



中华人民共和国金融行业标准

XX/T XXXXX—XXXX

私募 FOF 底层基金数据传输规范

The Specification of Data Transmission for Sub-funds in Private Fund of
Funds

(送审稿)

XXXX - XX - XX 发布

XXXX - XX - XX 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前言	II
引言	III
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
4 各方权利与义务	2
4.1 授权机制	2
4.2 数据准确性、及时性责任	2
5 数据类别及类型	2
5.1 数据类别	2
5.2 数据类型	2
6 数据内容和格式	3
6.1 基金行情及持仓数据	3
6.2 基金交易类确认数据	4
6.3 基金分红确认数据	5
7 数据文件要求	6
7.1 文件命名	6
7.2 文件结构	6
8 数据传输路径与传输时点	6
附录 A（规范性）数据字典	7
附录 B（规范性）代码取值及描述	8
参考文献	9

前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

本文件由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC 180/SC4）提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）归口。

本文件起草单位：中国证券监督管理委员会、华泰证券股份有限公司、中证信息技术服务有限责任公司、招商证券股份有限公司、国泰君安股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、创金合信基金管理有限公司、海通期货股份有限公司、恒生电子股份有限公司、深圳市金证科技股份有限公司。

本文件主要起草人：姚前、蒋东兴、周云晖、陈欣、陈鹏宇、李欣然、赵磊、钟希敏、路一、刘彬、蔡华、程溯、邓维、董富强、杜金龙、顾晶晶、侯有荣、毛银杰、刘加加、刘三高、刘宗武、卢莹莹、陆雯丽、邵小舟、吴浩原、王美玉、赵斗斗。

引 言

私募 FOF 基金作为资管产品的重要组成部分，其估值核算的主要数据源为所投底层基金相关数据，目前行业内该类数据传输存在规范性、准确性、及时性等问题。私募 FOF 底层基金数据传输规范的制定，有利于统一私募 FOF 底层基金的数据内容与格式，提高底层基金数据传输的质量和效率，防范私募 FOF 基金运营风险，降低行业内耗，提高托管与服务行业整体服务效率。

私募FOF底层基金数据传输规范

1 范围

本文件规定了私募FOF底层基金数据发送方与数据接收方在数据传输过程中，对数据内容和格式的要求。

本文件适用于私募FOF基金及所投底层基金的管理人、基金托管人以及基金服务机构，开展日常运营、托管过程中，所涉及底层基金数据交换场景。

2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB/T 39595—2020 开放式基金业务数据交换协议

JR/T 0177.3—2020 证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第3部分：基金

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

私募基金 private fund

中华人民共和国境内，以非公开方式向投资者募集资金设立的投资基金。

3.2

私募FOF基金 private Fund of Funds

中华人民共和国境内，以非公开方式向投资者募集资金设立的、投资标的包含私募基金（3.1）的投资基金。

3.3

私募FOF底层基金 sub-funds in private Fund of Funds

底层基金

作为投资标的的私募基金（3.1）。

3.4

基金管理人 fund manager

依法从事投资基金管理的基金管理公司。

[来源：GB/T 39595—2020，3.2.1]

3.5

基金托管人 custodian

依法保管基金资产、监督基金管理人（3.4）投资活动的机构。

注：一般获得托管牌照的机构即可成为基金托管人。

[来源：GB/T 39595—2020，3.2.2]

3.6

基金服务机构 fund service institution

为基金管理人（3.4）提供基金募集、投资顾问、份额登记、估值核算、信息技术系统等服务业务的机构。

3.7

数据发送方 data sender

私募FOF底层基金（3.3）的基金管理人（3.4）或其基金服务机构（3.6）。

3.8

数据接收方 data receiver

私募FOF基金（3.2）的基金托管人（3.5）、基金管理人（3.4）或其基金服务机构（3.6）。

3.9

虚拟单位净值 net virtual asset value

基金单位净值扣除对持有份额中的业绩报酬预估值，所得到的基金单位的净资产价值。

4 各方权利与义务

4.1 授权机制

私募FOF底层基金管理人负责底层基金数据发送，或授权其基金服务机构进行数据发送。

4.2 数据准确性、及时性责任

由私募FOF底层基金管理人承担，相关授权基金服务机构根据其于底层基金管理人的服务协议约定承担相应责任，如数据接收方发现数据未按基金合同约定及时发送或数据有误，可对数据发送方做相应提示。

