定号	约定号
16	HBCDYY	空格	空格	空格	空格
17	HBVHTXH	前 6 个字符固定为 000000 中间 8 个字符为成 交日期 后 8 个字符为交易 编号	前 6 个字符固定为 000000 中间 8 个字符为成 交日期 后 8 个字符为交易 编号	前 6 个字符固定为 000000 中间 8 个字符为初 始交易成交日期 后 8 个字符为初始 交易的交易编号	前 6 个字符固定为 000000 中间 8 个字符为初 始交易成交日期 后 8 个字符为初始 交易的交易编号
18	HBJSJG	01	01	01	01
19	HBSYL	-99.000000	-99.000000	-99.000000	-99.000000
20	HBHBSL2	0	0	0	0
21	HBHBJG2	0.000	0.000	0.000	0.000
22	HBVYBZ	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用
23	HBVYWB				
23.1	HBHBJE	融资金额	融资金额	到期回购的结 算金额	到期回购的结算 金额

序号	字段名	资金融入方 初始交易回报	资金融出方 初始交易回报	资金融入方 购回交易回报	资金融出方 购回交易回报
23.2	HBHBJE2	0.000	0.000	0.000	0.000
23.3	HBQTZH	空格	空格	空格	空格
23.4	HBYYB	空格	空格	空格	空格
23.5	HBBJLX	空格	空格	空格	空格
23.6	HBQTWB	空格	空格	空格	空格

说明：

(1) HBYHTXH (字段 17: 原合同序号) 的第 1 至第 6 位字符固定为“000000”，
第 7 至第 14 位为初始交易成交日期，第 15 至第 22 位为初始交易的交易编号。

4.2 撤单记录

撤单记录通过综合协议交易网关的综合回报库 SJSZHHB.dbf 的回报内容见下表。

序号	字段名	初始交易主动 撤单成功	初始交易主动 撤单失败	初始交易自动 撤单	购回交易主动撤 单成功	购回交易主动 撤单失败	购回交易自动 撤单
1	HBCJHM	成交号码	成交号码	成交号码	成交号码	成交号码	成交号码
2	HBZQDM	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
3	HBQXLX	空格	空格	3	空格	空格	空格
4	HBGHQX	0	0	回购天数	0	0	0
5	HBHTXH	券商申报合同 序号	券商申报合同 序号	券商申报合同 序号	券商申报合同序 号	券商申报合同 序号	券商申报合同 序号
6	HBZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
7	HBCJSL	-撤单数量	0	-撤单数量	-撤单数量	0	-撤单数量
8	HBCJGG	0.000	0.000	初定的百元资 金年收益	0.000	0.000	实际的百元资 金年收益
9	HBDFDY	空格	空格	对方交易单元	空格	空格	对方交易单元
10	HBDFZH	空格	空格	自动撤单原因	空格	空格	自动撤单原因
11	HBCJSJ	撤单时间	撤单时间	撤单时间	撤单时间	撤单时间	撤单时间
12	HBCJRQ	撤单日期	撤单日期	撤单日期	撤单日期	撤单日期	撤单日期
13	HBYYLB	04	04	04	04	04	04
14	HBZLLB	UC	UC	UC	VC	VC	VC
15	HBYYDH	0	0	约定号	0	0	约定号
16	HBCDYY	空格	空格	自动撤单代码	空格	空格	自动撤单代码
17	HBYHTXH	被撤销的合同 序号	被撤销的合同 序号	14 个“0”加 8 个空格	被撤销的合同序 号	被撤销的合同 序号	前 6 个字符固 定为 000000 中间 8 个字符 为初始交易成 交日期 后 8 个字符为

