

跨境业务数据报送文件接口规范

版本 v0.3

中证机构间报价系统股份有限公司

目录

1 目标	5
2 通信约定	5
2.1 文件格式	5
2.2 文件命名规范.....	5
2.3 文件结构	6
2.3.1 报送信息文件结构	6
2.3.2 应答文件结构.....	8
2.3.3 结构化文件命名规范.....	8
2.3.4 非结构化文件命名规范	10
2.4 文件传输约定	11
3 结构化文件规范	12
3.1 报文格式概述.....	12
3.1.1 字符集.....	12
3.1.2 关于BOM.....	12
3.1.3 报文结构.....	12
3.1.4 报头格式.....	15
3.1.5 报体格式.....	17
3.2 报送报体格式定义.....	18
3.2.1 跨境自营投资业务	18
3.2.2 跨境衍生品业务	21

3.2.3 跨境收益凭证业务	28
3.2.4 跨境ETF做市业务	34
3.2.5 跨境月报业务	36
4 附录	38
4.1 数据字典	38
4.1.1 接口标识	38
4.1.2 操作标识	38
4.1.3 响应码	38

1 目标

为提升跨境业务报告数据报送效率,规范报送义务人电子化接口报送,特制定本接口规范。

2 通信约定

2.1 文件格式

报送信息文件和应答文件均采用 ZIP 文件格式。ZIP 文件中包含结构化信息文件和非结构化信息文件。其中结构化信息文件内容为报送信息、应答信息等,文件格式为 XML 格式。每个 XML 文件为一类报送信息,如跨境月报报送为一类,跨境月报的补正信息为第二类,跨境衍生品的报送为第三类等,分别放在不同的 XML 文件中;非结构化信息文件是结构化信息的补充材料,通过结构化信息中的内容关联,包括产品合同、募集说明书等。

2.2 文件命名规范

报送信息文件和应答文件命名规范相同,定义如下:

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号].zip

说明:

1. 文件名为 UTF-8 编码
2. 文件名中所有字母均大写,文件名中不带中括号“[”、“]”;
3. 文件创建人代码:6 位字符,使用场外证券业务报告系统为报送主体分配的编码;如果文件创建人是场外证券业务报告库系统,填 000899;

4. 文件接收人代码:6 位字符，使用场外证券业务报告系统为报送主体分配的编码；如果文件接收人是场外证券业务报告库系统，填 000899；
5. 数据日期：为当前机器时间，应采用北京标准时间（东八区时区），格式为 YYYYMMDD（如 20200824），报送机构应尽量减少本地机器时间和北京标准时间的偏差，应答文件的数据日期与报送信息文件的数据日期相同；
6. 文件序号：采用四位数字顺序编号，每日从 0001 开始顺序递增，最大支持 9999，作为数据日期下的报送批次数，应答文件的文件序号与报送信息文件的文件序号相同。

