



中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0177.2—2020

证券期货业投资者权益相关数据的内容和 格式 第2部分：期货

Contents and formats of data on investors' rights and interests in the securities and
futures industry—Part2: Futures

2020 - 02 - 26 发布

2020 - 02 - 26 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

| | |
|--------------------------|----|
| 前言..... | II |
| 1 范围..... | 1 |
| 2 规范性引用文件..... | 1 |
| 3 术语和定义..... | 1 |
| 4 数据类别及类型..... | 1 |
| 4.1 数据类别..... | 2 |
| 4.2 数据类型..... | 2 |
| 5 数据内容和格式..... | 2 |
| 5.1 投资者账户数据..... | 2 |
| 5.1.1 投资者基本资料数据..... | 2 |
| 5.1.2 投资者编码数据..... | 4 |
| 5.1.3 投资者结算账户数据..... | 5 |
| 5.2 持仓业务数据..... | 5 |
| 5.2.1 投资者期货持仓数据..... | 5 |
| 5.2.2 投资者期权持仓数据..... | 6 |
| 5.2.3 投资者现货持仓数据..... | 7 |
| 5.3 交割业务数据..... | 8 |
| 5.3.1 待交割数据..... | 8 |
| 5.3.2 交割数据..... | 9 |
| 5.4 结算业务资金数据..... | 9 |
| 5.4.1 投资者期货期权账户资金数据..... | 9 |
| 5.4.2 投资者现货账户资金数据..... | 11 |
| 5.4.3 投资者其他分项资金数据..... | 12 |
| 5.5 充抵业务数据..... | 13 |
| 5.5.1 货币充抵明细数据..... | 13 |
| 5.5.2 非货币充抵明细数据..... | 13 |
| 附录 A（规范性附录） 数据字典..... | 15 |
| 附录 B（规范性附录） 代码取值及描述..... | 19 |
| 参考文献..... | 26 |

前 言

JR/T 0177—2020《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式》分为3部分内容：

——第1部分：证券；

——第2部分：期货；

——第3部分：基金。

本部分为JR/T 0177—2020的第2部分。

本部分依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本部分由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本部分由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本部分起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、中证信息技术服务有限责任公司、上海期货信息技术有限公司。

本部分主要起草人：姚前、刘铁斌、罗凯、王东明、周云晖、路一、周桢、罗璇、贾石、韩晓红、袁彦明、温雯、杨雪。

证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第2部分：期货

1 范围

本部分规定了期货业投资者权益数据的数据类别及类型、数据内容和格式等内容，数据内容和格式包括投资者账户数据、持仓业务数据、交割业务数据、结算业务资金数据及充抵业务数据等。

本部分适用于行业机构开展期货业投资者权益数据治理相关工作。

2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅所注日期的版本适用于本文件。凡是不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB/T 4658—2006 学历代码

GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

GB/T 13497—1992 全国清算中心代码

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

期货投资者 futures investor

参与商品期货、金融期货、商品期权等场内期货市场的投资者。

注：主要有机构投资者和个人投资者。

3.2

交易编码 trading code

会员和客户进行期货交易的专用代码。由会员号和客户号两部分组成，共十二位数字，前四位为会员号，后八位为客户号。

3.3

客户内部资金账户 customer fund account

投资者用于期货资金清算的专用账户。

注：根据业务不同客户内部资金账户分为期货期权资金账户和证券现货资金账户。

3.4

保证金 margin

期货交易者按照规定交纳的资金或者提交的价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等有价值证券，用于结算和保证履约。

4 数据类别及类型

4.1 数据类别

本部分覆盖期货市场的期货及期权业务，暂未覆盖期货公司开展的资管业务。主要包括五大类业务数据：投资者账户数据、持仓业务数据、交割业务数据、结算业务资金数据、充抵业务数据，数据类别内容见表1。各数据类别涉及的数据项见附录A，数据项的代码取值见附录B。

表1 数据类别

| 序号 | 数据 | 说明 | 数据类别 |
|----|----------|---|---------------|
| 1 | 投资者账户数据 | 该类数据旨在将各类投资者在期货市场开户时产生的客户资料进行整理，包括客户的基本信息以及投资者的各类账户信息及其对应关系。 | 投资者基本资料数据 |
| | | | 投资者编码数据 |
| | | | 投资者结算账户数据 |
| 2 | 持仓业务数据 | 该类数据旨在将投资者在期货市场的持仓数据进行整理。主要包含期货持仓、期权持仓及现货持仓。 | 投资者期货持仓数据 |
| | | | 投资者期权持仓数据 |
| | | | 投资者现货持仓数据 |
| 3 | 交割业务数据 | 该类数据旨在对期货合约进行交割行为所产生的相关数据进行整理，包括待交割和交割的数据信息。 | 待交割数据 |
| | | | 交割数据 |
| 4 | 结算业务资金数据 | 该类数据旨在对期货业投资者的每日结算数据进行整理。包括投资者的期货期权和现货账户资金数据结算信息及其他分项资金的结算信息。 | 投资者期货期权账户资金数据 |
| | | | 投资者现货账户资金数据 |
| | | | 投资者其他分项资金数据 |
| 5 | 充抵业务数据 | 该类数据旨在对投资者进行保证金充抵时产生的相关数据进行整理。 | 货币充抵明细数据 |
| | | | 非货币充抵明细数据 |

4.2 数据类型

数据类型说明：

——A，数字字符型。限于0—9，如交易所在地区代码，A4；

——C，字符型。如交易编码，C13；

——date，日期型。格式：YYYY-MM-DD；

——N，数值型。其长度不包含小数点，可参与数值计算。字段长度为x，表示该字段最长为x；字段长度为(x,y)，表示该字段最长为x，保留y位小数，如交易保证金，N(15,3)。

