

# 登记结算数据接口规范

## (基金管理公司版 V1.22)



二零二六年一月

## 版本修订历史

更新日期	最新版本	修订说明
2026/1/28	1. 22	<p>新增 3 个实时服务“资金代收付指令提交”、“资金代收付指令维护”、“资金代收付指令查询”。</p> <p>以上接口调整自 2026 年 2 月 2 日生效。</p>
2025/12/26	1. 21	<p>1. 向基金管理人新增发送 jjmcc(基金持有人债券回购质押专用账户明细文件)；</p> <p>2. 调整 djgg(股票认购冻结结果)文件说明, 删除已停用的 jjrg(网上发行投资人认购名册)文件。</p> <p>以上接口调整自 2025 年 12 月 29 日生效。</p>
2024/6/13	1. 20	<p>1. 配合北交所证券纳入跨市场 ETF, 调整 etftbkyyyymmdd. dbf(ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)的填写说明。</p> <p>以上接口调整自 2024 年 6 月 17 日生效。</p> <p>2. 补充描述配合货银对付改革 tzxx (通知信息文件) 新增通知类别“050: 证券账户最低备付明细数据 (管理人专用)”</p>
2022/6/8	1. 19	<p>1. 配合银行间债券市场与交易所债券市场互联互通业务开展, “RTGS 管理人当日交收情况查询”、“RTGS 管理人历史交收情况查询”调整填写说明。</p> <p>2. 配合 ETF 多码合一业务开展, etftbkyyyymmdd. dbf(ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)调整填写说明。</p> <p>以上接口调整自 2022 年 6 月 20 日生效。</p>
2022/5/13	1. 18	<p>配合银行间债券市场与交易所债券市场互联互通业务开展, 对“RTGS 管理人当日交收情况查询”、“RTGS 管理人历史交收情况查询”中相关证券代码字段位数由 8 位扩充到 20 位。</p> <p>以上接口调整自 2022 年 5 月 23 日生效。</p>
2021/5/19	1. 17	<p>配合上交所债券 ETF 申赎业务从竞价撮合平台迁移至综合业务平台, 修订 jsmx (结算明细数据) 的填写说明。</p> <p>以上接口调整自 2021 年 5 月 24 日生效。</p>
2020/12/22	1. 16	<p>配合 QFII(RQFII) 制度改革, 修改 jjmcb (基金持有人名册文件) 中清算编号 (QSBH) 字段的字段描述 (仅为描述修改)。</p> <p>以上接口调整自 2020 年 12 月 28 日生效。</p>
2020/12/16	1. 15	<p>配合新增 ETF 现金替代退补款清算数据转发服务, 新增 etftbkyyyymmdd. dbf(ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)文件和 ret_etftbkyyyymmdd. dbf(ETF 现金替代退补款清算数据应答文件)文件。</p> <p>以上接口调整自 2020 年 12 月 21 日生效。</p>
2020/12/4	1. 14	<p>配合 ETF 发行登记业务电子化, 新增基金管理人通过 PROP 综合业务终端界面报送 ncstdj(新初始登记名册)的接口说明, 增加通过 PROP 综合业务终端报送 bgdj(变更初始登记申请文件)的文件传输方式。</p> <p>以上接口调整自 2020 年 12 月 14 日生效。</p>
2020/9/11	1. 13	<p>配合 RTGS 系统升级, 新增 RTGS 系统实时服务 (服务域 ‘SSCCRC’, 服务名 ‘RTGS’), 并新增 3 个服务类型 ‘03’、‘10’ 和 ‘11’。</p>
2020/5/13	1. 12	<p>为进一步改善对外数据服务, 根据市场参与人建议对股息红利差别化计税缴纳业务接口进行优化: 在 abcsj 增加 A 股待申报的全量红利税需补缴明细数据。</p> <p>以上接口调整自 2020 年 5 月 18 日生效。</p>
2020/1/14	1. 11	<p>配合信用保护工具资金代收付业务的推出, 调整服务名 ‘JSXT’, 服务类型 ‘60’ 的服务描述为: ETF 申赎及信用保护工具资金代收付指令确认, 并新增划付类别 ‘006’: 信用保护工具资金代收付; 调整服务名 ‘JSXT’, 服务类型 ‘61’ 的服务描述为: ETF 申赎及信用</p>

		保护工具资金代收付指令查询，并新增处理结果；调整服务名‘JSXT’，服务类型‘62’的服务描述为：ETF 申赎及信用保护工具资金代收付指令勾单查询。
2019/12/16	1. 10	1、配合 ETF 文件报送方式优化，修订 ETF 系统“ETF 现金差额和基金净值报送”、“ETF 申购赎回清单报送”服务的填写说明并新增服务时间。 2、删除已停用的服务“ETF 申赎代收付指令生成”、“ETF 申赎代收付指令删除”、“ETF 申赎代收付指令查询”
2016/11/27	1. 09	删除了“基金管理人验证投资人账户”的实时接口说明。
2016/05/25	1. 08	配合 ETF 及场内实时申赎货币基金持有人名册服务优化项目，增加了 jjmcb (基金持有人名册文件)的文件接口说明，删除了 jjmc (基金持有人名册文件)的文件接口说明。以上接口变更自 2016 年 5 月 30 日生效。
2014/12/18	1. 07	增加了 ywhb (ETF 业务---网下认购业务回报文件)的文件接口说明，增加了 ETF 网下认购证券冻结指令申报，ETF 网下认购证券冻结指令申报，ETF 网下认购证券冻结指令删除，ETF 网下认购证券冻结指令查询，ETF 网下认购证券过户指令申报，ETF 网下认购证券过户指令删除和 ETF 网下认购证券过户指令查询的 PROP 实时接口说明。
2014/8/13	1. 06	修订了 ywxz (场内实时申赎货币基金业务---业务规模限制文件)和 ywhb (场内实时申赎货币基金业务---业务回报文件) 接口说明。
2013/6/25	1. 05	增加了黄金 ETF 基金业务的接口说明
2013/3/4	1. 04	删除本文档中关于 jsmx 类文件的结构定义描述。
2013/1/28	1. 03	增加了交易型货币市场基金业务的接口说明
2012/12/13	1. 02	修订了 jjmc (场内实时申赎货币基金业务---持有人名册)的文件说明，新增了 ywxz(场内实时申赎货币基金业务---业务规模限制文件)的文件说明。
2012/11/30	1. 01	增加了场内实时申赎货币基金业务的接口说明。
2012/4/19	1. 00	建立

# 目 录

目 录.....	4
前 言.....	5
一. 规范所涉内容及适用范围.....	5
二. 数据文件命名规则.....	5
三. 基本数据说明.....	5
第一章 上海分公司发送数据文件接口规范.....	6
一. 数据文件清单.....	6
二. 文件详细说明.....	6
1. abcsj (A 股补充数据文件) .....	6
2. djjg (股票认购冻结结果) .....	7
3. jjmcb (基金持有人名册文件) .....	8
4. jjmcc (基金持有人债券回购质押专用账户明细文件) .....	10
5. jsmx (结算明细数据) .....	10
6. ret_etftbkyyyymmdd. dbf (ETF 现金替代退补款清算数据应答文件) .....	11
7. ywhb (业务回报文件) .....	12
8. tzxx (通知信息文件) .....	14
第二章 上海分公司接收数据文件接口规范.....	16
一. 数据文件清单.....	16
二. 文件详细说明.....	16
1. bgdj (变更初始登记申请文件) .....	16
2. csdj (初始登记名册) .....	16
3. etftbkyyyymmdd. dbf (ETF 现金替代退补款清算数据报送文件) .....	17
4. ncsdj (新初始登记名册) .....	18
5. rgdj (认购股票冻结申请文件) .....	18
6. syjz (收益结转文件) .....	19
7. ywxz (场内实时申赎货币基金业务---业务规模限制文件) .....	19
第三章 PROP 实时数据接口规范.....	21
一. 实时数据清单.....	21
二. 接口详细说明.....	21
1. ETF 现金差额和基金净值报送.....	21
2. ETF 申购赎回清单报送.....	22
3. ETF 申赎及其他代收付申报.....	23
4. ETF 申赎及其他代收付查询.....	23
5. ETF 申赎及其他代收付勾单查询.....	23
6. 资金代收付指令提交.....	23
7. 资金代收付指令维护.....	24
8. 资金代收付指令查询.....	24
9. ETF 网下认购证券冻结指令申报.....	24
10. ETF 网下认购证券冻结指令删除.....	25
11. ETF 网下认购证券冻结指令查询.....	25
12. ETF 网下认购证券过户指令申报.....	26
13. ETF 网下认购证券过户指令删除.....	27

