

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所

固定收益证券综合电子平台

外部数据接口规范



上海证券交易所

二〇二一年二月

修改记录

版本号	操作	日期	说明
<u>V3.21</u>	<u>修改</u>	<u>2021-02-01</u>	<u>增加“15：公募 REITs”产品及相关说明；</u> <u>文中所述“基金”包含公募 REITs；</u>
<u>V3.2</u>	<u>修改</u>	<u>2020-12-31</u>	<u>非交易改造相关内容</u>
V3.1	修改	2019-05-07	修改 2.3 本方成交数据文件记录格式章节中字段 6 的英文字段说明，字段 13 的描述
V3.0	修改	2019-02-22	增加债券回售撤销业务
V2.9	修改	2018-09-19	增加特定债券转让业务
V2.9	修改	2018-04-11	三方回购业务上线，该部分接口规范正式启用。
V2.8	修改	2018-01-09	增加创新创业债换股业务
V2.7	修改	2017-11-06	增加三方回购业务(该业务尚未上线，相关接口规范为预发布版)
V2.6	修改	2016-08-02	增加非公开公司债券回售相关内容；该业务尚未上线，相关接口规范为预发布版，回售业务已于 2016 年 11 月上线，该部分接口规范正式启用。
V2.5	修改	2016-7-19	增加非公开可交换债券换股业务相关内容；固定收益平台非公开可交换债换股业务已于 2016 年 1 月上线，于 2016 年 7 月完成首单换股业务。该部分接口规范正式启用。
V2.41	修改	2014-07-31	因债券质押式协议回购进行修订 1、“成交明细记录格式”中去掉了债券质押式协议回购业务的相关内容；
V2.4	修改	2014-07-19	因债券质押式协议回购业务进行修订 1、增加了一种债券质押式协议回购业务类型并对业务类型编号进行了调整； 2、买卖方向进行了定义，B 为正回购，S 为逆回购；

			<ul style="list-style-type: none"> 3、对回购利率的表示方式进行了细化； 4、对当日加权平均利率计算公式进行补充； 5、对当日总成交金额计算公式进行补充； 6、将首次结算金额改为首次成交金额。 7、“首次交易”更名为“成交申报”。 8、“应计利息”更名为“回购利息”。 9、“首次成交金额”更名为“成交金额”。 10、“到期结算交易”更名为“到期确认”。 11、将交易类型编号 612 更改为 619。 12、将“质押式协议回购”更名为“债券质押式协议回购”
V2.3	修改	2014-4-15	<p>因债券质押式协议回购业务进行修订</p> <ul style="list-style-type: none"> 1、本方成交数据格式，增加债券质押式协议回购格式说明，增加交易产品“08：债券质押式协议回购” 2、成交行情数据格式，增加债券质押式协议回购格式说明 3、成交明细数据格式，增加债券质押式协议回购格式说明，增加成交方式“8：债券质押式协议回购” 4、证券信息记录格式，增加债券质押式协议回购格式说明
V2.2	修改	2012-6-5	<p>因私募债券转让业务上线进行修订。</p> <ul style="list-style-type: none"> 1. 本方成交数据，包含私募债券转让的记录。 2. 行情数据文件中的成交明细记录格式第 11 个字段“成交方式”，增加一种“6：指定对手方”。 3. 行情数据文件中的证券信息记录格式第 3 个字段“交易产品”，增加一种“06：中小企业私募债券”。

			<p>4. 私募债券转让业务上线后，公告信息暂不对行情商用户开放。</p> <p>5. 行情数据文件中成交行情、成交明细两个文件中，不包含私募债券的数据。修订部分在文中突出显示。</p>
V2.1	修改	2011-12-8	<p>因交易客户端 V2.9.0.2 版本增加成交数据自动下载功能，对文档进行修订，增加相关说明。</p> <p>修改部分集中在“2. 本方成交数据文件接口规范”。</p>
V2.0	修改	2011-6-3	<p>增加报盘机用户下载本方成交数据文件的说明。</p> <p>调整公告内存及附件保存的说明。</p> <p>关于本方成交数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 调整余额打通后成交文件包含的交易产品。 2. 应计利息字段长度描述修正为 12 位。 <p>关于行情数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 调整余额打通后落地文件包含的成交方式。
V1.6	修改	2009-1-16	<p>关于行情数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 成交明细文件的成交方式字段增加类型“自营出入库”。
V1.5	修改	2008-12-11	<p>关于本方成交数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 修改证券信息字段，当申报来自报盘机时，在末 10 位填写申报接口中的标记字段内容。
V1.4	修改	2008-11-21	<p>关于本方成交数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交易产品增加“08 专项出入库”。
V1.3	修改	2008-09-16	<p>关于本方成交数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交易产品增加“07 谈判式回购”。 2. 应计利息字段扩充为 12 位长度，其中小数位为 8 位。 <p>关于行情数据文件接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 增加了证券信息文件，存放在系统安

