

# 关于基金公司申请参与证券出借有关事项的通知

各相关公募基金管理人：

为明确公募基金申请参与转融通证券出借流程（以下简称“证券出借”），现将有关事项通知如下：

一、采用券商结算模式的公募基金产品参与证券出借的，应按照证券交易所有关规定，由托管该产品的证券公司代其向证券交易所申请开通并取得相关权限后，即可参与证券出借。

二、采用托管行结算模式的公募基金产品参与证券出借的，由其基金管理人（以下简称“独立出借人”）按照以下流程申请参与证券出借：

1、独立出借人与相关托管行应先在中国证券金融公司（以下简称“我司”）仿真测试环境进行全业务测试（测试流程详见《转融通业务仿真测试环境使用指南》，附件1）。测试通过后，我司将向独立出借人反馈《独立出借人转融通业务仿真测试结果》（附件2）。

2、独立出借人及相关托管行通过深证通网站提交与我司 FDEP 和 MR 配对的申请。（具体操作流程可见《深证通金融数据交换平台转融通业务上线操作指引》，附件3）。已与我司建立 FDEP 和 MR 配对关系的，无需再次进行配对申请。

3、独立出借人应按照沪深证券交易所相关要求申请出

借权限。

4、出借权限申请成功后，独立出借人向我司提交《独立出借人转融通业务技术系统申请表》(附件4)和《转融通合约清算数据发送申请》(附件5)。独立出借人应填写拟用于参与出借的交易单元对应的所有托管行信息。我司将在转融通平台为独立出借人开立结算机构，并将结算机构代码及托管行结算机构信息反馈给独立出借人。

5、独立出借人取得我公司反馈的结算机构代码后，应按照我司《转融通参与人数据接口规范》要求，报备相关基金产品的账户、托管单元等基本信息和托管银行基本信息。报备完成后，即可参与证券出借。

特此通知。

附件：

1. 《转融通业务仿真测试环境使用指南》
2. 《独立出借人转融通业务仿真测试结果》
3. 《深证通金融数据交换平台转融通业务上线操作指引》
4. 《独立出借人转融通业务技术系统申请表》
5. 《转融通合约清算数据发送申请》

中国证券金融股份有限公司

2019年7月4日

附件 1

# 转融通业务仿真测试环境使用指南

(Ver 2.0)