5 数据类别及类型

5.1 数据类别

私募FOF底层基金数据主要包括三类业务数据：基金行情及持仓数据、基金交易类确认数据、基金分红确认数据。数据类别内容见表1。

表 1 数据类别

序号	数据类别	说明
1	基金行情及持仓数据	私募 FOF 基金所持底层基金的单位净值、份额数据。
2	基金交易类确认数据	私募 FOF 基金作为底层基金投资者，相关的交易类业务，包括申购、赎回、强行调增、强行调减、转换等相关数据。
3	基金分红确认数据	底层基金管理人向投资者发放红利/红利再投资的数据。

5.2 数据类型

数据类型说明：

——C, 字符型。如产品代码，C20；

——A, 数字型。限于0—9，如基金净值日期，A8；

——N, 数值型。其长度不包含小数点，可参与数值计算。

6 数据内容和格式

6.1 基金行情及持仓数据

基金行情及持仓数据内容和格式见表2。

表2 基金行情及持仓数据内容和格式

序号	字段名	类型	长度	描述	备注	是否必需
1	TACode	C	18	TA 代码		Y
2	FundCode	C	20	基金代码	底层基金在注册登记系统中设置的基金代码。	Y
3	FundName	C	120	基金名称	可能包含中文英文字符，表示最多 40 个 UTF—8 字符。	Y
4	UpdateDate	A	8	基金净值日期	格式为：YYYYMMDD	Y
5	NAV	N	16（八位小数）	基金单位净值		Y
6	AccumulativeNAV	N	16（八位小数）	累计基金单位净值		Y
7	InvestorName	C	120	投资者名称	作为底层基金投资者的私募 FOF 基金，其产品名称。	Y
8	CertificateNo	C	30	投资者证件号码	作为底层基金投资者的私募 FOF 基金，其基金业协会备案代码。	Y
9	AvailableVol	N	16（两位小数）	持有基金份额		Y
10	VirtualAmount	N	16（两位小数）	虚拟计提金额		N
11	VirtualNAV	N	16（八位小数）	虚拟单位净值		N

6.2 基金交易类确认数据

基金交易类确认数据内容和格式见表3。

表3 基金交易类确认数据内容和格式

序号	字段名	类型	长度	描述	备注	是否必需	代码取值
1	TACode	C	18	TA 代码		Y	
2	FundCode	C	20	基金代码	底层基金在注册登记系统中设置的基金代码。	Y	
3	FundName	C	120	基金名称	可能包含中文英文字符，表示最多 40 个 UTF—8 字符。	Y	
4	TransactionCfmDate	A	8	交易确认日期	格式为：YYYYMMDD	Y	
5	InvestorName	C	120	投资者名称	作为底层基金投资者的私募 FOF 基金，其产品名称。	Y	
6	CertificateNo	C	30	投资者证件号码	作为底层基金投资者的私募 FOF 基金，其基金业协会备案代码。	Y	
7	BusinessCode	A	3	基金业务类型代码	编码见附录 B	Y	DIM01
8	ConfirmedVol	N	16（两位小数）	基金账户交易确认份数	确认的转出基金份额	Y	
9	ConfirmedAmount	N	16（两位小数）	每笔交易确认金额	为投资者的实得金额，不含手续费，含业绩补偿。	Y	
10	Charge	N	10（两位小数）	手续费	投资人应付总手续费	N	
11	AchievementPay	N	16（两位小数）	业绩报酬		N	
12	CodeOfTargetFund	C	20	转换时的目标基金代码		N	
13	TargetFundName	C	120	转换时的目标基金名称	可能包含中文英文字符，表示最多 40 个 UTF—8 字符。	N	
14	CfmVolOfTargetFund	N	16（两位小数）	目标基金的确认份数	确认的转入基金份额。	N	
15	CfmAmountOfTargetFund	N	16（两位小数）	目标基金的确认金额	确认的转入基金金额	N	
16	TASerialNO	C	20	TA 确认交易流水号		Y	