序号	字段名	初始交易主动 撤单成功	初始交易主动 撤单失败	初始交易自动 撤单	购回交易主动撤 单成功	购回交易主动 撤单失败	购回交易自动 撤单
							初始交易的交易 编号
18	HBJSJG	01	01	01	01	01	01
19	HBSYL	-99.000000	-99.000000	-99.000000	-99.000000	-99.000000	-99.000000
20	HBHBSL2	0	0	0	0	0	0
21	HBHBJG2	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
22	HBBYBZ	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用	券商备用
23	HBBYWB						
23.1	HBHBJE	融资金额	0.000	融资金额	到期回购的结 算金额	0.000	到期回购的 结算金额
23.2	HBHBJE2	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000	0.000
23.3	HBQTZH	空格	空格	空格	空格	空格	空格
23.4	HBYYB	空格	空格	空格	空格	空格	空格
23.5	HBBJLX	空格	空格	空格	空格	空格	空格
23.6	HBQTWB	空格	空格	空格	空格	空格	空格

五、清算和交收

详见附件二。

六、开展债券质押式协议回购业务的券商系统注意事项

6.1 行情相关说明

协议回购的证券基本资料已在证券信息库 SJSXX.dbf、新证券信息库 SJSXXN.dbf 挂牌，但购回交易时可能由于标的证券发生提前兑付而不在深交所交易系统挂牌；协议回购成交行情等信息不会反映到行情库 SJSHQ.dbf、指数库 SJSZS.dbf、综合行情库 SJSZHHQ.dbf。

6.2 委托相关说明

只能通过综合协议交易网关的综合委托库 SJSZHWT.dbf 申报协议回购业务的委托，无法通过综合协议交易终端或者委托库 SJSWT.dbf 申报。

6.3 回报相关说明

回报库 SJSHB.dbf 中不存在协议回购业务的任何回报记录，该类业务的成交回报只通过综合回报库 SJSZHHB.dbf 即时回报，券商技术系统只能使用综合回报库 SJSZHHB.dbf 完成相关的股份前端监控、资金前端监控、委托查询、清算、交收

等所有业务处理。

6.4 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，以支持协议回购业务的委托指令录入。

6.5 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

所有申报的数量、价格或金额等要素必须符合本所债券质押式协议回购交易相关业务规则。

证券公司应当实施相应的融入方、融出方适当性管理，确保向深交所交易系统申报的证券账户均为合法、合规账户。未开通相关交易权限的融入方、融出方不得录入该类业务的委托，或券商技术系统拒绝未开通交易权限的融入方、融出方委托。

◇ 向综合委托库 SJSZHWT.DBF 申报委托

接受融入方、融出方协议回购业务的委托指令后，按照数据接口规范所约定的内容向综合委托库 SJSZHWT.DBF 写入交易委托，合同序号 WTHTXH 的第 15、16 位（从左往右数）须填入相应的融入方所在营业部识别码。关于数据接口规范的更多内容说明详见[附件一、债券质押式协议回购业务的交易数据接口修订说明](#)。

每一次申报的合同序号不能重复（综合委托库 SJSZHWT.DBF 申报的合同序号与综合协议交易终端申报的合同序号也不能重复），否则后送到交易系统的重单委托将被视为非法而直接丢弃。

七、 联系方式

业务：0755-88668802（交易）

0755-25944255（结算）

技术：0755-88668679、88668467（交易）

Email: ssegcb@szse.cn

0755-25946080（结算）

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

附件一、债券质押式协议回购业务的交易数据接口修订说明

1、综合委托库 SJSZHWT.dbf

(1) 委托业务类别、指令类别含义表增加债券质押式协议回购业务的相关定义。

委托业务类别、指令类别含义表

WTYWLB	WTZLLB	指令类别含义	WTWTSL	WTWTJG
04	UB	协议回购初始交易融出资金的委托记录	>0	>0
04	US	协议回购初始交易融入交易的委托记录	>0	>0
04	UC	协议回购初始交易主动撤单的委托记录		=0
04	VB	协议回购购回交易返回资金的委托记录	>0	>0
04	VS	协议回购购回交易收取资金的委托记录	>0	>0
04	VC	协议回购购回交易主动撤单的委托记录		=0

(2) WTYWLB (字段 6: 业务类别) 为“04”且 WTZLLB (字段 7: 指令类别) 为“UB”或“US”或“VB”或“VS”时, WTDFDY (字段 8: 对方交易单元) 存放协议回购业务的对方交易单元。

