

编号：TS(12)-2024-0001

密级：公开



中国结算工程技术文档

工程技术标准

H股境外指定交易券商

结算数据接口规范

(Ver 1.5)

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

二〇二三年十二月

## 文档信息

文档名称	H股境外指定交易券商结算数据接口规范		
编制者	中国结算深圳分公司技术开发二部		
说明	用于B股转H股和H股全流通的境外交易券商与中国结算深圳分公司的数据交换		
<b>修订历史 (REVISION HISTORY)</b>			
<b>Rev</b>	<b>Type</b>	<b>Date</b>	<b>Remarks</b>
0.9	创建	2013/1/25	草稿
1.0		2013/2/7	征求境外券商意见后定稿
1.1		2018/1/2	配合H股全流通业务进行修改
1.2		2019/5/7	配合H股全流通业务进行修改
1.3		2021/9/23	配合财务汇报局交易征费进行修改
1.4		2022/6/8	配合跨境监管进行修改
1.5		2023/6/19	配合B转H清算业务优化进行修改

## 目 录

第一章 说明 .....	3
第二章 数据交换处理过程与时间约定 .....	5
2.1 B 股转 H 股 .....	5
2.1.1 深圳分公司—>境外指定交易券商 .....	5
2.2 H 股全流通 .....	5
2.2.1 深圳分公司—>境外指定交易券商 .....	5
第三章 数据接口定义 .....	7
3.1 B 股转 H 股 .....	7
3.1.1 清算汇总库 SJSQSHZH.DBF .....	7
3.1.2 成交明细卖空库 SJSMKKH.DBF .....	8
3.1.3 交收日安排 SJSJSRH.DBF .....	9
3.1.4 可交易股份总额库 SJSJYZEH.DBF .....	9
3.2 H 股全流通 .....	10
3.2.1 交易清算明细文件 H_SJSMX.DBF .....	10
3.2.2 可交易额度文件 H_SJSJY.DBF .....	11

# H 股境外指定交易券商

## 结算数据接口规范

### 第一章 说明

本文档用于描述中国证券登记结算公司深圳分公司（以下简称深圳分公司）在深市 B 股转换上市地以介绍方式在香港联交所上市及挂牌交易业务和 H 股全流通业务中对境外指定交易券商的结算数据接口，业务模式是中国结算在港交所充当境内投资者的托管人模式。

境外指定交易券商需要在深圳分公司开立结算账户，并与深圳证券通信公司联系数据通信事宜，安装综合结算通信平台 D-COM 用于相关数据的发送、接收。

本文中的资金结算货币为港币 HKD。

深圳分公司负责对本数据接口进行修订、解释。

《深市登记结算数据接口规范》可以通过中国证券登记结算公司网站（[www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn)）下载。

[http://www.chinaclear.cn/zdjs/jszsc/service\\_list.shtml](http://www.chinaclear.cn/zdjs/jszsc/service_list.shtml)

通讯地址:

深圳市福田区深南大道 2012 号深圳证券交易所广场 28 楼中国结算深圳分公司技术开  
发二部

邮政编码:

518038

联系电话:

0755-25946080

传真:

0755-25987633

电子邮箱:

[sz.jsb@chinaclear.com.cn](mailto:sz.jsb@chinaclear.com.cn)

## 第二章 数据交换处理过程与时间约定

### 2.1 B 股转 H 股

#### 2.1.1 深圳分公司—>境外指定交易券商

所有深圳分公司发送的文件均以 H 结尾。

深圳分公司在每日 18:00 前向境外指定交易券商发送清算汇总库 (SJSQSHZH.DBF)，如果当天没有清算数据，则 SJSQSHZH.DBF 是空库，无相关记录。

深圳分公司在每日 18:00 前向境外指定交易券商发送成交明细卖空库 (SJSMKKH.DBF)，如果当天没有卖空数据，则 SJSMKKH.DBF 是空库，无相关记录。

深圳分公司在每日 18:00 前向境外指定交易券商发送可交易股份总额库 (SJSJYZEH.DBF)，如果当天没有可卖出的股份，则 SJSJYZEH.DBF 是空库，无相关记录。

