

# 连接金融生态 共筑数字未来

**FDEP** 金融数据交换平台  
Financial Data Exchange Platform

**FDEP2023年技术培训会**

2023/07/14



深圳证券交易所  
SHENZHEN STOCK EXCHANGE



深圳证券通信有限公司  
SHENZHEN SECURITIES COMMUNICATION CO.,LTD.



# FDEP 发展历程

服务行业  
20 载

2003

金融数据交换平台  
(FDEP) 文件传输  
系统上线

2006

消息系统上线，应  
用于三方存管业务

2008

三方存管业务应用  
扩展到融资融券场  
景

2009

FDEP开始应用于电  
子对账业务

2013

FDEP v4上线

2013

三方存管业务应用  
扩展到银行衍生品  
业务

2014

转融通业务上线

2015

基金互认服务平台  
上线

2015

荣获“第五届中国证  
券期货科学进步奖”  
一等奖

2016

FISP、基  
金实时申  
赎业务上  
线



# FDEP 发展历程

服务行业  
20 载

13

P v4上线

2013

三方存管业务应用  
扩展到银行衍生品  
业务

2014

转融通业务上线

2015

基金互认服务平台  
上线

2015

荣获“第五届中国证  
券期货科学进步奖”  
一等奖

2016

FISP、基金实时申  
赎业务上线

2019

FDEPv5上线

2020

券商结算模式交易委托  
指令传输服务上线

2021

个人养老金基  
金行业平台服  
务上线

2021

理财产品委外  
业务数据传输  
服务上线



## 证券公司

覆盖国内全部140+家证券公司，业务涵盖经纪业务、自营、资管、托管、代销业务等

## 基金公司

覆盖国内全部140+家公募基金，业务涵盖基金代销、资产托管、转融通、监管报送等

## 资管机构

各类160+家资产管理机构，包括保险资产管理、资管子公司、私募基金等

## 第三方基金销售

全覆盖90+家独立第三方销售机构

## 境外机构

香港金管局；100+家中外资券商、基金、信息商；国际服务商等

## 其他各类型机构

财务管理机构、投资顾问、金融服务机构等  
包括信息商、服务厂商

## 核心机构

交易所、证监会、中证登、证金公司、股转公司、报转公司、新三板、中债登、社保理事会等

## 银行及理财子公司

包括全市场的持牌证券存管银行、资产托管银行，另外还包括城商行、农商行，共140+家；全覆盖已开业的近30家银行理财子

## 信托、期货

覆盖70+家信托公司及  
110+家期货公司



金融数据交换平台  
Financial Data Exchange Platform



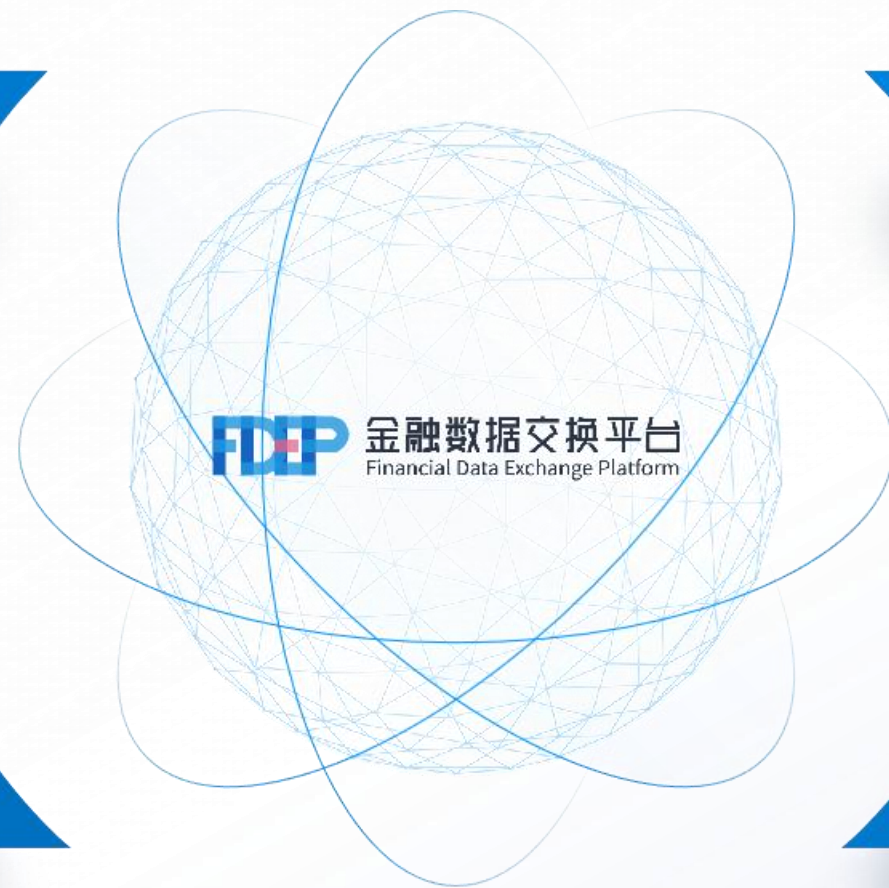


深圳证券通信有限公司  
SHENZHEN SECURITIES COMMUNICATION CO.,LTD.



金融数据交换平台  
Financial Data Exchange Platform

