

上海证券交易所
市场数据文件交换接口规格说明书
2.90 版



二〇二五年十一月

文档修订记录

版本号	日期	修订说明
2.90	2025-11	<u>基于 EzOES 已下线，《ISI01 上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》文档正式废止，相关内容迁移至本文档，具体包括如下接口文件：</u> <u>(1) 盘前参考数据：上市公司公告文件、国债利息文件、标准券折算率变更文件、</u> <u>(2) 标准券折算率变更公告文件、标准券折算比率文件、担保品及标的证券清单文件、</u> <u>质押式报价回购折算率文件、产品基础信息第二版第一批次、产品基础信息第二</u> <u>版第二批次、产品非交易基础信息文件、权证信息文件</u> <u>(3) 实时数据：竞价撮合系统行情文件</u> <u>(4) 盘后数据：过户数据文件、新股发行过户数据文件、减持控制数据文件、证券账</u> <u>户资料文件、证券权益数据文件、交易公开信息公告文件、科创板交易公开信息</u> <u>公告文件</u> <u>(5) 开放式基金数据接口（净值、分红、账户对账、交易确认）</u> <u>(6) 上传数据：已开通科创板交易权限账户资产信息接口</u>
2.80	2025-10	根据 UT 下线第六阶段安排，UT 停发所有文件，此阶段涉及： 1) 竞价撮合系统行情文件 mkttdt00.txt 2) 综合业务系统行情文件 mkttdt01.txt 3) 债券行情文件 mkttdt02.txt 4) 期权交易系统行情文件 mkttdt03.txt 5) 基金通行情文件 mkttdt06.txt 6) B 转 H 行情文件 mktdth.txt 7) 指数通行情文件 csiYYYYMMDD.txt
2.70	2025-09	新增外部源行情文件 mktdde.txt。
2.60	2025-07	根据 UT 下线第五阶段安排，UT 停止转发以下文件： 1) 国债利息文件 gzlz.MDD 2) 标准券折算率变更文件 zslMMDD.tx 3) 标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt 4) 标准券折算比率文件 xzslMMDD.txt

		5) 产品基础信息第二版第一批次 cpxx0201MMDD.txt 6) 产品基础信息第二版第二批次 cpxx0202MMDD.txt 7) 国际化产品信息文件 ifjyyyyymmdd.xml 8) 债券产品信息文件压缩包 archive_bondinfoYYYYMMDD.zip 9) 期权基础信息文件 reff03MMDD.txt 10) 期权基础信息第二版文件 reff0302YYYYMMDD.xml 11) 期权组合策略文件 zhcl03MMDD.txt 12) 竞价撮合系统盘中停牌公告文件 tpxxxxhmmss.txt 13) 债券盘中停牌公告文件 ztxxxxhmmss.txt 14) 重点指数表现文件 zsbxYYMMDD.txt 15) 期权收盘价格文件 clpr03MMDD.txt。
2.50	2025-04	根据 UT 下线第四阶段安排，UT 停止转发以下过户数据文件： 1) 债券过户数据文件 zqghXXXXX.txt 2) 国际化产品过户数据文件 ighXXXXX.txt 3) 期权过户文件压缩包 OGHXXXXX.zip（包括期权成交过户数据文件 trns03XXXXX.txt、期权持仓余额对账文件 hold03XXXXX.txt、期权其他业务文件 qtyw03XXXXX.txt）。
2.40	2025-01	调整重点指数表现文件 zsbxYYMMDD.txt，新增科创综指（000680）产品。