上海证券交易所

深圳证券交易所

中国证券金融股份有限公司

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一九年六月

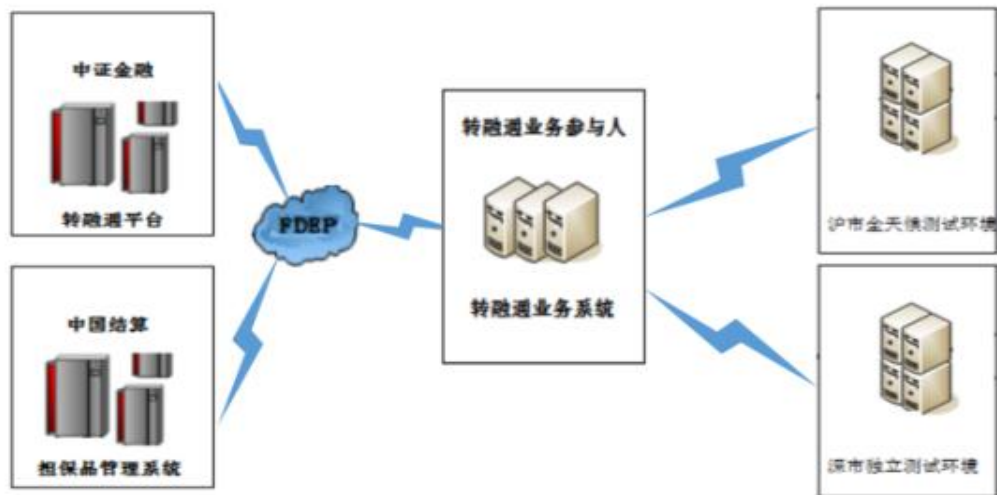
## 修订记录

版本	修订日期	修订描述（位置、内容）	修订人	核准人
1.0	2017-6-1	创建初始版本	陈亮	张绍莲

## 一、转融通业务仿真测试环境简介

为更好地支持转融通业务参与人进行转融通业务创新和系统变更，中国证券金融股份有限公司（以下简称“中证金融”）联合上海证券交易所（以下简称“上交所”）、深圳证券交易所（以下简称“深交所”）、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）、深圳证券通信有限公司（以下简称“深证通”），自2017年7月起向市场定期提供转融通业务仿真测试环境（暂定每月第二周周一至周五）。该仿真测试环境基于沪市全天候测试环境和深市独立测试环境建设，提供转融通业务全链条、全流程的测试服务。

转融通业务仿真测试环境包括中证金融转融通平台测试系统、中登担保品管理测试系统、沪市全天候测试环境、深市独立测试环境，以及转融通业务参与人相关技术系统，系统连接示意图如下：



图一、转融通业务系统连接示意图

## 二、仿真测试系统运行方案

### （一）测试申请

2017年7月1日前已具备了转融通业务资格的参与者，无需申请，可直接接入转融通业务仿真测试环境。2017年7月1日前尚未开通转融通业务资格的参与者，首次接入，需向中证金融tech@csf.com.cn提交转融通业务仿真测试申请表（附件4/附件5附件6），并收到中证金融测试确认表（附件7/附件8/附件9）后方可接入转融通业务仿真测试环境。测试申请通过后，后续测试无需再次申请。

## （二）测试时间

每月第二周的周一至周五开放转融通业务仿真测试环境，模拟5个交易日的交易和结算。每交易日的具体测试时间安排，上海市场以沪市全天候测试环境时间安排为准，深圳市场以深市独立测试环境时间安排为准，担保品管理系统日间划转服务时间为9:30-11:30。每轮测试前一个交易日，中证金融和中登开放仿真测试环境，供参与者做联通性测试，且日终下发清算对账数据。

## （三）测试内容

包含转融资、转融券和保证金业务，以及上述业务的清算与交收。如参与者有特殊测试需求，请提前5个工作日联系中证金融，将测试具体需求发送至tech@csf.com.cn。

## （四）初始数据安排

1、**账户信息**：仿真测试环境下，参与者相关测试账户信息请以沪市全天候测试环境和深市独立测试环境数据为准。中证金融转融通业务相关测试账户信息如表一：

证券账户类型	交易单元	证券账户
沪市转融通专用证券账户	26372	D890792580
深市转融通专用证券账户	391961	0689900051
沪市转融通担保证券账户	26373	D890792572
深市转融通担保证券账户	391962	0689900052
资金交收账户类型	交收资金账户	
沪市转融通资金交收账户	040000000000251167	
深市转融通资金交收账户	B001650126	
沪市转融通担保资金账户	040000000000251269	
深市转融通担保资金账户	B001650127	

表一：中证金融转融通业务账户信息表

**2、资金和证券初始安排：**每轮测试前，中证金融和中国结算为每个借入人转融通担保资金明细账户设置初始资金各 2 亿元。担保证券明细账户的初始证券持仓以沪市全天候测试环境和深市独立测试环境数据为准。如参与人对转融通业务相关证券账户初始持仓和相关资金账户初始金额有特殊需求，请提前 5 个工作日联系中证金融，分别按照附件 1、2 格式要求填写初始数据需求，发送至 tech@csf.com.cn。

