收益凭证电子化接口信息报送常见问题解答（一）

2023年10月

中证报价-监测业务三部

收益凭证电子化接口信息报送常见问题解答（一）

**一、接口相关问题**

**（一）收益凭证发行情况报送**

1. Q：《收益凭证基础产品信息与发行情况》中“单客户持有上限金额”字段如何填报？

A：“单客户持有上限金额”应小于等于“产品规模上限”，并与产品说明书相应字段保持一致，未设定上限的，该字段与产品规模上限保持一致。单位为元，保留小数点后两位数。

1. Q：证券公司收益凭证在发行备案时是否需要同时报送《收益凭证发行情况报送》和《收益凭证存续期业务情况报送》？

A：证券公司收益凭证在发行备案时需要报送《收益凭证发行情况报送》；若发生存续期业务变动，则需报送《收益凭证存续期业务情况报送》，若无，则暂时无需报送。

1. Q：若发行的收益凭证募集失败，是否还需要报送相关信息？

A：不需要报送。

1. 《收益凭证基础产品信息与发行情况》中“挂钩标的名称”字段关于公共代码方面有什么填报要求？

A：根据《收益凭证业务数据报送文件接口规范（试行）（以下简称《接口规范》），若收益凭证挂钩标的有公共代码，“挂钩标的名称”字段需要在填写挂钩标的全称后同时标识挂钩标的代码，二者之间用西文括号分隔，例如“中证500指数(000905.SH)”。若收益凭证挂钩标的无公共代码，则只填写挂钩标的全称，例如“中债国债到期收益率”。

1. Q：《收益凭证基础产品信息与发行情况》中证券公司在填报 “期权执行价格系数”、“敲出观察期间的敲出价格系数”和“敲入观察期间的敲入价格系数”三个字段时是否需要加“%”？

A：以上三个字段在报送时需要加“%”。

1. Q：投资者为“员工持股计划”时，《收益凭证产品投资者持有份额明细表》中“投资者类型”、“投资者证件号码”及“投资者子类”三个字段应当如何填报？

A：“投资者类型”应填报“02:机构”，“投资者证件号码”应填报“05：统一社会信用代码营业执照”，“投资者子类”应填“99：其他产品”。

1. Q：《收益凭证产品投资者变动明细表》中的“交易金额”字段是否为实际成交金额？

A：“交易金额”字段应为实际成交金额。

1. Q：《收益凭证基础产品信息与发行情况》中，若”敲入或敲出观察分布情况”字段为“连续观察”，但收益凭证设置了多个不同的价格系数或收益率，应当如何填报？

A：根据《接口规范》，应当按照“离散观察”的口径填报。“离散观察”的填报口径为：每一个“敲出观察日”应分别对应一个“敲出观察期间的敲出价格系数”、一个“敲出观察期间的敲出收益率（%）”和一个“敲出方向”； 每一个“敲入观察日”应分别对应一个“敲入观察期间的敲入价格系数”和一个“敲入方向”。