此处仅保留近一年的修订记录，历史修订记录详见文末历史修订记录部分。

目 录

第一章 概述	1
1.1. 使用说明	1
1.2. 名词定义	1
1.3. 接口规范	1
第二章 盘前参考数据	3
2.1. 上市公司公告文件	3
2.2. 国债利息文件	3
2.3. 标准券折算率变更文件	4
2.4. 标准券折算率变更公告文件	4
2.5. 标准券折算比率文件	5
2.6. 担保品及标的证券清单文件	5
2.7. 质押式报价回购折算率文件	6
2.8. 产品基础信息第二版第一批次文件	7
2.9. 产品基础信息第二版第二批文件	16
2.10. 产品非交易基础信息文件	16
2.11. 权证信息文件	20
2.12. 交易申报错误码信息文件	21
2.13. 产品与销售机构对应关系文件	22
2.14. 产品与做市商对应关系文件	23
2.15. 国际化产品信息文件	23
2.16. 债券产品信息文件	24
2.17. 单一股票担保物比例信息	32
2.18. 期权基础信息文件	32
2.19. 期权基础信息第二版文件	36
2.20. 期权组合策略文件	38
第三章 实时数据	41
3.1. 竞价撮合系统行情文件	41
3.2. 综合业务系统行情文件	48
3.3. 债券行情文件	48
3.4. 期权交易系统行情文件	52
3.5. 港股实时行情文件	57
3.6. 港股通交易盘实时状态行情文件	58
3.7. 固定收益平台确定报价行情文件	58
3.8. 固定收益平台成交行情文件	58
3.9. 固定收益平台成交明细行情文件	59
3.10. 固定收益平台证券信息行情文件	59
3.11. 竞价撮合系统盘中停牌公告文件	59
3.12. 债券盘中停牌公告文件	60
3.13. 基金通行情文件	62

3.14. B 转 H 行情文件	67
3.15. 指数通行行情文件	76
3.16. 外部源行情文件	76
第四章 盘后数据	79
4.1. 现货过户数据文件	79
4.2. 新股发行过户数据文件	83
4.3. 减持控制数据文件	85
4.4. 证券账户资料文件	88
4.5. 证券权益数据文件	89
4.6. 交易公开信息公告文件	89
4.7. 科创板交易公开信息公告文件	90
4.8. 债券过户数据文件	90
4.9. 重点指数表现文件	92
4.10. 份额过户文件	93
4.11. 国际化产品过户数据文件	94
4.12. 期权收盘价格文件	95
4.13. 期权过户文件压缩包	96
4.14. 期权成交过户数据文件	96
4.15. 期权持仓余额对账文件	99
4.16. 期权其他业务文件	100
4.17. 期权结算价试算结果文件	103
第五章 开放式基金数据	105
5.1. 开放式基金净值数据文件	106
5.2. 开放式基金分红数据文件	107
5.3. 开放式基金账户对账数据文件	110
5.4. 开放式基金交易确认数据文件	111
5.5. 取值附表	118
5.5.1. 基金业务代码与含义表	118
5.5.2. 销售人代码表	120
5.5.3. 返回代码表	121
第六章 上传数据	141
6.1. 期权市场参与者数据报送文件	141
6.2. 已开通科创板交易权限账户资产信息接口	143
第七章 后记	146
历史修订记录	147

第一章 概述

1.1. 使用说明

本接口规格说明书（以下简称“本接口”）规定了证券公司等会员单位及相关市场参与主体（以下简称“市场参与主体”）与上海证券交易所技术系统（以下简称“本所技术系统”）进行数据文件交换的接口规范。

1.2. 名词定义

名词	简称	说明
证通云盘	ztDisk	面向证券行业推出的高效数据存储及交换服务平台，为用户提供数据汇总分发、存储备份以及监控管理等功能
行情网关	MDGW	为用户提供 BINARY/STEP 行情接收功能
会员订单管理系统	OMS	

1.3. 接口规范

本接口支持 txt、xml、dbf 格式文件。除特别说明，本接口中所有数据文件均采用 GB18030 编码规范。

1、txt 格式数据文件均遵循以下约定（开放式基金的 txt 文件格式另有约定）：

- （1）CX 类型表示字符型字段，其中 X 代表总长度，左对齐，不足部分右补空格；
- （2）NX 类型表示十进制整数型字段，其中 X 代表数字型字符串总长度，右对齐，不足部分左补空格。除非特殊说明，整数型字段值均有正负；
- （3）NX(Y)类型表示十进制浮点数字型字段，其中 X 代表数字型字符串总长度（包括小数点位），Y 代表小数位数（小数位数不足时必须在后面补 0），右对齐，不足部分左补空格。除非特殊说明，浮点数字型字段值均有正负；
- （4）除非特殊说明，对于数字字段数值溢出的情况，将填写全 9 数值，如 N6（2）型字段值溢出时将填写 999.99；
- （5）字段间分隔符为竖线('|')；

