

沪市货银对付改革技术实施指引 (正式版)



中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

二〇二二年六月

版本说明

修订日期	版本	修订说明
2022 年 1 月	开发版	形成沪市货银对付改革技术实时指引（开发版）
2022 年 6 月	正式版	1. 补充接口启用时间说明； 2. 货银对付预清算结果查询新增业务类型；

目录

版本说明.....	2
接入平台.....	4
技术调整说明.....	4
数据接口文档.....	4
一 数据接口列表.....	4
二 数据接口内容.....	5
(一) PROP 实时服务接口.....	5
(二) 日终数据文件.....	13
联系方式.....	19

接入平台

结算参与机构通过 PROP 系统与中国结算上海分公司结算系统对接。通过 PROP 综合业务终端或信箱文件交换工具获取货银对付日间批次数据和相关日终登记结算数据文件。

技术调整说明

为支持沪市货银对付改革方案实施，我公司对结算数据服务主要调整如下：

一、新增 PROP 实时服务

新增 4 类 PROP 实时服务，分别为：货银对付预清算结果查询、货银对付优先/免除标识指令申报及查询、货银对付待处置证券指令申报及查询以及证券交收情况查询。

二、日终结算数据文件调整填写说明

- 1、qtsl(证券其他数量对账文件)增加证券锁定、解锁的描述。
- 2、tzxx(通知信息文件)新增通知类别“050”，并调整通知类别“020”、“030”相关描述。
- 3、ywhb(业务回报文件)新增业务类型“830”、“831”。
- 4、zqbd(证券变动文件)启用“BY”字段。
- 5、zqye(证券余额对账文件)调整字段“YE2”填写说明。

数据接口文档

一 数据接口列表

序号	PROP 实时服务	调整说明	备注
1	货银对付预清算结果查询	新增(服务域 SSCRC, 服务名 JSXT, 服务类	模拟运行期暂不

		型 20)，用于查询日间预清算结果	启用调整
2	货银对付优先/免除标识指令申报及查询	新增（服务域 SSCRC，服务名 JSXT，服务类型 21），用于进行货银对付优先标识、免除标识指令的申报以及查询申报情况	模拟运行期暂不启用调整
3	货银对付待处置证券指令申报及查询	新增（服务域 SSCRC，服务名 JSXT，服务类型 22），用于进行待处置证券申报以及查询申报情况	模拟运行期暂不启用调整
4	证券交收情况查询	新增（服务域 SSCRC，服务名 JSXT，服务类型 23），用于查询当日证券锁定、解锁情况	模拟运行期暂不启用调整
5	资金变动查询	修改（服务域 SSCRC，服务名 ZJCGXT，服务类型 52），调整填写说明	模拟运行期暂不启用调整
序号	日终数据文件	调整说明	
1	qtsl（证券其他数量对账文件）	调整，启用字段“BH2”、“FZDM”、“BCSM”描述货银对付相关证券锁定、解锁情况	模拟运行期启用
2	tzxx（通知信息文件）	调整，新增通知类别“050：证券账户最低备付明细数据（管理人专用）”；调整通知类别 020、030 的填写说明	模拟运行期暂不启用调整
3	ywhb（业务回报文件）	调整，新增 2 个业务类型，分别为“830：货银对付优先/免除标识指令申报结果”、“831：货银对付待处置证券指令申报结果”	模拟运行期暂不启用调整
4	zqbd（证券变动文件）	调整，启用字段“BY”描述锁定原因，并增加证券锁定、证券锁定解锁的填写说明	模拟运行期暂不启用调整
5	zqye（证券余额对账文件）	调整，调整字段“YE2”填写说明	模拟运行期暂不启用调整

二 数据接口内容

（一）PROP 实时服务接口

序号	服务域	服务名	服务类型	服务时间	描述	备注
1	SSCCRC	JSXT	20	8:00-19:00	货银对付预清算结果查询	新增
2	SSCCRC	JSXT	21	8:00-17:00	货银对付优先/免除标识指令申报及查询	新增
3	SSCCRC	JSXT	22	8:00-16:00	货银对付待处置证券指令申报及查询	新增
4	SSCCRC	JSXT	23	8:00-19:00	证券交收情况查询	新增
5	SSCCRC	ZJCGXT	52	6:00-23:00	资金变动查询	调整