1. Q：《收益凭证基础产品信息与发行情况》中，“挂钩标的类型”字段与“挂钩标的小类”字段之间是否有对应关系?对应关系具体是什么？

A：“挂钩标的类型”字段与“挂钩标的小类”两个字段之间有对应关系，具体对应关系如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **7-1 挂钩标的类型** | **7-2 挂钩标的小类** | **7-5 挂钩标的交易场所名称（示例）** | **备注** |
| 权益类 | 境内股票 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 　 |
| 境内股指 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 　 |
| 新三板挂牌股票 | 全国中小企业股份转让系统 | 　 |
| 香港股票 | 香港联合交易所 | 　 |
| 香港股指 | 香港联合交易所 | 　 |
| 基金及基金专户 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 　 |
| 境外股票 | 境外交易所名称（示例：纽约证券交易所） | 　 |
| 境外股指 | 境外交易所名称（示例：纽约证券交易所） | 　 |
| 境内股指期货 | 中国金融期货交易所 | 　 |
| 境外股指期货 | 境外交易所名称（示例：纽约证券交易所） | 　 |
| 境内债券 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 可转债 |
| 其他标的 | 交易所名称 | 　 |
| 大宗商品 | 境内黄金期货 | 上海期货交易所 | 　 |
| 境内其他期货 | 大连商品交易所、郑州商品交易所、上海期货交易所、广州商品交易所 | 　 |
| 境内黄金现货 | 上海黄金交易所 | 　 |
| 境内其他现货 | 境内交易所名称 | 　 |
| 境外黄金期货 | 境外交易所名称（示例：纽约证券交易所） | 　 |
| 境外黄金现货 | 境外交易所名称（示例：纽约证券交易所） | 　 |
| 境外其他期货 | 境外交易所名称（示例：芝加哥商品交易所） | 　 |
| 境外其他现货 | 境外交易所名称 | 　 |
| 基金及基金专户 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 黄金及商品期货ETF按商品类报送 |
| 其他标的 | 交易所名称 | 　 |
| 信用类 | 境内债券 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、其他交易所名称 | 信用债 |
| 基金及基金专户 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 除基金合同明确约定可转债（含可交债）投资比例不低于非现金基金资产80%的债券基金以外的其他债券基金 |
| 其他标的 | 交易所名称 | 　 |
| 汇率 | 汇率 | 中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心、其他交易所名称 | 　 |
| 其他标的 | 交易所名称 | 　 |
| 利率 | 利率 | - | 　 |
| 境内国债期货 | 中国金融期货交易所 | 　 |
| 境外国债期货 | 境外交易所名称（示例：纽约证券交易所） | 　 |
| 境内债券 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、其他交易所名称 | 利率债 |
| 基金及基金专户 | 上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所 | 公募基金基金合同明确约定利率债投资比例不低于非现金基金资产80%的债券基金、债券型FOF、同业存单基金 |
| 其他标的 | 交易所名称 | 　 |
| 混合类 | 无限制 | 交易所名称 | 　 |
| 其他 | 无限制 | 交易所名称 | 　 |

特别提示：

（1）若挂钩标的为可转债，“挂钩标的类型”应为权益类，“挂钩标的小类”应为境内债券；

（2）若挂钩标的为信用债，“挂钩标的类型”应为信用类，“挂钩标的小类”应为境内债券；

（3）若挂钩标的为利率债，“挂钩标的类型”应为利率类，“挂钩标的小类”应为境内债券；

（4）若挂钩标的为公募基金，基金合同明确约定利率债投资比例不低于非现金基金资产80%的债券基金、债券型基金中基金 (FOF)、同业存单基金、货币基金按利率类报送，股票基金、偏股混合型基金、股票型基金中基金 (FOF )、偏股混合型基金中基金 (FOF)、基金合同明确约定可转债(含可交债) 投资比例不低于非现金基金资产80%的债券基金、公开募集基础设施基金按权益类报送，其他债券基金按信用类报送，黄金及商品期货ETF按商品类报送，其他混合基金、其他基金中的基金 (FOF) 按其他类报送。

1. Q：《收益凭证产品投资者持有份额明细表》中，证券公司在报送投资者相关信息时，“投资者类型”与“投资者子类”两个字段之间是否有对应关系?对应关系具体是什么？

A：“投资者类型”与“投资者子类”两个字段之间有对应关系，具体对应关系如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **1 投资者类型** | **2 投资者证件类型** | **3投资者子类** |
| 机构 | 统一社会信用代码营业执照或其他(仅针对投资者子类为境外机构、其他) | 证券公司 |
| 基金公司 |
| 期货公司 |
| 基金公司子公司 |
| 期货公司风险管理公司 |
| 商业银行 |
| 保险公司 |
| 保险子公司 |
| 信托公司 |
| 财务公司 |
| 私募基金（应以中国基金业协会备案为准） |
| 其他金融机构 |
| 境内非金融机构（一般工商企业） |
| 境外金融机构 |
| 境外非金融机构 |
| 商业银行子公司 |
| 证券公司资产管理子公司 |
| 证券公司其他子公司 |
| 政策性银行 |
| 外资银行 |
| 期货资产管理公司 |
| 其他产品（后续接口规范修订为“其他”） |
| 个人 | 居民身份证或港澳居民来往内地通行证或台湾居民来往大陆通行证或护照或其他 | 个人 |
| 产品 | 其他 | 公募基金产品 |
| 资产证券化产品 |
| 资产管理计划 |
| 信托计划 |
| 银行理财产品 |
| 基金专户 |
| 私募基金产品 |
| 其他产品（后续接口规范修订为“其他”） |

