

# 转融通参与人数据接口规范

## （Ver 1.09）

中国证券金融股份有限公司  
二〇一二年八月

## 前 言

为加快推进转融通业务技术平台的建设工作，全面落实转融通业务技术平台和各参与人技术系统之间的数据接口，我们制定了本规范文件。

本文根据《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则（试行）》中的内容，详细规范了参与人通过转融通业务技术平台完成的日间申报数据接口以及日终清算数据文件接口的具体内容，包括借入人的借资借券申报、合约展期和出借人提前偿还申报以及转融通合约归还交收通知等清算数据文件接口等内容。

本文没有包括出借人通过沪市综合业务平台或深市综合协议平台出借证券申报的接口内容，其相关内容由两交易所分别制定和发布。

本版规范由中国证券金融股份有限公司负责起草，并负责具体的解释工作。

## 历次更新

版本	日期	修订说明	修订人	审核人
V1.09	20120920	1、增加附录 I 合约状态, 附录 J 债权债务变动方向, 附录 K 债权债务类型, 附录 L 债权债务明细标识 2、修改 T 日合约偿还明细库 3、删除 T 日合约偿还汇总库 4、增加“偿还划付差错库” 5、合约对账库增加展期在途数量、在途金额 6、T+1 交收通知库中增加待收付资产数量、待收付资产金额 7、权益处理库修改为, 每日发送参与权益清算的数据 8、对“保证金追缴通知库”的“负债总金额”字段调整为“转融通总负债” 9、去除某些接口文件中标识的 18:00 下发的字样 10、去除日初 T 日转融通期限库、T 日转融通标的期限费率库、T 日转融通可充抵保证金证券库 9:00 下发的字样 11、增加日间接口: 借入人综合信息查询 12、上海市场增发买卖标识 (bsflag) 修正为: 0J; 买卖标识 (bsflag) 0D 只支持深圳增发。		
V1.08.2	20120809	1、增加头寸资金接口 2、错误代码增加 2076: 合约已超过最长展期期限		
V1.07	20120625	1、新增第三章第十二节, “证券出借交易单元报备库 (CJJYDYBB.dbf); 2、新增第三章第十三节, “证券出借人资料报备库/出借人资料报备确认库 (CJRZLBB.dbf/CJRZLBBQR.dbf); 3、转融通权益处理库修改字段类型: MGBCJE (每股补偿金额)、MGBCGS (每股补偿股数) 由原来的 “N9,7” 修改为 “N12,8”; 4、转融通错误代码调整: 0007 不存在改为 0008; 增加错误号 0016, 0017, 0037, 1017, 1018, 1019, 2013, 2018, 5019, 5026; 1015 号错误改成 “没有签到或已经签退”; 5、增加附录 H, 合约类别, 明晰各种合约类别的含义, 以及到期日等的填报规则, 资金划付的细节; 对新合约信息库中的罚息 (偿还违约罚息)、违约金 (出借违约罚息) 进行了详细的解释; 3、删除: “转融通成交库” 和 “合格出借人库”。		
V1.06	20120515	保证金追缴通知库的 BZJXJYE 字段, 改为保证金现金实际余额, 不包含在途的买入、卖出金额		
V1.05	20120508	1、保证金追缴通知库 (ZRTBZJZJTZ.dbf), 增加担保权益现金调整, 被借用保证金现金字段;		

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

		<p>2、调整 ZRTBZJZJTZ 库字段顺序</p> <p>3、合约类型增加“保证金违约合约”</p> <p>4、当日新合约库增加“现金替代单位”，如果该合约是因为现金替代而生成，则金额会大于 0</p>		
V1.04	20120416	<p>转融通权益处理库：</p> <p>1、增加 zqdm(证券代码)、BCQDBZ（补偿确定标志）两个字段。</p> <p>2、修改权益类别。</p> <p>3、明确合约到期日、权益到帐日、权益补偿合约号的具体含义。</p>		
V1.03	20120402	T 日合约对账库增加 LLDQR(理论到期日)、HYDQR(合约到期日)		
V1.02	20120329	T 日新合约增加违约金字段 HYYJWYJ		
V1.01	20120228	<p>1、增加转融通 T 日合约偿还明细文件、T 日偿还划付汇总文件、展期申请状态库；</p> <p>2、T 日转融通新合约库增加“展期标识”字段，合约类型由 4 种减少为 3 种（去除了“展期合约类型”）</p> <p>3、修改出借人账户资料申报库，增加上海和深圳结算备付金账号；</p> <p>4、保证金查询应答包，ElementStock 组件增加股份未交收买入解冻、股份未交收卖出冻结返回域；资金未交收买入冻结、资金未交收卖出解冻；</p> <p>5、保证金委托成交组件增加交易所错误代码域。</p>		
V1.00	20120217	<p>1、T 日新合约增加证券价格字段：合约对账数据增加证券价格字段；</p> <p>2、交收通知(ZRTJSTZ.dbf)增加字段：HVLX(合约类型)、HYZT(合约状态)。</p>		
V1.00	20111219	<p>修订内容</p> <p>1、修正静态数据文件里部分字段拼写有误的内容；</p> <p>2、保证金委托成交查询组件增加“CreditOrderid”域；</p> <p>3、ZRTQYCLK.dbf 库的 QYLB 字段由 N4 改为 C1；</p> <p>4、ZRTXHYXX.dbf 增加字段：HYYJFX(合约预计罚息)、HYZT(合约状态)；</p> <p>5、完善错误代码；</p> <p>6、增加转融通成交库(ZRTCJK.dbf)。</p>		
V1.00	20111212	修订了“转融通参与人（接入方）签到、签退及密码变更消息”一节内容描述，增加了签到签退等密码长度。		
V1.00	20111205	<p>1、增加《保证金追缴通知》、《出借人账户资料申报库》、《出借人账户资料返回库》三个接口库；</p> <p>2、修改日间动态业务数据包约定《保证金查询请求应答消息》增加“PostStr”域，删除“ElementOrderMatch”和“ElementStock”组件“PostStr”域；</p> <p>3、补充转融通平台返回代码；</p>		

转融通参与人数据规范（Ver1.09）

		<p>4、修改日间动态业务数据包约定《保证金委托请求应答消息》和《保证金查询请求应答消息》删除 Pbu 的域；</p> <p>5、将原对于无意义的域处理方法“不填或者为空”改为“不返回该域或为空”；</p> <p>6、修改日间动态业务数据包约定《保证金委托请求应答消息》bsflag=‘0D’的描述，‘0D’只能用于老股东的增发申购，不能用于新股申购。</p>		
V1.00	20111205	接口中所有利率字段本次修订为不带百分号格式，例如年利率 2.34%，则字段值为 2.34。		
V1.00	20110918	转融通参与人数据规范接口初稿		

# 目录

<b>第一章 接口概述</b> .....	<b>7</b>
第一节 接口说明.....	7
第二节 系统架构.....	9
<b>第二章 日间动态业务数据接口</b> .....	<b>10</b>
第一节 接口协议.....	10
第二节 日间动态业务数据消息包约定.....	10
第三节 参与者签到、签退及签到密码变更消息.....	12
第四节 转融通业务消息.....	13
第五节 保证金业务消息.....	18
第六节 其他业务消息.....	22
<b>第三章 日终静态数据文件接口</b> .....	<b>24</b>
第一节 T 日转融通期限库 (ZRTQX.DBF) .....	24
第二节 T 日转融通标的期限费率库 (ZRTBDQXFL.DBF) .....	25
第三节 T 日转融通可充抵保证金证券库 (ZRTBZJZQ.DBF) .....	25
第四节 T 日转融通资金头寸 (ZRTZJTC.DBF) .....	26
第五节 T 日转融通新合约信息库 (ZRTXHYXX.DBF) .....	27
第六节 转融通权益处理库 (ZRTQYCLK.DBF) .....	29
第七节 T 日合约偿还明细库 (ZRTHYCHMX.DBF) .....	31
第八节 偿还划付差错库 (ZRTCHHFCC.DBF) .....	32
第九节 T 日合约对帐库 (ZRTHYDZ.DBF) .....	33
第十节 T+1 日交收通知库 (ZRTJSTZ.DBF) .....	35
第十一节 保证金追缴通知库 (ZRTBZJZJTZ.DBF) .....	36
第十二节 展期结果通知库 (ZRTZQJGTZ.DBF) .....	38
第十三节 证券出借交易单元报备库(CJJYDYBB.DBF).....	41
第十四节 证券出借人资料报备库/证券出借人资料报备确认库(CJRZLBB.DBF/ CJRZLBBQR.DBF).....	42
<b>第四章 附录</b> .....	<b>49</b>
附录 A: 日间业务数据接口-返回错误代码表.....	49
附录 B: 日间业务数据接口-订单消息实例.....	53
附录 C: 计算校验和算法.....	54
附录 D: 应用消息重复组件.....	54
附录 E: 主要数据字典.....	55
附录 F: 证件代码字典.....	56
附录 G: 通讯密码明文转密码 C 语言例子.....	57
附录 H: 合约类型.....	58
附录 I: 合约状态.....	58
附录 J: 债权债务变动方向.....	59
附录 K: 债权债务变动类型.....	59
附录 L: 债权债务明细标识.....	59

# 第一章 接口概述

## 第一节 接口说明

中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）和转融通参与人技术系统之间的数据交互包括日间动态业务数据和日终静态数据文件两个部分。

### 一、日间动态业务数据

日间动态业务数据主要是指借入人转融通借资借券申报指令、转融通展期和提前偿还申报指令、借入人保证金交易及查询申报指令等日间交互的业务数据，具体内容包括：

#### （一）借入人转融通借资借券申报指令

- 1、借入人转融资借入申报及撤单；
- 2、借入人转融券借入约定申报及撤单；
- 3、借入人转融券借入非约定申报及撤单；

#### （二）转融通展期和提前偿还申报指令

- 4、借入人转融资借入展期申报；
- 5、借入人转融券借入展期申报；
- 6、出借人转融券借出同意展期申报；
- 7、出借人转融券借出提前偿还申报；
- 8、借入人转融券借入同意提前偿还申报；

#### （三）借入人保证金交易及查询申报

- 9、借入人保证金交易及权益处理申报和撤单；

- 10、 借入人保证金交易委托成交查询申报;
- 11、 借入人保证金资金和股份查询申报。

(四) 其他业务消息

- 12、借入人综合信息查询

## 二、日终静态数据文件

日终静态数据文件主要是指证券金融公司在转融通业务平台完成日终处理后,向参与人发送的日终清算对帐数据文件接口。具体内容包  
括:

(一) 转融通参数信息

- 1、 T 日转融通期限库 ( ZRTQX. dbf );
- 2、 T 日转融通标的期限费率库 ( ZRTBDQXFL. dbf );
- 3、 T 日转融通可充抵保证金证券库 ( ZRTBZJZQ. dbf );
- 4、 T 日转融通资金头寸 ( ZRTZJTC.dbf )