6.3 基金分红确认数据

基金分红确认数据内容和格式见表4。

表4 基金分红确认数据内容和格式

序号	字段名	类型	长度	描述	备注	是否必需	代码取值
1	TACode	C	18	TA 代码		Y	
2	FundCode	C	20	基金代码	底层基金在注册登记系统中设置的基金代码。	Y	
3	FundName	C	120	基金名称	可能包含中英文字符，表示最多 40 个 UTF—8 字符。	Y	
4	TransactionCfmDate	A	8	交易确认日期	格式为：YYYYMMDD	Y	
5	InvestorName	C	120	投资者名称	作为底层基金投资者的私募 FOF 基金，其产品名称。	Y	
6	CertificateNo	C	30	投资者证件号码	作为底层基金投资者的私募 FOF 基金，其基金业协会备案代码。	Y	
7	DefDividendMethod	A	1	默认分红方式	取值见附录 B	Y	DIM02
8	RegistrationDate	A	8	权益登记日期	格式为：YYYYMMDD	Y	
9	DividendAmount	N	16（两位小数）	基金账户红利资金	红利总金额，含冻结红利及再投资红利。	Y	
10	ConfirmedAmount	N	16（两位小数）	每笔交易确认金额	实发红利资金，不含冻结红利及再投资红利。	Y	
11	DividendforReinvestment	N	16（两位小数）	再投资红利金额		Y	
12	VolOfDividendforReinvestment	N	16（两位小数）	基金账户红利再投资基金份数	投资者实得红股，含被续冻的红股。	Y	
13	AchievementPay	N	16（两位小数）	业绩报酬		N	
14	TASerialNO	C	20	TA 确认交易流水号		Y	

7 数据文件要求

7.1 文件命名

私募FOF底层基金数据文件采用CSV文件格式，其命名应具有唯一性，易于辨识、存储与检索。文件命名划分为5个子域，各部分之间以“_”分隔，大小写不敏感，以“.CSV”作为“后缀名”。其命名规则如下：

文件日期_数据类别_TA代码_接收方代码_批次号_其他说明

其中：

——文件日期：格式为YYYYMMDD；

——数据类别：采用底层基金数据类别缩写，基金行情及持仓数据缩写为HQCC，基金交易类确认数据缩写为JYQR，基金分红确认数据为FHQR；

——TA代码：数据发送方作为底层基金注册登记机构，其TA代码；

——接收方代码：基金管理人/基金托管人/注册登记机构的代码；

——批次号：01—99，支持一个文件日期下多批次的文件；

——其他说明：根据实际情况自定义，最大长度32位。

域与域之间通过半角逗号（0x4C）分隔，转义字符采用半角双引号（0x42）。

如域内容中包含半角逗号，一律使用字符串形式“,”；如域内容中包含半角双引号，一律替换为其转义字符“””。

7.2 文件结构

私募FOF底层基金数据文件的结构如下：

——数据格式均为半角字符，字符不区分大小写；

——第一行为域名，列举本文件所包含数据域的字段标识；

——第二行开始为数据内容，数据内容的顺序必需与第一行数据域的顺序保持一致；

——根据数据域“必需”属性，数据域分为“必需”（“必需”属性为“Y”）和“非必需”（“非必需”属性为“N”）两类。

——“必需”的数据域不能裁剪，必需包含在文件内容中；“非必需”的数据域可根据各实际业务进行裁剪，部分包含在文件中；

——“必需”的数据域和选择包含的“非必需”的数据域的英文名称需要在第一行中列举；

——对于整数和浮点数类型的数据域内容，统一转换成字符串类型并使用“”进行转换。

8 数据传输路径与传输时点

私募FOF底层基金管理人或其授权的基金服务机构，应每日将私募FOF底层基金数据发送至数据接收方指定路径。任何一方数据传输路径如发生变更，应提前以有效形式通知其他相应方变更时间、变更事项等。