覆盖全国行业用户  
互通全球金融机构





# 金融数据交换平台

文件传输

1300家用户

安全运行

二十年

FDEP

基金互认

券商交易结算模式

基金直销

开放式基金

253TB文件

FISP

3208个小站

融资融券

文件

消息

场外基金

FOF实时

电子对账

银行业务

146亿收发包

监管报送

个人养老金

三方存管

QDIIQFII

中证易签

投票

私募报转

代销

用户报表

54069条关系对

转融通

基金实时申赎

基金销售费用对账

理财委外业务



社会效益  
4大价值



降低行业成本



服务行业科技监管

保障行业信息安全



促进行业创新发展





**文件传输/路由模式**  
 投资建议书  
 投顾策略

券商/期货公司  
 资管机构/独立咨询机构

投前

**券结交易委托模式/路由模式**  
 投资交易  
 交易委托单

交易券商  
 销售机构

**基金实时申赎**  
 理财产品投资/FOF

SPV, 委外机构

**理财委外业务**  
 私募投资  
 专户管理

**FISP业务**  
 场外基金投资

中登公司

**转融通**  
 转融券

证金公司

**FIX平台**  
 QDII业务

境外平台/金融机构

投中

**资管机构**  
 (公募、券商资管、理财子  
 信托、保险、独立管理机构)

投后

销售

**电子对账**  
 托管户划款、对账

托管行

**私募报转**  
 私募产品报价、转让

中证机构

**理财委外业务**  
 底层资产  
 估值穿透管理

SPV, 委外机构

**文件传输**  
 监管报送

证监会

**文件传输**  
 基金代销

**开放式基金**

销售机构

**个人养老金基金行业平台**  
 参与养老型基金业务

中登公司

**基金销售费用对账**  
 销售佣金核对

销售机构

**基金互认**  
 基金南下销售

代理机构





## 业务场景

- 券商结算模式：基金公司与证券公司签署备忘录，约定由证券公司作为经纪商，代理公募基金产品在交易所进行证券交易及资金交收等事宜
- 该模式下，基金公司需要将交易委托指令提交给证券公司，再由证券公司将其委托订单向交易所报单，后将处理结果反馈给基金公司

## 适用机构

基金公司、证券公司





## 业务场景

- FISP：中登机构投资者场外投资业务平台
- 主要应用于采用第三方托管模式的非法人产品的场外开放式基金投资业务，同时也支持无托管人模式的场外开放式基金投资业务。
- 系统连接采用接口直连模式，以FDEP作为通讯平台。

## 适用机构

业务身份	参与人	使用FISP开展何种业务
投资管理人	证券公司、期货公司、报销公司、信托公司、期货公司、其他	维护投管产品信息、发起投管产品的账户类业务、交易类业务、接受账户类和交易类回报等
销售机构	基金公司直销、代销	维护销售产品行情、接收投管人账户和交易申请、通知账户类和交易类业务回报等
托管机构	商业银行、非银行金融机构	投管产品信息审核、接受账户类业务和投资类业务回报等





