

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0294.2—2024

金融市场交易报告数据要素指南
第2部分：全球唯一交易识别码

Guidance on data elements of financial market trade reporting
—Part 2: Unique transaction identifier

2024-09-03 发布

2024-09-03 实施

中国人民银行
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 UTI 的基本特征..... | 2 |
| 5 UTI 的使用方法及技术指引..... | 3 |
| 参考文献..... | 7 |

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。

本文件是JR/T 0294—2024《金融市场交易报告数据要素指南》的第2部分。JR/T 0294—2024已经发布了以下部分。

——第1部分：全球唯一产品识别码。

——第2部分：全球唯一交易识别码。

——第3部分：其他关键数据要素。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）提出并归口。

本文件起草单位：中国人民银行科技司，中国证券监督管理委员会科技监管司、期货监管司，中国人民银行浙江省分行、中国期货市场监控中心有限责任公司、北京国家金融标准化研究院有限责任公司、成方金融科技有限公司、银行间市场清算所股份有限公司。

本文件主要起草人：李伟、杨富玉、李兴锋、蒋东兴、李钟、张小雪、冯蕾、刘子群、周云晖、王蕾蕾、杨光、程莘、巫伟斐、杨志、孙坚、蒋梦凌、邢向飞、毕向群、刘萌、凌肯、秦菁、周夕崇、谢彦丽、张晋钰、薄舜添、唐卓、李佳凝、姜才康、茅廷、胡冰冰、林茜漾、何鹏、卢欢、邓浩然。

引 言

2009年二十国集团（G20）峰会提出，为提高市场透明度和降低系统性风险，所有场外衍生品合约均需向交易报告库（TR）报告，这是场外衍生品市场改革的重要一环。2014年金融稳定理事会（FSB）发布了关于建立全球数据标准机制的可行性研究报告，认为应引入全球法人识别编码（LEI）以及创建全球唯一交易识别码（UTI）和全球唯一产品识别码（UPI）。

为了更好地为我国金融市场交易报告制度建设提供标准支持，现根据支付与市场基础设施委员会（CPMI）和国际证监会组织（IOSCO）发布的《UTI协调技术指南》制定本文件，旨在为需要全球识别的金融交易分配唯一字符串，提出UTI的标准化格式和结构，以及UTI生成原则，使UTI能够成为跨系统、跨流程的参考数据要素。

金融市场交易报告数据要素指南

第2部分：全球唯一交易识别码

1 范围

本文件提供了对场外衍生品交易进行全球唯一识别的要素，以及生成全球唯一交易识别码（UTI）的指引。

本文件适用于中华人民共和国境内法人机构向交易报告库（TR）报告的场外衍生品交易。

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 42495.1—2023 金融服务 全球法人识别编码 第1部分：编码说明（ISO 17442-1:2020，IDT）