5 数据内容和格式

5.1 投资者账户数据

5.1.1 投资者基本资料数据

投资者基本资料数据内容和格式见表2，该数据内容属于期货市场投资者开户业务场景，内容为投资者开户过程中产生的关键信息。

表2 投资者基本资料数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------------|------|------|-------|-------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHLXDM | 客户类型代码 | C | 1 | N | DIM01 | |
| 3 | KHMC | 客户名称 | C | 400 | N | | |
| 4 | SFZ | 身份证号码 | C | 50 | Y | | 境内自然人客户的身份证号码，如果是法人客户，此字段为空。 |
| 5 | TZZXL | 投资者学历 | C | 2 | Y | | 根据 GB/T 4658—2006 确定的投资者学历代码。 |
| 6 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | |
| 7 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 投资者在期货交易所进行期货交易时使用的编码。 |
| 8 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 9 | SZD | 所在地 | C | 100 | N | | 投资者的户籍地址。 |
| 10 | TXDZ | 通讯地址 | C | 200 | N | | |
| 11 | YZBM | 邮政编码 | C | 6 | N | | |
| 12 | LXDH | 联系电话 | C | 40 | N | | |
| 13 | JYSZDQDM | 交易所在地区代码 | A | 4 | Y | | 根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。 |
| 14 | KHHXHBZ | 开户和销户标志 | C | 1 | N | DIM03 | |
| 15 | KHRQ | 客户期货期权内部资金账户开户日期 | C | 10 | N | | 客户开户并生效的实际日期，并非预开户的日期。 |
| 16 | ZZJGDM | 组织机构代码 | C | 40 | Y | | 境内法人客户的组织机构代码。如果是自然人客户，此字段为空。 |
| 17 | YYZZH | 营业执照号码 | C | 40 | Y | | 境内法人客户的营业执照号码，如果是自然人客户，此字段为空。 |
| 18 | TYSHXYDM | 统一社会信用代码 | C | 18 | Y | | 境内法人客户的统一社会信用代码，如果是自然人客户，此字段为空。 |
| 19 | KHDLRMC | 开户代理人名称 | C | 100 | Y | | |
| 20 | KHDLRSFZ | 开户代理人身份证号码 | C | 50 | Y | | |
| 21 | ZHZTDM | 账户状态代码 | C | 1 | N | DIM04 | |
| 22 | JWKHBZ | 境外客户标志 | C | 1 | Y | DIM05 | |
| 23 | GJDQDM | 国籍地区代码 | C | 10 | Y | | 根据 GB/T 2659—2000 确定的国家地区代码；如果是境内客户，此字段为空。 |

表2 投资者基本资料数据的数据内容和格式(续)

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|----------------------|------------------|------|------|-------|-------|---|
| 24 | JWGRKHZJHM | 境外个人客户证件号码 | C | 50 | Y | | 境外个人客户的护照号或港澳台个人客户往来大陆通行证号(注:目前港澳台个人客户的有效身份证明文件尚未最终确定,暂定为通行证);如果是境内客户、境外单位客户,此字段为空。 |
| 25 | SYDJZHM | 商业登记证号码 | C | 50 | Y | | 境外机构的商业登记证明文件号码,如果是境内客户、境外个人客户,此字段为空。 |
| 26 | JWZJJGBZ | 境外中介机构标志 | C | 1 | Y | DIM16 | |
| 27 | JWZJJGBH | 境外中介机构编号 | C | 10 | Y | | 如果不是境外中介机构,此字段为空。 |
| 28 | XHNBZJZH | 客户证券现货内部资金账户编码 | C | 18 | Y | | 此字段填写证券现货资金账户,客户同时参与证券交易所股票期权交易的,期货公司需为客户单独开立证券现货内部资金账户,用于记录证券现货有关的资金和交易。如客户未参与证券业务(含备兑开仓、行权等与之相关的业务)的,此字段为空。 |
| 29 | XHNBZJZHKHRQ | 客户证券现货内部资金账户开户日期 | date | 10 | Y | | 客户开户并生效的实际日期,(并非预开户的日期),格式:YYYY-MM-DD。如客户未开立证券现货内部资金账户,此字段为空。 |
| 30 | JWTSCYZYJWZJ JGBS | 境外特殊参与者与境外中介机构标识 | C | 1 | Y | DIM17 | 0:境外特殊经纪参与者;1:境外特殊非经纪参与者;2:境外中介机构;如果不是境外特殊参与者或境外中介机构,此字段为空。 |

5.1.2 投资者编码数据

投资者编码数据内容和格式见表3,该数据内容属于期货公司为参与期货期权交易和现货交易的投资者开立账户的业务场景,内容为期货期权资金账户与衍生品合约账号对应关系、现货资金账户与证券账户的对应关系。

表3 投资者编码数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------|-------|------|------|-------|------|----------------|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为:YYYY-MM-DD |

表3 投资者编码数据的数据内容和格式（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|------|-------|-------|---|
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的期货期权资金账户或证券现货资金账户，期货期权业务：填写期货期权资金账户；证券现货业务：填写证券现货资金账户。 |
| 3 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | |
| 4 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 填写期货期权资金账户的交易编码或证券现货资金账户的交易编码。其中期货期权资金账户的交易编码，填写证券交易所的衍生品合约账户（即客户证券账户+888）；证券现货资金账户的交易编码，填写客户在证券交易所的证券账户。 |

