



股转系统办发〔2020〕115号附件2

全国中小企业股份转让系统 市场参与者技术系统变更指南 之融资融券业务 (V1.0)

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

二〇二〇年八月

修订历史

修订历史		
版本号	修订日期	修订说明
V0.1	2020.08.13	创建文档
V0.2	2020.08.20	修订信息公告文件说明，融资融券信息采用单独的公告文件类型
V0.3	2020.08.21	错误码修订
V1.0	2020.09.01	定稿

目录

一、说明.....	1
二、参考文档.....	1
三、变动简述.....	1
(一) 资格认定.....	2
(二) 通过信息公告发布融资融券信息.....	3
1. 融资融券信息发布时间和对象.....	3
2. 融资融券信息发布内容.....	4
(三) 申报.....	5
(四) 回报.....	10
(五) 业务数据报送.....	20
1. 融资融券余额数据.....	20
2. 信用违约资料.....	22
3. 信用违约资料汇总.....	22
四、数据接口规范修订说明.....	23
(一) 信息公告文件 RByymmdd.nnn	23
(二) 信息公告文件 DBByymmdd.nnn	25
(三) 申报库 NQWT.DBF	27
(四) 回报库 NQHB.DBF.....	30
(五) 融资融券余额数据 RR?????.DBF	32
(六) 信用违约资料 WY?????.DBF	33

(七) 信用违约资料汇总 XYWYZL.DBF	35
五、清算交收与税费标准.....	36
六、市场参与者技术系统注意事项.....	36
七、联系方式.....	38

一、说明

为便于各市场参与者和相应 IT 提供商更好地理解融资融券业务对相关技术系统的改造要求，做好技术系统的准备工作，全国股转公司专门编制和发布本指南。本指南包括业务申报、行情发送、信息发送等方面的内容，清算、交收方面的内容由中国证券登记结算有限责任公司另行发布。

本次变更参考技术文档为《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.45）》（以下简称“数据接口规范”），未涉及内容请参考相关业务实施规则、细则和制度。

特别提示：如果业务规则、细则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

二、参考文档

《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.45）》

三、变动简述

全国股转公司拟推出融资融券业务，允许有资格的证券公司为投资者提供相应服务。

融资融券交易，也称信用交易或保证金交易。

融资交易是指投资者向证券公司提交保证金，借入资金买入标的证券，买入的标的证券同时作为投资者向证券公司融资的担保物。

融券交易是指投资者向证券公司提交保证金，借入证券并卖出标的证券。卖出的价款连同投资者提交的保证金一起作为投资者融券的担保物。

对于融资交易，投资者可通过融资卖出（卖券还款）或直接还款的方式了结融资合约。

对于融券交易，投资者可通过融券买入（买券还券）或直接还券的方式了结融券合约。

本次修改内容如下：

（一） 资格认定

只有开通融资融券交易权限的证券公司才能向投资者提供融资融券业务。

只有合格投资者才能参与融资融券业务。

参与融资融券业务的投资者需要向开通融资融券交易权限的证券公司申请新开立专门的信用证券账户，并同时开通“全国股转标识”。

融资融券业务必须通过证券公司融资融券专用交易单元进行。券商接受投资者的融资融券委托后，通过融资融券专用交易单元向全国股转公司申报，申报应当标注“融资”或“融券”。

投资者向证券公司申请融资或融券时交存的保证金、融资买入的证券或融券卖出的价款作为对证券公司的担保物，若担保物不足，且投资者未能按要求及时追加的，证券公司有权按照程序采取强制平仓等措施，其买卖申报应当标注“强制平仓”。

证券公司应当开立客户信用交易担保证券账户用于记

载信用交易客户持有的证券总量。

证券公司应当开立融券专用证券账户用于存放供投资者融券卖出的证券。

其他相关要求以全国股转公司发布的相关规则为准。

(二) 通过信息公告发布融资融券信息

公开发布的融资融券信息分为两类：融资融券标的券信息和融资融券担保券信息，每个交易日开市前通过行情通道发布。

1. 融资融券信息发布时间和对象

- 融资融券标的券信息和担保券信息由全国股转公司编制并发布。
- 融资融券信息发布对象为全市场。
- 融资融券信息通过行情公告通道下发。
- 全国股转公司在日间（8:30-15:00）通过信息公告文件（RRyymmdd.nnn）发布当日所有融资融券标的券信息。
- 全国股转公司在日间（8:30-15:00）通过信息公告文件（DByymmdd.nnn）发布当日所有融资融券担保券信息。
- 融资融券信息每日至少发布一次（8:30）。
- 如果任一支证券的可融资融券状态在日间发生变化，则会实时发送更新后的完整的融资融券标的券信息公告文件。
- 如果任一支证券的可担保状态在日间发生变化，则会实时发送更新后的完整的融资融券担保券信息公告文件。