			<p>装目录下的 quot 子目录,格式见文档。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2. 增加了公告信息文件,存放在系统安装目录下的 info 子目录,格式见文档。 3. 确定报价、成交行情、成交明细的文件存放位置由系统安装目录下改为系统安装目录下的 quot 子目录。 4. 确定报价文件买入报价时间和卖出报价时间字段改为 HHMMSS 格式,增加了买入报价编号和卖出报价编号。 5. 成交行情的时间字段改为 HHMMSS 格式。 6. 成交明细文件的成交日期字段改为 YYYYMMDD 格式,成交时间改为 HHMMSS 格式。 7. 确定报价和成交明细文件的应计利息文件单位为 0.1 厘。 8. 成交明细文件的成交方式字段增加类型“4 协议交易”。
V1.1	修改	2007-08-15	
V1.0	创建	2007-07-27	

目 录

1. 概述.....	7
2. 本方成交数据文件接口规范.....	7
2.1 本方成交数据下载实现方式.....	7
2.2 本方成交数据文件定义.....	7
2.3 本方成交数据文件记录格式.....	8
3. 行情数据文件接口规范.....	13
3.1 行情数据文件下载方式.....	13
3.2 行情下载文件定义.....	13
3.3 行情文件格式概述.....	14
3.4 确定报价行情记录格式.....	14
3.5 成交行情记录格式.....	15
3.6 成交明细记录格式.....	18
3.7 证券信息记录格式.....	19
3.8 公告信息的获取.....	21
3.8.1 公告信息文件格式说明.....	21
3.8.2 公告内容存放说明.....	22
3.8.3 公告附件存放说明.....	22

1. 概述

上证所固定收益证券综合电子平台外部数据接口规范包括以下几部分：

1. 本方成交数据文件接口规范（对交易商）
2. 行情数据文件接口规范（对信息提供商）
3. 公告信息文件接口规范（对信息提供商）

2. 本方成交数据文件接口规范

2.1 本方成交数据下载实现方式

使用交易客户端登录系统的用户，登录成功以后，可以在菜单上选择“服务一）成交数据手工下载”，并指定期望文件保存的目录，当日成交数据将以 dbf 文件的形式保存到该目录。

此外，系统将以 10 秒为频率，以纯文本 txt 文件的形式，将当日成交数据自动保存到本地。保存目录为客户端软件安装目录下的 data 子目录。

使用报盘机登录系统的用户，会在每天收盘后自动下载成交数据文件。用户也可以在菜单上选择“成交数据下载一）成交数据下载”自行下载。

2.2 本方成交数据文件定义

手工下载的本方成交数据文件名称为 zgh[xxx].dbf，其中[xxx]为该交易商代码。数据文件采用 dbf 格式，可使用 FoxPro、Access、Excel 等工具导入进行后续处理。

系统自动下载的本方成交数据文件名称为 zgh[xxx].txt，其中[xxx]为该交易商代码。该文件有另外如下说明：

1、文件采用纯文本格式。该文件的第一行包括两个字段：更新时间和实际成交记录数，两字段间以竖线“|”分隔。如果自动下载时没有成交数据，则成交记录数为 0。实际成交记录内容从文件的第二行开始。成交记录各字段间同样以竖线“|”分隔符分隔，各行开始和结尾不包含分隔符。

