

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 | 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”。 以上接口调整自 2026 年 2 月 2 日生效。 |
| 2025/12/26 | 1.21 | 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)； 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。 以上接口调整自 2025 年 12 月 29 日生效。 |
| 2024/6/13 | 1.20 | 1. 配合北交所证券纳入跨市场 ETF，调整 etftbkyyymdd.dbf(ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)的填写说明。 以上接口调整自 2024 年 6 月 17 日生效。 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)” |
| 2022/6/8 | 1.19 | 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。 2. 配合 ETF 多码合一业务开展，etftbkyyymdd.dbf(ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)调整填写说明。 以上接口调整自 2022 年 6 月 20 日生效。 |
| 2022/5/13 | 1.18 | 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。 以上接口调整自 2022 年 5 月 23 日生效。 |
| 2021/5/19 | 1.17 | 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。 以上接口调整自 2021 年 5 月 24 日生效。 |
| 2020/12/22 | 1.16 | 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)。 以上接口调整自 2020 年 12 月 28 日生效。 |
| 2020/12/16 | 1.15 | 配合新增 ETF 现金替代退补款清算数据转发服务，新增 etftbkyyymdd.dbf(ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)文件和 ret_etftbkyyymdd.dbf(ETF 现金替代退补款清算数据应答文件)文件。 以上接口调整自 2020 年 12 月 21 日生效。 |
| 2020/12/4 | 1.14 | 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 ncsdj(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。 以上接口调整自 2020 年 12 月 14 日生效。 |
| 2020/9/11 | 1.13 | 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’。 |
| 2020/5/13 | 1.12 | 为进一步改善对外数据服务，根据市场参与者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。 以上接口调整自 2020 年 5 月 18 日生效。 |
| 2020/1/14 | 1.11 | 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 |

| | | |
|------------|-------|--|
| | | 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. djcg (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_etftbkyyymdd.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. etftbkyyymdd.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“一元”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_etftbkyyyyymmdd.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. djgg（股票认购冻结结果）

- 1) 文件名称：djgg*****.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 | TZPMC | 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 | TZPMC2 | 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 | 证件类型 | 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型; 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型。 |
| 6 | ZJLB2 | 证件类型 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型。 |
| 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 | 证件类型 | Character | 2 | 出质人证件类型 |
| 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_etftbkyyyyymmdd.dbf (ETF 现金替代退补款清算数据应答文件)

- 1) 文件名称: ret_etftbkyyyyymmdd.dbf (yyyyymmdd 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 etftbkyyyyymmdd.dbf 文件, 均会生成相应应答文件 ret_etftbkyyyyymmdd.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 | LT LX | 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 | ±9999999999999999.99 | 金额 1 |
| 28 | JE2 | Character | 19 | ±9999999999999999.99 | 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 |
| LT LX | 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 | LT LX | 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 | ±9999999999999999.99 | 金额 1 | # |
| 15 | JE2 | Character | 19 | ±9999999999999999.99 | 金额 2 | 上月买入金额 |
| 16 | JE3 | Character | 19 | ±9999999999999999.99 | 金额 3 | # |
| 17 | JG1 | Character | 17 | 9999999.999999999 | 价格 1 | # |
| 18 | JG2 | Character | 17 | 9999999.999999999 | 价格 2 | # |
| 19 | BL1 | Character | 17 | 9999999.999999999 | 比率 1 | 托管人最低备付收取比例 |
| 20 | BL2 | Character | 17 | 9999999.999999999 | 比率 2 | # |
| 21 | SL1 | Character | 16 | ±9999999999999999 | 数量 1 | 统计天数 |
| 22 | SL2 | Character | 16 | ±9999999999999999 | 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 | etftbkyyyyymmdd.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 | BGSL | 变更数量 | Character | 11 | 正值: 基金份额增加; 负值: 基金份额减少 |
| 4 | BGSL | 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. etftbkyyyyymmdd.dbf (ETF 现金替代退补款清算数据报送文件)

- 1) 文件名称：etftbkyyyyymmdd.dbf (yyyyymmdd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； ±9999999999999999.99； 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_etftbkyyyyymmdd.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 | TRNLT LX | 流通类型 | C1 | N |
| 7 | TRNGPNF | 挂牌年份 | N5 | # |
| 8 | TRNQVLB | 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：±9999999999999999 |

- 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: 每个交易日下午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：±999999999999999.99 |
| 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：±999999999999999.99 |
| 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：±999999999999999.99 |
| 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：±999999999999999.99 |
| 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：±999999999999999.99 |

| | | | | | |
|----|-----|------|-----------|----|--|
| | | | | | 元)，格式：±9999999999999999.99 |
| 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：±9999999999999999.99 |
| 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：±9999999999999999.99 |
| 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：±9999999999999999.99 |
| 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 | JZDWJJJZ | 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 | DWJJJZ | 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 | JZDWJJJZ | 基准单位基金净值 | Character | 17 | 同请求 |
| 6 | DWJJJZ | 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 = “ETFXT”

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“999999999999999”，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 | 过入账户 | Character | 10 | 必填，基金管理公司需过入的账户 |
| 4 | TGDM | 托管代码 | Character | 6 | 必填 |
| 5 | SQGHS� | 申请过户数量 | Character | 15 | 必填，大于 0 的整数，格式为“999999999999999”，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 | 过入账户 | 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 | 过入账户 | 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 | 过入账户 | 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 | 若为上海证券交易所相关业务，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 | 若为上海证券交易所相关业务，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 | # | ±999999999999999999 |
| 32 | CJSL | 成交数量 | Character | 20 | # | ±999999999999999999 |
| 33 | BZ | 币种 | Character | 3 | # | CNY |
| 34 | JG1 | 价格 1 | Character | 20 | # | ±999999999.999999999 |
| 35 | JG2 | 价格 2 | Character | 20 | # | ±999999999.999999999 |
| 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 | SJLH | 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 | ±999999999.999999999 |
| 34 | JG2 | 价格 2 | Character | 20 | ±999999999.999999999 |
| 35 | QSJE | 清算金额 | Character | 20 | ±999999999999999999.99 |
| 36 | YHS | 印花税 | Character | 20 | ±999999999999999999.99 |
| 37 | JSF | 经手费 | Character | 20 | ±999999999999999999.99 |
| 38 | GHF | 过户费 | Character | 20 | ±999999999999999999.99 |
| 39 | ZGF | 证管费 | Character | 20 | ±999999999999999999.99 |
| 40 | SXF | 手续费 | Character | 20 | ±999999999999999999.99 |

| | | | | | |
|----|-------|--------|-----------|-----|---------------------------------------|
| 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 | SJLH | 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”。