

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所市场参与者 融资融券技术实施指引



上海证券交易所

二零一零年三月

文档摘要

本文档是对上海证券交易所（简称 上交所）拟于近期推出的融资融券业务的实施说明，主要侧重于券商系统的接口实施。

特别申明：

- 本指引为技术实施指引，所涉相关业务规定以本所业务规则为准。
- 因使用本指引产生的一切后果，由使用人自行承担。
- 本所保留对本指引的解释与修改权。

联系方式

如开发或测试中，出现问题，可以与上交所技术中心进行联系。

联系电话：021-68644780

传真：021-68810883

目 录

1	交易系统账户体系	4
1.1	证券公司融券专用帐户	4
1.2	客户信用证券帐户	4
2	担保物及标的证券管理	4
3	融资融券业务权限管理	4
4	交易类申报及成交回报	4
4.1	担保品交易	4
4.2	融资交易	5
4.3	融券交易	5
4.4	平仓交易	5
5	非交易类申报业务	5
5.1	信用账户指定	5
5.2	权益类申报	6
5.3	余券划转	6
5.4	还券划转	6
5.5	担保物划转	6
5.6	券源划转	7
6	成交回报说明	7
6.1	实时成交回报	7
6.2	闭市后的过户文件	7
7	信息披露	8
7.1	担保品及标的证券清单	8

