

**场外证券业务报告系统
文件接口数据报送指引-衍生品业务
(V1.0)**

目录

| | | |
|----------|---------------------|--------------|
| 1 | 概述 | - 3 - |
| 1.1 | 背景 | - 3 - |
| 1.2 | 适用对象 | - 3 - |
| 1.3 | 术语 | - 3 - |
| 2 | 技术对接方案 | - 4 - |
| 2.1 | 系统通讯方案 | - 4 - |
| 2.2 | 文件交互流程 | - 5 - |
| 2.3 | 文件接口格式 | - 5 - |
| 2.4 | 文件处理流程 | - 7 - |
| 2.5 | 结构化文件处理顺序 | - 7 - |
| 2.6 | 应答处理机制 | - 8 - |
| 3 | 业务报送方案 | - 9 - |
| 3.1 | 报送内容 | - 9 - |
| 3.2 | 特殊事项 | - 11 - |

1 概述

1.1 背景

根据证券业协会《证券公司场外期权业务管理办法》（以下简称《期权管理办法》）有关规定，为便于各报送主体根据接口规范进行系统开发，推进接口报送对接工作，特制订本工作指引。

1.2 适用对象

适用于通过电子化接口方式报送场外期权及收益互换业务数据的报送主体。

1.3 术语

场外证券业务报告系统：为场外业务提供交易备案、数据报送等服务的技术系统。

报送主体：具有报送义务的证券基金经营机构。

FDEP：FDEP 文件传输系统是指深证通金融数据交换平台，用于银行、证券公司以及相关金融机构间业务文件交换的系统，其构成要素包括通信网络、交换中枢软硬件、接入客户端等。金融数据交换平台采用标准的 PKI 安全认证体系，提供点到点，端到端的加密认证机制。

页面报送：通过网页的方式登录场外证券业务报告系统，并报送数据，进行业务备案的处理模式。

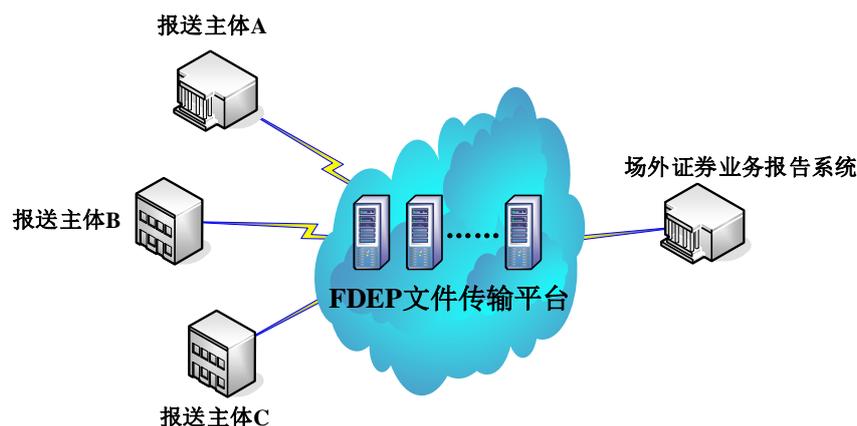
接口报送：按照文件接口规范组织数据文件，包括结构化、非结构文件，将生成的报送文件传输到报告库系统，进行业务备案的处理模式。

2 技术对接方案

场外证券业务报告系统提供衍生品业务数据自动批量报送接口。报送主体根据《场外证券业务报告系统衍生品业务数据报送文件接口规范》要求，上传报送信息文件，执行报送义务。

2.1 系统通讯方案

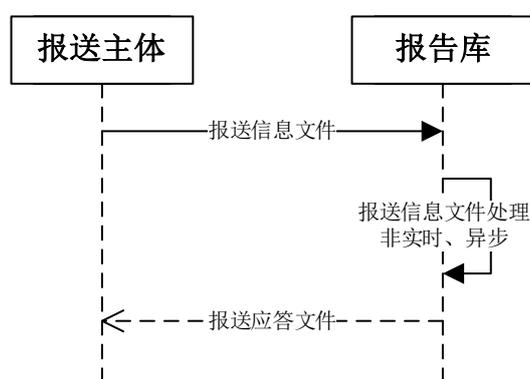
报送主体和场外证券业务报告系统目前选择通过 FDEP 文件传输系统互通，通过非实时文件传输方式完成衍生品业务数据自动化报送，交换的文件包括报送信息文件和应答文件。



文件传输具体使用方式请参考《FDEP 文件传输系统技术白皮书》、《FDEP 文件传输系统客户端用户手册》等。

2.2 文件交互流程

报送主体将报送信息打包生成“报送信息文件”，通过深证通 FDEP 文件传输系统发送到场外证券业务报告系统。场外证券业务报告系统定期轮询处理报送信息文件，生成“应答文件”，通过 FDEP 文件传输系统发送回报送主体。



