

关于合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者申请参与转融通证券出借有关事项的通知

各合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者、相关代理证券公司和托管行：

根据中国证监会、中国人民银行、国家外汇管理局《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》、中国证监会《关于实施〈合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法〉有关问题的规定》以及转融通证券出借相关业务规则，为便于合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者（以下统称“合格境外机构投资者”）申请参与转融通证券出借（以下简称“证券出借”），现将有关事项通知如下：

一、合格境外机构投资者采用托管行结算模式参与证券出借的，按照以下流程申请参与证券出借：

1、代理证券公司与托管行应在我公司仿真测试环境进行全业务测试（测试流程详见《转融通业务仿真测试环境使用指南》，附件1）。

2、已与我公司建立 FDEP 和 MR 配对关系的代理证券公司和托管行，可根据自身业务需要决定是否再次进行配对申

请。若需要单独为合格境外机构投资者建立 FDEP 和 MR 配对关系的代理证券公司和托管行，可以通过深证通网站分别提交与我公司 FDEP 和 MR 配对的申请（具体操作流程详见《深证通金融数据交换平台转融通业务上线操作指引》，附件 2），并分别向我公司申请开立结算机构代码（详见《合格境外机构投资者转融通业务技术系统申请表》，附件 3）。

3、托管行向我公司提交用印的《合格境外机构投资者基础信息表》（以下简称《基础信息表》，附件 4，纸质版和电子版）并将有关内容抄送至相关代理证券公司。

4、代理证券公司应按照我公司接口规范要求（详见《转融通参与人数据接口规范（Ver2.3）》，附件 5）第三章“独立出借人交易单元报备库”和“证券出借人资料报备库”，报备相关基本信息（《接口填写说明》详见附件 6）。代理证券公司自报备完成后次一交易日起，即可代理相关合格境外机构投资者参与证券出借。

代理证券公司在完成向我公司报备“独立出借人交易单元报备库”、“证券出借人资料报备库”信息前（含当日），不得代理出借证券，否则会导致托管行无法接收我公司发送的合约清算文件。

5、新增合格境外机构投资者客户参与证券出借的，已与我公司建立 FDEP 和 MR 配对关系的代理证券公司和托管行

仅需分别进行“独立出借人交易单元报备库”、“证券出借人资料报备库”报备更新和提交《基础信息表》。

二、合格境外机构投资者采用证券公司结算模式参与证券出借的，由代理证券公司提交《基础信息表》后，比照经纪业务客户的相关流程代理合格境外机构投资者申请并参与证券出借。

三、合格境外机构投资者、托管人和代理证券公司参与证券出借交易，应注意以下事项：

1、请共同做好出借前端控制，提交出借指令前，确认有足够的证券持仓，避免出借违约风险；

2、当日新办理指定交易或转托管的账户，次一交易日方可参与出借；

3、在合格境外机构投资者已出借证券的账户未收回全部已出借证券和借券费用前，不得为其办理撤销指定交易和转托管。

特此通知。

业务咨询电话：010-63211661，zrtfw@csf.com.cn

技术开发联系人：吴昀，010-63211769，

wuyun@csf.com.cn

刘铮，010-63211774，liuzheng@csf.com.cn

技术运维电话：010-63211700

联系地址:北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦
15 层

附件:

- 1、转融通业务仿真测试环境使用指南
- 2、深证通金融数据交换平台转融通业务上线操作指引
- 3、合格境外机构投资者转融通业务技术系统申请表
- 4、合格境外机构投资者基础信息表
- 5、转融通参与人数据接口规范 (Ver2.3)
- 6、接口填写说明

中国证券金融股份有限公司

2020 年 10 月 30 日

附件 1

转融通业务仿真测试环境使用指南

(Ver 2.0)

上海证券交易所

深圳证券交易所

中国证券金融股份有限公司

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一九年六月

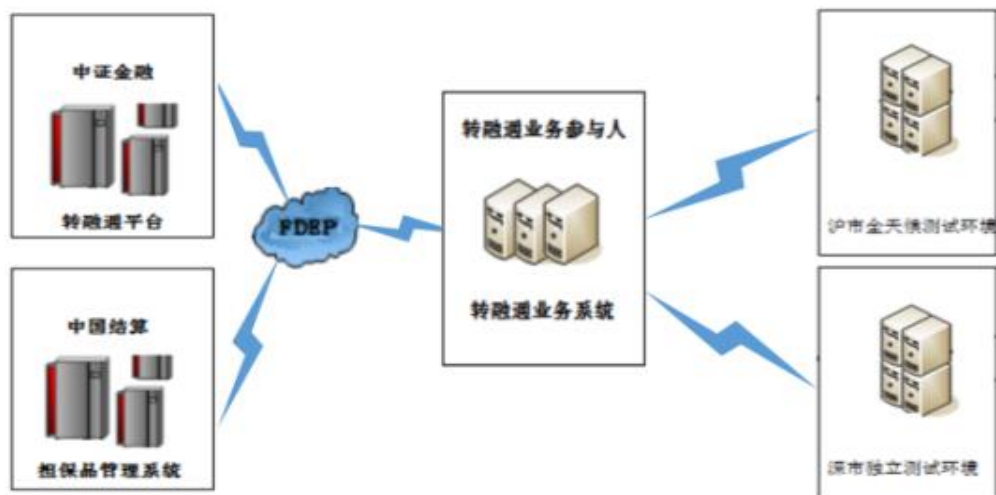
修订记录

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

一、转融通业务仿真测试环境简介

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

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



图一、转融通业务系统连接示意图

二、仿真测试系统运行方案

（一）测试申请

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

（二）测试时间

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

（三）测试内容

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

（四）初始数据安排

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

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

表一：中证金融转融通业务账户信息表

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

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

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

（五）其他说明

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

三、仿真测试环境接入参数

（一）中证金融转融通平台和中国结算担保品管理系统接入参数

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

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

表二：中证金融转融通平台和中国结算担保品管理系统接入参数表

（二）沪市全天候测试环境接入参数

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

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

（三）深市独立测试环境接入参数

深市独立测试环境接入方式：《深圳证券交易所新一代交易独立测试系统指南》（请参见深交所官网=>技术专栏=>交易独立测试系统栏目（<http://www.szse.cn/main/rule/jysywn/dlcsxt/xgwd/>）