2、在每次文件内容刷新前，首先清空第一行内容，说明该文件正处于刷新状态；完成刷新后，根据本次实际情况，回填第一行内容，作为刷新完成的标志。

3、该文件必须以只读方式打开读取，并且在内容读取完成后，及时关闭。若一直保持在打开状态，会影响系统的自动刷新。

2.3 本方成交数据文件记录格式

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
1	trade_no	成交编号	TEXT	10		
2	order_no	申报编号	TEXT	10		
3	trade_date	成交日期	TEXT	8		YYYYMMDD
4	order_time	申报时间	TEXT	6		HHMMSS
5	trade_time	成交时间	TEXT	6		HHMMSS
6	trader_id	交易员代码	TEXT	6		
7	proc	交易产品	TEXT	2		01: 现券交易 02: 协议交易 05: 隔夜回购 06: 转托管 07: 谈判式回购 08: 债券质押式协议回购 09: 可交换债换股 10: 债券回售, 债券回售撤销 11: 三方回购 12: 创新创业双非可转债转股
8	account	本方股东账号	TEXT	10		
9	firm	本方交易席位号	TEXT	5		
10	stock_code	证券代码	TEXT	6		对一般业务, 填证券代码; 对债券质押式协议回购, 填质押券现券代码; 对可交换债换股, 填现券代码; 对债券回售填现券代码;

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						对于三方回购转入、转出填现券代码；对 <u>创新创业双非可转</u> 债转股填现券代码；对三方回购其他业务填回购代码；
11	stock_name	证券信息	TEXT	30		<p>交易类型为转托管时：证券简称(8位)+银行间托管账户(11位)+空格(1位)+券商报盘标记字段(10位)；</p> <p>其它情况：证券简称(8位)+空格(12位)+券商报盘标记字段(10位)</p> <p>对债券质押式协议回购：</p> <p>证券简称(8位)+到期日(8位)+业务子类型(3位)+空格(1位)+券商报盘标记字段(10位)</p> <p>其中业务子类型取值：</p> <p>'619'：债券质押式协议回购成交申报</p> <p>'613'：债券质押式协议回购到期确认</p> <p>'614'：债券质押式协议回购到期续做前期合约了结</p> <p>'615'：债券质押式协议回购合约新开</p> <p>'616'：债券质押式协议回购换券申报</p> <p>'617'：债券质押式协议回购提前终止</p> <p>'618'：债券质押式协议回购解除质押；</p> <p>对可交换债换股：<u>—</u>：证券简称(8位)+<u>换股代码空格(65位)+换股状态(1位)</u>+空格(16位)；对债券回售、债券回售撤销，证券简称(8位)+<u>回售代码空格(62位)+回售批次号(4位)</u>+空格(16位)；交易类型为<u>创新创业双非可转</u>债转股时：证券简称(8位)+<u>转股代码空格(65位)+转股状态(1位)</u>+空格(16位)；</p> <p>对三方回购：</p>

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						证券简称(8位, 转入, 转出填现券简称, 其他业务为空)+到期日(8位, 转入、转出填交易日, 三方回购其他类型填到期日)+业务子类型(3位)+空格(1位)+券商报盘标记字段(10位) 其中业务子类型取值: '680': 债券质押式三方回购回购交易 '681': 债券质押式三方回购到期购回 '682': 债券质押式三方回购到期续做合约新开 '683': 债券质押式三方回购提前终止 '684': 债券质押式三方回购转入申报 '685': 债券质押式三方回购转出申报 '686': 债券质押式三方回购换券申报 '687': 债券质押式三方回购补券申报 '688': 债券质押式三方回购解除质押 '689': 债券质押式三方回购到期续做合约了结
12	dir	买卖方向	TEXT	1		B: 买入 S: 卖出 对债券质押式协议回购, B为正回购, S为逆回购; 对可交换债换股填S; 对债券回售填S, 对债券回售撤销填B; 对 创新创业双非可转债 转股冻结, 填S, 对 创新创业双非可转债 转股解冻, 填B 三方回购转入专户填B, 普通账户填S; 对于三方回购转出专户填S, 普通账户填B; 对于三方回购其他业务, B为正回购, S为逆回购;
13	net_price	成交净价价格	NUMBER	10	3	单位: 元 对债券质押式协议回购, 代表回购利率, 精确到%小数点后3位, 只填写%左边的数值, 省略%, 例如: 现实中的3.456%在此字段中填3.456, 右对齐左补空; 对可交换债换股, 填换股