- (6) 竖线('|')不应出现在每条记录的开头和结尾；
- (7) 各字段遵循类型定义，均为定长字段；
- (8) 每行记录以二进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。

2、dbf 格式数据文件遵循 DBF 文件有关定义，采用特殊的文件头结构与记录行结构。dbf 格式数据文件遵循以下约定：

- (1) 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。
- (2) 对于整数数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度。
- (3) 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：123.00000 显示为 123.00000；
- (4) 无特别声明，对于数字字段数值溢出，将填写全 9 数值，如 N6(2) 填写 999.99。

3、其他补充约束参见字段具体描述。

第二章 盘前参考数据

2.1. 上市公司公告文件

文件名：MMDDfNNNN、MMDDzNNNN

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为上市公司公告文件。转发自上证信息公司文件。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期，NNNN 表示序列号。

接口格式：无

2.2. 国债利息文件

文件名：gzlx

扩展名：MDD

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件包含国债应计利息。本文件转发自中登上海分公司 gzlxYYYYMMDD001.txt，并重新命名，转换为 DBF 格式。具体说明参见《IS101-上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中国债利息文件相关章节文件名中 MDD 表示月日格式的日期，M 为月份（10 月份时，M 为‘a’；11 月份时，M 为‘b’；12 月份时，M 为‘c’。），DD 为日期。

接口格式：参见《IS101-上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及国债利息文件相关章节

序号	字段名称	字段描述	类型
<u>1</u>	<u>gzdm</u>	<u>国债证券代码</u>	<u>C6</u>
<u>2</u>	<u>jxrq</u>	<u>计息日期</u>	<u>C8</u>
<u>3</u>	<u>yjlx</u>	<u>每百元应计利息额</u>	<u>N15(8)</u>
<u>4</u>	<u>lxts</u>	<u>利息天数</u>	<u>N6</u>

<u>5</u>	<u>pml1</u>	<u>票面利率</u>	<u>N8(5)</u>
----------	-------------	-------------	--------------

2.3. 标准券折算率变更文件

文件名：zslMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件提供产品在折算率启用日期所在星期开始适用的标准券折算率。本文件转发自中登上海分公司bzqz1YYYYMMDD001.txt，并重新命名。—文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。

接口格式：参见《IS101-上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及标准券折算率变更文件相关章节

<u>序号</u>	<u>字段名称</u>	<u>字段描述</u>	<u>类型</u>
<u>1</u>	<u>证券代码</u>	<u>债券、债券 ETF 证券代码</u>	<u>C6</u>
<u>2</u>	<u>证券名称</u>	<u>债券、债券 ETF 名称</u>	<u>C20</u>
<u>3</u>	<u>标准券折算率/折算值</u>	<u>标准券折算率</u> <u>当证券代码为债券代码时本字段为标准券折算率。</u> <u>当证券代码为债券 ETF 代码时本字段为标准券折算值</u>	<u>N15</u>
<u>4</u>	<u>开始适用日</u>	<u>YYYYMMDD</u>	<u>C8</u>
<u>5</u>	<u>结束适用日</u>	<u>YYYYMMDD</u>	<u>C8</u>

2.4. 标准券折算率变更公告文件

文件名：zslwMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为债券适用的标准券折算率的变更通知文件。本文件，转发自中登上海分公司

zsgglYYYYMMDD001.txt，并重新命名。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。

若为债券标准券折算率计算日,则发送调整后的债券折算率；若当日有新上市债券的折算率数据或非计算日但需调整债券折算率，则发送新上市债券和调整后的债券折算率数据；否则，发送空文件。具体说明参见《~~IS101~~上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中标准券折算率变更公告文件相关章节

接口格式：无参见《~~IS101~~上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及标准券折算率变更公告文件相关章节