- 融资融券信息日间无变化时，每隔 10 分钟重发一次，重发文件时不会更新证券行情库里的信息公告更新时间。

2. 融资融券信息发布内容

融资融券标的券信息发布的内容包括证券代码、证券简称、融资标的状态、融券标的状态、当日可融资状态和当日可融券状态。各字段结构定义见表 3-1。

表 3-1 融资融券标的的信息字段定义

序号	字段名称	格式	备注
1	证券代码	6 位数字编码	
2	证券简称	8 位字符	
3	融资标的	1 位字符	“Y”是 “N”否
4	融券标的	1 位字符	“Y”是 “N”否
5	当日可融资	1 位字符	“Y”是 “N”否
6	当日可融券	1 位字符	“Y”是 “N”否

融资融券担保券信息发布的内容包括证券代码、证券

简称。各字段结构定义见表 3-2。

表 3-2 融资融券担保信息字段定义

序号	字段名称	格式	备注
1	证券代码	6 位数字编码	
2	证券简称	8 位字符	

（三）申报

融资融券的申报业务类型不变。

投资者可使用信用证券账户进行普通交易（相应买卖委托不需向证券公司融资或融券，即担保品买卖）和信用交易。

投资者进行信用交易时，必须通过融资融券专用交易单元进行，其交易申报应当标注“融资”或“融券”，信用交易的交易指令分为融资买入、卖券还款、融券卖出、买券还券。若是证券公司进行强制平仓的，应当标注“强制平仓”。

为申报相关标识，申报库 NQWT.DBF 增加两个字段：

（1） 增加 WTRZRQ（字段 14：融资融券标志）字段，用于标识该笔申报是否属于信用交易，“ ”（空格）表示为普通交易，“1”表示为融资交易，“2”表示为融券交易。投资者使用非信用证券账户委托时该字段只能填“ ”（空格）。

（2） 增加 WTPCBZ（字段 15：平仓标志）字段，用

于标识该笔申报是否属于证券公司强制平仓,“ ”
(空格)表示属于普通交易,“3”表示属于强制
平仓。投资者委托时该字段只能填“ ”(空格)。

(3) 申报要素及填写格式见表 3-2。

表 3-2: 申报要素

申报内容	融资买入		卖券还款	
	买入	撤单	卖出	撤单
合同序号	22 位编码: 6 位交易单元代码(数字)、8 位申报日期 (数字)、8 位申报流水号; 申报流水号为 2 位证券营业 部识别码(字母和数字)加上 6 位数字编码。			
证券代码	6 位数字编码			
证券账户号码	10 位数字编码, 不足 10 位前补“0”			
申报数量	≥ 0 , 与原业务申报填写要求一致			
申报价格	≥ 0 , 与原业务申报填写要求一致			
业务类别	2 位数字与字母组合, 与原业务申报填写要求一致			
拟成交对手方交 易单元	6 位数字编码, 与原业务申报填写要求一致			
拟成交对手方证 券账号	10 位数字编码, 与原业务申报填写要求一致			
申报数量 2	≥ 0 , 与原业务申报填写要求一致			
申报价格 2	≥ 0 , 与原业务申报填写要求一致			
成交约定号	8 位以内数字, 与原业务申报填写要求一致			

融资融券标志	1	空格	1	空格
平仓标志	空格	空格	空格	空格
申报时间	6 位数字编码（HHMMSS）			
处理标记	1 位编码			

申报内容	融券卖出		买券还券	
	卖出	撤单	买入	撤单
合同序号	22 位编码：6 位交易单元代码（数字）、8 位申报日期（数字）、8 位申报流水号；申报流水号为 2 位证券营业部识别码（字母和数字）加上 6 位数字编码。			
证券代码	6 位数字编码			
证券账户号码	10 位数字编码，不足 10 位前补“0”			
申报数量	≥0，与原业务申报填写要求一致			
申报价格	≥0，与原业务申报填写要求一致			
业务类别	2 位数字与字母组合，与原业务申报填写要求一致			
拟成交对手方交易单元	6 位数字编码，与原业务申报填写要求一致			
拟成交对手方证券账号	10 位数字编码，与原业务申报填写要求一致			
申报数量 2	≥0，与原业务申报填写要求一致			
申报价格 2	≥0，与原业务申报填写要求一致			
成交约定号	8 位以内数字，与原业务申报填写要求一致			

融资融券标志	2	空格	2	空格
平仓标志	空格	空格	空格	空格
申报时间	6 位数字编码（HHMMSS）			
处理标记	1 位编码			

申报内容	强制平仓			普通交易		
	买入	卖出	撤单	买入	卖出	撤单
合同序号	22 位编码：6 位交易单元代码（数字）、8 位申报日期（数字）、8 位申报流水号；申报流水号为 2 位证券营业部识别码（字母和数字）加上 6 位数字编码。					
证券代码	6 位数字编码					
证券账户号码	10 位数字编码，不足 10 位前补“0”					
申报数量	≥0，与原业务申报填写要求一致					
申报价格	≥0，与原业务申报填写要求一致					
业务类别	2 位数字与字母组合，与原业务申报填写要求一致					
拟成交对手方交易单元	6 位数字编码，与原业务申报填写要求一致					
拟成交对手方证券账号	10 位数字编码，与原业务申报填写要求一致					
申报数量 2	≥0，与原业务申报填写要求一致					
申报价格 2	≥0，与原业务申报填写要求一致					
成交约定号	8 位以内数字，与原业务申报填写要求一致					

