

中国证券登记结算公司上海分公司文件

中国结算沪业字〔2017〕46号

关于调整债券质押式回购交易购回价格计算公式的通知

各结算参与人：

为配合《上海证券交易所债券交易实施细则》的修订，我公司拟调整债券质押式回购交易购回价格计算公式和相关数据接口，具体调整内容如下：

一、债券质押式回购交易购回价格计算公式调整

自本通知生效日起达成的债券质押式回购交易，其购回价格计算公式调整为：

回购交易的购回价格=100 元+（回购交易的成交年利率/365）*资金实际占用天数*100 元

其中，资金实际占用天数为回购交易成交日对应的交收日（含）至回购交易购回日对应的交收日（不含）的自然日天数。

本通知生效日前达成的回购交易，其购回价格计算公式不变。

二、相关数据接口调整

自本通知生效日起，“结算明细文件填写说明”不再包含购回价格的计算公式（详见附件 1）；“未到期业务对账文件”不再填写债券质押式回购交易的到期购回价格（详见附件 2），购回价格以购回当日“结算明细文件”为准。

本通知自 2017 年 5 月 22 日起生效。

特此通知。

- 附件：1. 结算明细文件填写说明——二十一 账户式质押式债券回购的购回业务
2. wdq（未到期业务对账文件）

二〇



日

附件 1：结算明细文件填写说明

二十一 账户式质押式债券回购的购回业务

- 1) YWLX (业务类型) :
“024” 账户式质押式债券回购购回
- 2) QSBZ (清算标志) :
“22A” 账户式债券购回
- 3) GHLX (过户类型) :
“00A” 交易过户
- 4) SL (交收数量) :
融资方: ZQDM2 字段所填券的实际交收数量, 单位为‘元’(为正数)。
融券方: 不填写
- 5) CJSL (成交数量)
该笔成交的交易成交数量乘以 1000, 单位为‘元’(融资方为正数, 融券方为负数)。
- 6) ZQDM1 (证券代码 1): 交易代码
- 7) ZQDM2 (证券代码 2): 标准券代码
融资方: “888880”
融券方: 为空, 不填写
- 8) JG1 (价格 1): 购回价格, 百元价
$$\text{回购价格} = 100 \text{元} + \text{回购成交价格} (1 \text{元价}) \times 100 \times \text{回购天数} / 360 \text{ (保留三位小数)}$$
- 9) JG2 (价格 2): 回购成交价, 百元价。
- 10) 数据填写说明:

字段名	长度	说明	帐户式质押式债券回购的购回业务
SCDM	2	市场代码	01
JLLX	3	记录类型	001
JYFS	3	交易方式	001
JSFS	3	交收方式	001
YWLX	3	业务类型	024
QSBZ	3	清算标志	22A
GHLX	3	过户类型	00A
JSBH	16	交收编号	#
CJBH	16	成交编号	*
SQBH	16	申请编号	*
WTBH	16	委托编号	#
JYRQ	8	交易日期	回购成交日期
QSRQ	8	清算日期	回购清算日
JSRQ	8	交收日期	回购交收日
QTRQ	8	其它日期	回购日期
WTSJ	6	委托时间	
CJSJ	6	成交时间	

XWH1	5	业务单元 1	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元
XWHY	8	业务单元 1 所属 结算参与人的清 算编号	交易单元所属结算参与人的清算编号
JSHY	8	结算参与人的清 算编号	结算单元所属结算参与人的清算编号
TGHY	8	托管银行的清算 编号	#
ZQZH	10	证券账号	*
ZQDM1	6	证券代码 1	*
ZQDM2	6	证券代码 2	融资方：“888880” 融券方：#
ZQLB	2	证券类别	融资方：“GZ” 融券方：#
LTLX	1	流通类型	融资方：“0” 融券方：#
QYLB	2	权益类别	#
GPNF	4	挂牌年份	#
MMBZ	1	买卖标志	“B” 融资到期 “S” 融券到期
SL	16	交收数量	融资方：ZQDM2 字段所填券的实际交收数量， 单位为‘元’（为正数）。 融券方：不填写
CJSL	16	成交数量	交易成交数量(手数)×1000 (融资方为正数，融券方为负数)
ZJZH	25	资金账号	结算备付金账号
BZ	3	币种	RMB
JG1	17	价格 1	购回价格
JG2	17	价格 2	成交价格
QSJE	19	清算金额	ABS(购回价格×成交数量/100)×收付方向
YHS	17	印花税	印花税
JSF	17	经手费	经手费
GHF	17	过户费	过户费
ZGF	17	证管费	证管费
SXF	17	手续费	手续费
QTJE1	19	其它金额 1	0.00
QTJE2	19	其它金额 2	0.00
QTJE3	19	其它金额 3	0.00
SJSF	19	实际收付	清算金额加各项费用
JGDM	4	结果代码	0000
FJSM	40	附加说明	同清算标志的附加说明

