上海证券交易所技术文档



**上海证券交易所市场参与者专项报送文件接口规格说明书**

**（1.10版）**

**上海证券交易所**

**二○一七年二月**

**《上海证券交易所市场参与者专项报送文件接口规格说明书》1.10版发布说明**

1. 调整资金用途类型数据字典。

**《上海证券交易所市场参与者专项报送文件接口规格说明书》1.00版发布说明**

2015年10月进行了修订，主要有：

1. 修改接口规格说明书的命名，对所有市场参与者专项报送的文件接口进行统一命名
2. 修改压缩文件的命名
3. 增加“附录一 股票质押式回购交易业务数据文件”接口规范

本文档由上海证券交易所（简称“上交所”）起草，并负责进行解释。

服务电话：021-4009003600

 通信地址：上海市浦东南路528号上海证券交易所技术规划与服务部

目录

[一 接口说明与约定规范 4](#_Toc433358948)

[1、标志文件使用约定 4](#_Toc433358949)

[2、文件发送约定 5](#_Toc433358950)

[3、附录中数据文件格式约定 5](#_Toc433358951)

[4、附录中基本数据约定 6](#_Toc433358952)

[附录一 股票质押式回购交易业务数据文件 7](#_Toc433358953)

[1. zyhgXXXXX001YYYYMMDD.txt（T-1日股票质押回购盯市报告数据文件） **7**](#_Toc433358954)

# 接口说明与约定规范

## 1、标志文件使用约定

文件发送方在传输一个数据文件完毕后，必须相应地传输一个标志文件。标志文件必须在数据文件传输完毕之后开始传输。标志文件的作用包括：

* 作为数据文件就绪的通知。文件接收方如果看到标志文件，即确认数据发送方已完成对应数据文件的发送，且其内容不会再发生变化。此时，文件接收方确认数据文件可用。反之，如果文件接收方没有看到标志文件，不应在此时使用数据文件。
* 对数据文件的完整性和正确性进行校验。在标志文件中定义了数据文件的相关要素，包括：文件名、文件生成日期及时间、文件记录数、文件长度及数据内容校验码等。文件接收方可据此校验数据文件的内容是否完整，数据内容是否正确等。这是一个数据发送方和接收方的端到端校验机制，以校验数据文件是否被正确传输。

标志文件格式如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 说明 | 长度 |  |
| 1 | 数据文件名称 | 60 | 左对齐 |
| 2 | ‘|’ | 1 |  |
| 3 | 文件大小 | 16 | 以字节为单位，左对齐，不足部分补空格 |
| 4 | ‘|’ | 1 |  |
| 5 | 文件生成日期 | 8 | YYYYMMDD格式 |
| 6 | ‘|’ | 1 |  |
| 7 | 文件生成时间 | 6 | HHMMSS格式 |
| 8 | ‘|’ | 1 |  |
| 9 | 记录数 | 12 | 左对齐，不足部分补空格 |
| 10 | ‘|’ | 1 |  |
| 11 | 数据文件校验码 | 64 | MD5校验码，左对齐，不足部分补空格，字母为大写。 |
| 12 | ‘|’ | 1 |  |
| 13 | 预留 | 64 | 保留字段 |
| 14 | 换行符 | 1 |  |

文件发送方应在数据文件发送完毕后发送该标志文件，文件接收方要在发现和成功读取该标志文件后，读取数据文件。

标志文件行尾以换行符0x0A结束。

## 2、文件发送约定

* 文件上传工具及使用手册：上海证券交易所通用文件传输平台客户端——EzTrans。

客户端下载地址：访问上海证券交易所主页，在“市场服务\交易服务\交易平台\交易技术支持专区\软件下载”栏目下载EzTrans的安装文件，或直接访问网址：<http://www.sse.com.cn/marketservices/tradingservice/platform/tradingtech/download/>。

* 根据不同的业务要求，各市场参与人需要报送的文件不尽相同。具体的报送文件清单和格式说明详见后文及附录。
* 所有报送文件，需打包生成一个rar格式的压缩文件再发送至上交所。

1）压缩文件命名格式为：zxbs?????YYYYMMDD001.rar

其中，?????代表pbu号，此pbu号与各市场参与人登录EzTrans的pbu号保持一致，**YYYYMMDD指文件生成日期的下一交易日，即T+1日**。例如2015年5月18日发送本文件，登录EzTrans的pbu号为20986，文件名应为zxbs2098620150519001.rar。

