

附件 2

新质押式国债回购业务  
会员技术系统接口指南  
V1.1

二零零六年三月

## 变更说明

版本号	修改日期	修改内容
1.1	2006-3-29	增加错误码，修改折算率文件名称为“xzslMMDD.txt”

## 目 录

<b>1</b>	<b>总则 .....</b>	<b>5</b>
<b>2</b>	<b>会员技术变更要点介绍 .....</b>	<b>6</b>
2.1	变更总则 .....	6
2.2	回购 .....	6
2.2.1	融资方 .....	6
2.2.2	融券方 .....	6
2.3	入库 .....	7
2.4	出库 .....	7
<b>3</b>	<b>简单业务介绍 .....</b>	<b>8</b>
3.1	质押式回购交易 .....	8
3.2	折算率 .....	8
3.3	标准券 .....	8
3.4	质押券 .....	8
<b>4</b>	<b>代码规则 .....</b>	<b>9</b>
4.1	出入库 .....	9
4.1.1	代码 .....	9
4.1.2	简称 .....	9
4.2	标准券 .....	9
4.2.1	代码 .....	9
4.2.2	简称 .....	9
4.3	回购 .....	9
<b>5</b>	<b>接口描述 .....</b>	<b>11</b>
5.1	回购交易 .....	11
5.1.1	申报要素 .....	11
5.1.2	交易系统检查 .....	11
5.1.3	成交回报 .....	11
5.2	入库 .....	12
5.2.1	申报要素 .....	12
5.2.2	交易系统处理 .....	13
5.2.3	成交回报 .....	13
5.3	出库 .....	14
5.3.1	申报要素 .....	14
5.3.2	交易系统处理 .....	15
5.3.3	成交回报 .....	15
5.4	信息 .....	17
5.4.1	交易行情 .....	17

---

5.4.2	折算率数据.....	17
5.4.3	发送途径.....	17
<b>6</b>	<b>其他.....</b>	<b>18</b>
6.1	新增错误码.....	18
6.2	联系方式.....	18

# 1 总则

1. 编制本文档的依据：《上海证券交易所债券交易实施细则》，本所原有的技术系统接口；
2. 本所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，要减少系统改造对会员公司带来的影响；
3. 本文中未涉及的内容请参考上证所及中国证券登记结算有限责任公司上海分公司公布的业务实施细则及现有业务规则；
4. 本文所指回购均指 2006 年 5 月 8 日后新推出的国债质押式回购品种；

## 2 会员技术变更要点介绍

新质押式国债回购业务中，通过交易所技术系统进行的业务主要包括：入库，出库及回购。

### 2.1 变更总则

与老质押式国债回购业务相比，新质押式国债回购业务从技术系统变更角度出发，主要有以下修改：

- 回购、出入库申报控制到账户；
- 需要对每一笔回购及出入库的投资者余额进行检查/控制；
- 新质押式国债回购业务中，能进行出入库申报的现券只有国债，不包括企业债；
- 其他业务问题，请参见交易所业务指引；

### 2.2 回购

#### 2.2.1 融资方

业务类型	交易系统端	会员端
申报	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查账户是否具有权限；</li> <li>● 检查申报价格、数量、账户与席位的指定关系；</li> <li>● 检查融资方标准券余额；</li> </ul>	检查投资者申报代码是否正确；
成交回报处理	发送一条成交回报，代码为‘204***’	根据成交回报中的“成交数量”修改融资方账户中的标准券余额

备注：以上“会员端”内容仅作为参考，会员应综合考虑是否还有其他检查内容。

#### 2.2.2 融券方

业务类型	交易系统端	会员端
申报	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查账户是否具有权限；</li> <li>● 检查申报价格、数量、账户与席位的指定关系；</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查投资者申报代码是否正确；</li> <li>● 检查融券方资金是否足够；</li> </ul>
成交回报	发送一条成交回报，代码为‘204***’	根据成交回报扣减投资者资金账户余额