**3、初始合约：**每轮测试前，中证金融转融通测试系统将清除所有历史合约。如参与人对初始合约有特殊需求，请提前 5 个工作日联系中证金融，按照附件 3 格式要求填写初始合约需求，发送至 tech@csf.com.cn。

4、出借权限：仿真测试环境下，出借人交易单元具备出借权限，无需向沪深证券交易所申请开通。

#### （五）其他说明

对于其它未尽事宜，中证金融和中国结算将通过转融通测试交流QQ群（260512248）发布。

### 三、仿真测试环境接入参数

#### （一）中证金融转融通平台和中国结算担保品管理系统接入参数

转融通业务参与者通过互联网连接深证通 FDEP 测试平台，实现与中证金融转融通平台、中国结算担保品管理系统的连接，具体接入参数如表二：

参数名称	参数
深证通 FDEP 消息服务器	58.253.80.173:7001
深证通 FDEP 文件服务器	58.253.80.173:7015
中证金融 FDEP UserID	R_ZHENGJIN01
中证金融 FDEP APPID	zrt01
中证金融 FDEP 业务类型编号	17
中证金融 FDEP 参数文件群发业务类型名称	ZRTCS
中国结算 FDEP UserID	R_BEIJING01
中国结算 FDEP APPID	zrt01
参测证券公司初始签到密码	123456

表二：中证金融转融通平台和中国结算担保品管理系统接入参数表

#### （二）沪市全天候测试环境接入参数



沪市全天候测试环境接入方式:《上海证券交易所全天候测试环境使用指引\_20141215》(请参见上交所官网=>服务=>交易服务=>交易技术支持专区=>技术服务栏目

<http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/services/>)

### (三) 深市独立测试环境接入参数

深市独立测试环境接入方式:《深圳证券交易所新一代交易独立测试系统指南》(请参见深交所官网=>技术专栏=>交易独立测试系统栏目

(<http://www.szse.cn/main/rule/jysywn/dlcsxt/xgwd/>)

## 四、测试联系方式

### (一) 联系电话及邮箱

中证金融: (010-63211719, 010-63211761; tech@csf.com.cn)

中国结算总部:

担保品测试服务 (010-50938662; nxsun@chinaclear.com.cn)

担保品技术支持 (010-50938987; zxfan@chinaclear.com.cn)

上交所: 技术服务电话 (4009003600)

中国结算上海分公司: 全天候测试热线电话 (021-68419167)

PROP 技术支持热线电话 (021-62321666)

深交所: 交易技术支持 (0755-88668223; testsystem@szse.cn)

深证通: 深证通机房 (0755-83182222; v5test@sscc.com)

中国结算深圳分公司: 结算技术支持 (0755-25946080)

### (二) 测试交流 QQ 群

转融通测试交流 QQ 群: 260512248

上交所技术服务 QQ 群：130170298

中国结算上海分公司 QQ 群：149247290

深交所交易开发测试 QQ 群：288321593

中国结算深圳分公司技术交流 QQ 群：91355646

**附件：**

附件 1：担保资金明细账户资金余额变更申请 DBF 库

附件 2：担保证券明细账户证券持仓变更申请 DBF 库

附件 3：初始合约新增申请 DBF 库

附件 4：转融通业务仿真测试借入人业务申请表

附件 5：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请表

附件 6：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请表

附件 7：转融通业务仿真测试借入人业务申请确认表

附件 8：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请确认表

附件 9：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请确认表

## 附件 1：担保资金明细账户资金余额变更申请 DBF 库

NO	字段名	类型	长度	说明
1	JSJG	Character	6	结算机构
2	HBDM	Character	1	货币代码
3	ZJYE	Numeric	16,2	资金余额
4	QSBH	Character	8	清算编号
4	SXSJ	Character	8	生效日期

注：担保资金余额变更是指参与人对仿真测试环境担保明细资金账户余额有调整需求时向中证金融测试提交变更申请的 DBF 库，多次报送的，以最后一次报送为准。申报后的初始持仓永久有效。

- 1) 结算机构：报的结算机构，是证券公司在测试环境的结算结构代码。
- 2) 货币代码：资金的货币标识，0 为人民币。
- 3) 资金余额：希望调整到的资金余额，须大于零，不符合要求的记录将一律予以剔除。
- 4) 清算编号：申报时填写申报参与人对应的清算编号。在返回被剔除的申报记录时，该字段可便于参与人检查自己的申报数据。
- 5) 生效日期：资金余额调整生效时间。

## 附件 2：担保证券明细账户证券持仓变更申请 DBF 库

NO	字段名	类型	长度	说明
1	JYS DM	Character	1	交易所代码
2	ZQZH	Character	10	证券账号
3	ZQDM	Character	6	证券代码
4	ZQSL	Numeric	11,0	证券数量
5	QSBH	Character	8	清算编号
6	SXSJ	Character	8	生效日期