1. 货银对付预清算结果查询

ServiceDomain = “SSCCRC”
ServiceName = “JSXT”
ServiceType = “20”

请求文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	ZJZH	资金账户	Character	25	结算备付金账户
2	BY	备用	Character	40	
	合计			65	

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明	说明
1	QSRQ	清算日期	Character	8	YYYYMMDD	YYYYMMDD
2	SJLX	数据类型	Character	3	100：按清算编号汇总实际收付金额； 102：按备付金账户汇总实际收付金额	101：按清算编号汇总资金核验净应付金额； 103：按备付金账户汇总资金核验净应付金额
3	PCH	批次号	Character	1	批次号	批次号
4	QSBH	清算编号	Character	6	清算编号	清算编号
5	ZJZH	资金账户	Character	25	同请求	同请求
6	QSJE	清算金额	Character	20	清算金额	
7	YHS	印花税	Character	20	印花税	
8	JSF	经手费	Character	20	经手费	
9	GHF	过户费	Character	20	过户费	
10	ZGF	证管费	Character	20	证管费	
11	SXF	手续费	Character	20	手续费	
12	QTJE1	其他金额 1	Character	20	其他金额 1	
13	QTJE2	其他金额 2	Character	20	其他金额 2	
14	QTJE3	其他金额 3	Character	20	其他金额 3	
15	SJSF	实际收付	Character	20	实际收付	资金核验净应付金额
16	BY	备用	Character	40		
17	JGDM	结果代码	Character	4	结果代码	结果代码
18	JGSM	结果说明	Character	40	结果说明	结果说明
	合计			327		

说明：

(1) 预清算数据包含以下业务类型的净额担保交收数据：001、002、003、004、012、022、023、024、034、036、037、100、102/103、104、108、451、500、501、502、503、504、505、506、507、601、611、627、628、638（仅含预发行交易）、639（仅含预发行交易），以及以上业务类型相关的大宗交易（交易方式 002）。

(2) 当数据类型为‘101’、‘103’时，字段“实际收付”为 0 表示当日为资金净应收方或净应付资金为 0，“实际收付”为负数表示表示当日为资金净应付方。

(3) 第一批次预清算结果的可查询时间为 14:30 左右。

第二批次预清算结果的可查询时间为 15:15 左右。

第三批次预清算结果的可查询时间视当日闭市后上海证券交易所交易数据发送我公司的时间而定，一般为 15:45 左右。

第四批次预清算结果的可查询时间视当日闭市后上海证券交易所科创板盘后交易数据、大宗交易数据和科创板配售数据发送至我公司的时间而定，一般为 15:50 左右。

2. 货银对付优先/免除标识指令申报及查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “JSXT”

ServiceType = “21”

申报方式： 批量申报

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	左起 16 位有效；同一批次请求中申报编号不可重复
2	SBLX	申报类型	Character	2	
3	SLBH	受理编号	Character	20	
4	ZLLX	指令类型	Character	4	
5	ZJZH	资金账户	Character	25	备付金账户
6	ZQZH	证券账号	Character	20	
7	ZQDM	证券代码	Character	8	
8	ZQLB	证券类别	Character	2	
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	SL	数量	Character	20	左起 14 位有效；正整数，数量单位股票、优先股和科创板股票为股，基金和 CDR 为份，债券为元且需填写 1000 的整数倍。
13	BY	备用	Character	40	暂不启用
	合计			168	

填写说明：

字段名	字段描述	申报请求	删除请求	查询请求
SBBH	申报编号	必填	必填	必填
SBLX	申报类型	SB：申报	SC：删除	CX：查询
SLBH	受理编号	#	成功申报应答中的受理编号	#
ZLLX	指令类型	JLZL：优先标识指令； YLZL：免除标识指令	#	JLZL：优先标识指令； YLZL：免除标识指令
ZJZH	资金账户	必填	#	必填
ZQZH	证券账号	必填	#	选填
ZQDM	证券代码	选填；若填写数量则此项必填	#	选填
ZQLB	证券类别	选填；若填写数量则此项必填	#	选填
LTLX	流通类型	选填；若填写数量则此项必填	#	选填
QYLB	权益类别	选填；若填写数量则此项必填	#	选填
GPNF	挂牌年份	选填；若填写数量则此项必填	#	选填
SL	数量	选填	#	#
BY	备用	暂不启用	暂不启用	暂不启用
合计				