(3) 协议回购业务的购回交易指令, WTYHTXH (字段 18: 原合同序号) 第 1 至 6 位填空格, 第 7 至 14 位填写对应初始交易指令中委托日期, 第 15 至 22 位填对应初始交易的交易编号。

(4) 对于协议回购的初始交易和购回交易指令, WTWTJE (字段 22.1: 委托金额) 表示申报金额。

2、综合回报库 SJSZHQB.dbf

(1) 回报业务类别、指令类别含义表增加债券质押式协议回购业务的相关定义。

回报业务类别、指令类别含义表

HBYWLB	HBZLLB	回报指令类别含义	HBCJSL	HBCJJG
04	UB	协议回购初始交易融出资金的确认成交回报记录	>0	>0
04	US	协议回购初始交易融入资金的确认成交回报记录	>0	>0
04	UC	协议回购初始交易的撤单回报记录	<=0	=0
04	VB	协议回购购回交易返回资金的确认成交回报记录	>0	>0
04	VS	协议回购购回交易收取资金的确认成交回报记录	>0	>0
04	VC	协议回购购回交易的撤单回报记录	<=0	=0

(2) 对于协议回购业务的回报记录, HBYDH (字段 15: 约定号) 的值与

综合委托库 SJSZHW.T.dbf 相应委托记录的 WTYDH（字段 12：约定号）字段相等，HBYYB（字段 23.4：营业部识别码）的值与综合委托库 SJSZHW.T.dbf 相应委托记录的 WTYB（字段 22.3：营业部识别码）字段相等。

（3）对于协议回购业务，HBQTZH（字段 23.3：其他账户）的值无意义，其值固定为“0000000000”。

（4）交易主机自动撤单含义表中增加自动撤单原因及其解释说明。

交易主机自动撤单含义表

HBCDYY	HBDFZH	具体含义
08	价格错误	协议回购业务的申报价格不符合规定
09	数量非法	协议回购业务的申报数量不符合规定
18	无对手	协议回购业务的对手方已成交
19	配对失败	协议回购业务的买卖双方申报信息不相符
20	重复约定号	协议回购业务的约定号重复
22	错误约定号	协议回购业务的约定号格式错误
23	无效单元	协议回购初始交易的申报交易单元无质押标的的品种经营权限
45	买卖禁止	该证券代码当天禁止进行协议回购业务
49	金额非法	协议回购业务的申报金额非法
51	结算机构错	协议回购业务的结算机构代码错误
54	原合同号错	协议回购业务购回交易指令的初始成交日期或初始交易对应的交易编号非法
59	购回期限错	协议回购业务的购回期限不符合规定

附件二、债券质押式协议回购业务的结算数据接口修订说明

1、接口修订简要说明

对深交所债券质押式协议回购（以下简称“协议回购”）业务的相关成交指令，中国结算深圳分公司采用 RTGS 或 T+0 日末逐笔全额非担保交收方式进行交收处理；RTGS 交收需对应债券的交易支持 RTGS 交收，如证券公司次级债 1J、私募债 1S（不包括可交换私募债）、资产证券化 1Z 等债券品种。

使用 SJSMX0.DBF 和 SJSJG0.DBF、SJSJG.DBF 分别表示协议回购业务指令的逐笔清算和实时、日终交收结果。新增两种业务类别：‘XYCS’协议回购初始交易、‘XYDQ’协议回购购回交易；这两种业务的证券数量仅表示业务涉及的证券质押与解押数量，并不表示证券数量的变更。另外，SJSJG.DBF 新增通知类业务‘XYHY’表示未购回协议回购合约。

初始交易将融资方的证券在融资方的席位上进行质押冻结，购回交易将对融资方质押证券与其产生的红利（若有）进行解除质押冻结。使用 SJSJG.DBF 中业务类别‘DJDJ’、‘DJJD’、‘DJJX’分别表示协议回购业务中涉及的证券冻结、证券解冻、质押红利解冻。此外，业务类别为‘DJ00’（冻结总股数）的数据记录中也包含协议回购质押冻结的证券数量。