四、测试联系方式

（一）联系电话及邮箱

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

[中国结算总部：](#)

[担保品测试服务（010-50938662；\[nxsun@chinaclear.com.cn\]\(mailto:nxsun@chinaclear.com.cn\)）](tel:010-50938662)

[担保品技术支持（010-50938987；\[zxfan@chinaclear.com.cn\]\(mailto:zxfan@chinaclear.com.cn\)）](tel:010-50938987)

[上交所：技术服务电话（4009003600）](tel:4009003600)

[中国结算上海分公司：全天候测试热线电话（021-68419167）](tel:021-68419167)

[PROP 技术支持热线电话（021-62321666）](tel:021-62321666)

[深交所：交易技术支持（0755-88668223；\[testsystem@szse.cn\]\(mailto:testsystem@szse.cn\)）](tel:0755-88668223)

[深证通：深证通机房（0755-83182222；\[v5test@sscc.com\]\(mailto:v5test@sscc.com\)）](tel:0755-83182222)

[中国结算深圳分公司：结算技术支持（0755-25946080）](tel:0755-25946080)

（二）测试交流 QQ 群

转融通测试交流 QQ 群：260512248

上交所技术服务 QQ 群：130170298

中国结算上海分公司 QQ 群：149247290

深交所交易开发测试 QQ 群：288321593

中国结算深圳分公司技术交流 QQ 群：91355646

附件：

附件 1：担保资金明细账户资金余额变更申请 DBF 库

附件 2：担保证券明细账户证券持仓变更申请 DBF 库

附件 3：初始合约新增申请 DBF 库

附件 4：转融通业务仿真测试借入人业务申请表

附件 5：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请表

附件 6：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请表

附件 7：转融通业务仿真测试借入人业务申请确认表

附件 8：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请确认表

附件 9：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请确认表

附件 1：担保资金明细账户资金余额变更申请 DBF 库

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

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

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

附件 2：担保证券明细账户证券持仓变更申请 DBF 库

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

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

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

附件3：初始合约新增申请 DBF 库

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

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

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

附件 4：转融通业务仿真测试借入人业务申请表

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

注：本表格是测试参与人向中证金融报的申请表，本表格请填测试环境信息。

附件 5：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请表

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

注：本表格是测试参与人向中证金融报的申请表，本表格请填测试环境信息。

附件 6：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请表

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

注：本表格是测试参与人向中证金融报的申请表，本表格请填测试环境信息。

附件 7：转融通业务仿真测试借入人业务申请确认表

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

注：本表格为中证金融反馈给申请人的业务申请确认表，由中证金融负责填写。

附件 8：转融通业务仿真测试独立出借人业务申请确认表

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

注：本表格为中证金融反馈给申请人的业务申请确认表，由中证金融负责填写。

附件9：转融通业务仿真测试托管行（银行）业务申请确认表

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

注：本表格为中证金融反馈给申请人的业务申请确认表，由中证金融负责填写。

附件 2

深证通金融数据交换平台转融通业务上线操作指引

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

1.用户登录

登录深圳证券通信有限公司网站：

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

用户登录：已有 userID 的用户初次使用本站办理业务，需要在本站注册。

注册：点击，链接至帐号注册界面。

登录成功后开始办理相关业务

2.选择业务

进入用户中心，选择业务申请开始办理业务。

选择转融通上线办理开通 FDEP 消息传输系统。

选择文件传输上线办理开通 FDEP 文件传输系统。

中证金融的 FDEP 文件小站号：R_ZHENGJIN01。

中证金融的 FDEP MR 小站号：R_ZHENGJIN01。



3.填写信息

填写并提交业务办理订单，提交申请后将有短信通知申请人订单受理进度。

4.对端确认

业务对端登录平台对订单进行确认，确认结果将有短信通知申请人及对端。

5.业务审核

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

6.运维配置

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

7.业务上线

8.深圳证券通信有限公司联系方式：

运维支持：0755-23826278

7x24 小时运维热线：0755-83182222

运维 E-mail：fdep@sscc.com

仿真测试支持：0755-23826503

业务办理咨询：0755-23826196

合格境外投资者
转融通业务技术系统申请表
(证券公司版)

证券公司全称			
联系方式			
	姓名	电话	邮件
技术部门负责人			
指定技术联系人			
指定传真			
FDEP 信息			
FDEP 文件小站号			
FDEP MR 小站号			
(公章)			
年 月 日			

合格境外投资者

转融通业务技术系统申请表

(托管行版)

托管人全称			
联系方式			
	姓名	电话	邮件
技术部门负责人			
指定技术联系人			
指定传真			
FDEP 信息			
FDEP 文件小站号			
<p>(公章)</p> <p>年 月 日</p>			

附件 4

合格境外机构投资者基础信息表

托管人信息							
托管机构名称			中证金融结算机构编码				
托管机构业务联系人 1			联系方式（座机和手机）				
托管机构业务联系人 2			联系方式（座机和手机）				
合格境外机构投资者基本信息							
合格境外机构投资者名称（中文）			经营证券期货业务许可证号				
合格境外机构投资者名称（英文）							
注册地所在国家/地区			境内办公地址（如有）				
业务联系人 1			电话和邮箱				
业务联系人 2			电话和邮箱				
合格境外机构投资者账户信息							
注：机构类别可为：A、基金管理公司（Fund management company）；B、保险公司（Insurance company）；C、证券公司/投资银行（Securities company/Investment bank）；D、商业银行（Commercial bank）E、其他机构，请列明（other institution, please specify）。请将上述序号填写至下表机构类别中。							
账户名称 1	机构类别	人民币特殊账户号	证券账号				代理证券公司
			上海		深圳		
			账户 1		账户 1		
			账户 2		账户 2		
			账户 3		账户 3		
...

