

收益凭证业务数据报送文件接口规范 (试行)

版本 v1.03

中证机构间报价系统股份有限公司

目录

1	目标	3
2	通信约定	3
2.1	文件格式	3
2.2	文件命名规范	3
2.3	文件结构	4
2.3.1	报送信息文件结构	4
2.3.2	应答文件结构	5
2.3.3	结构化文件命名规范	5
2.3.4	非结构化文件命名规范	6
2.4	文件传输约定	6
3	结构化文件规范	7
3.1	报文格式概述	7
3.1.1	字符集	7
3.1.2	关于 BOM	7
3.1.3	报文结构	7
3.1.4	报头格式	10
3.1.5	报体格式	11
3.2	报送报体格式定义	12
3.2.1	收益凭证发行情况报送	12
3.2.2	收益凭证存续期业务情况报送	47
3.2.3	证券公司月度收益凭证统计数据报送	52
3.2.4	收益凭证产品重大事项信息披露	55
4	附录	56
4.1	数据字典	56
4.1.1	接口标识(BusiDataType)	56
4.1.2	操作标识(OperationType)	56
4.1.3	响应码(RetCode)	57

1 目标

为提升收益凭证业务数据报送效率,规范报送义务人在场外证券交易报告库中的电子化接口报送工作,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,如收益凭证基础产品信息与发行情况为一类,收益凭证基础产品信息与发行情况的补正信息为第二类,收益凭证产品投资者持有份额明细为第三类等,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,包括产品说明书、认购协议、风险揭示书等。

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]_[报告类型代码]_[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. 报告类型代码:4 位字符,收益凭证业务填写: SYPZ;
6. 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;
7. 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_SYPZ_20200824_0001.zip

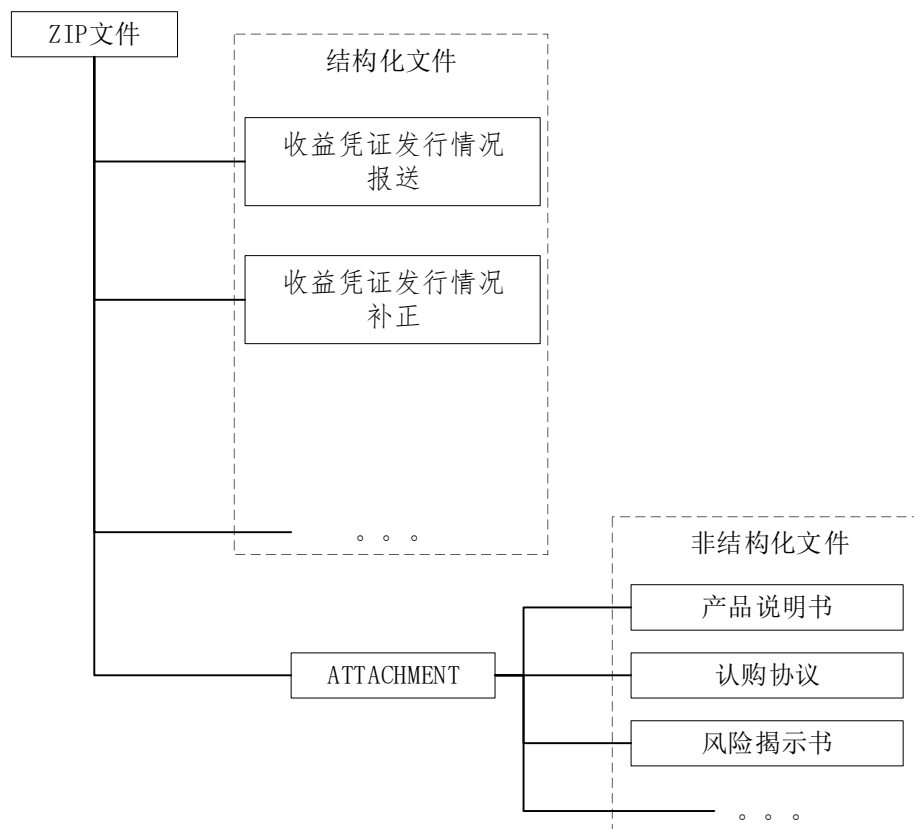
应答文件命名示例:

OTC_000899_131101_SYPZ_20200824_0001.zip

2.3 文件结构

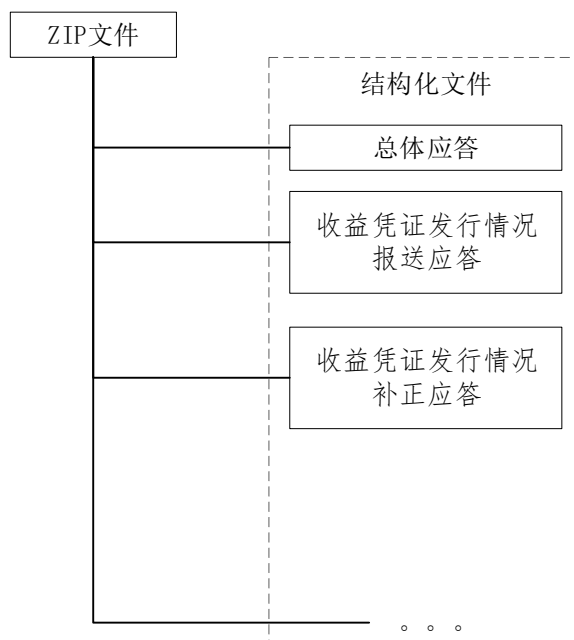
2.3.1 报送信息文件结构

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，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_20211028_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_20211028_0001_A3001_A.xml

结构化补正信息文件命名示例:

OTC_131101_000899_20211028_0001_A3001_U.xml

结构化应答文件命名示例:

OTC_131101_000899_20211028_0001_A3001_A_R.xml

OTC_131101_000899_20200825_0001_A3001_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, 对于非结构化文件的命名不做约束, 文件创建方可自行命名, 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. 报送主体需要按业务顺序发送报送文件, 一个报送信息文件中的报送内容不能在有关联关系的另一个报送信息文件之前发送。
2. 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;
3. 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;

4. 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;
5. 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;
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;
7. 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;

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>111002</SenderCode>
    <ReceiverCode>000899</ReceiverCode>
    <SendDate>2022-03-28</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A3001</BusiDataType>
    <OperationType>A</OperationType>
  </Header>
  <Body>
    <ProductReport>
      <ExcelID>0000000008992021120800000001</ExcelID>
      <SecurityCompanyCode>12345678</SecurityCompanyCode>
      <SecurityCompanyName>证券公司名称</SecurityCompanyName>
      <ProductCode>SF0001</ProductCode>
      <ProductFullName>产品全称</ProductFullName>
      <ProductShortName>产品简称</ProductShortName>
      <ProductShareRegistrationType>01</ProductShareRegistrationType>
      <ProductShareRegistrationName>产品份额登记人名称</ProductShareRegistrationName>
      <.....></.....>
      <ShareDetailsTuple>
        <.....></.....>
        <.....></.....>
      </ShareDetailsTuple>
      <ShareDetailsTuple>
        <.....></.....>
        <.....></.....>
      </ShareDetailsTuple>
      <InvestorsChangesTuple>
        <.....></.....>
        <.....></.....>
      </InvestorsChangesTuple>
      <InvestorsChangesTuple>
        <.....></.....>
        <.....></.....>
      </InvestorsChangesTuple>
      <Name>业务代表1</Name>
      <Title>职务1</Title>
      <Telephone>010-123245678</Telephone>
      <Mobile>13012345678</Mobile>
      <Email>123456@qq.com</Email>
    </ProductReport>
  </Body>
</Root>
```


3.1.3.2 总体应答报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
- <Root>
  - <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>000899</SenderCode>
    <ReceiverCode>111002</ReceiverCode>
    <SendDate>2022-03-28</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
</Root>
```