报送文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001.zip

应答文件命名示例：

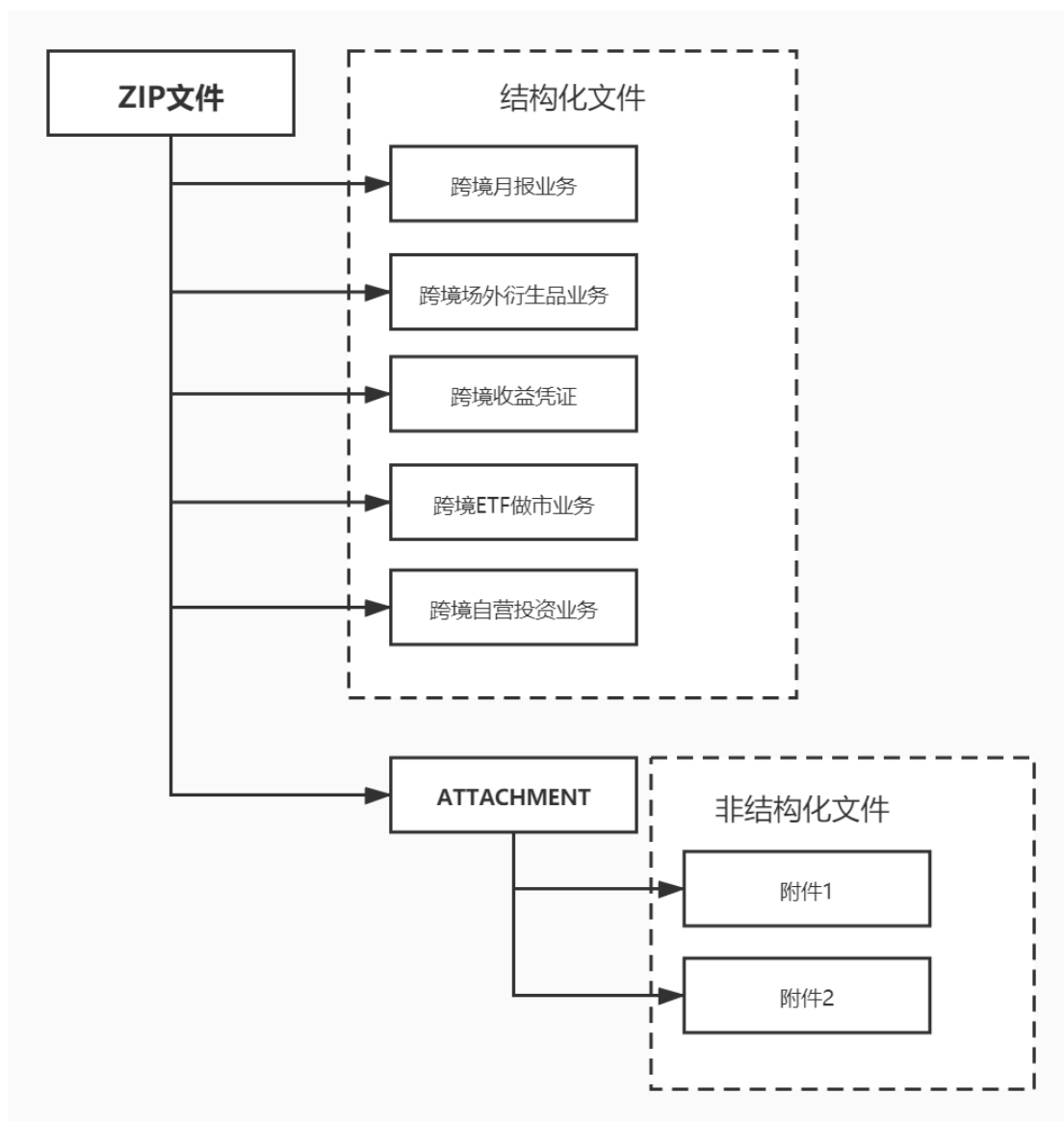
OTC_000899_131101_20200824_0001.zip

2.3 文件结构

2.3.1 报送信息文件结构

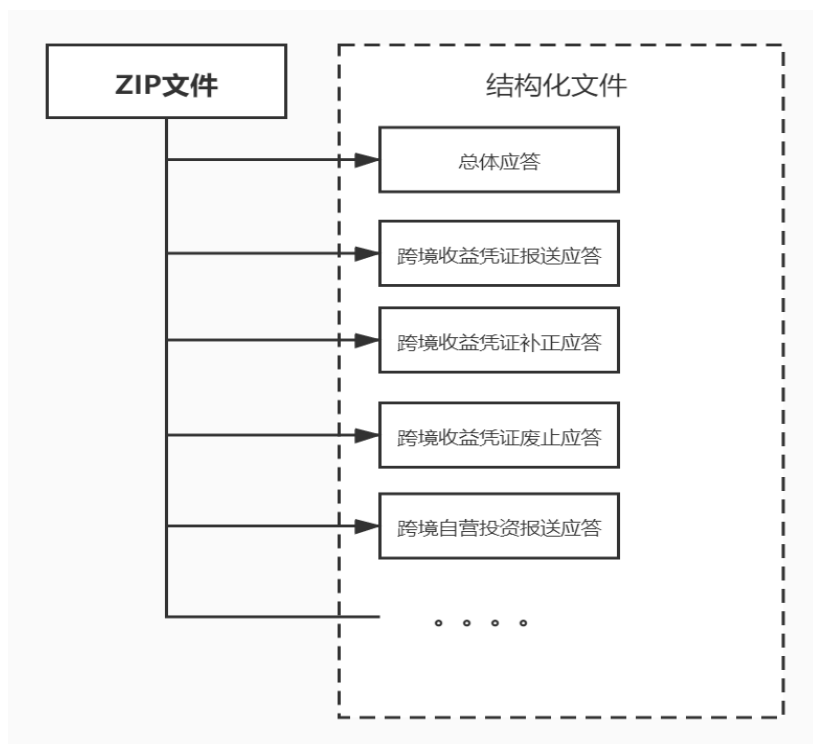
报送信息文件为 ZIP 格式，ZIP 文件中可打包树形文件目录结构。根据业务需要，定义