融资融券标志	2	1/空格	空格	空格	空格	空格
平仓标志	3	3	空格	空格	空格	空格
申报时间	6 位数字编码 (HHMMSS)					
处理标记	1 位编码					

注：

- (1) 对于融资买入、卖券还款融资融券标志填“1”融资；对于融券卖出、买券还券融资融券标志填“2”融券；对于其他申报（包括撤单）融资融券标志填“ ”（空格）。
- (2) 对于证券公司强制平仓，平仓标志填“3”强制平仓；对于其他申报（包括撤单）平仓标志填“ ”（空格）。
- (3) 要约业务不能开展融资融券业务。
- (4) 大宗交易不能开展融资融券业务。
- (5) 融券卖出价格不能低于最近成交价。
- (6) 融券卖出不能报市价申报。
- (7) 信用账户进行普通买入时，可交易证券代码必须在担保券范围内。
- (8) 信用账户进行融资买入或融券卖出时，可交易证

券代码必须在当日可融资或当日可融券标的券范围内。

(9) 接收申报的时间不变。

(四) 回报

融资融券的回报业务类型不变。

为回报相关标识，回报库 NQHB.DBF 增加两个字段：

(1) 增加 HBRZRQ(字段 14: 融资融券标志) 字段，用于标识该笔申报是否属于信用交易，“”(空格) 表示为普通交易，“1”表示为融资交易，“2”表示为融券交易。投资者使用非信用证券账户委托时该字段只能填“”(空格)。

(2) 增加 HBPCBZ (字段 15: 平仓标志) 字段，用于标识该笔申报是否属于证券公司强制平仓，“”(空格) 表示属于普通交易，“3”表示属于强制平仓。投资者委托时该字段只能填“”(空格)。

(3) 回报要素及填写格式见表 3-3。

表 3-3: 回报要素

回报内容	融资买入		卖券还款	
	买入	撤单	卖出	撤单
成交号码	8 位以内数字编码			

证券代码	6 位数字编码，同对应申报证券代码			
合同序号	22 位编码，同对应申报合同号码。			
证券账户号码	10 位数字编码，同对应申报证券账户号码			
成交数量	≥0，撮合成 交数量，与 原业务回报 填写要求一 致	申报数量的 负值	≥0，撮合成 交数量，与 原业务回报 填写要求一 致	申报数量的 负值
成交价格	≥0，撮合成 交价格，与 原业务回报 填写要求一 致	0	≥0，撮合成 交价格，与 原业务回报 填写要求一 致	0
成交数量 2	≥0，撮合成 交数量 2， 与原业务回 报填写要求 一致	申报数量的 负值	≥0，撮合成 交数量 2， 与原业务回 报填写要求 一致	申报数量的 负值
对手方交易单元	6 位数字编码，与原业务回报填写要求一致			
对手方证券账号	10 位数字编码，与原业务回报填写要求一致			
成交时间	6 位数字编码（HHMMSS）			
成交日期	8 位日期（CCYYMMDD）			

业务类别	2 位数字与字母组合，与原业务回报填写要求一致			
撤单原因	详见数据接口规范描述，与原业务申报填写要求一致			
融资融券标志	1	空格	1	空格
平仓标志	空格	空格	空格	空格

回报内容	融券卖出		买券还券	
	买入	撤单	卖出	撤单
成交号码	8 位以内数字编码			
证券代码	6 位数字编码，同对应申报证券代码			
合同序号	22 位编码，同对应申报合同号码。			
证券账户号码	10 位数字编码，同对应申报证券账户号码			
成交数量	≥0，撮合成 交数量，与 原业务回报 填写要求一 致	申报数量的 负值	≥0，撮合成 交数量，与 原业务回报 填写要求一 致	申报数量的 负值
成交价格	≥0，撮合成 交价格，与 原业务回报 填写要求一 致	0	≥0，撮合成 交价格，与 原业务回报 填写要求一 致	0
成交数量 2	≥0，撮合成	申报数量的	≥0，撮合成	申报数量的

	交数量 2， 与原业务回 报填写要求 一致	负值	交数量 2， 与原业务回 报填写要求 一致	负值
对手方交易单元	6 位数字编码，与原业务回报填写要求一致			
对手方证券账号	10 位数字编码，与原业务回报填写要求一致			
成交时间	6 位数字编码（HHMMSS）			
成交日期	8 位日期（CCYYMMDD）			
业务类别	2 位数字与字母组合，与原业务回报填写要求一致			
撤单原因	详见数据接口规范描述，与原业务申报填写要求一致			
融资融券标志	2	空格	2	空格
平仓标志	空格	空格	空格	空格