## 业务场景

代销机构通过FDEP消息平台，向公募基金、银行理财子等资产管理人发送开户、申购、赎回等实施指令，资管机构收到并确认后返回结果信息

## 适用机构

资产管理人、代销机构

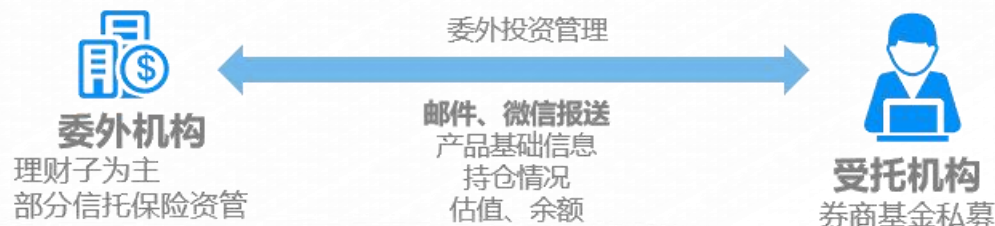




## FDEP与营安科技合作推出，面向理财子等资管机构的一项服务， 提升业务运营全过程全流程效率

### 业务背景

银行理财的各个部门具有大量与受托机构之间频繁交互SPV信息的需求（例如净值信息、持仓资产信息、交易流水信息等）



缺乏专门有效的数据管理系统，委外数据采集、分析、整合存在以下几个问题：

**01** 底层数据来源的准确性、完整性和及时性问题

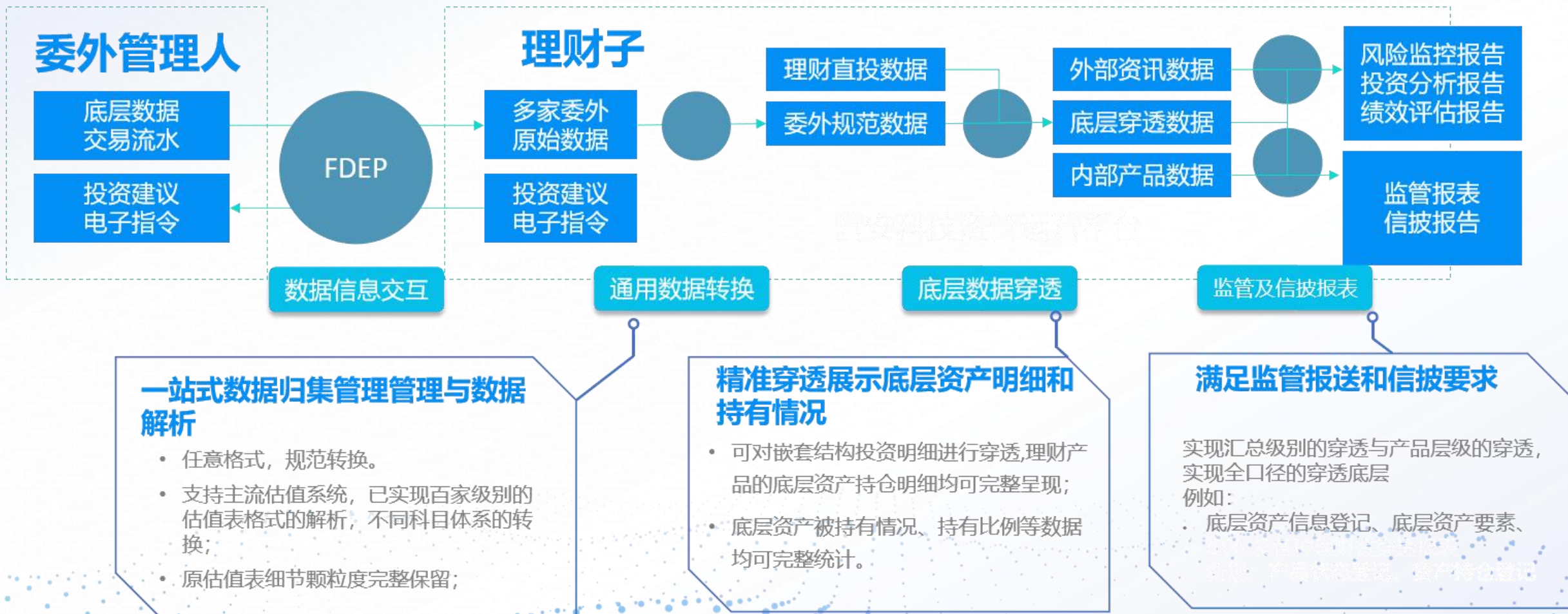
公司全口径的风控和绩效评估数据的滞后性 **02**

**03** 资讯数据源缺乏清洗校验影响监管报送数据质量

监管报送报表生成数据的准确性和时限压力 **04**