(二) 转融通清算对账文件

- 5、 T 日转融通新合约信息库 ( ZRTXHYXX. dbf );
- 6、 转融通权益处理库 ( ZRTQYCLK. dbf );
- 7、 T 日合约偿还明细库 ( ZRTHYCHMX. dbf );
- 8、 偿还划付差错库 ( ZRTCHHFCC.dbf )
- 9、 T 日合约对帐数据库 ( ZRTHYDZ. dbf );

(三) 转融通通知文件

- 10、 T+1 日交收通知库 ( ZRTJSTZ. dbf );
- 11、 保证金追缴通知库 ( ZRTBZJZJTZ. dbf );

12、 展期结果通知库 ( ZRTZQJGTZ. dbf );

(四) 转融通代理报备文件

13、 出借人账户资料报备库 ( CJRZLBB. dbf );

14、 出借人账户资料报备确认库 ( CJRZLBBQR. dbf )。

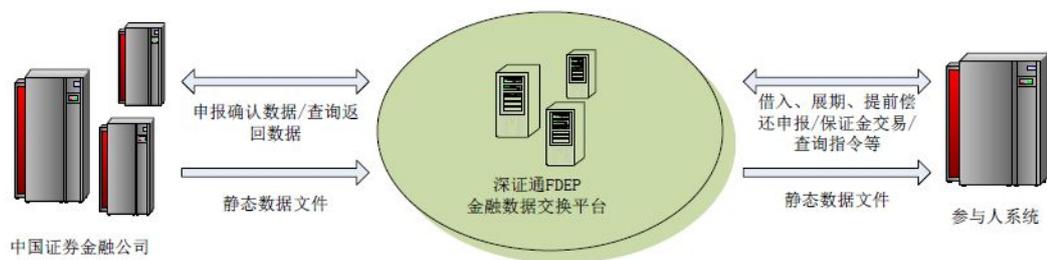
### 三、名词解释

罚息(偿还违约罚息): 指借入人、证金到期应该偿还但没有按时偿还产生的费用;

违约金(出借违约罚息): 指出借人、证金应该出借但没有成功出借而生成的费用;

## 第二节 系统架构

中国证券金融公司技术系统和转融通参与人技术系统, 通过深证通金融数据交换(FDEP)平台完成对接, 系统架构图如下所示。



图一、证券金融公司和参与人技术系统架构图

## 第二章 日间动态业务数据接口

### 第一节 接口协议

中国证券金融公司和参与人间的日间动态业务数据接口，是通过深证通 FDEP 金融数据交换平台，在证券交易数据交换协议（简称“STEP”）上实现交互和对接。

关于参与人通过深证通 FDEP 平台的 API 调用方法，可参考深圳证券通信公司网站上公布的开发文档《03\_FDEPAPI 用户手册》中的内容，本文不再赘述。

本档中关于消息包构建和解析方法，可参考金融行业标准《证券交易数据交换协议》（简称“STEP”）1.00 版或 FIX 标准 4.4 版。

### 第二节 日间动态业务数据消息包约定

本节具体描述证券金融公司和参与人之间的日间动态业务数据消息包的构成和约定。

每一个消息包都包含有消息头、消息体、消息尾三个部分，其中消息头、消息体和消息尾均采用依次排列“标签=字段取值<SOH>”的方式组织，消息中字段取值除非特别声明，均以 ASCII 码字符串表示，<SOH>为字段界定符，其值为不可打印字符 ASCII 码：十六进制的 0x01。如字段值为空，则采用“标签= <SOH>”的方式表示（等号后与域分隔符间有一个空格）。

## 一、消息头

每一个消息有一个消息头，消息头部分包括消息体长度、消息类型、收发方代码、发送日期和发送时间等域。如发送的订单在相当长的时间内没有确认，或者怀疑其根本未曾发送过，可以通过设置“可能重新发送”标志 (PossResend =Y) 来完成对该消息包的重新发送。

标准消息头部分格式下表：

Tag	域名	类型	必需	说明
1008	BeginString	C8	Y	起始串，固定值填： <b>STEP1.00</b>
1009	BodyLength	N10	Y	消息体长度(消息的第二个域) 是从消息头的消息体长度域后面的域分隔符<SOH> (包含)开始到消息尾的校验和域之前的<SOH>(包含) 共计所占的字节长度，包含界定符<SOH>
1035	MsgType	C3	Y	消息类型(消息的第三个域)，根据消息类型填写 前三个域必须固定次序
1049	SenderCompID	C16	Y	发送方代码 请求包填参与人深证通 MR 的 userid 应答时填证金深证通 MR 的 userid
1056	TargetCompID	C16	Y	接收方代码 请求包填证金深证通 MR 的 userid 应答时填参与人深证通 MR 的 userid
1097	PossResend	C1	Y	可能重发标志 Y: 重发 N: 首次发送
1051	SendingDate	C8	Y	发送日期
1052	SendingTime	C10	Y	发送时间

## 二、消息尾

每一个消息有一个消息尾，并以此终止。消息尾可用于分隔多个消息，包括 3 位数的校验和。

Tag	域名	类型	必需	说明
1093	SignatureLength	N10	Y	数字签名长度 (不可加密)
1089	Signature	C64	Y	数字签名 (不可加密) 签到请求填空，签到成功应答包返回当日有效签名， 后续业务每次必须填签到应答返回的数字签名

1010	Checksum	N3	Y	校验和，消息的最末域（不可加密）。是从消息头的起始串域开始，到消息尾的校验和域之前的<SOH>的整个字符串做校验和运算，计算校验和算法见附录 C
------	----------	----	---	--

### 第三节 参与人签到、签退及签到密码变更消息

#### 一、转融通参与人（接入方）签到、签退及密码变更消息

参与人接入到证券金融公司转融通业务技术平台之前，首先由接入方（证券公司等）向深证通申请 UserID（如已申请则不需重复申请），同时启用一个转融通业务的 APPID，专门用于转融通业务的通讯。接入方（证券公司等）须向证券金融公司提交 UserID，并由证券金融公司给接入方分配初始签到密码。参与人每交易日通过转融通业务技术平台申报日间业务之前，必须首先使用签到密码完成一次签到。签到成功后应答包会返回一个有效数字签名，后续业务申报必须每次在消息尾的 Signature 域带上该数字签名。

数字签名当日内有效，第二日必须重新签到。接入方在日中断开时可通过再次签到获取新的数字签名，接入方也可以通过签退的方式注销当日的签到，签退后在再次签到成功之前所有业务请求将被返回错误。

接入方可以通过发送变更签到密码消息完成签到密码的变更，变更签到密码不会影响上次签到返回的数字签名的有效性。

Tag	域名	数据	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 101
135	BusiCode	C4	Y	业务类型取值范围： 0001：签到 0002：签退 0003：变更签到密码
301	SignInPassWord	C20	Y	签到密码，BusiCode=0001/0002，送签

				到密码, BusiCode=0003 时送入原签到密码。注 1
302	NewSignInPassWord	C20	N	新密码, BusiCode=0003 修改签到密码必送。注 2 其余无实际意义, 不送该域或为空。 注 1 注 2: 明文密码必须经明密转换后以密文形式送入, 随接口文件提供的 kd30txmm.dll, 调用说明见附录 G;
	消息尾		Y	
安全控制应答消息				
Tag	域名	数据	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 201
135	BusiCode	C4	Y	同请求包内容
301	SignInPassWord	C20	Y	同请求包内容
302	NewSignInPassWord	C20	N	同请求包内容
119	ReturnCode	C4	Y	返回错误代码
	消息尾		Y	消息尾中包含数字签名信息

#### 第四节 转融通业务消息

##### 一、转融通订单申报消息及确认消息

参与人通过转融通订单申报消息, 完成转融通业务的借入申报、展期、提前偿还等指令向证券金融公司端的发送, 证券金融公司端处理完指令后将确认应答消息返回给发送方。

转融通订单申报及确认消息格式如下:

Tag	域名	类型	必填	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 121
135	BusiCode	C4	Y	业务类型取值范围: 5101:转融券借入非约定申报 5102:转融券借入约定申报 5121:申请转融券借入展期 5122:同意转融券出借展期 5131:申请转融券出借提前偿还 5132:同意转融券借入提前归还 5001:转融资借入申报 5021:转融资申请展期申报 5900:转融通订单撤单, 撤单请求的委托要素

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

				求同原请求单内容,允许撤单的业务类型: <b>5101/5102/5001/5121/5122</b>
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号,由参与人系统自动生成,同一参与人同一交易日不能重复(可不连续递增),此域值还作为参与人系统日终清算交收时的订单匹配依据。
92	OrderDate	C8	Y	订单日期
1	Market	C1	Y	市场代码 0: 深圳 1: 上海
2	Pbu	C6	Y	对应市场交易单元(借入人:融券专用证券账户交易单元或托管单元,出借人:普通证券账户交易单元或托管单元)
6	Seculd	C10	Y	对应市场证券账号(借入人:融券专用证券账户,出借人:普通证券账户)
4	CreditDays	N4	Y	转融通期限: 转融资: 7、14、28 转融券: 3、7、14、28、182
5	CreditRate	N9,7	Y	转融通息费率,不含百分号。例:年化利率3.45%,填 3.45
37	MoneyType	C3	Y	CNY: 人民币
17	CreditAmt	C16,2	N	转融资申请金额,如 36000000.00 转融券,无实际意义,不送该域或为空
21	StkCode	C6	N	转融券: 深圳、上海市场证券代码 转融资: 无实际意义,不送该域或为空
12	CreditQty	N16	N	转融券申请数量,如 12000000 转融资,无实际意义,不送该域或为空
7	TargetSeculd	C10	N	对手方证券账号, BusiCode=5102 必填 其余无实际意义,不送该域或为空
3	TargetPbu	C6	N	对手方交易单元, BusiCode=5102 必填 其余无实际意义,不送该域或为空
16	ContractSno	N18	N	转融通本方合约编号, BusiCode=5121/5122/ 5131/5132/5021 为必填字段,填本方合约号 其余无实际意义,不送该域或为空
89	TargetContractSno	N18	N	转融通对方合约编号, BusiCode=5122/5132 必填,同意展期、同意提前偿还对方合约编号 其余无实际意义,不送该域或为空
90	OriginalCreditOrderId	C10	N	BusiCode=5900 必填,原订单申请编号 其余无实际意义,不送该域或为空
30	RecoverDate	C8	N	提前偿还日期, BusiCode=5131/5132 必填 其余无实际意义,不送该域或为空
66	RecoverMsg	C2	N	提前偿还原因: BusiCode=5131 必填 01: 司法机关依法对出借人的转融券债权进行

