

关于交易所开放式基金数据接口规范调整的说明

我公司将于近期与上海证券交易所和深圳交易所联合推出开放式基金在交易所的申购赎回业务，为保证各方参与人和我公司 TA 系统顺利交换数据，我公司对《中国结算开放式基金数据接口规范 (DBF)》（以下简称《基金管理人接口规范》）和《中国结算开放式基金数据接口规范 (TXT)》（以下简称《基金销售人接口规范》）做如下调整，请各基金参与人参照执行。

一. 《基金管理人接口规范》的调整

1、申请预汇总库 KFJYHZ.DBF

系统每日将通过 TA 系统申报和通过交易所途径申报的认购申购赎回等业务分别汇总，统一发送给基金管理人。利用‘备用字段’区分 TA 接收交易申请和交易所申报交易：

‘HZBYBZ’为空，表示 TA 接收交易申请汇总记录，‘HZBYBZ’为‘1’表示交易所途径申报交易汇总。

2、交易待确认库 KFJYDQ.DBF

系统每日将通过 TA 系统申报和通过交易所途径申报的认购申购赎回等业务进行预处理，将成功的记录统一通过待确认库发送给基金管理人。系统利用‘申请单号’字段来区分 TA 系统申报和交易所途径申报交易。具体说明见下表：

字段名		DQSQDH	DQJJZH	DQDLRM
交易所	上海	199nnnnnnnn	10 位股票账户, 右对齐, 左补空格	6 位销售人代码
	深圳	198nnnnnnnn		
TA		98/99nnnnnnnn	12 位基金账户	

其中, nnnnnnnn 为顺序号。

对于上海, 增加了跨市场转托管交易和交易所转指定交易(转指定表示交易所十位账户变更其绑定席位的交易, 席位变更有时同时会引起席位对应结算法人的变更)。区别于深圳 LOFS 跨市场转托管, 上海转入转出的份额仍然登记在 TA 系统中。在 026 业务中, 增加说明如下:

	DQDLRM	DQJJZH	DQSQSL	DQYSQDH
转指定	当前指定席位对应销售人代码 (6xxxxx)	10 位(右对齐)	0	空
场内转场外	转出席位对应销售代理人 (6xxxxx)	10 位	不等于 0	转入代理人 (6xxxxx)
场外转场内	转入代理人	12 位	不等于 0	转入席位

3、交易回报库 KFJYHB. DBF

系统每日将通过 TA 系统申报和通过交易所途径申报的认购申购赎回等业务回报给管理人, 系统利用'申请单号'字段来区分 TA 系统申报和交易所途径申报交易。具体说明见下表:

字段名	HBSQDH	HBJJZH	HBDLRM
-----	--------	--------	--------

交易所	上海	199nnnnnnnn	10 位股票账户, 右对齐, 左补空格	6 位席位或销售人代码
	深圳	198nnnnnnnn		
TA		98/99nnnnnnnnn	12 位基金账户	6 位销售人代码

其中, nnnnnnnnn 为顺序号, 对于交易所途径申报的失败交易数据, 由于所申报时的席位无销售人对应, 这种情况下, 代理人字段填写对应申报的席位代码。

对于上海, 增加了跨市场转托管交易和交易所转指定交易回报。区分于深圳 LOFS 跨市场转托管, 上海转入转出的份额仍然登记在 TA 系统中。

(1) 对于转指定交易, 回报具体字段说明:

字段名	HBYWLX	HBDLRM	HBJJZH	HBSQSL	HBFSL
	027	转入销售人代码 (6xxxxx)	10 位 (右对齐)	0	大于 0
	028	转出席位对应销售人代码 (6xxxxx)	10 位 (右对齐)	0	小于 0

特别说明:

系统增加虚拟销售人: 对于转入席位无法对应系统中结算法人时, 转指定失败, 份额存放于代码为 ‘680101’ 的代理人下 (‘680101’ 是上交所的虚拟代码)。

(2) 对于从场内 (上海证券交易所) 转到场外 (TA), 回报具体字段说明:

字段名	HBYWLX	HBDLRM	HBJJZH	HBSQSL	HBFSL
-----	--------	--------	--------	--------	-------

	026	转出席位对应销售人代码 (6xxxxx)	10 位 (右对齐)	大于 0	大于 0
	027	转入销售人代码 (6xxxxx)	12 位	0	大于 0
	028	转出席位对应销售人代码 (6xxxxx)	10 位 (右对齐)	0	小于 0

(3) 对于从场外 (TA) 转到场外 (上海证券交易所), 回报具体字段说明:

字段名	HBYWLX	HBDLRM	HBJJZH	HBSQSL	HBFSSL
	026	转出销售人代码 (6xxxxx)	12 位	大于 0	大于 0
	027	转入席位对应销售人代码 (6xxxxx)	10 位 (右对齐)	0	大于 0
	028	转出销售人代码 (6xxxxx)	12 位	0	小于 0

4、结算对帐库 KFJSDZ.DBF

如果基金属于深圳市场的 LOFs 基金, 相关的结算对帐具体字段说明如下:

		DZDLRM	DZJJZH	DZCYFE	DZDJFE	DZHSFE	DZBYBZ
TA 系统	明细数据	基金销售人编码 (6XXXXX)	基金帐户 (12 位)	TA 系统持有份额	TA 系统冻结份额	=0	空
	汇总数据	空	空	TA 系统持有份额	TA 系统冻结份额	=0	= '1'
	在途数据	基金销售人编码 (6XXXXX)	基金帐户 (12 位)	确认份额		=0	= '2'
登记结算系统	明细数据	基金销售人编码或结算参与人席位号	证券帐户 (10 位), 右对齐, 左补空格	登记结算系统持有份额	登记结算系统冻结份额	=0	空

	汇总数据	空	空	登记结算 系统持有 份额	登记结算 系统冻结 份额	=0	= '0'
--	------	---	---	--------------------	--------------------	----	-------

注意: 红字部分为变更部分, 对于结算系统登记份额, 当对应席位在 TA 系统中有销售代理人 (6*****) 对应, 则填写销售人代码, 否则仍然填写席位信息。

如果基金属于上海市场基金, 由于通过交易所认购/申购的份额也登记在 TA 系统中, 在结算对帐中统一发送给基金管理人, 具体如下:

字段名			DZDLRM	DZJJZH
TA 系统	明 细 数据	场内途径	销售人 6 位编码 6xxxxxx	10 位 (右对齐, 左 补 2 空格)
		场外途径		12 位基金账户
	汇 总 数据	场内场外合并汇总		

二. 《基金销售代理人接口规范》的调整

1、增加下发上海基金参与人及结算席位文件数据文件
系统增加下发上海基金参与人及结算席位文件 (文件类型为 21, 文件名为 OFD_99_???-CCYYMMDD-21.TXT) 中, 文件内容为上海方面的证券结算席位相关信息, 其中 ??? 为销售人 3 位编码。

文件采用纯文本形式, 只包含数据记录, 不包含文件标识、文件版本号、文件创建人、文件接收人、日期、汇总表号、文件类型码、发送人、接收人、字段数、字段名和文件结束标识, 并且文件名不包含在索引文件中。具体字段定义

如下:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	DistributorCode	销售参与人代号	C	6	销售参与人为三位，左对齐，右补空格。
2	DistributorName	销售参与人名称	C	32	
3	DistributorType	销售参与人类型	C	1	‘0’ -销售银行 ‘1’ -销售券商 ‘2’ -结算券商 ‘3’ -基金直销
4	TransferPermitFlag	允许转入标志	C	1	‘Y’ -允许 ‘N’ -不允许
5	DownloadDate	发送日期	C	8	CCYYMMDD

注意: 上海结算席位为 3 位或 5 位, 5 位结算席位采用左对齐方式, 3 位席位采用左补 2 位空格。

2、上海交易所跨市场转托管交易申报和确认

上海交易所发行的开放式基金可进行交易所场内和 TA 场外之间的跨市场转托管，具体接口参照 LOFS 的跨市场转托管接口说明 (www.chinaclear.com.cn, 可以下载)。其中的席位是上海市场交易席位。