说明：

(1) 同一批申报数据中申报类型、指令类型必须相同。

(2) 该指令于申报当日日终进行生效校验，并且仅当日有效，最终指令生效情况以日终数据为准。

(3) 优先标识指令或免除标识指令申报可按以下三种方式：

优先级 1：备付金账户+证券账户；

优先级 2：备付金账户+证券账户+证券代码；

优先级 3：备付金账户+证券账户+证券代码+证券类别+流通类型+权益类别+挂牌年份+证券数量。

若同一证券账户按多种方式进行申报将按优先级高低生效；若有多条相同的备付金账户+证券账户+证券代码+证券类别+流通类型+权益类别+挂牌年份数据，将对多条相同记录的证券数量汇总处理。

(4) 示例：

示例一：某结算参与人的备付金账户 A，对证券账户 a 持有的 600001 无限售流通股 200 股申报优先标识指令。

示例二：某结算参与人的备付金账户 A，对证券账户 b 持有的 600001 配股 100 股申报优先标识指令。

示例三：某结算参与人的备付金账户 A，对证券账户 c 持有的 510050 基金 50 份申报优先标识指令。

示例四：某结算参与人的备付金账户 A，对证券账户 d 持有的 120001 债券 1000 元申报优先标识指令。

字段名	字段描述	示例一	示例二	示例三	示例四
SBBH	申报编号	必填	必填	必填	必填
SBLX	申报类型	SB	SB	SB	SB
SLBH	受理编号	#	#	#	#
ZLLX	指令类型	JLZL	JLZL	JLZL	JLZL
ZJZH	资金账户	A	A	A	A
ZQZH	证券账号	a	b	c	d
ZQDM	证券代码	600001	600001	510050	120001
ZQLB	证券类别	PT	PT	JJ	GZ
LTLX	流通类型	0	N (配股次数)	0	0
QYLB	权益类别		P		
GPNF	挂牌年份		YYYY		
SL	数量	200	100	50	1000
BY	备用	暂不启用	暂不启用	暂不启用	暂不启用
合计					

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	申报应答	撤销应答	查询应答
1	SBBH	申报编号	Character	20	同请求	同请求	同请求
2	SBLX	申报类型	Character	2	同请求	同请求	同请求
3	SLBH	受理编号	Character	20	受理编号	同请求	受理编号
4	ZLLX	指令类型	Character	4	同请求	指令类型	同请求

5	ZJZH	资金账户	Character	25	同请求	备付金账户	同请求
6	ZQZH	证券账号	Character	20	同请求	证券账号	证券账号
7	ZQDM	证券代码	Character	8	同请求	证券代码	证券代码
8	ZQLB	证券类别	Character	2	同请求	证券类别	证券类别
9	LTLX	流通类型	Character	1	同请求	流通类型	流通类型
10	QYLB	权益类别	Character	2	同请求	权益类别	权益类别
11	GPNF	挂牌年份	Character	4	同请求	挂牌年份	挂牌年份
12	SL	数量	Character	20	同请求	数量	数量
13	BY	备用	Character	40	暂不启用	暂不启用	暂不启用
14	JGDM	结果代码	Character	4	0000: 提交成功 其他为失败	0000: 撤销成功 其他为失败	0000: 成功 其他为失败
15	JGSM	结果说明	Character	40	结果代码对应的 结果说明	结果代码对应的 结果说明	结果代码对应的 结果说明
	合计			212			

说明：对于申报类型‘SB’，若应答文件结果代码为‘0000’，仅代表该笔申报指令提交成功，系统已进行受理。是否申报成功，以日终 ywhb 文件中的‘货银对付优先/免除标识指令申报结果’为准。

3. 货银对付待处置证券指令申报及查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “JSXT”