2.5. 标准券折算比率文件

文件名：xzslMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为账户式质押回购业务下标准券折算比率数据文件。本文件，转发自中登上海分公司 ngzzlYYYYMMDD001.txt，并重新命名。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。具体说明参见《~~IS101~~上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中标准券折算比率文件相关章节

接口格式：参见《IS101上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及标准券折算比率文件相关章节

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券代码	国债、债券 ETF 证券代码	C6
2	标准券比例/标准券折算值	标准券比例 当证券代码为债券代码时本字段为标准券折算率。 当证券代码为债券 ETF 代码时本字段为标准券折算值	N15(3)

2.6. 担保品及标的证券清单文件

文件名：dbpMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为融资融券业务相关证券信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券代码		C6
2	对应类别	001：融资、002：融券、003：担保品	C3
3	余额	对应类别为 001 时，表示融资余额； 对应类别为 002 时，表示融券余量； 对应类别为 003 时，固定为 0；	N15

2.7. 质押式报价回购折算率文件

文件名：bzsl01MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为质押式报价回购质押券折算率（值），含债券的标准券比率及 ETF 的标准券折算值。本文件转发自指数公司文件，文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期。

允许标准券比率/标准券折算值为零。若标准券比率/标准券折算值为零，则出入库时现券发生增减变化，标准券不变化。

接口格式：

字段名称	描述	类型
证券代码	证券代码，不足 6 位左边补 0	C6
标准券比率/标准券折算值	右对齐，不足左补空格 保留三位小数，最大值为 999.999 当证券代码为债券时本字段为标准券折算率。 当证券代码为 ETF 时本字段为标准券折算值，折算值单位为元。	N15(3)

2.8. 产品基础信息第二版第一批次文件

文件名：cpxx0201MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：MDGW、ztDisk

文件说明：该文件为产品的基础信息数据文件，（包含停牌的产品，不含非交易信息、未发行上市产品）。文件名中 0201 分别代表第二版、第一批次，文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期。具体说明参见~~《IS101—上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》~~中产品基础信息第二版第一批次文件接口相关章节

接口格式：~~参见《IS101—上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及产品基础信息第二版第一批次文件接口~~

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券代码	证券代码 非交易业务（比如发行业务）而挂牌的“证券代码”（比如 780***），没有对应的产品基础信息数据记录，有关属性通过非交易信息文件获取。	C6
2	ISIN 代码	ISIN 代码（预留）。	C12
3	记录更新时间	标识接口中本记录更新时间 HH:MM:SS	C8
4	中文证券名称（短）	中文证券名称（短）	C8
5	英文证券名称	英文证券名称（预留）	C10
6	基础证券代码	当产品为权证、可转债、可交换债等衍生品时，该字段为其 标的产品的证券代码。	C6
7	市场种类	‘ASHR’表示 A 股市场；‘BSHR’表示 B 股市场。 科创板股票、综业平台集合资产管理计划、债券预发行、定向可转债取‘ASHR’。	C4
8	证券类别	‘ES’表示股票；‘EU’表示基金；‘D’表示债券；‘CB’表示公募 REITs。（参考 ISO10962），集合资产管理计划、债券预发 行、定向可转债取‘D’	C6
9	证券子类别	自定义详细证券类别，取值请参考数据说明部分	C3