1 交易系统中的账户体系

1.1 证券公司融券专用帐户

开展融券业务的证券公司必须在中国证券登记结算公司开设融券专用账户，里面存放自有证券，供投资者进行融券交易。

证券公司融券专用账户不得进行任何买卖申报。

1.2 客户信用证券帐户

投资者要进行融资融券信用交易，需向具备融资融券业务资格的证券公司申请，开设 E 字头的客户信用证券账户。

仅 E 字头的客户信用证券账户可以进行融资融券申报业务，信用证券账户的申报必须带有信用标签。

其余需要开设的账户及账户之间的关系，请参见中国证券登记结算公司的规则。

2 担保物及标的证券管理

上交所负责担保物及标的证券范围调整，有关担保物及标的证券的信息参考本文档第 3 节“交易所信息披露”说明。

3 融资融券业务权限管理

客户信用帐户必须指定在具有融资融券资格的证券公司的交易单元上。

客户信用帐户的交易订单必须通过具备融资融券权限的交易单元进行申报，融资融券权限包括融资权限和融券权限两种。

4 交易类申报及成交回报

融资融券申报可分成交类申报和非交易类申报两大类。交易类业务指的是二级市场买卖撮合交易，非交易类业务指的是指定（撤指定）申报、非交易过户申报等。

成交回报包括实时成交回报记录和闭市后上交所发送的过户数据两类。

4.1 担保品交易

买卖方向为 B 的，表示信用买入申报，信用标签为*XY，只允许买入作为担保品的证

券；

买卖方向为 S 的，表示信用卖出申报，信用标签为*XY，可卖出的证券范围：A 股、封闭式基金、ETF、债券、权证。

4.2 融资交易

买卖方向为 B 的，表示融资买入申报，信用标签为*RZ，只允许买入可融资买入的证券品种；

买卖方向为 S 的，表示卖券还款申报，信用标签为*RZ，可卖出的证券范围：A 股、封闭式基金、ETF、债券、权证。

4.3 融券交易

买卖方向为 B 的，表示买券还券申报，信用标签为*RQ，只允许买入具有融券卖出权限的证券品种及被调出融券卖出范围但有合约未到期的证券品种；

买卖方向为 S 的，表示融券卖出申报，信用标签为 LRQ，只允许卖出可融券卖出的证券品种；

融券卖出不允许申报市价订单。

4.4 平仓交易

买卖方向为 B 的，表示证券公司进行平仓买入申报，信用标签为*PC，可买入的证券范围等同于融券交易类型中买券还券的证券范围；

买卖方向为 S 的，表示证券公司进行平仓卖出申报，信用标签为*PC，可卖出的证券范围等同于融资交易类型中卖券还款的证券范围；

5 非交易类申报业务

本文档所述的非交易类业务，包括信用账户的指定、权益类及 4 类证券划转申报，其余非交易类业务不被允许。

证券划转申报只有主机返回确认信息，不会产生成交回报，也不代表划转成功，其过户申报数据以中国证券登记结算公司数据为准。

5.1 信用账户指定

申报要素同普通账户指定申报，但订单类型必须为 “LXY”；

5.2 权益类申报

信用账户允许进行的权益类申报为：配股、配债及行权，其余权益类申报不被允许。申报要素同普通账户申报，订单类型必须为“LXY”。

5.3 余券划转

- 申报代码：799981
- 申报账户：为投资者信用证券账户（E字头账户），交易系统不作前端检查；
- 订单类型：必须为“LXY”；
- 买卖方向含义：
 - B表示从证券公司融券专用账户过户到证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）。
 - 暂不允许申报卖单；
- 申报价格：被划转的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）；
- 申报数量：为申请划转数量，允许为零散股；

此类非交易订单由交易主机在闭市后路由给登记公司处理。

5.4 还券划转

- 申报代码：799982
- 申报账户：为投资者信用证券账户（E字头账户），交易系统不作前端检查；
- 订单类型：必须为“LXY”；
- 买卖方向含义：
 - S表示从证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）过户到证券公司融券专用账户。
 - 暂不允许申报买单；
- 申报价格：被划转的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）；
- 申报数量：为申请划转数量，允许为零散股；

此类非交易订单由交易主机在闭市后路由给登记公司处理。

5.5 担保物划转

- 申报代码：799983
- 申报账户：为投资者信用证券账户（E字头账户），交易系统不作前端检查；
- 订单类型：必须为“LXY”；
- 买卖方向含义：

- B 表示从投资者普通证券账户过户到证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）；
 - S 表示从证券公司担保证券账户（对应的投资者信用证券账户明细数据由登记公司维护）过户到投资者普通证券账户；
 - 申报价格：被划转的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）；
 - 申报数量：为申请划转数量，允许为零散股；
- 此类非交易订单由交易主机在闭市后路由给登记公司处理。

5.6 券源划转

- 申报代码：799984
 - 申报账户：证券公司自营证券账户，交易系统不作前端检查；
 - 订单类型：必须为“LPT”或“ORD”；
 - 买卖方向含义：
 - B 表示从证券公司融券专用账户过到证券公司自营账户；
 - S 表示从证券公司自营账户将证券过户到融券专用账户中；
 - 申报价格：被划转的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）；
 - 申报数量：为申请划转数量，允许为零散股；
- 此类非交易订单由交易主机在闭市后路由给登记公司处理。

6 成交回报说明

6.1 实时成交回报

对于融资融券业务，撮合成交后实时返回的成交回报为客户信用账户的成交记录。

6.2 闭市后的过户文件

上交所发布的闭市后过户文件中，将在成交记录中体现订单的业务类型。具体编制方法说明如下：

过户文件中买卖方向（BS）字段值作如下扩展，其他字段保持不变。

BS 字段值	对应的订单类型说明
B	普通订单，买卖方向：买入
S	普通订单，买卖方向：卖出
1	信用买入订单
2	信用卖出订单
3	融资买入订单，融资类买入

4	卖券还款订单，融资类卖出
5	买券还券订单，融券类买入
6	融券卖出订单，融券类卖出
7	融券平仓订单，平仓类买入
8	融资平仓订单，平仓类卖出

7 信息披露

7.1 担保品及标的证券清单

文件名：dbpMMDD.txt

说明：文件名中 MMDD 表示月日格式的日期，开市前发送。

字段间用分隔符 ‘|’ 来定位。

数据格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码		C6
2	对应类别	001：融资、002：融券、003：担保品	C3
3	余额	对应类别为 001 时，表示融资余额； 对应类别为 002 时，表示融券余量； 对应类别为 003 时，固定为 0；	N15