3.1.3.3 应答报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
- <Root>
  - <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>000899</SenderCode>
    <ReceiverCode>111002</ReceiverCode>
    <SendDate>2022-03-28</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A3001</BusiDataType>
    <OperationType>R</OperationType>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
  - <Body>
    - <ProductReport>
      <ExceID>1110020008992022032800000001</ExceID>
      <RetCode>000000</RetCode>
      <RetMsg>接收成功</RetMsg>
      <BizID>9a275148163742d29425a22e7a51f67f</BizID>
    </ProductReport>
  </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	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	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		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	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	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		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	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	说明
1	ExcelID	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)
2	其他业务字段参见 3.2 报送报体格式定义下各业务信息明细信息					

3.1.5.2 响应报体格式

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	说明
1.	ExcelID	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		BizID 由报告库接口返回, 数据处理异常时, BizID

						返回值为空。
--	--	--	--	--	--	--------

收益凭证补正时必须使用 BizID。因涉及补正流程管理，补正申请获批后才可使用 BizID 进行补正报送。具体补正流程请见配套报送文件指引文档。

3.2 报送报体格式定义

3.2.1 收益凭证发行情况报送

包含在标签<ProductReport>内

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
0	BizID	业务编号	C(50)	否			1、补正时必填
1	SecurityCompanyCode	证券公司代码	C(50)	是	编码	填写场外证券业务交易对手编码（机构）。	
2	SecurityCompanyName	证券公司名称	C(200)	是	文本	全称。	
3	ProductCode	产品代码	C(50)	是	编码	符合《证券公司私募产品代码管理办法（试行）》的产品代码要求。	
4	ProductFullName	产品全称	C(200)	是	文本		
5	ProductShortName	产品简称	C(200)	是	文本		
6		收益凭证基础产品信息与发行情况表		是	字段信息详见【3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况表】		

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
7	ShareDetailsTuple	收益凭证产品投资者持有份额明细表	T	是	字段信息详见【3.2.1.2收益凭证产品投资者持有份额明细表】		
8	InvestorsChangesTuple	收益凭证产品投资者变动明细表	T	是	字段信息详见【3.2.1.3收益凭证产品投资者变动明细表】		
9	Name	报送方业务代表姓名	C(200)	是	文本		
10	Title	报送方业务代表职务	C(200)	是	文本		
11	Telephone	报送方业务代表电话	C(200)	是	文本		
12	Mobile	报送方业务代表手机	C(20)	是	文本		手机号校验
13	Email	报送方业务代表邮箱	C(200)	是	文本		

3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
1	ProductShareRegistrationType	产品份额登记人类型	C(2)	是	01:本公司 02:其他机构		
2	ProductShareRegistrationName	产品份额登记人名称	C(200)	是	文本	全称。	

3	ProductShareRegistrationOrganizationCode	产品份额 登记人组 织机构代 码	C(50)	是	编码		1、必须为 8、9、10 或 18 位。
4	SaleOrganizationType	销售机构 类型	C(2)	是	01: 本公司 02: 子公司 03: 本公司及 子公司 04: 其他机构	1、销售机构 类型为“02: 子 公司”或“03: 本公司及子 公司的”,应当 进一步填报 涉及子公司 的机构名称 (4-1) 与组 织机构代码 (4-2)。	
4-1	SaleOrganizationName	销售机构 名称	C(200)	否	文本	为机构全称。 涉及多个销 售机构的,不 同名称之间 用“ ”分隔。	1、字段 4“销售 机构类型”为 “02:子公司”或 “03:本公司及 子公司”或“04: 其他机构”的, 本字段为必 填。
4-2	SaleOrganizationCode	销售机构 组织机构 代码	C(200)	否	编码	涉及多个销 售机构的,不 同机构代码 之间用“ ”分 隔。	1、字段 4“销售 机构类型”为 “02:子公司”或 “03:本公司及 子公司”或“04: 其他机构”的, 本字段为必 填。
5	CreditEnhancementOrganizationDesign	增信机构 情况	C(2)	是	01: 无 02: 有	增信机构情 况为“02: 有” 的,应当进一 步填报增信 机构名称(5- 1) 与组织机 构代码(5- 2)。	
5-1	CreditEnhancementName	增信机构 名称	C(200)	否	文本	为机构全称。	1、字段 5“增信 机构情况”为

	ntOrganizationName					涉及多个增信机构的，不同机构名称之间用“ ”分隔。	“02:有”的，本字段为必填。
5-2	CreditEnhancementOrganizationCode	增信机构组织机构代码	C(200)	否	编码	涉及多个增信机构的，不同机构代码之间用“ ”分隔。	1、字段5“增信机构情况”为“02:有”的，本字段为必填。
6	ProductType	产品类型	C(2)	是	01:固定收益型 02:浮动收益型	1、固定收益型是指，收益率为募集期结束日(含)之前可确定的产品；其余为浮动收益型 2、产品类型为浮动收益型的，应当进一步填写6-1“嵌入金融衍生品类型”、6-2“上行参与率”及6-3“下行参与率”字段。	
6-1	EmbeddedFinancialDerivativesType	嵌入金融衍生品类型	C(2)	否	01:期权 02:收益互换	1、嵌入金融衍生品含期权的，请选择“01:期权”；不含期权的，请选择“02:收益互换”。 2、嵌入金融衍生品类型为“01:期权”的，应当进一步填写6-1-1至6-1-10嵌入期权结构明细。	1、字段6“产品类型”为“02:浮动收益型”的，本字段为必填。

6-1-1	EmbeddedOptionStructureType	嵌入期权结构类型	C(2)	否	01:香草 02:二元及其组合 03:鲨鱼鳍 04:雪球类 05:区间累计 06:安全气囊 07:价差 08:其他香草组合 09:其他障碍及其组合 10:其他自动赎回 99:其他	1、期权结构类型为“99:其他”的,应当进一步填写 6-1-1-1“其他期权结构名称”字段。	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的,本字段为必填。
6-1-1-1	OtherOptionStructureName	其他期权结构名称	C(200)	否	文本	涉及多个期权结构名称的,不同期权结构名称之间用“ ”分隔。	1、字段 6-1-1“嵌入期权结构类型”为“99:其他”的,本字段为必填。
6-1-2	EmbeddedOptionDirection	嵌入期权方向	C(2)	否	01:看涨 02:看跌 03:双向 99:其他	1、期权方向按照收益凭证产品收益与挂钩标的价格涨跌行情的关系来填报。 2、如果产品收益与挂钩标的涨跌行情无明显关系的,字段取值为“99:其他”。	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的,本字段为必填。
6-1-3	InitialObservationDate	期初观察日	C(10)	否	日期	1、格式:YYYY-MM-DD。	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的,本字段为必填。

