转融通参与人数据接口规范

（**Ver 2.4，开发稿**）

中国证券金融股份有限公司

二○二三年二月

**前 言**

为支持市场参与人开展转融通业务，约定转融通业务技术平台（以下简称转融通平台）和各参与人技术系统之间的数据接口，中国证券金融股份有限公司（以下简称中证金融）制定了本数据规范。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）》相关规定，详细规范了参与人技术系统与转融通平台间交互所使用的日间申报及日终清算数据接口的具体内容，包括借资借券申报、合约展期、提前了结申报，以及转融通合约归还交收通知等清算数据文件接口等。

本数据规范不包括出借人通过上海证券交易所综合业务平台或深圳证券交易所综合金融服务平台出借证券申报的数据接口内容，该内容由交易所制定和发布。

本数据规范由中国证券金融股份有限公司起草和解释。

**历次更新**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **版本** | **日期** | **修订说明** | **备注** |
| V2.4 | 20230131 | 1. 对于上海市场股票的保证金交易市价委托，委托价格（OrderPrice）支持填入保护限价，不限于科创板股票 2. 添加T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）的附加说明 3. 添加提前了结结果通知库（ZRTTQLJJGTZ.dbf）的附加说明 4. 修改附录A返回错误代码表 |  |
| V2.3.2 | 20221121 | 修改转融通权益处理库（ZRTQYCLK.dbf）的说明，对于上海市场权益送股、转增股，只会于权益登记日，发送一次权益处理数据 |  |
| V2.3.1 | 20220628 | 1. 转融通订单申报消息支持做市借入证券，修改2域和6域的文字描述，27域增加数据字典1：做市专用证券账户 2. 修改附录A返回错误代码表 |  |
| V2.3 | 20200907 | 1、保证金委托请求消息及确认消息新增5H（深市回售撤销）业务类型  2、修改T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）的BY（备注）、转融通订单申报及确认消息的CreditDays（转融通期限）、保证金交易委托成交记录属性组< ElementOrderMatch>的OrderStatus（订单状态）等字段的文字描述  3、修改T日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）的BS字段位数为255  4、修改T日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.dbf）文件传输方式的描述  5、修改展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）中DFHYBH的描述  6、修改独立出借人交易单元报备库/独立出借人交易单元报备确认库（DLCJRJYDYBB.dbf/ DLCJRJYDYBBQR.dbf）文字描述，增加由代理券商报备QFII/RQFII内容；修改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)文字描述，出借人性质-7 修改为“QFII/RQFII” |  |
| V2.2 | 20200320 | 1、增加T日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）  2、将“科创板转融券”文字描述调整为“市场化转融券” |  |
| V2.1 | 20191025 | 1、保证金委托请求消息及确认消息对市价委托新增填入保护限价  2、转融券执行报告消息启用备用字段返回交易所错误代码  3、对于证券份额折算引起的债权债务变动，新增债权债务变动类型310（合约股份数量调整）  4、对于权益、展期、提前了结及合约证券数量调整等业务，T日转融通新合约信息库在备注字段记录新生成合约对应的原合约编号  5、对于合约证券数量调整等业务，展期结果通知库在备注字段记录新生成合约对应的原合约编号  6、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)的出借人全称、产品名称、产品托管人、证件地址、联系地址字段进行扩位  7、修改第三章第十七节关于发送时间相关表述文字；修改第三章第十六、十七、十八节关于传输方式相关表述文字 |  |
| V2.0 | 20190612 | 1、第一章第一节、第二节增加数据说明，增加第三节“市场化转融券借入约定申报消息流图”  2、转融通订单申报消息增加5103、5123、5124、5901四个业务类型，消息域增加原订单业务类型（137域）、借入人证券账户类型（27域），将66域改为非必填  3、新增转融券执行报告，以及转融券执行报告同步消息  4、新增市场化约定申报交易参数库（ZRQJYCSK.dbf）  5、修改T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）备注（BZ）字段的相关描述，增加提前了结新生成合约编号、出借战略配售股份标志、出借订单编号等  6、展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）增加市场化转融券约定申报展期业务相关字段，以及修改相关描述  7、新增提前了结结果通知库（ZRTTQLJJGTZ.dbf）  8、债权债务库变动类型增加309（提前了结）  9、启用独立出借人报备和确认文件  10、修改T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）参与人订单号（CYRDDH）字段描述  11、修改转融通业务订单申报确认应答消息TargetContractSno字段描述  12、增加错误说明  13、文字修订 |  |
| V1.13 | 20180330 | 1. T日合约对帐库新增成交类型和对手方合约号字段 2. 修订附录A错误代码表 3. 保证金查询应答消息新增120字段 |  |
| V1.12 | 20170421 | 1、新增担保资金结息库（DBZJJX.dbf）  2、证券代码，证券账户，委托价格和委托数量扩位，证券代码扩至C8，证券账户扩至C20，委托价格扩至N(10，4)，委托数量扩至N(17,2)，其中委托价格和委托数量只针对保证金业务扩位  3、为T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）、T日合约对帐库（ZRTHYDZ.dbf）、T+1日交收通知库（ZRTJSTZ.dbf）、展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）增加托管单元字段  4、证券出借人资料报备确认库文件中增加产品名称，产品类型，产品截止时间和产品托管人字段  5、保证金追缴通知库中去除被借用保证金现金和被借用的证券市值字段  6、增加独立出借人交易单元报备库和确认库  7、增加证券出借交易单元报备确认库  8、合约偿还明细库中增加股东代码字段  9、转融通权益处理库权益类别增加配售优先股  10、T日转融通新合约信息库增加债券应计利息字段  11、新增基金红利再投资选择报文  12、修订转融通权益处理库（ZRTQYCLK.dbf）发送数据说明 | 1、委托数量扩至N(17,2)是为业务预留，现在各业务委托数量应为整数  2、红利再投策略默认选择红利资金，选择再投份额才需要申报 |
| V1.10 | 20150128 | 1、增加通知说明类文件接口  2、增加证券数量单位约定  3、更新偿还划付差错库BZ字段描述  4、债权债务变动类型增加307（合约到期日调整）、308（偿还差错调账）  5、转融通订单申报及确认消息135域允许撤单的业务类型增加转融资申请展期申报（5021）  6、更正日间业务数据接口-订单消息实例  7、更新返回错误代码表  8、统一中国证券金融公司简称为中证金融  9、更正描述不准确的文字 |  |
| 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；   1. 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； 2. 调整ZRTBZJZJTZ库字段顺序 3. 合约类型增加“保证金违约合约” 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 |  |
| V1.04 | 20120416 | 转融通权益处理库：   1. 增加zqdm(证券代码)、BCQDBZ（补偿确定标志）两个字段。 2. 修改权益类别。 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。 |  |
| 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 | 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； 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”） 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； 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； 5. 保证金委托成交组件增加交易所错误代码域。 |  |
| V1.00 | 20120217 | 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； 2. 交收通知(ZRTJSTZ.dbf)增加字段: HYLX(合约类型)、HYZT(合约状态)。 |  |
| V1.00 | 20111219 | 修订内容   1. 修正静态数据文件里部分字段拼写有误的内容； 2. 保证金委托成交查询组件增加“CreditOrderid”域； 3. ZRTQYCLK.dbf库的QYLB字段由N4改为C1； 4. ZRTXHYXX.dbf增加字段：HYYJFX(合约预计罚息)、HYZT(合约状态)； 5. 完善错误代码； 6. 增加转融通成交库(ZRTCJK.dbf)。 |  |
| 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 | 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；  2、修改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；  3、补充转融通平台返回代码；  4、修改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；  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“；  6、修改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。 |  |
| 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

[第一章 接口概述](#_Toc13657)

[第一节 接口说明](#_Toc12168)

[第二节 系统架构](#_Toc1589)

[第三节 市场化转融券借入约定申报消息流图](#_Toc2741)

[第一节 接口协议](#_Toc6926)

[第二节 动态业务数据消息包约定](#_Toc10787)

[第三节 参与人签到、签退及签到密码变更等系统消息](#_Toc12150)

[第四节 转融通业务消息](#_Toc28413)

[第五节 保证金业务消息](#_Toc19543)

[第六节 其他业务消息](#_Toc296)

[第三章 静态数据文件接口](#_Toc23048)

[第一节 T日转融通期限库（ZRTQX.dbf）](#_Toc3997)

[第二节 T日转融通标的期限费率库（ZRTBDQXFL.dbf）](#_Toc31665)

[第三节 T日市场化转融券约定申报交易参数库（ZRQJYCSK.dbf）](#_Toc26799)

[第四节 T日转融通可充抵保证金证券库（ZRTBZJZQ.dbf）](#_Toc18167)

[第五节 T日转融通资金头寸（ZRTZJTC.dbf）](#_Toc20868)

[第六节 T日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）](#_Toc16924)

[第七节 T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）](#_Toc32325)

[第八节 转融通权益处理库（ZRTQYCLK.dbf）](#_Toc9195)

[第九节 T日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.dbf）](#_Toc22732)

[第十节 偿还划付差错库（ZRTCHHFCC.dbf）](#_Toc27682)

[第十一节 T日合约对账库（ZRTHYDZ.dbf）](#_Toc29153)

[第十二节 担保资金结息库（DBZJJX.dbf）](#_Toc24652)

[第十三节 T+1日交收通知库（ZRTJSTZ.dbf）](#_Toc6471)

[第十四节 保证金追缴通知库（ZRTBZJZJTZ.dbf）](#_Toc6166)

[第十五节 展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）](#_Toc15130)

[第十六节 提前了结结果通知库（ZRTTQLJJGTZ.dbf）](#_Toc23977)

[第十七节 证券出借交易单元报备库/证券出借交易单元报备确认库(CJJYDYBB.dbf/ CJJYDYBBQR.dbf)](#_Toc21850)

[第十八节 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)](#_Toc2458)

[第十九节 独立出借人交易单元报备库/独立出借人交易单元报备确认库（DLCJRJYDYBB.dbf/ DLCJRJYDYBBQR.dbf）](#_Toc11926)