注：1、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者（统称“合格境外机构投资者”），一个合格境外机构投资者填写一张表。

2、请保证信息真实、完整，填写完毕后用印。

转融通参与人数据接口规范

(Ver 2.3)

中国证券金融股份有限公司

二〇二〇年九月

前 言

为支持市场参与者开展转融通业务，约定转融通业务技术平台（以下简称转融通平台）和各参与者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，详细规范了参与者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
V2.3	20200907	<p>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</p> <p>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</p> <p>3、修改 T 日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）的 BS 字段位数为 255</p> <p>4、修改 T 日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.dbf）文件传输方式的描述</p> <p>5、修改展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.dbf）中 DFHYBH 的描述</p> <p>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，出借人性别-7 修改为“QFII/RQFII”</p>	
V2.2	20200320	<p>1、增加 T 日转融通成交信息库（ZRTCJXX.dbf）</p> <p>2、将“科创板转融券”文字描述调整为“市场化转融券”</p>	
V2.1	20191025	<p>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</p> <p>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</p> <p>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）</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p>	
V2.0	20190612	<p>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”</p> <p>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</p>	

		<p>入人证券账户类型（27 域），将 66 域改为非必填</p> <p>3、新增转融券执行报告，以及转融券执行报告同步消息</p> <p>4、新增市场化约定申报交易参数库（ZRQJYCSK.dbf）</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>7、新增提前了结结果通知库（ZRTTQLJJGTZ.dbf）</p> <p>8、债权债务库变动类型增加 309（提前了结）</p> <p>9、启用独立出借人报备和确认文件</p> <p>10、修改 T 日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.dbf）参与者订单号（CYRDDH）字段描述</p> <p>11、修改转融通业务订单申报确认应答消息 TargetContractSno 字段描述</p> <p>12、增加错误说明</p> <p>13、文字修订</p>	
V1.13	20180330	<p>1、T 日合约对帐库新增成交类型和对手方合约号字段</p> <p>2、修订附录 A 错误代码表</p> <p>3、保证金查询应答消息新增 120 字段</p>	
V1.12	20170421	<p>1、新增担保资金结息库（DBZJXX.dbf）</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>6、增加独立出借人交易单元报备库和确认库</p> <p>7、增加证券出借交易单元报备确认库</p> <p>8、合约偿还明细库中增加股东代码字段</p> <p>9、转融通权益处理库权益类别增加配售优先股</p> <p>10、T 日转融通新合约信息库增加债券应计利息字段</p> <p>11、新增基金红利再投资选择报文</p> <p>12、修订转融通权益处理库（ZRTQYCLK.dbf）发送数据说明</p>	<p>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</p> <p>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</p>
V1.10	20150128	<p>1、增加通知说明类文件接口</p> <p>2、增加证券数量单位约定</p> <p>3、更新偿还划付差错库 BZ 字段描述</p> <p>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）</p>	

		<p>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）</p> <p>6、更正日间业务数据接口-订单消息实例</p> <p>7、更新返回错误代码表</p> <p>8、统一中国证券金融公司简称为中证金融</p> <p>9、更正描述不准确的文字</p>	
V1.09	20120920	<p>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</p> <p>2、修改 T 日合约偿还明细库</p> <p>3、删除 T 日合约偿还汇总库</p> <p>4、增加“偿还划付差错库”</p> <p>5、合约对账库增加展期在途数量、在途金额</p> <p>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</p> <p>7、权益处理库修改为，每日发送参与权益清算的数据</p> <p>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”</p> <p>9、去除某些接口文件中标识的 18：00 下发的字样</p> <p>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</p> <p>11、增加日间接口：借入人综合信息查询</p> <p>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。</p>	
V1.08.2	20120809	<p>1、增加头寸资金接口</p> <p>2、错误代码增加 2076：合约已超过最长展期期限</p>	
V1.07	20120625	<p>1、新增第三章第十二节，“证券出借交易单元报备库（CJJYDYBB.dbf）；</p> <p>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）”；</p> <p>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”；</p> <p>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”；</p> <p>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；</p> <p>3、删除：“转融通成交库”和“合格出借人库”。</p>	
V1.06	20120515	<p>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</p>	
V1.05	20120508	<p>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；</p>	

		<ul style="list-style-type: none"> 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	<p>转融通权益处理库：</p> <ul style="list-style-type: none"> 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	<ul style="list-style-type: none"> 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	<ul style="list-style-type: none"> 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	<p>修订内容</p> <ul style="list-style-type: none"> 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“转融通参与者（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	<ul style="list-style-type: none"> 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	37
第一节 接口说明	37
第二节 系统架构	40
第三节 市场化转融券借入约定申报消息流程图	41
第一节 接口协议	45
第二节 动态业务数据消息包约定	45
第三节 参与人签到、签退及签到密码变更等系统消息	47
第四节 转融通业务消息	49
第五节 保证金业务消息	56
第六节 其他业务消息	61
第三章 静态数据文件接口	62
第一节 T日转融通期限库（ZRTQX.DBF）	62
第二节 T日转融通标的期限费率库（ZRTBDQXFL.DBF）	63
第三节 T日市场化转融券约定申报交易参数库（ZRQJYCSK.DBF）	64
第四节 T日转融通可充抵保证金证券库（ZRTBZJZQ.DBF）	65
第五节 T日转融通资金头寸（ZRTZJTC.DBF）	65
第六节 T日转融通成交信息库（ZRTCJXX.DBF）	66
第七节 T日转融通新合约信息库（ZRTXHYXX.DBF）	68
第八节 转融通权益处理库（ZRTQYCLK.DBF）	71
第九节 T日合约偿还明细库（ZRTHYCHMX.DBF）	73
第十节 偿还划付差错库（ZRTCHHFCC.DBF）	74
第十一节 T日合约对账库（ZRTHYDZ.DBF）	75
第十二节 担保资金结息库（DBZJJX.DBF）	77
第十三节 T+1日交收通知库（ZRTJSTZ.DBF）	79
第十四节 保证金追缴通知库（ZRTBZJZJTZ.DBF）	80
第十五节 展期结果通知库（ZRTZQJGTZ.DBF）	82
第十六节 提前了结结果通知库（ZRTTQLJGTZ.DBF）	85
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)	87
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)	89
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）	95
第四章 通知说明类文件接口	98
第五章 附录	99
附录 A：日间业务数据接口-返回错误代码表	99
附录 B：日间业务数据接口-订单消息实例	103
附录 C：计算校验和算法	104
附录 D：应用消息重复组件	104
附录 E：主要数据字典	106
附录 F：证件代码字典	107