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

				处置, 要求提前了结相关转融券合约 02: 转融券融入的证券被收购, 收购后该上市公司非存续 03: 转融券融入证券的上市公司召开股东大会 其余无意义, 不送该域或为空 99: 其它原因
	消息尾		Y	
转融通业务订单申报确认应答消息				
Tag	域名	类型	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 221
11	CreditConfSno	N10	Y	证券金融公司生成预确认流水号, 由证金转融通平台生成, 同一交易日不重复, 是证金接收订单的唯一标识。
135	BusiCode	C4	Y	业务类型, 同请求包内容
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号, 同请求包内容
92	OrderDate	C8	Y	订单日期, 同请求包内容
1	Market	C1	Y	市场代码, 同请求包内容
2	Pbu	C6	Y	交易单元, 同请求包内容
6	Seculd	C10	Y	证券账号, 同请求包内容
4	CreditDays	N4	N	转融通期限品种, 同请求包内容
5	CreditRate	N9,7	N	息费率, 同请求包内容
37	MoneyType	C3	N	CNY: 人民币, 同请求包内容
17	CreditAmt	N16,2	N	转融资申请金额, 同请求包内容
21	StkCode	C6	N	深圳、上海市场证券代码, 同请求包内容
12	CreditQty	N16	N	转融券申请数量, 同请求包内容
7	TargetSeculd	N10	N	对手方证券账号, 同请求包内容
3	TargetPbu	C6	N	对手方交易单元, 同请求包内容
16	ContractSno	N18	N	转融通合约编号, 同请求包内容
89	TargetContractSno	N18	N	转融通对方合约编号, 同请求包内容
90	OriginalCreditOrderId	C10	N	参与者转融通原订单申请编号, 同请求包内容
30	RecoverDate	C8	N	偿还日期, 同请求包内容
15	AgreementId	C10	N	对手方约定号, BusiCode=5102, 并且成功必填, 由证金返回约定号。 其余无意义, 不返回该域或为空
61	ConfTime	C10	Y	证金接收订单时间, 同请求包内容
119	ReturnCode	C4	Y	返回错误代码, 详见返回代码表。 转融通订单撤单返回 0000, 表示撤单订单执行成功, 原订单被撤销。
58	Text	C128	N	返回错误详细信息。非必然返回项。返回包文中是否存在该域由证金公司决定。
	标准消息尾		Y	

## 二、转融通订单查询消息及应答消息

用于查询转融通业务订单处理的状态信息。在参与人发送了转融通订单申请之后,如果在一定的时间内没有收到对方的订单的预确认消息的话,可发送转融通订单交易查询请求,确认证券金融公司对该笔业务的处理状态信息。

订单查询的应答包括二种处理状态,一是未收到该申请单;二是已收到该申请单并已确认。如果该交易已经确认,交易查询应答必须包含确认结果信息。

转融通订单查询及应答消息格式如下:

Tag	域名	类型	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 131
135	BusiCode	C4	Y	业务类型取值范围 5400:转融通订单查询
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号,由参与人系统自动生成,同一参与人同一交易日不能重复(可不连续递增),此域值还作为日终清算交收时的订单匹配依据。
92	OrderDate	C8	Y	订单日期
1	Market	C1	Y	市场代码 0: 深圳 1: 上海
2	Pbu	C6	Y	对应市场交易单元(借入人:融券专用证券账户交易单元或托管单元,出借人:普通证券账户交易单元或托管单元)
6	Seculd	C10	Y	对应市场证券账号,(借入人:融券专用证券账户,出借人:普通证券账户)
90	OriginalCreditOrderId	C10	Y	参与人转融通原订单编号, <b>BusiCode=5400</b> 必填,需要查询的订单编号
	消息尾		Y	
转融通业务查询及应答消息				
Tag	域名	类型	必	说明

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

			需	
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 231
11	CreditConfSno	N10	Y	证券金融公司预确认流水号,由证金转融通平台生成,同一交易日不重复,是证金接收订单的唯一标识。
135	BusiCode	C4	Y	业务类型,同请求包内容
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号,同请求包内容
92	OrderDate	C8	Y	订单日期,同请求包内容
1	Market	C1	Y	市场代码,同请求包内容
2	Pbu	C6	Y	交易单元,同请求包内容
6	Seculd	C10	Y	证券账号,同请求包内容
137	OriginalBusiCode	C4	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码不返回该域或为空 原业务类型,同域“业务类型 135”定义
4	CreditDays	N4	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码不返回该域或为空 转融通期限
5	CreditRate	N9,7	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码不返回该域或为空 息费率
37	MoneyType	C3	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码不返回该域或为空 CNY: 人民币
17	CreditAmt	N16,2	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码错误不返回该域或为空, 转融资填申请金额 转融券无实际意义,不送该域或为空
21	StkCode	C6	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码不返回该域或为空,深圳、上海市场证券代码, 转融资无意义,不送该域或为空
12	CreditQty	N16	N	ReturnCode=0000 必填,返回其余错误代码不返回该域或为空,转融券申请数量 转融资无意义,不送该域或为空。
7	TargetSeculd	C10	N	ReturnCode=0000 并且 BusiCode=5102 必填,其余错误代码不返回该域或为空 对手方证券账号,
3	Target Pbu	C6	N	ReturnCode=0000 并且 BusiCode=5102 必填,其余不返回该域或为空; 对手方交易单元
15	AgreementId	C10	N	ReturnCode=0000 并且 BusiCode=5102

				必填, 其余不返回该域或为空; 对手方约定号
16	ContractSno	N18	N	ReturnCode=0000 并且 BusiCode= <b>5121/ 5122/5131/5132/5021</b> 必填, 其 余不返回该域或为空; 转融通合约编号
89	TargetContractSno	N18	N	ReturnCode=0000 并且 BusiCode= <b>5122/ 5132</b> 必填, 其余不返回该域, 转 融通对方合约编号
95	OriginalCreditStatus	C1	N	ReturnCode=0000 必填, 返回其余错误 代码不返回该域或为空 原订单状态 0: 正常 1: 已撤 9: 废单
90	OriginalCreditOrderId	C10	Y	参与者转融通原订单申请编号, 同请求 包内容
61	ConfTime	C10	Y	证券金融公司接收原订单时间
119	ReturnCode	C4	Y	返回错误代码
58	Text	C128	N	返回错误详细信息。非必然返回项。返 回包文中是否存在该域由证金公司决 定。
	消息尾		Y	

## 第五节 保证金业务消息

### 一、保证金委托请求消息及确认消息

借入人向证券金融公司提交的转融通担保品, 需要通过转融通业务平台进行证券交易, 包括担保品买卖、行权委托请求等。

保证金委托请求消息及确认消息的格式如下:

Tag	域名	类型	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 141
135	BusiCode	C4	Y	业务类型取值范围: 6101:保证金交易 6900:保证金交易撤单
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号, 由参与者系统自动生成, 同一参与者同一交易日不能重复(可不连续递增), 此域值还作为日终清算交收时的订单匹配依据。

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

92	OrderDate	C8	Y	订单日期
1	Market	C1	Y	市场代码 0: 深圳 1: 上海
6	Seculd	C10	Y	对应市场证券账号, (借入人: 担保证券明细账户)
90	OriginalCreditOrderId	C10	N	参与者转融通原订单申请编号, <b>BusiCode=6900</b> 必填 其余无实际意义, 可空
23	BsFlag	C2	Y	买卖类别取值范围 07:认购行权 08:认沽行权 09:现金行权 0B:证券买入 0D:定价申购 (只支持深圳增发) 0G:转 股 0H:回 售 0J:配股缴款、上海增发 0S:证券卖出 0a:深圳对手方最优价格买入 0b:深圳本方最优价格买入 0c:深圳即时成交剩余撤销买入 0d:最优五档即时成交剩余撤销买入 0e:深圳全额成交或撤销委托买入 0f:深圳对手方最优价格卖出 0g:深圳本方最优价格卖出 0h:深圳即时成交剩余撤销卖出 0i:最优五档即时成交剩余撤销卖出 0j:深圳全额成交或撤销委托卖出 0q:上海最优五档即时成交剩余转限价买入 0r:上海最优五档即时成交剩余转限价卖出
21	StkCode	C6	Y	深圳、上海市场证券代码
19	OrderQty	N16	Y	委托数量
18	OrderPrice	N10,3	Y	委托价格
	消息尾		Y	
保证金委托确认消息				
Tag	域名	数据	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 241
11	CreditConfSno	N10	Y	证券金融公司预确认流水号, 由证金转融通平台生成, 同一交易日不重复, 是证金接到收订单的唯一标识。
135	BusiCode	C4	Y	业务类型, 同请求包内容
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号, 同请求包内容

65	OrderId	C10	N	ReturnCode=0000 必填, 返回其余错误代码不送该域或为空, 申请编号, 由证金系统自动生成
92	OrderDate	C8	Y	订单日期
1	Market	C1	Y	0: 深圳 1: 上海
2	Pbu	C6	N	ReturnCode=0000 填交易单元, 否则不返回该域或为空
6	Seculd	C10	Y	证券账号, 同请求包内容
23	BsFlag	C2	Y	买卖类别, 同请求包内容
21	StkCode	C6	Y	深圳、上海市场证券代码, 同请求包内容
19	OrderQty	N16	Y	委托数量, 同请求包内容
18	OrderPrice	N10,3	Y	委托价格, 同请求包内容
61	ConfTime	C10	Y	证券金融公司接收订单时间
119	ReturnCode	C4	Y	返回错误代码。保证金交易撤单返回 0000 表示撤单订单成功受理, 原订单是否撤单成功需要后续查成交才能确定是否撤销。
58	Text	C128	N	返回错误详细信息。非必然返回项。返回包文中是否存在该域由证金公司决定。
	消息尾		Y	

## 二、保证金查询请求消息及应答消息

用于借入人查询保证金交易和托管情况。依据所查询的内容, 包括:  
保证金资金查询、保证金证券查询、保证金委托查询、保证金成交查询,  
保证金查询请求及应答消息格式如下:

Tag	域名	数据	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 151
135	BusiCode	C4	Y	业务类型取值范围: 6401:查保证金委托成交 6402:查保证金资金 6403:查保证金证券
8	CreditOrderId	C10	Y	订单申请编号, 由参与者系统自动生成, 同一参与者同一交易日不能重复 (可不连续递增), 此域值还作为日终清算交收时的订单匹配依据
92	OrderDate	C8	Y	订单日期
1	Market	C1	Y	市场代码 0: 深圳 1: 上海