ServiceType = “22”

申报方式： 批量申报

请求文件：

序号	字段名	字段说明	类型	长度	说明
1	SBBH	申报编号	Character	20	左起 16 位有效；同一批次请求中申报编号不可重复；
2	SBLX	申报类型	Character	2	
3	SLBH	受理编号	Character	20	
4	ZJZH	资金账号	Character	25	
5	ZQZH	证券账号	Character	20	
6	ZQDM	证券代码	Character	8	
7	ZQLB	证券类别	Character	2	
8	LTLX	流通类型	Character	1	
9	QYLB	权益类别	Character	2	
10	GPNF	挂牌年份	Character	4	
11	SBSL	申报数量	Character	20	左起 14 位有效；正整数，数量单位：股票、优先股和科创板股票为股，基金和 CDR 为份，债券为元且需填写 1000 的整数倍。
12	BY	备用	Character	40	暂不启用
	合计			164	

填写说明：

字段名	字段说明	长度	申报请求	删除请求	查询请求
SBBH	申报编号	20	必填	必填	必填
SBLX	申报类型	2	必填 SB：申报	必填 SC：删除	必填 CX：查询
SLBH	受理编号	20	#	必填；成功申报应答中的受理编号	#
ZJZH	资金账号	25	必填	#	必填
ZQZH	证券账户	20	必填	#	选填
ZQDM	证券代码	8	必填	#	选填
ZQLB	证券类别	2	必填	#	#
LTLX	流通类型	1	必填	#	#
QYLB	权益类别	2	必填	#	#
GPNF	挂牌年份	4	必填	#	#
SBSL	申报数量	20	必填	#	#
BY	备用	40	暂不启用	暂不启用	暂不启用
合计					

示例：若结算参与人A需对某证券账户a持有的600001无限售流通股的200股送股(当年第一次送股)申报转待处置，则填写如下：

字段名	字段说明	长度	对送股申报转待处置
SBBH	申报编号	20	申报编号
SBLX	申报类型	2	SB
SLBH	受理编号	20	#
ZJZH	资金账号	25	A
ZQZH	证券账户	20	a
ZQDM	证券代码	8	600001
ZQLB	证券类别	2	PT
LTLX	流通类型	1	1
QYLB	权益类别	2	S
GPNF	挂牌年份	4	YYYY
SBSL	申报数量	20	200
BY	备用	40	暂不启用
合计			

应答文件：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	申报应答	撤销应答	查询应答
1	SBBH	申报编号	Character	20	同请求	同请求	同请求
2	SBLX	申报类型	Character	2	同请求	同请求	同请求
3	SLBH	受理编号	Character	20	受理编号	同请求	受理编号
4	ZJZH	资金账户	Character	25	同请求	备付金账户	同请求
5	ZQZH	证券账号	Character	20	同请求	证券账号	证券账号
6	ZQDM	证券代码	Character	8	同请求	证券代码	证券代码
7	ZQLB	证券类别	Character	2	同请求	证券类别	证券类别
8	LTLX	流通类型	Character	1	同请求	流通类型	流通类型
9	QYLB	权益类别	Character	2	同请求	权益类别	权益类别

10	GPNF	挂牌年份	Character	4	同请求	挂牌年份	挂牌年份
11	SL	数量	Character	20	同请求	数量	数量
12	SBRQ	申报日期	Character	8	申报当日日期	申报当日日期	申报当日日期
13	BY	备用	Character	40	暂不启用	暂不启用	暂不启用
14	JGDM	结果代码	Character	4	0000,表示记录提交成功 其他,表示记录提交失败	0000,表示记录撤销成功 其他,记录撤销失败	0000,表示记录查询成功 其他,表示没查到数据
15	JGSM	结果说明	Character	40			
	合计			216			

4. 证券交收情况查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “JSXT”

ServiceType = “23”

请求文件:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	JSRQ	交收日期	Character	8	必填; YYYYMMDD
2	ZJZH	资金账号	Character	25	必填; 左起 18 位有效
3	BY	备用	Character	40	暂不启用
	合计			73	