5.1.3 投资者结算账户数据

投资者结算账户数据内容和格式见表4，该数据内容为期货市场投资者开户设立结算账户时产生的数据信息。

表4 投资者结算账户数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|------|-------|-------|---|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 期货期权业务：填写期货期权资金账户；证券现货业务：填写证券现货资金账户，将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构视为客户处理。 |
| 3 | YHBM | 银行编码 | C | 2 | N | DIM15 | |
| 4 | YHZH | 银行账户编码 | C | 22 | N | | |
| 5 | JSZHBGBZ | 结算账户变更标志 | C | 1 | N | DIM12 | |
| 6 | YHZHKHRXM | 银行账户开户人姓名 | C | 400 | Y | | 该银行账户的开户人名称。 |
| 7 | KHH | 银行账户的开户行名称 | C | 400 | Y | | 开户银行具体网点（到支行）。 |
| 8 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

5.2 持仓业务数据

5.2.1 投资者期货持仓数据

期货持仓数据内容和格式见表 5，该数据内容为期货市场各类投资者交易、强平、期转现、期权行权等行为产生的期货持仓结果。

表 5 期货持仓数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|---------|-------|-------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | PZHY | 品种合约代码 | C | 30 | N | | |
| 4 | MMFXDM | 买卖方向代码 | C | 1 | N | DIM06 | |
| 5 | TJTBBZ | 投机套保标志 | C | 1 | N | DIM07 | |
| 6 | CCSL | 持仓数量 | N | 10 | N | | 单位：手 |
| 7 | KCJ | 开仓价 | N | (20, 3) | N | | |
| 8 | JYBZJ | 交易保证金 | N | (20, 3) | N | | |
| 9 | ZRCCYK | 持仓盈亏(逐日盯市) | N | (20, 3) | N | | |
| 10 | ZBCCYK | 持仓盈亏(逐笔对冲) | N | (20, 3) | N | | |
| 11 | CCJJ | 持仓均价 | N | (20, 3) | N | | |
| 12 | ZJSJ | 昨结算价 | N | (20, 3) | N | | |
| 13 | JJSJ | 今结算价 | N | (20, 3) | N | | |
| 14 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 该笔持仓对应交易所的客户交易编码。 |
| 15 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | |
| 16 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

5.2.2 投资者期权持仓数据

期权持仓数据内容和格式见表 6，该数据内容为期货市场各类投资者交易、强平、期转现、期权行权等行为产生的期权持仓结果。

表 6 期权持仓数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|------|-------|------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | PZHY | 品种合约代码 | C | 30 | N | | 商品期权合约代码，如：“M1311-C-2900”；股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”。 |

表6 期权持仓数据的数据内容和格式(续)

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|--------|------------|------|---------|-------|-------|--|
| 4 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 商品期权：该笔持仓对应期货交易所的客户交易编码；股票期权：该笔持仓对应证券交易所的衍生品合约账号（即客户证券账户+888）。 |
| 5 | MMFXDM | 买卖方向代码 | C | 1 | N | DIM06 | |
| 6 | TJTBBZ | 投机套保标志 | C | 1 | Y | DIM07 | 股票期权业务下，此字段为空。 |
| 7 | CCSL | 持仓数量 | N | 10 | N | | 商品期权以“手”为单位；股票期权以“张”为单位。 |
| 8 | JYBZJ | 交易保证金 | N | (20, 3) | N | | 商品期权：期权卖方交易保证金额；股票期权：期权卖方应交维持保证金金额。 |
| 9 | ZRCCYK | 持仓盈亏(逐日盯市) | N | (20, 3) | N | | |
| 10 | ZBCCYK | 持仓盈亏(逐笔对冲) | N | (20, 3) | N | | |
| 11 | CCJJ | 持仓均价 | N | (20, 3) | N | | |
| 12 | ZJSJ | 昨结算价 | N | (20, 3) | N | | |
| 13 | JJSJ | 今结算价 | N | (20, 3) | N | | |
| 14 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | |
| 15 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据GB/T 12406—2008确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |
| 16 | QQLXDM | 期权类型代码 | C | 1 | N | DIM08 | |
| 17 | ZXJ | 执行价 | N | (20, 7) | N | | |
| 18 | BDPZ | 标的品种 | C | 2 | N | | 商品期权：大写英文字母表示；股票期权：标的证券代码。 |
| 19 | BDHY | 标的合约 | C | 30 | N | | |
| 20 | BDBZ | 备兑标志 | C | 1 | N | DIM14 | 投资者进行期权交易时是否是备兑开仓。 |

5.2.3 投资者现货持仓数据

现货持仓数据内容和格式见表7，该数据内容为期货市场各类投资者备兑开仓以及行权相关的证券现货业务产生的持仓结果。

表7 现货持仓数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------|-------|------|------|-------|------|----------------|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |

表7 现货持仓数据的数据内容和格式（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|----------|----------------|------|--------|-------|-------|-------------------------|
| 2 | XHNBZJZH | 客户证券现货内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行现货交易的资金账户。 |
| 3 | ZQZHBM | 客户证券账户编码 | C | 13 | N | | |
| 4 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | |
| 5 | ZJDM | 证券代码 | C | 6 | N | | |
| 6 | ZJZWMC | 证券的中文简称 | C | 30 | N | | |
| 7 | ZQLBDM | 证券类别代码 | C | 2 | N | DIM09 | |
| 8 | LTLXDM | 流通类型代码 | C | 1 | N | DIM10 | |
| 9 | QYLXDM | 权益类别代码 | C | 2 | N | DIM11 | |
| 10 | GPNF | 挂牌年份 | C | 4 | N | | |
| 11 | DRCL | 当日持仓量 | N | 16 | N | | 全部持有证券的数量，单位：股。 |
| 12 | CCKYL | 持仓可用量 | N | 16 | N | | 当日持仓量中，未被冻结的证券的数量。 |
| 13 | CCCBJ | 持仓成本价 | N | (20,3) | N | | 证券现货持仓成本 |
| 14 | CCZXJ | 持仓最新价 | N | (20,3) | N | | |
| 15 | CCFDYK | 持仓浮动盈亏 | N | (20,3) | N | | |
| 16 | SZ | 市值 | N | (20,3) | N | | 所持股票按最新价计算的市值。 |