ISO 23897 金融服务 全球唯一交易识别码（Financial services—Unique transaction identifier）

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

全球唯一交易识别码 unique transaction identifier; UTI

在交易主体和（或）在该交易发生的管理体系的认可下，分配给一笔金融交易的全球唯一字符串。

3.2

交易报告库 trade repository; TR

集中保存场外衍生品交易数据电子记录的金融基础设施。

3.3

生成方 generating entity

创建并分配编码给某笔金融交易（3.4）的法定实体。

注：法定实体指根据法律成立的组织。

3.4

金融交易 financial transaction

2 个或多个主体之间进行的、涉及共同定义的金融产品的交易。

4 UTI 的基本特征

4.1 全球统一

UTI在全球范围内适用，并且UTI的生成宜符合CPMI和IOSCO的要求。UTI的生成宜足够灵活以满足场外交易报送规则（例如单边报送或双边报送）。

4.2 一一对应

每个可报告的交易都有唯一的UTI，不同的可报告交易应具备独有的UTI。若某一交易不再进行，其UTI则不再使用。

4.3 报告一致

为便于交易匹配，避免重复计数，即使某一交易被多次报告，也具有相同的UTI。

注：交易匹配出现在同一交易被多次报告的情况，例如交易双方均被要求报送交易数据。

4.4 编码不变

为便于交易报告的修订和更新，交易在其整个生命周期内保持相同的UTI。

一些影响现有场外衍生品交易生命周期的事件会产生1个或多个新的可报告交易，这些可报告交易都需要新的UTI。

注：需要新UTI的情况包括但不限于以下内容。

- a) 更替，例如交易的中央对手方变更或交易对手方之一变更。
- b) 分配，例如对各个交易对手分配区块。
- c) 净额清算和交易压缩等。

4.5 便于追溯

为便于理解交易的发展，并提供审计跟踪，如果某一交易被另一个具有不同UTI的交易取代，那么在这种UTI变更前后宜有方法关联到被取代的交易。

4.6 方法清晰

产生UTI的方法宜清晰且无歧义。

注：产生UTI的方法宜明确以下几点。

- a) 需要UTI的情况。
- b) UTI生成方。
- c) 生成UTI的时间。
- d) UTI编码结构。
- e) 交易变更需要生成新UTI的情况。

4.7 生成及时

为便于市场参与者遵守UTI的报送要求，当机构需要UTI来标识交易时，可及时生成或获取UTI。同样，UTI的生成方宜及时与相关机构分享UTI，以便相关机构履行报告义务。

4.8 标识共存

创建UTI的方法不宜影响已存在的交易标识,并且尽可能不造成问题,特别是对1组交易进行分析时,UTI和已存在的交易标识可同时出现。

4.9 广泛灵活

UTI生成方法宜适用于各种场外衍生品报告制度,且有足够的灵活性。

注:1.UTI可适用的范围如下。

- a) UTI 可适用于全球被归类为“场外衍生品”且出于报告目的需使用 UTI 的任何交易。
 - b) 场外衍生品交易的 UTI 方案可能与其他交易兼容或适用。
2. 某一交易可能被多次报告,这些报告可能会向同一 TR 或不同的 TR 提交,具体原因如下。
- a) 交易双方均被要求报告(即双边报送)。
 - b) 在跨司法管辖区的交易中,交易双方和其他各方都需要报告,即使司法管辖区可能只需要单边报送。
 - c) 更新现有报告。

4.10 易于展示

UTI的格式和表述宜单一(例如字母)且全球适用,并且可通过金融交易传输并在计算机显示器上清晰可见。

4.11 长期有效

UTI在可预见的未来长期有效。

4.12 交易匿名

在公布交易报告信息时,UTI不宜暴露场外衍生品合约的交易对手方信息。

5 UTI 的使用方法及技术指引

5.1 可报告交易

可报告交易使用UTI情形如下。

- a) 每个可报告交易宜有区别于任何其他交易的UTI。
- b) 若某一交易被多次报送,则使用同一UTI。

5.2 生命周期事件对UTI的影响

当UTI被分配给某一可报告交易时,该UTI在整个生命周期中一直作为该交易的标识符。当某一交易终止并替换为1个或多个其他交易时,宜使用新的UTI。可能产生新UTI的生命周期事件如下。

- a) 交易被其他交易取代,例如交易压缩或净额结算。
- b) 交易被分割为多个独立交易。

针对各种生命周期事件使用UTI的方法如下。

- a) 如果报告有关已报送的场外衍生品交易的新信息,或以前报告的某些信息已更改,则宜使用与以前相同的UTI更新报告,主要包括以下情况。
 - 报告合约重新估值。
 - 报告已报送过的信息,例如交易确认、交易发生变更。
 - 合约为摊销互换或类似合约,且名义金额已根据合约条款变更。
 - 报告有关生命周期结束的事件,例如提前终止合约。
 - 更正以前报告的除UTI本身以外的信息错误。

c) 宜使用新 UTI 报告以下情况。

- 交易对手方的变更，包括正在清算的交易，例如某一交易对手方变更为中央对手方（CCP）。
- 某一场外衍生品交易被 1 个或多个场外衍生品交易取代（无论是否涉及不同的交易对手方）。
- 若某一交易发生多个上述变更，且变更中需要新的 UTI。

无论使用何种清算模式或规定哪些实体必须报告清算交易，均宜适用上述方法。

5.3 生成 UTI 的责任

每个可报告的场外衍生品交易均分配 1 个 UTI 且只有 1 个机构负责为特定交易生成 UTI。分配生成 UTI 的责任时宜考虑下表中的因素。UTI 生成方判定流程见下表和下图。