应答文件:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	说明
1	JSRQ	交收日期	Character	8	同请求
2	ZJZH	资金账号	Character	25	同请求
3	SDZT	可售交收锁定标志	Character	2	00: 无可售交收锁定 01: 有可售交收锁定 02: 已转待处置交收锁定
4	PCH	批次号	Character	1	批次号
5	BY	备用	Character	40	暂不启用
6	JGDM	结果代码	Character	4	0000: 成功 其他为失败
7	JGSM	结果说明	Character	40	结果代码对应的结果说明
	合计			120	

说明:

(1) 批次说明:

批次号	说明
0	清算日证券锁定情况
1	第一批次证券交收情况
2	第二批次证券交收情况
3	第三批次证券交收情况

4	最终交收结果
---	--------

(2) 若某批次证券可售交收锁定标志为‘00’表示无可售交收锁定证券，则无后续批次数据生成。

(3) 清算日证券锁定情况（批次号 0）、第一批次证券交收情况（批次号 1）9:00 之后可查。

第二批次证券交收情况（批次号 2）10:00 之后可查。

第三批次证券交收情况（批次号 3）12:00 之后可查。

最终交收结果（批次号 4）17:00 之后可查。

5. 资金变动查询

ServiceDomain = “SSCCRC”

ServiceName = “ZJCGXT”

ServiceType = “52”

服务时间： 6:00-23:00

请求文件：

序号	字段名	类型	长度	说明
1	SBBH	Character	16	申报编号，右对齐，左补空格，填写“1”
2	SBFDM	Character	8	PROP 用户代码
3	ZLLX	Character	4	“BDCX”（变动查询）
4	YHDM	Character	14	“0100”（中国结算上海分公司）
5	ZJZH	Character	32	资金账户，左边 18 位有效，左对齐，右补空格
6	BZ	Character	3	CNY
7	QSRQ	Character	8	起始日期，必填
8	JZRQ	Character	8	终止日期，必填
9	BY	Character	40	左边 19 位有效，首次资金变动查询，填写“起始日期+0000000000”，左对齐，右边不足补空格。后续资金变动查询，填写上一次查询应答文件最后一条记录的备用（BY）字段的值。
	合计		133	

应答文件：

序号	字段名	类型	长度	说明
1	SBBH	Character	16	同请求
2	SBFDM	Character	8	同请求
3	ZLLX	Character	4	同请求
4	YHDM	Character	14	同请求
5	ZJZH	Character	32	同请求
6	ZHMC	Character	120	资金账户名称
7	BZ	Character	3	同请求
8	YEBD	Character	19	变动金额
9	SDBD	Character	19	本次余额
10	DJBD	Character	19	#（暂不启用）

11	ZWLX	Character	4	# (暂不启用)
12	ZFYF	Character	3	# (暂不启用)
13	ZY	Character	254	摘要
14	ZFBH	Character	20	#
15	SDBH	Character	20	账务流水号
16	DJBH	Character	20	#
17	KHLSH	Character	24	#
18	FSRQ	Character	8	发生日期
19	FSSJ	Character	6	发生时间； 若为结算资金账户的出入账（含三地资金调拨）， 则此项必填；其他情况此项为空
20	FJXX	Character	254	#
21	BY	Character	40	左边 19 位有效。返回“99999999999999999999”（19 个 9），表示无后续数据；返回其余值表示本笔变动并非查询结果中的最后一笔，仍有后续数据
22	SLRQ	Character	8	受理日期
23	SLSJ	Character	6	受理时间
24	JGDM	Character	4	结果代码，“0000”表示成功，“3100”表示无符合查询条件的记录
25	JGSM	Character	40	对结果代码的说明
26	JLJYM	Character	32	#
	合计		997	

数据说明：

1) 变动金额 (YEBD) 为正表示余额增加，变动金额为负表示余额减少。格式：±9999999999999999.99，正号不填。

2) BY 字段说明：如果符合查询条件的查询结果集小于 1000 条，则返回结果中除最后一笔以外的每笔记录 BY 字段为“变动日期+变动序号”，最后一笔变动记录的 BY 字段为“99999999999999999999”；如果符合查询条件的查询结果集大于 1000 条，则只按“变动日期+变动序号”排序返回前 1000 条数据，且第 1000 条数据的 BY 字段仍为“变动日期+变动序号”，可以将这个值填写在请求的 BY 字段中（表示所查询变动的起始序号），发起新的查询请求，新的查询应答将把变动序号为起始序号加一的变动记录作为首笔应答记录并按序返回后续变动。