6-1-4	FinalObservationDate	期末观察日	C(10)	否	日期	1、格式：YYYY-MM-DD	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的，本字段为必填。
6-1-5	OptionExercisePriceCoefficient	期权执行价格系数（行权价）	C(500)	否	文本	<p>1、格式为百分数，保留小数点后四位小数。</p> <p>2、采用单一固定执行价格的，填写具体的执行价格系数： 字段 7-2“挂钩标的小类”为“18:汇率”或“19:利率”的，该执行价格系数=执行价格-挂钩标的期初价格； 其它挂钩标的类型的，执行价格系数 = (执行价格 / 挂钩标的期初价格) * 100%。</p> <p>3、涉及多个执行价格的，按照产品说明书设计中执行价格 1、执行价格 2... 的递推顺序进行列式，不同之间用“ ”分隔。</p>	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的，本字段为必填。
6-1-6	KnockOutDesign	敲出设计	C(2)	否	01:无 02:有	敲出设计为“02:有”的，应当进一步填报字段 6-1-	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期

						6-1 “敲出观察期间的期初观察日”、6-1-6-2 “敲出观察期间的期末观察日”、6-1-6-3 “敲出观察日分布情况”、6-1-6-4 “敲出观察期间的敲出价格系数”、6-1-6-5 “敲出观察期间的敲出收益率”及 6-1-6-6 “敲出方向”。	权”的，本字段为必填。
6-1-6-1	KnockOutTheOpeningObservationDate	敲出观察期间的期初观察日	C(10)	否	日期	1、日期格式：YYYY-MM-DD。 2、指第一个敲出观察日。	1、字段 6-1-6 “敲出设计”为“02:有”的，本字段为必填。
6-1-6-2	KnockOutTheFinalObservationDate	敲出观察期间的期末观察日	C(10)	否	日期	1、日期格式：YYYY-MM-DD。 2、指最后一个敲出观察日。	1、字段 6-1-6 “敲出设计”为“02:有”的，本字段为必填。
6-1-6-3	KnockOutObservationDistribution	敲出观察分布情况	C(2)	否	01:连续观察 02:离散观察	1、在敲出观察期间每个交易日连续（不间断）观察的，敲出观察分布情况为“01:连续观察”。其他则为“02:离散观察”。 2、敲出观察分布情况为“02:离散观	1、字段 6-1-6 “敲出设计”为“02:有”的，本字段为必填。

						察"的,或敲出观察分布情况为"01:连续观察",但设置了多个不同敲出价格系数或敲出收益率的,应当进一步填报字段 6-1-6-3-1 "敲出观察日"。	
6-1-6-3-1	KnockOutObservationDate	敲出观察日	C	否	日期数组	1、日期格式:YYYY-MM-DD。 2、按照从期初到期末的时间先后顺序,列示各观察日,不同观察日之间用" "分隔。	1、字段 6-1-6-3"敲出观察日分布情况"为"02:离散观察",本字段为必填。 2、敲出观察日分布为"01:连续观察",但设置了多个不同敲出价格系数或敲出收益率的,本字段必填。
6-1-6-4	KnockOutPriceCoefficient	敲出观察期间的敲出价格系数	C	否	数值数组	1、格式为百分数,保留小数点后四位小数。 2、采用单一固定敲出价格的,填写具体的敲出价格系数:其中字段 7-2"挂钩标的小类"为"18:汇率"或"19:利率"的,该敲出价格系数=敲出价格-挂钩标的期初价格;	1、字段 6-1-6"敲出设计"为"02:有"的,本字段为必填。

						<p>其它挂钩标的类型的，敲出价格系数 = (敲出价格 / 挂钩标的期初价格) * 100%。</p> <p>3、涉及多个敲出价格系数的，敲出价格系数列示顺序应当与字段 6-1-6-3-1“敲出观察日”数组列示数据对应，按照从期初到期末的时间先后顺序，列示各观察日下的敲出价格系数，不同系数之间用“ ”分隔。</p>	
6-1-6-5	KnockOutYield	敲出观察期间的敲出收益率 (%)	C	否	数值数组	<p>1、填写发生敲出事件后的年化票面利率。格式为百分数，保留小数点两位数。</p> <p>2、单一敲出收益率的，填写具体的敲出收益率。</p> <p>3、涉及多个敲出收益率的，敲出收益率列示顺序应当与字段 6-1-6-3-1“敲出观察日”数组列示数</p>	<p>1、字段 6-1-6“敲出设计”为“02:有”的，本字段为必填。</p>

						据对应，按照从期初到期末的时间先后顺序，列示各观察日下的敲出收益率，不同收益率之间用“ ”分隔。	
6-1-6-5-1	KnockOutFixedYield	敲出观察期间的敲出收益率(绝对)(%)	C	否	数值数组	<p>1、填写发生敲出事件后的与产品期限无关的绝对固定票面利率。格式为百分数，保留小数点两位数，如无，填“0.00”。</p> <p>2、涉及多个敲出收益率(绝对)的，敲出收益率列示顺序应当与字段 6-1-6-3-1“敲出观察日”数组列示数据对应，按照从期初到期末的时间先后顺序，列示各观察日下的敲出收益率，不同收益率之间用“ ”分隔。</p>	
6-1-6-6	KnockOutDirection	敲出方向	C	否	数值数组 取值要求如下： 01:向上敲出 02:向下敲出	1、单一敲出方向的，填写具体的敲出方向。其中挂钩标的在敲出观察日发生收益表现	1、字段 6-1-6“敲出设计”为“02:有”的，本字段为必填。

						<p>水平大于或等于敲出观察日对应敲出水平的,为向上敲出;挂钩标的在敲出观察日发生收益表现水平小于或等于敲出观察日对应敲出水平的,为向下敲出。</p> <p>2、涉及多情形敲出方向的,敲出方向列示顺序应当与字段 6-1-6-3-1“敲出观察日”数组列示数据对应,按照从期初到期末的时间先后顺序,列示各观察日下的敲出方向,敲出方向之间用“ ”分隔。</p>	
6-1-7	KnockIn Design	敲入设计	C(2)	否	01:无 02:有	<p>敲入设计为“02:有”的,应当进一步填报字段 6-1-7-1“敲入观察期间的期初观察日”、6-1-7-2“敲入观察期间的期末观察日”、6-1-7-3“敲入观察日分布情况”、6-1-7-4“敲入观察期间的</p>	<p>1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的,本字段为必填。</p>