附录 G: 通讯密码明文转密码 C 语言例子	108
附录 H: 合约类型	109
附录 I: 合约状态	109
附录 J: 债权债务变动方向	109
附录 K: 债权债务变动类型	110
附录 L: 债权债务明细标识	110

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者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

- 6、借入人转融资借入展期申报
- 7、借入人转融券借入展期申报
- 8、借入人转融券市场化约定申报展期申报
- 9、出借人转融券借出同意展期申报
- 10、出借人转融券市场化约定申报同意展期申报
- 11、出借人转融券借出提前了结申报

12、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

13、借入人保证金交易及权益处理申报和撤单

14、借入人保证金交易委托成交查询申报

15、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：

(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日市场化转融券交易参数库 (ZRQJYCSK.dbf)

4、T日转融通可充抵保证金证券库 (ZRTBZJZQ.dbf)

5、T日转融通资金头寸 (ZRTZJTC.dbf)

(二) 转融通清算对账文件

6、T日转融通新合约信息库 (ZRTXHYXX.dbf)

7、转融通权益处理库 (ZRTQYCLK.dbf)

8、T日合约偿还明细库 (ZRTHYCHMX.dbf)

9、偿还划付差错库 (ZRTCHHFCC.dbf)

10、T日合约对帐数据库 (ZRTHYDZ.dbf)

11、 担保资金结息库 (DBZJJX.dbf)

(三) 转融通通知文件

12、 T日转融通成交信息库 (ZRTCJXX.dbf)

13、 T+1日交收通知库 (ZRTJSTZ.dbf)

14、 保证金追缴通知库 (ZRTBZJZJTZ.dbf)

15、 展期结果通知库 (ZRTZQJGTZ.dbf)

16、 提前了结结果通知库 (ZRTTQLJJGTZ.dbf)

(四) 转融通出借人报备文件

17、 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)

18、 出借人资料报备库/出借人资料报备确认库 (CJRZLBB.dbf
/CJRZLBBQR.dbf)