为保证关联信息正常处理，请报送主体保证不同批次报送文件传输的串行化。FDEP 平台有技术手段可获取文件的传输到达状态。

2.3 文件接口格式

关于文件接口格式，参见《场外证券业务报告系统衍生品业务数据报送文件接口规范》。需要注意的事项有：

1. 保证报送文件的完整性：FDEP 文件传输系统提供文件传输完整性技术手段，技术系统对接可参考《FDEP 文件传输系统客户端用户手册》相关内容。

2. 所有文件名、结构化文件内容采用 UTF-8 编码（附件除外），结构化文件内容不得包含 BOM 头信息。

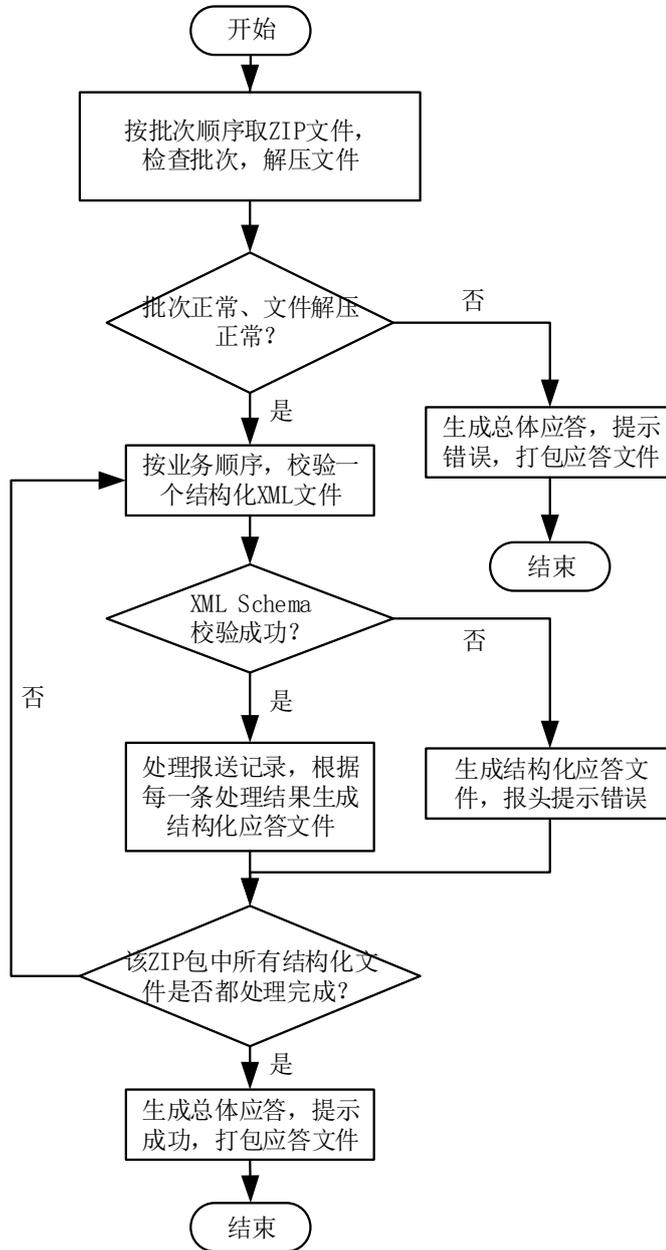
3. 文件名大小写相关。

结构化文件内容为 XML 格式，需严格遵守 W3C XML1.0 规范，格式需遵守报告系统 XML Schema 约定，XML Schema 相应的文件在场外证券业务报告系统对外发布。

4. 文件名和文件内容为 UTF-8 编码。

5. 单个结构化 XML 文件大小原则上需限制在 100M 内，单个附件大小限制在 30M 内。

2.4 文件处理流程



2.5 结构化文件处理顺序

由于不同报送内容有关联关系, 因此报送系统对于同一个报送批次文件中的结构化报送内容, 会有处理顺序, 如下:

1. 处理新增报送，按照主协议、主协议产品列表、补充协议、交易确认书、交易终止、履约担保顺序处理。
2. 处理补正，按照补正接口报送文件序号顺序处理。
3. 处理废止，按照主协议、主协议产品列表、补充协议、交易确认书、交易终止、履约担保逆序处理。