5.3 交割业务数据

5.3.1 待交割数据

待交割数据内容和格式见表8，该数据内容为进入交割月后，有交割意向的期货市场机构投资者准备交割的持仓数据信息。

表8 待交割数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|--------|-------|-------|---------------------------|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | Y | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 该笔待交割持仓对应交易所的客户交易编码。 |
| 4 | PZHY | 品种合约代码 | C | 30 | N | | |
| 5 | MMFXDM | 买卖方向代码 | C | 1 | N | DIM06 | |
| 6 | DJYCCL | 待交割持仓量 | N | 10 | N | | 进入交割月，准备进行交割的持仓量，单位：手。 |
| 7 | JGBZJ | 交割保证金 | N | (20,3) | N | | 单位：元 |

表 8 待交割数据的数据内容和格式（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|--------|--------|------|---------|-------|-------|--|
| 8 | KCJ | 开仓价 | N | (20, 3) | Y | | |
| 9 | JGJSJ | 交割结算价 | N | (20, 3) | N | | |
| 10 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | |
| 11 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

5.3.2 交割数据

交割数据内容和格式见表 9，该数据内容为期货市场机构投资者的交割行为产生的数据信息。

表 9 交割数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|---------|-------|-------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | Y | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 该笔交割对应交易所的客户交易编码。 |
| 4 | PZHY | 品种合约代码 | C | 30 | N | | 交割合约号 |
| 5 | MMFXDM | 买卖方向代码 | C | 1 | N | DIM06 | |
| 6 | CJJJ | 成交均价 | N | (20, 3) | N | | 分客户分品种合约分买卖的开仓成交均价。 |
| 7 | CJJE | 成交金额 | N | (20, 3) | N | | 总额 |
| 8 | JGJSJ | 交割结算价 | N | (20, 3) | N | | |
| 9 | JGHK | 交割货款 | N | (20, 3) | N | | |
| 10 | JGSS | 交割手数 | N | 10 | N | | |
| 11 | JGSXF | 交割手续费 | N | (20, 3) | N | | |
| 12 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

5.4 结算业务资金数据

5.4.1 投资者期货期权账户资金数据

期货期权账户资金数据内容和格式见表10，该数据内容用于描述期货市场投资者的期货期权资金信息。

表 10 期货期权账户资金数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|-------------|------|--------|-------|------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | ZJQYZE | 资金权益总额 | N | (20,3) | N | | 当日客户（或交易会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构）权益。 |
| 4 | KYZJ | 可用资金 | N | (20,3) | N | | 逐日盯市下计算得出的可用资金，此外，在逐笔对冲下，将浮动盈亏算入可用资金后，其额度应该等同于在逐日盯市下计算得出的可用资金。 |
| 5 | ZJBZJ | 追加保证金 | N | (20,3) | Y | | |
| 6 | FXD | 风险度 | N | (20,3) | Y | | 去掉百分号，如 46 表示 46%。 |
| 7 | ZRSRJC | 上日结存（逐日盯市） | N | (20,3) | N | | |
| 8 | ZBSRJC | 上日结存（逐笔对冲） | N | (20,3) | Y | | |
| 9 | ZRDRJC | 当日结存（逐日盯市） | N | (20,3) | N | | |
| 10 | ZBDRJC | 当日结存（逐笔对冲） | N | (20,3) | Y | | |
| 11 | ZRDRZYK | 当日总盈亏（逐日盯市） | N | (20,3) | N | | 逐日盯市下的当日总盈亏 |
| 12 | ZBDRZYK | 当日总盈亏（逐笔对冲） | N | (20,3) | Y | | 逐笔对冲下的平仓盈亏 |
| 13 | ZBFDYK | 浮动盈亏（逐笔对冲） | N | (20,3) | Y | | 逐笔对冲方式计算的浮动盈亏 |
| 14 | FHBCDJE | 非货币充抵金额 | N | (20,3) | N | | 仓单等有价值证券充抵额度，不含其它货币充抵金额部分。 |
| 15 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |
| 16 | SYRMBZJ | 实有人民币资金 | N | (20,3) | N | | 人民币实有货币资金余额，不含非货币充抵金额和货币充抵金额。 |
| 17 | HBCDJE | 货币充抵金额 | N | (20,3) | N | | 当日其他货币余额的充抵金额，以美元充抵人民币为例，此项为当日美元余额充抵为人民币的金额。无币种间充抵业务的客户该字段值为零。 |

表 10 期货期权账户资金数据的数据内容和格式（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|-----------|-----------|------|---------|-------|------|--------------------------------------|
| 18 | QTHBZCJE | 其它货币质出金额 | N | (20, 3) | Y | | 原油期货暂无此业务，此字段值为零。 |
| 19 | HBZYBZJZY | 货币质押保证金占用 | N | (20, 3) | Y | | 原油期货暂无此业务，此字段值为零。 |
| 20 | DRZQLJ | 当日总权利金 | N | (20, 3) | Y | | 期权业务(含股票期权业务)的当日权利金收支余额，无期权业务的该字段为零。 |
| 21 | DJZJ | 冻结资金 | N | (20, 3) | Y | | 针对股票期权业务增加此字段，即有冻结资金款项产生时，填写此字段。 |