2）标志文件名称为zxbs?????YYYYMMDD001.flg。

3）发送完毕后系统会返回一个响应文件表示确认收到各市场参与人发送的文件，响应文件名为：zxqr?????YYYYMMDD001.rar，文件内容同各市场参与人发送的压缩文件。

## 3、附录中数据文件格式约定

除非特别说明，上交所和各市场参与人之间交换的数据文件遵循如下格式规范：

* 数据文件为文本格式。文件内容大小写敏感。
* 数据文件为定长格式。文件的中每行为一条数据记录，由多个字段组成，各字段间以分隔符分隔。每行以二进制0x0A结束，最后一行也以0x0A结束。
* 文件的字段分隔符为‘|’，但每行的开始和结束不含分隔符。
* 文件基于GB18030编码规范(字母和数字占1个字节，汉字占2个字节)。

## 4、附录中基本数据约定

* 文件名称中YYYYMMDD（yyyymmdd）指8位的日期（世纪年月日），YYMMDD（yymmdd）指6位的日期（年月日），MMDD（mmdd）指4位的日期（月日），MDD（mdd）指3位的日期（月日，其中10月为‘a’，11月为‘b’，12月为‘c’)。
* 对于字符型字段，不足部分左对齐，右补空格；以 CX格式表示，其中X代表长度。
* 对于整数数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以NX格式格式表示，其中X代表数字型字符串总长度。
* 对于浮点数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以NX (Y)格式表示，其中X代表数字型字符串总长度，Y代表小数位数。X包括一位小数点。带浮点的数字型字段包括小数位，如：N9(5)的123 填写为123.00000。

# 附录一 股票质押式回购交易业务数据文件

### 1. zyhgXXXXX001YYYYMMDD.txt（T-1日股票质押回购盯市报告数据文件）

1）数据文件名：zyhgXXXXX001YYYYMMDD.txt**（YYYYMMDD为T日日期，XXXXX代表会员唯一码，由会员编号的后5位数字组成）**

2）数据内容：T-1日日内了结的股票质押初始交易和补充质押情况，以及截止T-1日未了结（包括T-1日当日申报）的初始交易和补充质押情况；

特别注意：数据内容为T-1日数据，数据文件名中日期为T日，压缩文件名中日期为T+1日。

3）发送时间：每个交易日15:30-16:30；

4）发送周期：每一交易日；

5）数据格式：TXT格式；

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 字段名 | 长度 | 字段描述 |
|  | 会员编号 | C5 | 会员唯一码，由会员编号后五位数字组成 |
|  | 盯市日期 | C8 | 格式：YYYYMMDD |
|  | 业务类型 | C1 | 初始交易：0；补充质押：1 |
|  | 初始交易日期 | C8 | 格式：YYYYMMDD |
|  | 初始交易成交编号 | C22 |  |
|  | 补充质押日期 | C8 | 格式：YYYYMMDD |
|  | 补充质押成交编号 | C22 |  |
|  | 证券代码 | C6 |  |
|  | 证券简称 | C8 |  |
|  | 是否属于限售股份 | C1 | 否：0；是：1 |
|  | 标的证券数量 | N10 | 单位：股/份/张 |
|  | 初始交易金额 | N18（2） | 单位：元 |
|  | 初始购回期限 | N4（0） | 单位：天 |
|  | 初始购回日期 | C8 | 格式：YYYYMMDD |
|  | 初始购回金额 | N18（2） | 单位：元 |
|  | 融资利率 | N9（4） | 年化收益率 单位：% |
|  | 融出方属性 | C2 | 自有资金：00；集合资产管理计划：01；定向资产管理计划：02；其他：03 |
|  | 融入方属性 | C1 | 个人投资者：0；机构投资者：1 |
|  | 融入方应付金额 | N18（2） | 单位：元 |
|  | 实际融资利率 | N9（4） | 年化收益率，单位：% |
|  | 当前质押数量 | N10（0） | 单位：股/份/张 |
|  | 当前质押红利金额 | N18（2） | 单位：元 |
|  | 盯市履约保障比例 | N9（2） | 单位：% |
|  | 履约保障级别 | C1 | 正常：0；警戒：1；触发：2 |
|  | 合约状态 | C1 | 未到期：0；已到期未了结：1；当日已了结：2；违约处置中：9 |
|  | 了结类型 | C2 | 未了结：00；提前购回：01；到期购回：02；延期购回：03；终止购回：04；违约处置了结：09 |
|  | 资金用途类型 | C2 | 即融资投向，其代码字典定义如下：01 生产经营02 补充流动资金03 股权性投资04 债权类投资05 不动产类投资06 二级市场证券交易07 偿还债务08 个人消费09 其他 |
|  | 资金用途描述 | C100 |  |
|  | 业务备用字段 | C100 | 预留字段，全空格 |