						敲入价格系数”及 6-1-7-5 “敲入方向”。	
6-1-7-1	KnockInOpeningObservationDate	敲入观察期间的期初观察日	C(10)	否	日期	1、日期格式：YYYY-MM-DD。 2、指第一个敲入观察日。	1、字段 6-1-7“敲入设计”为“02:有”的，本字段为必填。
6-1-7-2	KnockInTheFinalObservationDate	敲入观察期间的期末观察日	C(10)	否	日期	1、日期格式：YYYY-MM-DD。 2、指最后一个敲入观察日。	1、字段 6-1-7“敲入设计”为“02:有”的，本字段为必填。
6-1-7-3	KnockInObservationDistribution	敲入观察分布情况	C(2)	否	01:连续观察 02:离散观察	1、在敲入观察期间每个交易日连续（不间断）观察的，敲入观察分布情况为“01:连续观察”。其他则为“02:离散观察”。 2、敲入观察分布情况为“02:离散观察”的，或敲入观察分布情况为“01:连续观察”，但设置了多个不同敲入价格系数的，应当进一步填报字段 6-1-7-3-1“敲入观察日”。	1、字段 6-1-7“敲入设计”为“02:有”的，本字段为必填。
6-1-7-3-1	KnockInObservationDate	敲入观察日	C	否	日期数组	1、日期格式：YYYY-MM-DD。	1、字段 6-1-7-3“敲入观察日分布情况”为

						<p>2、按照从期初到期末的时间先后顺序,列示各观察日,不同观察日之间用“ ”分隔。</p>	<p>“02:离散观察”,本字段为必填。</p> <p>2、字段6-1-7-3“敲入观察日分布情况”为“01:连续观察”,但不同分段期间的敲入价格系数不同的,按“离散观察”填报本字段。</p>
6-1-7-4	KnockIn Observat ionPrice Coefficient	敲入观察期间的敲入价格系数	C	否	数值数组	<p>1、执行价格系数 = (敲入价格/挂钩标的期初价格) *100%。格式为百分数,保留小数点两位数。</p> <p>2、单一敲入价格系数的,填写具体的敲入价格系数。</p> <p>3、涉及多个敲入价格系数的,敲入价格系数列示顺序应当与字段6-1-7-3-1“敲入观察日”数组列示数据对应,按照从期初到期末的时间先后顺序,列示各观察日下的敲入价格系数,不同系数之间用“ ”分隔。</p>	<p>1、字段6-1-7“敲入设计”为“02:有”的,本字段为必填。</p>

6-1-7-5	KnockIn Direction	敲入方向	C	否	数值数组, 取值要求如下: 01:向上敲入 02:向下敲入	1、单一敲入方向的, 填写具体的敲入方向。 2、涉及多情形敲入方向的, 按照从期初到期末的时间先后顺序, 列示各观察日下的敲入方向, 敲入方向之间用“ ”分隔。	1、字段 6-1-7 “敲入设计”为“02:有”的, 本字段为必填。
6-1-8	Dividend Coupon	红利票息	N(36, 2)	否	数值	1、格式为百分数, 保留小数点两位数。 2、如产品结构没有设置红利票息的, 则填报“0.00”。	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的, 本字段为必填。
6-1-9	OtherObstaclesOr Hedging Conditions	其他障碍或避险条件	C	否	文本	1、设置了敲入敲出障碍期权以外的其他障碍或避险条件的, 对障碍或避险条件进行说明。例如, 防御雪球的防御事件等。 2、未设置其他障碍或转换条件的, 则填写“-”。	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的, 本字段为必填。
6-1-10	Transfer ToConversionConditions	转换条件安排	C	否	文本	1、设置了转换条件安排的, 对转换条件安排进行说明。例如, 雪球到期转指增结构。	1、字段 6-1“嵌入金融衍生品类型”为“01:期权”的, 本字段为必填。

						2、未设置转指增等转换条件安排的，则填写“-”。	
6-2	UpwardParticipationRatio	上行参与率 (%)	C(200)	否	数值数组	1、“上行参与率”指收益曲线上行时的参与率。格式为百分数，保留小数点两位数。 2、涉及多个上行参与率的，按照各参与率对应执行价格从低到高的顺序进行列示，不同上行参与率之间用“ ”分隔。	1、字段6“产品类型”为“02:浮动收益型”的，本字段为必填。
6-3	DownwardParticipationRatio	下行参与率 (%)	C(200)	否	数值数组	1、“下行参与率”指收益曲线下行时的参与率。格式为百分数，保留小数点两位数。 2、涉及多个下行参与率的，按照各参与率对应执行价格从高到低的顺序进行列示，不同下行参与率之间用“ ”分隔。	1、字段6“产品类型”为“02:浮动收益型”的，本字段为必填。
7	UnderlyingAssetsDesign	挂钩标的情况	C(2)	是	01:无 02:单一标的 03:组合标的	挂钩标的情况为“02”或“03”的，应当进一步填写7-1、7-2、7-	

						3、7-4 及 7-5、7-6 “挂钩标的的明细”字段。	
7-1	UnderlyingAssets Type	挂钩标的类型	C(200)	否	数值数组 取值要求如下： 01:权益类 02:大宗商品 03:利率 04:信用类 05:汇率 06:混合类 99:其他	字段 7“挂钩标的的情况”为“03:组合标的的”，即多个挂钩标的的，标的类型之间用“ ”分隔报送，并做好字段 7-1、7-2、7-3、7-4、7-5、7-6 逻辑结构的对应。	1、字段 7“挂钩标的的情况”为“02:单一标的的”或“03:组合标的的”的，本字段为必填。
7-2	UnderlyingAssets Subclass	挂钩标的小类	C(200)	否	数值数组 取值要求如下： 01:境内股票 02:境内股指 03:新三板挂牌股票 04:香港股票 05:香港股指 06:基金及基金专户 07:境内债券 08:境内黄金期货 09:境内国债期货 10:境内股指期货 11:境内其他期货 12:境内黄金现货 13:境内其他现货 14:境外黄金期货	字段 7“挂钩标的的情况”为“03:组合标的的”，即多个挂钩标的的，标的小类之间用“ ”分隔报送，并做好字段 7-1、7-2、7-3、7-4、7-5、7-6 逻辑结构的对应。	1、字段 7“挂钩标的的情况”为“02:单一标的的”或“03:组合标的的”的，本字段为必填。

					15:境外黄金现货 16:境外股票 17:境外股指 18:汇率 19:利率 20:境外国债期货 21:境外股指期货 22:境外其他期货 23:境外其他现货 99:其他标的		
7-3	UnderlyingAssets Name	挂钩标的名称	C(500)	否	文本数组	1、收益凭证挂钩标的全称。 2、挂钩标的有公共代码的，在挂钩标的全称后补充标的代码，二者之间用西文括号分隔，例如“中证小盘500指数(000905.SH)” 。 3、字段7“挂钩标的情况”为“03:组合标的”，即多个挂钩标的的，标的名称之间用“ ”分隔报送，并做好字段7-1、7-2、7-3、7-4、7-5、7-6逻辑结构的对应。	1、字段7“挂钩标的情况”为“02:单一标的”或“03:组合标的”的，本字段为必填。