5.4.2 投资者现货账户资金数据

现货账户资金数据内容和格式见表 11，该接口数据用于描述期货市场投资者的现货资金信息。

表 11 投资者现货账户资金数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|----------|----------------|------|---------|-------|------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | XHNBZJZH | 客户证券现货内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 期货公司开展与股票期权备兑开仓以及行权相关证券经纪业务时，为客户单独开立的证券现货资金账户。 |
| 3 | DRZJYE | 当日资金账户余额 | N | (20, 3) | N | | 证券现货账户内，未被占用的可用资金总额以及冻结资金等全部资金金额合计。 |
| 4 | DRKYZJ | 当日可用资金 | N | (20, 3) | N | | 证券现货账户内当日可用资金余额，可用资金余额为负，表示客户资金不足。 |
| 5 | BQJEHJ | 买券金额合计 | N | (20, 3) | N | | 当日客户证券账户内，用于买券的资金合计，以正数表示。 |
| 6 | SQJEHJ | 卖券金额合计 | N | (20, 3) | N | | 当日客户证券现货账户内，卖券所得资金合计，以正数表示。 |
| 7 | CJHJ | 出金合计 | N | (20, 3) | N | | 当日客户证券现货账户内的出金合计，以负数表示。 |
| 8 | RJHJ | 入金合计 | N | (20, 3) | N | | 当日客户证券现货账户内的入金合计，以正数表示。 |
| 9 | SRZJJE | 上日资金账户余额 | N | (20, 3) | N | | 客户证券现货账户内上日资金余额。 |

表 11 投资者现货账户资金数据的数据内容和格式（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------|-------|------|---------|-------|------|--------------------------------------|
| 10 | GPSZ | 股票市值 | N | (20, 3) | N | | 客户所持股票现货的市值。 |
| 11 | ZZC | 总资产 | N | (20, 3) | N | | 总资产=股票市值+当日资金账户余额 |
| 12 | YHS | 印花税 | N | (20, 3) | N | | |
| 13 | JSF | 经手费 | N | (20, 3) | N | | |
| 14 | GHF | 过户费 | N | (20, 3) | N | | |
| 15 | ZGF | 证管费 | N | (20, 3) | N | | |
| 16 | SXF | 手续费 | N | (20, 3) | N | | |
| 17 | QTFY | 其他费用 | N | (20, 3) | N | | |
| 18 | LX | 利息 | N | (20, 3) | N | | |
| 19 | SJSF | 实际收付 | N | (20, 3) | N | | 实际收付为正数时以正数表示，实际支付为负数时，以负数表示。 |
| 20 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据GB/T 12406—2008确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

5.4.3 投资者其他分项资金数据

其他分项资金数据内容和格式见表 12，该数据内容适用于描述期货市场投资者的其他资金信息。

表 12 投资者其他分项资金数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|---------|-------|-------|---|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | N | DIM02 | 如果资金项目为交易手续费 A001，结算手续费 A017 时，资金金额取客户在所有交易所的资金合计数，该交易所标识字段可以为空。其余资金项目必须分交易所填写，不能为空，S：上期所；Z：郑商所；D：大商所；J：中金所；N：上海能源交易中心；H：上海证券交易所；P：深圳证券交易所。 |
| 4 | ZJXMBH | 资金项目编号 | C | 4 | N | DIM13 | 用于说明期货公司调整资金项目的理由。 |
| 5 | ZJJE | 资金金额 | N | (20, 3) | N | | +表示客户收入，-表示支出。 |

表 12 投资者其他分项资金数据的数据内容和格式（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------|-------|------|------|-------|------|--|
| 6 | MEMO | 备注 | C | 100 | Y | | 用于说明期货公司调整资金项目的理由。 |
| 7 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | N | | 该笔分项资金对应期货交易所的客户交易编码和证券交易所的客户证券账户及衍生品合约账户。 |
| 8 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

5.5 充抵业务数据

5.5.1 货币充抵明细数据

货币充抵明细数据内容和格式见表 13，该数据内容用于描述期货市场投资者进行货币充抵行为产生的数据信息。

表 13 货币充抵明细数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|---------|-------|------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | YBZDM | 原币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |
| 4 | YBZYE | 原币种余额 | N | (20, 3) | N | | |
| 5 | CDMBZDM | 充抵目标币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |
| 6 | CDJE | 充抵金额 | N | (20, 3) | N | | |
| 7 | CDHL | 充抵汇率 | N | (16, 8) | N | | |
| 8 | CDZKL | 充抵折扣率 | N | (16, 8) | N | | |
| 9 | MEMO | 备注 | C | 100 | Y | | |

5.5.2 非货币充抵明细数据

非货币充抵明细数据内容和格式见表 14，该数据内容用于描述期货市场投资者进行非货币充抵行为产生的数据信息。

表 14 非货币充抵明细数据的数据内容和格式

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 是否可为空 | 代码取值 | 说明 |
|----|------------|------------|------|---------|-------|------|--|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | N | | 格式为：YYYY-MM-DD |
| 2 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | N | | 投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。 |
| 3 | CDPMC | 充抵品名称 | C | 6 | N | | |
| 4 | CDSS | 充抵手数 | N | 10 | N | | |
| 5 | CDJG | 充抵价格 | N | (20, 3) | N | | 仓单填各品种对应标准单位的折后价格。 |
| 6 | CDJE | 充抵金额 | N | (20, 3) | N | | 充入为正，充出为负。 |
| 7 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | N | | 根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。 |