序号	字段名称	字段描述	类型
10	货币种类	货币代码取值： 美元：USD；人民币：CNY；（参考 ISO4217）	C3
11	面值	债券当前面值，单位元，其他产品取 0.000	N15(3)
12	可流通证券未上市数量	对于 A 股股票（含存托凭证）、B 股股票，取值为可流通证券未上市数量 对于其它证券产品（含优先股），预留，暂不启用	N15
13	最后交易日期	对于国债预发行产品，为最后交易日期， 格式为 YYYYMMDD	C15
14	上市日期	在上交所首日交易日期，YYYYMMDD	C8
15	产品集 SET 编号	取值范围从 1 到 999。 用来表明产品的一种分组方式，用于在多主机间进行负载均衡分配。该值在一个交易日内不会变化。	N3
16	买数量单位	买订单的申报数量必须是该字段的整数倍。	N12
17	卖数量单位	卖订单的申报数量必须是该字段的整数倍。	N12
18	限价申报数量下限	限价申报数量下限	N12
19	限价申报数量上限	限价申报数量上限	N12
20	前收盘价格	前收盘价格（如有除权除息，为除权除息后前收盘价） 对于货币市场基金实时申赎，取值为 0.010 集合资产管理计划固定填写挂牌首日开盘参考价格 定向可转债如果处于转让期，则为除权除息前的前收盘价， 否则为 0	N11(3)
21	价格档位	申报价格的最小变动单位	N11(3)
22	涨跌幅限制类型	‘N’表示有涨跌幅限制类型； ‘R’表示无涨跌幅限制类型（进入退市整理期交易的退市整理股票首日、退市后重新上市的股票首日。根据交易规则（2023 年修订）3.3.13 规定）； ‘S’表示回购涨跌幅控制类型 ‘F’表示基于参考价格的涨跌幅控制	C1

序号	字段名称	字段描述	类型
		‘P’表示 IPO 上市无涨跌幅限制类型（首次公开发行上市的股票上市前 5 日。根据交易规则（2023 年修订）3.3.13 规定）； ‘U’表示无任何价格涨跌幅控制类型	
23	涨幅上限价格	对于 N 类型涨跌幅限制的产品，该字段当日不会更改，基于前收盘价（首日上市交易产品为发行价）计算。 对于其他涨跌幅限制类型，该字段仅供参考，无实际控制意义。	N11(3)
24	跌幅下限价格	计算方式参考涨幅上限价格	N11(3)
25	除权比例	每股送股比例 对于国债预发行产品，为保证金比例，单位为%。 对于基金产品，为份额折算的变动比例。当为份额拆分时，变动比例>0；当为份额合并时，-1<变动比例<0。	N11(6)
26	除息金额	每股分红金额	N11(6)
27	融资标的标志	‘T’表示是融资标的证券 ‘F’表示不是融资标的证券。	C1
28	融券标的标志	‘T’表示是融券标的证券 ‘F’表示不是融券标的证券。	C1
29	产品状态标志	该字段为 20 位字符串，每位表示含义如下，无定义则填空格。 第 1 位对应：‘N’表示首日上市。 第 2 位对应：‘D’表示除权。 第 3 位对应：‘R’表示除息。 第 4 位对应：‘D’表示国内正常交易产品，‘S’表示股票风险警示产品，‘P’表示退市整理产品（主板），‘T’表示退市转让产品，‘U’表示优先股产品。 第 5 位：‘Y’表示该产品为存托凭证。 第 6 位对应：‘L’表示债券投资者适当性要求类，‘M’表示债券机构投资者适当性要求类。 第 7 位对应：‘F’表示 15:00 闭市的产品，‘S’表示 15:30 闭市	C20

序号	字段名称	字段描述	类型
		的产品，为空表示非竞价撮合平台且非新债券交易系统挂牌产品，无意义。 第 8 位对应：‘U’表示上市时尚未盈利的上市公司股票（含存托凭证），科创板科创成长层上市公司被调出科创板成长层，或者其他上市公司上市后首次实现盈利的，取消该特殊标识。 该字段仅针对注册制股票（含存托凭证）有效。 第 9 位对应：‘W’表示具有表决权差异安排的发行人的股票（含存托凭证）。该字段仅针对注册制股票（含存托凭证）有效。 第 10 位对应：‘Y’表示支持当日交易回转，‘N’表示不支持当日交易回转。 第 11 位对应：‘Y’表示该产品为注册制股票（含存托凭证）。	
30	市价申报数量下限	市价申报数量下限	N12
31	市价申报数量上限	市价申报数量上限	N12
32	中文证券名称（长）	中文证券名称（长）	C32
33	备注	保留字段，用于扩展。备注中补充以下字段，每个字段根据格式定义，参照本文档 txt 文件对齐方式约定，字段定长，字段间以&分隔。 一、产品属性区间（第 1-40 位） 1、对于债券类产品（证券类别为“D”），定义如下： 对于国债预发行产品（证券子类别为“WIT”）： 1）招标方式 C1，‘1’表示国债预发行利率招标，‘2’表示国债预发行价格招标。 2）基准价格 N11(3)，当价格招标时为基准价格，当利率招标时为基准收益率。 3）参考久期 N6(2)，单位为年。 4）当期发行量 N9，单位为千元面额。 其他位预留，暂不启用。	C100