2.6 应答处理机制

对于报送信息文件，报告系统对于错误和异常，处理从外到内分为三层：

1. 对于批次文件解压错误、批次号错误：在应答 ZIP 包中返回总体应答文件中，返回“错误”标识，其中的所有结构化文件不被解析处理。

2. 对于 XML 解析错误，如不能通过 XML Schema 校验，在结构化应答文件报文头中，返回“错误”标识，其中的所有报送信息不被处理。

3. 对于单笔报送信息错误或处理异常，在结构化应答报文体中，对应每笔应答，返回“错误”标识（每笔成功也会返回“成功”标识）。

3 业务报送方案

3.1 报送内容

1. 主协议报送

主协议应当按照《场外证券业务报告系统衍生品业务数据报送文件接口规范》(以下简称“接口规范”)“3.2.1 主协议”中的相关内容进行报送。

如果交易对手方代签产品的,或其交易对手以自营身份或以产品管理人身份开展交易的应当按照《接口规范》“3.2.2 主协议关联产品列表”中的相关内容进行报送。

2. 补充协议报送

补充协议应当按照《接口规范》“3.2.3 补充协议”中的相关内容进行报送。

3. 履约保证书报送

履约保障书应当按照《接口规范》“3.2.4 履约保证书”中的相关内容进行报送。

4. 交易确认书报送

场外期权交易确认书应当按照《接口规范》“3.2.5.1 期权交易确认书”中的相关内容进行报送。

收益互换交易确认书应当按照《接口规范》“3.2.5.2 互换交易确认书”中的相关内容进行报送。

5. 交易终止协议

(1) 场外期权交易存续期管理

场外期权交易存续期管理应当按照《接口规范》“3.2.6.1 期权交易存续期管理”中的相关内容进行报送。

(2) 收益互换交易存续期管理

收益互换交易存续期管理应当按照《接口规范》“3.2.6.2 互换交易存续期管理”中的相关内容进行报送。

6. 定期报告

(1) 月度报告

报送主体应当报送每月场外期权总体业务情况。

报送应当按照《接口规范》“3.2.7 定期报告”中的“3.2.7.1 SAC 模板”、“3.2.7.2 NAFMII 模板”、“ISDA 模板”相关内容进行报送。

(2) 季度报告

报送主体应当报送公司合规部门关于每季度场外衍生品合规部门审查意见以及业务开展合规情况说明。

7. 重大事项报告

报送主体应当按照《接口规范》“3.2.8 重大事项报告”中的相关内容进行报送。

8. 其他事项报告

报送主体应当按照《接口规范》“3.2.9 其他事项报告”中的相关内容进行报送。

3.2 特殊事项

1. 补正

发现已报送内容需要完善（比如：补充盖章版协议）或出现错误时，可通过补正接口进行补正操作，具体操作步骤如下：

（1）首先应重新按照接口规范组织补正报文，补正报文必须包含该报告的所有字段数据，并且附带场外报告库生成的业务编号（见表1）。

表1 补正报文中业务编码说明

| 序号 | 报告类型 | 说明(补正时必传的业务编码) |
|----|-----------|--|
| 1 | 主协议 | 主协议编号，主协议编号（双方约定） |
| 2 | 主协议关联产品列表 | 主协议编号（双方约定），代签产品编号 |
| 3 | 补充协议 | 主协议编号（双方约定），补充协议编号，补充协议编号（双方约定） |
| 4 | 履约保证书 | 主协议编号（双方约定），补充协议编号（双方约定），履约担保协议编号 |
| 5 | 交易确认书 | 主协议编号（双方约定），补充协议编号（双方约定），交易确认书编号，交易确认书编号（双方约定） |
| 6 | 交易终止协议 | 业务编号，交易确认书编号（双方约定） |
| 7 | 定期报告 | 业务编号 |
| 8 | 重大事项报告 | 业务编号 |
| 9 | 其他事项报告 | 业务编号 |

(2) 然后将报告重新压缩成 zip 包, zip 包文件需满足接口规范要求;

(3) 最后待场外报告库处理完并反馈处理文件, 机构需查看反馈文件确认该报告是否补正成功。

2. 废止

当报送主体发现已报送内容有严重错误需要废止时, 可通过废止接口进行该操作, 按照主协议、主协议产品列表、补充协议、交易确认书、交易终止、履约担保逆序处理, 具体操作步骤如下:

(1) 首先机构需参考接口规范组织废止报文, 废止报文无需包含该报告的所有字段数据, 只要提供场外报告库生成的业务编号, 以及接口必要字段即可。

(2) 然后将报告重新压成 zip 包, zip 包文件需要满足接口规范要求;

(3) 最后待场外报告库处理完并反馈处理文件, 机构需查看反馈文件确认该报告是否废止成功。

3. 报送方式与查询

在报送方式上, 接口报送测试通过并申请上线后, 页面报送的权限将被取消, 只具有查询功能。