## FDEP与营安科技合作推出，面向理财子等资管机构的一项服务，提升业务运营全过程全流程效率



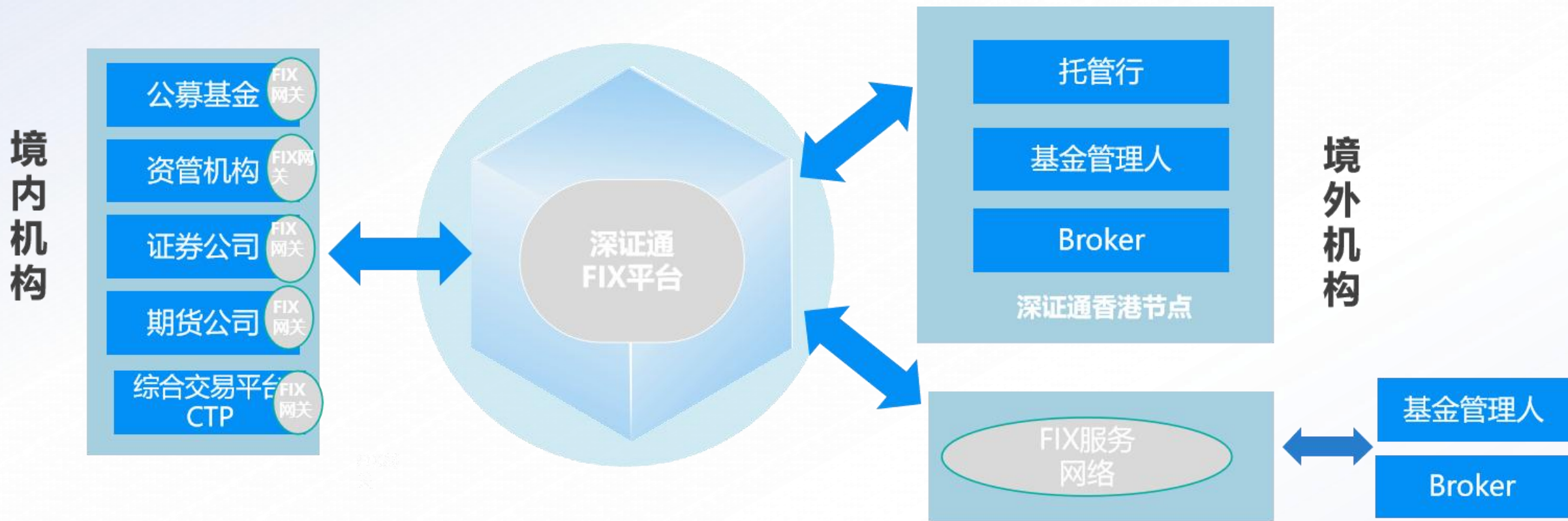


**转融通是指公募基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向证券金融公司出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务**





## 基于FIX协议的跨境综合交易服务平台



平台功能:

交易指令

成交结果

对账数据

清算数据



## FDEP2019年推出的V5版在原接口上新增实时文件传输接口，实现 电子对账业务实时指令与划款附件的同步传输



### 业务场景

公募基金、银行理财子、信托、券商/保险资管等各类资管机构与托管银行间关于托管资产的实时划款指令、对账指令传输

### 适用机构

资管机构及托管机构

### 业务规模

- 支持大陆**全部**托管银行对账指令传输及**大部分**托管银行划款指令传输
- 覆盖大陆**全部**公募基金、20+家银行理财子、50+家资产管理机构及信托、城商行等