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						价格；对债券回售填回售价格；对 <u>创新创业双非可转债</u> 债转股填转股价格； 对于三方回购，代表回购利率，精确到%小数点后3位，只填写%左边的数值，省略%，例如：现实中的3.456%在此字段中填3.456，右对齐做补空；转入转出填0； <u>对于基金，代表成交价格-</u>
14	vol	成交数量	NUMBER	10	0	单位：手 对债券质押式协议回购，成交申报和换券申报时填写质押数量，到期确认，到期续做前期合约了结、到期续做合约新开、解除质押、提前终止时填0，右对齐左补空 三方回购业务转入转出、换券、补券填数量，其他填0 <u>对于基金，单位为“份”</u>
15	intr	应计利息	NUMBER	12	8	单位：元 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效； <u>创新创业双非可转债</u> 债转股无效；对债券回售、债券回售撤销无效； 对三方回购、 <u>基金</u> 无效
16	full_price	成交全价价格	NUMBER	10	3	单位：元 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效； <u>创新创业双非可转债</u> 债转股无效；对三方回购无效； <u>对于基金，代表成交价格</u>
17	face	券面总额	NUMBER	10	0	单位：万元 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对 <u>创新创业双非可转债</u> 债转股无效；对三方回购无效； <u>对于基金无效</u>
18	net_sum	成交净价金额	NUMBER	12	2	单位：万元 对债券质押式协议回购无效；对可交

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对 <u>创新创业双非可转债</u> 转股无效；对三方回购无效； <u>对于基金，代表成交价格</u>
19	full_sum	结算金额	NUMBER	12	2	单位：万元 对债券质押式协议回购填回购利息，单位为元；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对 <u>创新创业双非可转债</u> 转股无效；对三方回购填回购利息，单位为元
20	profi	到期收益率	NUMBER	10	4	对债券质押式协议回购，为折算比例（百分比，精确到%小数点后2位），只填写%左边的数值，省略%，最右两位填00，例如：现实中的95.27%填写95.2700）；对可交换债换股无效；对债券回售无效；对 <u>创新创业双非可转债</u> 转股无效；对三方回购回购交易，填写指定篮子编号； 左对齐，1至8位有效，代表第1号至第8号篮子。例如指定1, 2, 5号篮子，左边8位填“11001000”，对于三方回购其他业务无效； <u>对于基金无效</u>
21	mkt_quote	是否做市报价	TEXT	1		M：做市报价 N：非做市报价 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对 <u>创新创业债双非可转债</u> 转股无效；对三方回购无效

说明：

- a. 在本方成交数据文件中，按照成交时间顺序排列各条成交记录。
- b. 在本方成交数据文件中，包含了由确定报价、待定报价、询价、场务应急录入、协议交易、指定对手方、隔夜回购、谈判式回购、转托管、债券质押式协议回购、可交换债换股、债券回售、创新创业双非可转债转股、三方回购等方式达成的成交。

c. 换股状态取值：Y 表示当日可换股，N 表示当日不可换股；转股状态取值：Y 表示当日可转股，N 表示当日不可转股。

3. 行情数据文件接口规范

3.1 行情数据文件下载方式

上证所为每个行情提供商提供一个独立的用户账号，以及初始登录口令。行情商使用该账号和口令登录固定收益平台的交易端，用户可以在登录后更改口令。

用户在指定网站上下载并安装了固定收益平台的交易端软件后，运行该软件，能够看到登录画面。在界面下方输入上证所提供的服务器地址和端口，在界面上方输入上证所提供的用户账号和登录口令，选择使用数据库口令，点击登录后可以进入固定收益平台系统。

注：行情提供商的用户账号信息由上证所统一维护和管理，其类型为“行情提供商”，并以大写字母“I”为首字母。信息提供商的账号只能在交易时段登录系统。

行情提供商用户登录系统后，能看到如下信息。

在界面的上方为系统的报价信息区，其中包括：确定报价和待定报价。

在界面的下方为系统的行情信息窗口，可以看到实时的成交行情和逐笔成交。

行情提供商可以通过这些内容了解固定收益平台的当前交易情况。

目前盘后通过单向卫星发送确定报价行情和成交明细行情，需要的交易商可自行下载。

3.2 行情下载文件定义

用户登录后，系统会自动将确定报价、成交行情、成交明细、证券信息这四项内容以文本文件形式保存在客户端计算机中，这些文件会随着行情的变化而更新。文件存放位置是系统安装目录下的 quot 子目录。