**（二）收益凭证存续期业务情况报送**

1. Q：若收益凭证只是报送“展期”状态，不涉及存续规模变动，《收益凭证存续期业务变动情况表》中“实际总收益率（年化）（%）”字段是否按“0”报送？

A：若收益凭证已经产生收益，实际总收益率=（产品累计总收益\*365）/（产品发行规模\*存续期限），其中存续期限=当前存续期报告的变动日期-产品存续期起始日+1；若从未产生收益，则“实际总收益率”为0。

1. Q：《收益凭证存续期业务变动情况表》中的“实际总收益率（年化）（%）”字段，在报送时是否需要包含分红的收益部分？

A：答：“实际总收益率（年化）（%）”字段需要包含分红的收益部分。

1. Q：如果投资者发生亏损，《收益凭证存续期业务变动情况表》中“本次利息兑付金额”字段是否填负数？

A：应当填负数。

1. Q：收益凭证发生“到期终止”时，证券公司在报送“产品终止日”时应注意什么？

A：（1）若收益凭证发生“到期终止”时遇到产品说明书约定的不可抗力情形或到期日为非交易日的情形，证券公司应按照实际到期日填写“产品终止日”，并在“备注”字段中说明未按期终止原因。

（2）若收益凭证发生“到期终止”时未遇到前述情形， “最新到日期”字段发生过变化的，“产品终止日”应按照最新一条报送的“最新到日期”报送；“最新到日期”字段未发生过变化的，“产品终止日”应按照“存续期到期日”报送。

1. Q：若收益凭证“展期”和“部分终止”两种状态发生在同一天，《收益凭证存续期业务情况报送》应当如何报送？是否可以合并成一个场景报送？

A：（1）证券公司应当以“变动日期”区分《收益凭证存续期业务情况报送》的报送顺序，“变动日期”字段可精确到时分秒。

（2）收益凭证两种不同状态不可以合并成一个场景报送，需要分别报送，并以“变动日期”区分报送顺序。

1. Q：如果雪球产品触发合同中约定的敲出条款而终止，“收益凭证状态（报送类型）”字段应当报送 “提前终止”还是“到期终止”？

A：上述情形应当报送“提前终止”。

**（三）证券公司月度收益凭证统计数据报送**

1. Q：如何理解《证券公司月度收益凭证统计数据报送》中“转让规模”这一字段？

A：“转让规模”应为统计期间的转让交易规模汇总，是指在《证券公司月度收益凭证统计数据》“数据统计期间-报告年份”“数据统计期间报告月份”的统计期间（例如“2023年”“9月”），收益凭证存续期“报送状态（报送类型）”为“转让”时，报送的“交易类型”为“转入（+）”或“转入（-）”的“交易金额”的汇总。

1. Q：证券公司《月度收益凭证统计数据报送》中的“月初存量本金规模”“新增发行规模” “月末存量本金规模”月度报送规模相关字段是否只报送柜台的统计数据？

A：对于既在柜台发行又在报价系统发行收益凭证的证券公司，需要同时报送柜台和报价系统的月度规模汇总数据。

**二、备案及报送相关问题**

1. Q：若收益凭证发行备案材料使用公司部门章、业务章、合同章等，是否每只收益凭证发行备案材料报送都需要上传授权签章的文件？

A：收益凭证发行备案材料原则上应加盖证券公司公章。证券公司授权使用部门章、业务章、合同章等其他印章的，应当与对应的备案报送服务专员联系，提供公司授权签章的文件（例如授权书、公司制定的印章制度、申请刻制印章的流程证明等）。经备案服务专员确认后，在后续报送的每一笔发行信息报告中上传授权或证明文件。

1. Q：收益凭证发生展期、提前终止等情形并与客户签订补充协议的，在报送存续期变动情况时如何报送补充协议？

A：在发行报送情况中提交补正申请，通过后在发行报送情况附件-其他文件中上传补充协议，报送存续期变动情况时，在“备注”中说明具体情况并注明“在发行报送情况中已上传补充协议”。