附 录 A
(规范性附录)
数据字典

数据字典内容见表A.1。

表 A.1 数据字典

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 代码取值 |
|----|-------------|------------------|------|------|-------|
| 1 | RQ | 日期 | date | 10 | |
| 2 | KHLXDM | 客户类型代码 | C | 1 | DIM01 |
| 3 | KHMC | 客户名称 | C | 400 | |
| 4 | SFZ | 身份证号码 | C | 50 | |
| 5 | TZZXL | 投资者学历 | C | 2 | |
| 6 | JYCSDM | 交易场所代码 | C | 2 | DIM02 |
| 7 | JYBM | 交易编码 | C | 13 | |
| 8 | KHNBZJZHBM | 客户内部资金账户编码 | C | 18 | |
| 9 | SZD | 所在地 | C | 100 | |
| 10 | TXDZ | 通讯地址 | C | 200 | |
| 11 | YZBM | 邮政编码 | C | 6 | |
| 12 | LXDH | 联系电话 | C | 40 | |
| 13 | JYSZDQDM | 交易所在地区代码 | A | 4 | |
| 14 | KHHXHBZ | 开户和销户标志 | C | 1 | DIM03 |
| 15 | KHRQ | 客户期货期权内部资金账户开户日期 | C | 10 | |
| 16 | ZZJGDM | 组织机构代码 | C | 40 | |
| 17 | YYZZH | 营业执照号码 | C | 40 | |
| 18 | TYSHXYDM | 统一社会信用代码 | C | 18 | |
| 19 | KHDLRMC | 开户代理人名称 | C | 100 | |
| 20 | KHDLRSFZ | 开户代理人身份证号码 | C | 50 | |
| 21 | ZHZTDM | 账户状态代码 | C | 1 | DIM04 |
| 22 | JWKHBZ | 境外客户标志 | C | 1 | DIM05 |
| 23 | GJDQDM | 国籍地区代码 | C | 10 | |
| 24 | JWGRKHZJHM | 境外个人客户证件号码 | C | 50 | |
| 25 | SYDJZHM | 商业登记证号码 | C | 50 | |
| 26 | JWZJJGBZ | 境外中介机构标志 | C | 1 | DIM16 |
| 27 | JWZJJGBH | 境外中介机构编号 | C | 10 | |
| 28 | XHNBZJZH | 客户证券现货内部资金账户编码 | C | 18 | |
| 29 | XHNBZJZHHRQ | 客户证券现货内部资金账户开户日期 | date | 10 | |

表 A.1 数据字典（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 代码取值 |
|----|-----------|------------|------|---------|-------|
| 30 | YHBM | 银行编码 | C | 2 | DIM15 |
| 31 | YHZH | 银行账户编码 | C | 22 | |
| 32 | JSZHBGBZ | 结算账户变更标志 | C | 1 | DIM12 |
| 33 | YHZHKHRXM | 银行账户开户人姓名 | C | 400 | |
| 34 | KHH | 银行账户的开户行名称 | C | 400 | |
| 35 | BZDM | 币种代码 | C | 3 | |
| 36 | PZHY | 品种合约代码 | C | 30 | |
| 37 | MMFXDM | 买卖方向代码 | C | 1 | DIM06 |
| 38 | TJTBBZ | 投机套保标志 | C | 1 | DIM07 |
| 39 | CCSL | 持仓数量 | N | 10 | |
| 40 | ZRCCYK | 持仓盈亏(逐日盯市) | N | (20, 3) | |
| 41 | ZBCCYK | 持仓盈亏(逐笔对冲) | N | (20, 3) | |
| 42 | CCJJ | 持仓均价 | N | (20, 3) | |
| 43 | ZJSJ | 昨结算价 | N | (20, 3) | |
| 44 | JJSJ | 今结算价 | N | (20, 3) | |
| 45 | QQLXDM | 期权类型代码 | C | 1 | DIM08 |
| 46 | ZXJ | 执行价 | N | (20, 7) | |
| 47 | BDPZ | 标的品种 | C | 2 | |
| 48 | BDHY | 标的合约 | C | 30 | |
| 49 | BDBZ | 备兑标志 | C | 1 | DIM14 |
| 50 | ZQZHBM | 客户证券账户编码 | C | 13 | |
| 51 | ZJDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 52 | ZJZWC | 证券的中文简称 | C | 30 | |
| 53 | ZQLBDM | 证券类别代码 | C | 2 | DIM09 |
| 54 | LTLXDM | 流通类型代码 | C | 1 | DIM10 |
| 55 | QYLXDM | 权益类别代码 | C | 2 | DIM11 |
| 56 | GPNF | 挂牌年份 | C | 4 | |
| 57 | DRCCCL | 当日持仓量 | N | 16 | |
| 58 | CCKYL | 持仓可用量 | N | 16 | |
| 59 | CCCBJ | 持仓成本价 | N | (20, 3) | |
| 60 | CCZXJ | 持仓最新价 | N | (20, 3) | |
| 61 | CCFDYK | 持仓浮动盈亏 | N | (20, 3) | |
| 62 | SZ | 市值 | N | (20, 3) | |
| 63 | DJYCCL | 待交割持仓量 | N | 10 | |
| 64 | KCJ | 开仓价 | N | (20, 3) | |
| 65 | JGJSJ | 交割结算价 | N | (20, 3) | |
| 66 | CJJJ | 成交均价 | N | (20, 3) | |
| 67 | CJJE | 成交金额 | N | (20, 3) | |