[第四章 通知说明类文件接口](#_Toc32603)

[第五章 附录](#_Toc32526)

[附录A：日间业务数据接口-返回错误代码表](#_Toc22115)

[附录B：日间业务数据接口-订单消息实例](#_Toc1990)

[附录C：计算校验和算法](#_Toc23909)

[附录D：应用消息重复组件](#_Toc12132)

[附录E：主要数据字典](#_Toc20545)

[附录F：证件代码字典](#_Toc15056)

[附录G：通讯密码明文转密码C语言例子](#_Toc7839)

[附录H：合约类型](#_Toc10217)

[附录I：合约状态](#_Toc20569)

[附录J：债权债务变动方向](#_Toc8909)

[附录K：债权债务变动类型](#_Toc15892)

[附录L：债权债务明细标识](#_Toc4747)

# 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和转融通参与人技术系统之间的数据交互包括动态业务数据和静态数据文件两个部分。

一、动态业务数据

动态业务数据主要是指**借入人转融通借资借券申报指令及转融券执行报告**、**转融通展期和提前了结申报指令**、**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及转融券执行报告

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
4. 借入人转融券市场化约定申报及撤单
5. 转融券执行报告

（二）转融通展期和提前了结申报指令

1. 借入人转融资借入展期申报
2. 借入人转融券借入展期申报
3. 借入人转融券市场化约定申报展期申报
4. 出借人转融券借出同意展期申报
5. 出借人转融券市场化约定申报同意展期申报
6. 出借人转融券借出提前了结申报
7. 借入人转融券借入同意提前了结申报

（三）借入人保证金交易及查询申报

1. 借入人保证金交易及权益处理申报和撤单
2. 借入人保证金交易委托成交查询申报
3. 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、静态数据文件

静态数据文件主要是指中证金融在转融通业务平台完成盘后处理后向参与人发送的成交信息文件、完成日终处理后向参与人发送的日终清算对帐数据文件和日初参数文件接口等。具体内容包括：

1. 转融通参数信息
2. T日转融通期限库（ZRTQX.dbf）
3. T日转融通标的期限费率库（ZRTBDQXFL.dbf）
4. T日市场化转融券交易参数库（ZRQJYCSK.dbf）
5. T日转融通可充抵保证金证券库（ZRTBZJZQ.dbf）
6. T日转融通资金头寸（ZRTZJTC.dbf）
7. 转融通清算对账文件
8. T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）
9. 转融通权益处理库（ZRTQYCLK.dbf）
10. T日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.dbf）
11. 偿还划付差错库（ZRTCHHFCC.dbf）
12. T日合约对帐数据库（ZRTHYDZ.dbf）
13. 担保资金结息库（DBZJJX.dbf）
14. 转融通通知文件
15. T日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）
16. T+1日交收通知库（ZRTJSTZ.dbf）
17. 保证金追缴通知库（ZRTBZJZJTZ.dbf）
18. 展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）
19. 提前了结结果通知库（ZRTTQLJJGTZ.dbf）
20. 转融通出借人报备文件
21. 证券出借交易单元报备库/证券出借交易单元报备确认库（CJJYDYBB.dbf/CJJYDYBBQR.dbf）
22. 出借人资料报备库/出借人资料报备确认库（CJRZLBB.dbf /CJRZLBBQR.dbf）
23. 独立出借人交易单元报备库/独立出借人交易单元报备确认库（DLCJRJYDYBB.dbf/ DLCJRJYDYBBQR.dbf）

三、通知说明类文件

通知说明类文件为非结构化数据，比如测试通知和测试方案等，此类文件将会出现在以“ANNOUNCE”命名的文件夹中。

四、名词解释

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

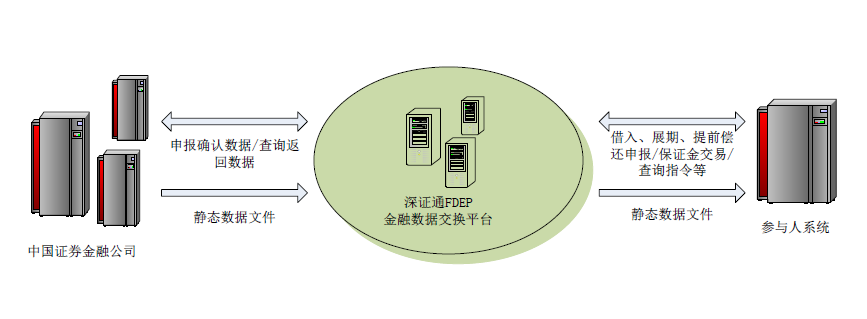
违约金（出借违约罚息）：指出借人、中证金融应该出借但没有成功出借而生成的费用；

五、证券数量单位约定

本文档中提及的证券数量单位，股票的单位为股，债券的单位为张，基金的单位为份。

## 第二节 系统架构

中证金融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、中证金融和参与人技术系统架构图

## 第三节 市场化转融券借入约定申报消息流图



中证金融对于收到的每一笔市场化转融券借入约定申报订单消息，在校验无误后都会实时向交易所发送证券融入申报。交易所系统撮合出借人和中证金融成交后，发送证券融入执行报告，中证金融分派证券给借入人后，再向交易所发送证券划出指令，将刚借入的证券从中证金融账户划至借入人证券账户。交易所返回证券划出指令响应成功后，中证金融向借入人发送转融券执行报告消息，执行报告类型为0（成交且调仓成功）。



中证金融对于交易所返回证券划出指令响应失败的订单，向借入人返回一个转融券执行报告消息，执行报告类型为1（成交但调仓失败）。



中证金融对于借入人市场化转融券约定申报撤单成功的订单，向借入人返回一个转融券执行报告消息，执行报告类型为3（撤单成功）。



中证金融对于借入人市场化转融券约定申报撤单失败的订单，向借入人返回一个转融券执行报告消息，执行报告类型为4（撤单失败）。



中证金融对于借入人市场化转融券约定申报中，交易所证券融入响应失败的订单，向借入人返回一个转融券执行报告消息，执行报告类型为2（废单）。

# 第二章 动态业务数据接口

## 第一节 接口协议

中证金融和参与人间的动态业务数据接口，是通过深证通FDEP金融数据交换平台，以证券交易数据交换协议（简称“STEP”）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，本文不再说明。

本文档中关于消息包构建和解析的方法，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 动态业务数据消息包约定

本节具体描述中证金融和参与人之间的动态业务数据消息包的构成和约定。

每一个消息包都包含消息头、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：**STEP1.00** |
| 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**  应答时填中证金融深证通MR的userid |
| 1056 | TargetCompID | C16 | Y | 接收方代码  **请求包填中证金融深证通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等系统消息

一、转融通参与人（接入方）签到、签退及密码变更消息

参与人接入到中证金融转融通平台之前，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，专用于转融通业务的通讯。接入方须向中证金融提交UserID，并由中证金融给接入方分配初始签到密码。 参与人每交易日通过转融通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，后续所有业务申报必须在消息尾的Signature域填入该数字签名。

数字签名当日内有效，次日必须重新签到。 接入方在日间断开时，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，签退后且再次签到成功之前，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** |
| 302 | NewSignInPassWord | C20 | | N | 新密码，**BusiCode=0003**修改签到密码必送  其余无实际意义，不送该域或为空。 |
|  | 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 |

数据说明：

1） 关于签到密码（Tag 301）和新密码（Tag 302）的说明

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。

二、转融券执行报告同步消息

本消息用于借入人系统在成功签到转融通平台后，通知中证金融其希望接收的下一条转融券执行报告的记录号，中证金融将向借入人逐笔推送大于等于该记录号的全部转融券执行报告。**目前只支持市场化转融券约定申报和市场化转融券约定申报撤单两种订单类型。**

转融券执行报告同步消息格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **类型** | **必需** | **说明** |
|  | 消息头 |  | Y | 消息头中MsgType域为111 |
| 135 | BusiCode | C4 | Y | 业务类型取值范围  0010:市场化转融券约定申报及撤单执行报告同步 |
| 10 | ReportIndex | N8 | Y | 执行报告记录号，期望接收的下一条转融券执行报告的记录号（含） |
| 92 | OrderDate | C8 | Y | 订单日期 |
|  | 消息尾 |  | Y |  |
| 转融券执行报告同步消息确认应答消息 | | | | |
| **Tag** | **域名** | **类型** | **必需** | **说明** |
|  | 消息头 |  | Y | 消息头中MsgType域为211 |
| 135 | BusiCode | C4 | Y | 业务类型，同请求包内容 |
| 10 | ReportIndex | N8 | Y | 执行报告记录号，同请求包内容 |
| 92 | OrderDate | C8 | Y | 订单日期，同请求包内容 |
| 200 | ReturnCount | N16 | Y | 异步返回的执行报告数量 |
| 61 | ConfTime | C10 | Y | 中证金融接收订单时间 |
| 119 | ReturnCode | C4 | Y | 返回错误代码 |
|  | 消息尾 |  | Y |  |

数据说明：如果借入人系统在发送市场化转融券约定申报或撤单后，较长时间没有收到转融券执行报告，可向中证金融申报该消息，请求中证金融向其重发丢失的转融券执行报告。中证金融收到本消息后，同步给证券公司反馈确认应答信息，并通过异步方式逐笔向借入人系统发送该记录号之后（含）的所有转融券执行报告。转融券执行报告消息格式见“第四节 二、转融券执行报告”。