回报内容	强制平仓			普通交易		
	买入	卖出	撤单	买入	卖出	撤单
成交号码	8 位以内数字编码					
证券代码	6 位数字编码，同对应申报证券代码					
合同序号	22 位编码，同对应申报合同号码。					
证券账户号码	10 位数字编码，同对应申报证券账户号码					
成交数量	≥0，撮合成交数 量，与原业务回报 填写要求一致	申报 数量 的负		≥0，撮合成交数 量，与原业务回报 填写要求一致	申报 数量 的负	

		值		值
成交价格	≥0，撮合成交价格，与原业务回报填写要求一致	0	≥0，撮合成交价格，与原业务回报填写要求一致	0
成交数量 2	≥0，撮合成交数量 2，与原业务回报填写要求一致	申报数量的负值	≥0，撮合成交数量 2，与原业务回报填写要求一致	申报数量的负值
对手方交易单元	6 位数字编码，与原业务回报填写要求一致			
对手方证券账号	10 位数字编码，与原业务回报填写要求一致			
成交时间	6 位数字编码（HHMMSS）			
成交日期	8 位日期（CCYYMMDD）			
业务类别	2 位数字与字母组合，与原业务回报填写要求一致			
撤单原因	详见数据接口规范描述，与原业务申报填写要求一致			
融资融券标志	2	1/空格	空格	空格
平仓标志	3	3	空格	空格

注：

- （1） 对于融资买入、卖券还款融资融券标志填“1”融资；对于融券卖出、买券还券融资融券标志填“2”融券；对于其他申报（包括撤单）融资融券标志填“ ”（空格）。
- （2） 对于证券公司强制平仓，平仓标志填“3”强制平

仓；对于其他申报(包括撤单)平仓标志填“”(空格)。

(3) 撮合规则不变。

(4) 返回回报的时间不变。

(5) 新增融资融券错误编码：

HBCD YY	HBDFZH	具体含义
01	无效账户	证券账户编码不存在； 证券账户不是 10 位数字编码。
03	单元卖空	托管单元拥有的该证券可用股数小于卖出申报数量。
04	股东卖空	股东拥有的该证券可用股数小于卖出申报数量， 证券公司融券专户上可用股数小于融券卖出数量。
06	价格过高	两网公司及退市公司股票交易申报价格超出涨幅的上限； 做市商间互报成交确认申报价格超过当日允许申报价格区间的上限。
07	价格过低	两网公司及退市公司股票交易申报价格超出跌幅的下限； 做市商间互报成交确认申报价格超过当日允许申报价格区间的下限。
08	价格错误	申报价格非价格档位的整数倍； 撤单申报但价格不为零，非撤单申报但价格不大于零； 挂牌公司股票和两网公司及退市公司 A 类股票价格没有精确到小数点后 2 位；

HBCD YY	HBDFZH	具体含义
		两网公司及退市公司 B 类股票价格没有精确到小数点后 3 位； 非做市申报但申报价格 2 的值不为 0； 融券卖出价格低于规定价格。
09	数量非法	申报买数量小于下限； 撤单申报单数量不为零； 非撤单申报但数量不大于零； 申报数量不是整数； 买申报数量不是 NQXX.XXBLDW 的整数倍且不属于例外条款； 卖申报数量不是 NQXX.XXSLDW 的整数倍且不属于例外条款； 申报数量超出 NQXX.XXMBXL 的限值； 非做市申报但申报数量 2 的值不为 0。
12	账户非法	证券账户/对方证券账户格式非法； 证券账户/对方证券账户状态不可用。
13	账户限制	证券账户禁止申报该业务类别； 证券账户有买入、卖出或者双向限制； 证券账户限制交易申报买卖的证券（买入、卖出或双向限制）； 证券账户在申报交易单元上限制交易（买入、卖出或双向限制）； 证券账户在申报交易单元上限制交易申报买卖的证券（买入、卖出或双向限制）； 该证券账户无权交易该种证券 信用账户融资买入或融券卖出禁止交易非标的券；

HBCD YY	HBDFZH	具体含义
		信用账户不允许买入非担保品； 信用账户融券卖出必须是限价单； 信用账户不能在非融资融券专用交易单元上进行交易； 非信用账户不能在融资融券专用交易单元上进行交易； 融券专用账户禁止交易。
19	配对失败	互报成交确认申报之间不满足配对合法性要求； 成交确认申报与定价申报之间不满足配对合法性要求； 互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户非法； 互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户为空； 定价申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 限价申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 做市商做市申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 成交确认申报中（约定号≥ 1000000）拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 对方证券账户不存在； 对方证券账户不是 10 位数字编码； 对方交易单元不存在； 对方交易单元不是 6 位数字编码。
22	错误约定号	成交确认申报约定号格式错误（不为长度小于 8 位的数字字符串）；

