



工程技术标准

深圳证券交易所创业板改革并  
试点注册制  
市场参与者技术系统变更指南  
(Ver1.02)



深圳证券交易所

二〇二〇年五月

## 文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2020-04-23	Ver1.00	正式稿
2020-05-07	Ver1.01	1、增加对“有效竞价范围”的说明; 2、盘后定价交易业务增加“交易参考信息”及行情快照发布机制的说明。
2020-05-28	Ver1.02	(本文档中橙色修订部分) 1、增加部分基金产品涨跌幅限制调整为20%的说明; 2、增加创业板存托凭证的说明; 3、增加《深市登记结算XML实时报文接口规范》部分业务支持“07”股份性质的说明。

## 目 录

一、说明.....	1
二、创业板改革并试点注册制业务简介.....	1
2.1 创业板股票新增特殊标识.....	1
2.2 创业板股票投资者适当性管理.....	1
2.3 创业板股票交易机制优化.....	1
2.4 新增盘后定价交易业务.....	1
2.5 转融通证券出借业务优化.....	2
2.6 创业板股东大会网络投票代码区间调整.....	2
三、技术系统变更概况.....	2
四、新增特殊标识.....	3
五、创业板存托凭证.....	4
5.1 投资者适当性.....	4
5.2 交易机制.....	5
六、交易机制优化.....	5
6.1 证券状态发布.....	5
6.2 委托数量上限及数量单位发布.....	5
6.3 涨跌幅限制及有效竞价范围发布.....	6
七、盘后定价交易业务.....	6
7.1 交易参考信息.....	7
7.2 委托及成交回报.....	7
7.3 行情发布.....	7
7.4 成交汇总.....	8
八、转融通证券出借业务优化.....	9
8.1 市场化转融通标识.....	9
8.2 申报数量上下限.....	9
8.3 约定申报实时撮合成交.....	9
8.4 首发后可出借限售股出借.....	10
8.5 禁止可售冻结证券出借.....	13
8.6 转融通出借业务开关.....	13
九、清算和交收.....	13
9.1 盘后定价交易结算数据接口变更.....	13
9.1.1 清算明细库 SJSMX1.DBF.....	14
9.1.2 资金清算汇总库 SJSQS.DBF 、 T+0 资金清算汇总库 SJSQS0.DBF.....	16
9.1.3 资金变动库 SJSZJ.DBF.....	16
9.1.4 资金余额信息库 SJSYE.DBF.....	16
9.1.5 证券交易统计库 SJSTJ.DBF.....	16
9.2 转融通证券出借及转融券优化结算数据接口变更.....	16
9.2.1 接口修订概述.....	16
9.2.1.1 现状描述.....	16
9.2.1.2 变动内容.....	16

---

9.2.2 明细结果库 SJSJG.DBF.....	17
9.2.3 其他接口.....	20
9.3 账户系统数据变更.....	20
9.4 创业板存托凭证.....	20
<b>十、 市场参与者系统注意事项.....</b>	<b>20</b>
10.1 关于客户委托服务渠道.....	20
10.2 关于市场参与者柜台系统.....	20
10.3 关于接口兼容性要求.....	21
<b>十一、 相关事宜.....</b>	<b>21</b>
11.1 参考文档.....	21
11.2 联系方式.....	21

# 深圳证券交易所创业板改革并试点注册制市场参与者 技术系统变更指南

## 一、说明

本文档旨在阐述创业板改革并试点注册制的技术方案，供市场参与者及其IT提供商进行相关技术系统改造时使用。如果业务规则及方案有所变更，本文档将做相应修订。

深交所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，尽量降低系统改造对市场参与者的影响。

## 二、创业板改革并试点注册制业务简介

本文档仅适用于创业板存量股票、新发行上市创业板股票和存托凭证，若无特别说明，以下创业板股票是指创业板存量及新发行上市股票。

### 2.1 创业板股票新增特殊标识

对注册制下发行上市的创业板股票和存托凭证进行标识。

对创业板股票和存托凭证上市时尚未盈利、具有表决权差异安排或协议控制架构的发行人的股票或存托凭证作出相应标识，当发行人首次实现盈利、上市后不再具有表决权差异安排或者协议控制架构时，对应的特殊标识取消。

### 2.2 创业板股票投资者适当性管理

市场参与者应对参与创业板股票、存托凭证申购、交易的投资者权限进行控制。

新申请开通创业板交易权限的投资者（新增投资者）交易已上市及新上市创业板股票的，均需符合新规相关适当性管理条件；其中新增的普通投资者在参与创业板交易前，应当签署风险揭示书。

存量专业投资者和重新签署风险揭示书的存量普通投资者才能参与注册制下创业板股票、存托凭证的申购、交易

### 2.3 创业板股票交易机制优化

本次创业板改革并试点注册制方案中，对创业板股票和存托凭证涨跌幅限制、有效竞价范围、盘中自动临时停牌、单笔申报数量限制等方面做了调整。

### 2.4 新增盘后定价交易业务

盘后定价交易，是指在当日收盘集合竞价结束后，按照时间优先原则，以当日收盘价对盘后定价买卖订单进行逐笔连续撮合的交易方式。

深交所每个交易日 15:05 之后每 15 秒钟向市场发布一轮盘后定价交易的行情快照，以揭示盘后定价交易业务的实时行情，发布内容包括：证券代码、证券代码源、昨收价、当日收盘价、当日累计盘后定价交易成交笔数、当日累计盘后定价交易成交数量、当日累计盘后定价交易成交金额、实时收盘定价买入或/和收盘定价卖出的累计未成交申报数量、交易阶段代码。