## 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，向中证金融发送资券借入、展期、提前了结等指令，中证金融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  5103:市场化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  5123:申请市场化转融券借入展期  5124:同意市场化转融券出借展期  5131:申请转融券出借提前了结  5132:同意转融券借入提前了结  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要求同原请求单内容,允许撤单的业务类型：5101/5102/5001/5121/5122/5123/5124/5131/5132/5021**  5901:市场化转融券订单撤单，**撤单请求的委托要素要求同原请求单内容,允许撤单的业务类型：5103** |
| 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：融券专用证券账户托管单元、做市专用证券账户交易单元，出借人：普通证券账户交易单元） |
| 6 | SecuId | C20 | Y | 对应市场证券账号（借入人：融券专用证券账户、做市专用证券账户，出借人：普通证券账户） |
| 27 | SecuIdType | C1 | N | **借入人证券账户类型,BuisCode=5103必填，**其它业务无实际意义，不送该域或为空  0：融券专用证券账户  1：做市专用证券账户 |
| 4 | CreditDays | N4 | Y | 转融通期限 |
| 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 | C8 | 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 | TargetSecuId | C20 | N | **对手方证券账号，BusiCode=5102/5103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=5102/5103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/ 5123/5124/5131/5132/5021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 | **转融通对手方合约编号，BusiCode=5122/5124**  **/5132必填，同意展期、同意提前了结对方合约编号**  其余无实际意义，不送该域或为空 |
| 90 | OriginalCreditOrderId | C10 | N | **Busicode=5900/5901必填，原订单申请编号**  其余无实际意义，不送该域或为空 |
| 137 | OriginalBusicode | C4 | N | **原订单业务类型，BuisCode=5901必填**  其它业务无实际意义，不送该域或为空 |
| 30 | RecoverDate | C8 | N | **提前了结日期，BusiCode=5131/5132必填**  根据该日期算期限，其余无实际意义，不送该域或为空 |
| 66 | RecoverMsg | C2 | N | **提前了结原因：BusiCode=5131非必填**  01：司法机关依法对出借人的转融券债权进行处置，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  99：其它原因  其余无意义，不送该域或为空 |
|  | 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 | 中证金融生成预确认流水号，由中证金融转融通平台生成，同一交易日不重复，是中证金融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 | SecuId | C20 | Y | 证券账号，同请求包内容 |
| 27 | SecuIdType | C1 | N | 借入人证券账户类型**，**同请求包内容 |
| 4 | CreditDays | N4 | N | 转融通期限品种，**BusiCode=5131/5132有意义** |
| 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 | C8 | 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 | TargetSecuId | C20 | 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 | 转融通对手方合约编号**，**同请求包内容  **BusiCode=5131，返回对手方合约编号** |
| 90 | OriginalCreditOrderId | C10 | N | 参与人转融通原订单申请编号，同请求包内容 |
| 137 | OriginalBusiCode | C4 | N | 原订单业务类型，同请求包内容 |
| 30 | RecoverDate | C8 | N | 提前了结日期，同请求包内容 |
| 15 | AgreementId | C10 | N | **对手方约定号，BusiCode=5102/5103，必填**  其余无意义，不返回该域或为空 |
| 61 | ConfTime | C10 | Y | 中证金融接收订单时间，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，Busicode=5900表示撤单订单执行成功，原订单被撤销；Busicode=5901表示撤单订单已受理。 |
| 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中证金融决定。 |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 标准消息尾 | Y |  |

数据说明：

1） 关于对手方证券账号（Tag 7）、对手方交易单元（Tag 3）和对手方合约号（Tag 89）的说明

对手方是指在交易所出借证券的出借方，而非中证金融。

2） 关于应答报文中对手方约定号（Tag 15）的说明

在BusiCode=5102/5103，即转融券借入约定申报或市场化转融券借入约定申报时，当借入人成功申报后，由中证金融返回该约定号，出借人需使用此约定号到交易所进行申报。

3） 关于指令要素的说明

* 转融券非约定申报指令应包括借入人的证券账号和托管单元代码、证券代码、期限、费率、证券数量等要素。
* 转融券约定申报指令应包括借入人的证券账号和托管单元代码、证券代码、期限、费率、证券数量、对手方证券账号和交易单元代码等要素。
* 市场化转融券约定申报指令应包括借入人的融券专用证券账号和托管单元代码、证券账户类型、证券代码、期限、费率、证券数量、对手方证券账号和交易单元代码等要素。

二、转融券执行报告消息

对于借入人市场化转融券约定申报订单，中证金融在撮合处理后向借入人发送执行报告，包含成交且调仓成功、成交但调仓失败、废单等三种类型；对于借入人市场化转融券约定申报撤单订单，中证金融在处理后向借入人发送执行报告，包含撤单成功和撤单失败两种类型。

转融券执行报告消息格式如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tag** | **域名** | **类型** | **必填** | **说明** |
|  | 消息头 |  | Y | 消息头中MsgType域为223 |
| 10 | ReportIndex | N8 | Y | 执行报告记录号，每个交易日该字段值从1开始连续编号，表示其为第几笔执行报告，如出现跳号，说明在传输过程中存在丢单，需向中证金融申请执行报告同步 |
| 36 | MatchType | C1 | Y | 执行报告类型  0：成交且调仓成功  1：成交但调仓失败  2：废单  3：撤单成功  4：撤单失败 |
| 135 | BusiCode | C4 | Y | 同参与人请求业务类型，支持业务：  5103：市场化转融券借入约定申报  5901：市场化转融券借入约定申报撤单 |
| 8 | CreditOrderId | C10 | Y | 该域值同参与人请求的申请编号 |
| 92 | OrderDate | C8 | Y | 该域值同参与人请求的订单日期 |
| 1 | Market | C1 | Y | 该域值同参与人请求的市场代码 |
| 2 | Pbu | C6 | Y | 该域值同参与人请求的对应市场交易单元 |
| 6 | SecuId | C20 | Y | 该域值同参与人请求的对应市场证券账号 |
| 4 | CreditDays | N4 | Y | 该域值同参与人请求的转融通期限 |
| 5 | CreditRate | N9,7 | Y | 该域值同参与人请求的转融通息费率 |
| 37 | MoneyType | C3 | Y | 该域值同参与人请求的币种 |
| 21 | StkCode | C8 | Y | 该域值同参与人请求的证券代码 |
| 12 | CreditQty | N16 | Y | 该域值同参与人请求的转融券申请数量 |
| 22 | MatchQty | N16 | Y | **转融券成交证券数量，必填，如：1000** |
| 25 | CancelQty | N16 | Y | **转融券撤单成功证券数量，必填，如：1000** |
| 26 | RealAvlQty | N16 | Y | **本次交易后参与人实时可用证券数量，必填，为0表示中证金融向交易所做股份持仓调整失败，等于MatchQty表示调仓成功** |
| 7 | TargetSecuId | C20 | Y | 该域值同参与人请求的对手方证券账号 |
| 3 | TargetPbu | C6 | Y | 该域值同参与人请求的对手方交易单元 |
| 16 | ContractSno | N18 | Y | **转融通本方合约编号，BusiCode=5103转融券成交时为必填字段，填本次成功借入的合约号**  其余该域为空格，无实际意义 |
| 66 | Remark | C64 | N | **备注信息：**  **MatchType=1/2/4**有意义，为交易所返回错误代码，具体含义参考交易所发布的错误代码表  **MatchType=0/3**无意义，该域为空格 |
| 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。 |
|  | 消息尾 |  | Y |  |

数据说明：参与人市场化转融券借入约定申报发送至中证金融后，中证金融给参与人同步反馈申报确认消息；中证金融从出借人借入证券后，通过异步方式向参与人发送该笔申报的执行报告。

三、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，如果在一定时间内未收到中证金融的预确认消息，可发送该请求确认中证金融对该笔业务的处理状态。

订单查询的应答有两种处理状态，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） | |
| 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：融券专用证券账户托管单元，出借人：普通证券账户交易单元） | |
| 6 | SecuId | C20 | | 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，**Busicode =5400**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** | | **必需** | | **说明** |
|  | 消息头 | |  | | Y | | 消息头中MsgType域为231 |
| 11 | CreditConfSno | | N10 | | Y | | 中证金融预确认流水号，由中证金融转融通平台生成，同一交易日不重复，是中证金融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 | SecuId | | C20 | | 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“转融通订单申报消息及确认消息”的域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：申请金额  转融券：无实际意义，不送该域或为空 |
| 21 | StkCode | | C8 | | N | | ReturnCode=0000必填，返回其余错误代码不返回该域或为空  转融券：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 | TargetSecuId | | C20 | | N | | ReturnCode=0000并且**BusiCode=5102/**  **5103**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/**  **5103**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/**  **5103**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= 5121/ 5122/5123/5124/5131/5132/**  **5021**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= 5122/5124/5132**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  3：已成  6：已报（中证金融已向交易所发送证券融入申报，交易所尚未返回成交）  7：已报待撤（中证金融已向交易所发送撤单申报，交易所尚未返回撤单结果）  9：废单 |
| 90 | OriginalCreditOrderId | | C10 | | Y | | 参与人转融通原订单申请编号，同请求包内容 |
| 61 | ConfTime | | C10 | | Y | | 中证金融接收原订单时间 |
| 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中证金融决定。 |
|  | 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

借入人向中证金融提交的转融通担保品，需要通过转融通平台进行证券交易，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  6102：基金红利再投资  6900：保证金交易撤单  6901：基金红利再投资撤单 |
| 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 |
| 6 | SecuId | C20 | Y | 对应市场证券账号，（借入人：担保证券明细账户） |
| 90 | OriginalCreditOrderId | C10 | N | 参与人转融通原订单申请编号, **BusiCode=6900/6901**必填  其余无实际意义，可空 |
| 23 | BsFlag | C2 | Y | 买卖类别取值范围  （1）BusiCode=6101  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  5H:深圳回售撤销  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  （2）BusiCode=6102  zj：选择红利资金  fe：选择再投为份额 |
| 21 | StkCode | C8 | Y | 深圳、上海市场证券代码 |
| 19 | OrderQty | N17,2 | N | 委托数量，除BusiCode=6102/6901外必填 |
| 18 | OrderPrice | N10,4 | N | 委托价格，除BusiCode=6102/6901外必填；**StkCode**为上海市场股票且**BsFlag=0d/0i/0q/0r**时，填入保护限价 |
|  | 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 | 中证金融预确认流水号，由中证金融转融通平台生成，同一交易日不重复，是中证金融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 |
| 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，由中证金融系统自动生成 |
| 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 | SecuId | C20 | 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 | C8 | Y | 深圳、上海市场证券代码，同请求包内容 |
| 19 | OrderQty | N17,2 | N | 委托数量，同请求包内容 |
| 18 | OrderPrice | N10,4 | N | 委托价格，同请求包内容 |
| 61 | ConfTime | C10 | Y | 中证金融接收订单时间 |
| 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中证金融决定 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 消息尾 |  | Y |  |