注：持仓变更是指参与人对仿真测试环境担保明细股东代码持仓有调整需求时，提交变更申请的 DBF 库。多次报送的，以最后一次报送为准。申报后的初始持仓永久有效。

- 1) 交易所代码：报送的交易必须为沪深交易所，0 为深圳，1 为上海。
- 2) 证券账号：报送的证券账户必须为沪深测试环境合法的转融通担保明细证券账户，如证券账号不合法，将一律予以剔除。
- 3) 证券代码：报送的证券需为沪深两市测试环境的 A 股、债券、基金等实际持有且挂牌交易的证券，如不是将一律予以剔除。
- 4) 证券数量：希望的持仓证券数量，股票数量单位为股，债券数量单位为张、基金数量单位为份。债券的数量必须是 10 的整数倍，不符合要求的记录将一律予以剔除。
- 5) 清算编号：申报时填写申报参与人对应的清算编号。在返回被剔除的申报记录时，该字段可便于参与人检查自己的申报数据。
- 6) 生效日期：股份持仓调整生效时间。

### 附件 3：初始合约新增申请 DBF 库

NO	字段名	类型	长度	说明
1	JSJG	Character	6	结算结构代码
2	JSBFJZH	Character	32	结算备付金账号
3	JYS DM	Character	1	交易所代码
4	ZQZH	Character	10	证券账号
5	TGDY	Character	6	托管单元
6	ZQDM	Character	6	证券代码
7	ZRTL B	Character	1	转融通类别
8	HYSL	Numeric	11,0	合约成交证券数量
9	HYJE	Numeric	11,0	合约成交金额
10	CYRL B	Character	1	参与人类别
11	CJRQ	Character	8	成交日期
12	ZRTQX	Numeric	3,0	转融通期限
13	DFZQZH	Character	10	对手方证券账号
14	DFJYDY	Character	6	对手方交易单元
15	SQBH	Character	8	申请编号

注：新增初始合约，是指参与人在仿真测试环境有新增合约的需求时，提交变更申请的 DBF 库。多次报送的，以最后一次报送为准，申请成功后仅本次测试有效。

- 1) 结算机构：报的结算机构，是证券公司在测试环境的结算结构代码。
- 2) 结算备付金账号：托管单元对应的结算备付金账号。
- 3) 交易所代码：0 为深圳，1 为上海。
- 4) 证券账号：证券账户需是沪深测试环境合法的融券专用账户或出借人账户。
- 5) 托管单元：对应证券账号的托管单元。
- 6) 证券代码：证券需为沪深两市测试环境的 A 股、债券、基金等实际挂牌交易的证券。
- 7) 转融通类别：0 为转融资，1 为转融券。
- 8) 合约成交数量：股票单位为股，债券单位为张，基金单位为份，数量必须大于零。
- 9) 合约成交金额：转融资合约有效，转融资的金额，金额必须大于零。
- 10) 参与人类别：0 为出借人，1 为借入人。
- 11) 成交日期：是合约达成的日期，必须是 YYYYMMCC 格式。
- 12) 转融通期限：是转融通合约的期限，以中证金融下发期限库的定义为准。
- 13) 对方证券账号：约定的转融券合约必填。
- 14) 对手方交易单元：约定的转融券合约必填。
- 15) 申请编号：填参与者申请编号，中证金融新合约信息的参与者订单号字段填该编号。

#### 附件 4：转融通业务仿真测试借入人业务申请表

申请人基本信息（请根据企业法人营业执照填写）			
申请人名称		申请人简称	
营业执照注册号		营业执照发证单位	
组织机构代码			
申请人联系方式			
联系人姓名		手 机	
联系人身份证号码		办公电话	
电子邮件			
申请人融资融券业务情况			
中登参与人编码		测试开始日期	
融券专用证券账户信息 (深)	股东代码		
	托管席位		
	结算备付金账号		
融券专用证券账户信息 (沪)	股东代码		
	托管席位		
	结算备付金账号		
FDEP 信息			
FDEP 文件小站号		FDEP MR 小站号	