备注：以上“会员端”内容仅作为参考，会员应综合考虑是否还有其他检查内容。

## 2.3 入库

业务类型	交易系统端	会员端
申报	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查账户是否具有权限</li> <li>● 检查申报价格、数量、账户与席位的指定关系</li> <li>● 投资者现券余额是否足够</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查投资者申报代码，为'09*****'</li> </ul>
成交回报	发送成交编号连续递增的三条成交回报：入库记录（09*****）、现券记录（现券代码）、标准券记录（888880）；	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 使用现有的数据表，但要根据规则综合三条成交回报一起处理</li> <li>● 记录质押库中现券明细及对应的标准券数量</li> </ul>

备注：以上“会员端”内容仅作为参考，会员应综合考虑是否还有其他检查内容。

## 2.4 出库

业务内容	交易系统端	会员端
申报	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查账户是否具有权限</li> <li>● 检查申报价格、数量、账户与席位的指定关系</li> <li>● 检查投资者标准券余额</li> <li>● 检查投资者质押库中质押的现券数量是否足够</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 检查投资者申报代码，为'09*****'</li> </ul>
成交回报	发送成交编号连续递增的三条成交回报：出库记录（09*****）、现券记录（现券代码）、标准券记录（888880）；	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 使用现有的数据表，但要根据规则综合三条成交回报一起处理</li> <li>● 记录质押库中现券明细及对应的标准券数量</li> </ul>

备注：以上“会员端”内容仅作为参考，会员应综合考虑是否还有其他检查内容。

## 3 简单业务介绍

### 3.1 质押式回购交易

指将债券质押的同时，将相应债券以标准券折算比率计算出的标准券数量为融资额度而进行的质押融资，交易双方约定在回购期满后返还资金和解除质押的交易。

### 3.2 折算率

标准券折算比率指各债券现券品种所能折成的标准券金额与债券面值之比，简称折算率，即标准券金额=折算率×债券面值。

### 3.3 标准券

指由不同债券品种按相应折算比率折算形成的，用以确定可利用质押式回购交易进行融资的额度。

### 3.4 质押券

申报提交结算公司作为质押物的债券。



## 4 代码规则

### 4.1 出入库

#### 4.1.1 代码

国债的出入库代码为“09\*\*\*\*”，后四位与国债代码后四位一一对应。

出库和入库使用同一个代码。

#### 4.1.2 简称

出入库代码简称为“\*\*\*\*质押”，其中，\*\*\*\*为出入库代码后四位。

### 4.2 标准券

#### 4.2.1 代码

为 888880。

#### 4.2.2 简称

另行公布。

### 4.3 回购

回购代码为“204\*\*\*”。

代码	品种	简称
204001	1 天国债回购	GC001
204002	2 天国债回购	GC002
204003	3 天国债回购	GC003
204004	4 天国债回购	GC004
204007	7 天国债回购	GC007
204014	14 天国债回购	GC014

204028	28 天国债回购	GC028
204091	91 天国债回购	GC091
204182	182 天国债回购	GC182

## 5 接口描述

### 5.1 回购交易

#### 5.1.1 申报要素

- 代码：规定的回购代码；
- 数量：标准券数量，必须为 100 手的整数倍，单笔申报不超过 1 万手；
- 价格：为每百元资金到期年收益，最小变动单位为 0.005 元；
- 买卖方向：融资方为买，融券方为卖；
- 帐号：融资方、融券方均必须具有国债回购资格；
- 申报时间：9：15—9：25 集合竞价，9：30—11：30，13：00—15：00 的连续竞价；

其他要素，请参考普通交易申报。

#### 5.1.2 交易系统检查

- 是否有回购资格；
- 融资方的标准券余额是否足够，不对融券方的余额进行检查；
- 标准券属性检查：
  - 当日提交现券生成的标准券可用于回购；
  - 当日到期的回购，其对应的标准券可以申报继续用于回购；