数据说明：对于BsFlag（买卖类别）=5H（深圳回售撤销）的申报，中证金融不校验撤销请求数量不超过参与人之前申报的回售委托数量（BsFlag=0H），参与人系统应做好前端控制。

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  6404：查基金红利再投资处理结果 |
| 8 | CreditOrderId | C10 | | Y | | 订单申请编号，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） |
| 92 | OrderDate | C8 | | Y | | 订单日期 |
| 1 | Market | C1 | | Y | | 市场代码  0：深圳  1：上海 |
| 6 | SecuId | C20 | | Y | | 对应市场证券账号（借入人：担保证券明细账户） |
| 37 | MoneyType | C3 | | N | | BusiCode=6402必填，其他非必填  CNY：人民币 |
| 23 | BsFlag | C2 | | N | | 买卖类别：  **BusiCode=6401/6404**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  BusiCode=6404不填 |
| 21 | StkCode | C8 | | N | | 深圳、上海市场证券代码 |
| 90 | OriginalCreditOrderId | C10 | | N | | **BusiCode=6401/6404**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  **BusiCode=6401/6403**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 | 中证金融预确认流水号，由中证金融转融通平台生成，同一交易日不重复，是中证金融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 | SecuId | | C20 | | Y | 证券账号，同请求包内容 |
| 🡪 | 组件< ElementStock> | |  | | N | **保证金证券托管股份组件，BusiCode= 6403并且有托管股份为必填，**其余不送该域  具体内容见附录D描述 |
| 🡪 | 组件  < ElementOrderMatch> | |  | | N | **保证金委托成交汇总信息组件，BusiCode=6401/6404并且有委托成交信息为必填，**其余不送该域  具体内容见附录D描述 |
| 37 | MoneyType | | C3 | | N | CNY：人民币，**BusiCode=6402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，**BusiCode=6402**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，**BusiCode=6402**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，**BusiCode=6402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，**BusiCode=6402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，**BusiCode=6402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，**BusiCode=6402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，**BusiCode=6402**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  **BusiCode=6401**有委托成交记录和**BusiCode=6403**有股份托管记录必填，其余无意义，不送该域填空。 |
| 61 | ConfTime | | C10 | | Y | 中证金融接收订单时间 |
| 119 | ReturnCode | | C4 | | Y | 返回错误代码 |
| 120 | MarketErrcode | | C10 | | N | 返回交易所或登记公司错误信息。非必然返回项。返回包文中是否存在该域由中证金融决定 |
| 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中证金融决定 |
|  | 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 |
| 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） |
| 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 | 中证金融预确认流水号，由中证金融转融通平台生成，同一交易日不重复，是中证金融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 |
| 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 | 中证金融接收订单时间 |
| 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中证金融决定 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 消息尾 |  | Y |  |

# 第三章 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：中证金融—〉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、可提前了结申报标志等内容，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 | 转融通期限 |
| 3 | BZRRFL | 标准融入费率 | N9,7 | 中证金融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 | 中证金融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 | 提前了结标识 | C1 | 0不允许  1允许（暂不启用） |
| 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：中证金融—〉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：每交易日开市前下发，当日生效。

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 | C8 | 转融资：无意义，填空  转融券：对应标的证券代码 |
| 4 | QX | 期限 | N4 | 转融通期限 |
| 5 | RRFL | 融入费率 | N9,7 | 中证金融向出借人融入的费率，年化利率 |
| 6 | RCFL | 融出费率 | N9,7 | 中证金融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日市场化转融券约定申报交易参数库（ZRQJYCSK.dbf）

文件名称：ZRQJYCSK.dbf；

传输方向：中证金融—〉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日转融券费率差库主要包含中证金融各证券品种市场化转融券约定申报出借人和借入人申报的费率差、期限及费率有效范围，主要用于参与人系统做前端控制，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 | 1 转融券 |
| 2 | ZQPZ | 证券品种 | C1 | 0：股票 |
| 3 | QXSX | 期限上限 | N4 | 中证金融转融券出借最长期限 |
| 4 | QXXX | 期限下限 | N4 | 中证金融转融券出借最短期限 |
| 5 | FLSX | 费率上限 | N9,7 | 中证金融向借入人融出的最高年化费率，含百分号，例如99.9999表示9999.99% |
| 6 | FLXX | 费率下限 | N9,7 | 中证金融从出借人融入的最低年化费率，含百分号，例如0.0001表示0.01% |
| 7 | FLC | 费率差 | N9,7 | 出借人和借入人申报费率的差值，费率差大于等于零。 |
| 8 | JYRQ | 交易日期 | C8 | 文件生效日期 |

数据说明：本接口仅适用于转融券市场化约定申报。

## 第四节 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：中证金融—〉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 | C8 |  |
| 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 |

## 第五节 T日转融通资金头寸（ZRTZJTC.dbf）

文件名称：ZRTZJTC.dbf；

传输方向：中证金融—〉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、上海市场转融资资金的投放量，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 |  |

## 第六节 T日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）

文件名称：ZRTCJXX.dbf；

传输方向：中证金融—〉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盘后下发（16:30前）。

T日转融通成交信息库包含当日转融通资金或证券类订单的初步成交信息，主要为证券公司盘后对当日订单成交情况提供参考，**不作为清算交收依据**。

转融通成交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 | DDRQ | 订单日期 | C8 | 格式为YYYYMMDD |
| 4 | DDLX | 订单类型 | C4 | 5101:转融券借入非约定申报  5102:转融券借入约定申报  5103:市场化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  5123:申请市场化转融券借入展期  5124:同意市场化转融券出借展期  5131:申请转融券出借提前了结  5132:同意转融券借入提前了结  5001:转融资借入申报  5021:转融资展期申报 |
| 5 | CYRDDH | 参与人订单号 | C16 | 1、对于订单类型5101，5102，5103，5121，5123，5132，5001，5021：  借入人向中证金融提交申请的订单编号；  2、对于订单类型5122、5124、5131：出借人向中证金融提交申请的订单编号 |
| 6 | BZ | 币种 | C1 | 0:人民币 |
| 7 | SCDM | 市场代码 | C1 | 0：深圳  1：上海 |
| 8 | ZQDM | 证券代码 | C8 |  |
| 9 | GDDM | 股东代码 | C20 | 证券账户 |
| 10 | WTSL | 委托数量 | N12 | 1:转融券类订单委托数量  2:转融资类订单为0，无意义 |
| 11 | WTJE | 委托金额 | N16,2 | 1:转融资类订单委托金额  2:转融券类订单为0，无意义 |
| 12 | QX | 期限 | N4 | 转融通期限 |
| 13 | QXFL | 期限费率 | N9,7 |  |
| 14 | YDH | 约定号 | N10 | 约定对手方大于0,非约定对手方等于0 |
| 15 | DDZT | 订单状态 | C1 | 1:已撤  2:部分成交（5101,5001）  3:全部成交（5101，5102，5103，5001）  4:对手方已报（5121，5122，5123，5124，5131，5132，5021）  5:对手方未报（5121，5122，5123，5124，5131，5132）  9:废单  A:未成交（5101，5102，5103，5001）  Z:待处理 |
| 16 | CJSL | 成交数量 | N12 | 1:转融券类订单成交数量（5101，5102，5103）  2:其余为0，无意义 |
| 17 | CJJE | 成交金额 | N16,2 | 1:转融资类订单成交金额（5001）  2: 其余为0，无意义 |
| 18 | BS | 备注 | C255 | 备用 |

附加说明：

1.对于申请转融券借入展期（5121）和同意转融券出借展期（5122）订单，T日转融通成交信息库也会提供T日之前申报的但对手方尚未申报且处于待审核状态的委托记录信息。

2.对于展期和提前了结业务订单，订单状态（字段15）仅为说明对手方申报情况，不代表审核结果。

## 第七节 T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）

文件名称：ZRTXHYXX.dbf；

传输方向：中证金融—〉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。中证金融可以根据出借人、借入人的申请将该文件发送给其托管人。

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 | 格式为YYYYMMDD(合约生成日) |
| 5 | HYBH | 合约编号 | N16 | 中证金融生成的唯一合约编号 |
| 6 | CYRDDH | 参与人订单号 | C16 | 1、对于首次生成的合约  1）出借人：出借人在交易所出借成交的成交编号；  2）借入人：借入人向中证金融提交申请的订单编号；  2、对于展期、权益补偿、合约现金替代新生成的合约，出借人和借入人都填原合约号  3、对于提前了结生成的合约，出借人和借入人都填向中证金融提交申请的订单编号 |
| 7 | HYLX | 合约类型 | C1 | 详见(附录H：合约类型) |
| 8 | ZRTLB | 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)，不含市场化转融券)  2：市场化转融券（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 | C20 | 证券账户 |
| 11 | JYDY | 交易单元 | C6 | 交易单元，发送对象为出借人时必填 |
| 12 | TGDY | 托管单元 | C6 | 托管单元，发送对象为借入人时必填 |
| 13 | QX | 期限 | N4 | 转融通期限 |
| 14 | QXFL | 期限费率 | N9,7 |  |
| 15 | ZQDM | 证券代码 | C8 |  |
| 16 | ZQJG | 证券价格 | N10,4 | T日交易所证券行情收盘价 |
| 17 | YJLX | 应计利息 | N12,8 | 债券全价交易下，该字段为零；债券净价交易下，该字段为T日登记公司发布的债券应计利息 |
| 18 | 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； |
| 19 | 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； |
| 20 | HYYJLX | 合约预计利息 | N16,2 | 合约到期预计利息； |
| 21 | 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，并产生罚息的情况 |
| 22 | HYYJWYJ | 合约预计违约金  (出借违约罚息) | N16,2 | 合约预计违约金 |
| 23 | HYZT | 合约状态 | C1 | 见附录I |
| 24 | HYDQR | 理论到期日 | C8 | 理论到期日 |
| 25 | ZQBS | 展期标识 | N4 | >0表示本合约是通过其它合约展期生成 |
| 26 | 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 |
| 27 | BZ | 备注 | C64 | 第1-16位表示权益、展期、提前了结及合约股份数量调整等业务生成新合约对应的原合约编号，非上述业务新生成的合约填空格；第17位表示出借人合约的战略配售股份标志，1对于沪市表示是战略配售股份出借、对于深市表示是首发后可出借限售股份出借，0对于沪市表示非战略配售股份出借、对于深市表示非首发后可出借限售股份出借，借入人合约填空格；当合约为首次成交生成时，第18-27位表示出借人向交易所提交出借申报的订单编号 |