序号	字段名称	字段描述	类型
		对于非国债预发行产品： 1) 产品细分类别 C4, “B010”表示科创板可转债，其他债券产品暂不标识。 其他位预留，暂不启用。 2、对于股票类产品（证券类别为“ES”），定义如下： 1) 市场流通总量 N15，单位为股。 上述字段仅对 A 股股票（含存托凭证）、B 股股票有效。其他位预留，暂不启用。 3、对于基金类产品（证券类别为“EU”），定义如下： 1) 产品细分类别 C4, “F111”表示单市场股票（沪）ETF； “F112”表示跨市场股票（沪深京）ETF； “F113”表示跨市场股票（沪港深京）ETF； “F114”表示单市场股票（科创板）ETF； “F115”表示跨市场股票（含科创板）ETF； “F121”表示单市场债券（沪）ETF； “F122”表示跨市场债券（沪深）ETF； “F123”表示现金申赎类债券 ETF； “F131”表示跨境 ETF； “F141”表示黄金 ETF； “F142”表示商品期货 ETF； “F150”表示交易型货币基金； “F220”表示科创板相关 LOF。 其他位预留，暂不启用。 二、交易属性区间（第 41-60 位） 对所有产品，定义如下： 1、盘后固定价格交易标志 C1, “Y”表示支持盘后固定价格交易，“N”表示不支持盘后固定价格交易	

序号	字段名称	字段描述	类型
		2、其他位预留，暂不启用。 交易属性区间在本文件中不提供，在 cpxx0202mmdd.txt 中提供。	

数据说明：

一、各证券子类别取值说明：

业务分类	证券子类别取值
股票	<u>ASH</u> 以人民币交易的股票（主板） <u>KSH</u> 以人民币交易的股票（科创板） <u>BSH</u> 以美元交易的股票 <u>OEQ</u> 其它股票 <u>OPS</u> 公开发行优先股 <u>PPS</u> 非公开发行优先股
基金	<u>CEF</u> 封闭式基金 <u>OEF</u> 开放式基金（仅含开放式货币市场基金） <u>EBS</u> 交易所交易基金（ETF） <u>OFN</u> 其它基金 <u>LOF</u> LOF 基金
债券	<u>GBF</u> 国债、地方债、政府支持债、政策性金融债 <u>DST</u> 国债分销（仅用于分销阶段） <u>DVP</u> 公司债（地方债）分销 <u>CBF</u> 企业债 <u>CCF</u> 可转换企业债 <u>CPF</u> 公司债、企业债、可交换债、政府支持债 <u>CRP</u> 通用质押式回购 <u>OBD</u> 其它债券 <u>WIT</u> 国债预发行 <u>QRP</u> 报价回购 <u>AMP</u> 集合资产管理计划

	<u>TCB</u> 定向可转债
<u>公募 REITs</u>	<u>RET</u> 公募 REITs
<u>其他</u>	<u>CMD</u> 控制指令（中登身份认证密码服务产品、指定登记、指定撤销复用 <u>CMD</u> 证券子类别）