信用账户可开展盘后定价交易业务。使用信用账户申报盘后定价交易买入委托时，只能以普通交易方式买入融资融券可冲抵保证金证券，不能以融资融券开仓、平仓方式买入；使用信用账户申报盘后定价交易卖出委托时，只能以普通交易方式卖出证券，不能以融资融券开仓、平仓方式卖出。

具体业务流程参见《深圳证券交易所盘后定价交易业务之券商技术系统变更指南》第二节业务流程。

## 2.5 转融通证券出借业务优化

为了向市场提供更灵活、高效的交易机制，提高约定申报的市场化水平，对于部分证券实施市场化转融通，市场化转融通主要包括如下几点：

- 1、拟优化现有转融通证券出借约定申报方式，放宽出借期限、费率等限制，放宽交易申报数量要求，对出借和借入申报实时撮合成交，并对证券公司和出借人账户的可交易余额进行实时调整；
- 2、拟优化现有转融券约定申报方式，深交所交易系统根据证券公司发送的成交数据，对证券公司和证券公司账户的可交易余额进行实时调整；
- 3、放宽现有非约定申报交易申报数量的要求；
- 4、禁止可售冻结证券出借。

除市场化转融通优化之外，还增加如下两点业务变更：

- 1、允许首发后可出借限售股做约定申报及非约定申报出借；
- 2、增加转融通出借业务开关。

## 2.6 创业板股东大会网络投票代码区间调整

创业板股东大会网络投票的投票代码为“35+证券代码的后四位”。

### 三、 技术系统变更概况

本次技术系统变更适用于创业板存量及新发行上市股票。

本次技术系统变更主要涉及的改造要点如下：

- 1、支持创业板新增特殊标识及上市初期证券状态的揭示。
- 2、现货集中竞价委托申报时按照新发布的委托数量参数进行委托数量合法性检查。
- 3、支持新增的盘后定价交易业务的委托申报、回报接收、行情揭示以及清算交收。
- 4、支持转融通证券出借市场化约定申报及实时确认。
- 5、按照新发布的转融通证券出借委托数量参数进行委托数量合法性检查。
- 6、支持首发后可出借限售股的转融通出借。
- 7、持有可售冻结股份的证券账户禁止申报转融通证券出借市场化约定申报。
- 8、按照新的创业板适当性管理要求进行投资者适当性管理。

除上述改造要点之外，其余前端控制、竞价撮合、行情发布、成回报等规则与现状保持一致。

#### 四、新增特殊标识

交易系统每个交易日开市前向市场发布的证券信息文件（securities）、网上发行认购业务参考信息（issueparams）中已含“是否尚未盈利”、“是否存在投票权差异”字段，新增“是否具有协议控制架构”和“是否注册制”字段。

启用“是否注册制”字段判断是否为按照《创业板首次公开发行股票注册管理办法》发行的股票和存托凭证。创业板股票和存托凭证启用“是否尚未盈利”字段用于标识公司是否盈利，启用“是否存在投票权差异”字段用于标识公司是否具有表决权差异，启用“是否具有协议控制架构”字段判断是否具有协议控制架构。

市场参与者技术系统应根据“是否注册制”字段对参与创业板股票、存托凭证申购、交易的投资者权限进行控制。对于“是否注册制”字段取值为‘Y’的股票、存托凭证，只有满足创业板投资者适当性管理相关要求的新增投资者、存量专业投资者和重新签署风险揭示书的存量普通投资者才能参与申购、交易。

对于可交债、可转债，市场参与者技术系统可以通过证券信息文件（securities）的基础证券代码（UnderlyingSecurityID）获取该债券对应的标的股票（可转债对应标的股票为转股所得股票，可交债对应标的股票为换股所得股票），并根据标的股票的“是否注册制”标识，对参与可转换公司债券转股、可交换公司债券换股的投资者权限进行控制。

具体取值参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》3.1 证券信息（securities）、3.10 网上发行认购业务参考信息（issueparams）。

## 五、创业板存托凭证

深交所每个交易日向市场发布的静态参考信息文件中证券类别（SecurityType）字段增加取值：37，用于表示创业板存托凭证。现有取值36表示主板、中小板存托凭证。

创业板存托凭证代码区间为：309800-309999，主板、中小板存托凭证代码区间为：001001-001199。市场参与者技术系统可以通过深交所发布的证券类别或代码区间识别两类存托凭证。

市场参与者可以通过证券信息文件（securities）区分各类股票及存托凭证如下表所示：

类型 字段名	SecurityType 取值	Attribute 取值
创业板普通股票	3	0
创业板创新企业股票	3	1
创业板存托凭证	37	N/A
主板普通股票	1	0
中小板普通股票	2	0
主板创新企业股票	1	1
中小板创新企业股票	2	1
主板、中小板存托凭证	36	N/A