附件 2: wdq (未到期业务对账文件)

- 1) 文件名称: wdqXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)。
- 2) 数据内容: 包含未到期业务的对账信息, 包括未到期回购业务 (买断式回购、账户式质押回购、证券质押式报价回购、约定购回式证券交易未到期数据、股票质押式回购未到期数据和债券质押式协议回购未到期等) 对账数据;
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人PROP信箱。
- 5) 发送时间: 每个交易日日终后。
- 6) 发送周期: 每个交易日。
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

NO	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	QSBH	Character	8		清算编号
3	WDQLB	Character	3		未到期类别
4	ZQZH	Character	10		证券账户
5	XWH1	Character	5		业务单元 1
6	XWH2	Character	5		业务单元 2
7	ZQDM	Character	6		证券代码
8	ZQLB	Character	2		证券类别
9	LTLX	Character	1		流通类型
10	QYLB	Character	2		权益类别
11	GPNF	Character	4		挂牌年份
12	CJXLH	Character	16		成交序列号
13	CJBH	Character	16		成交编号
14	SQBH	Character	16		申请编号
15	WTBH	Character	16		委托编号
16	JSBH	Character	16		交收编号
17	MMBZ	Character	1		买卖标志
18	SL1	Character	16	±9999999999999999	数量 1
19	SL2	Character	16	±9999999999999999	数量 2
20	JG1	Character	17	9999999.999999999	价格 1
21	JG2	Character	17	9999999.999999999	价格 2
22	JE1	Character	19	±9999999999999999.99	金额 1
23	JE2	Character	19	±9999999999999999.99	金额 2
24	CJRQ	Character	8		成交日期
25	QTRQ	Character	8		其他日期
26	FZDM	Character	10		辅助代码
27	BCSM	Character	40		补充说明

9) 数据说明:

- (1) WDQLB: 定义了未到期业务数据的类别, 定义如下:

- 002: 买断式回购未到期数据
- 003: 账户式质押回购未到期数据
- 004: 证券质押式报价回购未到期数据
 - 005: 约定购回式证券交易未到期数据
 - 006: 股票质押式回购未到期数据
 - 007: 债券质押式协议回购未到期数据

(2) 对于约定购回式证券交易未到期数据, 说明如下:

在初始交易交收成功之后, 未到期数据生成。购回交收成功之前, 未到期数据一直存在。购回交易根据券商向上交所的申报进行结算, 到期不申报不会自动购回。

(3) 对于证券质押式报价回购未到期数据, 说明如下:

若到期自然日为工作日, 在该日交收; 若到期自然日为非工作日, 在下一个工作日交收。

若辅助代码出现‘YCJS’, 说明出现了延迟交收的情况。下一日若不能完成交收将进入清算程序。进入清算程序后, 不再发送专项回购未到期数据。

10) 数据填写详细说明:

字段名	长度	说明	买断式回购未到期数据	账户式质押回购未到期数据	约定购回式证券交易未到期数据
SCDM	2	市场代码	‘01’	‘01’	‘01’
QSBH	8	清算编号	清算编号	清算编号	清算编号
WDQLB	3	未到期类别	‘002’	‘003’	‘005’ (约定购回式证券交易未到期数据)
ZQZH	10	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
XWH1	5	业务单元 1	交易单元	交易单元	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元	结算单元	结算单元
ZQDM	6	证券代码	买断式回购代码	回购代码	标的证券代码
ZQLB	2	证券类别	#	#	标的证券的证券类别
LTLX	1	流通类型	#	#	标的证券的流通类型
QYLB	2	权益类别	#	#	标的证券的权益类别
GPNF	4	挂牌年份	#	#	标的证券的挂牌年份
CJXLH	16	成交序列号	#	#	#
CJBH	16	成交编号	成交编号	成交编号	成交编号
SQBH	16	申请编号	申请编号	申请编号	申请编号
WTBH	16	委托编号	委托编号	委托编号	委托编号
JSBH	16	交收编号	#	#	交收编号
MMBZ	1	买卖标志	‘B’: 融资 ‘S’: 融券	‘B’: 融资 ‘S’: 融券	‘B’: 自营 ‘S’: 客户
SL1	16	数量 1	未到期数量 (融资融券均正数, 单位为元)	未到期数量 (融资融券均正数, 单位为元)	未到期数量 (B 方、S 方均正数。对股票单位为股, 基金为份, 债券为元)
SL2	16	数量 2	#	#	#
JG1	17	价格 1	成交价格, 百元价	成交价格, 百元价	#
JG2	17	价格 2	#	# 回购价格, 百元价	#