二、产品涨跌幅说明

（一）股票（“证券类别”=“ES”）

<u>证券子类别</u>	<u>产品状态标志第4位</u>	<u>涨跌幅限制类型</u>			
		<u>N(有涨跌幅限制类型)</u>	<u>R(无涨跌幅限制类型)</u>	<u>P(IPO上市无涨跌幅限制类型)</u>	<u>U(无任何价格涨跌幅控制类型)</u>
<u>ASH</u>	<u>D</u>	<u>主板股票(A股)(涨跌幅为前收价10%)</u>	<u>主板股票(A股)(例：重新上市首日)</u>	<u>新股上市前五日主板股票(A股)(无涨跌幅限制)</u>	<u>不适用</u>
	<u>S</u>	<u>风险警示板股票(A股)(涨跌幅为前收价5%)</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	
	<u>P</u>	<u>退市整理股票(A股)(涨跌幅为前收价10%)</u>	<u>退市整理股票(A股)(退市整理期首日)</u>	<u>不适用</u>	
<u>BSH</u>	<u>D</u>	<u>主板股票(B股)(涨跌幅为前收价10%)</u>	<u>主板股票(B股)(例：重新上市首日)</u>	<u>新股上市前五日主板股票(B股)(无涨跌幅限制)</u>	
	<u>S</u>	<u>风险警示板股票(B股)(涨跌幅为前收价5%)</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	
	<u>P</u>	<u>退市整理股票(B股)(涨跌幅为前收价10%)</u>	<u>退市整理股票(B股)(退市整理期首日)</u>	<u>不适用</u>	
<u>KSH</u>	<u>D</u>	<u>科创板股票(涨跌幅为</u>	<u>科创板股票</u>	<u>新股上市前五日科创板</u>	

		<u>前收价 20%)</u>	<u>(例：退市整理期首日)</u>	<u>股票(无涨跌幅限制)</u>	
<u>PPS</u>	<u>U</u>	<u>不适用</u>			<u>非公开发行优先股</u>

(二) 基金 (“证券类别”=“EU”)

<u>证券子类别</u>	<u>产品状态标志第4位</u>	<u>涨跌幅限制类型</u>	
		<u>N (有涨跌幅限制类型)</u>	<u>R (无涨跌幅限制类型)</u>
<u>EBS</u>	<u>D</u>	<u>ETF(涨跌幅为前收价 10%, 科创板相关 ETF 为 20%)</u>	<u>不适用</u>
<u>LOF</u>	<u>D</u>	<u>LOF(涨跌幅为前收价 10%, 科创板相关 LOF 为 20%)</u>	<u>不适用</u>
<u>CEF</u>	<u>D</u>	<u>封闭式基金(涨跌幅为前收价 10%)</u>	<u>不适用</u>
<u>OEF</u>	<u>D</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>

(三) 债券 (“证券类别”=“D”)

<u>证券子类别</u>	<u>产品状态标志第4位</u>	<u>涨跌幅限制类型</u>				
		<u>N (有涨跌幅限制类型)</u>	<u>R (无涨跌幅限制类型)</u>	<u>F (基于参考价格的涨跌幅控制类型)</u>	<u>S (回购涨跌幅控制类型)</u>	<u>U (无任何价格涨跌幅控制类型)</u>
<u>GBF</u>	<u>D</u>	<u>不适用</u>	<u>国债</u>			
<u>CBF</u>	<u>D</u>	<u>不适用</u>	<u>企业债券</u>			
<u>CCF</u>	<u>D</u>	<u>可转换企业债券(上市首日涨幅为发行价 57.3%, 跌幅为发行价 43.3%, 上市次日起涨跌幅为前收价 20%)</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>

<u>CPF</u>	<u>D</u>	<u>不适用</u>	<u>公司债券(或地方债券)</u>			
<u>DST</u>	<u>D</u>	<u>国债分销(涨跌幅为前收价30%)</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	
<u>DVP</u>	<u>D</u>	<u>公司债(地方债)分销(固定价格)</u>				
<u>CRP</u>	<u>D</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>质押式国债回购</u>	
<u>BRP</u>	<u>D</u>				<u>质押式企债回购</u>	
<u>WIT</u>	<u>D</u>			<u>国债预发行</u>	<u>不适用</u>	
<u>TCB</u>	<u>D</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>不适用</u>	<u>定向可转债</u>

(四) 公募 REITs (“证券类别”=“CB”)

<u>证券子类</u> <u>别</u>	<u>产品状态</u>	<u>涨跌幅限制类型</u>
	<u>标志第 4 位</u>	<u>N (有涨跌幅限制类型)</u>
<u>RET</u>	<u>D</u>	<u>公募 REITs (上市首日涨跌幅为发行价 30%,后续为前收价 10%)</u>