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

6	Seculd	C10	Y	对应市场证券账号 (借入人: 担保证券 明细账户)
37	MoneyType	C3	N	CNY: 人民币 6402:查保证金资金 必填,其他非必填
23	BsFlag	C2	N	买卖类别: <b>BusiCode=6401</b> 使用, 不送该域或为空是 查全部买卖类别、填单个买卖类别表示 只查该类别的委托或成交记录。
21	StkCode	C6	N	深圳、上海市场证券代码
90	OriginalCreditOrderId	C10	N	<b>BusiCode=6401</b> 使用, 不送该域或为空。 查所有定单申请编号的委托, 填有非空 值表示查该笔订单申请编号的委托成 交。 其余无实际意义, 不送该域或为空
600	PostStr	C64	Y	查询请求定位串 <b>BusiCode=6401/6403</b> 为空或者填上次查 询应答包的 PostStr(600)域的值。 每次查询最多只返回 20 条数据, 当超过 20 条数据想查全部, 要分多次查询, 每 次查询都要将上次查询的返回包 PostStr(600)域作为本次查询的入参, 返 回查询数据少于 20 条, 表示已经全部返 回。
	消息尾		Y	
保证金查询请求应答消息				
Tag	域名	数据	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 251
11	CreditConfSno	N10	Y	证券金融公司预确认流水号, 由证金转 融通平台生成, 同一交易日不重复, 是 证金接收订单的唯一标识。
135	BusiCode	C4	Y	业务类型, 同请求包内容
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号, 同请求包内容
92	OrderDate	C8	Y	订单日期, 同请求包内容
1	Market	C1	Y	市场代码, 同请求包内容
6	Seculd	C10	Y	证券账号, 同请求包内容
→	组件< ElementStock>		N	<b>保证金证券托管股份组件, BusiCode= 6403 并且有托管股份为必填</b> , 其余不送 该域 具体内容见附录 D 描述
→	组件 < ElementOrderMatch>		N	<b>保证金委托成交汇总信息组件, BusiCode=6401 并且有委托成交信息为 必填</b> , 其余不送该域

				具体内容见附录 D 描述
37	MoneyType	C3	N	CNY: 人民币, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
40	FundBal	N16,2	N	资金余额, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
41	FundLastBal	N16,2	N	资金昨日余额, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
211	FundBuy	N16,2	N	资金买入冻结数, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
212	FundSale	N16,2	N	卖出解冻金额, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
14	FundAvl	N16,2	N	资金可用金额, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
213	FundUncomeBuy	N16,2	N	未交收买入冻结金额, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空, 支持非担保交收使用
214	FundUncomeSale	N16,2	N	未交收卖出解冻金额, <b>BusiCode= 6402</b> 必填, 其余无实际意义, 不送该域为填空
600	PostStr	C64	N	查询返回定位串 <b>BusiCode=6401</b> 有委托成交记录和 <b>BusiCode=6403</b> 有股份托管记录必填, 其余无意义, 不送该域为填空。
61	ConfTime	C10	Y	证金接收订单时间
119	ReturnCode	C4	Y	返回错误代码
58	Text	C128	N	返回错误详细信息。非必然返回项。返回包文中是否存在该域由证金公司决定。
	消息尾		Y	

## 第六节 其他业务消息

### 一、借入人综合信息查询请求消息及确认消息

借入人查询保证金总价值、负债等信息。返回信息主要包含: 保证金总价值、转融通总负债、保证金比例、保证金现金比例等。日间实时查询返回的借入人综合信息与日终清算后的数据可能存在差异。

借入人综合信息查询请求消息及确认消息的格式如下:

Tag	域名	类型	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 161

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

135	BusiCode	C4	Y	业务类型取值范围： 5600:借入人综合信息查询
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号，由参与人系统自动生成，同一参与人同一交易日不能重复(可不连续递增)，此域值还作为日终清算交收时的订单匹配依据。
70	ClearOrgId	C10	Y	结算机构代码
	消息尾		Y	
借入人综合信息查询确认消息				
Tag	域名	数据	必需	说明
	消息头		Y	消息头中 MsgType 域为 261
11	CreditConfSno	N10	Y	证券金融公司预确认流水号，由证金转融通平台生成，同一交易日不重复，是证金接收到的订单的唯一标识。
135	BusiCode	C4	Y	业务类型，同请求包内容
8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号，同请求包内容
70	ClearOrgId	C10	Y	结算机构代码，同请求包内容
71	AssureRate	N9,4	Y	保证金比例档次
72	FundRate	N9,4	Y	保证金现金比例下限
73	DrawRate	N9,4	Y	提取保证金比例
74	BailAsset	N16,2	Y	保证金总价值
75	FundAsset	N16,2	Y	保证金资金价值
76	StkAsset	N16,2	Y	保证金证券价值
77	DebtValue	N16,2	Y	转融通总负债（包括当日转融通委托）
78	BailRate	N9,4	Y	当前保证金比例
79	BailFundRate	N9,4	Y	当前保证金现金比例
80	MaxDrawValue	N16,2	Y	可提取保证金上限
81	MaxDrawFundValue	N16,2	Y	可提取保证金现金上限
82	BailAssetNeeded	N16,2	Y	应追缴的保证金总额
83	FundAssetNeeded	N16,2	Y	应追缴的保证金资金总额
84	MaxOrderAmt	N16,2	Y	可转融通上限
61	ConfTime	C10	Y	证券金融公司接收订单时间
119	ReturnCode	C4	Y	返回错误代码。返回 0000 表示查询成功
58	Text	C128	N	返回错误详细信息。非必然返回项。返回包文中是否存在该域由证金公司决定。
	消息尾		Y	

## 第三章 日终静态数据文件接口

### 第一节 T日转融通期限库（ZRTQX.dbf）

文件名称：ZRTQX.dbf；

传输方向：证券金融公司→借入人、出借人；

传输方式：通过FDEP文件传输系统以文件的形式传输；

发送时间：每交易转融通平台日终清算完成后下发。

T日转融通期限库主要包含转融通资金或证券的各档期限的标准费率及可展期、可提前偿还申报标志等内容，主要用于证券公司等前端控制，具体格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	填写说明
1	JLLX	记录类型	C1	0 转融资 1 转融券
2	QX	期限	N4	转融资：7、14、28 转融券：3、7、14、28、182
3	BZRRFL	标准融入费率	N9,7	证券金融公司向出借人融入的标准费率，年化利率
4	BZRCFL	标准融出费率	N9,7	证券金融公司向借入人融出的标准费率，年化利率
5	ZQBZ	展期标识	C1	0 不允许 1 允许
6	SHBZ	提前偿还标识	C1	0 不允许 1 允许
7	JYRQ	交易日期	C8	文件生效日期

## 第二节 T日转融通标的期限费率库 (ZRTBDQXFL. dbf)

文件名称: ZRTBDQXFL. dbf;

传输方向: 证券金融公司—> 借入人、出借人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

T日转融通标的期限费率库主要包含沪深市场转融通标的证券以及各档期限的费率情况, 主要用于证券公司等前端控制, 具体格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	填写说明
1	JLLX	记录类型	C1	0 转融资 1 转融券
2	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
3	ZQDM	证券代码	C6	转融资: 无意义, 填空 转融券: 对应标的证券代码
4	QX	期限	N4	转融资: 7、14、28 转融券: 3、7、14、28、182
5	RRFL	融入费率	N9, 7	证券金融公司向出借人融入的费率, 年化利率
6	RCFL	融出费率	N9, 7	证券金融公司向借入人融出的费率, 年化利率
7	JYRQ	交易日期	C8	文件生效日期

## 第三节 T日转融通可充抵保证金证券库 (ZRTBZJZQ. dbf)

文件名称: ZRTBZJZQ. dbf;

传输方向: 证券金融公司—> 借入人;

传输方式：通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输；

发送时间：每交易日开市前下发，当日生效。

T 日转融通可充抵保证金证券库主要用于借入人提交保证金证券前端控制时使用，具体格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	填写说明
1	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
2	ZQDM	证券代码	C6	
3	ZSL	折算率	N9, 7	折算率，以小数形式填写，小于等于 1.0
4	TJBZ	提交标志	C1	0 不允许 1 允许提交
5	JYRQ	交易日期	C8	文件生效日期

#### 第四节 T 日转融通资金头寸 (ZRTZJTC. dbf)

文件名称：ZRTZJTC. dbf；

传输方向：证券金融公司—>借入人；

传输方式：通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输；

发送时间：每交易日开市前下发，当日生效。

T 日转融通资金头寸库主要用于告知借入人当天深圳、上海市场转融通资金的投放量，具体格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	填写说明
1	JYRQ	交易日期	C8	
2	SZTCJE	深圳头寸金额	N16, 2	
3	SHTCJE	上海头寸金额	N16, 2	

## 第五节 T 日转融通新合约信息库 (ZRTXHYXX. dbf)

文件名称: ZRTXHYXX. dbf;

传输方向: 证券金融公司—> 借入人、出借人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

T 日转融通新合约信息库主要包含当日所有新生成合约的明细信息, 用于借入人和出借人维护内部系统的合约信息时使用。转融通新合约信息库文件的格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与者结算机构代码
2	FSDX	发送对象	C1	0 出借人, 向出借人下发的数据 1 借入人, 向借入人下发的数据
3	QSRQ	清算日期	C8	格式为 YYYYMMDD
4	CJRQ	成交日期	C8	格式为 YYYYMMDD(合约生成日)
5	HYBH	合约编号	N16	证券金融公司生成的唯一合约编号
6	CYRDDH	参与者订单号	C16	出借人: 出借人在交易所出借成交的成交编号; 借入人: 借入人向证金提交申请的订单编号; 由于展期、权益补偿、合约现金替代而新生成的合约都记原合约号;
7	HYLX	合约类型	C1	详见(附录 H: 合约类型)
8	ZRTL B	转融通类别	C1	0: 转融资(保证金违约合约借用转融资合约) 1: 转融券(现金替代合约、权益补偿合约也是转融券合约)
9	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
10	GDDM	股东代码	C10	证券账户
11	JYDY	交易单元	C6	交易单元

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

12	QX	期限	N4	转融资：7、14、28 转融券：3、7、14、28、182
13	QXFL	期限费率	N9, 7	
14	ZQDM	证券代码	C6	
15	ZQJG	证券价格	N9. 3	T 日收盘价
16	HYSL	合约数量	N12	1:转融券合约证券数量 2:转融券权益补偿合约补偿数量 3:调帐合约的证券数量 转融资合约该字段为 0，无意义 合约状态为“交收违约”时，该字段为 0；
17	HYJE	合约金额	N16, 2	1:转融资的融资金额 2:转融券权益补偿合约补偿金额 3:调帐合约的资金金额 4: 现金替代合约的资金金额 合约状态为“交收违约”时，该字段为 0；
18	HYYJLX	合约预计利息	N16, 2	合约到期预计利息；
19	HYYJFX	合约预计罚息 (偿还违约罚息)	N16, 2	合约违约预计罚息； 注：目前只有权益补偿合约存在这种当天生成合约当天就过期，并产生罚息
20	HYYJWYJ	合约预计违约金 (出借违约罚息)	N16, 2	合约预计违约金
21	HYZT	合约状态	C1	见附录 I
22	HYDQR	理论到期日	C8	理论到期日
23	ZQBS	展期标识	N4	>0 表示本合约是通过其它合约展期生成

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

24	XJTDDW	现金替代单位	N9, 3	>0 表示本合约按金额/股转换而来, 合约如果设置了现金替代, 会产生一笔跟原合约类型相同的新合约; 在新合约中, 本字段值>0, 原合约本券会了结, 但相应的利息还是需要进行了结, 对于新的合约如果未及时了结, 会产生新的利息、罚息
25	BZ	备注	C64	