1. Q：如何进行补正？

A：（1）在证券公司柜台发行的收益凭证补正流程：

①备案服务专员核查发现存在错报问题

备案服务专员通过场外证券业务报告系统（简称报告库）线上退回→证券公司报告库报告状态为已退回，证券公司就该笔报送信息提交补正申请→备案服务专员对补正申请进行确认→补正申请通过后证券公司报告库报告状态为已同意，证券公司进行补正报文；补正申请不符合要求的，予以退回，证券公司重新提交补正申请。

②证券公司发现存在错报问题

证券公司通过报告库提交补正申请→备案服务专员对补正申请进行确认→补正申请通过后证券公司报告库报告状态为已同意，证券公司进行补正报文；补正申请不符合要求的，予以退回，证券公司重新提交补正申请。

（2）在报价系统发行的收益凭证补正流程：

①备案服务专员核查发现存在错报问题

备案服务专员通过报告库线上退回→证券公司报告库报告状态为已退回，证券公司就该笔报送信息提交补正申请→备案服务专员对补正申请进行确认→补正申请通过后证券公司报告库报告状态为已同意，证券公司通过报价系统进行补正报文；补正申请不符合要求的，予以退回，证券公司重新提交补正申请

②证券公司发现存在错报问题

证券公司通过报告库提交补正申请→备案服务专员对补正申请进行确认→补正申请通过后证券公司报告库报告状态为已同意，证券公司通过报价系统进行补正报文；补正申请不符合要求的，予以退回，证券公司重新提交补正申请。

《场外业务报告库收益凭证模块操作手册》对补正操作进行了详细说明，注意补正申请内容应按如下格式及要求填写：（1）补正事项（原有内容、修改后内容）；（2）补正原因、发现途径；（3）造成的影响（是否对客户或其他方面造成影响）；（4）后续处置措施；（5）说明及证明材料格式为PDF，且不能为空。补正申请不符合要求的会被退回。

1. Q：补正申请中要求提交“说明及证明材料”，是否要求加盖公章？

A：涉及变更收益凭证备案材料或提供证明文件的，需加盖公章，其他不强制要求。如有特殊情形联系备案服务专员。

1. Q：证券公司补正笔数较多，除逐笔补正外是否有其他补正方式？

A：目前报告库暂无批量补正申请功能，需逐笔提交补正申请，具体情况请联系备案服务专员。

1. Q：证券公司进行补正时系统提示“该产品不存在或该报告状态不是已同意”，这种情况应如何处理？

A：首先检查处理的BIZID是否与审核端退回产品的BIZID一致；若一致，检查报送端是否提交了补正申请。

1. Q：审核端处理后，证券公司如何在系统上确认节点在报送端？

A：报告库-收益凭证-发行报送情况/存续变动情况/定期报告-报告状态为“已同意”“已拒绝”“已退回”时，节点在报送端，证券公司可以进行补正操作。

1. Q：收益凭证已到期终止，是否可以补正？

A：收益凭证存续或终止状态均可进行全生命周期补正。

1. Q：证券公司补正是否有时间要求？

A：审核端处理后，证券公司原则上在5个工作日内完成补正。

1. Q：报告库中收益凭证历史数据模块是否仍可以进行补正？

A：不可以。报告库中历史数据模块已于2023年7月1日0点关闭，目前只保留“查看”功能。

**三、用户管理相关问题**

1. Q：证券公司在报告库中“收益凭证”模块下无法查看收益凭证相关信息，这种情形应如何操作？

A：只有合规用户可以查看相关信息，合规用户的设置流程可参考《场外业务报告库收益凭证模块操作手册》。

**四、技术相关问题**

1. Q：报告库中的收益凭证数据是否支持下载功能？

A：目前报告库中的相关数据不支持下载。

1. Q：生产环境下的证券公司代码和准生产环境下证券公司代码是否一致？

A：生产环境和准生产环境下的证券公司代码应当一致。

1. Q：证券公司在报送单个ZIP文件时有什么注意事项？

A：建议单个ZIP文件大小在200M左右，超过会影响传输及报送效率。

1. Q：证券公司在使用电子化接口报送系统报送《收益凭证发行情况报送》和《收益凭证存续期业务情况报送》时，是否需要间隔一段时间？

A：《收益凭证发行情况报送》正常入库后即可报送《收益凭证存续期业务情况报送》，没有特殊的时间间隔。