表 A.1 数据字典（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 代码取值 |
|-----|-----------|-------------|------|---------|------|
| 68 | JGSS | 交割手数 | N | 10 | |
| 69 | JGSXF | 交割手续费 | N | (20, 3) | |
| 70 | ZJQYZE | 资金权益总额 | N | (20, 3) | |
| 71 | KYZJ | 可用资金 | N | (20, 3) | |
| 72 | ZJBZJ | 追加保证金 | N | (20, 3) | |
| 73 | FXD | 风险度 | N | (20, 3) | |
| 74 | ZRSRJC | 上日结存（逐日盯市） | N | (20, 3) | |
| 75 | ZBSRJC | 上日结存（逐笔对冲） | N | (20, 3) | |
| 76 | ZRDRJC | 当日结存（逐日盯市） | N | (20, 3) | |
| 77 | ZBDRJC | 当日结存（逐笔对冲） | N | (20, 3) | |
| 78 | ZRDRZYK | 当日总盈亏（逐日盯市） | N | (20, 3) | |
| 79 | ZBDRZYK | 当日总盈亏（逐笔对冲） | N | (20, 3) | |
| 80 | ZBFDYK | 浮动盈亏（逐笔对冲） | N | (20, 3) | |
| 81 | SYRMBZJ | 实有人民币资金 | N | (20, 3) | |
| 82 | HBCDJE | 货币充抵金额 | N | (20, 3) | |
| 83 | QTHBZCJE | 其它货币质出金额 | N | (20, 3) | |
| 84 | HBZYBZJZY | 货币质押保证金占用 | N | (20, 3) | |
| 85 | DRZQLJ | 当日总权利金 | N | (20, 3) | |
| 86 | DJZJ | 冻结资金 | N | (20, 3) | |
| 87 | JYBZJ | 交易保证金 | N | (20, 3) | |
| 88 | JGBZJ | 交割保证金 | N | (20, 3) | |
| 89 | FHBCDJE | 非货币充抵金额 | N | (20, 3) | |
| 90 | JGHK | 交割货款 | N | (20, 3) | |
| 91 | DRZJYE | 当日资金账户余额 | N | (20, 3) | |
| 92 | DRKYZJ | 当日可用资金 | N | (20, 3) | |
| 93 | BQJEHJ | 买券金额合计 | N | (20, 3) | |
| 94 | SQJEHJ | 卖券金额合计 | N | (20, 3) | |
| 95 | CJHJ | 出金合计 | N | (20, 3) | |
| 96 | RJHJ | 入金合计 | N | (20, 3) | |
| 97 | SRZJJE | 上日资金账户余额 | N | (20, 3) | |
| 98 | GPSZ | 股票市值 | N | (20, 3) | |
| 99 | ZZC | 总资产 | N | (20, 3) | |
| 100 | YHS | 印花税 | N | (20, 3) | |
| 101 | JSF | 经手费 | N | (20, 3) | |
| 102 | GHF | 过户费 | N | (20, 3) | |
| 103 | ZGF | 证管费 | N | (20, 3) | |
| 104 | SXF | 手续费 | N | (20, 3) | |
| 105 | QTFY | 其他费用 | N | (20, 3) | |

表 A.1 数据字典（续）

| 序号 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 字段长度 | 代码取值 |
|-----|----------------------|----------------------|------|---------|-------|
| 106 | LX | 利息 | N | (20, 3) | |
| 107 | SJSF | 实际收付 | N | (20, 3) | |
| 108 | ZJXMBH | 资金项目编号 | C | 4 | DIM13 |
| 109 | ZJJE | 资金金额 | N | (20, 3) | |
| 110 | MEMO | 备注 | C | 100 | |
| 111 | YBZDM | 原币种代码 | C | 3 | |
| 112 | YBZYE | 原币种余额 | N | (20, 3) | |
| 113 | CDMBBZDM | 充抵目标币种代码 | C | 3 | |
| 114 | CDJE | 充抵金额 | N | (20, 3) | |
| 115 | CDHL | 充抵汇率 | N | (16, 8) | |
| 116 | CDZKL | 充抵折扣率 | N | (16, 8) | |
| 117 | CDPMC | 充抵品名称 | C | 6 | |
| 118 | CDSS | 充抵手数 | N | 10 | |
| 119 | CDJG | 充抵价格 | N | (20, 3) | |
| 120 | JWTSCYZYJWZJ JGBS | 境外特殊参与者与境外中 介机构标识 | C | 1 | DIM17 |

附 录 B
(规范性附录)
代码取值及描述

B.1 客户类型代码

客户类型代码取值内容见表B.1。

表 B.1 客户类型代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|-----------------|
| 客户类型代码/DIM01 | 0 | 自然人 |
| | 1 | 一般法人 |
| | 2 | 特殊法人 |
| | 3 | 单一客户纯期货资产管理计划 |
| | 4 | 单一客户综合类资产管理计划 |
| | 5 | 特定多个客户纯期货资产管理计划 |
| | 6 | 特定多个客户综合类资产管理计划 |
| | 9 | 其它 |

B.2 交易场所代码

交易场所代码取值内容见表B.2。

表 B.2 交易场所代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|----------|
| 交易场所代码/DIM02 | S | 上期所 |
| | Z | 郑商所 |
| | D | 大商所 |
| | J | 中金所 |
| | N | 上海能源交易中心 |
| | H | 上海证券交易所 |
| | P | 深圳证券交易所 |

B.3 开户和销户标志

开户和销户标志代码取值内容见表B.3。

表 B.3 开户和销户标志代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|---------------|--------|---------|
| 开户和销户标志/DIM03 | a | 已开户的客户 |
| | d | 当日销户的客户 |

B.4 账户状态代码

账户状态代码取值内容见表B.4。

表 B.4 账户状态代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|--------|
| 账户状态代码/DIM04 | a | 活跃账户 |
| | d | 休眠账户 |

B.5 境外客户标志

境外客户标志代码取值内容见表B.5。

表 B.5 境外客户标志代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|-----------|
| 境外客户标志/DIM05 | 1 | 国内客户 |
| | 2 | 港澳台客户 |
| | 3 | 国外客户 |
| | 4 | 在中国永久居留客户 |

B.6 买卖方向代码

买卖方向代码取值内容见表B.6。

表 B.6 买卖方向代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|--------|
| 买卖方向代码/DIM06 | B | 买 |
| | S | 卖 |

B.7 投机套保标志

投机套保标志代码取值内容见表B.7。

表 B.7 投机套保标志代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|--------|
| 投机套保标志/DIM07 | S | 投机 |

表 B.7 投机套保标志代码取值（续）

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|--------|
| 投机套保标志/DIM07 | H | 套保 |
| | A | 套利 |

B.8 期权类型代码

期权类型代码取值内容见表B.8。

表 B.8 期权类型代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|--------|
| 期权类型代码/DIM08 | C | 看涨期权 |
| | P | 看跌期权 |