19、 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；

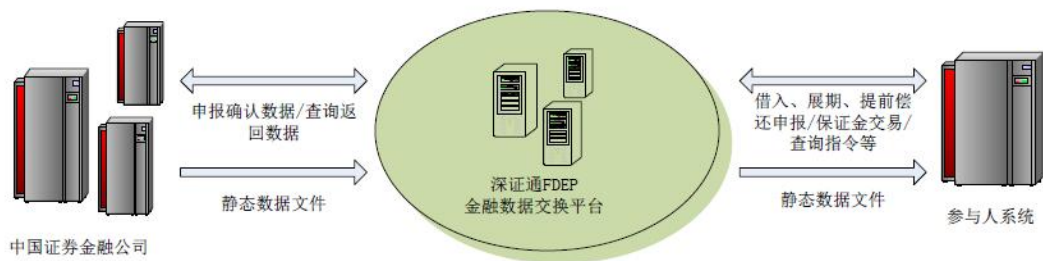
违约金(出借违约罚息)：指出借人、中证金融应该出借但没有成功出借而生成的费用；

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。

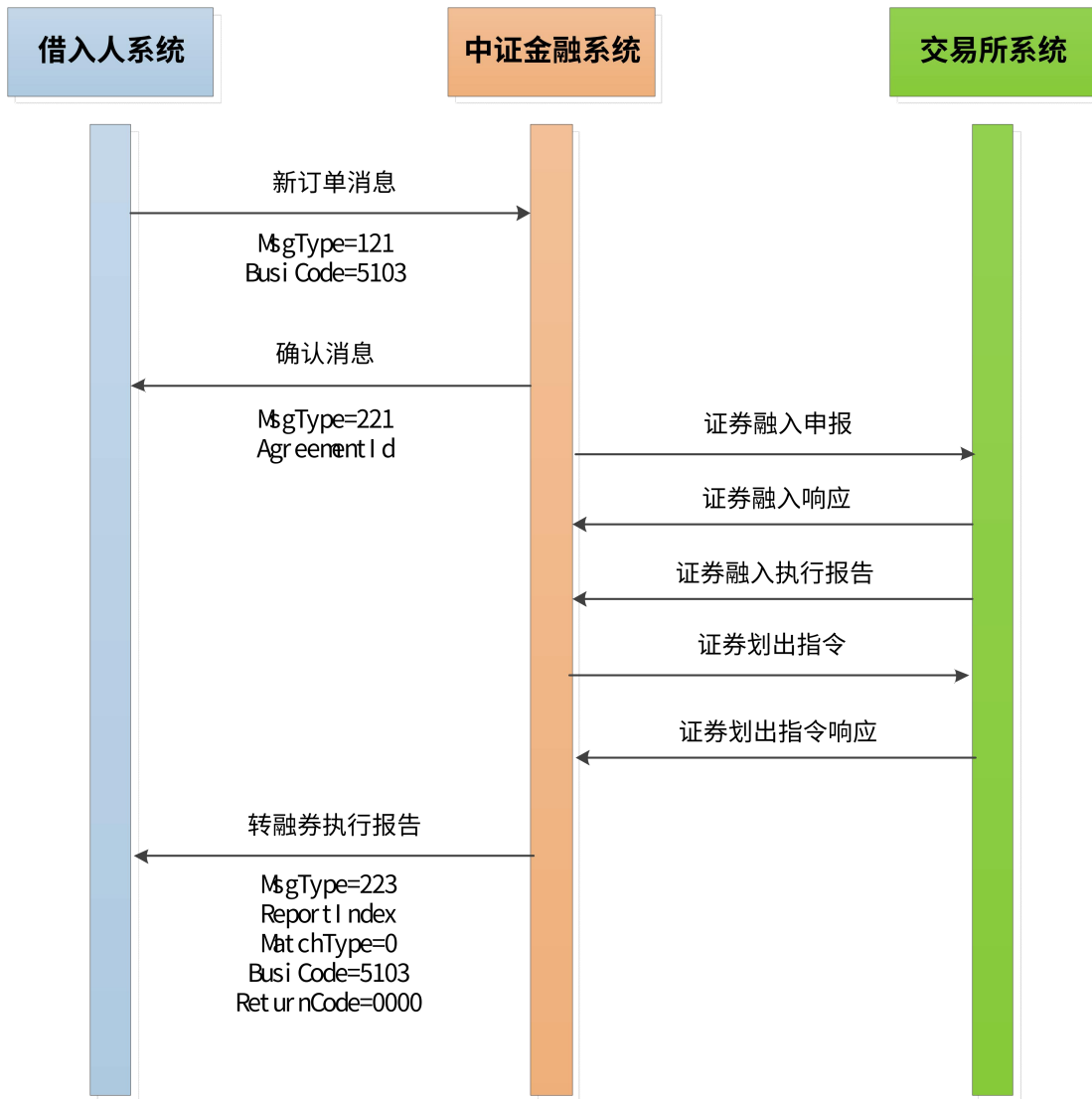
第二节 系统架构

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。

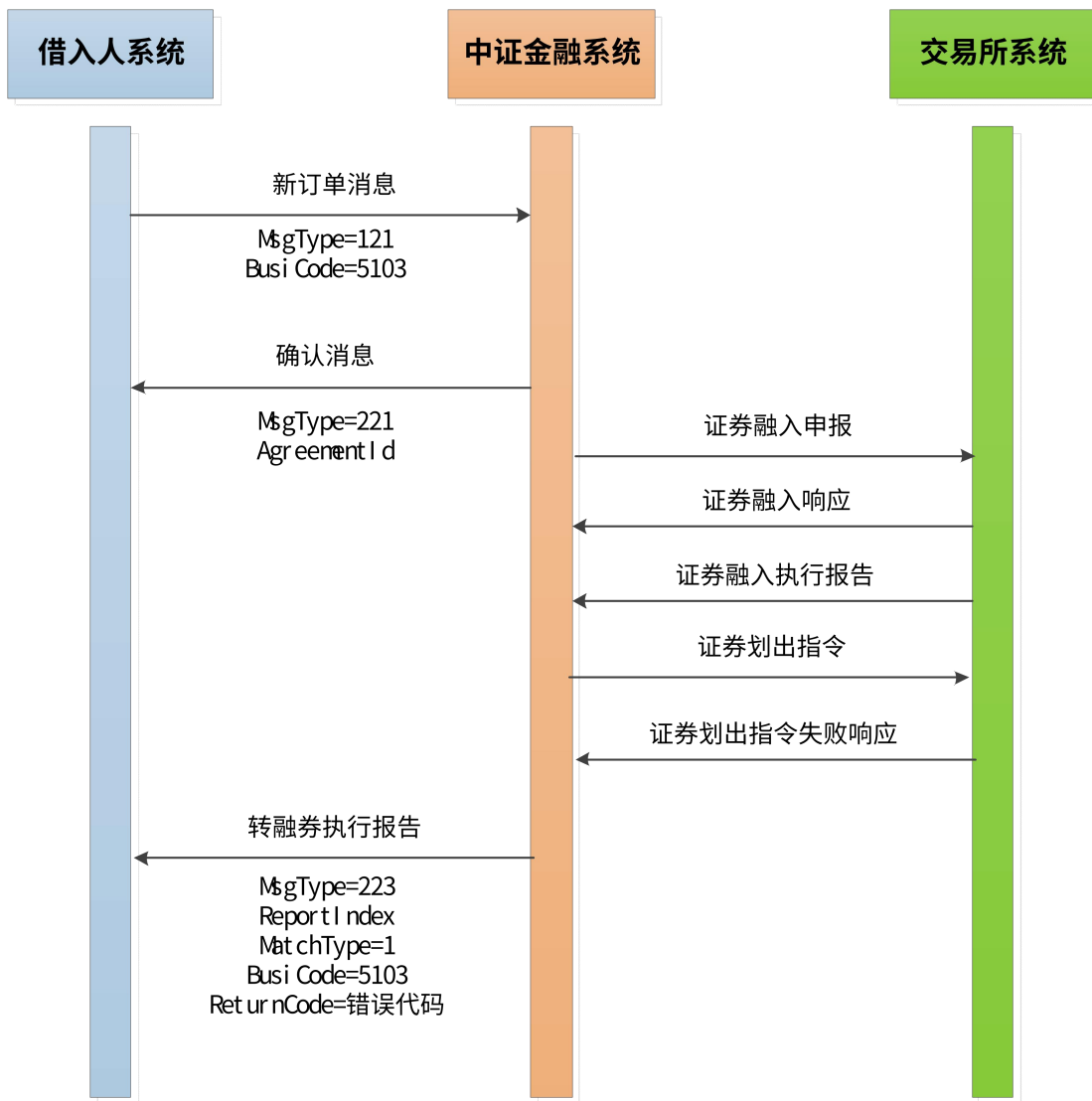