使用 SJSZJ.DBF 表示相关资金交收数据，业务类别同 SJSJG.DBF。

使用 SJSFW.DBF 中‘11’冻结明细数据下发协议回购质押冻结明细信息。

SJSMX0.DBF、SJSJG0.DBF、SJSJG.DBF、SJSFW.DBF 详细说明见下文。

2、清算明细库 SJSMX0.DBF

SJSMX0.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》（网址：<http://www.chinaclear.cn> 的首页之“服务支持”-“业务资料”-“接口规范”-“深圳市场”栏目）。

债券质押式协议回购的初始交易、购回交易指令的逐笔清算采用 SJSMX0.DBF 中的‘XYCS’、‘XYDQ’业务类别。SJSMX0.DBF 具体请参见下表：

字段名	业务类别	
	XYCS(协议回购初始交易)	XYDQ (协议回购购回交易)
MXJSZH	结算账号	结算账号

字段名	业务类别	
	XYCS(协议回购初始交易)	XYDQ (协议回购购回交易)
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘XYCS’	‘XYDQ’
MXZQDM	证券代码	证券代码
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 MXTGDY 为出资单元时>0; MXTGDY 为融资单元时<0;	0
MXQSSL	清算数量 MXTGDY 为出资单元时=0; MXTGDY 为融资单元时<0;	清算数量 MXTGDY 为出资单元时=0; MXTGDY 为融资单元时>0;
MXCJG	百元资金利率	百元资金利率
MXQSJG	百元资金利率	百元资金利率
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	证券类别	证券类别
MXZQZL	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	股份性质	股份性质
MXJSFS	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’
MXHBDH	货币代号	货币代号
MXQSBJ	清算本金	清算本金
MXYHS		
MXJYJSF	交易经手费	交易经手费
MXJGGF		
MXGHF		
MXJSF	结算费	结算费
MXSXF		
MXQSYJ		
MXQTFY		
MXZJJE		
MXSFJE	收付净额	收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日

字段名	业务类别	
	XYCS(协议回购初始交易)	XYDQ (协议回购购回交易)
MXQSRQ	T 日	T 日
MXJSRQ	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日
MXQTRQ	拟购回日期	
MXSCDM		
MXJYFS	‘02’	‘02’
MXZQDM2		
MXTGDY2		
MXDDBH2		
MXCWDH		
MXPPHM		
MXFJSM	初始合约号 (表示初始成交日期+交易编号)	初始合约号
MXBYBZ		

下面是对 SJSMX0.DBF 接口的实例化说明。(实例沿用深交所的成交示例)

20130307, 某融入方交易单元为 008888, 融出方交易单元为 006666, 融入方托管单元为 008888, 融出方托管单元为 006666, 融入方证券账户为 0866666666, 融出方证券账户为 0877777777, 融入方结算账号为 998888, 融出方结算账号为 996666, 20130307 日各提交一笔初始交易指令, 质押债券为 118003, 数量为 20 万, 融资金额 1000 万, 初定每百元资金年收益为 6.000, 达成期限为 31 天的协议回购, 交易编号为 00000011。

到期日 20130407, 双方又各自提交一笔购回交易指令, 归还质押债券 118003, 数量 15 万 (其中 5 万债券发生提前兑付), 归还资金 1005 万 (其中 5 万为利息), 实际每百元资金年收益为 6.000。

则双方接收到的 SJSMX0 数据应当如下:

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
MXJSZH	998888	996666	998888	996666
MXBFZH	B001998888	B001996666	B001998888	B001996666
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘XYCS’	‘XYCS’	‘XYDQ’	‘XYDQ’
MXZQDM	118003	118003	118003	118003