数据发送方应当于基金合同约定的估值日当天24:00前将完成数据发送。如遇法定节假日和公休日，数据发送顺延至法定节假日和公休日后第一个工作日（交易日）。

附 录 A
(规范性)
数据字典

数据字典内容见表A.1。

表 A.1 数据字典

序号	字段名	类型	长度	描述	代码取值/ 备注
1	TACode	C	18	TA 代码	
2	FundCode	C	20	基金代码	
3	FundName	C	120	基金名称	
4	UpdateDate	A	8	基金净值日期	
5	NAV	N	16 (八位小数)	基金单位净值	
6	AccumulativeNAV	N	16 (八位小数)	累计基金单位净值	
7	InvestorName	C	120	投资者名称	
8	CertificateNo	C	30	投资者证件号码	
9	AvailableVol	N	16 (两位小数)	持有基金份额	
10	VirtualAmount	N	16 (两位小数)	虚拟计提金额	
11	VirtualNAV	N	16 (八位小数)	虚拟单位净值	
12	TransactionCfmDate	A	8	交易确认日期	
13	BusinessCode	A	3	基金业务类型代码	DIM01
14	ConfirmedVol	N	16 (两位小数)	基金账户交易确认份数	
15	ConfirmedAmount	N	16 (两位小数)	每笔交易确认金额	
16	Charge	N	10 (两位小数)	手续费	
17	AchievementPay	N	16 (两位小数)	业绩报酬	
18	CodeOfTargetFund	C	20	转换时的目标基金代码	
19	TargetFundName	C	120	转换时的目标基金名称	
20	CfmVolOfTargetFund	N	16 (两位小数)	目标基金的确认份数	
21	CfmAmountOfTargetFund	N	16 (两位小数)	目标基金的确认金额	
22	TASerialNO	C	20	TA 确认交易流水号	
23	DefDividendMethod	A	1	默认分红方式	DIM02
24	RegistrationDate	A	8	权益登记日期	
25	DividendAmount	N	16 (两位小数)	基金账户红利资金	
26	DividendforReinvestment	N	16 (两位小数)	再投资红利金额	
27	VolOfDividendforReinvestm ent	N	16 (两位小数)	基金账户红利再投资基金份 数	

附 录 B
(规范性)
代码取值及描述

B.1 业务类型代码

业务类型代码取值见表B.1。

表 B.1 业务类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
基金业务类型代码 /DIM01	122	申购确认
	124	赎回确认
	144	强行调增
	145	强行调减
	136	转换确认
	130	基金成立
	150	基金清盘

B.2 分红方式代码

分红方式代码取值见表B.2。

表 B.2 分红方式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
分红方式代码/DIM02	0	红利转投
	1	现金分红

参 考 文 献

- [1] 《中华人民共和国证券法》
 - [2] 《中华人民共和国证券投资基金法》
 - [3] 关于规范金融机构资产管理业务的指导意见（银发〔2018〕106号）
 - [4] 《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第105号）
 - [5] 《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第151号）
 - [6] 《证券投资基金托管业务管理办法》（证监会令第172号）
 - [7] 《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31号）
 - [8] 《中国基金估值标准2018》中国证券投资基金业协会
 - [9] 《私募投资基金服务业务管理办法（试行）》中国证券投资基金业协会
 - [10] GB/T 39595—2020 开放式基金业务数据交换协议
 - [11] JR/T 0177.3—2020 证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第3部分：基金
-