附加说明：

1.对于原有权益合约，若由于提前了结而生成了新权益合约，则新权益合约的CYRDDH字段为空（新权益合约不存在参与人向中证金融提交的订单编号）。

## 第八节 转融通权益处理库（ZRTQYCLK.dbf）

文件名称：ZRTQYCLK.dbf；

传输方向：中证金融—〉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权益登记日产生的权益处理数据，但是除红利、送股和转增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，权益登记日清算一次，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、配售优先股、派发权证等，权益登记日清算一次，证券上市日清算一次，因此也会发送两次权益处理数据。中证金融可以根据出借人、借入人的申请将该文件发送给其托管人。

转融通权益处理库的格式定义如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **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  7:配售优先股 |
| 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 | C8 | 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 |  |

## 第九节 T日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.dbf）

文件名称：ZRTHYCHMX.dbf；

传输方向：中证金融—〉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。中证金融可以根据出借人、借入人的申请将该文件发送给其托管人。

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 | 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 | 中证金融生成的唯一合约编号 |
| 6 | HYLX | 合约类型 | C1 | 参见附录H |
| 7 | ZRTLB | 转融通类别 | C1 | 0:转融资  1:转融券  2:市场化转融券 |
| 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 | C8 | 证券代码 |
| 13 | GDDM | 股东代码 | C20 | 证券账户 |
| 14 | BDSL | 变动数量 | N12 | >=0 |
| 15 | BDJE | 变动金额 | N16,2 | >=0 |
| 16 | BZ | 备注 | C64 |  |

## 第十节 偿还划付差错库（ZRTCHHFCC.dbf）

文件名称：ZRTCHHFCC.dbf；

传输方向：中证金融—〉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、停牌证券提前了结等原因，证券公司己划付给中证金融，但中证金融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’：差错数据权益,该类数据主要是指证券公司提前、或多还给中证金融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 | C8 | 证券代码 |
| 7 | CCSL | 差错数量 | N12 | >0表示是证券公司划付给中证金融的差错，或差错产生的权益  <0表示是中证金融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中证金融的差错，或差错产生的权益  <0表示是中证金融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位表示原数据的处理序号  如果SJLY=’0’，则1-16位为偿还时的合约编号 |

## 第十一节 T日合约对账库（ZRTHYDZ.dbf）

文件名称：ZRTHYDZ.dbf；

传输方向：中证金融—〉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中证金融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。中证金融可以根据出借人、借入人的申请将该文件发送给其托管人。

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 | 理论到期日 | C8 | 理论到期日(由期限计算) |
| 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 | 中证金融生成的唯一合约编号 |
| 8 | HYLX | 合约类型 | C1 | 详见附录H |
| 9 | ZRTLB | 转融通类别 | C1 | 0:转融资  1:转融券  2:市场化转融券 |
| 10 | CJLX | 成交类型 | C1 | 0:非约定申报  1:约定申报 |
| 11 | DSFHYBH | 对手方合约号 | N16 | 当成交类型为约定申报时表示对手方合约号 |
| 12 | JSFX | 交收方向 | C1 | 0:中证金融->出借人  1:出借人->中证金融  2:中证金融->借入人  3:借入人->中证金融 |
| 13 | SCDM | 市场代码 | C1 | 0：深圳  1：上海 |
| 14 | GDDM | 股东代码 | C20 | 证券账户 |
| 15 | JYDY | 交易单元 | C6 | 交易单元，发送对象为出借人时必填 |
| 16 | TGDY | 托管单元 | C6 | 托管单元，发送对象为借入人时必填 |
| 17 | QX | 期限 | N4 | 转融通期限 |
| 18 | QXFL | 期限费率 | N9,7 | 年化利率 |
| 19 | ZQDM | 证券代码 | C8 | 证券代码 |
| 20 | JSSL | 未还总数量 | N12 | >=0 |
| 21 | JSJE | 未还总金额 | N16,2 | >=0 |
| 22 | JSBJ | 未还本金 | N16,2 | >=0 |
| 23 | JSLX | 未还利息 | N16,2 | >=0 |
| 24 | JSFXJE | 未还罚息金额 | N16,2 | >=0 |
| 25 | JSWYJ | 未还违约金 | N16,2 | >=0 |
| 26 | JSQTF | 未还其它费 | N16,2 | >=0 |
| 27 | ZQZTSL | 展期在途数量 | N12 | >=0，在JSSL字段中的值己包含了该数量 |
| 28 | ZQZTJE | 展期在途金额 | N16,2 | >=0,在JSJE字段中的值己包含了该金额 |
| 29 | BZ | 备注 | C64 |  |

## 第十二节 担保资金结息库（DBZJJX.dbf）

文件名称：DBZJJX.dbf；

传输方向：中证金融—〉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，每季度结息日有数据记录，其余交易日没有数据记录；

中证金融在每季度末月21日（遇节假日则顺延至21日后的第一个交易日）通过担保资金结息库通知借入人该季度其担保资金利息数据。担保资金结息库的格式定义如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** | **说明** |
| 1 | JSJG | 结算机构 | C10 | 参与人结算机构代码 |
| 2 | HZLX | 利息汇总类型 | C1 | 0:按季度内各利率适用时间段汇总利息  1:按季度汇总利息 |
| 3 | JXQSRQ | 计息起始日期 | C8 | 适用利率起始日期，含当日 |
| 4 | JXJZRQ | 计息截止日期 | C8 | 适用利率截止日期，含当日 |
| 5 | BZ | 币种 | C1 | 0:人民币 |
| 6 | LL1 | 有偿使用利率 | N9,7 | 计算有偿使用利息（LX1）所适用的年化利率，不含百分号，例如年化利率为4.56%则数据为0.0456  利息汇总类型（HZLX）=1时为0 |
| 7 | LJJS1 | 有偿使用累计利息积数 | N19,2 | 计算有偿使用利息（LX1）所使用的借入人利息积数 |
| 8 | LX1 | 有偿使用利息 | N19,2 | 借入人担保资金有偿使用部分的利息金额 |
| 9 | LL2 | 未有偿使用利率 | N9,7 | 计算未有偿使用利息（LX2）所适用的年化利率，不含百分号，例如年化利率为1.62%则数据为0.0162  利息汇总类型（HZLX）=1时为0 |
| 10 | LJJS2 | 未有偿使用累计利息积数 | N19,2 | 计算未有偿使用利息（LX2）所使用的借入人利息积数 |
| 11 | LX2 | 未有偿使用利息 | N19,2 | 借入人担保资金未有偿使用部分的利息金额 |
| 12 | ZLX | 总利息 | N19,2 | 1、利息汇总类型（HZLX）=0（按季度内各利率使用时间段汇总利息）  总利息（ZLX）=有偿使用利息（LX1）+未有偿使用利息（LX2）  2、利息汇总类型（HZLX）=1（按季度汇总利息）  总利息（ZLX）为利息汇总类型（HZLX）为0的全部记录的总利息（ZLX）汇总值 |
| 13 | BY1 | 备用1 | C64 | 预留 |
| 14 | BY2 | 备用2 | C64 | 预留 |
| 15 | BY3 | 备用3 | C64 | 预留 |
| 16 | BY4 | 备用4 | C64 | 预留 |
| 17 | BY5 | 备用5 | C64 | 预留 |

数据说明：

1、对于同一季度内不同时间段适用不同有偿使用利率（LL1）和未有偿使用利率（LL2）组合的情况，担保资金结息库提供多条利息汇总类型（HZLX）=0的记录，例如2014年第四季度9月21日-10月23日适用4.56%（有偿使用利率）和1.62%（未有偿使用利率）、10月24日-11月19日适用4.56%（有偿使用利率）和1.62%（未有偿使用利率）、11月20日-12月20日适用4.58%（有偿使用利率）和1.62%（未有偿使用利率），担保资金结息库提供3条按时间段汇总利息的记录；

2、当记录的利息汇总类型（HZLX）=0时，该记录的总利息（ZLX）为有偿使用利息（LX1）与未有偿使用利息（LX2）之和；文件只有一条利息汇总类型（HZLX）=1的记录，该记录的总利息（ZLX）为利息汇总类型（HZLX）为0的全部记录的总利息（ZLX）汇总值。

## 第十三节 T+1日交收通知库（ZRTJSTZ.dbf）

文件名称：ZRTJSTZ.dbf；

传输方向：中证金融—〉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，数据包含归还本金、证券、利息费用、违约罚息、备注等各类信息。中证金融可以根据出借人、借入人的申请将该文件发送给其托管人。