14. ETF 网下认购证券过户指令查询.....	27
15. RTGS 交收相关方信息查询.....	28
16. RTGS 管理人当日交收情况查询.....	29
17. RTGS 管理人历史交收情况查询.....	31

## 前言

## 一. 规范所涉内容及适用范围

为了进一步规范中国证券登记结算有限责任公司上海分公司(以下简称中国结算上海分公司)与基金管理公司之间的登记结算数据接口,确保登记结算数据处理的正确性,特编写本登记结算数据接口规范文档。本文主要针对中国结算上海分公司发送和接收的基金管理公司的各类登记结算数据进行详细的说明。

本规范的适用范围为：中国结算上海分公司和基金管理公司之间的数据交换。

## 二. 数据文件命名规则

目前中国结算上海分公司发送和接收的数据文件,均采用 FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式。为了减少数据通讯量,中国结算上海分公司发送的数据文件都经过 ZIP 软件压缩后发送至 PROP 电子信箱中。

中国结算上海分公司发送基金管理公司的数据文件的一般命名规则为：

“前缀” + “标识” + “.” + “后缀”

前缀为文件代码，表示文件类型，如 rgdj…；

标识 = 基金代码:

后缀 = mdd，表示文件发送日期，其中 m 表示月（m=1, 2, 3, ..., 9, a, b, c），dd 表示日（dd=01, 02, 03, ..., 31）。

### 三. 基本数据说明

1. 股票的数量单位为“股”、基金的数量单位为“份”；债券、融券数量单位为“元”面值数量；金额单位为“元”。
  2. 如无特殊说明，所有的日期格式为：YYYYMMDD，时间格式为：HHMMSS。
  3. 在本规范中，如在数据填写说明中出现“#”，表明该字段的内容对此类数据记录无意义。

# 第一章 上海分公司发送数据文件接口规范

## 一. 数据文件清单

序号	前缀	文件说明	发送周期	标识	备注
1	abcsj	A股补充数据文件	每个交易日		
2	djjg	股票认购冻结结果	一次(认购期)	基金代码	
3	jjmcb	基金持有人名册	每个交易日	基金代码	
4	jjmcc	基金持有人债券回购质押专用账户明细文件	每个交易日	基金代码	
5	jsmx	结算明细数据	每个交易日	基金代码	
6	ret_etftbkyyyymmdd.dbf	ETF现金替代退补款清算数据应答文件	每个交易日		
7	ywhb	业务回报文件	每个交易日		
8	tzxx	通知信息文件	每个交易日		

## 二. 文件详细说明

### 1. abcsj(A股补充数据文件)

- 1) 文件名称: abcsjXXXXX.mdd (XXXXX为清算编号)。
- 2) 数据内容: A股股息红利差别化计税当前交易日需补缴明细数据。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: PROP信箱。
- 5) 发送时间: 每个交易日早上5:00前。
- 6) 发送周期: 每个交易日。
- 7) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	格式定义	红利税补缴明细
1	SCDM	市场代码	Character	2		01-上海A股市场
2	TZLB	通知类别	Character	3		HLS-红利税补缴明细
3	TZRQ	通知日期	Character	8	YYYYMMDD	当前交易日
4	QSBH	清算编号	Character	5		结算参与人的清算编号
5	XH	序号	Character	16		程序生成的补税序号, 减持日期+补税序号全局唯一
6	ZQZH	证券账号	Character	10		投资者证券帐号
7	ZQDM	证券代码	Character	6		减持的证券代码
8	ZQLB	证券类别	Character	2		PT
9	LTLX	流通类型	Character	1		#
10	QYLB	权益类别	Character	2		#
11	GPNF	挂牌年份	Character	4		#
12	ZH1	账户1	Character	25		#
13	ZH2	账户2	Character	25		#
14	RQ1	日期1	Character	8		当证券账户为内地与香港基金互认之内地基金证券账户时, 此应补缴红利税明细数据为境外

						投资者所占份额，则“RQ1”字段填写0。其他情况时该字段填写初始持有日期。
15	RQ2	日期 2	Character	8		减持日期 (S 日)
16	RQ3	日期 3	Character	8		对应的权益登记日期
17	JE1	金额 1	Character	19	±999999999999999.99	需要补缴的现金红利或股票红利税金额，单位：元。计算公式：价格 1×比率 1×数量 1，四舍五入保留 2 位小数。
18	JE2	金额 2	Character	19	±999999999999999.99	#
19	JE3	金额 3	Character	19	±999999999999999.99	#
20	JG1	价格 1	Character	17	±999999.999999999	现金红利的税前红利价格或股票红利的应纳税税基价格，单位：元。后者的计算公式为：股份面值*每股送股比例，四舍五入保留 5 位小数。
21	JG2	价格 2	Character	17	±999999.999999999	#
22	BL1	比率 1	Character	17	±999999.999999999	补税税率 持股期限在 1 个月以内（含）为 0.15；持股期限在 1 个月以上、1 年以内（含）为 0.05。
23	BL2	比率 2	Character	17	±999999.999999999	当证券账户为内地与香港基金互认之内地基金证券账户时，该字段填写相应的计税比例，否则填空
24	SL1	数量 1	Character	16	±999999999999999	须纳税数量（绝对值）
25	SL2	数量 2	Character	16	±999999999999999	#
26	FZDM	辅助代码	Character	10		前 2 位有效，‘HL’：表示本条记录针对现金红利补税 ‘SG’：表示本条记录针对股票红利补税
27	BZ	备注	Character	80		#
28	BY	备用	Character	40		#

填写说明：

A 股股息红利差别化计税补缴业务，通知类型为“HLS”，对于 A 股证券，发送自投资者减持日起不超过 31 个工作日的尚未成功申报的红利税补缴明细数据。

## 2. djjg (股票认购冻结结果)

- 1) 文件名称: djjg\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 对申购 ETF 份额的组合证券实施冻结的反馈结果。
- 3) 文件传输方式: 手工下载后发送公司总部，由公司总部转发给基金管理公司。
- 4) 发送目标: 基金管理公司。
- 5) 发送时间: 股票认购时申请投资人股票冻结当日日终处理完成后，数据手工生成。
- 6) 发送周期: 一次 (认购期)。
- 7) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	DJBH	冻结编号	C	9	

2	ZQZH	证券帐号	C	10	
3	ZQDM	证券代码	C	6	
4	SQDJSL	申请冻结数量	N	11	
5	DJSL	冻结数量	N	11	
6	ZZRQ	终止日期	C	8	
7	FHDM	返回代码	C	4	
8	JGXX	结果信息	C	40	

### 3. jjmcb (基金持有人名册文件)

- 1) 文件名称: jjmcb\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 包括当日登记在册的 ETF 及场内实时申赎货币基金持有人名册。
- 3) 发送目标: 基金管理人 PROP 信箱。
- 4) 发送时间: 日终发送。
- 5) 发送周期: 每个交易日 (基金登记日之后)。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQZH	证券帐号	Character	10	普通 A 股账户, 取值为该账户对应的证券帐号; 若为融资融券账户, 取值为与其对应的 E 字头信用证券账户证券帐号; 若为转融通担保账户, 取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户证券帐号
2	ZQZH2	证券帐号 2	Character	10	普通 A 股账户, 该字段为空; 若为融资融券或转融通担保账户, 取值为 D 字头担保大账户证券帐号。
3	TZRM C	投资人名称	Character	80	普通 A 股账户, 取值为该账户对应的投资人名称; 若为融资融券信用担保账户, 取值为与其对应的 E 字头信用证券账户名称; 若为转融通担保证券账户, 取值为与之对应的 E 字头转融通担保证券明细账户名称。
4	TZRM C2	投资人名称 2	Character	80	普通 A 股账户, 该字段为空; 若为融资融券信用担保账户, 取值为“XX 证券公司客户信用交易担保证券账户”; 若为转融通担保证券账户, 取值为“中国证券金融股份有限公司转融通担保证券账户”。
5	ZJLB	证件类别	Character	2	若为融资融券账户, 取值为与其对应的 E 字头信用证券账户证件类别; 若为转融通担保账户, 取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户证件类别。
6	ZJLB2	证件类别 2	Character	2	普通 A 股账户, 该字段为空; 若为融资融券或转融通担保账户, 取值为 D 字头担保大账户证件类别。
7	ZJDM	证件代码	Character	40	普通 A 股账户, 该字段为空; 若为融资融券账户, 取值为与其对应的 E 字头信用证券账户证件代码; 若为转融通担保账户, 取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户证件代码。
8	ZJDM2	证件代码 2	Character	40	普通 A 股账户, 该字段为空;