图一、中证金融和参与人技术系统架构图

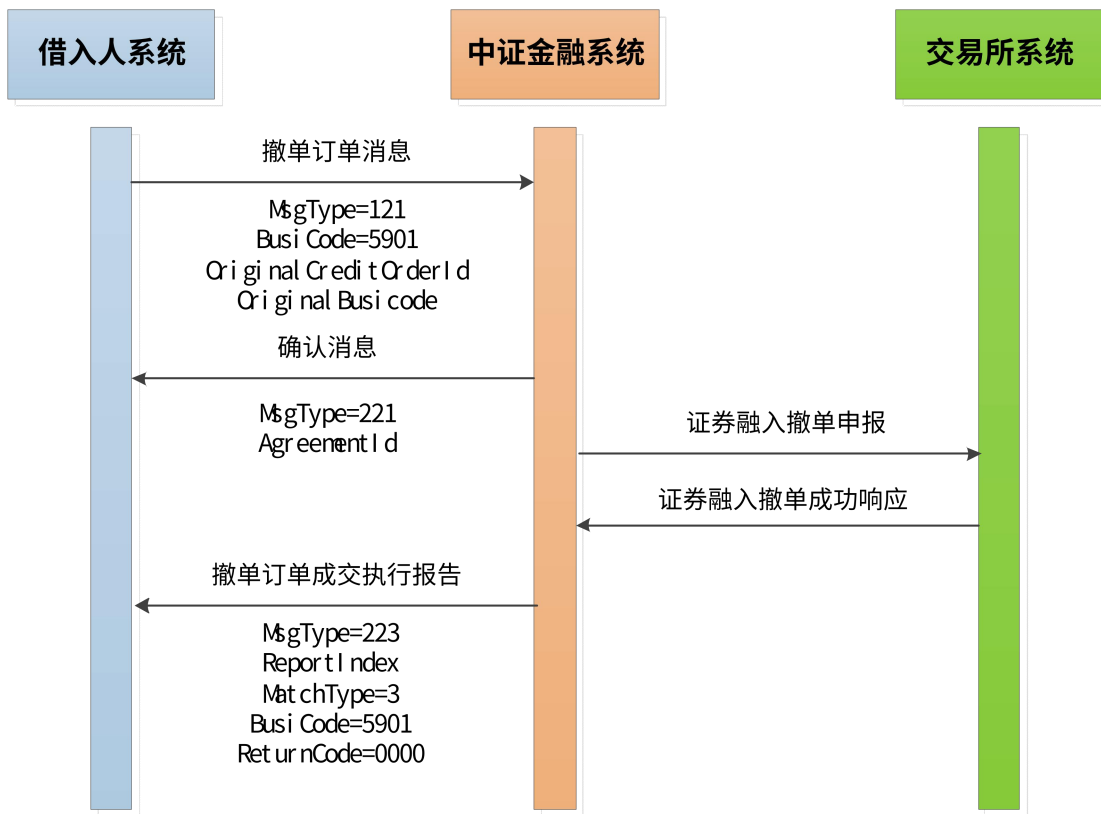
第三节 市场化转融券借入约定申报消息流程图



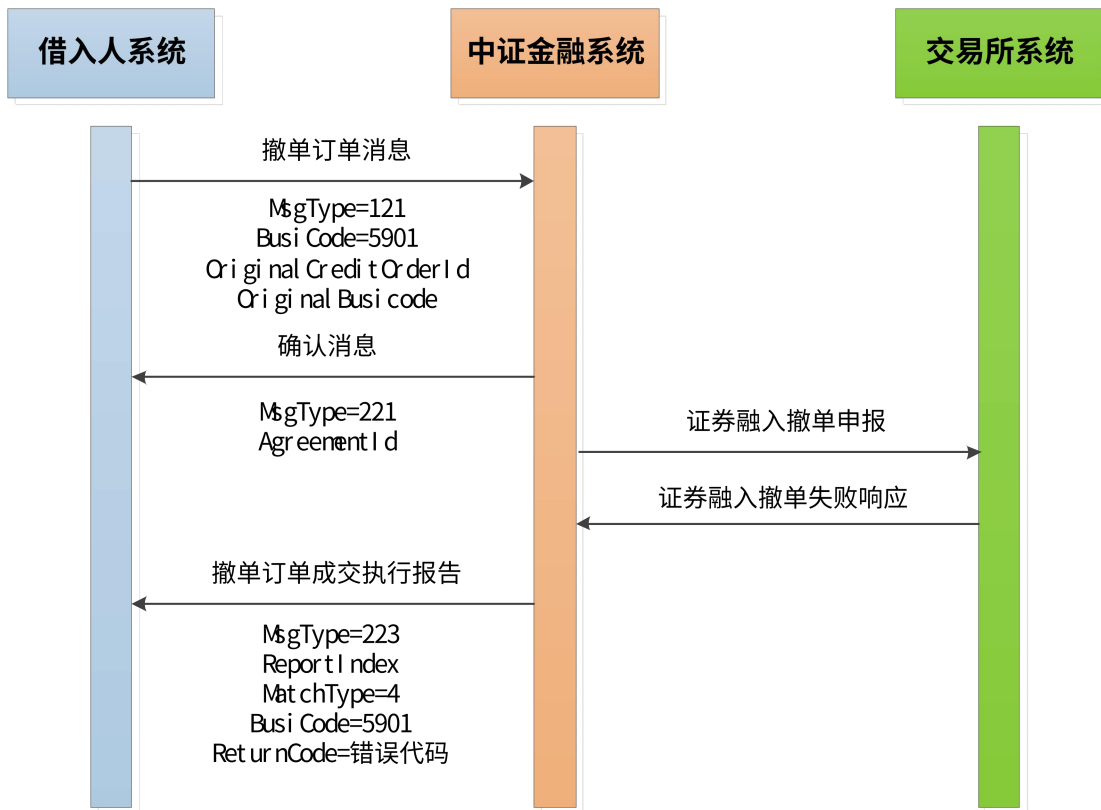
中证金融对于收到的每一笔市场化转融券借入约定申报订单消息，在校验无误后都会实时向交易所发送证券融入申报。交易所系统撮合出借人和中证金融成交后，发送证券融入执行报告，中证金融分派证券给借入人后，再向交易所发送证券划出指令，将刚借入的证券从中证金融账户划至借入人证券账户。交易所返回证券划出指令响应成功后，中证金融向借入人发送转融券执行报告消息，执行报告类型为0（成交且调仓成功）。