报送信息文件打包的目录结构如下图所示：



ZIP 文件打包的第一级目录包含有所有的结构化内容文件以及非结构化文件目录 (ATTACHMENT) ,其中每个结构化文件为一类报送信息(维度为接口类型加上操作类型 , 例如跨境月报补正为一类 , 含多条业务信息) , 同一类报送信息在 ZIP 文件中最多有一个。非结构化信息放在 ATTACHMENT 文件目录下 , 再没有子目录 , 文件名称不能重复。

2.3.2 应答文件结构



如上图所示，对应于每个报送主体的报送信息文件，一般情况下场外业务报告系统会发送类似目录结构的应答文件。其中，总体应答文件内容表示 ZIP 包的总体校验是否符合接口规范，例如批次号等字段校验是否通过等；对于报送的每个结构化内容文件，对应有一个结构化应答文件，每个结构化应答文件表述了对于结构化报送内容文件的总体处理结果，以及对报送每条内容的处理结果。

如果总体应答文件内的响应码表示有错误，则表示对应的报送信息文件的格式有错误或处理出现异常。

2.3.3 结构化文件命名规范

2.3.3.1 总体应答文件

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号]_R.XML

1. 文件名中所有字母均为大写，UTF-8 编码；
2. 文件创建人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件创建人代码相同；
3. 文件接收人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件接收人代码相同；
4. 数据日期：8 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的数据日期相同；
5. 文件序号：4 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件序号相同；

总体应答结构化文件名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001_R.xml

2.3.3.2 报送信息文件和应答文件

结构化报送信息文件命名：

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号]_[接口标识]_[操作标识].XML

结构化应答文件命名：

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号]_[接口标识]_[操作标识]_R.XML

1. 文件名中所有字母均为大写，UTF-8 编码；
2. 文件创建人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件创建人代码相同；

3. 文件接收人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件接收人代码相同；
4. 数据日期：8 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的数据日期相同；
5. 文件序号：4 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件序号相同；
6. 接口标识：5 位字符，具体见附录；
7. 操作标识：1 位字符，具体见附录；

结构化报送信息文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001_A2001_A.xml

结构化补正信息文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200825_0001_A2001_U.xml

结构化应答文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001_A2001_A_R.xml

OTC_131101_000899_20200825_0001_A2001_U_R.xml

2.3.4非结构化文件命名规范

ATTACHMENT 目录下包括若干非结构化数据文件，但文件创建方应确保同一个 ATTACHMENT 目录下的非结构化文件无重名，且能与对应的结构化文件中的记录相关联。此外，由于非结构化文件名称可能含有中文或其它多字节文字，为提高兼容性，要求文件名统一采用 UTF-8 字符集。