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 | 中证金融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 | ZRTLB | 转融通类别 | C1 | 0:转融资  1:转融券  2:市场化转融券 |
| 10 | JSFX | 交收方向 | C1 | 0:中证金融->出借人  1:出借人->中证金融  2:中证金融->借入人  3:借入人->中证金融 |
| 11 | SCDM | 市场代码 | C1 | 0：深圳  1：上海 |
| 12 | GDDM | 股东代码 | C20 | 证券账户 |
| 13 | JYDY | 交易单元 | C6 | 交易单元 |
| 14 | TGDY | 托管单元 | C6 | 托管单元 |
| 15 | ZQDM | 证券代码 | C8 | 证券代码 |
| 16 | JSSL | 应交收数量 | N12 | >=0 |
| 17 | JSJE | 应交收金额 | N16,2 | >=0 |
| 18 | JSBJ | 交收本金 | N16,2 | >=0 |
| 19 | JSLX | 交收利息 | N16,2 | >=0 |
| 20 | JSFXJE | 交收罚息金额 | N16,2 | >=0 |
| 21 | JSWYJ | 交收违约金 | N16,2 | >=0 |
| 22 | JSQTF | 交收其它费 | N16,2 | >=0 |
| 23 | DLJSL | 已划付待了结数量 | N12 | >=0,指借入人以前己划付给中证金融该数量的证券，但是中证金融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） |
| 24 | DLJJE | 已划付待了结金额 | N16,2 | 预留 |
| 25 | BZ | 备注 |  |  |

## 第十四节 保证金追缴通知库（ZRTBZJZJTZ.dbf）

文件名称：ZRTBZJZJTZ.dbf；

传输方向：中证金融—〉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 | 参与人结算机构代码 |
| 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+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 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 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 |
| 15 | DBQYTZZQJZ | 担保权益调整证券价值 | N16,2 | 包括红股、转增股、配股、增发、配债、债券回售等权益调整事项，为折算后价值 |
| 16 | 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） |
| 17 | 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） |
| 18 | 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,为(CJBZJZJZ- CJBZJXJJE)后的催缴金额，用现金和保证金证券充抵都可以。 |
| 19 | CJBZJXJJE | 催缴保证金现金金额 | N16,2 | 催缴保证金>0时，必须缴纳现金部分的金额 |
| 20 | KRRZED | 可融入总额度 | N16,2 | 日终清算后根据保证金价值等计算出的可融入总额度 |
| 21 | QSRQ | 清算日期 | C8 | 格式为YYYYMMDD |
| 22 | BZXX | 备注信息 | C128 |  |

## 第十五节 展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）

申报文件：ZRTZQJGTZ.dbf；

传输方向：中证金融—〉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：中证金融端系统日终清算后。

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 |
| 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 | C20 | 证券账户 |
| 8 | JYDY | 交易单元 | C6 | 交易单元 |
| 9 | TGDY | 托管单元 | C6 | 托管单元 |
| 10 | HYBH | 合约编号 | C16 | 合约编号 |
| 11 | DFHYBH | 对方合约编号 | C16 | 对方合约编号（仅FSDX为0时有意义） |
| 12 | ZRTLX | 转融通类型 | C1 | 0：转融资 1：转融券 2：市场化转融券 |
| 13 | QX | 期限 | N4 | 转融通期限 |
| 14 | FL | 费率 | N9，7 | 年化利率（仅对于市场化转融券约定申报展期适用） |
| 15 | ZQDM | 证券代码 | C8 | 转融资：无意义，填空  转融券：对应标的证券代码 |
| 16 | HYSL | 合约数量 | N12 | 转融券合约展期必填，转融资为0 |
| 17 | HYJE | 合约金额 | N16，2 | 转融资合约展期必填，转融券为0.00 |
| 18 | YDH | 约定号 | N10 | 约定对手方大于0,非约定对手方等于0 |
| 19 | SFZDDSF | 是否约定对手方 | C1 | 0:是 1：否 |
| 20 | HYDQR | 合约到期日 | C8 | 格式为YYYYMMDD |
| 21 | 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) |
| 22 | ZQSQJE | 展期申请金额 | N16,2 | 转融资必填(借入人的申请金额) |
| 23 | ZQZT | 展期状态 | C1 | 1,未确认  2,已同意  3,中证金融审核通过  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,中证金融审核未通过  8,已撤  9,废单  请看下方对状态的详细说明 |
| 24 | ZQQRSL | 展期确认数量 | N12 | 展期确认数量,中证金融审核通过的数量 |
| 25 | ZQQRJE | 展期确认金额 | N16,2 | 展期确认金额,中证金融审核通过的金额 |
| 26 | SHSBYY | 审核失败原因 | C128 |  |
| 27 | QRRQ | 审核通过日期 | C8 | 中证金融审核通过的日期，未审核通过为空 |
| 28 | BZ | 备注 | C64 | 第1-16位表示因合约股份数量调整(310)新生成合约对应的原合约编号，展期期间未发生合约股份数量调整(310)均填空格。 |
| 29 | FSRQ | 发送日期 | C8 | 格式为YYYYMMDD |

展期业务须知

1.转融券约定申报展期需要在合约到期日前3天申请，市场化转融券约定申报展期需要在合约到期日前1天申请(展期详细说明请见业务文档)。

2.转融资展期在日间交易时间发起申请，申请成功后等待中证金融审核

3.转融券非约定对手方展期在日间交易时间发起申请，等待中证金融制定方案，方案制定后中证金融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，等待中证金融审核。

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，出借人同意后等待中证金融审核。约定对手方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、中证金融审核结果都会在日终文件ZRTZQJGTZ.dbf中展示。

6.因ETF发生了股份数量调整业务“310”，如该ETF相关合约申请了展期且展期未结束，展期通知在相关公司公告的调整日下发新合约的相关信息，原合约编号记录在新合约的备注信息的第1-16位。

7.ZRTZQJGTZ.dbf的状态对应中证金融系统的状态详细情况如下

借入人展期状态说明

|  |  |
| --- | --- |
| 非市场化约定申报展期状态说明 | |
| 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,中证金融审核通过 | 中证金融在合约到期日之前做出审核 |
| 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,中证金融审核未通过 | 中证金融在合约到期日之前做出审核 |
| 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 |

|  |  |
| --- | --- |
| 市场化约定申报展期状态说明 | |
| 3,中证金融审核通过 | 中证金融在展期申请当天做出审核 |
| 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’ |
| 7,中证金融审核未通过 | 中证金融在展期申请当天做出审核 |
| 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 |

## 第十六节 提前了结结果通知库（ZRTTQLJJGTZ.dbf）

文件名称：ZRTTQLJJGTZ.dbf；

传输方向：中证金融—〉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：中证金融端系统清算后。

发送的数据包含：参与人申请提前了结的反馈信息。

提前了结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 |
| 2 | FSDX | 发送对象 | C1 | 0出借人，向出借人发送的数据  1借入人，向借入人发送的数据 |
| 3 | WTRQ | 委托日期 | C8 | 申请的委托日期 |
| 4 | YWLX | 业务类型 | C4 | 提前了结业务类型：同日间申请消息BusiCode |
| 5 | CYRDDH | 参与人订单号 | C10 | 参与人委托的订单号 |
| 6 | CYRDM | 参与人代码 | C12 | 参与人代码 |
| 7 | SCDM | 市场代码 | C1 | 0：深圳  1：上海 |
| 8 | GDDM | 股东代码 | C20 | 证券账户 |
| 9 | JYDY | 交易单元 | C6 | 交易单元 |
| 10 | TGDY | 托管单元 | C6 | 托管单元 |
| 11 | HYBH | 合约编号 | C16 | 合约编号 |
| 12 | DFHYBH | 对方合约编号 | C16 | 对方合约编号 |
| 13 | ZRTLX | 转融通类型 | C1 | 0：转融资,1：转融券,2：市场化转融券 |
| 14 | QX | 期限 | N4 | 申请提前了结期限 |
| 15 | FL | 费率 | N9,7 | 申请提前了结费率，年化利率 |
| 16 | ZQDM | 证券代码 | C8 | 转融资：无意义，填空  转融券：对应标的证券代码 |
| 17 | HYSL | 合约数量 | N12 | 转融券必填，转融资为0 |
| 18 | HYJE | 合约金额 | N16，2 | 转融资必填，转融券为0.00 |
| 19 | YDH | 约定号 | N10 | 约定对手方大于0,非约定对手方等于0 |
| 20 | SFZDDSF | 是否约定对手方 | C1 | 0:是 1：否 |
| 21 | SQDQR | 申请到期日 | C8 | 格式为YYYYMMDD |
| 22 | SQSL | 申请数量 | N12 | 转融券必填(借入人或出借人的申请数量) |
| 23 | SQJE | 申请金额 | N16,2 | 转融资必填(借入人的申请金额) |
| 24 | TQLJZT | 提前了结状态 | C1 | 1，已申请，待处理  2，提前了结处理成功  3，提前了结处理失败  4，已过期  5，已撤单  6，废单 |
| 25 | SBYY | 失败原因 | C128 |  |
| 26 | QRSL | 确认数量 | N12 | 确认数量,中证金融审核通过的数量 |
| 27 | QRJE | 确认金额 | N16,2 | 确认金额,中证金融审核通过的金额 |
| 28 | JGHYBH | 结果合约编号 | C16 | 提前了结处理成功后对应的合约编号 |
| 29 | QRRQ | 审核日期 | C8 | 中证金融审核日期 |
| 30 | BZ | 备注 | C64 | 备注信息 |
| 31 | FSRQ | 发送日期 | C8 | 格式为YYYYMMDD |

附加说明：

1.由于本文件仅包含参与人申请提前了结的反馈信息，故提前了结的权益合约不在本文件范围内。

## 第十七节 证券出借交易单元报备库/证券出借交易单元报备确认库(CJJYDYBB.dbf/ CJJYDYBBQR.dbf)

1、文件名称：CJJYDYBB.dbf；

传输方向：证券出借代理券商—〉中证金融；

传输方式：通过FDEP文件传输系统默认的单个对端用户规则以文件形式传输（若使用ZRTCS等其他业务规则传输，将导致报备失败）。

文件状态：启用；

发送时间：代理证券公司新增交易单元用于证券出借业务，或者已报备的交易单元发生转让、出租、注销等改变交易单元与结算机构所属关系的情形时，代理证券公司在发生上述情形的前一交易日的16：00前，向中证金融报备全量数据，同一交易日内证券公司可以多次进行该文件的发送，中证金融以证券公司最后一次发送的文件为准。中证金融于证券出借代理券商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）。