3) 对于备付金账户的资金出入账（含三地资金调拨）发生时间，以上海分公司后台系统记录时间为准。

(二) 日终数据文件

1. qtsl (证券其他数量对账文件)

- 1) 文件名称： qtslXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)。
- 2) 数据内容： 包含证券的其他数量信息，例如证券冻结明细数量、当日退登记证券股份明细

数量、证券账户质押券余额、证券账户标准券余额、询价增发保留权数量、当前有效的质押物明细及股权激励期权持有明细数据、证券账户日终“T+1日欠库测算”数据及债券质押式三方回购质押品数量及科创板战略投资者配售股份数据等。

- 3) 文件生成单位： 清算编号。
- 4) 发送目标： 结算参与人PROP信箱。
- 5) 发送时间： 每个交易日日终后。
- 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	类型	长度	说明	证券锁定明细数量
1	SCDM	Character	2	市场代码	'01'
2	HYDM	Character	8	结算参与人的清算编号	清算编号
3	SJLX	Character	3	数据类型	020
4	ZQZH	Character	10	证券账户	证券账户
5	XWH	Character	5	业务单元	指定交易单元
6	ZQDM	Character	6	证券代码	证券代码
7	ZQLB	Character	2	证券类别	证券类别
8	LTLX	Character	1	流通类型	流通类型
9	QYLB	Character	2	权益类别	权益类别
10	GPNF	Character	4	挂牌年份	挂牌年份
11	SL1	Character	16	数量 1	锁定数量
12	SL2	Character	16	数量 2	#
13	BH1	Character	20	编号 1	锁定序号； 填空则表示为证券锁定模拟运行数据
14	BH2	Character	20	编号 2	当锁定原因为“CZS”时，填原可售交收锁定的锁定序号
15	FZDM	Character	3	辅助代码	锁定原因； KSS： 可售交收锁定； CZS： 待处置交收锁定
16	RQ	Character	8	日期	锁定日期
17	BCSM	Character	40	补充说明	资金账号
18	BY	Character	20	备用	
	合计		186		

2. tzxx（通知信息文件）

- 1) 文件名称： tzxx.mdd
- 2) 数据内容： 包含最低备付调整、最低备付不足、交收违约金扣收通知、债券折算率/折算值调整、权益登记信息及轮候冻结生效通知、科创板配售登记信息、个人转让上市公司限售股交易所得税数据、清算交割准备金余额、价差保证金明细数据、证券账户最低备付明细数据、互保类结算保证金调整、股权激励期权登记信息、CDR现金权益登记信息、CDR现金权益清算信息、CDR送股登记信息和沪市A股质押比例信息\已报送的最高额度控制生效情况数据、科创板配售登记信息和科创板配售终止信息等各类通知数据

- 3) 文件生成单位： 结算参与人信箱
- 4) 发送目标： 结算参与人PROP信箱
- 5) 发送时间： 每个交易日日终后
- 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	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	TZLB	Character	3		通知类别
3	TZRQ	Character	8		通知日期
4	QSBH	Character	8		结算参与人的清算编号
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
11	ZH2	Character	25		账户 2
12	RQ1	Character	8		日期 1
13	RQ2	Character	8		日期 2
14	JE1	Character	19	±9999999999999999.99	金额 1
15	JE2	Character	19	±9999999999999999.99	金额 2
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
20	BL2	Character	17	9999999.999999999	比率 2
21	SL1	Character	16	±9999999999999999	数量 1
22	SL2	Character	16	±9999999999999999	数量 2
23	FZDM	Character	10		辅助代码
24	BZ	Character	80		备注
25	BY	Character	40		备用