### 5.1 投资者适当性

各类股票及存托凭证投资者适当性管理如下表所示，市场参与者技术系统应根据投资者适当性业务规则对各类产品做好相关权限控制：

类型 板块	主板/中小板	创业板
普通股票	无	创业板投资者适当性
创新企业股票	创新企业股票或存托凭证投资者适当性	创新企业股票或存托凭证投资者适当性、 创业板投资者适当性
存托凭证	创新企业股票或存托凭证投资者适当性	创新企业股票或存托凭证投资者适当性、

		创业板投资者适当性
--	--	-----------

注：1) 创业板股票或存托凭证投资者适当性指应满足本所于 2018 年 6 月 15 日发布的《试点创新企业股票或存托凭证上市交易实施办法》及《试点创新企业股票或存托凭证交易风险揭示书必备条款》；

2) 创业板投资者适当性指应满足本所于 2020 年 4 月 27 日发布的《创业板投资者适当性管理实施办法》。

## 5.2 交易机制

创业板存托凭证的交易机制与创业板股票的交易机制保持一致，主板、中小板存托凭证的交易机制与主板、中小板股票的交易机制保持一致。

# 六、交易机制优化

## 6.1 证券状态发布

交易系统每个交易日开市前下发的证券信息文件（securities）的证券状态代码字段新增取值：17-上市初期，用于标识该证券处在新股上市初期。特别地，对于处于新股上市首日的创业板股票和存托凭证，仍会对外揭示证券状态：6-上市首日。对于创业板股票和存托凭证，处在新股上市初期、恢复上市首日、退市整理期时证券信息文件发布的证券状态如下表所示：

证券状态	新股上市初期且 上市首日	新股上市初期但 非上市首日	恢复上市首 日	退市整理期
6-上市首日	√	×	×	×
8-恢复上市首日	×	×	√	×
10-退市整理期	×	×	×	√
17-上市初期	√	√	×	×

注：√表示将发布该证券状态代码

创业板股票和存托凭证，处在新股上市初期或恢复上市首日时，无价格涨跌幅限制。根据交易规则 3.3.5 的规定，“市价申报只适用于有价格涨跌幅限制证券连续竞价期间的交易。其他交易时间，交易主机不接受市价申报。”；故在此期间，市价申报不适用于创业板股票和存托凭证。

## 6.2 委托数量上限及数量单位发布

交易系统每个交易日开市前下发的现货集中竞价交易业务参考信息文件（cashauctionparams）增加四个字段：“市价买数量上限”、“市价卖数量上限”、“市价买数量单位”、“市价卖数量单位”字段，用于发布市价委托的买卖数量上限、数量

单位。现有“买数量上限”、“卖数量上限”、“买数量单位”、“卖数量单位”更名为“限价买数量上限”、“限价卖数量上限”、“限价买数量单位”、“限价卖数量单位”，用于发布限价委托的买卖数量上限、数量单位。

上述市价委托是指《深圳证券交易所交易规则》3.3.4 节规定的市价委托类型。

具体取值参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》3.4 现货集中竞价交易业务参考信息（cashauctionparams）。

### 6.3 涨跌幅限制及有效竞价范围发布

交易系统每个交易日开市前下发的现货集中竞价交易业务参考信息文件（cashauctionparams）发布价格涨跌幅限制及有效竞价范围，新增“有效范围基准价类型（AuctionReferPriceType）”字段，用于标识有效竞价范围的计算方式。

有效范围涨跌幅度（AuctionUpDownRate）、有效范围涨跌价格（AuctionUpDownAbsolute）使用方式与有效范围基准价类型取值有关。具体如下：

对于有效范围涨跌幅度：

- 若 AuctionReferPriceType 为 1 时，如 AuctionUpDownRate 取值为 0.100，基准价为 9.8400，价格档位为 0.0100，则买、卖委托有效竞价范围为：【 $9.8400 * (1 - 0.100)$ ， $9.8400 * (1 + 0.100)$ 】，结果为：【8.8600,10.8200】。
- 若 AuctionReferPriceType 为 2 时，如 AuctionUpDownRate 取值为 0.100，基准价为 9.8400，跌停价为 8.0000，涨停价为 12.0000，价格档位为 0.0100，则买委托有效竞价范围为：【跌停价， $9.8400 * (1 + 0.100)$ 】，结果为：【8.0000,10.8200】，卖委托有效竞价范围为：【 $9.8400 * (1 - 0.100)$ ，涨停价】，结果为【8.8600,12.0000】。

使用有效范围涨跌价格计算与有效范围涨跌幅度类似，只是将上述计算公式的按比例相乘改为直接加减。**注意：市场参与者技术系统无需根据发布的有效竞价范围参数作委托价格检查。**

部分基金产品（创业板主题基金和创业板指数基金）现货集中竞价交易业务、协议交易业务的价格涨跌幅限制比例由 10% 调整为 20%。深交所通过静态参考信息文件（cashauctionparams、negotiationparams）及实时行情快照消息发布每只证券的涨跌幅限制参数，市场参与者技术系统应根据深交所发布的涨跌幅限制参数做好相关业务处理，同时需对此部分基金产品在交易前端（如手机 APP 或网上交易平台等）进行显著标识。

具体取值参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》3.4 现货集中竞价交易业务参考信息（cashauctionparams）。