2.4 文件传输约定

1. 报送主体发送不同批次的文件需要串行处理 ,需要确认前一文件发送成功后才能发送下一文件 ;
2. 场外证券业务报告系统仅处理符合文件命名规范的文件 ,对于不符合命名规范的文件不做应答 ;
3. 如果报送主体的报送信息文件存在格式校验等问题 ,如 ZIP 包解压出现问题或当天批次号重复等 ,场外证券业务报告系统将在应答文件中的总体应答结构化内容中返回错误码 ,对于报送信息文件中的结构化信息不进行处理 ;
4. 报送主体生成结构化 XML 文件后 ,必须使用 XML schema 校验通过后再发送 ;文件接收方处理结构化文件内容之前 ,必须先使用 XML schema 校验通过 ;
5. 场外证券业务报告系统对于报送信息文件内的结构化内容 ,如果没有通过 XML schema 格式校验 ,将返回通用错误信息 ,该文件内所有信息将不被处理 ;
6. 场外证券业务报告系统对于报送信息文件内的结构化内容 ,如果通过 XML schema 格式校验 ,将逐条处理后一批返回 ,其中包含每条的处理结果 ;
7. 如果本月没有相应的跨境业务也要上报空的报告。空报告格式同正常报告格式 ,但在 Body 体内不填写数据。示例详见 3.1.3.2 ;

3 结构化文件规范

3.1 报文格式概述

3.1.1 字符集

采用 Unicode 字符集，UTF-8 编码方式。

3.1.2 关于 BOM

报文主体发送的报文不能带有 BOM header (EF BB BF) 三个字符。对于带有 BOM header 的报文，报告系统将返回错误信息，该文件内所有信息将不被处理。

3.1.3 报文结构

报文采用 XML 格式定义，包括报头和报体，报头 (Header 元素) 包含通信相关信息，报体 (Body 元素) 包含业务信息，根元素为 Root。主体结构示例如下：

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
```

```
<Root>
```

```
<Header>
```

```
</Header>
```

```
<Body>
```

```
</Body>
```

```
</Root>
```

3.1.3.1 报送报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>144096</SenderCode>
    <ReceiverCode>000899</ReceiverCode>
    <SendDate>2021-08-03</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A2004</BusiDataType>
    <OperationType>A</OperationType>
  </Header>
  <Body>
    <ProprietaryInvestmentReport>
      <ExceID>1440960008992021080352847093</ExceID>
      <BizID></BizID>
      <Year>2021</Year>
      <Month>8</Month>
      <ProprietaryTuple>
        <Fillparty>中证技术</Fillparty>
        <InvestmentType>1</InvestmentType>
        <UndrlygAssetName>标的名称</UndrlygAssetName>
        <UndrlygAssetCode>SACE01</UndrlygAssetCode>
        <UndrlygAssetTradgPlc>深圳交易所</UndrlygAssetTradgPlc>
        <BuyingAmount>10000.00</BuyingAmount>
        <SellingAmount>10000.00</SellingAmount>
        <CostofSharesHeld>10000.00</CostofSharesHeld>
        <SharesHeld>10000</SharesHeld>
        <MarketValue>10000.00</MarketValue>
      </ProprietaryTuple>
      <ProprietaryTuple>
        <Fillparty>中证技术</Fillparty>
        <InvestmentType>2</InvestmentType>
        <UndrlygAssetName>标的名称</UndrlygAssetName>
        <UndrlygAssetCode>SACE01</UndrlygAssetCode>
        <UndrlygAssetTradgPlc>北京交易所</UndrlygAssetTradgPlc>
        <BuyingAmount>10000.00</BuyingAmount>
        <SellingAmount>10000.00</SellingAmount>
        <CostofSharesHeld>10000.00</CostofSharesHeld>
        <SharesHeld>10000</SharesHeld>
        <MarketValue>10000.00</MarketValue>
      </ProprietaryTuple>
    </ProprietaryInvestmentReport>
  </Body>
</Root>
```

3.1.3.2空报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>
  <Root>
    <Header>
      <Version>001</Version>
      <SenderCode>131101</SenderCode>
      <ReceiverCode>000899</ReceiverCode>
      <SendDate>2021-08-13</SendDate>
      <FileNumber>0001</FileNumber>
      <BusiDataType>A2001</BusiDataType>
      <OperationType>A</OperationType>
    </Header>
    <Body>
    </Body>
  </Root>
```

3.1.3.3总体应答报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>

<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>000899</SenderCode>
    <ReceiverCode>134034</ReceiverCode>
    <SendDate>2021-08-03</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
</Root>
```