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）。

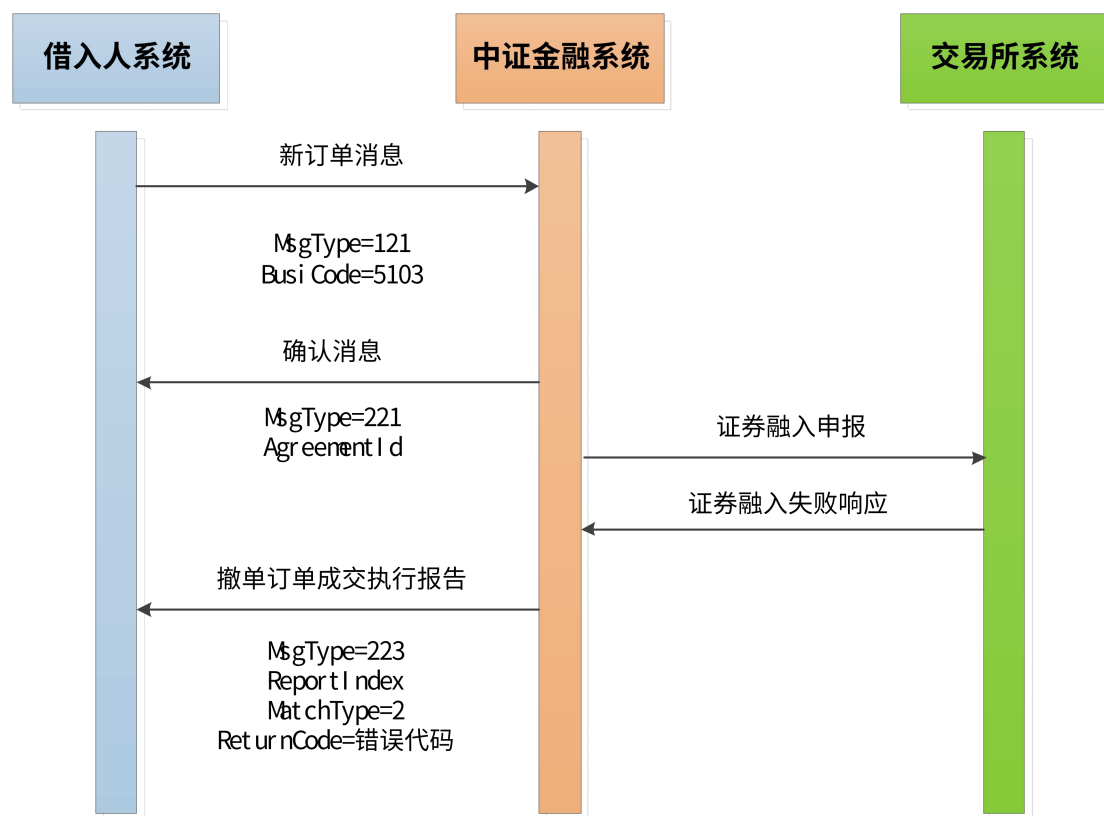


中证金融对于借入人市场化转融券约定申报撤单成功的订单，向借入人返回一个转融券执行报告消息，执行报告类型为3（撤单成功）。



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 参与者签到、签退及签到密码变更等系统消息

一、转融通参与者（接入方）签到、签退及密码变更消息

参与者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。参与者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

参与者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），此域值还作为参与者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, 出借人: 普通证券账户交易单元)
6	Seculd	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)
27	SeculdType	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
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	TargetSeculd	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	Seculd	C20	Y	证券账号,同请求包内容
27	SeculdType	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	TargetSeculd	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，中证金融在处理后将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	同参与者请求业务类型，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	该域值同参与者请求的申请编号
92	OrderDate	C8	Y	该域值同参与者请求的订单日期
1	Market	C1	Y	该域值同参与者请求的市场代码
2	Pbu	C6	Y	该域值同参与者请求的对应市场交易单元
6	Seculd	C20	Y	该域值同参与者请求的对应市场证券账号
4	CreditDays	N4	Y	该域值同参与者请求的转融通期限
5	CreditRate	N9,7	Y	该域值同参与者请求的转融通息费率
37	MoneyType	C3	Y	该域值同参与者请求的币种
21	StkCode	C8	Y	该域值同参与者请求的证券代码
12	CreditQty	N16	Y	该域值同参与者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	本次交易后参与者实时可用证券数量，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	TargetSeculd	C20	Y	该域值同参与者请求的对手方证券账号
3	TargetPbu	C6	Y	该域值同参与者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：参与者市场化转融券借入约定申报发送至中证金融后，中证金融给参与者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者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。在参与者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）
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	Seculd	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	参与者转融通原订单编号， 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	Seculd	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	TargetSeculd	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	参与者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
6	Seculd	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	参与者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 为上海科创板证券且 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	Seculd	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	Seculd	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	Seculd	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	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	参与者订单号	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	中证金融生成的唯一合约编号
6	CYRDDH	参与者订单号	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	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),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须填
12	TGDY	托管单元	C6	托管单元,发送对象为借入人时必须填
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式；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
--	--	--	--	---