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
					若为融资融券或转融通担保账户，取值为 D 字头担保大账户证件代码。
9	XB	性别	Character	1	1 表示性别为男； 2 表示性别为女； 3 为其他，表示非自然人
10	TZRLB	投资人类别	Character	1	1 表示个人； 2 表示机构
11	GJDM	国籍代码	Character	3	若为融资融券账户，取值为与其对应的 E 字头信用证券账户国籍代码； 若为转融通担保账户，取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户国籍代码。
12	TXDZ	通讯地址	Character	80	若为融资融券账户，取值为与其对应的 E 字头信用证券账户通讯地址； 若为转融通担保账户，取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户通讯地址。
13	LXDH	联系电话	Character	20	若为融资融券账户，取值为与其对应的 E 字头信用证券账户联系电话； 若为转融通担保账户，取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户联系电话。
14	YZBM	邮政编码	Character	6	若为融资融券账户，取值为与其对应的 E 字头信用证券账户邮政编码； 若为转融通担保账户，取值为与之对应的 D 字头转融通担保证券明细账户邮政编码。
15	ZDXW	指定交易席位	Character	5	普通 A 股账户、QFII、RQFII 取值为指定交易席位； 若为融资融券或转融通担保账户，取值为 D 字头担保大账户指定交易席位。
16	QSBH	清算编号	Character	5	普通 A 股账户取值为指定交易对应清算编号； 指定结算的 QFII/RQFII 账户取值为指定结算会员的清算编号； 若为融资融券或转融通担保账户，取值为 D 字头担保大账户指定交易席位对应的清算编号。
17	ZJZH	非担保交收资金帐号	Character	25	清算编号对应的非担保交收资金帐号，用于场外代收代付
18	JSHY	结算参与人名称	Character	80	清算编号所属机构名称
19	ZQDM	证券代码	Character	6	
20	ZQLB	证券类别	Character	2	
21	LTLX	流通类型	Character	1	
22	QYLB	权益类别	Character	2	
23	GPNF	挂牌年份	Character	4	
24	CYSL	持有数量	Character	12	
25	DJRQ	登记日期	Character	8	
26	BY1	备用 1	Character	40	正常席位持有，该字段为空； 若有基金份额被司法冻结或用于质押，则提示“该基金份额位于冻结席位”
27	BY2	备用 2	Character	40	预留

#### 4. jjmcc (基金持有人债券回购质押专用账户明细文件)

- 1) 文件名称: jjmcc\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 基金持有人债券回购质押专用账户明细数据。
- 3) 发送目标: 基金管理人的 PROP 信箱。
- 4) 发送时间: 日终发送 (与现有 jjmcb 数据文件发送时间保持一致)。
- 5) 发送周期: 每个交易日 (基金登记日之后)。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段	说明	格式	长度	备注
1	ZQZH1	证券账户 1	Character	20	出质人证券账户
2	ZHMC1	账户名称 1	Character	120	出质人证券账户名称
3	ZQZH2	证券账户 2	Character	20	债券质押式回购质押专用账户证券账户
4	ZHMC2	账户名称 2	Character	120	债券质押式回购质押专用账户的证券账户名称
5	ZJLB	证件类别	Character	2	出质人证件类别
6	ZJDM	证件代码	Character	40	出质人证件代码
7	XB	性别	Character	1	出质人性别; 1: 男; 2: 女; 3: 其他, 表示非自然人
8	TZRLB	投资人类别	Character	1	出质人投资者类别; 1: 个人; 2: 机构
9	GJDM	国籍代码	Character	3	出质人国籍代码
10	TXDZ	通讯地址	Character	120	出质人通讯地址
11	LXDH	联系电话	Character	32	出质人联系电话
12	YZBM	邮政编码	Character	6	出质人邮政编码
13	ZDXW	指定交易席位	Character	6	出质人普通 A 股账户、QFII、RQFII 取值为指定交易席位
14	QSBH	清算编号	Character	6	出质人普通 A 股账户取值为指定交易对应清算编号 指定结算的 QFII/RQFII 账户取值为指定结算会员的清算编号
15	ZJZH	资金账号	Character	25	清算编号对应的非担保交收资金账号
16	JSHY	结算参与人名称	Character	120	清算编号所属机构名称
17	ZQDM	证券代码	Character	20	
18	ZQLB	证券类别	Character	2	
19	LTLX	流通类型	Character	1	
20	QYLB	权益类别	Character	2	
21	GPNF	挂牌年份	Character	4	
22	SL1	数量 1	Character	20	出质人质押明细数量
23	SL2	数量 2	Character	20	债券质押式回购质押专用账户的持有数量 (含冻结数量)
24	RQ	日期	Character	8	文件发送当日日期
25	BY1	备用 1	Character	80	预留
26	BY2	备用 2	Character	80	预留

#### 5. jsmx (结算明细数据)

- 1) 文件名称: jsmx\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 各类 ETF 及货币基金申赎数据、货币 ETF (申赎价格恒定、申赎价格变动) 的二级市场交易数据。

- 3) 发送目标: ETF 发行人或者基金管理人 PROP 信箱。
- 4) 发送时间: 日终发送。
- 5) 发送周期: 每个交易日。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式;
- 7) 数据说明: 本文件将结算参与人数据抄送基金管理公司, 结算明细数据填写格式参照《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》“结算明细文件填写说明”中 ETF 相关业务的填写说明。

## 6. ret\_etftbkyyyymmdd.dbf (ETF 现金替代退补款清算数据应答文件)

- 1) 文件名称: ret\_etftbkyyyymmdd.dbf (yyyymmdd 为数据报送当日日期)。
- 2) 数据内容: ETF 现金替代退补款清算数据的报送结果。
- 3) 发送目标: 基金管理人 PROP 信箱。
- 4) 发送时间: 每个交易日 8:00-10:40。
- 5) 发送周期: 每个交易日。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JLLX	记录类型	Character	3	001: 整批数据报送结果 002: 数据报送结果明细
2	JGDM	结果代码	Character	4	参考下文说明
3	JGSM	结果说明	Character	40	结果代码对应结果说明
4	SBBH	申报编号	Character	20	同报送数据
5	JJDM	基金代码	Character	8	同报送数据
6	SSDM	申赎代码	Character	8	同报送数据
7	QSBH	清算编号	Character	6	同报送数据
8	ZQZH	证券账号	Character	20	同报送数据
9	XWH	交易单元	Character	6	同报送数据
10	TBKJE	退补款金额	Character	20	同报送数据
11	ZJLX	资金类型	Character	3	同报送数据
12	JYRQ	交易日期	Character	8	同报送数据
13	JSRQ	交收日期	Character	8	同报送数据
14	CJBH	成交编号	Character	20	同报送数据
15	ZJZH	资金账号	Character	25	同报送数据
16	ZHZQDM	组合证券代码	Character	8	同报送数据
17	BZ	备注	Character	40	同报送数据
18	BY	备用	Character	80	暂不启用

说明:

- (1) 对于每次上传的 etftbkyyyymmdd.dbf 文件, 均会生成相应应答文件 ret\_etftbkyyyymmdd.dbf, 超过当日报送时间的报送文件将不予受理, 且无应答文件反馈。
- (2) 对于记录类型‘001’, 表示整批数据报送结果, 结果代码‘0000’表示数据报送成功, ‘9999’表示数据报送失败, 结果说明对应结果代码, 其他字段填空。对于记录类型为‘002’, 表示每条明细数据的校验结果, 结果代码‘0000’仅表示该条明细数据校验通过。
- (3) 若一批报送数据全部校验通过, 则整批数据报送成功; 若一批报送数据中存在校验不

通过的记录，则整批数据报送失败。

## 7. ywhb (业务回报文件)

- 1) 文件名称: ywhb.mdd。
- 2) 数据内容: 包含基金管理公司当日通过 PROP 申报的 ETF 证券冻结、过户处理结果。场内货币基金及货币 ETF 当日收益结转不成功的业务回报数据; 以及场内货币基金小额账户总市值等数据。
- 3) 发送目标: 基金管理人 PROP 信箱。
- 4) 发送时间: 日终处理后。
- 5) 发送周期: 每个交易日。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	QSBH	Character	8		结算会员的清算编号
3	YWLX	Character	3		业务类型
4	YWLY	Character	2		业务来源
5	SBLX	Character	2		申报类型
6	JGDM	Character	4		结果代码
7	JGSM	Character	40		结果说明
8	SLBH	Character	20		受理编号
9	YWBH	Character	20		业务编号
10	SBBH	Character	20		申报编号
11	YHDM	Character	8		用户代码
12	SBRQ	Character	8		申报日期
13	SBSJ	Character	6		申报时间
14	ZQDM	Character	6		证券代码
15	ZQLB	Character	2		证券类别
16	LTLX	Character	1		流通类型
17	QYLB	Character	2		权益类别
18	GPNF	Character	4		挂牌年份
19	FZDM	Character	10		辅助代码
20	ZQZH1	Character	10		证券账户 1
21	ZQZH2	Character	10		证券账户 2
22	XWH1	Character	5		业务单元 1
23	XWH2	Character	5		业务单元 2
24	SBSL	Character	16	±9999999999999999	申报数量
25	CGSL	Character	16	±9999999999999999	成功数量
26	BCYE	Character	16	±9999999999999999	本次余额
27	JE1	Character	19	±999999999999999.99	金额 1
28	JE2	Character	19	±999999999999999.99	金额 2
29	RQ	Character	8		日期
30	BCSM	Character	40		补充说明