## 七、 盘后定价交易业务

综合金融服务平台新增盘后定价交易业务，应用标识（ApplID）为 370，盘后定价交易业务的交易参考信息、委托及成交回报、行情发布、成交汇总等功能如下所示。

## 7.1 交易参考信息

交易系统每个交易日开市前下发盘后定价交易业务参考信息文件(fixedpriceparams)，用于发布参与盘后定价交易业务的证券及其相关交易参数。

券商技术系统依据应依据本所发布的盘后定价交易业务参考信息(fixedpriceparams)中的买委托数量上限、卖委托数量上限字段进行盘后定价交易业务委托数量合法性检查；盘后定价交易业务的实际成交价格由现货集中竞价交易业务的收盘价确定，因此券商技术系统应依据本所发布的现货集中竞价交易业务中的价格限定参数（包括价格档位、涨跌限制等）进行盘后定价交易业务委托的价格合法性检查。

## 7.2 委托及成交回报

盘后定价交易业务的委托及回报对应的关系如下表所示：

业务	ApplID	委托申报		成交回报	
		MsgType (Binary)	MsgType (STEP)	MsgType (Binary)	MsgType (STEP)
盘后定价交易	370	103701	D	203702 203715	8

## 7.3 行情发布

深交所每个交易日 15:05 之后每 15 秒钟通过 Level1 和 Level2 同时向市场发布一轮盘后定价交易的行情快照，以揭示盘后定价交易业务的实时行情。

盘后定价交易业务的 Binary 行情快照消息类型为：303711，STEP 行情快照消息类型为：w。新增行情类别(MDStreamID)：370，新增频道代码(ChannelNo)：3011。

盘后定价交易业务行情快照中的成交总量(TotalVolumeTrade)、成交总金额(TotalValueTrade)不包含现货集中竞价业务的成交总量和成交总金额。

现货证券收盘行情文件(cashsecurityclosemd\_YYYYMMDD.xml)中证券的成交总量、成交总金额不含盘后定价交易业务的成交总量和成交总金额。

盘后定价交易业务行情快照(行情类别 MDStreamID 为 370)中的交易阶段代码(TradingPhaseCode)第 0 位为'A'，表示盘后定价交易业务进入盘后交易阶段，将进行实时撮合成交；TradingPhaseCode 第 0 位为‘E’，表示盘后定价交易业务进入闭市阶段。

现货集中竞价业务在该业务闭市（15:00）后将持续发送闭市行情快照（行情类别 MDStreamID 为 010），其中 TradingPhaseCode 第 0 位为'E'。15:05 后，券商技术系统将同时收到现货集中竞价业务和盘后定价交易业务的行情快照。

#### 7.4 成交汇总

成交汇总服务下发的数据中包含盘后定价交易业务订单成交执行报告，二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	203715
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	370
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为：

203715<T>2<T>370<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302281  
44215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F<T  
>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>1<N>

## 八、转融通证券出借业务优化

### 8.1 市场化转融通标识

交易系统每个交易日开市前下发的转融通证券出借业务参考信息(securitylendingparams)新增“市场化转融通标志”字段，用于标识该证券是否实施市场化转融通，若取值为“Y”，即实施市场化转融通，则表示该证券支持2.4节中市场化转融通的四点内容。若取值为“N”，则表示不实施市场化转融通。市场参与者技术系统应支持根据“市场化转融通标志”识别某只证券是否实施市场化转融通，并采取不同的处理模式。

具体参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》3.8 转融通证券出借业务参考信息(securitylendingparams)。

### 8.2 申报数量上下限

交易系统每个交易日开市前下发的转融通证券出借业务参考信息(securitylendingparams)新增6个字段分别用于标识约定申报出借、非约定申报出借的数量上下限及数量单位，这6个字段为：“约定申报出借数量上限”、“约定申报出借数量下限”、“约定申报出借数量单位”、“非约定申报出借数量上限”、“非约定申报出借数量下限”、“非约定申报出借数量单位”。

市场参与者技术系统应根据上述数量上下限、数量单位对出借委托做前端检查。对于不符合要求的委托予以拒绝。

具体参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》3.8 转融通证券出借业务参考信息(securitylendingparams)。

### 8.3 约定申报实时撮合成交

对于实施市场化转融通的证券，交易系统首先检查出借人的约定申报出借委托与借入人的约定申报借入委托的合法性，若合法，将其实时撮合并发成交(Binary:200703, STEP:AE)给出借人及借入人，同时实时计减出借人的股份，实时计增借入人的股份。

对于未实施市场化转融通的证券，交易系统实时检查出借人的约定申报出借与借入人的约定申报借入申报合法性，但不撮合，等到下午 3:00-3:30 之间进行一次性撮合，与现状保持一致。

无论是否实施市场化转融通，交易系统实时检查出借人的非约定申报出借申报合法性，但不撮合，等到下午 3:00-3:30 之间进行一次性撮合，与现状保持一致。

#### 8.4 首发后可出借限售股出借

交易系统每个交易日开市前下发的转融通证券出借业务参考信息 (securitylendingparams) 新增“限售股份出借标志”字段，用于标识该证券是否允许首发后可出借限售股出借，若取值为“Y”，即允许首发后可出借限售股出借。