（2）盯市日期：T-1日日期。

（3）业务类型：根据该笔交易的申报类型选择初始交易或补充质押。

（4）初始交易日期：初始交易申报日期；对于补充质押，填写对应初始交易的申报日期。

（5）初始交易成交编号：对于补充质押，填写对应初始交易成交编号。

（6）补充质押日期：如属于补充质押则填写，如属于初始交易则不填。

（7）补充质押成交编号：如属于补充质押则填写，如属于初始交易则不填。

（8）证券代码：质押标的证券代码。

（9）证券简称：质押标的证券简称。

（10）是否属于限售股：质押标的证券是否属于限售股。

（11）标的证券数量：对于初始交易，填写初始交易质押标的证券数量；对于补充质押，填写补充质押标的证券数量。

（13）初始购回期限：初始交易时约定的购回期限。

（14）初始购回日期：初始交易时约定的购回日期。

（15）初始购回金额：初始交易时约定的购回金额。

（16）融资利率：对于初始交易和补充质押，均填写初始交易时约定的融资利率，计量单位为年化收益率%，如预期融资利率为5.0000%，则融资利率字段填报数值应为5.0000（下同）。

（17）融出方属性：对资金融出方分为自有资金、集合资产管理计划、定向资产管理计划、其他，分别取值为‘00’、‘01’、‘02’、‘03’。

（18） 融入方属性：对资金融入方分为个人投资者和机构投资者，分别取值‘0’、‘1’。

（19）融入方应付金额：根据场外分期付息等情况调整；对于当日了结的合约，填报该笔合约实际的购回金额。

（20）实际融资利率：对于未了结的合约，填写该笔合约初始交易时约定的融资利率；对于当日了结的合约，填报该笔合约实际的融资利率。计量单位为年化收益率%。

（21）当前质押数量：标的证券当前的质押在押数量，包括质押红股数量。从初始交易日（或补充质押日）起至T-1日（含）期间，该笔初始交易（或补充质押交易）标的证券数量与累计权益分派所获得的红股数量之和减去累计部分解除质押的标的证券数量。对于当日了结的合约，填报该笔合约实际的购回数量。

（22）当前质押红利金额：从初始交易日（或补充质押日）起至T-1日（含）期间，所有权益分派所获得的红利金额之和减去累计部分解除质押的红利金额。

（23）履约保障比例：指单笔交易或合并管理的多笔交易的质押标的证券市值与质押红利金额之和与融入方应付金额的比值；质押标的证券涉及沪深两市的，合并计算履约保障比例。单位：%；例如，合约当前的履约保障比例为185%，则履约保障比例字段填报时应为185.00。

（24）履约保障级别: 截止T-1日日期，券商根据履约保障的要求，对尚未购回的初始交易的履约保障能力进行评级，分为正常、警戒、触发三个级别，分别取值为：‘0’、‘1’、‘2’。正常表示履约保障比例未达到警戒线；警戒表示履约保障比例达到或低于警戒线，未达到最低线；触发表示履约保障比例达到或低于最低线。

（27）资金用途类型：对融入方获得资金的后续用途进行分类，即融资投向，其代码字典定义如下：

01 生产经营

02 补充流动资金

03 股权性投资

04 债权类投资

05 不动产类投资

06 二级市场证券交易

07 偿还债务

08 个人消费

09 其他

（28）资金用途描述：若资金用途字段选择其他，即‘09’，则在本字段中对融入方获得资金的后续用途进行简要描述，不超过50个汉字长度，左对齐。

6）标志文件：zyhgXXXXX001YYYYMMDD.flg

注意：压缩包中每一个txt数据文件都要有一个flg文件，txt数据文件的flg压入压缩包内，rar压缩包上传时也要有一个flg文件。

**特殊情况说明：**

1）在当日发送时间截止之前，如发现数据漏发或错发，可重新打包上传，包内文件必须为全量数据；

2）T日上传时，除T-1日股票质押回购盯市报告数据外，如还包含T-1日之前的盯市报告数据，则需要根据具体日期，将相应的数据放入相应的文件中，文件命名规则同上。例如，如还包括T-2日的盯市数据，则将T-2日的数据保存在zyhgXXXXX001[T-1].txt中，并生成对应标志文件。所有数据文件就绪后，打包至rar压缩文件包进行上传。