### 7) 数据说明:

(1) YWLX: 定义业务回报数据的类型, 定义如下:

463: 场内货币基金 T-1 日收益结转不成功数据

464: ETF 网下认购证券冻结结果业务回报

465: ETF 网下认购证券过户结果业务回报

466: 场内货币基金小额账户总市值

(2) YWLY 定义如下:

02: PROP 申报

(3) 结果代码:

“0000”为成功, 其余为失败, 结果说明是对结果代码的说明。

(4) 对于当日收益结转不成功的数据会写当天的业务回报 (ywhb) 文件, 若收益结转全部成功, 则不写业务汇报 (ywhb) 文件, 也不会发空文件。

字段名	长度	说明	ETF 认购证券冻结	ETF 认购证券过户
SCDM	2	市场代码	‘01’	‘01’
QSBH	8	清算编号	#	#
YWLX	3	业务类型	‘464’	‘465’
YWLY	2	业务来源	‘02’	‘02’
SBLX	2	申报类型	#	#
JGDM	4	结果代码	日终冻结结果代码	日终过户结果代码
JGSM	40	结果说明	日终冻结结果说明	日终过户结果说明
SLBH	20	受理编号	申报受理编号	申报受理编号
YWBH	20	成交编号	冻结编号	冻结编号
SBBH	20	申报编号	申报编号	申报编号
YHDM	8	用户代码	#	#
SBRQ	8	申报日期	申报日期	申报日期
SBSJ	6	申报时间	#	#
ZQDM	6	证券代码	证券代码	证券代码
ZQLB	2	证券类别	证券类别	证券类别
LTLX	1	流通类型	流通类型	流通类型
QYLB	2	权益类别	权益类别	权益类别
GPNF	4	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份
FZDM	10	辅助代码	基金代码	基金代码
ZQZH1	10	证券账户 1	证券帐户	证券帐户
ZQZH2	10	证券账户 2	#	#
XWH1	5	业务单元 1	#	#
XWH2	5	业务单元 2	#	#
SBSL	16	申报数量	申报数量	申报数量
CGSL	16	成功数量	成功数量	成功数量
BCYE	16	本次余额	#	#
JE1	19	金额 1	#	#
JE2	19	金额 2	#	#
RQ	8	日期	#	#
BCSM	40	补充说明	#	#

续上表:

字段名	长度	说明	场内货币基金 T-1 日收益结转不成功数据	场内货币基金小额账户总市值回报
SCDM	2	市场代码	‘01’	‘01’
QSBH	8	清算编号	#	#
YWLX	3	业务类型	463	466
YWLY	2	业务来源	‘02’	‘02’
SBLX	2	申报类型	#	#
JGDM	4	结果代码	非“0000”表示不成功	“0000”

字段名	长度	说明	场内货币基金 T-1 日收益结转不成功数据	场内货币基金小额账户总市值回报
JGSM	40	结果说明	具体不成功的原因	#
SLBH	20	受理编号	#	#
YWBH	20	成交编号	#	#
SBBH	20	申报编号	#	#
YHDM	8	用户代码	PROP 用户代码	PROP 用户代码
SBRQ	8	申报日期	申报日期 (当前交易日)	申报日期 (当前交易日)
SBSJ	6	申报时间	#	#
ZQDM	6	证券代码	货币基金代码	货币基金代码
ZQLB	2	证券类别	JJ	JJ
LTLX	1	流通类型	0	0
QYLB	2	权益类别	#	#
GPNF	4	挂牌年份	#	#
FZDM	10	辅助代码	#	#
ZQZH1	10	证券账户 1	证券账户	#
ZQZH2	10	证券账户 2	#	#
XWH1	5	业务单元 1	#	#
XWH2	5	业务单元 2	#	#
SBSL	16	申报数量	基金收益结转份额	当日申报的货币基金小额账户标准
CGSL	16	成功数量	#	#
BCYE	16	本次余额	#	#
JE1	19	金额 1	#	当日货币基金小额账户总市值
JE2	19	金额 2	#	#
RQ	8	日期	当前日期	申报日期 (当前交易日)
BCSM	40	补充说明	#	#

#### 说明

- (1) 对于当日收益结转不成功的数据会写当天的业务回报 (ywhb) 文件, 若收益结转全部成功, 则不写业务汇报 (ywhb) 文件, 也不会发空文件。
- (2) 对于当日申报小额账户的货币基金, 日终通过业务回报 (ywhb) 文件, 将该基金的小额账户总市值反馈基金公司; 若没有申报小额账户标准, 则不发该数据。

## 8. tzxx(通知信息文件)

- 1) 文件名称: tzxx.mdd。
- 2) 数据内容: 包含证券账户最低备付明细通知数据。
- 3) 发送目标: 基金管理人PROP信箱。
- 4) 发送时间: 每个交易日日终后。
- 5) 发送周期: 每个交易日。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明	证券账户最低备付明细数据 (管理人专用)
1	SCDM	Character	2		市场代码	‘01’
2	TZLB	Character	3		通知类别	‘050’
3	TZRQ	Character	8		通知日期	当天日期

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明	证券账户最低备付明细数据 (管理人专用)
4	QSBH	Character	8		结算参与人的清算编号	清算编号
5	ZQDM	Character	6		证券代码	#
6	ZQLB	Character	2		证券类别	#
7	LTLX	Character	1		流通类型	#
8	QYLB	Character	2		权益类别	#
9	GPNF	Character	4		挂牌年份	#
10	ZH1	Character	25		账户 1	备付金账户
11	ZH2	Character	25		账户 2	证券账户
12	RQ1	Character	8		日期 1	生效日期
13	RQ2	Character	8		日期 2	调整日期
14	JE1	Character	19	±999999999999999.99	金额 1	#
15	JE2	Character	19	±999999999999999.99	金额 2	上月买入金额
16	JE3	Character	19	±999999999999999.99	金额 3	#
17	JG1	Character	17	9999999.99999999	价格 1	#
18	JG2	Character	17	9999999.99999999	价格 2	#
19	BL1	Character	17	9999999.99999999	比率 1	托管人最低备付收取比例
20	BL2	Character	17	9999999.99999999	比率 2	#
21	SL1	Character	16	±999999999999999	数量 1	统计天数
22	SL2	Character	16	±999999999999999	数量 2	#
23	FZDM	Character	10		辅助代码	最低备付计收业务类别
24	BZ	Character	80		备注	备付金账户名称
25	BY	Character	40		备用	#

## 第二章 上海分公司接收数据文件接口规范

### 一. 数据文件清单

序号	前缀	文件说明	发送周期	标识	备注
1	bgdj	变更初始登记申请文件	ETF 建仓结束 上市之前	基金代码	
2	csdj	初始登记名册	ETF 认购期	基金代码	
3	etftbkyyyymmdd.dbf	ETF 现金替代退补款清算 数据报送文件	每个交易日		本文件由中国结算上海分公司接收基金管理人的报送后按清算编号进行转发
4	ncsdj	新初始登记名册	ETF 认购期	基金代码	本文件由 ETF 发行人产生，向我公司进行申报
5	rgdj	认购股票冻结申请文件	ETF 发行期	基金代码	本文件由 ETF 发行人产生，向我公司进行申报
6	syjz	收益结转文件	每个交易日	基金代码	本文件由基金公司产生，向我公司进行申报
7	ywxz	场内实时申赎货币基金业 务---业务规模限制文件	每个交易日		本文件由基金公司产生，向我公司进行申报

### 二. 文件详细说明

#### 1. bgdj (变更初始登记申请文件)

- 1) 文件名称: bgdj\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 对初始登记的 ETF 份额作相应的转换。
- 3) 文件生成方: ETF 发行人。
- 4) 文件传输方式: PROP 综合业务终端或移动介质。
- 5) 发送周期: ETF 建仓结束上市之前。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQZH	证券帐号	Character	10	
2	ZQDM	证券代码	Character	6	基金代码
3	B GSL	变更数量	Character	11	正值: 基金份额增加; 负值: 基金份额减少
4	BGHSL	变更后数量	Character	11	
5	BGRQ	变更日期	Character	8	YYYYMMDD