7-4	UnderlyingAssets InitialPrice	挂钩标的 期初价格	C(200)	否	数值数组	<p>1、单位：元，保留小数点后两位数。</p> <p>2、字段 7“挂钩标的情况”为“03:组合标的”，即多个挂钩标的的，标的期初价格之间用“ ”分隔报送，并做好字段 7-1、7-2、7-3、7-4、7-5、7-6 逻辑结构的对应。</p> <p>3、字段 7-2“挂钩标的小类”为“18:汇率”或“19:利率”的，格式为百分数，保留小数点后四位数。</p>	<p>1、字段 7“挂钩标的情况”为“02:单一标的”或“03:组合标的”的，本字段为必填。</p>
7-5	UnderlyingAssets ExchangeName	挂钩标的 交易场所名称	C(500)	否	文本数组	<p>1、填写具体交易场所名称的全称。</p> <p>2、挂钩标的不在交易场所发行的，填“-”。</p> <p>3、字段 7“挂钩标的情况”为“03:组合标的”，即多个挂钩标的的，标的交易场所名称之间用“ ”分隔报送，并做好字段 7-1、7-2、7-3、7-4、7-5、7-6 逻辑结构的对应。</p>	<p>1、字段 7“挂钩标的情况”为“02:单一标的”或“03:组合标的”的，本字段为必填。</p>

7-6	UnderlyingAssets Weights	挂钩标的权重(%)	C(200)	否	数值数组	<p>1、填写所占名义本金权重，格式为百分数，保留小数点两位数。</p> <p>2、字段 7“挂钩标的情况”为“02:单一标的”，填写“100.00”。</p> <p>3、字段 7“挂钩标的情况”为“03:组合标的”，即多个挂钩标的的，标的权重之间用“ ”分隔报送，并做好字段 7-1、7-2、7-3、7-4、7-5、7-6 逻辑结构的对应。</p> <p>4、多标的组合中取其收益最优、最劣的情况判定收益的产品，该字段可填写“待定”，如“待定 待定”。</p>	<p>1、字段 7“挂钩标的情况”为“02:单一标的”或“03:组合标的”的，本字段为必填。</p>
8	Principal GuaranteeRation	本金保障比例(%)	N(36, 2)	是	数值	<p>1、格式为百分数，保留小数点两位数。</p> <p>2、产品类型“固定收益型”的，本金保障比例为“100.00”。</p> <p>3、产品类型“浮动收益型”的，无本金保障的，本金</p>	<p>1、产品类型“固定收益型”的，本金保障比例为 100%。</p>

						保障比例为“0.00”。 4、产品类型 为“浮动收益 型”的,有本金 保障安排的, 按照约定的 本金保障比 例填写。若存 在多种保障 可能的,按照 最坏情况填 写。	
9	ProductRiskRating	产品风险 评级	C(2)	是	01:R1 低 02:R2 较低 03:R3 中等 04:R4 较高 05:R5 高		
10	ProductScaleUpperLimit	产品规模 上限	C(200)	是	文本	1、单位:元, 保留小数点 后两位数。 2、若为固定 规模的,则上 限为固定规 模的数值,且 产品规模上 限=产品规模 下限。 3、未设定规 模上限的填 “无规模上 限”。	
11	ProductScaleLowerLimit	产品规模 下限	N(36, 2)	是	数值	1、单位:元, 保留小数点 后两位数。 2、若为固定 规模的,则下 限均为固定 规模的数值, 且产品规模 上限=产品规 模下限。	

12	ProductUnitValue	产品单位 面值	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。	
13	IssuingPrice	发行价格	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。	
14	ProductRaisingPeriodInitialDate	产品募集 期起始日	C(10)	是	日期	格式：YYYY-MM-DD。	
15	ProductRaisingPeriodFinalDate	产品募集 期到期日	C(10)	是	日期	格式：YYYY-MM-DD。	
16	ProductDurationPeriodInitialDate	产品存续 期起始日	C(10)	是	日期	格式：YYYY-MM-DD。	
17	ProductDurationPeriodFinalDate	产品存续 期到期日	C(10)	是	日期	格式：YYYY-MM-DD。	
18	DistributionChannel	发行渠道	C(2)	是	01:柜台 02:报价系统		
19	WhetherToProvideTransfer	是否提供 转让	C(2)	是	01:无 02:有		
20	Currency	币种	C(3)	是		人民币填报“CNY”	
21	FixedIncomeRate	约定固定 收益率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、年化收益率。格式为百分数，保留小数点两位数。 2、收益构成含有固定收益的，填写相应的固定收益率数值；未包含固定收益的，固定收益率为“0.00”。	

						3、有多个固定收益率的，填报最高值。	
22	MaxIncomeRate	理论最高收益率 (%)	C(20)	是	文本	1、年化收益率，格式为百分数，保留小数点两位数。 2、无最高收益率限制的，填报“无最高收益率上限”。	
23	MinIncomeRate	理论最低收益率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、年化收益率，格式为百分数，保留小数点两位数。 2、负收益率前要加负号。例如，最低收益率导致的最大亏损为全部本金时，最低收益率为“-100.00”。	1、字段8“本金保障比例”<100%的，最低收益率<0。
24	RepurchaseOption	回购选择权	C	是	文本	1、未设置回购选择权的，填“-”。 2、设置回购选择权的，描述相关回购条款及相应流动性控制条款。	
25	ResaleOption	回售权选择权	C	是	文本	1、未设置回售权的，填“-”。 2、设置回售权的，描述相关回售条款及相应流动性控制条款。	
26	HighVolumeResaleOption	大额回售安排	C	是	文本	1、未设置大额回售选择权的，填“-”。	

						2、设置大额回售选择权的，描述相关大额回售条款及相应流动性控制条款。	
27	ShareTransferOption	份额转让选择权	C	是	文本	1、未设置份额转让选择权的，填“-”。 2、设置份额转让选择权的，描述相关份额转让条款。	
28	ExtensionOption	展期选择权	C	是	文本	1、未设置展期选择权的，填“-”。 2、设置展期选择权的，描述相关条款。	
29	EarlyTerminationarrangement	提前终止安排	C	是	文本	1、未设置提前终止安排的，填“-”。 2、设置提前终止安排的，描述相关条款。	
30	InvestorUpperLimit	投资者数量上限	N(36)	是	整数	1、应当满足场外业务投资者适当性管理要求。	
31	LowestRiskTolerance	投资者风险承受能力等级最低要求	C(2)	是	01:C1 最弱 02:C2 较弱 03:C3 中等 04:C4 较强 05:C5 最强	1、应当与产品风险评级匹配。 2、分类符合《证券期货投资者适当性管理办法》相关要求。	