HBCD YY	HBDFZH	具体含义
		成交确认申报中约定号为空； 定价申报、限价申报或做市商做市申报中约定号不为空； 约定号重复； 非成交确认申报/互报成交确认申报但约定号不为0。
23	无效单元	交易单元不存在； 交易单元不是6位数字编码； 交易单元禁止在该报盘小站上使用； 交易单元未开通； 交易单元处于冻结或注销状态； 该交易单元融资/融券业务权限被暂停； 非融资融券专用交易单元禁止强制平仓； 非融资融券专用交易单元禁止融资融券交易。
26	单元限制	交易单元/对方交易单元禁买、禁卖； 交易单元/对方交易单元无权经营该业务； 交易单元/对方交易单元无权经营该类证券品种； 证券账户禁止通过该交易单元申报/对方证券账户禁止通过对方交易单元申报。
27	市价撤单	本方最优申报时，当前本方无有效委托或者有委托但不满足保护限价； 对手方最优申报时，当前对手方无有效委托或者有委托但不满足保护限价； 最优五档即时成交剩余转限价申报时，未成交部分无对手方申报也无本方申报或者有委托但都不满足保护限价； 最优五档成交剩余撤销申报时，未成交部分当前对



HBCD YY	HBDFZH	具体含义
		手方无有效委托或者有委托但不满足保护限价。
42	融资禁止	当前禁止该证券的融资交易业务。
43	融券禁止	当前禁止该证券的融券交易业务。
44	无效业务	无效业务类别； 不是有效的融资融券标志； 不是有效的平仓标志。
45	禁止零卖	申报数量小于规定值的股份应一次性卖出（余股没有一次性卖出）。
50	做市价格错	做市商双向做市申报价差不符合规定。
51	业务类别错	不属于目前已开通的交易业务； 证券代码不允许申报该业务类别。
52	禁止该业务	当前申报时间不允许接收该业务类别的申报； 该证券当前处于停牌且当天不接受申报状态； 该证券挂牌后未发生成交，禁止做市商间互报成交确认申报。
53	无申报可撤	没有匹配的可撤申报。
54	报价类型错	做市申报非法。
55	无对手方	无可匹配成交的对手方申报。
56	替换撤单	做市申报替换撤单。
57	联系信息错	联系人或联系方式不为空。
58	股份性质错	股份性质不存在； 股份性质不是 2 位以内数字编码。
95	无效代码	证券代码非法或不存在； 证券代码不是 6 位数字编码；

HBCD YY	HBDFZH	具体含义
		该证券不是已挂牌证券。
96	时间非法	申报时间格式非法。
97	日期非法	申报日期不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码； 非当前交易日期。
98	流水号非法	申报流水号格式非法，不是 2 位营业部编码+6 位数字编码。
99	其他错误	因其他原因导致的交易主机自动撤单。

（五）业务数据报送

每日收盘后，证券公司应于 22:00 前通过 FDEP 向全国股转公司申报有关融资融券余额及信用违约资料等业务数据，申报格式为 DBF 格式。

1. 融资融券余额数据

申报文件名为 RR?????.DBF，其中?????为转让参与人代码。填写要求如下：

（1）当日融资余额=前日融资余额+当日融资买入-当日融资偿还额；

当日融券余量数量=前日融券余量+当日融券卖出数量-当日融券买入数量-当日现券偿还数量；

当日融券余量金额=当日融券余量数量*当日收盘价。

（2）当日融资买入金额、当日融券卖出数量、当日融券买入数量、当日融资强制平仓金额、当日融券强制平仓量等当日交易发生额数据，以当天交易的清算数据为准。

其中，“当日融券买入数量”的申报数量应当为“融券

买入”交易指令（包括投资者主动下达的买券还券交易指令、强制平仓交易指令）达成成交而实际了结掉的融券合约数量，即证券公司申报的“当日融券买入数量” $\leq$ 买券还券指令成交数量+强制融券平仓交易指令成交数量。也就是说，当融券买入（包含强制融券平仓）交易指令成交数量超过融券合约数量时，应申报实际了结的融券合约数量，投资者多还部分（即超出融券合约数量部分）的退券视为修正处理，不纳入申报数据。

- (3) 通常，当日申报数据中的“前日融券余量”应与前一交易日申报的“当日融券余量”相等，但在当日发生因送红股而除权的情形下，当日申报数据中的“前日融券余额”不等于前一交易日申报的“当日融券余额”，其计算方法如下：

结算公司于股权登记日（R 日）下午收市后进行权益分派到账处理，证券于 R+1 日除权：证券公司在 R 日完成融资融券余额数据申报后，应对融券余额大于 0 的客户进行记借红股处理（例如，某投资者融券了 100 股，送股比例为 0.1,则将该投资者记借 100 股调整为记借 110 股，计算结果精确至股或份），于 R+1 日申报的“前日融券余量”=所有融券客户记借红股处理后的融券数量总计=R 日申报的“当日融券余量”+记借红股总量。