出借人在申报约定申报、非约定申报的出借委托时，需指定本笔委托的股份性质，如果为首发后可出借限售股，则交易系统检查出借人首发后可出借限售股是否足额。如果不为首发后可出借限售股，则与现有规则保持一致。不支持一笔委托中部分使用首发后可出借限售股、部分使用无限售流通股。“首发后可出借限售股”股份在进行转融通出借时，不受减持额度限制；非“首发后可出借限售股”股份在进行转融通出借时，与现有减持额度监控规则保持一致。

约定申报及非约定申报的交易接口（Binary:100701、100703，STEP：D、AE）拟增加字段“ShareProperty”（股份性质），取值为：00-无限售流通股，07-首发后可出借限售股。对于使用首发后可出借限售股出借的委托，ShareProperty 取值为 07，对于使用无限售流通股出借的委托取值为 00。

若投资者申报的委托中股份性质为 07，但该证券又不允许首发后可出借限售股出借（限售股份出借标志为“N”），则该笔委托将被交易系统拒绝，拒绝原因代码为：20012（业务禁止）。

约定申报及非约定申报的回报接口也增加股份性质字段，具体取值参见《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》和《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》。

交易系统支持多个 Binary 通信版本的登陆，对于本次未升级 Binary 通信版本（通信版本号低于 1.11）市场参与者，可以不做技术系统改造，但不能做首发后可出借限售股出借。

成交汇总服务下发的数据中包含转融通出借非约定申报成交执行报告、约定申报成交确认，相关消息中增加 ShareProperty 字段取值。具体如下所示：

转融通出借非约定申报成交执行报告二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200715
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	070
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
ExpirationDays	10
ExpirationType	1
MaturityDate	20160601
ShareProperty	00

转融通出借非约定申报成交执行报告对应到成交汇总文件中记录内容为：

200715<T>2<T>070<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302  
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F  
<T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>10<T>

1<T>20160601<T>00<N>

转融通出借约定申报成交确认二进制消息内容：

域名	取值
MsgType	200703
BodyLength	--
ReportIndex	2
ApplID	071
ReportingPBUID	000100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
TradeID	6B4569CDNB009C03
TradeReportID	0000004127
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	2
LastPx	171000
LastQty	30000
TrdType	1031
TrdSubType	0
ConfirmID	11000045
ExecID	1100000000004124
Side	1
PBUID	000100
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CounterpartyPBUID	000100
CounterpartyAccountID	0100005898
CounterpartyBranchID	BB

ExpirationDays	10
ExpirationType	1
MaturityDate	20160601
ShareProperty	00

转融通出借约定申报成交确认对应到成交汇总文件中记录内容为：

200703<T>2<T>071<T>000100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>201302  
28144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>0000004127<T>0<T>0<T>2<T>17.100  
0<T>300.00<T>1031<T>0<T>11000045<T>1100000000004124<T>1<T>000100<T>01000  
04698<T>AA<T>000100<T>0100005898<T>BB<T>10<T>1<T>20160601<T>00<N>

## 8.5 禁止可售冻结证券出借

对于实施市场化转融通的证券，出借人的股票被质押或被有权机关冻结的，不得用于出借，证券公司应当进行前端检查和控制。

## 8.6 转融通出借业务开关

交易系统每个交易日开市前下发的证券业务开关信息（securityswitch）开关类别增加取值：35-转融通出借。转融通证券业务开关适用于所有的转融通出借标的。

交易系统盘中通过证券实时状态消息（Binary:390013，STEP: f）实时发布证券业务开关的开关类别增加取值：35-转融通出借。

当转融通出借开关取值为‘Y’时，表示该证券允许做约定申报、非约定申报的出借及借入申报；当转融通出借开关取值为‘N’时，表示该证券不允许做约定申报、非约定申报的出借及借入申报，但允许撤单。

市场参与者技术系统应根据转融通出借业务开关对投资者委托申报进行相关控制。

## 九、清算和交收

### 9.1 盘后定价交易结算数据接口变更

盘后定价交易的股票和存托凭证的资金结算参照现行A股相关制度安排，实行分级结算原则。在结算方式上，盘后定价交易当日与其他交易一并纳入担保结算品种合并做净额担保结算，使用现有结算备付金账户完成资金交收。盘后定价交易业务相关费用，与现有A股集中交易业务的收费标准相同，结算保证金、最低结算备付金、交收违约、证券结算风险基金等参照现有规定执行。

盘后定价交易沿用现有业务类别‘JY00’，新增专用于标识盘后定价交易的交易方式‘12’，同时对原有的交易方式‘02’的描述修改为：综合金融服务平台交易（不含盘后定价交易部分）(经深交所)。本次改动的接口有：清算明细库 SJSMX1.DBF，并修订证券交易统计库 SJSTJ.DBF 等其他接口的部分文字描述。

盘后定价交易结算数据接口变更说明详见《深圳证券交易所盘后定价交易业务之券商技术系统变更指南》中“清算和交收”章节。

### 9.1.1 清算明细库 SJSMX1.DBF

盘后定价交易的明细数据，新增专用于标识盘后定价交易的交易方式‘12’，同时对原有的交易方式‘02’的描述修改为：综合金融服务平台交易（不含盘后定价交易部分）(经深交所)。盘后定价交易的明细数据为：