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、深圳市场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；再如上海市场送股、转增股，权益登记日清算一次，收到权益证券上市信息后清算一次，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	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	QYBCHY H	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	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	ZRTL B	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, 证券公司已划付给中证金融, 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	参与者结算机构代码
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 日合约对账库主要用于出借人和借入人和中证金融之间的合约对账时使用，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。

合约对账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	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	ZRTL	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	DSFHBYH	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须填
16	TGDY	托管单元	C6	托管单元,发送对象为借入人时必须填
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 字段中的值已包含了该数量
28	ZQZTJE	展期在途金额	N16,2	>=0,在 JSJE 字段中的值已包含了该金额
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	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	ZRTL B	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	应收收数量	N12	>=0
17	JSJE	应收收金额	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,指借入人以前已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	DBQYTTZZQJZ	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	WTRQ	委托日期	C8	展期申请的委托日期

4	CYRDDH	参与者订单号	C10	参与者委托的订单号
5	CYRDM	参与者代码	C12	参与者代码
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)均填充格。
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: 参与者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, 参与者结算机构代码

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	参与者订单号	C10	参与者委托的订单号
6	CYRDM	参与者代码	C12	参与者代码
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

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者结算机构代码
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	中登参与者编码	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者编码。如无中登参与者编码则填写为 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	中登参与者编码	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	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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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(CJRXXZ)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	LXRLXD Z	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	CJRXXZ	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	LXRDH M	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 户股东席位	C6	同申报库
38	SZGDDM	出借人深圳证券帐户 户股票代码	C20	同申报库
39	SZTGXW	出借人深圳证券帐户 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	CJRM	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	CJRZDB M	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	TGRZD BM	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	TGRJSJ	托管人中证金融结算机构	C10	必填，托管人在中证金融开立

	G		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。

2) 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	CJPMC	独立出借人、代理券商名称	C64	同申报库
4	CJRZDB M	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	TGRZD BM	托管人中登参与人编码	C32	同申报库
12	TGRJSJ G	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	参与者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
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阈值
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	Seculd	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	StkUncome Buy	N17,2	Y	未交收股份买入解冻
→	204	StkUncome Sale	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	Seculd	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	转融通业务
5	转融券借入非约定申报	121/221	5101	
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	已了结	表示合约到期后，全部负债正常了结的合约状态；
5	已终止	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)

接口填写说明

证券出借人资料报备库、独立出借人交易单元报备库、证券出借交易单元报备库填写指南见下，其他字段无特殊说明，请根据《中国证券金融公司转融通参与人数据接口规范 v2.3》第十八节“证券出借人资料报备库”的格式定义填写。

证券出借人资料报备库填写指南

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	填写代理证券公司在中证金融开立的结算机构代码。
2	SBXH	申报序号	N8	同一代理证券公司申报序号当日唯一，且不能为零。当天重复报备，序号要往后排列。
3	CJRJC	出借人简称	C32	填写出借人简称+QFII/RQFII。
4	CJRQC	出借人全称	C128	填写出借人全称+QFII/RQFII。
5	CJRXZ	出借人性质	C1	选择 7-QFII/RQFII。
6	CJRLB	出借人类别	C1	选择 1--非独立出借人。
7	DLQSM C	代理券商名称	C32	填写代理证券公司名称。
8	CJZQL Y	出借证券来源	C1	选择 2-产品。
9	CPMC	产品名称	C40	填写证券账户名称，需体现自营或管理的客户资金。
10	ZJLX	出借人证件类型	C1	选择 0--营业执照。
11	ZJHM	出借人证件号码	C64	填写经营证券期货业务许可证号码。
12	FRMC	法人代表名称	C32	填写经营证券期货业务许可证中的负责人姓名。
13	ZJGDM	组织机构代码	C32	填写经营证券期货业务许可证号码。

独立出借人交易单元报备库填写指南

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	CJPMC	独立出借人、代理券商名称	C64	填写代理证券公司名称。
2	CJRZDB M	独立出借人、代理券商中登参与人编码	C32	填写代理证券公司在中国结算开立的参与人编码。
3	JSJG	独立出借人、代理券商中证金融结算机构	C10	填写代理证券公司在中证金融开立的结算机构编码。
4	CPQC	产品名称全称	C64	填写 QFII/RQFII 证券账户名称全称。
5	CPJC	产品名称简称	C32	填写 QFII/RQFII 证券账户名称简称。
6	ZQZH	产品的证券账户	C32	填写 QFII/RQFII 产品的证券账户。
7	JYDY	产品的交易单元	C6	填写 QFII/RQFII 产品的专用交易单元。
8	TGRMC	产品对应托管人名称	C64	填写产品对应托管人名称。
9	TGRZD BM	托管人中登参与人编码	C32	填写托管人在中国结算开立的参与人编码。
10	TGRJSJ G	托管人中证金融结算机构	C10	填写托管人在中证金融开立的结算机构编码。

证券出借交易单元报备库填写指南

序号	字段名	字段描述	类型	说明
1	JSJG	结算机构	C10	填写代理证券公司在中证金融开立的结算机构编码。
2	JSJGMC	机构全称	C64	填写代理证券公司全称。
4	CYRDM	中登参与人编码	C32	填写代理证券公司在中国结算开立的参与人编码。如无中国结算参与人编码则

				填写为 0。
6	JYDY	交易单元	C6	填写 QFII/RQFII 产品的专用交易单元。
7	BFJZH	备付金账号	C32	填写填写代理证券公司备付金账户，但是相关费用不根据此项目进行划转。