32	MinimumPurchasingAmount	单个投资者最低认购金额	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。	
33	MinimumHoldingPositionsPerCustomer	投资者持仓最低金额	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。	
34	MaximumHoldingPositionsPerCustomer	单客户持有上限金额	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。 该字段小于等于产品规模上限。	
35	CreditEnhancementType	增信方式	C(500)	是	01:关联方信用担保 02:非关联方信用担保 03:自有资产抵押、质押 04:关联方资产抵押、质押 05:非关联方资产抵押、质押 06:商业保险 07:其他增信措施 08:组合增信 09:无	1、存在多种增信方式的，可多选，不同方式之间用“ ”分隔。	
36	CreditEnhancementDescription	增信说明	C(500)	是	文本	1、增信方式“07:其他增信措施”或“08:组合增信”的，需要进行补充说明；其他情形填“无”。	
37	MortgagedPledgedAssetsType	抵押、质押资产类型	C(500)	是	01:有价证券(含票据) 02:土地、建筑物 03:运输工具	1、存在多种增信方式的，可多选，不同方式之间用“ ”分隔。	

					04:收益权 05:无 99:其他		
38	IssuingScale	发行规模	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。 发行规模=个人投资者持有规模+机构投资者持有规模+产品参与投资的持有规模。具体应当与同时报送的相同产品的	1、发行规模=个人投资者持有规模+机构投资者持有规模+产品参与投资的持有规模。具体应当与同时报送的相同产品的 【3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表】字段“持有金额”汇总数据一致。 2、发行规模不能超过【3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况表】中字段“产品规模上限”。 3、发行规模不能低于【3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况表】中字段“产品规模下限”。
39	NumberOfShareholders	份额持有人数	N(36)	是	整数		1、总投资者数不能超过的 【3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况表】中字段“投资者数量上限”。 2、份额持有人数应当与同时

							报送的【3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表】、【3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细】一致。
40	IndividualInvestorHoldingScale	个人投资者持有规模	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。	1、发行规模=个人投资者持有规模+机构投资者持有规模+产品参与投资的持有规模。 2、个人投资者持有规模应当与同期间报送的【3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表】、【3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细】一致。
41	OrganizationInvestorHoldingScale	机构投资者持有规模	N(36, 2)	是	数值	单位：元，保留小数点后两位数。	1、发行规模=个人投资者持有规模+机构投资者持有规模+产品参与投资的持有规模。 2、机构投资者持有规模应当与同期间报送的【3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表】、【3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细】一致。

42	ProductInvestorHoldingScale	产品参与投资的持有规模	N(36, 2)	是	数值	单位: 元, 保留小数点后两位数。	1、发行规模=个人投资者持有规模+机构投资者持有规模+产品参与投资的持有规模。 2、产品参与投资的持有规模应当与同期间报送的【3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表】、【3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细】一致。
43	Remarks	备注	C	是	文本	1、无备注的, 写“-”。	
附件1 (必须提交)	ProductSpecification	产品说明书	A	是		1.附件名称格式要求为: 产品代码+产品简称+产品说明书。 2、收益凭证产品说明书、认购协议、风险揭示书原则上应加盖公章, 对于加盖部门章、业务章、合同章等其他印章的, 应提供加盖公章的公司授权签章的 PDF 文件。	
附件2 (必须提交)	SubscriptionAgreement	认购协议	A	是		1.附件名称格式要求为: 产品代码+产品简称+认购协议 (合同)。	

						2、收益凭证产品说明书、认购协议、风险揭示书原则上应加盖公章，对于加盖部门章、业务章、合同章等其他印章的，应提供加盖公章的公司授权签章的PDF文件。	
附件3(必须提交)	RiskDisclosureFile	风险揭示书	A	是		1.附件名称格式要求为：产品代码+产品简称+风险揭示书。 2、收益凭证产品说明书、认购协议、风险揭示书原则上应加盖公章，对于加盖部门章、业务章、合同章等其他印章的，应提供加盖公章的公司授权签章的PDF文件。	
附件4(特定提交)	OtherFile Tuple	其他文件	T	否		如需提交其他文件的，需同步提交加盖公司公章，合同专用章或者有授权的收益凭证合同专用章的PDF文件，支持多附件。	

3.2.1.1.1 其他文件

包含在标签<OtherFileTuple>内

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
1	OtherFileName	其他文件	A	否			1、格式必须为 PDF

3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表

包含在标签<ShareDetailsTuple>内

序号	源英文字段名称	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
1	InvestorType	投资者类型	C(2)	是	01:个人 02:机构 03:产品		
2	InvestorCertificateType	投资者证件类型	C(2)	是	01:居民身份证 02:港澳居民来往内地通行证 03:台湾居民来往大陆通行证 04:护照 05:统一社会信用代码营业执照 99:其他	1、投资者为个人的，境内人士优先选居民身份证，境外及港澳台人士优先选护照。	
3	InvestorID	投资者证件号码	C(50)	是	编码	1、个人：证件号码 2、机构：统一社会信用代码 3、产品：在相应协会备案的产品码	为字段 2“投资者证件类型”所选类型的编码。

4	InvestorName	投资者名称	C(200)	是	文本		
5	InvestorSubclasses	投资者子类	C(2)	是	01:证券公司 02:基金公司 03:期货公司 04:基金公司子公司 05:期货公司风险管理公司 06:商业银行 07:保险公司 08:保险子公司 09:信托公司 10:财务公司 11:私募基金 (应以中国基金业协会备案为准) 12:其他金融机构 13:境内非金融机构(一般工商企业) 14:境外金融机构 15:境外非金融机构 16:商业银行子公司 17:证券公司资产管理子公司 18:证券公司其他子公司 19:政策性银行 20:外资银行 21:期货资产管理公司 22:个人 23:公募基金产品 24:资产证券化产品		

					25:资产管理计划 26:信托计划 27:银行理财产品 28:基金专户 29:私募基金产品 99:其他产品		
6	WetherProfessionalInvestor	是否专业投资者	C(2)	是	01:是 02:否		
6-1	InvestorSuitabilityLevel	投资者适当性等级	C(2)	否	01:C1 最弱 02:C2 较弱 03:C3 中等 04:C4 较强 05:C5 最强	是否专业投资者为“02:否”的,应当进一步填报字段6-1“投资者适当性等级”。	
7	HoldingShare	持有份额	N(36,2)	是	数值		
8	HoldingAmount	持有金额	N(36,2)	是	数值	单位:元,保留小数点后两位数。	
9	FreezeMode	冻结状态	C(2)	是	01:正常 02:冻结	冻结是指依据人民法院依法通知,不准被申请人提取或者转移其财产的一种财产保全措施。	
9-1	FreezeShare	冻结份额	N(36,2)	否	数值		字段9:“冻结状态”为“02:冻结”时,此字段必填。
10	ShareRegistrationDate	份额登记日期	C(100)	是	时间	1、时间格式:YYYY-	

						MM-dd HH:mm:ss 。 2、指份额 确 认 日 期，包括 份 额 登 记 为 0 的 情 形。	
11	Remarks	备注	C	是	文本	1、无备注 的,写“-”。	