根据规则要求，基金销售过程中，每日的TA数据需要报送中登中央数据交换平台（CTP），FDEP则作为CTP的底层通信系统。





## 业务场景

- 2022年11月25日，个人养老金制度启动实施，投资者可建立个人养老金账户，并购买由监管部门认定的理财、公募基金、养老保险的产品。
- 对于参与个人养老金业务的公募基金产品，由中登建设个人养老金基金行业平台，为市场参与机构提供开户、申赎、查询等服务
- 系统连接采用接口直连模式，以FDEP作为通讯平台。

## 适用机构

证券公司、商业银行、独立基金销售机构等





- ✓为内地和香港基金拓展两地销售渠道提供平台服务
- ✓有效降低基金销售成本
- ✓促进基金市场互联互通

申购金额累计**600亿**人民币

**21家**香港参与机构

**53家**内地参与机构

**3个**国际服务平台



**中国证券期货业南方信息技术中心**是深圳证券交易所贯彻落实国家关于“加快5G、数据中心等新型基础设施建设”以及“加快金融市场基础设施建设”决策部署和中国证监会《资本市场信息化建设总体规划》要求，以打造“世界一流的行业信息技术中心”为目标，高起点、高标准建设的为中国证券期货业服务的数字化金融基础设施。

由深圳证券交易所下属机构—东莞深证通信息技术有限公司负责建设与运营。



## 整体规划

- 位于**广东省东莞市**，地处粤港澳大湾区核心区域（距深圳市区28公里，距香港33公里）
- 占地面积**13.5万平方米**，建筑面积**29万平方米**，机柜规模约**20,000个**
- 机房按照国标GB50174 A级、国际Uptime Tier III/IV 等级标准设计建造

## 两期建设

- **一期项目（已投产）**  
2016年投产，建筑面积约**4.4万m<sup>2</sup>**，机柜规模约**5,000个**  
目前已进驻证券、基金、期货等行业机构**160余家**
- **二期项目（建设中）**  
计划**2023年底前**投产，建筑面积约**25万m<sup>2</sup>**，机柜规模约**15,000个**



# 中国证券期货业南方信息技术中心

## 机房环境

- 冷通道封闭
- 标准19英寸机柜，高度42U/47U，承重600kg
- 机房架空地板最大可承重1,000kg/m<sup>2</sup>
- 建筑抗震设防烈度7度
- 满足三级防雷要求