填写说明：

字段名	说明	最低备付调整明细信息	证券账户最低备付明细数据	证券账户最低备付明细数据（管理人专用）
SCDM	市场代码	‘01’	‘01’	‘01’
TZLB	通知类别	‘020’	‘030’	‘050’
TZRQ	通知日期	当天日期	当天日期	当天日期
QSBH	清算编号	清算编号	清算编号	清算编号
ZQDM	证券代码	#	#	#
ZQLB	证券类别	#	#	#
LTLX	流通类型	#	#	#

字段名	说明	最低备付调整明细信息	证券账户最低备付明细数据	证券账户最低备付明细数据（管理人专用）
QYLB	权益类别	#	#	#
GPNF	挂牌年份	#	#	#
ZH1	账户 1	备付金账户	备付金账户	备付金账户
ZH2	账户 2	#	证券账户	证券账户
RQ1	日期 1	生效日期	生效日期	生效日期
RQ2	日期 2	调整日期	调整日期	调整日期
JE1	金额 1	最低备付金额	证券账户最低备付金额	#
JE2	金额 2	上月买入金额	上月买入金额	上月买入金额
JE3	金额 3	#	#	#
JG1	价格 1	#	#	#
JG2	价格 2	#	#	#
BL1	比率 1	最低备付收取比例	#	托管人最低备付收取比例
BL2	比率 2	#	#	#
SL1	数量 1	统计天数	统计天数	统计天数
SL2	数量 2	#	#	#
FZDM	辅助代码	最低备付计收业务类别	最低备付计收业务类别	最低备付计收业务类别
BZ	备注	备付金账户名称	备付金账户名称	备付金账户名称
BY	备用	#	#	#

说明：

(1) 如果 JE2 字段出现字段超长情况，即 JE2 大于 999999999999.99 时，JE2 字段填写为-1，相应的金额填入 BY 字段。

(2) 最低备付计收业务类别：

FZQL：非债券类

ZQXQ：债券现券

ZQHG：债券回购

3. ywhb（业务回报文件）

- 1) 文件名称： ywhb.mdd。
- 2) 数据内容： 包含各类登记结算业务的回报数据，如通过PROP系统申报的各类业务回报数据。
- 3) 文件生成单位： 结算参与者信箱。
- 4) 发送目标： 结算参与者PROP信箱。
- 5) 发送时间： 日终处理后。
- 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	类型	长度	说明	货银对付优先/免除标识指令申报结果	货银对付待处置证券指令申报结果
1	SCDM	Character	2	市场代码	01: 上海 A 股市场	01: 上海 A 股市场
2	QSBH	Character	8	结算会员的清算编号	#	#
3	YWLX	Character	3	业务类型	830	831
4	YWLY	Character	2	业务来源	02: PROP 申报	02: PROP 申报
5	SBLX	Character	2	申报类型	00: 优先标识指令 01: 免除标识指令	#
6	JGDM	Character	4	结果代码	0000: 申报成功 其他为申报失败	0000: 处理成功 其他为处理失败
7	JGSM	Character	40	结果说明	结果代码的结果说明	结果代码的结果说明
8	SLBH	Character	20	受理编号	受理编号	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	T 日	T 日
13	SBSJ	Character	6	申报时间	#	#
14	ZQDM	Character	6	证券代码	证券代码	证券代码
15	ZQLB	Character	2	证券类别	证券类别	证券类别
16	LTLX	Character	1	流通类型	流通类型	流通类型
17	QYLB	Character	2	权益类别	权益类别	权益类别
18	GPNF	Character	4	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份
19	FZDM	Character	10	辅助代码	#	#
20	ZQZH1	Character	10	证券账户 1	证券账户	证券账户
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	申报数量	申报数量	申报处置数量
25	CGSL	Character	16	成功数量	#	可售交收锁定实际转待处置数量
26	BCYE	Character	16	本次余额	#	#
27	JE1	Character	19	金额 1	#	#
28	JE2	Character	19	金额 2	#	#
29	RQ	Character	8	日期	#	#
30	BCSM	Character	40	补充说明	备付金账户	备付金账户