3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细表

包含在标签<InvestorsChangesTuple>内

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类 型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
1	Investo rType	投资者类 型	C(2)	是	01:个人 02:机构 03:产品		
2	Investo rCertifi cateTy pe	投资者证 件类型	C(2)	是	01:居民身份证 02:港澳居民来往内 地通行证 03:台湾居民来往大 陆通行证 04:护照 05:统一社会信用代 码营业执照 99:其他	1、投资者为 个人的，境 内人士优先 选居民身份 证，境外及 港澳台人士 优 先 选 护 照。	
3	Investo rID	投资者证 件号码	C(50)	是	编码	1、个人：证 件号码 2、机构：统 一社会信用 代码 3、产品：在 相应协会备 案的产品码	为字段 2 “投资者 证 件 类 型”所选 类型的编 码。
4	Investo rName	投资者名 称	C(200)	是	文本		

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类 型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
5	InvestorSubclass	投资者子类	C(2)	是	01:证券公司 02:基金公司 03:期货公司 04:基金公司子公司 05:期货公司风险管理公司 06:商业银行 07:保险公司 08:保险子公司 09:信托公司 10:财务公司 11:私募基金（应以中国基金业协会备案为准） 12:其他金融机构 13:境内非金融机构（一般工商企业） 14:境外金融机构 15:境外非金融机构 16:商业银行业务子公司 17:证券公司资产管理子公司 18:证券公司其他子公司 19:政策性银行 20:外资银行 21:期货资产管理公司 22:个人 23:公募基金产品 24:资产证券化产品 25:资产管理计划 26:信托计划 27:银行理财产品 28:基金专户 29:私募基金产品 99:其他产品		
6	WhetherProfessionallyInvestor	是否专业投资者	C(2)	是	01:是 02:否		

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
6-1	InvestorSuitabilityLevel	投资者适当性等级	C(2)	否	01:C1 最弱 02:C2 较弱 03:C3 中等 04:C4 较强 05:C5 最强	是否专业投资者为“02:否”的,应当进一步填报字段6-1“投资者适当性等级”。	
7	TransactionType	交易类型	C(2)	是	01:认购(+) 02:转入(+) 03:转出(-) 04:提前终止(-) 05:到期终止(-) 06:回购(-) 07:回售(-) 08:部分终止(-) 09:冻结 10:非交易过户(+) 11:非交易过户(-) 99:其他	1、交易类型为“02:转入(+)”、“03:转出(-)”、“10:非交易过户(+)”或“11:非交易过户(-)”的,应当进一步填报字段7-1“转让对手方-类型”、7-2“转让对手方-证件类型”、7-3“转让对手方-ID”、7-4“转让对手方-名称”。 2、交易类型为“99:其他”的,应当进一步填报字段7-5“其他交易类型的交易方向”。	
7-1	TransferCounterpartyType	转让对手方-类型	C(2)	否	01:个人 02:机构 03:产品		字段8“交易类型”为“02:转入(+)”、“03:转出(-)”、“10:

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类 型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
							非交易过 户 (+)" 或 "11: 非 交易过 户 (-)"的, 本 字段为必 填。
7-2	Transfe rCount erparty Certific ateType	转让对手 方-证件类 型	C(2)	否	01:居民身份证 02:港澳居民来往内 地通行证 03:台湾居民来往大 陆通行证 04:护照 05:统一社会信用代 码营业执照 99:其他	1、投资者为 个人的, 境 内人士优先 选居民身份 证, 境外及 港澳台人士 优先选护 照。	字段 8“交 易类型” 为“02: 转 入(+)”、 “03: 转 出(-)”、“10: 非交易过 户 (+)” 或“11: 非 交易过 户 (-)”的, 本 字段为必 填。
7-3	Transfe rCount erparty ID	转让对手 方证件号 码	C(50)	否	编码	1、个人: 证 件号码 2、机构: 统 一社会信用 代码 3、产品: 在 相应协会备 案的产品码	字段 8“交 易类型” 为“02: 转 入(+)”、 “03: 转 出(-)”、“10: 非交易过 户 (+)” 或“11: 非 交易过 户 (-)”的, 本 字段为必 填。
7-4	Transfe rCount erparty Name	转让对手 方-名称	C(200)	否	文本		字段 8“交 易类型” 为“02: 转 入(+)”、 “03: 转 出(-)”、“10: 非交易过 户 (+)”

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类 型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
							或"11:非交易过户(-)"的,本字段为必填。
7-5	OtherTransactionType	其他交易类型的交易方向	C(2)	否	01:份额增加(+) 02:份额减少(-)		字段7"交易类型"为"99:其他"的,本字段为必填。
8	TransactionShare	交易份额	N(36, 2)	是	数值		
9	TransactionAmount	交易金额	N(36, 2)	是	数值	单位:元,保留小数点后两位数。	
10	ShareRegistrationDate	份额变动日期	C(100)	是	时间	1、时间格式:YYYY-MM-dd HH:mm:ss。	
11	Remarks	备注	C	是	文本	1、无备注的,写"-"。	

3.2.2 收益凭证存续期业务情况报送

包含在标签<DurationReport>内

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类 型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
0	BizID	业务编号	C(50)	否			1、补正时必填
1	SecurityCompanyCode	证券公司代码	C(200)	是	编码	1、填写场外证券业务交易对手编码(机构)	
2	SecurityCompanyName	证券公司名称	C(200)	是	文本	1、填写全称	

序号	源英文 字段名	字段名称	数据 类型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
3	ProductCode	产品代码	C(50)	是	编码		
4	ProductFullName	产品全称	C(200)	是	文本		
5	ProductShortName	产品简称	C(200)	是	文本		
6	BusinessStatus	收益凭证 状态(报送 类型)	C(2)	是	01:展期 02:提前 终止 03:到期 终止 04:部分 终止 05:违约 终止 06:转让 07:非交 易过户 08:冻结 99:其他		
6-1		存续期基 本信息		否	字段信息 详见 【3.2.2.1 收益凭证 存续期业 务变动情 况表】	收益凭证状 态(报送类 型)为06:转 让、07:非交 易过户、08: 冻结时无需 报送,其余 状态均需填 报。	
6-2	ShareDetailsTuple	收益凭证 产品投资 者持有份 额明细表	T	否	字段信息 详见 【3.2.1.2 收益凭证 产品投资 者持有份 额明细表 】	收益凭证状 态(报送类 型)为01:展 期时无需 报送,其余 状态均需填 报。	
6-3	InvestorsChan	收益凭证 产品投资	T	否	字段信息 详见	收益凭证状 态(报送类	

序号	源英文 字段名	字段名称	数据 类型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
	gesTuple	投资者变动明细表			【3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细表】	型)为01:展期时无需报送,其余状态均需填报。	
7	Update Date	变动日期	C(100)	是	时间	1、格式: 1、时间格式: YYYY-MM-dd HH:mm:ss。 2、“变动日期”应获取同一产品同期报送的3.2.1.3 收益凭证产品投资者变动明细表最新一条数据的“份额变动日期”;如为展期业务,则取展期业务发生实际时间。	登记日不应当早于【3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况表】的产品存续期起始日。
8	Remarks	备注	C	是	文本	1、无备注的,写“-”。	