3.1.3.4 应答报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>000899</SenderCode>
    <ReceiverCode>131101</ReceiverCode>
    <SendDate>2020-08-24</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A1001</BusiDataType>
    <OperationType>R</OperationType>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
  <Body>
    <MasterAgrmt>
      <ExecID>1311010008992020082500000001</ExecID>
      <RetCode>000000</RetCode>
      <RetMsg>接收成功</RetMsg>
      <BizID>Z2020082500000001</BizID>
    </MasterAgrmt>
    <MasterAgrmt>
      <ExecID>1311010008992020082500000002</ExecID>
      <RetCode>000000</RetCode>
      <RetMsg>接收成功</RetMsg>
      <BizID>Z2020082500000002</BizID>
    </MasterAgrmt>
  </Body>
</Root>
```

3.1.4 报头格式

3.1.4.1 请求报头格式

主要元素包括文件创建人代码、文件接收人代码、文件创建日期、文件序号、接口标识、

操作标识。

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1.	Version	版本号	C(3)	是	001	
2.	SenderCode	文件创建人代码	C(6)	是		报告库分配

3.	ReceiverCode	文件接收 人代码	C(6)	是		报告库分 配
4.	SendDate	文件发送 日期	C(10)	是		校验规则： 必须是 YYYY-MM- DD
5.	FileNumber	文件序号	C(4)	是		0001~9999
6.	BusiDataType	接口标识	C(5)	是		参见附录
7.	OperationType	操作标识	C(1)	是		参见附录

3.1.4.2 响应报头格式

主要元素包括文件创建人代码、文件接收人代码、文件创建日期、文件序号、接口标识（总体应答文件不含）、操作标识（总体应答文件不含）、响应码、响应描述。其中，文件创建日期、文件序号、接口标识、操作标识这几个字段和请求报头内容一致。

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1.	Version	版本号	C(3)	是	001	
2.	SenderCode	文件创建 人代码	C(6)	是		报告库分 配
3.	ReceiverCode	文件接收 人代码	C(6)	是		报告库分 配
4.	SendDate	文件发送 日期	C(10)	是		校验规则： 必须是

						YYYY-MM-DD
5.	FileNumber	文件序号	C(4)	是		0001~9999
6.	BusiDataType	接口标识	C(5)	是 (总体 应答文件 不含)		参见附录
7.	OperationType	操作标识	C(1)	是 (总体 应答文件 不含)		参见附录
8.	RetCode	响应码	C(6)	是		参见附录
9.	RetMsg	响应描述	C(1000)	是		

3.1.5 报体格式

报体主要包括业务元素列表，具体定义参见报送报体格式定义。

3.1.5.1 请求报体格式

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	ExceID	业务数据流水号	C(28)	是		文件创建人代码 (6 位) + 文件接收人代码 (6 位) + 报送日期 (8 位) + 当日顺序编号 (8 位)

3.1.5.2 响应报体格式

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1.	ExceID	业务数据 流水号	C(28)	是		
2.	RetCode	响应码	C(6)	是		参见附录
3.	RetMsg	响应描述	C(1000)	是		
4.	BizID	报送数据 业务编号	C(50)	否		报告库接口返回,数据处理异常时为空。

3.2 报送报体格式定义

3.2.1 跨境自营投资业务

包含在标签<ProprietaryInvestmentReport>内