系统同样会自动将公告信息标题以文本文件形式保存在客户端计算机中，文件存放位置是系统安装目录下的 info 子目录。

注意：若要开发自身应用系统读取这几个文件，必须以只读方式打开，并且

在内容读取完成后，必须及时关闭行情文件。若一直保持在打开状态，会影响系统的行情刷新。

目前系统提供的可下载内容包括：确定报价、成交行情、成交明细、证券信息、公告文件。分别定义如下：

信息类型	文件名称
确定报价	ZQ_QDBJyyyyymmdd.txt
成交行情	ZQ_CJHQyyyyymmdd.txt
成交明细	ZQ_CJMXyyyyymmdd.txt
证券信息	ZQ_ZQXXyyyyymmdd.txt
公告信息	ZQ_GGXXyyyyymmdd.txt

其中 yyyyymmdd 为当前日期。

单向卫星盘后发送的确定报价行情文件名称为 bjqbmmdd.txt，其中 mmdd 为当天月日；成交明细行情文件名称为 bjmxmmdd.txt，其中 mmdd 为当天月日。格式同行情下载文件相应文件格式。

3.3 行情文件格式概述

行情文件每日生成一个单独的文件，当日刷新时采用覆写方式。

每个文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在刷新行情内容前清空，在刷新行情内容后回填，可作为刷新完成的标志。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录为定长数据，各字段的长度固定，内容采用右对齐，**前左**补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

以下是不同行情文件的详细格式定义。

3.4 确定报价行情记录格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1.	证券代码	TEXT	6	
2.	证券简称	TEXT	30	
3.	买入订单编号	TEXT	10	
4.	买入报价时间	TIME	8	HHMMSS，前补空
5.	买入报价方	TEXT	10	交易商简称

6.	买入价（净价）	NUMBER	10	单位：厘 <u>对于基金，代表买入价</u>
7.	买入数量	NUMBER	10	单位：手 <u>对于基金，单位为“份”</u>
8.	买入全价	NUMBER	10	单位：厘
9.	买入到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 如：2.1234 <u>对于基金无效</u>
10.	卖出订单编号	TEXT	10	
11.	卖出报价时间	TIME	8	HHMMSS，前补空
12.	卖出报价方	TEXT	10	交易商简称
13.	卖出价（净价）	NUMBER	10	单位：厘 <u>对于基金，代表卖出价</u>
14.	卖出数量	NUMBER	10	单位：手 <u>对于基金，单位为份</u>
15.	卖出全价	NUMBER	10	单位：厘
16.	卖出到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） <u>对于基金无效</u>
17.	应计利息	NUMBER	10	单位：0.1厘 <u>对于基金无效</u>

说明：

a. 在确定报价行情文件中，按照每个证券的代码从小到大依次排列各证券的所有当前报价。

b. 在每个证券的报价记录中，分别按最优买、卖报价的方式排序。

c. 在报价记录中，数量为当前剩余数量，如果是冰山订单，则当实际数量大于冰山订单值，在数量一栏显示冰山订单值，而不是实际数量。

d. 在报价记录中，如果是匿名报价，则在报价方一栏显示“匿名”。

e. 确定报价行情文件在系统开盘后开始刷新，刷新时间为5秒钟，若刷新时间段内报价数据没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。

f. 不包含特定债券数据

3.5 成交行情记录格式

序	字段	数据类型	长	格式
---	----	------	---	----

号			度	
1	证券代码	TEXT	6	对债券质押式协议回购，为回购代码 对于三方回购，为回购代码
2	证券简称	TEXT	30	对债券质押式协议回购，为回购简称 对于三方回购，为回购简称
3	时间	TIME	8	HHMMSS，前补空
4	昨日收盘价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购、三方回购，为回购利率，精确到%小数点后3位，现实中的利率放大100000倍即为该字段的表示形式。例如：现实中3.456%在此字段应填3456。右对齐左补空格。协议回购、三方回购中利率的填写规则下同。
5	昨日加权平均价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购，为上一交易日该品种所有成交的加权平均利率 对三方回购，为上一交易日该品种所有成交的加权平均利率
6	当日开盘价	NUMBER	10	单位：厘 当日开盘后的第一笔成交价格；若当日无成交，则为零 对债券质押式协议回购，为回购利率 对三方回购，为回购利率
7	当日最高价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购，为回购利率 对三方回购，为回购利率
8	当日最低价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购，为回购利率 对三方回购，为回购利率
9	当日最新价	NUMBER	10	单位：厘 当日最新的一条成交的价格，收盘后为收盘价；若当日无成交，则为零 对债券质押式协议回购，为回购利率 对三方回购，为回购利率
10	当日加权平均价	NUMBER	10	单位：厘 累加该证券（每笔成交的价格乘以该笔成交