#### 2. csdj (初始登记名册)

- 1) 文件名称: csdj\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 网下现金和组合证券认购的 ETF 份额初始登记。
- 3) 文件生成方: ETF 发行人。

- 4) 文件传输方式: 移动介质。  
 5) 发送周期: ETF 认购期。  
 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQZH	证券帐号	Character	10	
2	ZQDM	证券代码	Character	6	基金代码
3	CYSL	持有数量	Character	12	

### 3. etftbkyyyymmdd.dbf (ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)

- 1) 文件名称: etftbkyyyymmdd.dbf (yyyymmdd 为数据报送当日日期)。  
 2) 数据内容: ETF 现金替代退补款清算数据。本文件由中国结算上海分公司接收基金管理人的报送后按清算编号进行转发, 由基金管理人负责确保数据的完整性和准确性并进行数据解释。  
 3) 文件生成方: 基金管理人。  
 4) 发送时间: 每个交易日 8:00-10:30。  
 5) 发送周期: 每个交易日。  
 6) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	20	必填, 左起 16 位有效; 正整数, 同一个报送文件中申报编号不可重复;
2	JJDM	基金代码	Character	8	必填
3	SSDM	申赎代码	Character	8	不填
4	QSBH	清算编号	Character	6	必填
5	ZQZH	证券账号	Character	20	必填
6	XWH	交易单元	Character	6	必填
7	TBKJE	退补款金额	Character	20	必填; ±99999999999999.99; 大于零代表向投资者付款; 小于零代表向投资者收款
8	ZJLX	资金类型	Character	3	必填; 202: ETF 赎回现金替代 203: ETF 申购赎回现金替代退补 999: 其它 (原因详见“BZ”备注字段)
9	JYRQ	交易日期	Character	8	必填
10	JSRQ	交收日期	Character	8	必填
11	CJBH	成交编号	Character	20	选填
12	ZJZH	资金账号	Character	25	选填
13	ZHZQDM	组合证券代码	Character	8	如果是深圳或者北京市场组合证券, 则填写对应的深圳市场或者北京市场证券代码
14	BZ	备注	Character	40	业务类型 (3 位)
15	BY	备用	Character	80	暂不启用

说明: 本文件为全量数据, 当日允许多次报送, 报送结果于十分钟内通过 ret\_etftbkyyyymmdd.dbf 文件反馈, 实际处理将以最后一次报送成功的数据为准, 若最后一次报送为空文件且报送成功, 则当日其他报送数据将清空。超过当日报送时间的报送文件将不予受理。

#### 4. ncsdj (新初始登记名册)

- 1) 文件名称: ncsdj\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)
- 2) 数据内容: 网下现金和组合证券认购的 ETF 份额初始登记名册
- 3) 文件生成方: ETF 发行人
- 4) 文件传输方式: PROP 综合业务终端或移动介质
- 5) 发送时间: PROP 综合业务终端申报时间为每个交易日 8: 00-15: 30
- 6) 发送周期: ETF 认购期内
- 7) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	格式	字段说明
1	TRNGDDM	股东代码	C10	证券账号
2	TRNZQDM	证券代码	C6	基金代码
3	TRNZQLB	证券类型	C2	JJ
4	TRNTGSL	托管数量	N16	基金份额
5	TRNSFZH	身份证号	C20	#
6	TRNLTLX	流通类型	C1	N
7	TRNGPNF	挂牌年份	N5	#
8	TRNQYLB	权益类别	C2	#

- 8) 填写说明:

本文件由基金管理公司通过 PROP 综合业务终端界面 (PROP 综合业务终端-在线业务受理系统-发行人业务-ETF 发行登记申报) 或者移动介质报送, 在 ETF 认购期内发送一次, 全量发送。如发生多次报送, 以发送时点在 L+3 日 13: 30 前的最后一次报送内容为准。

#### 5. rgdj (认购股票冻结申请文件)

- 1) 文件名称: rgdj\*\*\*\*\*.mdd (\*\*\*\*\*为基金代码)。
- 2) 数据内容: 网下认购股票冻结申请。
- 3) 文件生成方: ETF 发行人。
- 4) 文件传输方式: 移动介质。
- 5) 发送时间: 中签当日 2 点前。
- 6) 发送周期: ETF 发行期。
- 7) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	XH	序号	N	9	照实填写, 不可重复, 冻结时按此序号由小到大顺序处理
2	ZQZH	证券帐号	C	10	照实填写
3	ZQDM	证券代码	C	6	证券代码
4	DJSL	冻结数量	N	11	照实填写
5	ZZRQ	终止日期	C	8	照实填写: 何时冻结失效。如果不能确定具体日期, 可以填写大于实际过户的日期, 前提是冻结数量需要全部过户。  若未过户, 该日期的下一交易日被冻结的证券可正常卖出。

## 6. syjz (收益结转文件)

- 1) 文件名称: syjz\*\*\*\*\*.mdd (其中\*\*\*\*\*为基金代码, mdd为T日日期)
- 2) 数据内容: 包含T-1日所有场内实时申赎货币基金及货币ETF持有客户的单日结转收益份额。
- 3) 文件生成方: 基金管理公司
- 4) 发送时间: 每个交易日中午12:00前, 以最后一次发送的为准。
- 5) 发送周期: 每个交易日。
- 6) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

序号	字段名	字段描述	长度	取值
1	ZQZH	证券账户	10	投资者证券账户
2	ZQDM	证券代码	6	货币基金代码
3	JZSL	结转数量	16	当日的收益结转份额增量 (单位: 份), 必须为正整数。右对齐, 目前仅 12 位有效数字位。格式: ±999999999999.99

- 7) 数据说明:
  - (1) 该文件的三个字段均为字符型。
  - (2) 当发生负收益时, 基金公司仍每日生成空文件发送, 直至正收益弥补负收益为止。
  - (3) 中国结算上海分公司在 T 日日终加载处理此数据, 并发送给上交所, 结转的收益份额 T+1 日可赎回。

## 7. ywxz (场内实时申赎货币基金业务---业务规模限制文件)

- 1) 文件名称: ywxz (场内实时申赎货币基金业务---业务规模限制文件)
- 2) 数据内容: 包含T+1日场内实时申赎货币基金申赎规模限制数据
- 3) 文件传输方式: 无特别要求, 业务规模限制可通过PROP客户端界面申报, 也可从PROP客户端下载dbf模板, 以文件导入方式申报。
- 4) 文件生成方: 基金管理公司
- 5) 发送时间: 每个交易日 16: 30 前, 以最后一次发送的为准。
- 6) 发送周期: 每个交易日
- 7) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	YWLX	业务类型	Character	3	“627”：货币基金申购业务——净申购额度限制
2	ZQZH	证券账户	Character	10	用于申购赎回对手方的基金公司证券账户
3	PBU	交易单元	Character	5	基金公司证券账户的指定交易 PBU
4	ZQDM	证券代码	Character	6	货币基金代码
5	XE1	限额 1	Character	19	货币基金净赎回上限 (正数或 0, 单位: 元), 格式: ±99999999999999.99
6	XE2	限额 2	Character	19	货币基金净申购上限 (正数或 0, 单位: 元), 格式: ±99999999999999.99
7	XE3	限额 3	Character	19	货币基金总赎回上限 (正数或 0, 单位: 元), 格式: ±99999999999999.99
8	XE4	限额 4	Character	19	货币基金总申购上限 (正数或 0, 单位: 元), 格式: ±99999999999999.99
9	XE5	限额 5	Character	19	货币基金单账户净赎回上限 (正数或 0, 单位:

					元) , 格式: ±99999999999999.99
10	XE6	限额 6	Character	19	货币基金单账户净申购上限 (正数或 0, 单位:元) , 格式: ±99999999999999.99
11	XE7	限额 7	Character	19	货币基金单账户总赎回上限 (正数或 0, 单位:元) , 格式: ±99999999999999.99
12	XE8	限额 8	Character	19	货币基金单账户总申购上限 (正数或 0, 单位:元) , 格式: ±99999999999999.99
13	YL	预留	Character	50	第 1-8 位为小额账户标准数据, 后 42 位暂不启用。小额账户标准最大值为 99999999, 非负整数, 单位元, 共 8 位右对齐, 左边不足补空格。若无小额账户标准则预留字段不填。

## 8) 数据说明:

- (1) 中国结算上海分公司将此数据审核后转发上交所, 用于下一交易日的申赎规模控制。
- (2) 对于业务类型 ‘627’ , 上交所要求各限额字段最大值为 999999999999.99 (整数部分 13 个 9) , 中国结算上海分公司技术系统不做检查。