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	BizID	业务编号	C(50)	否		校验规则：补正时必填；
2	Year	年份	N(4)	是		校验规则：必须是4位整数；

3	Month	月份	N(2)	是		校验规则:必须是1-12之间的整数;
4	ProprietaryTuple	自营投资业务	T			业务详情

(1) 自营投资业务

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	Fillparty	证券公司名称	C (100)	是		证券公司全称
2	InvestmentType	业务类型	C (2)	是	跨境固定收益 1 跨境大宗商品 2 跨境权益投资 3 跨境外汇业务 4 跨境其他业务 5 跨境融资业务 6	如开展跨境其他业务或跨境融资业务,请在月报中详细说明
3	UndrlygAssetName	标的名称	C (100)	是		

4	UndrlygAsset Code	标的代码	C (100)	是		
5	UndrlygAsset TradgPlc	交易场所	C (100)	是		
6	BuyingAmou nt	本月买入成交 额(元)	N (32, 2)	是		人民币，必须 填写两位小 数。
7	SellingAmou nt	本月卖出成交 额(元)	N (32, 2)	是		人民币，必须 填写两位小 数。
8	CostofShare sHeld	月末持仓成本	N (32, 2)	是		必须填写两位 小数。
9	SharesHeld	月末持仓数量	N (32)	是		
10	MarketValue	月末持仓市值 (元)	N (32, 2)	是		人民币，必须 填写两位小 数。
11	Blank1	预留 1				
12	Blank2	预留 2				

3.2.2 跨境衍生品业务

包含在标签<DerivativeReport>内

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则：补正时必填；
2	FillParty	证券公司名称	C (100)	是	证券公司全称	与衍生品交易确认书中保持一致
3	FillParty LEI	证券公司 LEI 码	C (50)	是		
4	TransactionType	业务类型	C (2)	是	收益互换 1、场外期权 2	与衍生品交易确认书中保持一致
5	ContractStart Period	交易类型	C (2)	是	本月新增 1、截至本月末存续 2	
6	MoneyFlow	资金方向	C (2)	是	南向 1、北向 2	南向：证券公司与境内交易对手开展的相关挂钩境外标的的跨境业务；北向：证

						券公司与香港子公司或与境外交易对手开展的相关挂钩境内标的的跨境业务；背对背交易规模不重复计算。
7	Confirmation ID	交易确认书编号	C(32)	是	证券公司进行衍生品持续报备时，场外证券业务报告系统分配的唯一编号	衍生品模块中报告库分配的编号 (J 编号)
8	Counterparty Name	交易对手方名称	C(100)	是	证券公司进行衍生品持续报备时，场外证券业务报告系统中填写的名称	与衍生品交易确认书中保持一致
9	Counterparty LEI	交易对手 LEI 码	C(50)	是		

10	Counterparty ProductName	交易对手方产 品名称 (如 有)	C (100)	否		
11	Counterparty Type	交易对手类型	C(32)	是	证券公司 0、 基金公司 1、 期货公司 2、 基金公司子公 司 4、期货公 司风险管理公 司 5、商业银 行 6、保险公 司 7、保险子 公司 8、信托 公司 9、财务 公司 10、私募 基金 (应以中 国基金业协会 备案为准) 11、其他金融 机构 12、境内 非金融机构 (一般工商企	

					业) 13、境外 金融机构 14、 境外非金融机 构 15、商业银 行子公司 16、 证券公司资产 管理子公司 17、证券公司 其他子公司 18、政策性银 行 19、外资银 行 20、期货资 产管理公司 21	
12	RegisteredAddress	交易对手方注 册地	C(2)	是	境内 0、香港 1、境外其他 2	
13	NotionalPrincipalAmount	名义本金 (元)	N(32, 2)	是		人民币，必须填 写两位小数。本 月新增交易，填 写初始名义本 金；本月未存续 交易，填写存续 名义本金。

14	Currency	交易货币	C(32)	是	CNY 0、 USD 1、 EUR 2、 HKD 3、 GBP 4、 JPY 5、 其他 6	合约结算货币
15	ContractStart Date	合约起始日	C(32)	是		YYYY-MM-DD