表 7-1 SJSMX1.DBF 盘后定价交易数据

字段名	业务类别
	JY00 (集中竞价平台、综合金融服务平台 (担保交收模式))
MXJSZH	结算账号
MXBFZH	备付金账户
MXSJLX	‘01’
MXYWLB	‘JY00’
MXZQDM	证券代码
MXJYDY	交易单元
MXTGDY	托管单元
MXZQZH	证券账户
MXDDBH	订单编号
MXYYB	营业部代码
MXZXBH	执行编号
MXYWLSH	业务流水号
MXCJSL	成交量
MXQSSL	清算数量
MXCJJG	交易回报价格
MXQSJG	最终清算价格
MXXYJY	信用交易标志
MXPCBS	平仓标志
MXZQLB	证券类别
MXZQZL	证券子类别

MXGFXZ	‘00’
MXJSFS	‘A’
MXHBDH	货币代号
MXQSBJ	清算本金
MXYHS	印花税
MXJYJSF	交易经手费
MXJGGF	监管规费
MXGHF	过户费
MXJSF	结算费
MXSXFM	
MXQSYJ	
MXQTFY	
MXZJJE	
MXSFJE	收付净额
MXCJRQ	T 日
MXQSRQ	T 日
MXJSRQ	T+1 日
MXFSRQ	T 日
MXQTRQ	
MXSCDM	
MXJYFS	‘12’
MXZQDM2	
MXTGDY2	
MXDDBH2	
MXCWDH	
MXPPHM	
MXFJSM	
MXBYBZ	

MXJYFS（字段 41：交易方式），表示业务委托的交易方式或渠道。‘01’：普通交易(经深交所)，‘02’：综合金融服务平台交易（不含盘后定价交易部分）(经深交所)，‘03’：经深交所申报的非交易业务，‘04’：经中国结算深圳分公司 D-COM 系统申报的非交易业务，‘05’：经中国结算总公司基金业务平台申报的业务，‘06’：经中国结算总公司 TA 系统申报的业务，‘07’：经其它渠道申报的业务，‘08’：中国结算深圳分公司前台业务，‘09’：中国结算深圳分公司特殊处理，‘12’：盘后定价交易(经深交所)，‘ ’：其它。

### 9.1.2 资金清算汇总库 **SJSQS.DBF** 、**T+0 资金清算汇总库 SJSQS0.DBF**

本次接口填写规则无变更，但因为盘后定价交易当日与其他交易一并纳入担保结算品种合并做净额担保结算，因此，SJSQS.DBF 包含了盘后定价交易，协议交易闭市后发送的 SJSQS0 文件是全天交易的资金汇总，也包含了盘后定价交易。

### 9.1.3 资金变动库 **SJSZJ.DBF**

本次接口填写规则无变更，在 T+1 的数据中，ZJYWLB 为 ‘JY00’（集中竞价交易、综合金融服务平台（担保交收模式）交易清算）的数据，包含了盘后定价交易。

### 9.1.4 资金余额信息库 **SJSYE.DBF**

本次接口填写规则无变更，该库为结算参与人在完成当日交收记账后的资金账户（含备付金账户和保证金账户）余额及下一交易日可提款资金额度等信息。因此在 T+1 的数据中包含了盘后定价交易。

### 9.1.5 证券交易统计库 **SJSTJ.DBF**

本次接口填写规则无变更，修订本库的描述信息为：本库包括担保交收的集中撮合交易、大宗交易和盘后定价交易，但不包含 B 转 H 证券的成交统计。

## 9.2 转融通证券出借及转融券优化结算数据接口变更

### 9.2.1 接口修订概述

#### 9.2.1.1 现状描述

转融通证券出借现包括约定申报方式及非约定申报方式，深交所不对双方账户的可交易余额进行实时调整，中国结算深圳分公司日终逐笔全额办理相关证券划转，证券账户中可供划转证券不足额的，该笔划转失败。

转融券业务（证金公司出借证券给证券公司）现由证金公司向中国结算深圳分公司申报，中国结算深圳分公司日终逐笔全额办理相关证券划转，证券账户中可供划转证券不足额的，该笔划转失败。

目前仅无限售流通股可参与转融通证券出借及转融券业务。

#### 9.2.1.2 变动内容

(1) 新增市场化转融通方式，包含转融通出借及转融券证券划转指令，深交所对双方账户的可交易余额进行实时调整，中国结算深圳分公司日终进行多边净额无条件过户。

所涉及业务类别及其含义如下表所示：

业务类别	业务类别名称	说明
RTCJ	转融通证券出借	新增市场化转融通的转融通出借
RTR4	转融通证券划转	新增市场化转融通的转融券证券划转 (证监会公司出借证券给券商, 划转原因‘A96’)

(2) 扩大券源, 允许“首发后可出借限售股”作为转融通券源。

新增股份性质“首发后可出借限售股”如下:

股份性质	股份性质名称
07	首发后可出借限售股

所涉及业务类别及其含义如下表所示:

业务类别	业务类别名称	说明
RTCJ	转融通证券出借	涉及约定申报及非约定申报方式的转融通证券出借
RTR4	转融通证券划转	涉及证监会公司归还证券给出借人(划转原因‘A97’)、证监会公司划付权益补偿证券给出借人(划转原因‘A98’)