#### 5.1.3 成交回报

##### 5.1.3.1 融资方

字段名	类型	长度	解释
gddm	Char	10	投资者股东账户
gdxm	Char	8	股东姓名
bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	成交的标准券数量

beye	Char	10	无实际意义
zqdm	Char	6	回购代码，‘204***’
sbsj	Char	6	申报时间。格式为：HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为：HHMMSS
cjgg	Char	8	成交价格
cjje	Char	12	成交金额
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	买卖方向，为买
mjbh	Char	5	操作员代码。

### 5.1.3.2 融券方

字段名	类型	长度	解释
gdsm	Char	10	投资者股东账户
gdxm	Char	8	股东姓名
bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	成交的标准券数量
beye	Char	10	无实际意义
zqdm	Char	6	回购代码，‘204***’
sbsj	Char	6	申报时间。格式为:HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为:HHMMSS
cjgg	Char	8	成交价格
cjje	Char	12	成交金额
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	买卖方向，为卖
mjbh	Char	5	操作员代码。

## 5.2 入库

### 5.2.1 申报要素

- 代码：交易所分配的出入库代码；
- 数量：提交入库的现券数量，以手为单位；
- 价格：为 1.00 元（无实际意义）；
- 帐户：必须具有国债回购资格；
- 申报时间：每个交易日 9：30—11：30，13：00—15：00；

- 买卖方向：卖（S）；
- 其他申报要素，请参考普通交易申报。

### 5.2.2 交易系统处理

- 检查是否具有回购资格；
- 现券属性检查：
  - 当日买入的现券，可用于提交质押库；
  - 当日申报转回的现券，可再次提交质押库；
- 生成的标准券数量 = （申报的现券数量 × 折算率）后取整；

### 5.2.3 成交回报

入库提交成功后，交易系统生成三条连续的成交回报给投资者：入库代码记录、现券记录、标准券记录。

#### 5.2.3.1 入库代码记录

字段名	类型	长度	解释
gddm	Char	10	投资者股东帐户
gdxm	Char	8	股东姓名
bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	提交入库的现券数量
beye	Char	10	无实际意义
zqdm	Char	6	出入库代码 ‘09****’
sbsj	Char	6	申报时间。格式为：HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为：HHMMSS
cjgg	Char	8	0
cjje	Char	12	0
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	S
mjbh	Char	5	操作员代码。

#### 5.2.3.2 现券记录

字段名	类型	长度	解释
Gddm	Char	10	投资者股东帐户
Gdxm	Char	8	股东姓名
Bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。

gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	提交入库的现券数量
bcye	Char	10	现券余额
zqdm	Char	6	现券代码
sbsj	Char	6	申报时间。格式为:HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为:HHMMSS
cjgg	Char	8	0
cjje	Char	12	0
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	S
mjbh	Char	5	操作员代码。

### 5.2.3.3 标准券记录

字段名	类型	长度	解释
gddm	Char	10	投资者股东帐户
gdxm	Char	8	股东姓名
bcrq	Char	8	成交日期。格式: YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	生成的标准券数量
bcye	Char	10	标准券余额
zqdm	Char	6	标准券代码, 为 '888880'
sbsj	Char	6	申报时间。格式为:HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为:HHMMSS
cjgg	Char	8	0
cjje	Char	12	0
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	B
mjbh	Char	5	操作员代码。

## 5.3 出库

### 5.3.1 申报要素

- 代码: 交易所分配的出入库代码;
- 数量: 申请转出的现券数量, 以手为单位;
- 价格: 为 1.00 元 (无实际意义);
- 帐户: 必须具有国债回购资格;