中证金融根据出借人出借证券时使用的交易单元，及报备的证券出借交易单元报备库中交易单元与结算机构的对应关系，确定日终清算文件的接收人。出借人代理券商漏报、错报交易单元信息的，将导致无法正常接收中证金融发送的清算文件。

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，中证金融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 |

2、应答文件: CJJYDYBBQR.dbf

传输方向：中证金融—〉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。

发送的数据包含：出借人报备中证金融的出借交易单元处理结果。

证券出借交易单元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 | JSJGMC | 机构全称 | C64 | 同申报库 |
| 3 | SBRQ | 申报日期 | C8 | 同申报库 |
| 4 | CYRDM | 中登参与人编码 | C32 | 同申报库 |
| 5 | SCDM | 市场代码 | C1 | 同申报库 |
| 6 | JYDY | 交易单元 | C6 | 同申报库 |
| 7 | BFJZH | 备付金账号 | C32 | 同申报库 |
| 8 | CLJG | 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 |
| 9 | FSRQ | 发送日期 | C8 | 必填，格式为YYYYMMDD，中证金融下发文件的日期 |

## 第十八节 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：出借人（包含证券出借代理券商和独立出借人）—〉中证金融；

传输方式：通过FDEP文件传输系统默认的单个对端用户规则以文件形式传输（若使用ZRTCS等其他业务规则传输，将导致报备失败）。

文件状态：启用；

发送时间：新增或发生变更的前一交易日16：00前证券出借代理券商或独立出借人发送给中证金融,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，参与人结算机构代码 |
| 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 | 中登参与人编码 | 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人编码，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 | C128 | 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/RQFII |
| 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 |
| 0—个人 |
| 1--机构 |
| 2—产品  3—其他 |
| 11 | CPMC | 产品名称 | C40 | 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 | C40 | 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 |
| 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 | C128 | 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 |
| 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 | LXRDHHM | 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 | C128 | 必填 |
| 36 | SHGDDM | 出借人上海证券账户股东代码 | C20 | 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 | C20 | 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。

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：中证金融—〉出借人（包含证券出借代理券商和独立出借人）；

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。

发送的数据包含：出借人报备中证金融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 | 中登参与人编码 | C32 | 同申报库 |
| 5 | CJRJC | 出借人简称 | C32 | 同申报库 |
| 6 | CJRQC | 出借人全称 | C128 | 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 | CPMC | 产品名称 | C40 | 同申报库 |
| 12 | CPLX | 产品类型 | C1 | 同申报库 |
| 13 | CPJZSJ | 产品截止时间 | C8 | 同申报库 |
| 14 | CPTGR | 产品托管人 | C40 | 同申报库 |
| 15 | ZJLX | 证件类型 | C1 | 同申报库 |
| 16 | ZJHM | 证件号码 | C64 | 同申报库 |
| 17 | ZJQSRQ | 证件有效起始日期 | C8 | 同申报库 |
| 18 | ZJJSRQ | 证件有效截止日期 | C8 | 同申报库 |
| 19 | ZJFZDW | 证件发放机构 | C64 | 同申报库 |
| 20 | ZJDZ | 证件地址 | C128 | 同申报库 |
| 21 | FRMC | 法人代表名称 | C32 | 同申报库 |
| 22 | FRZJLX | 法人代表证件类型 | C1 | 同申报库 |
| 23 | FRZJHM | 法人代表证件号码 | C64 | 同申报库 |
| 24 | FRFZJG | 法人代表证件发证机构 | C64 | 同申报库 |
| 25 | ZCZJ | 注册资金 | N19,2 | 同申报库 |
| 26 | ZJGDM | 组织机构代码 | C32 | 同申报库 |
| 27 | LXRMC | 联系人名称 | C32 | 同申报库 |
| 28 | LXRZJLX | 联系人证件类型 | C1 | 同申报库 |
| 29 | LXRZJHM | 联系人证件号码 | C64 | 同申报库 |
| 30 | LXRDHHM | 电话号码 | C32 | 同申报库 |
| 31 | LXRSJHM | 手机号码 | C32 | 同申报库 |
| 32 | LXRDZYX | 电子邮箱 | C32 | 同申报库 |
| 33 | LXRCZ | 传真 | C32 | 同申报库 |
| 34 | LXRYB | 邮政编码 | C16 | 同申报库 |
| 35 | LXRLXDZ | 联系地址 | C128 | 同申报库 |
| 36 | SHGDDM | 出借人上海证券账户股东代码 | C20 | 同申报库 |
| 37 | SHTGXW | 出借人上海证券帐户股东席位 | C6 | 同申报库 |
| 38 | SZGDDM | 出借人深圳证券账户股东代码 | C20 | 同申报库 |
| 39 | SZTGXW | 出借人深圳证券帐户股东席位 | C6 | 同申报库 |
| 40 | 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 |
| 41 | FSRQ | 发送日期 | C8 | 必填，格式为YYYYMMDD，中证金融下发文件的日期 |

## 第十九节 独立出借人交易单元报备库/独立出借人交易单元报备确认库（DLCJRJYDYBB.dbf/ DLCJRJYDYBBQR.dbf）

1、文件名称：DLCJRJYDYBB.dbf；

传输方向：独立出借人、证券出借代理券商—〉中证金融；

传输方式：通过FDEP文件传输系统默认的单个对端用户规则以文件形式传输（若使用ZRTCS等其他业务规则传输，将导致报备失败）。

文件状态：启用；

发送时间：独立出借人、代理券商新增交易单元、证券账号用于证券出借业务，或者已报备的交易单元、证券账号发生变更时，独立出借人、代理券商在发生上述情形的前一交易日的16：00前，向中证金融报备全量数据，同一交易日内独立出借人、代理券商可以多次进行该文件的发送，中证金融以最后一次发送的文件为准。中证金融于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，将使用到的业务要素相关信息全部报送（每个交易单元和证券账号一条记录）。

中证金融根据独立出借人、代理券商出借证券时使用的交易单元和证券账号，及报备的独立出借人交易单元报备库中交易单元、证券账号与结算机构的对应关系，确定日终清算文件的接收人。独立出借人、代理券商漏报、错报交易单元和证券账号信息的，将导致无法正常接收中证金融发送的相关清算文件。

独立出借人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 | SBRQ | 申报日期 | C8 | 必填，格式为YYYYMMDD，交易日期 |
| 2 | SCDM | 市场代码 | C1 | 0：深圳  1：上海 |
| 3 | CJRMC | 独立出借人、代理券商名称 | C64 | 必填，独立出借人（管理人）、代理券商公司名称 |
| 4 | CJRZDBM | 独立出借人、代理券商中登参与人编码 | C32 | 选填，此字段填入独立出借人（管理人）、代理券商在中国结算开立的参与人编码 |
| 5 | JSJG | 独立出借人、代理券商中证金融结算机构 | C10 | 必填，独立出借人（管理人）、代理券商在中证金融开立的结算机构编码 |
| 6 | CPQC | 产品名称全称 | C64 | 必填，产品名称全称 |
| 7 | CPJC | 产品名称简称 | C32 | 必填，产品名称简称 |
| 8 | ZQZH | 产品的证券账户 | C32 | 必填，产品的证券账户 |
| 9 | JYDY | 产品的交易单元 | C6 | 必填，产品的交易单元 |
| 10 | TGRMC | 产品对应托管人名称 | C64 | 必填，产品对应托管人名称 |
| 11 | TGRZDBM | 托管人中登参与人编码 | C32 | 选填，此字段填入托管人在中国结算开立的参与人编码 |
| 12 | TGRJSJG | 托管人中证金融结算机构 | C10 | 必填，托管人在中证金融开立的结算机构编码 |

数据说明：

1） 关于独立出借人的说明

独立出借人指公募基金、证券公司集合资产管理计划、保险资管等在证券交易所有专用交易单元，通过托管人进行证券资金结算的机构投资者。

1. 关于代理券商的说明

仅限于合格境外投资者（包括合格境外机构投资者QFII、人民币合格境外机构投资者RQFII）委托办理证券交易业务的代理券商，在证券出借之前向中证金融报备独立出借人交易单元报备库。

2、应答文件: DLCJRJYDYBBQR.dbf

传输方向：中证金融—〉独立出借人；

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。

发送的数据包含：独立出借人交易单元报备中证金融的处理结果。

独立出借人交易单元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 | SBRQ | 申报日期 | C8 | 同申报库 |
| 2 | SCDM | 市场代码 | C1 | 同申报库 |
| 3 | CJRMC | 独立出借人、代理券商名称 | C64 | 同申报库 |
| 4 | CJRZDBM | 独立出借人、代理券商中登参与人编码 | C32 | 同申报库 |
| 5 | JSJG | 独立出借人、代理券商中证金融结算机构 | C10 | 同申报库 |
| 6 | CPQC | 产品名称全称 | C64 | 同申报库 |
| 7 | CPJC | 产品名称简称 | C32 | 同申报库 |
| 8 | ZQZH | 产品的证券账户 | C32 | 同申报库 |
| 9 | JYDY | 产品的交易单元 | C6 | 同申报库 |
| 10 | TGRMC | 产品对应托管人名称 | C64 | 同申报库 |
| 11 | TGRZDBM | 托管人中登参与人编码 | C32 | 同申报库 |
| 12 | TGRJSJG | 托管人中证金融结算机构 | C10 | 同申报库 |
| 13 | CLJG | 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 |
| 14 | FSRQ | 发送日期 | C8 | 必填，格式为YYYYMMDD，中证金融下发文件的日期 |