根据《创业板首次公开发行股票注册管理办法》, “07”股份性质(首发后可出借限售股)的股份来源, 目前仅包括注册制发行的创业板战略投资者配售股份。

### 9.2.2 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)》, 变动如下:

字段名	业务类别	
	RTR4 转融通证券划转	RTCJ 转融通证券出借
JGJSZH	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘RTR4’	‘RTCJ’
JGZQDM	证券代码	证券代码

JGJYDY		
JGTGDY	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户
JGDBBH	委托序号	订单编号
JGYYB		
JGZXBH	若为市场化转融通的转融券指令，填写执行编号；否则填空。	证金公司方执行编号
JGYWLSH		
JGCJSL	委托数量	成交量
JGQSSL		
JGJSSL	交收数量	交收数量
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	证券类别	证券类别
JGZQZL	证券子类别	证券子类别
JGGFXZ	‘00’股份性质	‘00’股份性质
JGLTLX	流通类型	‘0’
JGJSFS	‘N’：非担保交收 ‘G’：无条件过户	‘N’：非担保交收 ‘G’：无条件过户
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’
JGQSBJ		
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF	手续费	手续费
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	收付净额	收付净额
JGJSBZ	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’或‘N’
JGZYDH	若 JGJSBZ 为‘N’， 则为错误代号； 若 JGJSBZ 为‘Y’， 则为证券划转原 因编码。	若JGJSBZ为‘N’,则是错误代号
JGCJRQ	T 日	T 日
JGQSRQ		
JGJSRQ		

JGFSRQ	T 日	T 日
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS		
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDBH2		
JGFJSM	左起 1-6 位为对手方托管单元； 7-26 位为对手方证券账户号码； 27-42 位为“合约代号”（若深交所/证金公司/结算参与人未提供此信息，则为空）； 43-45 位为转融通证券划转原因编码； 46-53 位为交易日期，若证金公司/结算参与人未提供此信息，则为空； 54-55 位为对手方股份性质。	对证金公司： 1-6 位为出借人交易单元； 7-12 位为出借人托管单元； 13-32 位为出借人证券账户号码； 51-60 位为出借方订单编号。 对出借方参与人及证金公司： 33-48 位填写出借方执行编号； 49-50 位填写对手方股份性质。
JGBYZ		

具体说明如下：

1. SJSJG.DBF 接口中交收方式字段增加定义：‘G’表示无条件过户。
2. 对于转融通证券划转 (RTR4)，现有指令的回报 JGDBH 填写申报指令中的委托序号，JGZXH 填写空，JGJSFS 填写‘N’（非担保交收）；现增加发送市场化转融通的转融券（证金公司出借证券给证券公司，划转原因为‘A96’）指令的处理结果，JGDBH 填写成交数据中证金公司成交申报编号，JGZXH 填写成交数据中的执行编号，JGJSFS 填写‘G’（无条件过户）。
3. 对于转融通出借 (RTCJ)，现有指令的回报 JGJSFS 填写‘N’（非担保交收）；现增加发送市场化转融通的转融通出借指令的处理结果，JGJSFS 填写‘G’（无条件过户）。
4. 为了表示首发后可出借限售股参与转融通后股份性质的变化，JGGFXZ 填写本方（收到数据一方）的股份性质，JGFJSM 启用两位标识位表示对手方股份性质：
  - 1) 无限售流通股份参与转融通出借及转融通证券划转，划转前后股份性质不变。划转双方收到的数据，JGGFXZ 填写‘00’，JGFJSM 中对手方股份性质也填写‘00’。
  - 2) 首发后可出借限售股由证金公司转融通专用证券账户借入后，性质变为无限售流通股；出借期满、归还至原出借人后，继续按首发后可出借限售股管理。转融通出借 (RTCJ) 数据及转融通证券划转 (RTR4) 中的证金公司归还证券给出借人（划转原因 ‘A97’）、证金公司划付权益补偿证券给出借人（划转原因 ‘A98’）的数据：出借方收到的数据，JGGFXZ 为‘07’，JGFJSM 中对手方股份性质为‘00’；证金公司收到的数据，JGGFXZ 为‘00’，JGFJSM 中对手方股份性质为‘07’。
5. 转融通证券划转 (RTR4) 启用 JGSXF 和 JGSFJE 字段，为以后收费预留（目前转融通证券划转暂不收费）。

6、修订转融通出借（RTCJ）业务 JGFJSM 和 JGZYDH 的描述、修订转融通证券划转（RTR4）业务 JGZYDH 的描述。

### 9.2.3 其他接口

股份结算对账库（SJSDZ.DBF）中包括首发后可出借限售股余额数据，其股份性质填写‘07’。

其它接口中，涉及首发后可出借限售股的，股份性质填写‘07’。

《深市登记结算 XML 实时报文接口规范》中非交易业务部分业务委托报文和回报报文中的股份性质字段可以填写“07”，包括：冻结、解冻、轮候冻结、限售股及未上市份转托管、要约收购限售股预受/解除等业务。