				数量)之和 除以 (总成交数量) 对债券质押式协议回购、三方回购, 为当日该品种所有成交的回购利率, 用成交金额作为权重的加权平均利率, 即 $(\sum(\text{成交金额} \times \text{回购利率})) / \sum \text{成交金额}$, 其中成交金额包含成交申报和到期续做合约新开。 精确到%小数点后3位
11	当日总成交量	NUMBER	10	单位: 手 <u>对于基金, 单位为“份”</u> 对债券质押式协议回购无效 对三方回购无效
12	当日总成交金额	NUMBER	10	单位: 万元 (四舍五入到万) 累加该证券 (每笔成交的价格乘以该笔成交数量) 之和 对债券质押式协议回购为 $\sum(\text{成交金额})$, 其中成交金额包含成交申报和到期续做合约新开。单位: 万元 (四舍五入到万元) 对三方回购为 $\sum(\text{成交金额})$, 其中成交金额包含成交申报和到期续做。单位: 万元 (四舍五入到万元)
13	当日总成交笔数	NUMBER	10	
14	昨日收盘收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数) 14~20 对债券质押式协议回购无效 14~20 对三方回购无效 <u>14-20 对基金无效</u>
15	昨日加权平均收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数)
16	当日开盘收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数)
17	当日最高收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数)
18	当日最低收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数)
19	当日最新收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数)
20	当日加权平均收益率	NUMBER	10	百分数 (4位小数)

说明：

a. 在成交行情文件中，按照每个证券的代码从小到大依次排列各证券的当前成交行情，每个证券一条记录。

b. 每个证券的统计行情包含了由确定报价、待定报价、询价等方式达成的成交，但不包括协议交易的成交。

c. 在行情记录中，除了基金，所有价格均为净价。

d. 成交行情文件在系统开市后开始刷新，开盘前刷新的数据字段包括：最优买、最优卖、上日均价，开盘后所有字段都将被刷新。成交行情数据刷新时间为5秒钟，不论在刷新时间段内成交数据有无变化，该文件都会被刷新。

e. 不包含私募债券和特定债券成交数据。

3.6 成交明细记录格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	证券代码	TEXT	6	
2	证券简称	TEXT	30	
3	成交日期	DATE	8	YYYYMMDD
4	成交时间	TIME	6	HHMMSS
5	成交净价	NUMBER	10	单位：厘 <u>对于基金，代表成交价格</u>
6	应计利息	NUMBER	10	单位：0.1 厘 <u>对基金无效</u>
7	成交全价	NUMBER	10	单位：厘
8	到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） <u>对基金无效</u>
9	成交量	NUMBER	10	单位：手 <u>对于基金，单位为份</u>
10	成交金额	NUMBER	10	单位：万元（四舍五入到万）
11	成交方式	TEXT	1	1：确定报价成交 2：待定报价成交 3：询价成交 4：协议交易 6：指定对手方

说明：

- a. 在成交明细行情文件中，按照成交时间顺序排列各条成交记录。
- b. 在成交明细行情文件中，包含了由确定报价、待定报价、询价、协议交易、指定对手方等方式达成的成交。
- c. 成交明细行情文件在系统开盘后开始刷新，刷新时间为 5 秒钟，若刷新时间段内成交数据没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。
- d. 不包含私募债券和特定债券成交数据。

3.7 证券信息记录格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	证券代码	TEXT	6	对债券质押式协议回购，为回购代码 对于三方回购，为回购代码
2	证券名称	TEXT	8	证券简称 对债券质押式协议回购，为回购简称 对于三方回购，为回购简称
3	交易产品	TEXT	2	01：国债现券 03：公司债现券 05：债券质押式协议回购 06：中小企业私募债券 10：三方回购 <u>15：公募 REITs</u> 21:特定债券
4	证券属性	TEXT	1	N：国债 E：公司债 P：仅在平台挂牌债券 A：信贷资产支持证券 T：特定债券 <u>R：公募 REITs</u> <u>空格：其他</u>
5	证券状态	TEXT	1	N：正常 S：挂起 <u>(禁止)</u> Z：摘牌 D：到期