深圳分公司在每日 18:30 前发送交收日安排 (SJSJSRH.DBF)，里面包含当年的深市 B 股全部交收日安排。

境外指定交易券商还会收到其他数据接口，包括但不限于 SJSGB.DBF。具体内容，请参见《深市登记结算数据接口规范》。

以上数据是在深圳的交易日进行数据发送。

### 2.2 H 股全流通

#### 2.2.1 深圳分公司—>境外指定交易券商

所有深圳分公司发送的文件均以“H\_”作为文件名前缀。

深圳分公司在每日 18:00 前向境外指定交易券商发送交易清算明细文件 (H\_SJSMX.DBF) 和可交易额度文件 (H\_SJSJY.DBF)。

如果当天没有交易清算数据，则 H\_SJSMX.DBF 是空库，无相关记录。

如果投资者次日没有可交易额度，则 H\_SJSJY.DBF 无相关记录。

境外指定交易券商需要在每个交易日上午 8:30 前通过 D-COM 收取最新的可交易额度文件，用于当天股份的卖空监控。

以上数据是在深圳市场的交易日进行数据发送。

### 第三章 数据接口定义

以下所有接口文件均采用 FOXPRO2.5 的标准 DBF 文件格式。库中的文字编码要求：  
中文编码 GBK 规范，英文 ASCII 码。

#### 3.1 B 股转 H 股

##### 3.1.1 清算汇总库 SJSQSHZH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	QSJSZH	结算账户	C	6	境外指定交易券商的结算账户
2	QSZQDM	证券代码	C	6	深市登记的 H 股证券代码， 不是联交所的证券代码
3	QSCJSL	成交数量	N	12,0	按证券代码汇总成交委托的成交 数量，成交数量 $\geq 0$
4	QSQSSL	清算数量	N	12,0	成交数量减去卖空数量，清算数 量 $\geq 0$
5	QSHBDH	货币代号	C	3	“HKD”
6	QSQSBJ	清算本金	N	17,2	金额 $\geq 0$
7	QSYHS	印花税	N	12,2	H 股印花税 金额 $\leq 0$
8	QSJYF	交易费	N	12,2	H 股交易费 金额 $\leq 0$
9	QSJYZF	交易征费	N	12,2	H 股交易征费 金额 $\leq 0$
10	QSGFJSF	股份交收费	N	12,2	股份交收费（持续净额交收） 金额 $\leq 0$
11	QSGHF	过户费	N	12,2	无，填 0
12	QSJSF	结算费	N	12,2	无，填 0
13	QSSXF	手续费	N	12,2	境外指定交易券商佣金 金额 $\leq 0$
14	QSCHJZF	财汇局征费	N	12,2	财务汇报局交易征费 金额 $\leq 0$
15	QSQTFY	其他费用	N	12,2	无，填 0
16	QSZJJE	资金金额	N	17,2	无，填 0



17	QSSFJE	收付净额	N	18, 2	所有金额的代数和 收付净额>0 表示境外指定交易券商应付金额
18	QSCJRQ	成交日期	D		实际交易日期, T 日 格式为 CCYYMMDD
19	QSQRQ	清算日期	D		T 日 格式为 CCYYMMDD
20	QSJSRQ	交收日期	D		T+2 日 格式为 CCYYMMDD
21	QSFSRQ	发送日期	D		发送日, T 日 格式为 CCYYMMDD
22	QSBYBZ	备用标志	C	1	备用

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库表示应在交收日完成股份、资金划付的交易清算汇总数据, 含各类税费。按照证券代码进行股份数量、资金金额汇总。

### 3.1.2 成交明细卖空库 SJSMKKH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	CJKJSZH	结算账户	C	6	境外指定交易券商的 结算账户 必填项
2	CJKZQDH	证券代号	C	6	深市登记的 H 股证券代码, 不是联交所的证券代码 必填项
3	CJKCJHM	成交号码	C	8	境外指定交易券商编写的号 码 (卖空订单编号) 必填项
4	CJKMFXH	卖方合同序号	C	22	国内券商报盘时的原委托序 号 必填项
5	CJKMFGD	卖方股东代码	C	10	空
6	CJKCJSL	成交数量	N	9, 0	必填项
7	CJKCJJG	成交价格	N	9, 3	必填项
8	CJKBQYE	成交前余额	N	12, 0	0
9	CJKBHYE	成交后余额	N	12, 0	0
10	CJKFSRQ	发送日期	D		格式为 CCYYMMDD, 必填项

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 深圳分公司在T日检查成交明细,如果发现成交数量将导致投资者卖空,则将会卖空的成交反馈该境外指定交易券商。

### 3.1.3 交收日安排 SJSJSRH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	GZRRQRQ	日期	D		
2	GZRBGBZ	B股工作标志	C	1	Y:是B股工作日 N:不是B股工作日
3	GZRJSBZ	B股交收标志	C	1	Y:是B股交收日 N:不是B股交收日
4	GZRFSRQ	发送日期	D		