SJSMXn.DBF 接口中交收方式字段同步增加定义：‘G’ 表示无条件过户。

## 9.3 账户系统数据变更

账户系统投资者适当性管理信息维护接口对数据报送要求有变更，详细说明参见中国结算总部统一账户平台最新发布数据接口规范。

## 9.4 创业板存托凭证

创业板存托凭证与主板、中小板存托凭证在登记结算数据接口方面没有区别，证券类别均为“0C”（中国存托凭证），不做板块区分。

## 十、市场参与者系统注意事项

市场参与者应按照业务方案和本指南，调整其柜台及相关系统支持创业板改革并试点注册制涉及的各项业务。

### 10.1 关于客户委托服务渠道

建议调整柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等投资者委托渠道（可选择一种或多种渠道）的相应前端系统，以支持盘后定价交易业务委托及其撤单指令的录入。

### 10.2 关于市场参与者柜台系统

#### (1) 投资者适当性管理

柜台系统应按照本所相关规则及本指南，分别就新申请开通创业板交易权限及新规实施前已开通创业板交易权限的投资者，做好相关股票、存托凭证申购交易，及可转债转股、可交债换股的权限控制。会员应根据本所发布的投资者适当性管理规定做好创业板投资者适当性管理工作，为投资者开通创业板交易权限应符合本所相关规定。

#### (2) 前端风险控制

柜台系统应对投资者委托的价格、数量、投资者资金、投资者股份等要素进行前端

风险控制，对于不符合前端风险控制要求的委托予以拒绝，不要申报至深交所交易系统。

### (3) 转融通出借业务处理

柜台系统应支持对于某些证券（按照证券的粒度）采用市场化转融通的处理方式，某些证券采用现有非市场化转融通的处理方式，对于转融通出借业务实施市场化转融通证券的约定申报，应支持处理实时返回的成交回报，并进行相应的股份维护。

对于实施市场化转融通的证券，出借人的股票被质押或被有权机关冻结的，不得用于出借，证券公司柜台系统应拒绝该投资者出借委托。

## 10.3 关于接口兼容性要求

本次技术变更，除前面提到接口变化外，还在交易参考信息文件中新增了预留字段 SymbolEx，详见《深圳证券交易所数据文件接口规范》及《上市公司股东大会数据接口》。

考虑到本次技术变更接口变化较大，为防范技术系统运行风险，保障证券市场业务安全稳定运行，深交所对接口规范中市场参与者技术系统兼容性要求作进一步明确，具体要求详见附件一，附件内容在接口规范中也有说明。

请各会员、信息服务商及相关单位高度重视，认真组织并梳理，对于不符合项及时进行改造。

# 十一、 相关事宜

## 11.1 参考文档

《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》

《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》

《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》

《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》

《深圳证券交易所 STEP 行情数据接口规范》

《深圳证券交易所上市公司股东大会数据接口》

《深圳证券交易所盘后定价交易业务之券商技术系统变更指南》

## 11.2 联系方式

深圳证券交易所业务：(0755) 88666284 (转融通)、(0755) 88668376 (其他)

深圳证券交易所技术：(0755) 88668446

中国结算深圳分公司业务：0755-21899272

中国结算深圳分公司技术：0755-25946080

## 附件一：市场参与者技术系统兼容性要求

## 一、交易接口规范兼容性要求

1、接口规范新增 TGW 发送给 OMS 的应用层消息类型，OMS 如果不使用这些新消息，应可以不作变更而自动忽略这些新消息。新消息可以是回报类消息也可以是非回报类消息。

2、二进制接口规范在现有 TGW 发送给 OMS 的消息尾部增加新的字段( 可能是重复组 )，OMS 如果不使用这些新增字段，应可以不作变更而自动忽略这些新增字段。

## 二、行情接口规范兼容性要求

1、接口规范新增行情频道，VSS 如果不使用新增的行情频道中发布的数据，应可以不作变更而自动忽略这些新增行情频道中的消息。

2、接口规范新增 MDGW 发送给 VSS 的应用层消息类型，VSS 如果不使用这些新消息，应可以不作变更而自动忽略这些新消息。

3、快照或逐笔行情新增行情类别 ( MDStreamID , tag1500 )，VSS 如果不使用这些新类别的行情，应可以不作变更而自动忽略新类别的行情消息。

4、二进制接口规范在现有 MDGW 发送给 VSS 的消息尾部增加新的字段 ( 可能是重复组 )，VSS 如果不使用这些新增字段，应可以不作变更而自动忽略这些新增字段。

5、行情快照消息增加新的行情条目类别 ( MDEntryType , tag269 )，VSS 如果不使用这些新的行情条目，应可以不作变更而自动忽略新的行情条目。

6、证券实时状态消息增加新的开关类别 ( SecuritySwitchType , tag10203 )，VSS 如果不使用这些新的开关信息，应可以不作变更而自动忽略新的开关信息。

## 三、数据文件交换接口规范兼容性要求

- 1、接口规范增加发送新的文件，OMS 或 VSS 如果不使用这些新的数据文件，应可以不作变更而自动忽略这些新的数据文件。
- 2、接口规范在现有 XML 文件中增加新的字段，OMS 或 VSS 如果不使用这些新增字段，应可以不作变更而自动忽略这些新增字段。
- 3、接口规范在现有的 TSV、CSV 文件记录尾部新增字段，OMS 或 VSS 如果不使用这些新增字段，应可以不作变更而自动忽略这些新增字段。