- (4) 报送的数据不应包含包括佣金或交易经手费等费用部分。如，“当日融资买入额”=融资买入成交数量*成交价格，不包括交易印花税和佣金等费用部分；“当日融资偿还额”，应为扣除交纳交易印花税和佣金及融资费用后实际了结的融资合约额。
- (5) 表中，“当日融资偿还额”包含“本日融资强制平仓额”，“当日融券买入数量”包含“当日融券强制平仓

量”。

- (6) 表中金额类字段，计算过程中精确至 0.01 元，最终结果精确至 1 元。
- (7) 当证券代码为‘999999’时，代表该笔记录为所有标的证券的总计金额。
- (8) 如某标的证券前日融资余额、前日融券余额都为零，且当日无融资融券业务发生，则可不申报该证券的记录。申报数据中必须包含汇总记录（证券代码为‘999999’），即使所有标的证券的余额数据都为 0。
- (9) 申报记录应按证券代码由小到大排序。
- (10) 证券公司应确保每交易日正确申报该数据，申报的截止时间点为当日晚上 10:00。如证券公司因故未能于通常申报时间（如晚 9:00）成功申报，应启动应急流程，向全国股转公司有关人员报告。
- (11) 如证券公司在约定时间（晚 10:00）前有多次申报，则以最后一次申报的数据为准。

2. 信用违约资料

申报文件名为 WY?????.DBF，其中 ????? 为转让参与人代码。填写要求如下：

- (1) 交易所于约定的截止时间点（每交易日晚上 10:00）前接收信用违约资料的申报。如券商多次申报，则以最后收到的数据为准。
- (2) 由于违约汇总资料为每日的变更情况而并非当前完整的违约信息，券商需根据变更情况（新增、撤销、结案）维护违约信息。

3. 信用违约资料汇总

全国股转公司汇总各券商的报送的当日数据变动情况

后，以 **XYWYZL.DBF**（库结构同 **WY?????.DBF**）通过 **FDEP** 发送给开展融资融券业务的券商。

四、数据接口规范修订说明

（一）信息公告文件 **RRyymmdd.nnn**

1) 公告文件编码规则

汉字编码方式采用**GBK**编码。

2) 公告文件命名规则

新增一类信息公告文件**RRyymmdd.nnn**。

其中，类型前缀“**RR**”表示“融资融券标的券信息”。

日期为不含世纪的**6**位数字，格式为**yymmdd**，其中**yy**表示年，**mm**表示月，**dd**表示日。

流水号后缀为**3**位数字，每天从**001**开始顺序编写，如果当天没有融资融券标的券信息变更，则只会存在后缀为**001**的融资融券标的券信息公告文件。

文件名相同的信息公告下发时，应当重新读取新文件内容，取代旧文件内容。

3) 公告文件的结构头

公告文件包含有一个带格式的结构头，结构头存放了信息公告的发送日期、发送时间、信息类型、主标题、主题词等要素。具体约定见表 4-1。

表 4-1：公告文件头结构定义

序号	要素	格式	备注
1	发送日期	8 位数字，格式：yyyymmdd	yyyy表示年，mm表示月，dd表示日
2	发送时间	8 位字符，格	hh 表示小时，mm 表示分，ss 表示秒

序号	要素	格式	备注
		式：hh:mm:ss	
3	信息类型	字符串	融资融券标的券信息
4	消息来源	字符串	全国股转公司
5	主标题	字符串	全国股转公司融资融券标的券信息
6	副标题	字符串	空
7	主题词	字符串	融资融券信息