第六节 转融通权益处理库 (ZRTQYCLK. dbf)

文件名称: ZRTQYCLK. dbf;

传输方向: 证券金融公司—> 借入人、出借人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 每交易日转融通平台日终清算完成后下发。 发送的数据为转融券合约于股权登记日产生的权益处理数据, 但是除红利、红股外的其他权益类型可能需要多次清算, 需多发送一次数据, 比如配股, 股权登记日清算一次, 配股除权日清算一次, 因此会发送两次权益处理数据; 又如增发、配债、派发权证等, 股权登记日清算一次, 证券上市日清算一次, 因此也会发送两次权益处理数据。

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与人结算机构代码
2	FSDX	发送对象	C1	0 出借人, 向出借人下发的数据 1 借入人, 向借入人下发的数据
3	QSRQ	清算日期	C8	格式为 YYYYMMDD
4	HYBH	合约编号	N16	权益数据或权益合约对应的原合

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

				约的合约号
5	QYLB	权益类别	C1	0:红利/兑息 1:红股/送股 2:配股 3:增发新股 4:派发权证 6:配债/发行可转换债券
6	GQDJR	股权登记日	C8	
7	QYDZR	预计权益补偿日	C8	该字段内容为预计的权益补偿日,供参考,最终的权益补偿日以交收通知库中的数据为准。
8	SCDM	市场代码	C1	0:深圳 1:上海
9	ZQDM	证券代码	C6	证券代码
10	WHGFSL	未还股份数量	N12	股权登记日合约的未还股数
11	MGBCJE	每股补偿金额	N12,8	每股的补偿金额,如果未确定,补偿金额则为0
12	MGBCGS	每股补偿股数	N12,8	每股的补偿数量,如果未确定,补偿数量则为0
13	YBCJE	应补偿金额	N16,2	$MGBCJE * WHGFSL$
14	YBCGS	应补偿股数	N12	$MGBCGS * WHGFSL$
15	BCQDBZ	补偿确定标识	C1	0:待确定 1:已确定 2:已取消
16	QYBCHYH	权益补偿合约号	N16,0	补偿确定标志为“1 已确定”时,内容为新产生的权益合约的合约编号。否则为0。
17	BZ	备注	C64	

## 第七节 T日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.dbf）

文件名称：ZRTHYCHMX.dbf；

传输方向：证券金融公司→借入人、出借人；

传输方式：通过深证通网关以文件的形式传输；

发送时间：每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

T日合约偿还明细库主要用于通知出借人或借入人T日合约的债权、债务偿还明细情况。借入人、出借人可根据资金证券的偿还划付结果、实际收资收券情况与本接口数据进行核对。

T日合约偿还明细库的格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与者结算机构代码
2	FSDX	发送对象	C1	0 出借人，向出借人下发的数据 1 借入人，向借入人下发的数据
3	CHRQ	偿还日期	C8	格式为 YYYYMMDD
4	CLXH	处理序号	N12	该序号在同一天内是唯一的
5	HYBH	合约编号	N16	证券金融公司生成的唯一合约编号
6	HYLX	合约类型	C1	参见附录 H
7	ZRTL	转融通类别	C1	0:转融资 1:转融券
8	BDFX	债权债务变动方向	C1	参见附录 J
9	BDLX	债权债务变动类型	C3	参见附录 K
10	ZQZWMX	债权债务明细标识	C5	参见附录 L
11	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
12	ZQDM	证券代码	C6	证券代码
13	BDSL	变动数量	N12	>=0

14	BDJE	变动金额	N16, 2	>=0
15	BZ	备注	C64	

### 第八节 偿还划付差错库 (ZRTCHHFCC. dbf)

文件名称: ZRTCHHFCC. dbf;

传输方向: 证券金融公司—> 借入人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

偿还划付差错库主要体现因多还、错还、停牌证券提前偿还等原因, 证券公司已划付给证金公司, 但证金公司没有进行债务了结或了结后还有剩余的资产的信息, 以及这些资产中的证券产生的权益资产的信息。

偿还划付差错库数据文件的格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与人结算机构代码
2	CLRQ	处理日期	C8	格式为 YYYYMMDD
3	CLXH	处理序号	N12	
4	SJLY	数据来源	C1	‘0’: 正常划付 ‘1’: 错差数据权益, 该类数据主要是指证券公司提前、或多还给证金后的证券又生成了新的红利、红股、送股权益
5	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
6	ZQDM	证券代码	C6	证券代码
7	CCSL	差错数量	N12	>0 表示是证券公司划付给证金的差错, 或差错产生的权益 <0 表示是证金公司划付给证券公司的差错, 或差错产生的权益
8	CCJE	差错金额	N16, 2	>0 表示是证券公司划付给证金的差错, 或差错产生的权益

				<0 表示是证金公司划付给证券公司的差错, 或差错产生的权益
9	BZ	备注	C64	如果 SJLY=' 1', 则 1-8 位表示权益数据关联的原数据的处理日期, 9-20 表示原数据的处理序号

### 第九节 T 日合约对帐库 (ZRTHYDZ. dbf)

文件名称: ZRTHYDZ. dbf;

传输方向: 证券金融公司—> 借入人、出借人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

T 日合约对帐库主要用于出借人和借入人和证券金融公司之间的合约对帐时使用, 数据包含截止到当日的所有未了结合约的明细信息。合约对帐数据文件的格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与人结算机构代码
2	FSDX	发送对象	C1	0 出借人, 向出借人下发的数据 1 借入人, 向借入人下发的数据
3	QSRQ	清算日期	C8	格式为 YYYYMMDD
4	CJRQ	成交日期	C8	合约生成日期
5	LLDQR	理论到日期	C8	理论到期日(根据期限计算出来的)
6	HYDQR	合约到期日	C8	实际到期日, 如果有停牌, 非交易日等会顺延改变
7	HYBH	合约编号	N16	证券金融公司生成的唯一合约编号

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

8	HYLX	合约类型	C1	详见附录 H
9	ZRTL B	转融通类别	C1	0:转融资 1:转融券
10	JSFX	交收方向	C1	0:证券金融公司→出借人 1:出借人→证券金融公司 2:证券金融公司→借入人 3:借入人→证券金融公司
11	SCDM	市场代码	C1	0:深圳 1:上海
12	GDDM	股东代码	C10	证券账户
13	JYDY	交易单元	C6	交易单元
14	QX	期限	N4	转融资:7、14、28 转融券:3、7、14、28、182
15	QXFL	期限费率	N9,7	年化利率
16	ZQDM	证券代码	C6	证券代码
17	JSSL	未还总数量	N12	>=0
18	JSJE	未还总金额	N16,2	>=0
19	JSBJ	未还本金	N16,2	>=0
20	JSLX	未还利息	N16,2	>=0
21	JSFXJE	未还罚息金额	N16,2	>=0
22	JSWYJ	未还违约金	N16,2	>=0
23	JSQTF	未还其它费	N16,2	>=0
24	ZQZTSL	展期在途数量	N12	>=0,在 JSSL 字段中的值已包含了该数量
25	ZQZTJE	展期在途金额	N16,2	>=0,在 JSJE 字段中的值已包含了该金额
26	BZ	备注	C64	

第十节 T+1 日交收通知库 (ZRTJSTZ. dbf)

文件名称: ZRTJSTZ. dbf;

传输方向: 证券金融公司→借入人、出借人;

传输方式：通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输；

发送时间：每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

T+1 日交收通知库文件主要用于通知出借人或借入人 T+1 日即将交收的转融通合约情况，数据包包含归还本金、证券、利息费用、违约罚息、备注等各类信息。

转融通交收通知数据文件的格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与人结算机构代码
2	FSDX	发送对象	C1	0 出借人，向出借人下发的数据 1 借入人，向借入人下发的数据
3	QSRQ	清算日期	C8	格式为 YYYYMMDD
4	JSRQ	交收日期	C8	格式为 YYYYMMDD
5	CJRQ	成交日期	C8	合约的生成日期
6	HYBH	合约编号	N16	证券金融公司生成的唯一合约编号
7	HYLX	合约类型	C1	详见附录 H
8	HYZT	合约状态	C1	详见附录 I
9	ZRTL	转融通类别	C1	0:转融资 1:转融券
10	JSFX	交收方向	C1	0:证券金融公司->出借人 1:出借人->证券金融公司 2:证券金融公司->借入人 3:借入人->证券金融公司
11	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
12	GDDM	股东代码	C10	证券账户
13	JYDY	交易单元	C6	交易单元
14	ZQDM	证券代码	C6	证券代码
15	JSSL	应交收数量	N12	>=0

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

16	JSJE	应收收金额	N16, 2	>=0
17	JSBJ	交收本金	N16, 2	>=0
18	JSLX	交收利息	N16, 2	>=0
19	JSFXJE	交收罚息金额	N16, 2	>=0
20	JSWYJ	交收违约金	N16, 2	>=0
21	JSQTF	交收其它费	N16, 2	>=0
22	DLJSL	已划付待了结数量	N12	>=0, 指借入人以前已划付给证金该数量的证券, 但是证金没有进行负债的偿还 (目前只体现停牌时借入人划付来的本合约的证券, 其它错还等不体现)
23	DLJJE	已划付待了结金额	N16, 2	预留
24	BZ	备注		

第十一节 保证金追缴通知库 (ZRTBZJZJTZ. dbf)

文件名称: ZRTBZJZJTZ. dbf;

传输方向: 证券金融公司—>借入人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 每交易日转融通平台日终清算完成后, 向全体借入人下发, 不区分是否需要追缴保证金。 发送的数据包含两类: 当日清算后保证金比例不足和现金比例不足的催缴额。

保证金追缴通知库的格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	填写说明
1	JSJG	结算机构	C10	参与者结算机构代码
2	FSDX	发送对象	C1	1 借入人, 向借入人下发的数

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

				据
3	WCBZJBL	维持保证金比例	N9, 4	维持保证金比例, 例如: 20%的保证金比例填写为 0.2000。
4	BZJBL	保证金比例	N9, 4	保证金比例, 例如: 20%的保证金比例填写为 0.2000。 无负债有保证金, 保证金比例填 9999.9999
5	WCBZJXJBL	维持保证金现金比例	N9, 4	维持保证金现金比例, 例如: 15%的现金比例填写为 0.1500。
6	BZJXJBL	保证金现金比例	N9, 4	保证金现金比例, 例如: 15%的现金比例填写为 0.1500。 无负债有保证金现金, 保证金现金比例填 9999.9999。
7	FZZJE	转融通总负债	N16, 2	借入人的总负债, 总负债不含“当日生成”的红利、红股权益补偿合约、“当日生成”的保证金违约合约
8	BZJZJZ	保证金总价值	N16, 2	保证金现金总资产+保证金证券总价值
9	BZJXJZZC	保证金现金总资产	N16, 2	保证金现金余额+担保权益现金调整+被借用保证金+未交收资金入-未交收资金出
10	BZJXJYE	保证金现金余额	N16, 2	实际现金余额
11	DBQYXJTZ	担保权益现金调整	N16, 2	如上海红利到账前会虚增现金
12	BJYBZJXJ	被借用保证金现金	N16, 2	证金借用借入人的现金
13	BZJZQJZ	保证金证券总价值	N16, 2	按照保证金证券折算后的保证金证券的价值
14	ZQSZ	证券总市值	N16, 2	指借入人当前担保明细账户登记持有的证券市值 注: 包含非担保证券
15	DBZQSZ	担保证券总市值	N16, 2	指借入人当前担保明细账户登记持有的担保证券市值
16	BJYZQSZ	被借用的证券市值	N16, 2	所有被借用的证券市值, 不区分是否担保证券
17	DBQYZZZQJZ	担保权益调整证券价	N16, 2	包括红股、转增股、配股、增发、配债、债券回售等权益调