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库用于境外指定交易券商参考深交所B股交易和交收安排。

(3) 如果发送日期为当年的倒数第三个工作日,则还会发送下一年全部交收日。

### 3.1.4 可交易股份总额库 SJSJZEH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZEJSZH	结算账户	C	6	境外指定交易券商的结算账户
2	ZEZQDM	证券代码	C	6	深市登记的H股证券代码,不是联交所的证券代码
3	ZEZYGS	总持股数	N	15,0	该证券的全部投资者持仓总额
4	ZEFRSQ	发送日期	D		格式为CCYYMMDD,必填项
5	ZEBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库是境外指定交易券商用于次日卖出进行前端监控使用。

(3) 如果没有可卖出的股份，就没有相关记录。

## 3.2 H 股全流通

### 3.2.1 交易清算明细文件 H\_SJSMX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	06: H 股全流通
2	JYFS	交易方式	C	2	02: 经深证通
3	JSFS	交收方式	C	1	H: 代收付
4	YWLB	业务类别	C	4	JY00-H 股全流通交易 (含大宗交易)
5	ZQLB	证券类别	C	2	F0: H 股全流通股票 F1: H 股全流通供配股权证 F2: H 股全流通其他权证
6	QSLSH	清算流水号	C	16	前 6 位为日期, 后 10 位为当日数字编号
7	CJBH	成交编号	C	21	港交所执行编号
8	WTBH	委托编号	C	16	委托编号
9	JYRQ	交易日期	C	8	YYYYMMDD
10	QSRQ	清算日期	C	8	YYYYMMDD
11	JSRQ	交收日期	C	8	清算日期对应下两个港股通交收日
12	QTRQ	其它日期	C	8	YYYYMMDD
13	CJSJ	成交时间	C	6	深证通确定的成交时间 HHMMSS
14	JYDY	交易单元	C	6	交易单元
15	TGDY	托管单元	C	6	托管单元
16	JSZH	结算账号	C	8	左 6 位有效, 左对齐
17	ZQZH	证券账户代码	C	20	左 10 位有效, 左对齐
18	ZQDM1	证券代码 1	C	8	左 6 位有效, 左对齐
19	ZQDM2	证券代码 2	C	8	
20	CJSL	成交数量	N	20, 3	单位为股 (份) 正数表示境内结算参与者应收数量 负数表示境内结算参与者应付数量
21	CJJG	成交价格	N	18, 10	单位为清算币种/股 (份), 如 HKD/股
22	JG2	价格 2	N	18, 10	
23	QSSL	清算数量	N	20, 3	单位为股 (份)

					正数表示境内结算参与者应收数量 负数表示境内结算参与者应付数量 清算数量为0,表示卖空导致整笔交易无效; 清算数量不为0且不等于成交数量,表示该笔交易部分卖空,清算数量即为有效部分。
24	WBJE	外币清算金额	N	19,2	正数表示境内结算参与者应收金额 负数表示境内结算参与者应付金额
25	ZJZH	资金账户	C	25	左10位有效,左对齐
26	YHS	印花税	N	19,2	负数,表示境内结算参与者应付金额
27	JYZF	交易征费	N	19,2	负数,表示境内结算参与者应付金额
28	JYF	交易费	N	19,2	负数,表示境内结算参与者应付金额
29	SYF	交易系统使用费	N	19,2	负数,表示境内结算参与者应付金额
30	JSF	股份交收费	N	19,2	负数,表示境内结算参与者应付金额
31	QTJE	其它金额	N	19,2	财务汇报局交易征费,负数表示境内结算参与者应付金额
32	WBYSF	外币应收付金额	N	19,2	正数表示境内结算参与者应收金额 负数表示境内结算参与者应付金额
33	QSBZ	清算币种	C	3	
34	HL	汇率	N	18,10	
35	YSFJE	人民币应收付金额	N	19,2	
36	CWDH	错误代号	C	4	
37	FJSM	附加说明	C	40	
38	FSRQ	发送日期	C	8	

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库表示应在交收日完成资金划付的交易清算明细,含各类税费。每笔记录按成交委托进行清算。具体清算算法参照相关业务指南。

### 3.2.2 可交易额度文件 H\_SJSJY.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JSZH	结算账号	C	8	左6位有效,左对齐
2	TGDY	托管单元	C	6	托管单元
3	ZQDM	证券代码	C	8	境内证券代码,左6位有效,左对齐

4	ZQZH	证券账户代码	C	20	左 10 位有效，左对齐
5	KJYE	可交易额	N	20, 3	单位为股（份），正整数
6	FSRQ	发送日期	C	8	YYYYMMDD
7	BYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

- (1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。
- (2) 本库是境外指定交易券商用于次日卖出进行前端监控使用。
- (3) 如果没有可卖出的股份，就没有相关记录。