注：本表格是测试参与人向中证金融报的申请表，本表格请填测试环境信息。

## 附件 5：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请表

申请人基本信息（请根据企业法人营业执照填写）			
申请人名称		申请人简称	
营业执照注册号		营业执照发证单位	
组织机构代码			
申请人联系方式			
联系人姓名		手 机	
电子邮件		办公电话	
申请人融资融券业务情况			
中登参与人编码		测试开始日期	
FDEP 信息			
FDEP 文件小站号		FDEP MR 小站号	

注：本表格是测试参与人向中证金融报的申请表，本表格请填测试环境信息。

## 附件6：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请表

申请人基本信息（请根据企业法人营业执照填写）			
申请人名称		申请人简称	
营业执照注册号		营业执照发证单位	
组织机构代码			
申请人联系方式			
联系人姓名		手机	
电子邮件		办公电话	
申请人融资融券业务情况			
中登参与人编码		测试开始日期	
FDEP 信息			
FDEP 文件小站号		FDEP MR 小站号	

注：本表格是测试参与人向中证金融报的申请表，本表格请填测试环境信息。



## 附件 7：转融通业务仿真测试借入人业务申请确认表

申请人信息			
申请人名称		申请人简称	
申请人结算机构代码		签到密码	123456
担保品账户信息			
沪市担保明细股东账号		沪市担保品交易单元	26373
深市担保明细股东账号		深市担保品交易单元	391962
担保明细资金账号			
中证金融账户信息			
沪市担保明细股东账号	D890792572	沪市担保品交易单元	26373
深市担保明细股东账号	0689900052	深市担保品交易单元	391962
沪市转融通专用证券账户	D890792580	沪市转融通交易单元	26372
深市转融通专用证券账户	0689900051	深市转融通交易单元	391961
沪市转融通资金交收账户	040000000000251167		
深市转融通资金交收账户	B001650126		
沪市转融通担保资金账户	040000000000251269		
深市转融通担保资金账户	B001650127		
中证金融 FDEP 信息			
中证金融 FDEP UserID	R_ZHENGJIN01		
中证金融 FDEP APPID	zrt01		
中证金融 FDEP 业务类型编号	17		
中证金融 FDEP 参数文件群发业务类型名称	ZRTCS		
中国结算 FDEP 信息			
中国结算 FDEP UserID	R_BEIJING01		
中国结算 FDEP APPID	zrt01		

注：本表格为中证金融反馈给申请人的业务申请确认表，由中证金融负责填写。

附件 8：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请确认表

申请人信息			
申请人名称		申请人简称	
申请人结算机构代码		签到密码	
中证金融账户信息			
沪市担保明细股东账号	D890792572	沪市担保品交易单元	26373
深市担保明细股东账号	0689900052	深市担保品交易单元	391962
沪市转融通专用证券账户	D890792580	沪市转融通交易单元	26372
深市转融通专用证券账户	0689900051	深市转融通交易单元	391961
沪市转融通资金交收账户	040000000000251167		
深市转融通资金交收账户	B001650126		
沪市转融通担保资金账户	040000000000251269		
深市转融通担保资金账户	B001650127		
中证金融 FDEP 信息			
中证金融 FDEP UserID	R_ZHENGJIN01		
中证金融 FDEP APPID	zrt01		
中证金融 FDEP 业务类型编号	17		
中证金融 FDEP 参数文件群发业务类型名称	ZRTCS		
中国结算 FDEP 信息			
中国结算 FDEP UserID	R_BEIJING01		
中国结算 FDEP APPID	zrt01		