表 UTI 生成方判定流程

| 步骤 | 考虑因素 | 生成 UTI 的责任 |
|----|--|--|
| 1 | CCP 是否是本次交易的交易对手方 | 是，CCP 负责；否，见步骤 2。 |
| 2 | 该交易的交易对手方是否为 CCP 的清算会员？如果是，是否以清算会员身份处理该交易 | 是，清算会员负责；否，见步骤 3。 |
| 3 | 交易是否在交易平台上执行 | 是，交易平台负责；否，见步骤 4。 |
| 4 | 交易是否跨司法管辖区（即交易对手方是否受多个司法管辖区的报告规则约束） | 是，见步骤 10；否，见步骤 5。 |
| 5 | 交易双方是否都有报告义务 | 是，见步骤 6；否，见步骤 7。 |
| 6 | 该交易是否已通过或将通过电子方式确认。如果是，确认平台是否能够、愿意并允许在规则规定的时间内生成 UTI | 是，确认平台负责；否，见步骤 7。 |
| 7 | 监管是否采用基于交易对手方身份的方法（例如规则定义生成方）来确定 UTI 生成方 | 是，见步骤 8；否，见步骤 11。 |
| 8 | 交易对手方在生成 UTI 方面是否具有相同的监管地位 | 是，见步骤 11；否，见步骤 9。 |
| 9 | 适用规则是否确定 UTI 生成方 | 是，指定机构负责；否，见步骤 12。 |
| 10 | 其中 1 个司法管辖区的报告截止日期是否早于其他司法管辖区 | 是，按照报送要求更早的司法管辖区规则生成 UTI；否，见步骤 11。 |
| 11 | 交易双方之间是否达成协议，规定哪个机构负责为此交易生成 UTI | 是，约定的机构负责；否，见步骤 12。 |
| 12 | 该交易是否已通过或将通过电子方式确认。如果是，确认平台是否能够、愿意并获许在规定的时间内生成 UTI | 是，确认平台负责；否，见步骤 13。 |
| 13 | 是否必须向某一 TR 报告交易，并且该 TR 能够、愿意和获许根据适用的规则生成 UTI | 是，TR 负责；否，其中 1 个交易对手方（交易对手方识别码字符串反转后排序在第一位的交易对手方）负责。 |