16	UndrlygAsset Type	挂钩标的类型	C(32)	是	权益类 0、大宗 商品 1、利率 2、信用类 3、 汇率 4、其他 99	
17	UndrlygAsset DtldType	挂钩标的小类	C(32)	是	股票 0、股指 1、新三板挂牌 股票 2、香港股 票 3、香港股指 4、基金及基金 专户 5、债券 6、黄金期货 7、国债期货	挂钩标的类型为 权益类时，可选 0-5、9、15-16、 99；挂钩标的为 大宗商品时，可 选 7、10-14、 99；挂钩标的为 利率类时，可选

					8、股指期货 9、其他期货 10、黄金现货 11、其他现货 12、境外期货 13、境外现货 14、境外股票 15、境外股指 16、汇率 17、Shibor 18、银行间回购定盘 (Fixing Repo Rate) 19、其他利率 20、其他标的 99	6、8、18-20、99；挂钩标的为信用类时，可选99；挂钩标的为汇率类时，可选17、99；挂钩标的类型为其他类时，可选99。18、19、20 仅为期权标的选项。
18	UndrlygAsset Name	标的名称	C(32)	是		
19	UndrlygAsset TradgPlc	标的交易场所	C (100)	是		
20	BasisPoint Value	对冲后净敞口/ 基点价值	N(32, 2)	是		必须填写两位小数。

21	InitialMargin	收取保证金比例 (%)	N(3)	是	填报方收取保证金为正，支付保证金为负。收取保证金比例为80%，该字段填写80。
22	BullAndBear	多空方向	C(32)	是	<p>收益互换交易中，按照客户收益的多头空头方向填写。场外期权交易中，客户买入看涨期权或卖出看跌期权为客户多头；客户买入看跌期权和卖出看涨期权为客户空头；双</p> <p>客户多头 0、 客户空头 1 双向 2</p> <p>鲨、三段式二元期权等结构可选择双向</p>

23	MarketNeutral	是否为多空交易	C(2)	是	否 0、是 1	市场中性组合的收益互换选择“是”
24	Blank1	预留 1				
25	Blank2	预留 2				

3.2.3 跨境收益凭证业务

包含在标签<IncomeVoucherReport>内

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	BizID	业务编号	C(50)	否		校验规则：补正时必填；
2	ProductID	产品代码	C(32)	是	收益凭证产品代码	

3	FillParty	证券公司	C(32)	是	证券公司全称	
4	FillParty LEI	证券公司 LEI 码	C (50)	是		
5	ContractStart Period	交易类型	C (2)	是	本月新增 1、 截至本月末存 续 2	
6	ParticipatepartyType	投资者类型	C(32)	是	证券公司 0、 基金公司 1、 期货公司 2、 基金公司子公 司 4、期货公 司风险管理公 司 5、商业银 行 6、保险公 司 7、保险子 公司 8、信托 公司 9、财务 公司 10、私募 基金 (应以中 国基金业协会 备案为准)	

					11、其他金融 机构 12、境内 非金融机构 (一般工商企 业) 13、境外 金融机构 14、 境外非金融机 构 15、商业银 行子公司 16、 证券公司资产 管理子公司 17、证券公司 其他子公司 18、政策性银 行 19、外资银 行 20、期货资 产管理公司 21、个人 22	
7	ContractStart Date	产品观察起始 日	C(32)	是		YYYY-MM-DD

8	ProductAmount	产品规模 (元)	N(32, 2)	是		<p>该产品每一类投资者填写相应类型投资者对应的规模。例如某产品共募集6000000元，商业银行1000000元，证券公司3000000元，个人投资者共认购2000000元，则填写3条数据，该字段分别为1000000.00、3000000.00、2000000.00。必须填写两位小数。</p>
9	UnderlyingAssetType	挂钩标的类型	C(32)	是	<p>权益类 0、大宗商品 1、利率 2、信用类</p>	

					3、汇率 4、 其他 99	
10	UndrlygAssetDtldType	挂钩标的小类	C(32)	是	股票 0、股指 1、新三板挂牌股票 2、香港股票 3、香港股指 4、基金及基金专户 5、债券 6、黄金期货 7、国债期货 8、股指期货 9、其他期货 10、黄金现货 11、其他现货 12、境外期货 13、境外现货 14、境外股票 15、境外股指 16、汇率 17、Shibor 18、银行间回购定盘	挂钩标的类型为权益类时，可选0-5、9、15-16、21、99；挂钩标的为大宗商品时，可选7、10-14、99；挂钩标的为利率类时，可选6、8、18-20、99；挂钩标的为信用类时，可选99；挂钩标的为汇率类时，可选17、99；挂钩标的类型为其他类时，可选99