注：本表格为中证金融反馈给申请人的业务申请确认表，由中证金融负责填写。

附件 9：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请确认表

申请人信息			
申请人名称		申请人简称	
申请人结算机构代码		签到密码	
中证金融账户信息			
沪市担保明细股东账号	D890792572	沪市担保品交易单元	26373
深市担保明细股东账号	0689900052	深市担保品交易单元	391962
沪市转融通专用证券账户	D890792580	沪市转融通交易单元	26372
深市转融通专用证券账户	0689900051	深市转融通交易单元	391961
沪市转融通资金交收账户	040000000000251167		
深市转融通资金交收账户	B001650126		
沪市转融通担保资金账户	040000000000251269		
深市转融通担保资金账户	B001650127		
中证金融 FDEP 信息			
中证金融 FDEP UserID	R_ZHENGJIN01		
中证金融 FDEP APPID	zrt01		
中证金融 FDEP 业务类型编号	17		
中证金融 FDEP 参数文件群发业务类型名称	ZRTCS		
中国结算 FDEP 信息			
中国结算 FDEP UserID	R_BEIJING01		
中国结算 FDEP APPID	zrt01		

注：本表格为中证金融反馈给申请人的业务申请确认表，由中证金融负责填写。

## 独立出借人转融通业务仿真测试结果

内容	仿真交易项目	是否正常	问题描述
接入和安全	转融通平台签到		
	转融通平台签到密码修改		
	转融通平台签退		
清算文件接收 和处理	T 日新合约信息		
	T 日合约偿还明细库		
	T 日合约对帐库		
	T+1 日交收通知库		
	展期结果通知库		
	偿还划付差错库		
	转融通权益处理库		
	独立出借人交易单元报备库		
日间业务申报 (转融通平台)	约定出借证券同意展期申报		
	约定出借证券同意展期申报撤单		
	沪市科创板证券申请提前了结		
	沪市科创板证券申请提前了结撤单		
转融券出借(上 交所综合业务 平台)	转融券出借约定申报\撤单		
	转融券出借非约定申报\撤单		
	综合业务回报		
转融券出借(深 交所综合协议 平台)	转融券出借约定申报\撤单		
	转融券出借非约定申报\撤单		
	综合业务回报		
其他项目	(可自行添加)		

## 填写说明：

- 1、是否正常项：填写“是”表示测试没有问题，“否”表示测试有问题，“-”表示未测试。
- 2、基金产品如在托管行托管，则对应的托管行必须与转融通平台正常对接，并能正确处理相关转融通业务清算数据。