4) 公告文件的正文

公告文件的正文分为四段：

首行为数据区开始标签TAG；

次行为本次发布标的券的总数；

第三行开始按行揭示标的券的融资融券状态，每只证券用一行揭示，按证券代码从小到大的顺序排列，各字段之间用“|”分隔。

最末一行为数据区结束标签END。

5) 公告文件示例

RR200817.001

发送日期: 20200817

发送时间: 08:30:00

信息类型: 融资融券标的券信息

消息来源: 全国股转公司

主标题：全国股转公司融资融券标的券信息

副标题：

主题词：融资融券信息

TAG

3

839000|测试9000|Y|N|Y|N

839001|测试9001|Y|Y|Y|Y

839002|测试9002|Y|Y|N|Y

END

（二） 信息公告文件 DByymmdd.nnn

1) 公告文件编码规则

汉字编码方式采用**GBK**编码。

2) 公告文件命名规则

新增一类信息公告文件**DByymmdd.nnn**。

其中，类型前缀“**DB**”示“融资融券担保券信息”。

日期为不含世纪的**6**位数字，格式为**yymmdd**，其中**yy**表示年，**mm**表示月，**dd**表示日。

流水号后缀为**3**位数字，每天从**001**开始顺序编写，如果当天没有融资融券担保券信息变更，则只会存在后缀为**001**的融资融券担保券信息公告文件。

文件名相同的信息公告下发时，应当重新读取新文件内容，取代旧文件内容。

3) 公告文件的结构头

公告文件包含有一个带格式的结构头，结构头存放了信息公告的发送日期、发送时间、信息类型、主标题、主题词等要素。具体约定见表 4-2。

表 4-2：公告文件头结构定义

序号	要素	格式	备注
1	发送日期	8 位数字，格式：yyyymmdd	yyyy表示年，mm表示月，dd表示日
2	发送时间	8 位字符，格式：hh:mm:ss	hh 表示小时，mm 表示分，ss 表示秒
3	信息类型	字符串	融资融券担保债券信息
4	消息来源	字符串	全国股转公司
5	主标题	字符串	全国股转公司融资融券担保债券信息
6	副标题	字符串	空
7	主题词	字符串	担保债券信息

4) 公告文件的正文

公告文件的正文分为四段：

首行为数据区开始标签**TAG**；

次行为本次发布担保券的总数；

第三行开始按行揭示所有担保券，每只证券用一行揭示，按证券代码从小到大的顺序排列，各字段之间用“|”分隔。

最末一行为数据区结束标签**END**。

5) 公告文件示例

DB200817.001

发送日期: 20200817

发送时间: 08:30:00

信息类型: 融资融券担保券信息

消息来源: 全国股转公司

主标题: 全国股转公司融资融券担保券信息

副标题:

主题词: 担保券信息

TAG

3

839000|测试9000

839001|测试9001

839002|测试9002

END

(三) 申报库 NQWT.DBF

- (1) 新增两个字段用于标识融资融券和强制平仓,新增三个字段用于以后扩展新业务使用,调整后的

库结构如表 4-1:

表 4-1: 申报库结构

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WTHTXH	合同序号	C	22	必填
2	WTZQDM	证券代码	C	6	必填
3	WTZQZH	证券账户	C	10	为十位数字字符，不足十位的左端补足平 0'，不可含空格，必填
4	WTWTSL	申报数量	N	9,0	必填
5	WTWTJG	申报价格	N	9,3	必填
6	WTYWLB	业务类别	C	2	必填
7	WTDFDY	拟成交对手方交易单元	C	6	数字字符串，互报成交确认申报必须填写
8	WTDFZH	拟成交对手方证券账户	C	10	数字字符串，互报成交确认申报必须填写

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
9	WTWTSL2	申报数量 2	N	9,0	做市报价申报中双向申报的卖出数量
10	WTWTJG2	申报价格 2	N	9,3	做市报价申报中双向申报的卖出价格
11	WTLXR	联系人	C	12	预留
12	WTLXFS	联系方式	C	30	预留
13	WTYDH	成交约定号	N	8,0	成交确认申报必须填写
14	WTRZRQ	融资融券标志	C	1	
15	WTPCBZ	平仓标志	C	1	
16	WTWTSJ	申报时间	C	6	HHMMSS, 必填
17	WTCLBZ	处理标志	C	1	必填
18	WTBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用
19	WTBYZD1	备用字段 1	N	19,3	预留
20	WTBYZD2	备用字段 2	N	19,3	预留

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
21	WTBYZD3	备用字段 3	C	40	预留

(四) 回报库 NQHB.DBF

(1) 新增两个字段用于标识融资融券和强制平仓,新增三个字段用于以后扩展新业务使用,调整后的库结构如表 4-2:

表 4-2: 回报库结构

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HBCJHM	成交号码	C	8	数字字符串
2	HBZQDM	证券代码	C	6	数字字符串
3	HBHTXH	合同序号	C	22	
4	HBZQZH	证券账户	C	10	数字字符串
5	HBCJSL	成交数量	N	10,0	为正数时表示买卖成交数量,为负数时表示撤单确认数量,做市商报价撤单时,填写买入撤单确认数量

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
6	HBCJJG	成交价格	N	9,3	
7	HBCJSL2	成交数量 2	N	10,0	做市商报价撤单时，填写卖出撤单确认数量
8	HBDFDY	对手方交易单元	C	6	数字字符串
9	HBDFZH	对手方证券账户	C	10	数字字符串 撤单回报时填写简要撤单说明
10	HBCJSJ	成交时间	C	8	HHMMSSss
11	HBCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
12	HBYWLB	业务类别	C	2	
13	HBCDYY	撤单原因	C	2	
14	HBRZRQ	融资融券标志	C	1	
15	HBPCBZ	平仓标志	C	1	
16	HBBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
17	HBZYD1	备用字段 1	N	19,3	预留
18	HBZYD2	备用字段 2	N	19,3	预留
19	HBZYD3	备用字段 3	C	40	预留