## 第三章 PROP 实时数据接口规范

### 一. 实时数据清单

序号	服务域	服务名	服务类型	说明
1	SSCCRC	ETFXT	00	ETF 现金差额和基金净值报送
2	SSCCRC	ETFXT	01	ETF 申购赎回清单报送
3	SSCCRC	JSXT	60	ETF 申赎及其他代收付申报
4	SSCCRC	JSXT	61	ETF 申赎及其他代收付查询
5	SSCCRC	JSXT	62	ETF 申赎及其他代收付勾单查询
6	SSCCRC	JSXT	86	资金代收付指令提交
7	SSCCRC	JSXT	87	资金代收付指令维护
8	SSCCRC	JSXT	88	资金代收付指令查询
9	SSCCRC	DJXT	14	ETF 网下认购证券冻结指令申报
10	SSCCRC	DJXT	15	ETF 网下认购证券冻结指令删除
11	SSCCRC	DJXT	16	ETF 网下认购证券冻结指令查询
12	SSCCRC	CGXT	49	ETF 网下认购证券过户指令申报
13	SSCCRC	CGXT	50	ETF 网下认购证券过户指令删除
14	SSCCRC	CGXT	51	ETF 网下认购证券过户指令查询
15	SSCCRC	RTGS	03	RTGS 交收相关方信息查询
16	SSCCRC	RTGS	10	RTGS 管理人当日交收情况查询
17	SSCCRC	RTGS	11	RTGS 管理人历史交收情况查询

### 二. 接口详细说明

在 PROP 实时交易中,为了方便 PROP 用户的操作,在许多业务模块中提供了数据导入功能,使用户一次可以提交多笔业务。在 PROP 公用模块的通用交易中,用户也可以直接提交一个符合规定格式的数据文件作为申报数据提交。此外,为了方便参与人技术系统与 PROP 系统的自动对接,我公司对某些业务提供了通用接口功能。本章的 PROP 实时交易数据接口规范就是针对上述各类应用中使用到的各类 PROP 实时申报的数据格式进行详细的说明。

读者在下文中将经常看到“ServiceDomain”、“ServiceName”和“ServiceType”这些术语,分别表示“服务域”、“服务名”和“服务类型”,是 PROP 系统的专用术语。用户仅在使用通用接口进行二次开发时才需要了解这三个术语的含义,在相关的通用接口技术文档中也有具体的说明,因此在本文档中不再赘述。

#### 1. ETF 现金差额和基金净值报送

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “ETFXT”

ServiceType = “00”

服务时间: 9:00-15:00

请求文件:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	例: 510050
2	JYRQ	交易日期	Character	8	YYYYMMDD, 现金差额对应的申赎日期

3	JJZJZ	基金总净值	Character	17	保留 2 位小数。 99999999999999. 99
4	JJZFE	基金总份额	Character	17	9999999999999999
5	JZDWJJZ	基准单位基金净值	Character	17	每百万份基金净值，保留 2 位小数。 99999999999999. 99
6	DWJJZ	单位基金净值	Character	17	每份基金对应的净值，即基金单位净值，保留 3 位小数 9999999999999. 999
7	XJCE	现金差额	Character	11	格式：99999999. 99 或-9999999. 99； 最小申购赎回单位对应的申购赎回的差额，保留 2 位小数。
8	FHDM	返回代码	Character	4	空
9	CLSM	处理说明	Character	40	空
	合计			137	

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	同请求
2	JYRQ	交易日期	Character	8	同请求
3	JJZJZ	基金总净值	Character	17	同请求
4	JJZFE	基金总份额	Character	17	同请求
5	JZDWJJZ	基准单位基金净值	Character	17	同请求
6	DWJJZ	单位基金净值	Character	17	
7	XJCE	现金差额	Character	11	同请求
8	FHDM	返回代码	Character	4	0000: 已受理 其它: 受理失败
9	CLSM	处理说明	Character	40	对返回结果的具体说明
	合计			137	

说明：

(1) 结算系统接收基金管理公司申报的现金差额和净值数据后，当日日终进行现金差额清算。具体申报日期由基金管理公司确定，一般情况，基金管理公司在申赎下一交易日申报现金差额和净值。

(2) 同一批可以申报多个基金代码或多个交易日数据，以“基金代码+交易日期”为关键字，同一批数据关键字不可重复。

(3) 当日可多次报送，相同“基金代码+交易日期”的报送数据以最新一次申报为准。

## 2. ETF 申购赎回清单报送

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “ETFXFT”

ServiceType = “01”

服务时间： 9:00-15:00

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	例：510050
2	JYRQ	交易日期	Character	8	YYYYMMDD， 申赎清单适用的交易日期

3	GPDM	股票代码	Character	6	
4	GPJC	股票简称	Character	8	
5	GPSL	股票数量	Character	12	每个申购篮子中该成分股的数量，数据右对齐，左补空，系统不检查是否为整百股
6	TDBZ	替代标志	Character	1	表示该股票是否允许用现金进行替代。0 表示禁止现金替代（必须有股票），1 表示可以进行现金替代（先用股票，股票不足的话用现金替代），2 表示必须用现金替代
7	YJBL	溢价比例	Character	7	股票用现金进行替代的时候，计算价格时增加的比例（不含 100%）。总长为 7 位（包括小数点），小数点后 5 位，数据右对齐，左补空，此字段只有当替代标志为‘1’时才用到
8	ZJE	总金额	Character	17	当某只股票必须用现金替代的时候，该股票所需总金额。总长为 17 位（包括小数点），小数点后 3 位，数据右对齐，左补空。此字段只有当替代标志为‘2’时才用到
	合计			65	

说明 (1) 当日可进行多次报送，对于同一“基金代码+交易日期”数据，以最后一次报送为准。

4) 应答文件：无。

### 3. ETF 申赎及其他代收付申报

具体格式见《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》的第三章中“交收系统”的相关描述。

### 4. ETF 申赎及其他代收付查询

具体格式见《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》的第三章中“交收系统”的相关描述。

### 5. ETF 申赎及其他代收付勾单查询

具体格式见《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》的第三章中“交收系统”的相关描述。

### 6. 资金代收付指令提交

具体格式见《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》的第三章中“交收系统”的相关描述。

## 7. 资金代收付指令维护

具体格式见《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》的第三章中“交收系统”的相关描述。

## 8. 资金代收付指令查询

具体格式见《登记结算数据接口规范(结算参与人版)》的第三章中“交收系统”的相关描述。

## 9. ETF 网下认购证券冻结指令申报

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “DJXT”

ServiceType = “14”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	16	必填，格式为“9999999999999999”，右对齐、不足前补空，同批次的申报编号不能重复
2	SQDW	申请单位	Character	20	必填
3	ZQZH	证券账户	Character	10	必填
4	TGDM	托管代码	Character	6	必填
5	DJSL	冻结数量	Character	15	必填，大于0的整数，格式为“9999999999999999”，右对齐、不足前补空
6	JJDM	基金代码	Character	6	必填
7	ZDJDRQ	自动解冻日期	Character	8	必填，格式为 YYYYMMDD
	合计			81	

说明：

- (1) 可以多次增量方式提交，每批次最多申报 10000 条。
- (2) 在同一基金代码多次申报中，申报编号必须唯一。
- (3) 同批次基金代码必须唯一，为 ETF 的上市证券代码。
  - a) 托管代码：用于网下申报认购 ETF 的证券代码，其份额为二级市场交易的债券、基金、股票全流通份额，不含配股、配债、行权、ETF 申购赎回、回购等代码。
  - b) 冻结数量：整数，必须大于零。

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	16	同申报
2	SLBH	受理编号	Character	16	受理编号
3	SLRQ	受理日期	Character	8	受理日期
4	ZQZH	证券账户	Character	10	同申报

5	TGDM	托管代码	Character	6	同申报
6	DJSL	冻结数量	Character	15	同申报
7	JJDM	基金代码	Character	6	同申报
8	ZDJDRQ	自动解冻日期	Character	8	同申报
	合计			85	

说明：

(1) 同一批申请证券冻结指令中，如果有一条数据校验不通过，则整批次申报指令失败。

## 10. ETF 网下认购证券冻结指令删除

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “DJXT”

ServiceType = “15”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	必填，基金代码
2	SLBH	受理编号	Character	16	必填，

说明：

(1) 受理编号填写申报时返回的受理编号

(2) 可多次申报，每批次最多申报 1500 笔

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SLBH	受理编号	Character	16	同请求
2	SLRQ	受理日期	Character	8	同请求
3	SBBH	申报编号	Character	16	同申报
4	ZQZH	证券账户	Character	10	同申报
5	TGDM	托管代码	Character	6	同申报
6	DJSL	冻结数量	Character	15	同申报
7	JJDM	基金代码	Character	6	同申报
8	ZDJDRQ	自动解冻日期	Character	8	同申报
9	JGDM	结果代码	Character	4	
10	JGSM	结果说明	Character	40	
	合计			129	