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
MXJYDY	008888	006666	008888	006666
MXTGDY	008888	006666	008888	006666
MXZQZH	0866666666	0877777777	0866666666	0877777777
MXDDBH	00000004	00000004	00000005	00000005
MXYYPB	00	00	00	00
MXZXBH	090036059	090036059	090034956	090034956
MXYWLSH	1303070027853211	1303070027853212	1304070027853211	1304070027853212
MXCJSL	-200000	200000	0	0
MXQSSL	-200000	0	150000	0
MXCJG	6	6	6	6
MXQSJG	6	6	6	6
MXXYJY				
MXPCBS				
MXZQLB	‘1S’	‘1S’	‘1S’	‘1S’
MXZQZL	‘1’	‘1’	‘1’	‘1’
MXGFXZ	‘00’	‘00’	‘00’	‘00’
MXJSFS	‘R’	‘R’	‘R’	‘R’
MXHBDH	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’
MXQSB	10000000	-10000000	-10050000	10050000
MXYHS				
MXJYJSF	-1	-1	0	0
MXJGGF				
MXGHF				
MXJSF	0	0	0	0
MXSXF				
MXQSYJ				
MXQTFY				
MXZJJE				
MXSFJE	9999999	-10000001	-10050000	10050000
MXCJRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
MXQSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
MXJSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
MXFSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
MXQTRQ	20130407	20130407		
MXSCDM				
MXJYFS	‘02’	‘02’	‘02’	‘02’
MXZQDM2				
MXTGDY2				

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
MXDDBH2				
MXCWDH				
MXPPHM				
MXFJSM	2013030700000011	2013030700000011	2013030700000011	2013030700000011
MXBYBZ				

3、实时交收明细结果库 SJSJG0.DBF

日间 D-COM 终端通过 SJSJG0.dbf 下发 RTGS 实时交收成功的结果数据，
其具体定义参见下文 SJSJG 中的业务类别 ‘XYCS’、‘XYDQ’。

下面是对 SJSJG0.DBF 接口的实例化说明。

沿用 SJSJG0 实例化中的业务用例，若对应交易日间进行 RTGS 交收且成功，则双方接收到的 SJSJG0 数据应当如下：

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
JGJSZH	998888	996666	998888	996666
JGBFZH	B001998888	B001996666	B001998888	B001996666
JGSJLX	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘XYCS’	‘XYCS’	‘XYDQ’	‘XYDQ’
JGZQDM	118203	118003	118003	118003
JGJYDY	008888	006666	008888	006666
JGTGDY	008888	006666	008888	006666
JGZQZH	0866666666	0877777777	0866666666	0877777777
JGDDBH	00000004	00000004	00000005	00000005
JGYYB	00	00	00	00
JGZXBH	090036059	090036059	090034956	090034956
JGYWLSH	1303070027853211	1303070027853212	1304070027853211	1304070027853212
JGCJSL	-200000	200000	0	0
JGQSSL	-200000	0	150000	0
JGJSSL	-200000	0	150000	0
JGCJJG	6	6	6	6
JGQSJG	6	6	6	6
JGXYJY				
JGPCBS				
JGZQLB	‘1S’	‘1S’	‘1S’	‘1S’
JGZQZL	‘1’	‘1’	‘1’	‘1’

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
JGGFXZ	'00'	'00'	'00'	'00'
JGJSFS	'R'	'R'	'R'	'R'
JGHBDH	'RMB'	'RMB'	'RMB'	'RMB'
JGQSB	10000000	-10000000	-10050000	10050000
JGYHS				
JGJYJSF	-1	-1	0	0
JGJGGF				
JGGHF				
JGJSF	0	0	0	0
JGSXF				
JGQSYJ				
JGQTFY				
JGZJJE				
JGSFJE	9999999	-10000001	-10050000	10050000
JGJSBZ	'Y'	'Y'	'Y'	'Y'
JGZYDH				
JGCJRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGQSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGJSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGFSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGQTRQ	20130407	20130407		
JGSCDM				
JGJYFS	'02'	'02'	'02'	'02'
JGZQDM2				
JGTGDY2				
JGDDBH2				
JGFJSM	2013030700000011	2013030700000011	2013030700000011	2013030700000011
JGBYBZ				

4、交收明细结果库 SJSJG.DBF

SJSJG.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》。

对于 SJSMX0.DBF 中 'XYCS'、'XYDQ' 业务，交收结果 T 日体现在 SJSJG.DBF 中。对申报要素合法性检查不通过的申报指令的交收结果，JGJSBZ 字段值为 'N'，JGZYDH 字段值为相应错误原因代码，错误代码及错误描述可