## 机柜用电标准

- 一期：单机柜用电标准3kVA
- 二期：单机柜用电标准4kVA

## 网络接入

- 支持多家基础电信运营商接入
- 区分交易/综合托管机柜，每个交易托管机柜提供主备两条光纤线路接入至深市交易结算系统





# 用户服务 报表

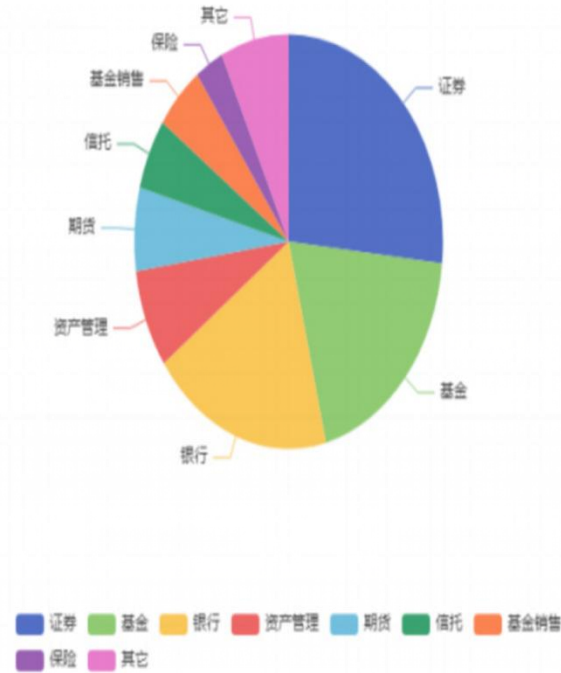




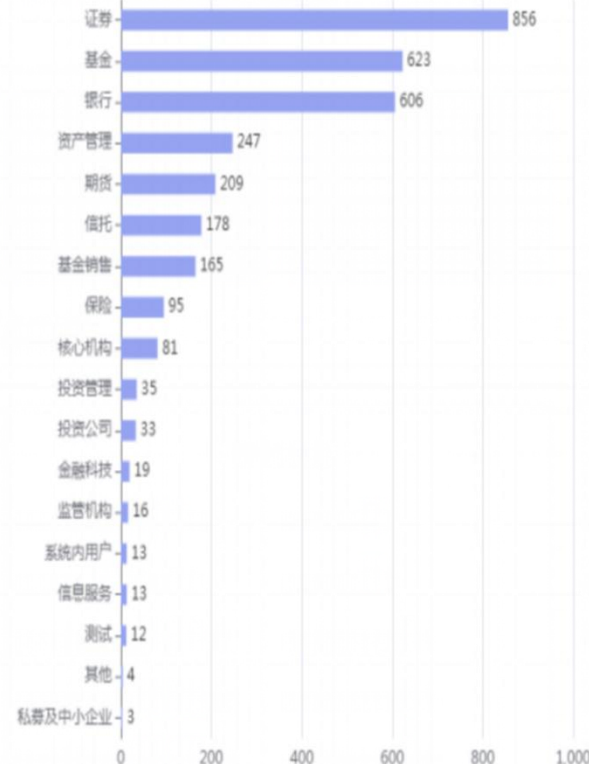
文件

本端小站号	对端小站号
1 ABCHINA01	S_BHZQ2
2 ABCHINA01	S_BOCI
3 ABCHINA01	S_CASS
4 ABCHINA01	S_CCZQ
5 ABCHINA01	S_CINDA
6 ABCHINA01	S_CNHT
7 ABCHINA01	S_CSCO
8 ABCHINA01	S_FCSC

小站行业分布



单位:个



数据更新于 2023 年 06 月

文件系统: /...  
消息系统: /...



文件传输情况

本月已传数据 **7.23 KB**

本月已收发文件 **9** 个

本月平均每日传数据 **246 B**

本月平均每日收发文件 **0** 个

本月单日收发文件数峰值 **3** 个





FDEP 金融数据交换平台 | 客户服务月报

数据更新于 2023 年 06 月

文件系统: /

消息系统: /

传输数据

今年传输数据 **564.27 MB**  
本月新增 **7.23 KB**

业务关系对

总关系对 **432 对**  
本月新增 **0 对**

消息业务已超过 **99.7%** 全网用户、**98.0%** 同业用户

文件业务已超过 **88.1%** 全网用户、**91.5%** 同业用户



传输数据

消息传输情况

今年已传数据 <b>564.26 MB</b>	本月已传数据 <b>0 B</b>
今年已收发包 <b>2.93</b> 百万个	本月已收发包 <b>0</b> 个
今年平均每月传数据 <b>94.04 MB</b>	本月平均每日传数据 <b>0 B</b>
今年平均每月收发包 <b>48.86</b> 万个	本月平均每日收发包 <b>0</b> 个
今年单日收发包峰值 <b>86.56</b> 万个	本月单日收发包峰值 <b>0</b> 个

文件传输情况

今年已传数据 <b>7.23 KB</b>	本月已传数据 <b>7.23 KB</b>
今年已收发文件 <b>9</b> 个	本月已收发文件 <b>9</b> 个
今年平均每月传数据 <b>1.21 KB</b>	本月平均每日传数据 <b>246 B</b>
今年平均每月收发文件 <b>1</b> 个	本月平均每日收发文件 <b>0</b> 个
今年单日收发文件数峰值 <b>3</b> 个	本月单日收发文件数峰值 <b>3</b> 个