		值		整事项, 为折算后价值
18	ZDBZJJZ	最低保证金价值	N16, 2	用负债*维持保证金比例计算出的最低应缴保证金价值 (低于该值就要追缴保证金)
19	ZDBZJXJJE	最低保证金现金金额	N16, 2	用负债*维持保证金比例*维持保证金现金比例计算出的最低应缴保证金现金金额 (低于该值就要追缴保证金现金)
20	CJBZJZJZ	催缴保证金总价值	N16, 2	需要缴纳的保证金总价值, 已经包含 CJBZJXJJE 字段的金额, (CJBZJZJZ - CJBZJXJJE) 后的催缴金额, 用现金和保证金证券冲抵都可以。
21	CJBZJXJJE	催缴保证金现金金额	N16, 2	催缴保证金里, >0 为必须缴纳现金部分的金额
22	KRRZED	可融入总额度	N16, 2	闭市后根据保证金价值等计算出的可融入总额度。
23	QSRQ	清算日期	C8	格式为 YYYYMMDD
24	BZXX	备注信息	C128	

## 第十二节 展期结果通知库 (ZRTZQJGTZ. dbf)

申报文件: ZRTZQJGTZ. dbf;

传输方向: 证券金融公司一) 借入人, 出借人;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

文件状态: 启用;

发送时间: 证金端系统收市后。

发送的数据包含: 借入人转融资、转融券展期申请信息, 出借人同意转融券展期申请信息。

展期结果通知库的格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	必填, 参与人结算机构代码

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

2	FSDX	发送对象	C1	0 出借人, 向出借人下发的数据 1 借入人, 向借入人下发的数据
3	WTRQ	委托日期	C8	展期申请的委托日期
4	CYRDDH	参与人订单号	C10	参与人委托的订单号
5	CYRDM	参与人代码	C12	参与人代码
6	SCDM	市场代码	C1	0: 深圳 1: 上海
7	GDDM	股东代码	C10	证券账户
8	JYDY	交易单元	C6	交易单元
9	HYBH	合约编号	C16	合约编号
10	DFHYBH	对方合约编号	C16	对方合约编号
11	ZRTLX	转融通类型	C1	0 转融资 1 转融券
12	QX	期限	N4	转融资: 7、14、28 转融券: 3、7、14、28、182
13	ZQDM	证券代码	C6	转融资: 无意义, 填空 转融券: 对应标的证券代码
14	HYSL	合约数量	N12	转融券合约展期必填, 转融资为 0
15	HYJE	合约金额	N16, 2	转融资合约展期必填, 转融券为 0.00
16	YDH	约定号	N10	约定对手方大于 0, 非约定对手方等于 0
17	SFZDDSF	是否约定对手方	C1	0: 是 1: 否
18	HYDQR	合约到期日	C8	格式为 YYYYMMDD
19	ZQSQSL	展期申请数量	N12	转融券必填 (借入人或出借人的申请数量)
20	ZQSQJE	展期申请金额	N16, 2	转融资必填 (借入人的申请金额)
21	ZQZT	展期状态	C1	1, 未确认 2, 已同意 3, 证金审核通过 4, 展期中 (到期日 T-1 生成交收通知) 5, 已完成 (合约到期日展期生成新合约) 6, 部分通过 (确认数量小于申请数量) 7, 证金审核未通过 8, 已撤 9, 废单

				请看下方对状态的详细说明
22	ZQQRSL	展期确认数量	N12	展期确认数量, 证金审核通过的数量
23	ZQQRJE	展期确认金额	N16, 2	展期确认金额, 证金审核通过的金额
24	QRRQ	审核通过日期	C8	证金审核通过的日期, 未审核通过为空
25	FSRQ	发送日期	C8	格式为 YYYYMMDD

### 展期业务须知

1. 需要在合约到期日前 3 天申请(展期详细请见业务文档)。
2. 转融资展期在日间交易时间发起申请, 申请成功后等待证金审核
3. 转融券非约定对手方展期在日间交易时间发起申请, 等待证金制定方案, 方案制定后证金会通知借入人有哪些出借人合约在方案中。方案制定后出借人发起同意展期申请, 等待证金审核。
4. 转融券约定对手方展期在日间交易时间发起申请, 自动生成方案, 等待出借人同意, 出借人同意后等待证金审核。约定对手放允许出借人先同意展期再由借入人发起展期申请。
5. 展期的方案、证金审核结果都会在日终文件 ZRTZQJGTZ. dbf 中展示。
6. ZRTZQJGTZ. dbf 的状态对应证金系统的状态详细情况如下

### 借入人展期状态说明

借入人展期状态说明	
1, 未确认	已经申请的状态但是没有出借人同意
2, 已同意	出借人同意的状态
3, 证金审核通过	证金在合约到期日之前 3 天做出审核
4, 展期中	合约到期日的前一天日终清算后的状态(到期日 T-1 生成交收通知)

5, 已完成	生成新合约后的状态(合约到期日展期生成新合约)
6, 部分通过	部分展期, 合约到期日状态为‘5’ (确认数量小于申请数量)
7, 证金审核未通过	证金在合约到期日之前 3 天做出审核
8, 已撤	展期申请当天可以撤单
9, 废单	合约到期日没有处理的订单变成废单

出借人展期状态说明	
1, 未确认	约定对手方自动生成展期方案, 非约定对手方由证金制定展期方案, 生成的展期通知状态为‘1’
2, 已同意	出借人同意的状态
3, 证金审核通过	证金在合约到期日至少前 3 天做出审核
4, 展期中	合约到期日的前一天日终清算后的状态(到期日 T-1 生成交收通知)
5, 已完成	生成新合约后的状态(合约到期日展期生成新合约)
6, 部分通过	部分展期, 合约到期日状态为‘5(确认数量小于申请数量)’
7, 证金审核未通过	证金在合约到期日至少前 3 天做出审核
8, 已撤	展期申请当天可以撤单
9, 废单	合约到期日没有处理的订单变成废单

### 第十三节 证券出借交易单元报备库(CJJYDYBB. dbf)

文件名称: CJJYDYBB. dbf;

传输方向: 证券出借代理券商(独立出借人)→ 证券金融公司;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间: 交易单元与结算备付金账号对应关系发生变更的前一交易日的 16: 00 前, 证券出借代理券商、独立出借人报备全量数据给证券金融公司, 同一交易日内证券公司可以多次进行该文件的发

送，证券金融公司以证券公司最后一次发送的文件为准。证券金融公司于证券出借代理券商、独立出借人报备日的下一交易日启用该文件；

数据类型：全量数据，将使用到的交易单元相关信息全部报送（每个交易单元一条记录）。

证券出借交易单元报备库的格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	必填，证金分配的参与人结算机构代码
2	JSJGMC	机构全称	C64	必填
3	SBRQ	申报日期	C8	必填，格式为 YYYYMMDD，申报日期
4	CYRDM	中登参与人编码	C32	必填，此字段填入代理证券公司（独立出借人）在登记结算公司开立的参与人编码。如无中登参与人编码则填写为 0
5	SCDM	市场代码	C1	0：深圳 1：上海
6	JYDY	交易单元	C6	必填
7	BFJZH	备付金账号	C32	必填，交易单元对应的结算备付金账号

#### 第十四节 证券出借人资料报备库/证券出借人资料报备确认库 (CJRZLBB. dbf/ CJRZLBBQR. dbf)

1、申报文件：CJRZLBB. dbf；

传输方向：证券出借代理券商（独立出借人）—> 证券金融公司；

传输方式：通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输；

发送时间：每交易日 16: 00 前证券出借代理券商发送给证券金融公司, 每个交易日以最后一次发送的文件为准。

证券出借人资料报备库的格式定义如下:

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	必填, 参与者结算机构代码
2	SBRQ	申报日期	C8	必填, 格式为 YYYYMMDD, 交易日期
3	SBXH	申报序号	N8	必填, 同一代理证券公司申报序号当日唯一
4	CYRDM	中登参与者编码	C32	如果出借人类别(CJRLB)等于非独立出借人(1), 则必填, 此字段填入代理证券公司在结算公司开立的参与者编码, 否则选填
5	CJRJC	出借人简称	C32	必填, 机构填公司简称
6	CJRQC	出借人全称	C64	必填, 机构填公司名称
7	CJRXZ	出借人性质	C1	必填 0--证券公司-自营 1--证券公司-资产管理 2--信托公司 3--证券投资基金 4--社保基金 5--保险公司 6--企业年金 7--QFII 8--一般机构 9--个人 (暂不启用) Z--其他
8	CJRLB	出借人类别	C1	必填 0--独立出借人 1--非独立出借人
9	DLQSMC	代理券商名称	C32	如果出借人类别(CJRLB)等于非独立出借人(1), 则必填, 否则不填
10	CJZQLY	出借证券来源	C1	必填

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

				0—个人 1—机构 2—产品 3—其他
11	CPMC	产品名称	C20	如果出借证券来源 (CJZQLY) 为产品 (2), 则必填, 否则不填
12	CPLX	产品类型	C1	如果出借证券来源 (CJZQLY) 为产品 (2), 则必填, 否则不填 0—集合理财 1—定向理财 2—开放式股票基金 3—开放式混合基金 4—开放式债券基金 5—指数基金 6—证券投资信托 7—组合投资信托 Z—其他
13	CPJZSJ	产品截止时间	C8	选填
14	CPTGR	产品托管人	C20	如果出借证券来源 (CJZQLY) 为产品 (2), 则必填, 否则不填
15	ZJLX	出借人证件类型	C1	必填 0—营业执照 2—身份证 3—护照 4—军官证 9—户口簿 A—港澳台通行证 G—其他

