



中国结算工程技术文档

沪市上市开放式基金（上证 LOF）

参与人数据接口规范

（Ver 1.1）



中国证券登记结算有限责任公司

二〇二二年七月

修订说明

版本号	修订者	修订时间	修订内容
Ver 1.0		2013. 4. 23	定稿
Ver 1.1	康鹏	2022. 7. 11	1、‘备注说明’字段新增值域 648 和 649； 2、对于认购结果数据，‘其他费用 2’字段赋值为认购期间产生的利息。

目 录

1 说明.....	4
2 上证 LOF 清算明细文件.....	5

1 说明

本规范用于将上证 LOF 基金场内份额的申购赎回等非撮合业务确认结果发送相关参与人。具体是由中国结算总部生成数据，由上海分公司在每个交易日日终后发送到结算参与人信箱。

2 上证 LOF 清算明细文件

- (1) 文件名称: lofmxzfXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号);
- (2) 数据内容: 中国结算总部对 LOF 场内份额的申购赎回等非撮合业务产生的清算明细结果。上海分公司受总部委托, 分发给参与人。
- (3) 文件生成单位: 清算编号。
- (4) 发送目标: 结算参与人信箱;
- (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;

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	FSRQ	发送日期	C	8	YYYYMMDD
2	HSBZ	沪深标志	C	1	'0': 深圳 '1': 上海
3	QRRQ	TA确认日期	C	8	YYYYMMDD
4	QRLS	TA确认流水号	C	20	
5	CJRQ	成交日期	C	8	YYYYMMDD
6	CJXLH	成交序列号	N	16, 0	原请求的交易所成交序列号
7	BFBH	买方交易所订单编号	N	16, 0	
8	SFBH	卖方交易所订单编号	N	16, 0	
9	QDBH	券商订单编号	C	16	
10	BZSM	备注说明	C	3	
11	JYDY	交易单元	C	5	右对齐
12	ZQDM	证券代码	C	6	
13	FZZQDM	辅助证券代码	C	6	

14	ZQZH	证券账户	C	10	
15	SQFE	申请份额	N	15, 0	整数，大于等于0； 单位为份。
16	SQJE	申请金额	N	17, 2	
17	QRFE	确认份额	N	15, 0	整数，大于等于0； 单位为份。
18	QRJE	确认金额	N	17, 2	
19	JJJZ	基金净值	N	10, 4	
20	SXFY	确认手续费	N	16, 2	
21	DLFY	确认代理费	N	16, 2	
22	JSFY	确认交易所经手费	N	16, 2	保留
23	GHFY	确认过户费	N	16, 2	
24	QTFY	确认其它费用	N	16, 2	
25	YHSE	确认印花税额	N	16, 2	
26	QTF2	其它费用2	N	16, 2	认购期间产生的利息
27	HSFY	后收费总金额	N	16, 2	保留
28	SFFS	收费方式	C	1	前收费/后收费，保留
29	RGBZ	认购标志	C	1	‘0’：认购 ‘1’：认购结果(指 认购结束时发送的 最终确认数据)
30	FHDM	返回代码	C	4	
31	JGSM	结果说明	C	40	
32	SJLX	数据类型	C	1	
33	BY1	备用1	C	20	备用
34	BY2	备用2	C	20	备用
35	BY3	备用3	C	20	备用

数据说明:

- (1) 唯一键字: TA 确认日期 + TA 确认流水号。
- (2) 发送日期为当日。若当日某参与人无应收数据, 上海分公司不发空文件。
- (3) 此接口文件的原始数据由总部 TA 系统产生, 上海分公司受总部委托, 分发给券商等对象。上海分公司不对原始内容进行加工。

(4) 字段填写说明:

- 1) QDBH (券商订单编号): 对于 LOF 场内份额的认购、申购填写买方券商订单编号; 对于 LOF 场内份额的赎回、场内转场外填写卖方券商订单编号。
- 2) BZSM (备注说明): 左对齐, 不足右补空格, 填写 LOF 业务类型对应的代码。取值如下:

取值	含义
641	LOF 认购
642	LOF 申购
643	LOF 赎回
644	LOF 场内转场外
645	LOF 场外转场内
648	LOF 其他调整
649	LOF/REITs 扩募认购

- 3) SQFE (申请份额): 对于赎回业务, 表示赎回申请份额。单位为份, 大于等于 0。
- 4) SQJE (申请金额): 对于申购业务, 表示申购申请金额。
- 5) QRJE (确认金额): 对于申购业务, 表示申购确认金额。对于赎回业务, 表示投资者实得金额。
- 6) SXFY (确认手续费): 投资者应付总手续费。
- 7) DLFY (确认代理费): 销售机构应得的费用。
- 8) QTFY (确认其它费用): 归基金资产的费用。

9) QTFY2 (其它费用 2): 对于认购结果数据, 赋值为认购期间产生的利息。

10) FHDM (返回代码): '0000' 表示成功, 否则为失败。

11) SJLX (数据类型): '0' 表示合法确认数据, '1' 表示经上海结算系统检查不合法的数据, '2' 表示经 TA 检查不合法的数据。