总数 **714 对**

关系对上线

单位: 对



单位: KBit

单位: KBit

对端小站号

S\_BHZQ2

S\_BOCl

S\_CASS

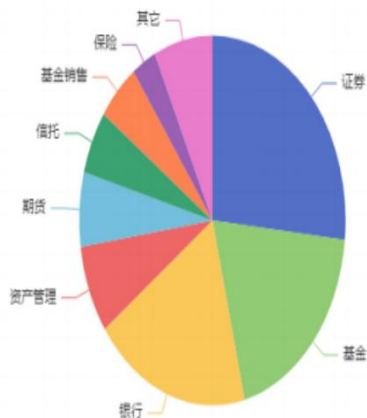
S\_CCZQ

S\_CINDA

S\_CNHT

S\_CSCO

S\_FCSC



■ 证券 ■ 基金 ■ 银行 ■ 资产管理 ■ 期货 ■ 信托 ■ 基金销售  
■ 保险 ■ 其它





传输数据

今年传输数据 **564.27 MB**  
本月新增 **7.23 KB**

业务关系对

总关系对 **432 对**  
本月新增 **0 对**

传输数据

消息传输情况

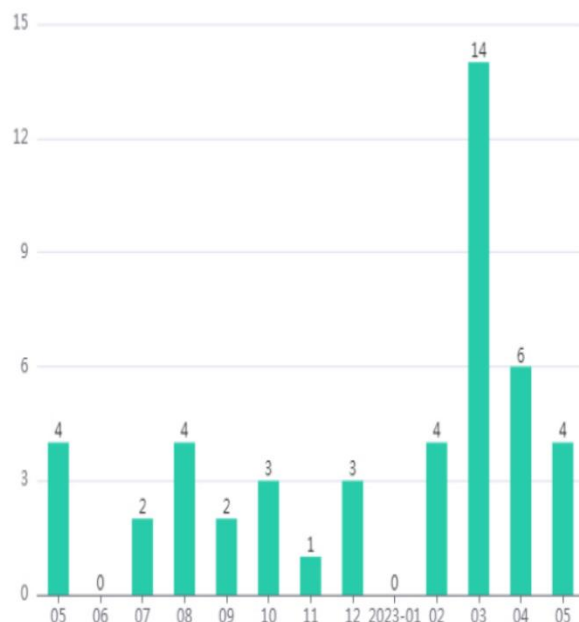
今年已传数据 **564.26 MB**      本月已传数据 **0 B**  
 今年已收发包 **2.93 百万个**      本月已收发包 **0 个**  
 今年平均每月传数据 **94.04 MB**      本月平均每日传数据 **0 B**  
 今年平均每月收发包 **48.86 万个**      本月平均每日收发包 **0 个**  
 今年单日收发包峰值 **86.56 万个**      本月单日收发包峰值 **0 个**

业务关系对

消息关系对总数 **156 对**

关系对上线

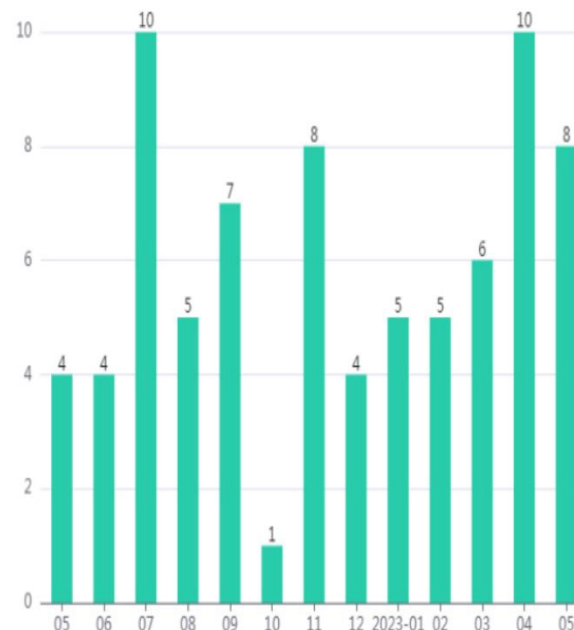
单位：对



文件关系对总数 **714 对**

关系对上线

单位：对



单位：KBits/s



单位：KBits/s



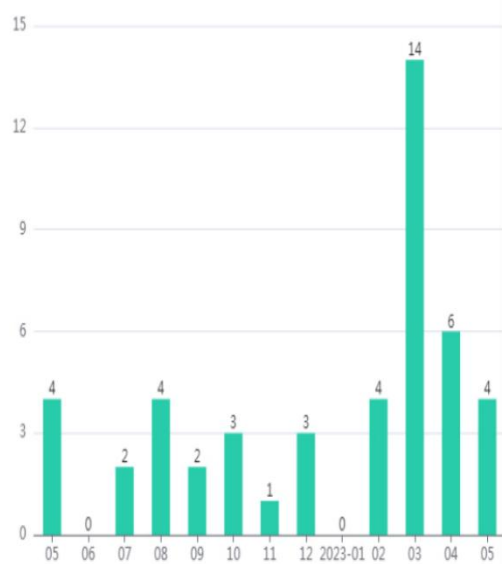


## 业务关系对

消息关系对总数 156 对

关系对上线

单位：对



消息传输-每日带宽占用(近一月平均值)