					(Fixing Repo Rate) 19、其他利率 20、其他标的 99	
11	MoneyFlow	资金方向	C (2)	是	南向 1、北向 2	南向：证券公司与境内交易对手开展的相关挂钩境外标的的跨境业务；北向：证券公司与香港子公司或与境外交易对手开展的相关挂钩境内标的的跨境业务。
12	BasisPoint Value	对冲后净敞口/ 基点价值	N (32, 2)	是		必须填写两位小数。
13	Blank1	预留 1				

14	Blank2	预留 2				
----	--------	------	--	--	--	--

3.2.4 跨境 ETF 做市业务

包含在标签<ETFReport>内

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则：补正时必填；
2	Year	年份	N(4)	是		校验规则：必须是 4 位整数；
3	Month	月份	N(2)	是		校验规则：必须是 1-12 之间的整数；
4	ETFTuple	ETF 做市业务	T			业务详情

(1) ETF 做市业务

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	Fillparty	证券公司名称	C (100)	是		证券公司全称

2	UndrlygAsset TradgPlc	标的交易场所	C (100)	是		
3	UndrlygAsset Name	标的名称	C (100)	是		
4	UndrlygAsset Code	标的代码	C (100)	是		
5	AmountOfAsk	申购成交金额 (元)	N(32 , 2)	是		人民币,必须填写两位小数。
6	SharesOfAsk Transaction	申购成交份额	N(32)	是		
7	AmountOfBid	赎回成交金额 (元)	N(32 , 2)	是		人民币,必须填写两位小数。
8	SharesOfBid Transaction	赎回成交份额	N(32)	是		
9	SharesHeldEndMonth	月末持仓份额	N(32)	是		
10	MarketValue	月末持仓市值	N(32)	是		人民币
11	Blank1	预留 1				
12	Blank2	预留 2				

3.2.5 跨境月报业务

包含在标签<MonthlyReport>内

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	BizID	业务编号	C(50)	否		校验规则：补正时必填；
2	Year	年份	N(4)	是		校验规则：必须是4位整数；
3	Month	月份	N(2)	是		校验规则：必须是1-12之间的整数；
4	File	月报文件	A	是	单附件	校验规则：只支持PDF格式；文件名称以文件创建人代码+报送年月命名，示例： M80074-2021年 8月.pdf

5	Swap	收益互换	N(32 , 2)	是		月末存量, 必须填写两位小数。
6	Option	场外期权	N(32 , 2)	是		月末存量, 必须填写两位小数。
7	IncomeCertificate	收益凭证	N(32 , 2)	是		月末存量, 必须填写两位小数。
8	ETF	ETF 做市	N(32 , 2)	是		月末存量, 必须填写两位小数。
9	FixedIncome	固定收益自营业务	N(32 , 2)	是		必须填写两位小数。
10	Commodity	大宗商品自营业务	N(32 , 2)	是		必须填写两位小数。
11	EquityInvestment	权益投资业务	N(32 , 2)	是		必须填写两位小数。
12	ForeignExchange	外汇业务	N(32 , 2)	是		必须填写两位小数。
13	Others	其他自营业务	N(32 , 2)	是		必须填写两位小数。
14	CrossBorderFinancing	跨境融资业务	N(32 , 2)	是		必须填写两位小数。

4 附录

4.1 数据字典

4.1.1 接口标识

序号	接口标识	含义
1.	A2001	跨境场外衍生品业务
2.	A2002	跨境收益凭证业务
3.	A2003	跨境 ETF 做市业务
4.	A2004	跨境自营投资业务
5.	A2005	跨境月报业务

4.1.2 操作标识

序号	操作标识	含义
1.	A	报送信息文件
2.	U	报送信息补正文件
3.	D	报送信息废止文件

4.1.3 响应码

序号	响应码	含义
----	-----	----

1.	000000	报送信息文件或该条记录接收成功
2.	000001	XML Schema 校验错误
3.	000002	其它失败，具体参见响应信息的内容