以通过 D-COM 下载 SJSGB.DBF，取广播类别是‘ZY’的数据获取。

对于‘XYCS’、‘XYDQ’，SJSJG.DBF 中的 JGJSSL 并不表示股份的实际变更，‘XYCS’时只是在融资方原席位上做证券质押冻结，‘XYDQ’时只是在融资方原席位上做证券质押解冻，证券的冻结与解冻也将体现在 SJSJG.DBF 的‘DJJD’与‘DJJD’中，购回时质押红利的解冻体现在 SJSJG.DBF 的‘DJJX’中。

SJSJG.DBF 中将新增‘XYHY’协议回购合约表示参与人（包括融资方、出资方对应的参与人）下未购回的协议回购合约。

字段名	业务类别		
	XYCS（初始交易）	XYDQ（购回交易）	XYHY（协议回购合约）
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’	‘02’
JGYWLB	‘XYCS’	‘XYDQ’	‘XYHY’
JGZQDM	证券代码	证券代码	证券代码
JGJYDY	交易单元	交易单元	
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	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	JGTGDY 为出资单元时>0; JGTGDY 为融资单元时<0;	0	
JGQSSL	JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时<0;	JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时>0;	
JGJSSL	JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时<0; 检查失败的记录，该字段填写 0	JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时>0;	质押数量 >=0 协议回购融资方 <=0 协议回购出资方
JGCJJG	百元资金年利率	百元资金年利率	百元资金年利率
JGQSJG	百元资金年利率	百元资金年利率	
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB	证券类别	证券类别	
JGZQZL	证券子类别	证券子类别	
JGAFXZ	股份性质	股份性质	

字段名	业务类别		
	XYCS (初始交易)	XYDQ (购回交易)	XYHY (协议回购合约)
JGJSFS	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’	
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’	
JGQSB	融资资金 JGTGDY 为出资单元时 <=0; JGTGDY 为融资单元 时>=0;	购回资金 JGTGDY 为出资单元 时>=0; JGTGDY 为融资单元时 <=0;	初始交易金额 <0 协议回购融资方 >0 协议回购出资方
JGYHS			
JGJYSF	经手费	经手费	
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF	结算费	结算费	
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJE			
JGSFJE	收付净额	收付净额	
JGJSBZ	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’	‘N’
JGZYDH	摘要代号	摘要代号	
JGCJRQ	T 日	T 日	初始成交日期
JGQSRQ	T 日	T 日	
JGJSRQ	T 日	T 日	
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ	拟购回日期		拟购回日期
JGSCDM			
JGJYFS	‘02’	‘02’	
JGZQDM2			
JGTGDY2			
JGDDBH2			
JGFJSM	初始合约号 (左对齐右补 空格)	初始合约号 (左对齐右补 空格)	初始合约号 (左对齐右补空格)
JGBYBZ			

下面是对 SJSJG.DBF 接口的实例化说明。

沿用 SJSJG0 实例化中的业务用例，若对应交易日终交收且成功，则双方接收到的 SJSJG 数据应当如下

则双方接收到的 SJSJG 数据应当如下：

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
JGJSZH	998888	996666	998888	996666
JGBFZH	B001998888	B001996666	B001998888	B001996666
JGSJLX	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘XYCS’	‘XYCS’	‘XYDQ’	‘XYDQ’
JGZQDM	118203	118003	118003	118003
JGJYDY	008888	006666	008888	006666
JGTGDY	008888	006666	008888	006666
JGZQZH	0866666666	0877777777	0866666666	0877777777
JGDDBH	00000004	00000004	00000005	00000005
JGYYB	00	00	00	00
JGZXBH	090036059	090036059	090034956	090034956
JGYWLSH	1303070027853211	1303070027853212	1304070027853211	1304070027853212
JGCJSL	-200000	200000	0	0
JGQSSL	-200000	0	150000	0
JGJSSL	-200000	0	150000	0
JGCJJG	6	6	6	6
JGQSJG	6	6	6	6
JGXYJY				
JGPCBS				
JGZQLB	‘1S’	‘1S’	‘1S’	‘1S’
JGZQZL	‘1’	‘1’	‘1’	‘1’
JGGFXZ	‘00’	‘00’	‘00’	‘00’
JGJSFS	‘N’	‘N’	‘N’	‘N’
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’
JGQSBJ	10000000	-10000000	-10050000	10050000
JGYHS				
JGJYJSF	-1	-1	0	0
JGJGGF				
JGGHF				
JGJSF	0	0	0	0
JGSXF				
JGQSYJ				
JGQTFY				
JGZJJE				
JGSFJE	9999999	-10000001	-10050000	10050000
JGJSBZ	‘Y’	‘Y’	‘Y’	‘Y’
JGZYDH				