说明：

(1) 结果代码“0000”为成功，其余为失败，结果说明是对结果代码的说明。

## 11. ETF 网下认购证券冻结指令查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “DJXT”

ServiceType = “16”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	必填，基金代码

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	16	同申报
2	SLBH	受理编号	Character	16	同申报
3	SLRQ	受理日期	Character	8	同申报
4	ZQZH	证券账户	Character	10	同申报
5	TGDM	托管代码	Character	6	同申报
6	DJSL	冻结数量	Character	15	同申报
7	JJDM	基金代码	Character	6	同申报
8	ZDJDRQ	自动解冻日期	Character	8	同申报
	合计			85	

说明：

- (1) 查询请求返回该基金代码下当日所有成功受理且未被删除的冻结申报指令

## 12. ETF 网下认购证券过户指令申报

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “CGXT”

ServiceType = “49”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	16	必填，格式为“9999999999999999”，右对齐、不足前补空，同批次的申报编号不能重复
2	SQSH	冻结申请书号	Character	9	必填，冻结申报业务回报中返回的冻结申请书号（即冻结申报业务回报中返回的YWBH 字段）
3	GRZH	过户账户	Character	10	必填，基金管理公司需过户的账户
4	TGDM	托管代码	Character	6	必填
5	SQGHSL	申请过户数量	Character	15	必填，大于 0 的整数，格式为“99999999999999”，右对齐、不足前补空
6	JJDM	基金代码	Character	6	必填
	合计			62	

说明：

- (1) 可以多次增量方式提交，每批次最多申报 10000 条。  
 (2) 在同一基金代码多次申报中，申报编号必须唯一。  
 (3) 同批次基金代码必须唯一，为 ETF 的上市证券代码。  
 (4) 托管代码：用于网下申报认购 ETF 的证券代码，其份额为二级市场交易的债券、基金、股票全流通份额，不含配股、配债、行权、ETF 申购赎回、回购等代码。  
 (5) 申请过户数量：整数，必须大于零。  
 (6) 在一次申报中，冻结申请书号必须唯一，且不能与当日其他批次申报中冻结申请书号重复。

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	16	同申报
2	SLBH	受理编号	Character	16	受理编号

3	SLRQ	受理日期	Character	8	受理日期
4	SQSH	冻结申请书号	Character	9	同申报
5	GRZH	过户账户	Character	10	同申报
6	TGDM	托管代码	Character	6	同申报
7	SQGHSL	申请过户数量	Character	15	同申报
8	JJDM	基金代码	Character	6	同申报
	合计			86	

说明：

- (1) 同一批申请证券过户指令中，如果有一条数据校验不通过，则整批次申报指令失败。

### 13. ETF 网下认购证券过户指令删除

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “CGXT”

ServiceType = “50”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	必填，基金代码
2	SLBH	受理编号	Character	16	必填，

说明：

- (1) 受理编号填写申报时返回的受理编号。  
(2) 可多次申报，每批次最多申报 1500 笔。

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SLBH	受理编号	Character	16	同请求
2	SLRQ	受理日期	Character	8	同请求
3	SBBH	申报编号	Character	16	同申报
4	SQSH	冻结申请书号	Character	9	同申报
5	GRZH	过户账户	Character	10	同申报
6	TGDM	托管代码	Character	6	同申报
7	SQGHSL	申请过户数量	Character	15	同申报
8	JJDM	基金代码	Character	6	同申报
9	JGDM	结果代码	Character	4	
10	JGSM	结果说明	Character	40	
	合计			120	

说明：

- (1) 结果代码“0000”为成功，其余为失败，结果说明是对结果代码的说明。

### 14. ETF 网下认购证券过户指令查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “CGXT”

ServiceType = “51”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JJDM	基金代码	Character	6	必填，基金代码

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SBBH	申报编号	Character	16	同申报
2	SLBH	受理编号	Character	16	同申报
3	SLRQ	受理日期	Character	8	同申报
4	SQSH	冻结申请书号	Character	9	同申报
5	GRZH	过户账户	Character	10	同申报
6	TGDM	托管代码	Character	6	同申报
7	SQGHSL	申请过户数量	Character	15	同申报
8	JJDM	基金代码	Character	6	同申报
	合计			86	

说明：

(1) 查询请求返回该基金代码下当日所有成功受理且未被删除的过户申报指令。

## 15. RTGS 交收相关方信息查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “RTGS”

ServiceTYPE = “03”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	SBBH	申报编号	Character	20	必填，左起 16 位有效； 正整数，同一批次请求中申报编号不可重复； 系统将按申报编号从小到大依次处理
2	JSBH	交收编号	Character	20	必填，左起 16 位有效
3	BY1	备用 1	Character	20	#
	合计			60	

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	SBBH	申报编号	Character	20	同请求
2	JSBH	交收编号	Character	20	同请求
3	ZJZH	资金账号	Character	25	#
4	ZHMC	资金账号名称	Character	120	交收相关方资金账号名称
5	GDZT	勾单状态	Character	2	交收相关方勾单状态
6	BY1	备用 1	Character	20	#
7	BY2	备用 2	Character	40	#
8	JGDM	结果代码	Character	4	0000: 成功； 6267: 无相应查询结果； 其他为失败；
9	JGSM	结果说明	Character	40	结果代码对应的结果说明
	合计			291	

说明：本接口支持批量查询，建议查询时间间隔 1 分钟以上。

## 16. RTGS 管理人当日交收情况查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “RTGS”

ServiceTYPE = “10”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	SBBH	申报编号	Character	20	#
2	JSBH	交收编号	Character	20	左起 16 位有效, 不填表示全部
3	JSZT	交收状态	Character	2	不填表示全部; 01: 未交收; 02: 交收中; 03: 交收结束
4	GDZT	本方勾单状态	Character	2	不填表示全部; 00: 未勾单; 01: 已勾单; 02: 无需勾单
5	ZJZH	资金账号	Character	25	不填表示全部
6	ZQZH	证券账户	Character	20	左起 10 位有效, 不填表示全部
7	QSBH	清算编号	Character	6	左起 5 位有效, 不填表示全部
8	CJBH	成交编号	Character	20	若为上海交易所相关业务, 则填写交易所成交序列号, 左起 16 位有效; 若为互联互通业务, 则填写上清所源交易 ID, 表示外汇交易中心成交编号, 左起 20 位有效; 不填表示全部
9	YWLX	业务类型	Character	3	不填表示全部
10	ZQDM	证券代码	Character	20	若为上海交易所相关业务, 则左起 6 位有效; 若为互联互通业务, 则左起 20 位有效; 不填表示全部
11	SJJLH	数据记录号	Character	20	选填, 左起 16 位有效; 填写方式见说明
12	BY1	备用 1	Character	20	#
13	BY2	备用 2	Character	40	查询标志; 选填, 左起 36 位有效; 填写方式见说明
	合计			206	

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	主记录	从记录
1	SBBH	申报编号	Character	20	#	#
2	ZCBZ	主从标志	Character	1	0: 主记录	1: 从记录
3	JSBH	交收编号	Character	20	必填, 同请求	必填, 同请求
4	JSZT	交收状态	Character	2	必填, 同请求	#
5	GDZT	本方勾单状态	Character	2	必填, 同请求	#
6	ZJZH	资金账号	Character	25	必填, 同请求	必填, 同请求
7	QSBH1	清算编号 1	Character	6	#	交易单元 1 对应的清算编号, 同请求
8	ZQZH	证券账户	Character	20	必填, 同请求	必填, 同请求
9	ZQDM1	证券代码 1	Character	20	#	交易代码
10	CJBH	成交编号	Character	20	#	必填, 同请求