说明：对于业务类型‘830’，表示日间优先/免除标识指令已申报成功，申报成功的指令是否生效需参考当日资金核验结果。

4. zqbd（证券变动文件）

- 1) 文件名称： zqbdXXXXX.mdd（XXXXX为清算编号）
- 2) 数据内容： 包含当日证券账户中各类证券及权益的变动数据。对于托管银行结算的账户，数据同时发送至托管银行。
- 3) 文件生成单位： 清算编号

- 4) 发送目标： 结算参与人PROP信箱
- 5) 发送时间： 每个交易日日终后
- 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	类型	长度	说明	证券锁定	证券锁定解锁
1	SCDM	Character	2	市场代码	01	01
2	QSBH	Character	8	指定交易券商的清算编号（对于指定结算的账户，填指定结算会员的清算编号）	指定交易券商的清算编号（对于指定结算的账户，填指定结算会员的清算编号）	指定交易券商的清算编号（对于指定结算的账户，填指定结算会员的清算编号）
3	ZQZH	Character	10	证券账户	证券账号	证券账号
4	XWH	Character	5	交易单元	指定交易单元	指定交易单元
5	ZQDM	Character	6	证券代码	证券代码	证券代码
6	ZQLB	Character	2	证券类别	证券类别	证券类别
7	LTLX	Character	1	流通类型	流通类型	流通类型
8	QYLB	Character	2	权益类别	权益类别	权益类别
9	GPNF	Character	4	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份
10	BDSL	Character	16	变动数量	锁定数量	解锁数量
11	BDLX	Character	3	变动类型	10C	10D
12	BDRQ	Character	8	变动日期	T 日	T 日
13	SL	Character	16	数量(保留字段)	#	#
14	BH	Character	20	编号(保留字段)	#	#
15	BY	Character	20	备用	锁定原因,左起3位有效; KSS: 可售交收锁定; KZC: 可售交收锁定转为待 处置交收锁定	锁定原因,左起3位有效; KSS: 可售交收锁定; CZS: 待处置交收锁定; KZC: 可售交收锁定转为待 处置交收锁定

5. zqye (证券余额对账文件)

- 1) 文件名称： zqyeXXXXX.mdd (XXXXX为清算编号)。
- 2) 数据内容： 包含当日日终证券账户的各类证券余额信息。对于托管银行结算的账户，数据同时发送至托管银行。
- 3) 文件生成单位： 清算编号。
- 4) 发送目标： 结算参与人PROP信箱。
- 5) 发送时间： 每个交易日日终后。
- 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	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
2	QSBH	Character	8		指定交易券商的清算编号（对于指定结算的账户，填指定结算会员的清算编号）
3	ZQZH	Character	10		证券账户
4	XWH	Character	5		指定交易单元
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	YE1	Character	16	±9999999999999999	余额 1（全部余额）
11	YE2	Character	16	±9999999999999999	余额 2；冻结数量（含权利受限部分）和锁定数量总额
12	BY	Character	12		备用
13	JZRQ	Character	8		截止日期

8) 数据说明：

(1) 本文件包含所有指定交易证券账户的余额数据，包括无限售流通股、限售流通股（含战略配售股份）、非流通股以及各类权益数据。

(2) 余额 1 字段的内容为证券账户持有某证券品种的全部余额，包括被冻结部分的余额。

(3) 余额 2 字段的数量，包括冻结数量（包含因报送不限制卖出冻结信息而引起的权利受限登记）和锁定数量，为两部分的合计。本字段不体现账户冻结信息。

(4) 本文件仅提供客户信用证券账户的余额数据，不提供证券公司客户信用交易担保证券账户的相关数据，即数据中的证券账户（ZQZH）填写客户信用证券账户，不再填写客户信用交易担保证券账户，备用（BY）字段填空。

(5) 股票（含沪市主板、科创板）余额的数量单位为“股”；CDR、基金和权证余额的数量单位为“份”；记账式债券余额的数量单位为“元”，信用保护凭证的数量单位为“张”。

(6) 如证券账户为转融通担保证券账户，则余额记录中 BY 字段内容为转融通担保证券明细账户。

(7) 若证券类别为“DT”，则备用（BY）字段表示权益次数，n 表示第 n 次。

联系方式

技术咨询：021-68606776

业务咨询：021-68606427（货银对付改革）

021-68606527（差异化最低备付比例）