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

16	ZJHM	出借人证件号码	C64	必填
17	ZJQSRQ	证件有效起始日期	C8	选填
18	ZJJSRQ	证件有效截止日期	C8	必填, 格式为 YYYYMMDD
19	ZJFZDW	证件发放机构	C64	选填, 出借人证件的发放机构
20	ZJDZ	证件地址	C64	选填, 出借人证件地址
21	FRMC	法人代表名称	C32	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填, 否则不填
22	FRZJLX	法人代表证件类型	C1	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填, 否则不填 2--身份证 3--护照 4--军官证 9--户口簿 A--港澳台通行证 G--其他
23	FRZJHM	法人代表证件号码	C64	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填, 否则不填
24	FRFZJG	法人代表证件发证机构	C64	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则选填, 否则不填
25	ZCZJ	注册资金	N19, 2	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则选填, 否则不填
26	ZJGDM	组织机构代码	C32	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填, 否则不填
27	LXRMC	联系人名称	C32	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填;
28	LXRZJLX	联系人证件类型	C1	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填; 2--身份证 3--护照 4--军官证 9--户口簿

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

				A--港澳台通行证 G--其他
29	LXRZJHM	联系人证件号码	C64	如果出借人性质(CJRXZ)不等于个人, 则必填;
30	LXRDHMH	联系人电话号码	C32	必填 含区号, 例 010-81231122
31	LXRSJHM	联系人手机号码	C32	必填
32	LXRDZYX	联系人电子邮箱	C32	必填
33	LXRCZ	传真	C32	选填
34	LXRYB	邮政编码	C16	必填
35	LXRLXDZ	联系地址	C64	必填
36	SHGDDM	出借人上海证券 账户股东代码	C10	出借人上海证券帐户股东代码(SHGDDM)和深圳证券帐户股东代码(SZGDDM)必填其一
37	SHTGXW	出借人上海证券 帐户股东席位	C6	如果填入上海证券帐户股东代码(SHGDDM), 则必填
38	SZGDDM	出借人深圳证券 账户股东代码	C10	出借人上海证券帐户股东代码(SHGDDM)和深圳证券帐户股东代码(SZGDDM)必填其一
39	SZTGXW	出借人深圳证券 帐户股东席位	C6	如果填入深圳证券帐户股东代码(SZGDDM), 则必填

补充说明: 必填字段每次申报都必须填写, 非必填信息可以填空, 按字段所填的信息进行记录和更新; 如果存在同一个证券账号在多个交易单元做出借, 需要按照交易单元报备多次。

填写内容必须为半角输入, 不能包含空格;

2、应答文件: CJRZLBBQR. dbf;

传输方向: 证券金融公司—>代理出借人证券公司;

传输方式: 通过 FDEP 文件传输系统以文件的形式传输;

发送时间：每交易日转融通平台日终清算完成后下发。

发送的数据包含：代理证券公司报备证券金融公司的出借人资料处理结果。

证券出借人资料报备确认库文件的格式定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	同申报库
2	SBRQ	申报日期	C8	同申报库
3	SBXH	申报序号	N8	同申报库
4	CYRDM	中登参与者编码	C32	同申报库
5	CJRJC	出借人简称	C32	同申报库
6	CJRQC	出借人全称	C64	同申报库
7	CJRXZ	出借人性质	C1	同申报库
8	CJRLB	出借人类别	C1	同申报库
9	DLQSMC	代理券商名称	C32	同申报库
10	CJZQLY	出借证券来源	C1	同申报库
11	ZJLX	证件类型	C1	同申报库
12	ZJHM	证件号码	C64	同申报库
13	ZJQSRQ	证件有效起始日期	C8	同申报库
14	ZJJSRQ	证件有效截止日期	C8	同申报库
15	ZJFZDW	证件发放机构	C64	同申报库
16	ZJDZ	证件地址	C64	同申报库
17	FRMC	法人代表名称	C32	同申报库
18	FRZJLX	法人代表证件类型	C1	同申报库
19	FRZJHM	法人代表证件号码	C64	同申报库
20	FRFZJG	法人代表证件发证机构	C64	同申报库
21	ZCZJ	注册资金	N19,2	同申报库

22	ZJGDM	组织机构代码	C32	同申报库
23	LXRMC	联系人名称	C32	同申报库
24	LXRZJLX	联系人证件类型	C1	同申报库
25	LXRZJHM	联系人证件号码	C64	同申报库
26	LXRDHHM	电话号码	C32	同申报库
27	LXRSJHM	手机号码	C32	同申报库
28	LXRDZYX	电子邮箱	C32	同申报库
29	LXRCZ	传真	C32	同申报库
30	LXRYB	邮政编码	C16	同申报库
31	LXRLXDZ	联系地址	C64	同申报库
32	SHGDDM	出借人上海证券账户 股东代码	C10	同申报库
33	SHTGXW	出借人上海证券帐户 股东席位	C6	同申报库
34	SZGDDM	出借人深圳证券账户 股东代码	C10	同申报库
35	SZTGXW	出借人深圳证券帐户 股东席位	C6	同申报库
36	CLJG	出借人报备处理结果	C64	必填，“成功”表示出借人报备校验成功,其他描述表示失败原因
37	FSRQ	发送日期	C8	必填，格式为YYYYMMDD，证券金融公司下发文件的日期

## 第四章 附录

附录 A: 日间业务数据接口-返回错误代码表

返回错误代码	对应错误信息
--------	--------

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

0000	成功
0001	校验和错误
0002	无效发送人
0003	无效接收人
0004	已经闭市
0005	报文长度错误
0006	无效签到密码
0008	消息类型错误
0009	协议版本错误
0016	域值类型错误
0017	域值长度错误
0023	固定域顺序错误
0024	报文有非法字符或 fix 报文语法不正确
0037	包体长度错误
0038	MR 通讯帐号错误
1000	日期错误
1001	无效数字签名
1002	交易单元无效
1003	无效标的证券
1004	无效转融通期限
1005	转融通息费率错误
1006	无效提前偿还原因
1007	对方交易单元错误
1008	无此证券代码
1009	证券账号错误
1010	对手方证券账号错误
1011	该业务被限制
1012	市场代码错误
1013	货币代码错误
1014	业务代码错误
1015	没有签到或已经签退
1016	签到指令太频繁, 请一分种后再发
1017	找不到报盘通道

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

1018	不允许夜市委托
1019	报盘席位不存在或异常
2001	超过单笔融入上下限
2002	超过全日融入上限
2003	保证金比例不足
2004	转融通原定单不存在
2005	转融通原合约编号不存在
2006	转融通订单已经撤单
2007	授信额度不足
2008	保证金现金比例不足
2009	超过单一证券融入上限
2010	超过单一保证金证券提交上限
2011	原转融通订单账户资料不匹配
2012	订单号重复
2013	预留
2014	无效出借人
2015	无效借入人
2017	该订单业务类型不能撤单
2018	撤单业务类型和订单业务类型不匹配
2019	超过单笔融入上下限
2020	证金公司净资本不明确
2021	借入人净资本不明确
2022	维持担保比例不明确
2023	借入人转融通余额与证券金融公司净资本比例超出风险值
2026	单一证券转融券数量与该证券可流通数量比例超出风险值
2027	单只担保证券数量占该证券总股本数比例超出风险值
2028	预留
2029	预留
2030	展期、提前偿还重复申请
2031	展期、提前偿还数量错误
2032	该证券不允许展期、提前偿还
2033	展期、提前偿还金额错误
2034	合约快到期不允许展期、提前偿还

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

2035	合约状态不对
2036	该合约不是成交合约或权益合约
2037	转融通订单数量不符合融入单位数量
2038	证金未制定展期方案
2039	出借人委托数量与证金同意数量不同
2040	展期申请金额不能小于或等于零
2041	展期申请数量不能小于或等于零
2042	同意展期数量不能小于或等于零
2043	出借人展期同意数量大于借入人展期申请数量
2044	没有找到对应的转融出合约
2045	没有找到对应的转融入合约
2046	没有找到对手方合约
2047	对手方合约状态不正确
2048	没有对应的展期申请
2049	出借人同意展期已申请
2050	证金公司已审核通过该笔合约展期
2051	展期合约已成
2052	资格已冻结/取消
2053	撤单申请的参数与原订单不匹配[交易市场]
2054	撤单申请的参数与原订单不匹配[席位代码]
2055	撤单申请的参数与原订单不匹配[股东代码]
2056	撤单申请的参数与原订单不匹配[证券代码]
2057	撤单申请的参数与原订单不匹配[合约编号]
2058	撤单申请的参数与原订单不匹配[约定号]
2059	撤单申请的参数与原订单不匹配[期限]
2060	当前时间不允许做此业务
2061	撤单申请的参数与原订单不匹配[币种]
2062	撤单申请的参数与原订单不匹配[委托金额]
2063	撤单申请的参数与原订单不匹配[委托数量]
2064	原订单委托状态非法, 不允许撤单
2065	转融通委托数量必须是提交单位的整数倍
2066	保证金比例 违约
2067	保证金现金比例 违约

转融通参与人数据规范（Ver1.09）

2068	转融通到期合约交收 违约
2069	当日转融资融入笔数超过上限
2070	展期申请的参数与合约不匹配[交易市场]
2071	展期申请的参数与合约不匹配[席位代码]
2072	展期申请的参数与合约不匹配[股东代码]
2073	展期申请的参数与合约不匹配[证券代码]
2074	展期申请的参数与合约不匹配[期限]
2075	展期申请的参数与合约不匹配[币种]
2076	合约已超过最长展期期限
5001	股份可用不足
5002	资金可用不足
5003	保证金委托合同序号不存在
5004	保证金委托已经撤单或全部成交
5005	保证金买卖类别错误
5006	保证金委托数量错误
5007	委托价格错误
5008	债券利息错误
5009	账户错误
5010	不能买卖零股
5011	该委托正在申报不能撤单
5012	该证券委托不能撤单
5013	该证券不是保证金证券
5014	该保证金证券限制缴存
5015	维持保证金比例未设置
5016	证券停牌
5017	维持保证金现金比例未设置
	（与 2008 重复）预留
5019	证金头寸为 0
5020	客户未签订有效合同
5021	保证金比例超过风险阈值
5022	保证金替换转出大于转入
5023	错误的买卖类别
5024	转融资展期申请数量小于最小单位

5025	转融资展期申请金额必须是最小单位的整数倍
5026	股东代码和席位不匹配或者不存在
9000	其它错误

### 附录 B: 日间业务数据接口-订单消息实例

转融券借入成交申报:

内容	数据
业务类型	5102
订单编号	0000000001
订单日期	20110915
市场代码	0
参与人交易单元	081700
参与人证券账户	0800124008
转融券期限代码	7
息费	2.25
币种	CNY
证券代码	000001
融入数量	320000
对手方证券账号	0899043660
对手方交易单元	062000
订单时间	93501120 (9 点 35 分 01 秒 120 毫秒)

消息格式如下:

```
1008=STEP1.00<SOH>1009=207<SOH>1035=121<SOH>1049=100<SOH>1056=200<SOH>1097=N<SOH>1051=20110915<SOH>135=5102<SOH>8=0000000001<SOH>92=20110915<SOH>1=0<SOH>2=081700<SOH>6=0800124008<SOH>4=7<SOH>5=2.25<SOH>37=CNY<SOH>21=000001<SOH>12=320000<SOH>7=0899043660<SOH>3=062000<SOH>93=93501120<SOH>1093=100<SOH>1089=3<SOH>1010=XXX<SOH>
```