单位：KBits/s



文件传输-每日带宽占用(近一月平均值)

单位：KBits/s



对端公司名

上线时间

渤海证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

中银国际证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

华金证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

长城证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

信达证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

恒泰证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

世纪证券有限责任公司

2019-01-01 00:00:00

第一创业证券股份有限公司

2019-01-01 00:00:00

623  
606

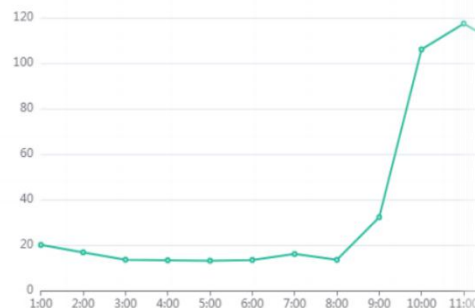
600



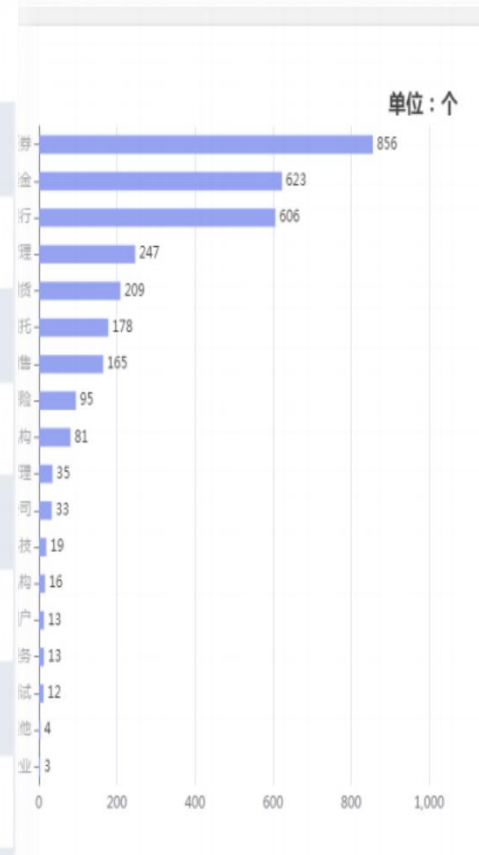
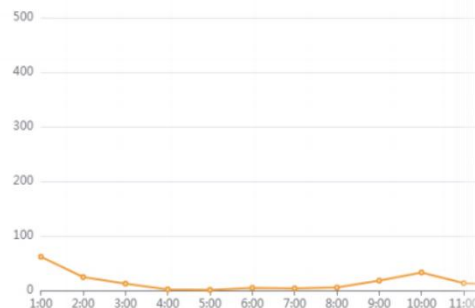
### 文件传输-关系对清单

序号	本端小站号	对端小站号	对端公司名	上线时间
1	ABCHINA01	S_BHZQ2	渤海证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00
2	ABCHINA01	S_BOIC	中银国际证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00
3	ABCHINA01	S_CASS	华金证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00
4	ABCHINA01	S_CCZQ	长城证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00
5	ABCHINA01	S_CINDA	信达证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00
6	ABCHINA01	S_CNHT	恒泰证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00
7	ABCHINA01	S_CSCO	世纪证券有限责任公司	2019-01-01 00:00:00
8	ABCHINA01	S_FCSC	第一创业证券股份有限公司	2019-01-01 00:00:00

消息传输-每日带宽占用(近一月平均值)



文件传输-每日带宽占用(近一月平均值)



数据更新: ...  
文件系统: ...  
3.0% 同业用户  
1.5% 同业用户  
情况  
本月已传数据 7.23  
本月已收发文件 9个  
本月平均每日传数据 2  
本月平均每日收发文件  
本月单日收发文件数峰值