11	YWLX	业务类型	Character	3	#	必填, 同请求
12	SQBH	申请编号	Character	20	#	参考各业务填写说明
13	WTBH	委托编号	Character	20	#	参考各业务填写说明
14	JYRQ	交易日期	Character	8	#	T 日
15	QSRQ	清算日期	Character	8	#	T 日
16	JSRQ	交收日期	Character	8	#	T 日
17	QTRQ	其它日期	Character	8	#	
18	GDSJ	勾单时间	Character	6	本方勾单状态为 01 时填写本方勾单时间; 其他填空	#
19	JSSJ	交收完成时间	Character	6	当交收状态为 03 时填写交收完成时间; 其他填空	#
20	XWH1	交易单元 1	Character	6	#	交易单元, 左起 5 位有效, 右补空格
21	XWH2	交易单元 2	Character	6	#	结算单元, 左起 5 位有效, 右补空格
22	QSBH2	清算编号 2	Character	6	#	交易单元 2 对应的清算编号
23	CYRMC	参与人名称	Character	120	#	结算参与人名称
24	ZQZHMC	证券账户名称	Character	120	#	证券账户名称
25	ZQDM2	证券代码 2	Character	20	#	证券代码 2
26	ZQLB	证券类别	Character	2	#	证券类别
27	LTLX	流通类型	Character	1	#	流通类型
28	QYLB	权益类别	Character	2	#	权益类别
29	GPNF	挂牌年份	Character	4	#	挂牌年份
30	MMBZ	买卖标志	Character	1	#	买卖标志
31	SL	交收数量	Character	20	#	±99999999999999999999
32	CJSL	成交数量	Character	20	#	±99999999999999999999
33	BZ	币种	Character	3	#	CNY
34	JG1	价格 1	Character	20	#	±999999999. 99999999
35	JG2	价格 2	Character	20	#	±999999999. 99999999
36	QSJE	清算金额	Character	20	#	±9999999999999999. 99
37	YHS	印花税	Character	20	#	±9999999999999999. 99
38	JSF	经手费	Character	20	#	±9999999999999999. 99
39	GHF	过户费	Character	20	#	±9999999999999999. 99
40	ZGF	证管费	Character	20	#	±9999999999999999. 99
41	SXF	手续费	Character	20	#	±9999999999999999. 99
42	SJSF	实际收付	Character	20	该笔交收涉及的所有成交明细的轧差金额	±9999999999999999. 99
43	QTJE1	其它金额 1	Character	20	#	±9999999999999999. 99
44	QTJE2	其它金额 2	Character	20	#	±9999999999999999. 99
45	SJJLH	数据记录号	Character	20	数据记录号	数据记录号
46	BY1	备用 1	Character	40	#	#
47	BY2	备用 2	Character	80	查询标志	查询标志
48	JGDM	结果代码	Character	4	清算失败或经过交收处理后生成结果代码; 0000: 成功; 其他为失败 (6267: 无相	#

					应查询结果)；	
49	JGSM	结果说明	Character	40	结果代码对应的结果说明	#
	合计			934		

说明：

- (1) 本接口不支持批量查询，建议查询时间间隔 1 分钟以上。
- (2) 返回结果做主从记录区分，一条主记录可能对应一条或多条从记录。
- (3) 查询标志：一次查询请求提交后生成唯一查询标志，所有符合本次查询条件的应答记录查询标志号码。
- (4) 一次查询结果可分批返回，每批最多返回 500 条主记录；

若查询结果不超过 500 条，则应答文件中“数据记录号”返回“9999999999999999”(16 个 9)，表示无后续数据；

若查询结果超过 500 条，则应答文件中“数据记录号”非“9999999999999999”，表示仍有后续数据，需分批查询；请求文件“数据记录号”填写上批应答数据中最大数据记录号，“备用 2”填写本次查询标志，则新应答将返回该最大“数据记录号”的后续记录。

(5) 分批获取查询结果时，请求文件中“数据记录号”、“备用 2”必填，其他字段无意义。

各业务填写说明参考《登记结算数据接口规范（结算参与人版）》中“RTGS 参与人当日交收情况查询”。

## 17. RTGS 管理人历史交收情况查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “RTGS”

ServiceTYPE = “11”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	SBBH	申报编号	Character	20	#
2	JSBH	交收编号	Character	20	左起 16 位有效，不填表示全部
3	JSZT	交收状态	Character	2	必填；03：交收结束
4	GDZT	本方勾单状态	Character	2	不填表示全部；00：未勾单； 01：已勾单； 02：无需勾单
5	ZJZH	资金账号	Character	25	必填，左起 18 位有效
6	ZQZH	证券账户	Character	20	左起 10 位有效，不填表示全部
7	QSBH	清算编号	Character	6	左起 5 位有效，不填表示全部
8	CJBH	成交编号	Character	20	不填表示全部
9	YWLX	业务类型	Character	3	不填表示全部
10	ZQDM	证券代码	Character	20	不填表示全部
11	JYRQ1	起始交易日	Character	8	选填，按自然日计算
12	JYRQ2	截止交易日	Character	8	选填，按自然日计算
13	JSRQ1	起始交收日	Character	8	必填，按自然日计算
14	JSRQ2	截止交收日	Character	8	必填，按自然日计算
15	JGDM	结果代码	Character	4	选填，交收结果代码； 0000：表示查询交收成功记录； 6220：表示查询所有交收失败的记录

16	SJJLH	数据记录号	Character	20	选填; 左起 16 位有效; 填写方式详见说明
17	BY1	备用 1	Character	20	#
18	BY2	备用 2	Character	40	#
	合计			242	

应答文件:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	SBBH	申报编号	Character	20	#
2	JSBH	交收编号	Character	20	必填, 同请求
3	JSZT	交收状态	Character	2	必填, 同请求
4	GDZT	本方勾单状态	Character	2	必填, 同请求
5	ZJZH	资金账号	Character	25	同请求
6	QSBH1	清算编号 1	Character	6	交易单元 1 对应清算编号, 必填, 同请求
7	ZQZH	证券账户	Character	20	必填, 同请求
8	ZQDM1	证券代码 1	Character	20	交易代码
9	CJBH	成交编号	Character	20	必填, 同请求
10	YWLX	业务类型	Character	3	必填, 同请求
11	SQBH	申请编号	Character	20	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
12	WTBH	委托编号	Character	20	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
13	JYRQ	交易日期	Character	8	T 日
14	QSRQ	清算日期	Character	8	T 日
15	JSRQ	交收日期	Character	8	T 日
16	QTRQ	其它日期	Character	8	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
17	GDSJ	勾单时间	Character	6	本方勾单状态为 01 时填写本方勾单时间; 其他填空
18	JSSJ	交收完成时间	Character	6	当交收状态为 03 时填写交收完成时间; 其他填空
19	XWH1	交易单元 1	Character	6	交易单元, 左起 5 位有效, 右补空格
20	XWH2	交易单元 2	Character	6	结算单元, 左起 5 位有效, 右补空格
21	QSBH2	清算编号 2	Character	6	交易单元 2 对应的清算编号
22	CYRMC	参与人名称	Character	120	结算参与人名称
23	ZQZHMC	证券账户名称	Character	120	证券账户名称
24	ZQDM2	证券代码 2	Character	20	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
25	ZQLB	证券类别	Character	2	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
26	LTLX	流通类型	Character	1	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
27	QYLB	权益类别	Character	2	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
28	GPNF	挂牌年份	Character	4	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
29	MMBZ	买卖标志	Character	1	参考 RTGS 当日交收情况查询各业务填写说明
30	SL	交收数量	Character	20	±999999999999999999
31	CJSL	成交数量	Character	20	±999999999999999999
32	BZ	币种	Character	3	CNY
33	JG1	价格 1	Character	20	±999999999. 99999999
34	JG2	价格 2	Character	20	±999999999. 99999999
35	QSJE	清算金额	Character	20	±999999999999999. 99
36	YHS	印花税	Character	20	±999999999999999. 99
37	JSF	经手费	Character	20	±999999999999999. 99
38	GHF	过户费	Character	20	±999999999999999. 99
39	ZGF	证管费	Character	20	±999999999999999. 99
40	SXF	手续费	Character	20	±999999999999999. 99

41	SJSF	实际收付	Character	20	±9999999999999999.99
42	QTJE1	其它金额 1	Character	20	±9999999999999999.99
43	QTJE2	其它金额 2	Character	20	±9999999999999999.99
44	SJJLH	数据记录号	Character	20	
45	BY1	备用 1	Character	40	#
46	BY2	备用 2	Character	80	#
47	JGDM	结果代码	Character	4	0000: 成功; 6267: 无相应查询结果; 其他为失败;
48	JGSM	结果说明	Character	40	结果代码对应的结果说明
	合计			933	

说明：

- (1) 本接口不支持批量查询，建议查询时间间隔 1 分钟以上。
- (2) 查询请求截止交易日、截止交收日应早于且不包含查询当日；查询支持获取自查询当日（不含查询当日）向前不超过一年的历史数据，每次查询起止交收日时间范围不超过 90 个自然日。
- (3) 一次查询结果可分批返回，每批最多返回 500 条记录；

若查询结果不超过 500 条，则应答文件中“数据记录号”返回“9999999999999999”（16 个 9），表示无后续数据；

若查询结果超过 500 条，则应答文件中“数据记录号”非“9999999999999999”，表示仍有后续数据，需分批查询；请求文件“数据记录号”填写上批应答数据中最大数据记录号，则新应答将返回该最大“数据记录号”的后续记录。

各业务填写参考《登记结算数据接口规范（结算参与人版）》中“RTGS 参与人历史交收情况查询”。