### 附录 C: 计算校验和算法

```
char *GenerateChecksum( char *buf, long bufLen )
{
    static char tmpBuf[ 4 ];
    long idx;
    unsigned int cks;

    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (unsigned int)buf[ idx++ ] );
    sprintf( tmpBuf, "%03d", (unsigned int)( cks % 256 ) );
}
```

```

return( tmpBuf );
}

```

#### 附录 D: 应用消息重复组件

证券金融公司和参与人之间的日间动态业务数据为保证金业务证券查询和委托成交查询应答消息定义了 2 个数据域集合（即组件），组件中第一个域指明了组件内其余域将以重复组形式重复出现的次数，后续域将按照重复次数连续出现，分别代表多记录返回时的数据内容。

##### （一）保证金证券记录属性组〈 ElementStock〉

该组件主要用于保证金证券查询返回的应答消息，格式如下：

Tag	域名		类型	必需	说明
501	NoElementStock		N4	Y	保证金证券记录数，重复组个数 以下各域将以重复组形式重复出现
→	1	Market	C1	Y	市场代码
→	6	Seculd	C10	Y	证券账号
→	2	Pbu	C6	Y	托管单元或交易单元
→	21	StkCode	C6	Y	交易所证券代码
→	38	StkBal	N16	Y	证券余额
→	39	StkLastBal	N16	Y	证券昨日余额
→	13	StkAvl	N16	Y	证券可用数量
→	201	StkBuy	N16	Y	证券买入解冻
→	202	StkSale	N16	Y	证券卖出冻结
→	203	StkUncomeBuy	N16	Y	未交收股份买入解冻
→	204	StkUncomeSale	N16	Y	未交收股份卖出冻结

##### （二）保证金交易委托成交记录属性组〈 ElementOrderMatch〉

该组件主要用于保证金证券交易时的委托成交查询返回的应答消息，格式如下：

Tag	域名	类型	必需	说明
-----	----	----	----	----

转融通参与人数据规范 (Ver1.09)

503	NoElementOrderMatch	N4	Y	保证金交易委托成交记录数, 重复组个数 以下各域将以重复组形式重复出现	
→	1	Market	C1	Y	市场代码
→	6	Seculd	C10	Y	证券账号
→	2	Pbu	C6	Y	交易单元
→	21	StkCode	C6	Y	交易所证券代码
→	23	BsFlag	C2	Y	买卖类别
→	19	OrderQty	N16	Y	交易数量, (汇总数据)
→	18	OrderPrice	N12,3	Y	委托价格
→	22	MatchQty	N16	Y	成交数量
→	20	MatchAvgPrice	N12,3	Y	成交均价
→	25	CancelQty	N16	Y	撤单数量
→	94	OrderStatus	C1	Y	0=未报 1=正报 2=已报 3=已报待撤 4=部成待撤 5=部撤 6=已撤 7=部成 8=已成 9=废单
→	65	OrderId	C10	Y	保证金委托向交易所申报的合同序号, 每个 个交易单元唯一
→	8	CreditOrderId	C10	Y	申请编号
→	120	MarketErrCode	C6	Y	交易所错误代码

附录 E: 主要数据字典

序号	业务名称	MSGTYPE	BUSICODE	说明
1	签到	101/201	0001	系统
2	签退	101/201	0002	
3	变更签到密码	101/201	0003	
4	转融券借入非约定申报	121/221	5101	转融通业务
5	转融券借入约定申报	121/221	5102	
6	申请转融券借入展期	121/221	5121	
7	同意转融券出借展期	121/221	5122	

转融通参与人数据规范（Ver1.09）

8	申请转融券出借提前偿还	121/221	5131		
9	同意转融券借入提前归还	121/221	5132		
10	转融资借入申报	121/221	5001		
11	转融资申请展期申报	121/221	5021		
12	转融通订单撤单	121/221	5900		
13	转融通订单查询	131/231	5400		
14	保证金交易	141/241	6101		保证金业务
15	保证金交易撤单	141/241	6900		
16	查保证金委托成交	151/251	6401		
17	查保证金资金	151/251	6402		
18	查保证金证券	151/251	6403		
19	借入人综合信息查询	161/261	5600	其他业务消息	

附录 F：证件代码字典

证件代码	证件名称
0	营业执照
1	组织机构代码
2	身份证
3	护照
4	军官证
5	其他证件
6	解放军文职干部证
7	警官证
8	解放军士兵证
9	户口簿
A	港澳回乡通行证
B	台湾通行证及其他有效旅行证
C	外国护照
D	武警文职干部证

E	武警士兵证
F	海外客户编号
G	其他有效证件

## 附录 G: 通讯密码明文转密码 C 语言例子

```

int Demo()
{
    char szTxzh[20+1]; //MR的USERID通讯账号,长20位,超过20左取20位,区分大小写;
    char szKey[10+1]; //签到密码明文,最长10位,超过10位左取10位,区分大小写;
    char szMm[20+1]; //加密后签到密文,输出的密文最长20位;
    int iRetCode = NULL;
    typedef int (*TxmmJiami)(const char * txzh, const char * key, char * mm);
    HMODULE hLib;
    TxmmJiami fnTxmmJiami;

    memset(szTxzh, 0x00, sizeof(szTxzh));
    memset(szKey, 0x00, sizeof(szKey));
    memset(szMm, 0x00, sizeof(szMm));
    strncpy(szTxzh, "B_ZHENGJI", 9);
    strncpy(szKey, "123456", 6);

    hLib = ::LoadLibrary(_T("kd30txmm.dll"));
    if(hLib == NULL)
    {
        iRetCode = -1;
    }
    fnTxmmJiami = (TxmmJiami)::GetProcAddress(hLib, "TxmmJiami");
    if(fnTxmmJiami == NULL)
    {
        ::FreeLibrary(hLib);
        iRetCode = -2;
    }
    //对明文加密,获取密文
    fnTxmmJiami(szTxzh, szKey, szMm);
    fnTxmmJiami = NULL;
    ::FreeLibrary(hLib);
    return iRetCode;
}

```

## 附录 H: 合约类型

合约类型	合约类型名称	备 注
0	成交合约	该类合约用于记录，由借入人主动发起借入申报，或出借人主动发起出借而生成的债权债务关系；
1	权益补偿合约	该类合约用于记录，未还的合约由于发生权益，而衍生出的新的债权债务关系；
2	保证金违约合约	该类合约是用于记录由于借入人未按时追缴保证金，对借入人未追缴金额按违约罚息费率产生的债权债务关系。该类合约的转融通类别借用转融资类别，到期日为合约生成日的下一交易日， 注：对于该类合约资金的偿还划付，深圳归还必须用 F013（）的划付类别，上海都可以归在 172 中；
3	调账合约	调账合约是证金公司根据与出借人、借入人的资金往来差错进行纠正调整，而生成的债权债务关系。该合约不产生利息、罚息。

## 附录 I: 合约状态

合约状态	合约状态名称	备 注
0	已 成	表示证金公司白天收到交易所成交数据以及进行分派后，合约的初始状态；
1	出借违约	表示证金公司清算后证券或资金出借失败的合约状态；
2	正 常	表示证金公司清算后证券或资金正常出借的合约状态；
3	已过期	表示合约到期后，未完全偿还了结的合约状态；
4	己了结	表示合约到期后，全部负债正常了结的合约状态；
5	己终止	表示 出借违约的合约，在支付了违约金后合约的状态

## 附录 J: 债权债务变动方向

债权债务变动方向	名 称	备 注
1	债权债务减少	表示因偿还、处置当日资金往来而引起的合约债权债务的减少；
3	债权债务其它减少	表示因其它原因如展期、手工了结、现金替代等没有资金往来而引起的合约债权债务的减少；

## 附录 K: 债权债务变动类型

债权债务变动类型	名 称	备 注
301	普通资券划付	表示由借入人或者证金公司主动发起的资券划付；
302	处置划付	表示由证金公司处置借入人的资金或证券的划付；
303	合约手工处理	表示证金公司对合约资金、证券债务进行的手工增加、减少
304	合约展期	表示因展期而引起的债权、债务的减少
305	待了结资产清偿债务	停牌日如果借入人进行了划付，但证金没有做了结，待到复牌日，证金手工进行的批量自动了结而引起的债权债务的减少
306	合约现金替代	由于合约设置了使用现金替代后而引起的债权债务的变动（债权债务的证券会减少，但金额会增加）

## 附录 L: 债权债务明细标识

债权债务变动类型	名 称	备 注
11002	证券出借违约金	记录出借人日间有划付，但日终没有划付而对出借人收的违约金
12001	转融出资金本金	证金转融出给证券公司的应收资金
12002	转融出资金利息	证金转融出给证券公司资金产生的应收利息
12003	转融出资金罚息	证券公司未及时归还证金资金产生的应付罚息
12004	转融出证券利息	证金转融出给证券公司证券产生的应收利息
12005	转融出证券罚息	证券公司未及时归还证金证券产生的应付罚息

转融通参与人数据规范（Ver1.09）

12006	转融出证券权益金额	证金转融出给证券公司的证券产生的应收权益资金
12011	转融出现金替代金额	证金转融出给证券公司的证券采用现金替代后的应收替代款
12012	保证金违约处罚金	证券公司未及时补足保证金而产生的应付罚金
12101	转融出证券本券	证金转融出给证券公司的证券
12102	转融出证券权益券	证金转融出给证券公司的证券产生的应收权益券
13001	其他资金资产	证金的应收资金（预留）
13101	其他证券资产	证金的应收证券（预留）
21004	转融入证券利息	证金向出借人转融入证券产生的应付利息
21005	转融入证券罚息	证金未及时归还出借人证券而产生的应付罚息
21006	转融入证券权益金额	证金向出借人转融入的证券产生的应还资金权益
21011	转融入现金替代金额	证金向出借人转融入证券采用现金替代后的应付替代款
21101	转融入证券本券	证金向出借人转融入证券
21102	转融入证券权益券	证金向出借人转融入证券产生的应付权益券
22001	转融出资金违约金	证金未成功向证券公司完成资金转融出划付而产生的违约金
22002	转融出证券违约金	证金未成功向证券公司完成证券转融出划付而产生的违约金
23001	其他资金负债	证金的应付资金（预留）
23101	其他证券负债	证金的应付证券（预留）
31001	转融入调账金额入	由于差错造成的证金应收金额（针对出借人）
31002	转融入调账金额出	由于差错造成的证金应付金额（针对出借人）
31101	转融入调账数量入	由于差错造成的证金应收证券（针对出借人）
31102	转融入调账数量出	由于差错造成的证金应付证券（针对出借人）
32001	转融出调账金额入	由于差错造成的证金应收金额（针对证券公司）
32002	转融出调账金额出	由于差错造成的证金应付金额（针对证券公司）
32101	转融出调账数量入	由于差错造成的证金应收证券（针对证券公司）
32102	转融出调账数量出	由于差错造成的证金应付证券（针对证券公司）