				对债券质押式协议回购适用 对三方回购适用
6	质押券代码	TEXT	6	<u>无效</u>
7	开盘时间	TIME	6	HHMMSS 对债券质押式协议回购适用 对三方回购适用
8	收盘时间	TIME	6	HHMMSS 对债券质押式协议回购适用 对三方回购适用
9	证券发行方式	TEXT	1	A: 付息 Z: 零息/贴现 P: 一次还本付息
10	证券面额	NUMBER	10	单位: 厘 <u>对基金无效</u>
11	发行价格	NUMBER	10	单位: 厘
12	利息类型	TEXT	1	X: 固定利率 F: 浮动利率 <u>12-20 对基金无效</u>
13	付息频率	TEXT	1	Y: 年付 H: 半年付 Q: 季付
14	票面利率/保底利率	NUMBER	10	单位: 厘
15	基本利率	NUMBER	10	单位: 厘 当前付息周期的基本利率
16	基本利差	NUMBER	10	单位: 厘
17	期限	NUMBER	3	单位: 年
18	实际发行总量	NUMBER	6	单位: 亿元
19	发行开始日期	DATE	8	YYYYMMDD
20	发行结束日期	DATE	8	YYYYMMDD
21	上市日期	DATE	8	YYYYMMDD

22	到期日期	DATE	8	YYYYMMDD <u>22-28 对基金无效</u>
23	国债类型	TEXT	1	A: 记帐式 R: 实物式 V: 凭证式
24	发行方法	TEXT	1	S: 包销 R: 代销 B: 招标 O: 其他
25	是否跨市场	TEXT	1	Y: 跨市场 N: 不跨市场
26	能否做空	TEXT	1	Y: 可以做空 N: 不能做空
27	总做空额度	NUMBER	10	单位: 手
28	交易商做空 额度	NUMBER	10	单位: 手
29	上日收盘价	NUMBER	10	单位: 厘
30	上日加权平 均价	NUMBER	10	单位: 厘

说明:

- a. 证券信息文件在系统开盘后开始刷新, 刷新时间为 5 分钟, 该文件总是被全量覆盖。
- b. 对债券质押式协议回购, 除明确说明的字段外, 其它字段均无效
- c. 对三方回购, 除明确说明的字段外, 其他字段均无效

3.8 公告信息的获取

3.8.1 公告信息文件格式说明

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	公告类型	TEXT	1	C: 研究报告 A: 交易所公告 F: 财经新闻

				T: 财政部公告 O: 人民银行公告 P: 发行人公告
2	公告标题	TEXT	100	
3	公告日期	DATE	8	YYYYMMDD
4	公告时间	TIME	6	HHMMSS
5	公告编号	NUMBER	10	非递增序编号

说明:

- a. 公告信息文件在系统开盘后开始刷新，刷新时间为 5 秒钟，若刷新时间段内公告信息没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。
- b. 私募债券转让业务上线后，公告信息暂不对行情商用户开放。

3.8.2 公告内容存放说明

根据公告信息文件中的公告编号到服务器上获取公告的详细内容，以公告编号为文件名，保存为一个单独文件，安置在 info 下的 content 子目录中。

文件中的内容依次为以下字段：

标题、作者、关键字 1、关键字 2、关键字 3、附件个数、附件编号及名称、内容。

其中，前 6 个字段从文件头开始，依次各占一行，除附件个数为 1-2 位的整数字段外，其它为长度不超过 100 位的文本字段。

根据附件个数 N，“附件编号及名称”字段，会占据文件中接下去的 N 行。每行对一个附件进行说明，包括附件编号和文件名称两个字段。前者为 1-2 位的整数类型，后者为长度不超过 200 位的文本字段，字段间以逗号分隔。

在附件说明之后，直到文件尾，都是内容字段，根据实际情况，可能占据多行，总长度不超过 800 字符。

3.8.3 公告附件存放说明

根据公告编号和附件编号到服务器上下载附件内容。每个附件保存为一个单独文件，安置在 info 下的 attach 子目录中。文件名格式为：[公告编号]_[附件编号]_[原文件名]。

