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。