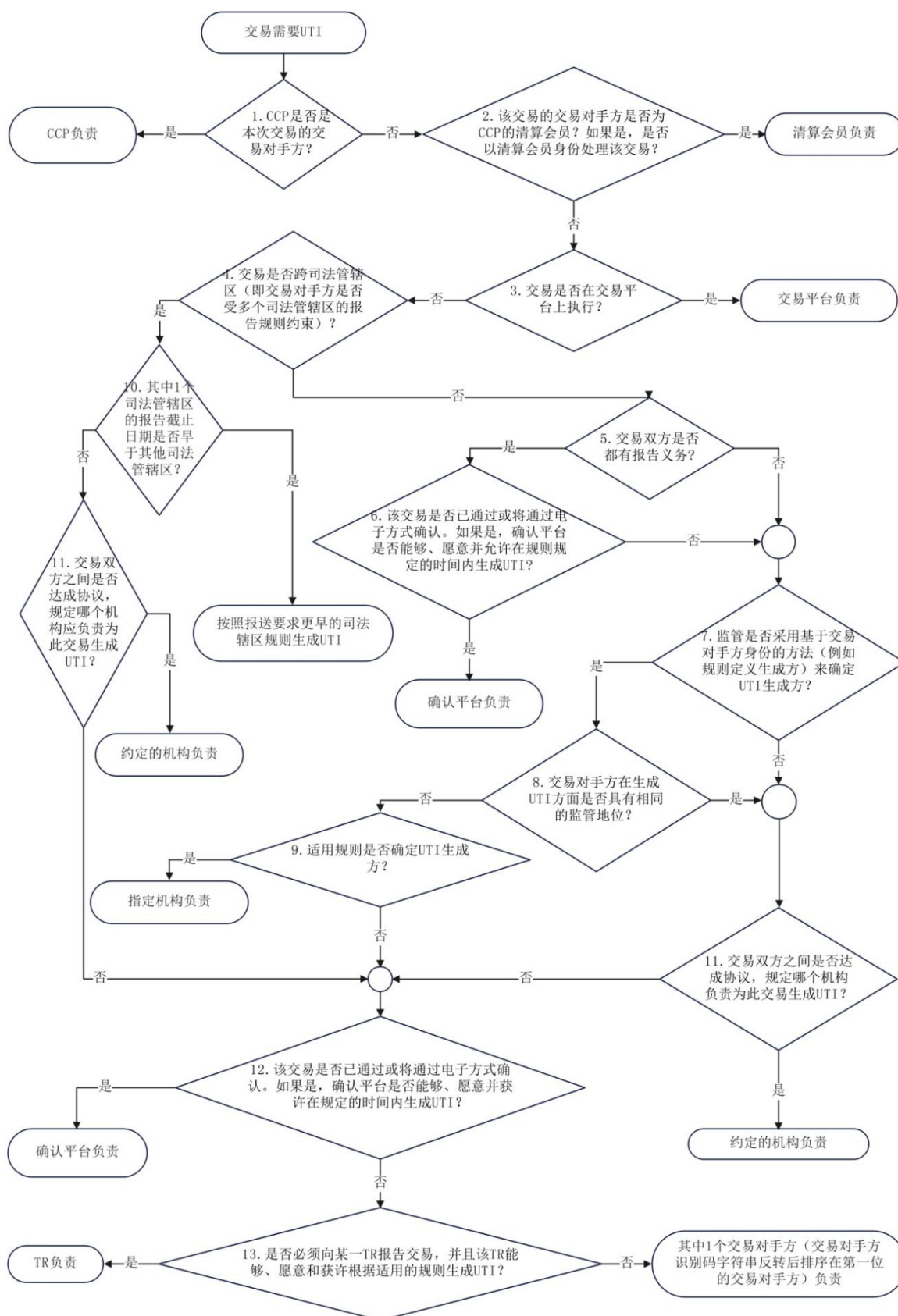


图 UTI生成方判定流程

UTI生成方不宜委托其他机构生成UTI。

5.4 生成 UTI 的时间

UTI宜及时生成并提供给所有相关方，以便他们可根据需要使用并优先将UTI提交给TR。

由于需要报告（使用UTI）的机构可能和UTI生成方不是同一机构，机构生成UTI后应及时与需要UTI的其他机构共享。

5.5 UTI 编码结构

根据ISO 23897，本文件对UTI编码的数据元素表示做出以下规定。

a) 字符表示：

- a：大写字母（仅限于字母字符A至Z）。
- n：数字（仅限数字字符0至9）。
- c：大写字母数字字符（仅限于A至Z、0至9）。

b) 长度指示：

- nn!：固定长度。
- nn：最大长度。

根据本文件定义的数据元素规定，UTI由最多52位字母与数字字符组成，格式为18!c2!n32c，具体构成如下。

a) 第1位至第20位（18!c和2!n）为UTI生成方的全球法人识别编码（LEI）。

b) 第21位至第52位（32c）由UTI生成方自主随机生成，该UTI唯一且不包含分隔符。

示例：UTI 最长为 52 位，例如中国期货市场监控中心有限责任公司生成的某笔交易的 UTI 为 300300FKXJWMVWFZ1971EBH13L59IH4U9L8RXWK7V1PX6ZX5I4V6，其中前 20 位为生成方 LEI 编码 300300FKXJWMVWFZ1971，第 21 位至第 52 位由 UTI 生成方随机生成。UTI 最短可为 35 位，例如银行间市场清算所股份有限公司生成某笔交易的 UTI 为 30030090CN1WA6ED1054202305161437592，其中前 20 位为生成方 LEI 编码 30030090CN1WA6ED1054，第 21 位至第 34 位为交易生成时间，第 35 位为交易生成时间内的交易序号。

参 考 文 献

- [1] 《UTI协调技术指南》（Technical Guidance—Harmonisation of the Unique Transaction Identifier）
-