(五) 融资融券余额数据 RR?????.DBF

(1) 新增一个接口文件用于报送融资融券余额数据，数据结构如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	RRZRCYZ	转让参与人代码	C	6	
1	RRZQDM	证券代码	C	6	
2	RRZRRZY E	前日融资余额	N	19,2	金额，以元为单位
	RRJRRZM R	当日融资买入额	N	19,2	金额，以元为单位
3	RRJRRZC H	当日融资偿还额	N	19,2	金额，以元为单位
4	RRZRRQY E	前日融券余量	N	19,2	数量，以股为单位
5	RRJRRQ MC	当日融券卖出数量	N	19,2	数量，以股为单位
6	RRJRRQ MR	当日融券买入数量	N	19,2	数量，以股为单位
7	RRJRXQC H	当日现券偿还数量	N	19,2	数量，以股为单位

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
8	RRJRRZPC	当日融资强制平仓额	N	19,2	金额，以元为单位
9	RRJRRQPC	当日融券强制平仓量	N	19,2	数量，以股为单位
10	RRJRRZYE	当日融资余额	N	19,2	金额，以元为单位
11	RRJRRQYE	当日融券余量金额	N	19,2	金额，以元为单位，融券余量*当日收盘价
12	RRJYRQ	信用交易发生日期	D	8	CCYYMMDD

(2) 本文件截止接收时间为每交易日晚上 22:00。

(六) 信用违约资料 WY?????.DBF

(1) 新增一个接口文件用于报送当日信用违约资料变动情况，数据结构如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WYZRCYZ	转让参与人代码	C	6	
2	WYJYDY	交易单元代码	C	6	主融资融券专用交易单元
3	WYQSMC	券商名称	C	40	
4	WYGDDM	违约者证券账户	C	10	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
5	WYGDXM	违约者姓名	C	60	
6	WYSFZH	证件号码	C	30	
7	WYWYJE	违约金额	N	19,2	
8	WYWYLB	违约类别	C	1	“1”：未按规定补足担保物 “2”：合约期满未清偿 “3”：提供虚假信息 “4”：发生司法纠纷
9	WYSBLB	申报类别	C	1	“1”：新增 “2”：撤销 “3”：结案
10	WYSBRQ	申报日期	D	8	
11	WYBYBZ	备用字段	C	2	备用

(2) 本文件截止接收时间为每交易日晚上 22:00。

(七) 信用违约资料汇总 XYWYZL.DBF

(1) 新增一个接口文件用于下发汇总后的当日信用违约资料变动情况，数据结构如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WYZRCYZ	转让参与人代码	C	6	
2	WYJYDY	交易单元代码	C	6	主融资融券专用交易单元
3	WYQSMC	券商名称	C	40	
4	WYGDDM	违约者证券账户	C	10	
5	WYGDXM	违约者姓名	C	60	
6	WYSFZH	证件号码	C	30	
7	WYWYJE	违约金额	N	19,2	
8	WYWYLB	违约类别	C	1	“1”：未按规定补足担保物 “2”：合约期满未清偿 “3”：提供虚假信息 “4”：发生司法纠纷

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
9	WYSBLB	申报类别	C	1	“1”：新增 “2”：撤销 “3”：结案
10	WYSBRQ	申报日期	D	8	
11	WYBYBZ	备用字段	C	2	备用

(2) 本文件通过 FDEP 下发，如当天没有变动则下发空库。

五、清算交收与税费标准

中国结算对于融资融券业务的具体规定与要求以中国结算官网发布的文档为准。

六、市场参与者技术系统注意事项

1. 行情软件应能揭示挂牌公司股票是否属于融资融券标的券以及当日是否可以融资/融券。
2. 证券公司被暂停或取消融资融券业务资格后，如有未了结合约，可继续清理。
3. 证券公司应当控制可充抵保证金证券必须在全国股转公司规定的可充抵保证金证券范围内。
4. 证券公司应当控制投资者使用信用账户开展融资融券交易时，其交易的对象只能是标的券，且该标的券当日属

可交易状态。

5. 证券公司应当控制投资者只能使用信用账户开展融资融券交易。

6. 董监高、持股 5%以上股东禁止在相应证券开展融资买入，融券卖出。

7. 证券公司应控制持有限售股的投资者不得融券卖出该股票。

8. 证券公司应确保担保品划转指令的划入、划出方为同一投资者的账户。

9. 证券公司应控制投资者买券还券数量不高于该客户的融券余量，余量不足 100 股的，买券还券数量不高于 100 股。

10. 证券公司应控制投资者信用账户买入或划入的证券不得超过可充抵保证金证券范围。

11. 证券公司应控制维持担保比例超过 300%时，才允许投资者信用账户划出股份。

12. 限售股不得划入作为担保品。

13. 证券公司应根据公开披露的董监高名单、持股 5%以上股东名单控制投资者不得在相应股票上做融资买入、融券卖出。

14. 证券公司应根据中国结算发布的持有原始股的投资

者名单控制投资者不得将对应公司股票划转入担保品账户。

七、联系方式

联系单位/部门	联系电话
全国股转公司	400-626-3333
深圳证券通信公司	0755-83182222
QQ 群	338167838