字段名	长度	说明	买断式回购 未到期数据	账户式质押回购 未到期数据	约定购回式证券交易 未到期数据
JE1	19	金额 1	保证金	#	初始交易金额
JE2	19	金额 2	#	#	购回交易金额
CJRQ	8	成交日期	成交日期	成交日期	初始交易成交日期
QTRQ	8	其他日期	购回日期	购回日期	到期自然日
FZDM	10	辅助代码	#	#	#
BCSM	40	补充说明	债券代码	#	#

续上表:

字段名	长度	说明	证券质押式报价回购 未到期数据	股票质押式回购 未到期数据
SCDM	2	市场代码	'01'	'01'
QSBH	8	清算编号	清算编号	清算编号
WDQLB	3	未到期类别	'004' (证券质押式报价 回购未到期数据)	'006' (股票质押式回购 未到期数据)
ZQZH	10	证券账户	证券账户	证券账户
XWH1	5	业务单元 1	交易单元	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元	结算单元
ZQDM	6	证券代码	填写 205 代码	证券代码
ZQLB	2	证券类别	#	证券类别
LTLX	1	流通类型	#	流通类型
QYLB	2	权益类别	#	权益类别
GPNF	4	挂牌年份	#	挂牌年份
CJXLH	16	成交序列号	#	成交序列号
CJBH	16	成交编号	成交编号	#
SQBH	16	申请编号	申请编号	申请编号
WTBH	16	委托编号	委托编号	委托编号
JSBH	16	交收编号	#	#
MMBZ	1	买卖标志	'B': 融资 (自营) 'S': 融券 (客户)	'B': 融出方 'S': 融入方
SL1	16	数量 1	未到期数量 (融资方、融券 方均正数, 单位为元)	未到期数量 (融出方、融出 方均为正数)
SL2	16	数量 2	#	#
JG1	17	价格 1	到期购回成交价格, 百元价	#
JG2	17	价格 2	提前终止成交价格, 百元价	#
JE1	19	金额 1	#	对于初始交易该字段填写 初始交易金额, 对于补充质 押该字段为 0
JE2	19	金额 2	#	#
CJRQ	8	成交日期	回购成交日	回购成交日
QTRQ	8	其他日期	到期购回自然日	到期购回日
FZDM	10	辅助代码	空: 正常未到期 'YCJS': 延迟交收	空: 正常未到期
BCSM	40	补充说明	#	#

字段名	长度	说明	债券质押式协议回购未到期数据
SCDM	2	市场代码	'01'
QSBH	8	清算编号	清算编号

字段名	长度	说明	债券质押式协议回购未到期数据
WDQLB	3	未到期类别	'007' (债券质押式协议回购未到期数据)
ZQZH	10	证券账户	证券账户
XWH1	5	业务单元 1	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元
ZQDM	6	证券代码	证券代码 (质押券代码)
ZQLB	2	证券类别	证券类别
LTLX	1	流通类型	流通类型
QYLB	2	权益类别	权益类别
GPNF	4	挂牌年份	挂牌年份
CJXLH	16	成交序列号	成交序列号
CJBH	16	成交编号	#
SQBH	16	申请编号	#
WTBH	16	委托编号	#
JSBH	16	交收编号	#
MMBZ	1	买卖标志	B: 资金融入方 (正回购方) S: 资金融出方 (逆回购方)
SL1	16	数量 1	未到期数量
SL2	16	数量 2	#
JG1	17	价格 1	对质押式协议回购填回购利率, 百元价, 精确到小数点后 3 位, 单位为元。
JG2	17	价格 2	#
JE1	19	金额 1	对于首次交易该字段填写首次成交金额. 对于到期续作 (合约新开) 填写新回购成交金额
JE2	19	金额 2	#
CJRQ	8	成交日期	回购成交日
QTRQ	8	其他日期	到期购回日
FZDM	10	辅助代码	#
BCSM	40	补充说明	质押登记编号

主题词：调整 债券质押式回购 购回价格 计算公式 通知

上海分公司综合部

2017 年 4 月 13 日 印发

打字：赵亦婷

校对：沙依拉

共印 1 份