## 深证通金融数据交换平台转融通业务上线操作指引

独立出借人通过深圳证券通信有限公司网站办理金融数据交换平台转融通业务上线的流程如下：

### 1. 用户登录

登录深圳证券通信有限公司网站：

<https://biz.sccc.com/>

用户登录：已有 userID 的用户初次使用本站办理业务，需要在本站注册。

注册：点击，链接至帐号注册界面。

登录成功后开始办理相关业务

### 2. 选择业务

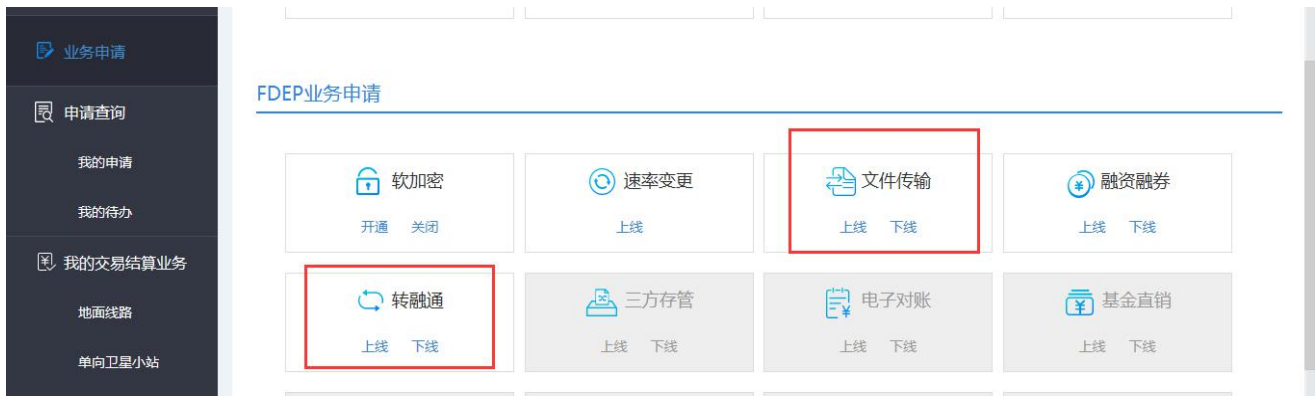
进入用户中心，选择业务申请开始办理业务。

选择转融通上线办理开通 FDEP 消息传输系统。

选择文件传输上线办理开通 FDEP 文件传输系统。

中证金融的 FDEP 文件小站号：R\_ZHENGJIN01。

中证金融的 FDEP MR 小站号：R\_ZHENGJIN01。



### 3.填写信息

填写并提交业务办理订单，提交申请后将有短信通知申请人订单受理进度。

### 4.对端确认

业务对端登录平台对订单进行确认，确认结果将有短信通知申请人及对端。

### 5.业务审核

FDEP 工作人员将对业务办理订单进行审核。审核结果将有短信通知申请人及对端。

### 6.运维配置

FDEP 运维工程师对业务订单进行配置操作。每个工作日 11:00 前提交并完成审核的订单将于当天闭市后进行配置操作，当日 11:00 后完成审核的订单将于第二个工作日闭市后进行配置。

### 7.业务上线

### 8.深圳证券通信有限公司联系方式：

运维支持：0755-23826278

7x24 小时运维热线：0755-83182222

运维 E-mail：[fdep@sscc.com](mailto:fdep@sscc.com)

仿真测试支持：0755-23826503

业务办理咨询：0755-23826196

## 独立出借人转融通业务技术系统申请表

出借人信息			
出借人名称			
出借人联系方式			
	姓名	电话	邮件
技术部门负责人			
指定技术联系人			
指定传真			
FDEP MR 小站号			
出借人 FDEP 信息			
出借人 FDEP 文件小站号			
托管机构信息（一）			
托管机构名称			
托管机构联系方式（一）			
	姓名	电话	邮件
技术部门负责人			
指定技术联系人			
指定传真			
托管机构 FDEP 信息（一）			
托管机构 FDEP 文件小站号			
托管机构信息（二）			
托管机构名称			
托管机构联系方式（二）			
	姓名	电话	邮件
技术部门负责人			
指定技术联系人			
指定传真			
托管机构 FDEP 信息（二）			
托管机构 FDEP 文件小站号			
（管理人公章）			



负责人：

中国证券金融股份有限公司			
参与者结算机构代码			
托管行结算机构代码			
联系方式			
	姓名	电话	邮件
指定联系人	吴忠华	010-63211771	wuzhh@csf.com.cn
转融通运维电话	010-63211700		
转融通运维交流 QQ 群	190490387		
指定传真	010-63211601		
FDEP 信息			
FDEP 文件小站号	R_ZHENGJIN01		
FDEP MR 小站号	R_ZHENGJIN01		

说明：

1、托管行需全量填写，即拟参与出借的交易单元对应的所有托管行信息均需填写。托管行信息栏表格可自行添加。

2、填写过程中如有问题，请联系 010-63211700。

3、本申请表一式两份。

附件 5

## 转融通合约清算数据发送申请

中国证券金融股份有限公司：

我公司管理的产品参与转融通证券出借的，请贵公司将相关合约清算数据同时发送给我公司及产品托管人。

我公司承诺在产品参与转融通证券出借前，通过 FDEP 文件传输系统向贵公司报送“独立出借人交易单元报备库

(DLCJRJYDYBB.dbf)”文件，并在新增交易单元用于转融通证券出借业务，或者已报备的交易单元发生转让、出租、注销等情形时，按照贵公司《转融通参与人数据接口规范》的要求向贵公司重新报送“独立出借人交易单元报备库

(DLCJRJYDYBB.dbf)”文件，因我公司漏报、错报上述信息，导致我公司及产品托管人无法正常接收转融通合约清算数据的，相关责任和后果由我公司承担。

联系人：

电话：

手机：

传真：

申请单位全称：

(加盖公章)

年 月 日