字段名	20130307 初始交易融入资金	20130307 初始交易融出资金	20130407 购回交易返回资金	20130407 购回交易收取资金
JGCJRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGQSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGJSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGFSRQ	20130307	20130307	20130407	20130407
JGQTRQ	20130407	20130407		
JGSCDM				
JGJYFS	‘02’	‘02’	‘02’	‘02’
JGZQDM2				
JGTGDY2				
JGDDBH2				
JGFJSM	2013030700000011	2013030700000011	2013030700000011	2013030700000011
JGBYBZ				

在 2013-03-07 初始交易达成后，2013-04-07 购回交易之前，结算公司每天下发的未到期合约信息如下：

字段名	资金融入方	资金融出方
JGJSZH	998888	996666
JGBFZH	B001998888	B001996666
JGSJLX	‘02’	‘02’
JGYWLB	‘XYHY’	‘XYHY’
JGZQDM	118003	118003
JGJYDY	008888	006666
JGTGDY	008888	006666
JGZQZH	0866666666	0877777777
JGDDBH		
JGYYB		
JGZXBH		
JGYWLSH		
JGCJSL		
JGQSSL		
JGJSSL	200000	-200000
JGCJJG	6	6
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB		
JGZQZL		
JGGFXZ		

字段名	资金融入方	资金融出方
JGJSFS		
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’
JGQSBJ	10000000	-10000000
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE		
JGJSBZ	‘N’	‘N’
JGZYDH		
JGCJRQ	20130307	20130307
JGQSRQ		
JGJSRQ		
JGFSRQ	T 日	T 日
JGQTRQ	20130407	20130407
JGSCDM		
JGJYFS		
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDBH2		
JGFJSM	2013030700000011	2013030700000011
JGBYBZ		

5、综合数据服务库 SJSFW.DBF

修订了数据类别‘11’的定义，冻结类型增加了协议回购的质押，详见下表。SJSFW.DBF 具体结构请见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》。

FWSJLB 数据类别	数据类别含义说明	FWMXZH 资金账户	FWXWDM 席位代码	FWZQDM 证券代码	FWGDDM 股东代码	FWMRJE 买入金额	FWMCJE 卖出金额	FWZJYE 资金余额	FWZYSM 摘要说明
11	股份司法冻结/质押 冻结明细	冻结序号	席位代码	证券代码	股东代码	冻结类型 1 通过结算公司柜台或 BPM 办理的质押冻结 2 深交所股票质押回购 质押冻结 3 司法冻结 4 债券协议回购 0 其他冻结	对于冻结类 型为 2、4 时，质押冻 结后产生的 红利	冻结数量	左起第 1~2 位为股份性质；第 3 位 为可售标识：‘S’-可售，空-不可 售； FWMRJE=1 时，左起第 4~60 位为 质权人名称； FWMRJE=2 时，左起第 4~25 位为 初始交易合同序号，第 26~47 位为 补充质押合同序号，第 51-60 位为 质押业务编号。 FWMRJE=3 时，左起第 4~60 位为 执行机关名称； FWMRJE=4 时，左起第 4~19 位表 示初始合约号，第 51-60 位为质押 业务编号

6、其它信息

(1)《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》可在中国结算网站 www.chinaclear.cn 首页之“服务支持”-“业务资料”-“接口规范”-“深圳市场”或深交所网站 www.szse.cn 首页之“技术专栏”下载。

(2)《深圳证券交易所数据接口规范（Ver4.72）》可在深交所网站 www.szse.cn 首页之“技术专栏”下载。

(3) 联系方式

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

电话: 0755-25946080