- 申报时间：每个交易日 9：30—11：30，13：00—15：00；
  - 买卖方向：买（B）；
- 其他申报要素，请参考普通交易申报。

### 5.3.2 交易系统处理

- 检查是否具有回购资格；
- 需要扣减的标准券数量 =（申报的现券数量 × 折算率）后取整；
- 标准券属性检查：
  - 当日提交入库的标准券可申请出库；
  - 当日开盘持有的标准券（即昨日交收完毕后标准券余额加上当日到期的回购）可申请出库；
- 交易系统会检查质押库中质押现券的数量，如果大于申报数量，则出库成功，否则出库失败；

### 5.3.3 成交回报

出库提交成功后，交易系统生成三条连续的成交回报给投资者：出库代码记录、现券记录、标准券记录。

#### 5.3.3.1 出库代码记录

字段名	类型	长度	解释
gddm	Char	10	投资者股东帐户
gdxm	Char	8	股东姓名
bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	申请出库的现券数量
beye	Char	10	无实际意义
zqdm	Char	6	出库代码（同入库代码）
sbsj	Char	6	申报时间。格式为：HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为：HHMMSS
cjgg	Char	8	0
cjje	Char	12	0
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	B
mjbh	Char	5	操作员代码。

#### 5.3.3.2 现券记录

字段名	类型	长度	解释
-----	----	----	----

Gddm	Char	10	投资者股东帐户
Gdxm	Char	8	股东姓名
Bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	申请出库的现券数量
bcye	Char	10	现券余额
zqdm	Char	6	现券代码
sbsj	Char	6	申报时间。格式为:HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为:HHMMSS
cjgg	Char	8	0
cjje	Char	12	0
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	B
mjbh	Char	5	操作员代码。

### 5.3.3.3 标准券记录

字段名	类型	长度	解释
gddm	Char	10	投资者股东帐户
gdxm	Char	8	股东姓名
bcrq	Char	8	成交日期。格式：YYYYMMDD
cjbh	Int	4	成交编号。
gsdm	Char	5	券商申报席位代码
cjsl	Char	10	对应的标准券数量
bcye	Char	10	标准券余额
zqdm	Char	6	标准券代码，为‘888880’
sbsj	Char	6	申报时间。格式为:HHMMSS
cjsj	Char	6	本次成交时间。格式为:HHMMSS
cjgg	Char	8	0
cjje	Char	12	0
sqbh	Char	10	同委托发送表中 REFF 字段
bs	Char	1	S
mjbh	Char	5	操作员代码。



## 5.4 信息

### 5.4.1 交易行情

同原有国债回购行情显示要素。

### 5.4.2 折算率数据

交易所每个交易日开市前，转发登记公司的折算率数据。

- 数据库名： xzslMMDD.txt;
- 数据内容： 用于账户式回购的标准券比例数据；

NO	字段名	长度	说明
1	证券代码	6	不足 6 位左边补 0
2	分隔符	1	竖线符号“ ”
3	标准券比例	15	右对齐，不足补空格

注：

- 1、证券代码构成唯一关键字。
- 2、文件内容为新回购业务对应的债券的标准券比例，老回购对应的标准券比例不包括在本文件中。

### 5.4.3 发送途径

通过交易所单向卫星，在每个交易日开市前发送。

## 6 其他

### 6.1 新增错误码

267: 帐户没有权限进行新回购的交易及出入库。

268: 场内报盘对于出入库申报的统一出错代码。( 268(%3d) Invalid IN/OUT NEWHG)

752: 帐户中没有现券

753: 帐户中现券余额不足

754: 帐户中没有标准券

755: 帐户中标准券余额不足

756: 帐户没有质押券

757: 帐户的质押券余额不足

758: 标准券折算率未初始化

759: 标准券代码不存在

### 6.2 联系方式

如开发或测试中，出现问题，可以与交易所技术中心进行联系。

联系电话：4008888400-8004

传真：021-68810883

email: [ytang@sse.com.cn](mailto:ytang@sse.com.cn)，（请在来信中留下电话，方便联系，谢谢）