# 第四章 通知说明类文件接口

文件夹名称：ANNOUNCE；

传输方向：中证金融—〉转融通参与人；

传输方式：通过FDEP文件传输系统以文件的形式传输，非结构化数据；

发送时间：不设置固定发送时间，按需发送，最迟随日终清算数据一起发送。

通知说明类文件接口用于发送测试通知或测试方案等非结构化文件，此类文件将会出现在以“ANNOUNCE”命名的文件夹中，如果当日有多个通知说明类文件，则均出现在该“ANNOUNCE”文件夹中，如果当日没有通知说明类文件，则当日可以不发送该“ANNOUNCE”文件夹。

# 第五章 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** |
| 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 | 无效提前了结原因 |
| 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 |
| 1018 | 不允许夜市委托 |
| 1019 | 报盘席位不存在或异常 |
| 1020 | 系统禁止该版块转融通业务 |
| 1021 | 该订单类型禁止申报该证券代码 |
| 1022 | 提前了结日期错误 |
| 1023 | 申请编号不存在或异常 |
| 2000 | 参与人禁止申报该转融通业务 |
| 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或全部成交 |
| 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 | 中证金融净资本不明确 |
| 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中证金融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、提前了结重复申请 |
| 2031 | 展期、提前了结数量错误 |
| 2032 | 该证券不允许展期、提前了结 |
| 2033 | 展期、提前了结金额错误 |
| 2034 | 合约快到期不允许展期、提前了结 |
| 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 | 中证金融未制定展期方案 |
| 2039 | 出借人委托数量与中证金融同意数量不同 |
| 2040 | 展期申请金额不能小于或等于零 |
| 2041 | 展期、提前了结申请数量不能小于或等于零 |
| 2042 | 同意展期、同意提前了结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、提前了结申请 |
| 2049 | 出借人同意展期已申请 |
| 2050 | 中证金融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 |
| 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、提前了结申请的参数与合约不匹配[交易市场] |
| 2071 | 展期、提前了结申请的参数与合约不匹配[席位代码] |
| 2072 | 展期、提前了结申请的参数与合约不匹配[股东代码] |
| 2073 | 展期、提前了结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、提前了结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 |
| 2077 | 原定单正在处理 |
| 2078 | 该类型的合约禁止提前了结 |
| 2079 | 该合约已申报展期不能提前了结 |
| 2080 | 该合约已申报提前了结不能展期 |
| 2081 | 同意展期或提前了结没有填写申请编号 |
| 2082 | 同意展期或提前了结数量错误 |
| 2083 | 同意展期或提前了结本方合约号填写不正确 |
| 2084 | 同意展期或提前了结对方合约号填写不正确 |
| 2085 | 同意展期或提前了结的不是转融券约定合约 |
| 2086 | 证券划出指令交易所响应失败 |
| 2087 | 当天新生成合约不允许展期 |
| 2088 | 借入人展期费率必须高于中证金融费率差 |
| 2089 | 出借人展期同意费率必须高于0 |
| 2090 | 出借人同意展期已申报,借入人展期申请数量与出借人不一致 |
| 2091 | 借入人申请展期已申报,出借人同意展期申报数量与借入人不一致 |
| 2092 | 非约定转融通合约不允许展期 |
| 2093 | 证券借入普通委托交易所响应失败 |
| 2094 | 证券借入撤单委托交易所响应失败 |
| 2099 | 该证券代码不允许做市借券 |
| 2097 | 转融资授信额度不足 |
| 2098 | 标的证券已暂停 |
| 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 |
| 5020 | 客户未签订有效合同 |
| 5021 | 保证金比例超过风险阀值 |
| 5022 | 保证金替换转出大于转入 |
| 5023 | 错误的买卖类别 |
| 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 |
| 5027 | 转融券展期数量必须是最小单位的整数倍 |
| 5028 | 保证金交易校验失败[证券信息校验] |
| 5029 | 保证金交易校验失败[账户信息校验] |
| 8101 | 保证金划转校验错误 |
| 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>1052=93501120<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>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

中证金融和参与人之间的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 | SecuId | C20 | Y | 证券账号 |
| 🡪 | 2 | Pbu | C6 | Y | 托管单元或交易单元 |
| 🡪 | 21 | StkCode | C8 | Y | 交易所证券代码 |
| 🡪 | 38 | StkBal | N17,2 | Y | 证券余额 |
| 🡪 | 39 | StkLastBal | N17,2 | Y | 证券昨日余额 |
| 🡪 | 13 | StkAvl | N17,2 | Y | 证券可用数量 |
| 🡪 | 201 | StkBuy | N17,2 | Y | 证券买入解冻 |
| 🡪 | 202 | StkSale | N17,2 | Y | 证券卖出冻结 |
| 🡪 | 203 | StkUncomeBuy | N17,2 | Y | 未交收股份买入解冻 |
| 🡪 | 204 | StkUncomeSale | N17,2 | 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** |
| 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 | SecuId | C20 | Y | 证券账号 |
| 🡪 | 2 | Pbu | C6 | Y | 交易单元 |
| 🡪 | 21 | StkCode | C8 | Y | 交易所证券代码 |
| 🡪 | 23 | BsFlag | C2 | Y | 买卖类别 |
| 🡪 | 19 | OrderQty | N17,2 | Y | 交易数量，（汇总数据） |
| 🡪 | 18 | OrderPrice | N10,4 | Y | 委托价格 |
| 🡪 | 22 | MatchQty | N17,2 | Y | 成交数量 |
| 🡪 | 20 | MatchAvgPrice | N10,4 | Y | 成交均价 |
| 🡪 | 25 | CancelQty | N17,2 | 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  A=待报 |
| 🡪 | 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 | 转融券执行报告同步消息 | 111/211 | 0010 |
| 5 | 转融券借入非约定申报 | 121/221 | 5101 | 转融通业务 |
| 6 | 转融券借入约定申报 | 121/221 | 5102 |
| 7 | 市场化转融券借入约定申报 | 121/221 | 5103 |
| 8 | 申请转融券借入展期 | 121/221 | 5121 |
| 9 | 同意转融券出借展期 | 121/221 | 5122 |
| 10 | 申请市场化转融券借入展期 | 121/221 | 5123 |
| 11 | 同意市场化转融券出借展期 | 121/221 | 5124 |
| 12 | 申请转融券出借提前了结 | 121/221 | 5131 |
| 13 | 同意转融券借入提前了结 | 121/221 | 5132 |
| 14 | 转融资借入申报 | 121/221 | 5001 |
| 15 | 转融资申请展期申报 | 121/221 | 5021 |
| 16 | 转融通订单撤单 | 121/221 | 5900 |
| 17 | 市场化转融券订单撤单 | 121/221 | 5901 |
| 18 | 转融券成交执行报告 | 223 | 5103 |
| 19 | 转融券撤单执行报告 | 223 | 5901 |
| 20 | 转融通订单查询 | 131/231 | 5400 |
| 21 | 保证金交易 | 141/241 | 6101 | 保证金业务 |
| 22 | 保证金交易撤单 | 141/241 | 6900 |
| 23 | 查保证金委托成交 | 151/251 | 6401 |
| 24 | 查保证金资金 | 151/251 | 6402 |
| 25 | 查保证金证券 | 151/251 | 6403 |
| 26 | 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，而派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。 |
| 3 | 调账合约 | 调账合约是中证金融根据与出借人、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 | 表示中证金融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 | 表示中证金融清算后证券或资金出借失败的合约状态； |
| 2 | 正 常 | 表示中证金融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 | 表示由借入人或者中证金融主动发起的资券划付； |
| 302 | 处置划付 | 表示由中证金融处置借入人的资金或证券的划付； |
| 303 | 合约手工处理 | 表示中证金融对合约资金、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，但中证金融没有做了结，待到复牌日，中证金融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) |
| 307 | 合约到期日调整 | 由于调整合约的到期日而引起的债权债务的变动 |
| 308 | 偿还差错调账 | 中证金融将因偿还出错而导致未参与了结合约的资金或证券生成差错调账合约 |
| 309 | 提前了结 | 由于合约提前了结而引起的债权债务变动 |
| 310 | 合约股份数量调整 | 由于ETF份额折算引起的债权债务变动，该业务了结原合约并生成新合约，并按相关公司公告的折算比例，新合约股份数量=原合约数量\*折算比例、证券价格=原合约证券价格/折算比例，费用及到期日等其它信息同原合约； |

## 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 | 中证金融转融出给证券公司的应收资金 |
| 12002 | 转融出资金利息 | 中证金融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中证金融资金产生的应付罚息 |
| 12004 | 转融出证券利息 | 中证金融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中证金融证券产生的应付罚息 |
| 12006 | 转融出证券权益金额 | 中证金融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 | 中证金融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 | 中证金融转融出给证券公司的证券 |
| 12102 | 转融出证券权益券 | 中证金融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 | 中证金融的应收资金（预留） |
| 13101 | 其他证券资产 | 中证金融的应收证券（预留） |
| 21004 | 转融入证券利息 | 中证金融向出借人转融入证券产生的应付利息 |
| 21005 | 转融入证券罚息 | 中证金融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 | 中证金融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 | 中证金融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 | 中证金融向出借人转融入证券 |
| 21102 | 转融入证券权益券 | 中证金融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 | 中证金融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 | 中证金融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 | 中证金融的应付资金（预留） |
| 23101 | 其他证券负债 | 中证金融的应付证券（预留） |
| 31001 | 转融入调账金额入 | 由于差错造成的中证金融应收金额(针对出借人) |
| 31002 | 转融入调账金额出 | 由于差错造成的中证金融应付金额(针对出借人) |
| 31101 | 转融入调账数量入 | 由于差错造成的中证金融应收证券(针对出借人) |
| 31102 | 转融入调账数量出 | 由于差错造成的中证金融应付证券(针对出借人) |
| 32001 | 转融出调账金额入 | 由于差错造成的中证金融应收金额(针对证券公司) |
| 32002 | 转融出调账金额出 | 由于差错造成的中证金融应付金额(针对证券公司) |
| 32101 | 转融出调账数量入 | 由于差错造成的中证金融应收证券(针对证券公司) |
| 32102 | 转融出调账数量出 | 由于差错造成的中证金融应付证券(针对证券公司) |