3.2.2.1 收益凭证存续期业务变动情况表

序号	源英文 字段名	字段名称	数据类 型	是否 必填	字段取值	填报要求	校验规则
1	TransactionChannel	交易渠道	C(2)	是	01:柜台 02:报价系统		
2	ProductDurationPeriod	产品存续期到期日	C(10)	是	日期	1、格式: YYYY-MM-DD	与【3.2.1.1 收益凭证基础产品信息与发行情况表】的产

	odFinalDate						品存续期到期日一致。
3	LatestExpirationDate	产品最新到期日	C(10)	是	日期	1、格式：YYYY-MM-DD 2、产品展期的，为产品展期后的实际到期日。未展期的，为产品存续期到期日。	
4	ProductTerminationDate	产品终止日	C(10)	是	日期	1、收益凭证状态（报送类型）为提前终止、到期终止、部分终止或违约终止的，填终止日期。格式：YYYY-MM-DD 2、收益凭证状态（报送类型）为展期的，填原“产品最新到期日”。	
5	TerminatedPrincipal	本次终止本金	N(36, 2)	是	数值	1、单位：元，保留小数点后两位数。 2、本次变动不涉及本金终止的，填写“0.00”。	
6	AmountOfInterestPayment	本次利息兑付金额	N(36, 2)	是	数值	1、单位：元，保留小数点后两位数。 2、无利息兑付时，填写“0.00”。	

7	Duratio nScale	存续规模	N(36, 2)	是	数值	单位: 元, 保留小数点后两位数。	1、存续规模=个人投资者持有金额+机构投资者持有金额+产品参与投资的持有金额。具体应当与同时报送的相同产品的【3.2.1.2 收益凭证产品投资者持有份额明细表】“持有金额”汇总数据一致。
8	Accum ulatedT otalRev enue	产品累计 总收益	N(36, 2)	是	数值	1、单位: 元, 保留小数点后两位数。 2、指产品累计兑付收益。产品累计总收益, 是指按照收付实现制原则来计算的已实现的收益。如果只是纯分红, 不涉及产品存续期报送(展期、转让、非交易过户、冻结)情形时, 暂不用报送; 待后续发生报送情形时再据实报送。	
9	RealTo talYield	实际总收 益率(年 化)(%)	C(200)	是	文本	1、按收付实现制来计算相关收益率。 2、产品状态为全部终止(收益凭证状态(报送	

						类型) 取值为 02:提前终止或 03:到期终止或 05:违约终止)的,该数值为最终实际收益率。	
--	--	--	--	--	--	--	--

3.2.3 证券公司月度收益凭证统计数据报送

证券公司月度收益凭证业务统计表

包含在标签<MonthReport>内

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
0	BizID	业务编号	C(50)	否			1、补正时必填
1	Year	数据统计期间-报告年份	C(10)	是	日期	格式: YYYY	1、必须是 4 位整数;
2	Month	数据统计期间-报告月份	C(10)	是	日期	格式: MM	1、必须是 2 位整数;
3	SecurityCompanyCode	证券公司代码	C(50)	是	编码	1、填写场外证券业务交易对手编码(机构)	
4	SecurityCompanyName	证券公司名称	C(200)	是	文本	1、填写全称	
5	DurationScaleAtTheBeginningOfTheMonth	月初存量本金规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元,保留小数点后两位数	

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
6	Durati onScal eAtTh eBegi nning OfThe Month InThe Count erMar ket	其中：柜台 市场月初 存量本金 规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元, 保留小 数点后两位数	
7	Newls suingS cale	新增发行 规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元, 保留小 数点后两位数	新增发行规模 应与本数据统 计期间内 3.2.1.1 收益凭 证基础产品信 息与发行情况 的“发行规模”汇 总数据相一致。
8	Transf erScal e	转让规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元, 保留小 数点后两位数, 如无则填写 “0.00”。	
9	Newls suingS caleIn Count erMar ket	其中：柜台 市场新增 发行规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元, 保留小 数点后两位数	
10	Durati onScal eAtTh eEndO fTheM onth	月末存量 本金规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元, 保留小 数点后两位数	
11	Durati onScal eAtTh eEndO fTheM	其中：柜台 市场月末 存量本金 规模	N(36, 2)	是	数值	单位:元, 保留小 数点后两位数	

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
	onthInTheCounterMarket						
12	MonthlyNetCapitalOfSecuritiesCompanies	证券公司月度净资本	N(36, 2)	是	数值	1、单位:元, 保留小数点后两位数 2、填写截至本月底的净资本	
13	RiskCoverage	风险覆盖率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、格式为百分数, 保留小数点后两位数。	
14	CapitalLeverageRatio	资本杠杆率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、格式为百分数, 保留小数点后两位数。	
15	LiquidityCoverage	流动性覆盖率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、格式为百分数, 保留小数点后两位数。	
16	NetStableCapitalRatio	净稳定资金率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、格式为百分数, 保留小数点后两位数。	
17	NetCapitalDebtRatio	净资本负债率 (%)	N(36, 2)	是	数值	1、格式为百分数, 保留小数点后两位数。	
18	Name	报送方业务代表姓名	C(200)	是	文本		
19	Title	报送方业务代表职务	C(200)	是	文本		

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
20	Telephone	报送方业务代表电话	C(200)	是	文本		
21	Mobile	报送方业务代表手机	C(20)	是	文本		手机号校验
22	Email	报送方业务代表邮箱	C(200)	是	文本		
23	Remarks	备注	C	是	文本	1、无备注的,写“-”。	

3.2.4 收益凭证产品重大事项信息披露

包含在标签<EventReport>内

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
0	BizID	业务编号	C (50)	否			1、补正时必须填
1	ProductCode	产品代码	C(20)	是			
2	ProductFullName	产品全称	C(200)	是			
3	ProductShortName	产品简称	C(200)	是	文本		
4	SecurityCompanyCode	证券公司代码	C(50)	是	编码		
5	SecurityCompanyName	证券公司名称	C(200)	是	文本		
6	OccurredDate	发生日期	C(10)	是	日期	1、格式：YYYY-MM-DD。 2、以重大事项实际发生日期为准。	

7	EventReportFileTuple	重大事项报告文件	T		多附件	字段信息详见【重大事项报告文件】	重大事项是指发生影响场外证券业务正常开展、可能造成投资者非正常重大损失的事件。
---	----------------------	----------	---	--	-----	------------------	---

3.2.4.1 重大事项报告文件

包含在标签<EventReportFileTuple>内

序号	源英文字段名	字段名称	数据类型	是否必填	字段取值	填报要求	校验规则
1	EventReportFileName	重大事项报告文件	A	是			格式必须为PDF;

4 附录

4.1 数据字典

4.1.1 接口标识(BusiDataType)

序号	接口标识	含义
1	A3001	收益凭证发行情况报送表
2	A3002	收益凭证存续期业务情况报送表
3	A3003	收益凭证证券公司定期报告月报
4	A3004	收益凭证产品重大事项信息披露

4.1.2 操作标识(OperationType)

序号	操作标识	含义
1	A	报送信息新增文件
2	U	报送信息补正文件

4.1.3 响应码(RetCode)

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