B.9 证券类别代码

证券类别代码取值内容见表B.9。

表 B.9 证券类别代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|-----------------|
| 证券类别代码/DIM09 | 01 | 普通股票 |
| | 02 | 配股 |
| | 03 | 配售股 |
| | 04 | 标准(普通)投资基金/共同基金 |
| | 05 | 交易型开放式指数基金(ETF) |
| | 06 | 普通债券 |
| | 07 | 股票质押式回购 |
| | 08 | 债券质押式回购/协议回购 |
| | 09 | 约定购回 |
| | 10 | 融资融券 |
| | 11 | 期货 |
| | 12 | 期权 |
| | 13 | 权证 |
| | 14 | 资产支持债券 |
| | 15 | 其他 |

B.10 流通类型代码

流通类型代码取值内容见表B.10。

表 B.10 流通类型代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|----------|
| 流通类型代码/DIM10 | 0 | 无限售条件流通股 |
| | N | 非流通 |

B.11 权益类别代码

权益类别代码取值内容见表B.11。

表 B.11 权益类别代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|--------|
| 权益类别代码/DIM11 | DF | 兑付 |
| | DX | 兑息 |
| | HL | 红利 |
| | PG | 配股 |
| | SG | 送股 |
| | ZP | 转配 |

B.12 结算账户变更标志

结算账户变更标志代码取值内容见表B.12。

表 B.12 结算账户变更标志代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|----------------|--------|--------|
| 结算账户变更标志/DIM12 | a | 现有 |
| | d | 废除 |

B.13 资金项目编号

资金项目编号代码取值内容见表B.13。

表 B.13 资金项目编号代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|--------|---------------------------------|
| 资金项目编号/DIM13 | A000 | 客户总盈亏(持仓盈亏+平仓盈亏+交割配对盈亏+行权盈亏) |
| | A001 | 交易手续费(含股票期权业务的“清算经手费”和“权利金结算费”) |
| 资金项目编号/DIM13 | A002 | 交割货款(含股票期权业务的“清算行权交收资金”) |
| | A003 | 交割手续费(含股票期权业务的“清算行权过户费”) |

表 B.13 资金项目编号代码取值(续)

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|--------------|-----------|--|
| 资金项目编号/DIM13 | A004 | 非货币充抵变动额(今日非货币充抵余额-上日非货币充抵余额) 证券充抵保证金业务开展后, 证券充抵保证金的变动额也利用此字段填报。 |
| | A005 | 非货币充抵手续费 |
| | A006 | 期转现手续费 |
| | A007 | 仓储费/仓租费 |
| | A008 | 交割配对盈亏(逐日盯市) |
| | A009 | 仓单升贴水 |
| | A010 | 仓单转让手续费 |
| | A011 | 交割定金/定金 |
| | A012 | 定金罚没 |
| | A013 | 交割违约罚款 |
| | A014 | 仓单抵押手续费 |
| | A015 | 强平盈利罚没 |
| | A016 | 冻结款 |
| | A017 | 结算手续费 |
| | A018 | 仓单转让货款 |
| | A019 | 卖方交割保证金 |
| | A020 | 买方交割补偿金 |
| | A021 | 卖方交割补偿金 |
| | A022 | 过户费(国债) |
| | A023 | 转托管费 |
| | A024 | 行权手续费(含股票期权业务的“清算行权结算费”) |
| | A026 | 货币充抵变动额(今日货币充抵余额-上日货币充抵余额) |
| | A027 | 资产管理业绩报酬或管理费 |
| | A030 | 中金所申报费 |
| | A031 | 手续费返还 |
| | A032 | 利息 |
| A999 | 其他与客户有关资金 | |

B.14 备兑标志

备兑标志代码取值内容见表B.14。

表 B.14 备兑标志代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|------------|--------|--------|
| 备兑标志/DIM14 | 1 | 备兑 |
| | 2 | 非备兑 |

B.15 银行编码

银行编码代码取值内容见表B.15。

表 B.15 银行编码代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|------------|--------|--------|
| 银行编码/DIM15 | 01 | 工商银行 |
| | 02 | 农业银行 |
| | 03 | 中国银行 |
| | 04 | 建设银行 |
| | 05 | 交通银行 |
| | 06 | 浦发银行 |
| | 07 | 兴业银行 |
| | 08 | 汇丰银行 |
| | 09 | 光大银行 |
| | 10 | 招商银行 |
| | 11 | 中信银行 |
| | 12 | 民生银行 |
| | 13 | 广发银行 |
| | 14 | 花旗银行 |
| | 15 | 平安银行 |
| | 16 | 邮储银行 |
| | 17 | 渣打银行 |
| | 18 | 农业发展银行 |
| | 99 | 其他银行 |

B.16 境外中介机构标志

境外中介机构标志代码取值内容见表B.16。

表 B.16 境外中介机构标志代码取值

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|----------------|--------|---------|
| 境外中介机构标志/DIM16 | 0 | 境外中介机构 |
| | 1 | 非境外中介机构 |

B.17 境外特殊参与者与境外中介机构

境外特殊参与者与境外中介机构标识表B.17。

表 B.17 境外特殊参与者与境外中介机构标识

| 中文名称/代码 | 代码取值编码 | 代码取值描述 |
|----------------------------|--------|------------|
| 境外特殊参与者与境外中介机构标识 /DIM17 | 0 | 境外特殊经纪参与者 |
| | 1 | 境外特殊非经纪参与者 |
| | 2 | 境外中介机构 |

参 考 文 献

- [1] 上海期货交易所. 上海期货交易所交易细则[Z]. 2016-12-12
 - [2] 中华人民共和国国务院. 期货交易管理条例[Z]. 2012-10-24
-