3、增加发送资金明细文件（文件类型是 25）

TA 系统将场内申购赎回委托与场外业务合并在一起清算，通过各基金参与人在场外开立的开放式基金帐户进行净额资金交收，交收结果可通过上海 PROP 系统或深圳 IST 系统查看。交收结果对应的资金清算明细数据通过在场外增加资金清算明细文件公布，将基金销售人在场内各席位的申购赎回业务和场外业务的清算明细数据合并并发送给基金参与人，供基金参与人发送给下属席位和对帐使用。

文件命名为:

OFD_99_XXX_CCYYMMDD_25.DBF 和

OFD_98_XXX_CCYYMMDD_25.DBF

其中, 'XXX'为销售人 3 位代码, 99 文件包中只包含属于 99TA 的基金相关资金明细, 98 文件包中只包含属于 98TA 的基金相关资金明细。98 与 99 文件包的区分与销售人在深圳或上海开立备付金户没有关系。

文件中具体字段定义见下表:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	QMOSXH	清算序号	C	20	
2	QMSQRQ	申请日期	C	8	CCYYMMDD
3	QMHSBZ	沪深标志	C	1	
4	QMZJZH	资金帐户	C	18	
5	QMJJDM	基金代码	C	6	
6	QMDLRM	基金销售人代码	C	3	
7	QMXWDM	席位代码	C	6	
8	QMYWLX	业务类型	C	3	
9	QMZJLX	资金类型	C	3	
10	QMSFJE	应收付金额	N	17, 2	
11	QMOSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
12	QMJSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
13	QMFSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD

(1) 本接口将开放式基金登记结算系统按基金代码、基金销售人代码、席位代码、业务类型和资金类型进行汇总的资金清算明细发送给基金参与人;

数据格式: FOXPRO2.5 下标准 DBF 格式。

数据发送时点: 每日 15:00 前

(2) QMOSXH (字段: -清算序号), 清算序号字段。该字段前 8 位用于存放资金清算序号, 右补空格。

(3) QMSQRQ (字段: 申请日期), 为清算数据对应的交易申报日期, '056' 业务中为空。

(4)、QMHSBZ (字段: 沪深标志), “0”为深圳, “1”为上海。

(5)、QMZJZH (字段: 资金帐户), 为基金参与人在深圳或上海开立的开放式基金账户, 账户左对齐, 右补空格。

(6)、QMJJDM (字段: 基金代码), 发生业务的基金代码。

(7)、QMDLRM (字段: 基金销售人代码), 发生场内或场外业务的基金销售人代码。

(8)、QMXWDM (字段: 席位代码), 对于场内申购赎回业务, 席位代码为委托申请的席位代码, 对于场外业务, 席位代码为空。

(9)、QMYWLX (字段: 业务类型), “020”为认购, “022”为申购, “024”为赎回, “026”为转托管, “036”为基金转换, “039”为定时定额, “043”为分红, “059”为认购结束。

(10)、QMZJLX (字段: 资金类型), “001”为交易净额, “002”为手续费, “003”为代理费, “004”为印花税, “005”为利息, “006”为利息税, “007”为过户费, “008”为其他费用, “009”为现金红利, “010”为红利所得税, “011”为退款金额, “012”为退款利息, “013”

现金分红手续费。

(11)、QMSFJE（字段：应收付金额），正数表示应收金额，负数表示应付金额。

(12)、QMOSRQ（字段：清算日期），为 T+1 日（其中，T 日为开放式基金交易申报日）。该字段为字符串类型，但存放 CCYYMMDD 格式的日期。

(13)、QMJSRQ（字段：交收日期），为资金交收指令执行交收的日期，为 T+2 日（其中 T 为交易申请日）。该字段为字符串类型，但存放 CCYYMMDD 格式的日期。

(14)、QMFSRQ（字段：发送日期），为总公司基金系统发送该接口文件的日期。该字段数据类型为字符串，但是存放 CCYYMMDD 格式的日期。

中国证券登记结算有限责任公司

开放式基金工作小组