三、其他说明

1. 涨跌幅类型“S”、“F”不适用于股票产品；涨跌幅类型“S”、“P”、“F”、“U”、“R”不适用于基金产品；涨跌幅类型“P”不适用于债券产品；涨跌幅类型“S”、“P”、“F”、“U”、“R”不适用于公募 REITs 产品。
2. 对于上市首日的股票、基金、公募 REITs 和债券，产品状态标志第 1 位取值为“N”。
3. 对于有价格涨跌幅和无价格涨跌幅证券，其动态价格笼子限制参见交易规则。
4. 对于国债预发行产品，采用价格申报的，国债预发行交易的价格申报区间为该期国债招标日前第六个法定工作日理论估值价格加减 3 元；采用收益率申报的，国债预发行的收益率申报区间为该期国债招标日前第六个法定工作日该期限国债到期收益率加减 0.75 个百分点。
5. 对于定向可转债产品，上市日期为转让、转股和回售起始日中最早的日期。

6. 对于当日交易回转标志，仅对分离式可转债 CBD、企业债券 CBF、可转换企业债券 CCF、公司债券 CPF、金融机构发行债券 FBF、国债 GBF、无息国债 GBZ、A 股股票 ASH、科创板股票 KSH、B 股股票 BSH、公开发行优先股 OPS、其它股票 OEQ、封闭式基金 CEF、交易所交易基金 EBS、上市型开放式基金 LOF、其它基金 OFN 有效。
7. 对于集合资产管理计划产品，基础证券代码、面值、买卖数量单位、申报数量上下限、价格档位、融资融券标的标识、除权比例、除息金额字段对该业务无意义，取定长空格。
8. 对于其他仅在综合业务平台挂牌的撮合产品，通常参照竞价撮合平台产品在本文件中发布，
9. 其中对于国债预发行产品，基础证券代码、申报数量上下限、除息金额、融资融券标志对该业务无意义，取定长空格。
10. 对于控制指令类产品，基础证券代码、证券类别、面值、买卖数量单位、申报数量上下限、前收盘价格、价格档位、涨跌幅类型、涨幅上下限、除权比例、除息金额、融资融券标的标识、产品状态标志字段无意义，取定长空格或取 0。

2.9. 产品基础信息第二版第二批次文件

文件名：cpxx0202MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：MDGW、ztDisk

文件说明：该文件为产品的基础信息数据文件（包含停牌的产品，不含非交易信息、未发行上市产品）。文件名中 0202 分别代表第二版、第二批次，文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期。具体说明参见《~~IS101~~上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中产品基础信息第二版第二批次文件接口相关章节

接口格式：同产品基础信息第二版第一批文件 cpxx0201MMDD.txt。本文件与 cpxx0201MMDD.txt 文件的区别是：第一批次发出后，第二批次对 cpxx 价格相关内容的更新以及备注字段中的交易属性区间会通过本文件发出。参见《~~IS101~~上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及产品基础信息第二版第二批次文件接口相关章节

2.10. 产品非交易基础信息文件

文件名：fjyYYYYMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：MDGW、ztDisk

文件说明：该文件为与产品相关的非交易业务基础信息数据。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的文件适用日期。

接口格式：

<u>序号</u>	<u>字段名称</u>	<u>描述</u>	<u>类型</u>
<u>1</u>	<u>参考数据类型</u>	<u>技术实现固定值</u> <u>竞价撮合平台非交易，该值固定填写为 R0001；</u> <u>互联网交易平台非交易，该值固定填写为 R0006；</u> <u>后续格式仅当参考数据类型字段为 R0001 或 R0006 时对应</u> <u>格式类型</u> <u>后续若加入其他平台非交易数据，则该字段有新的取值，</u> <u>对于不同的参考数据类型取值，后续字段格式则可能不一</u> <u>样。</u>	<u>C5</u>
<u>2</u>	<u>非交易证券代码</u>	<u>非交易证券代码，如无则为空</u>	<u>C6</u>
<u>3</u>	<u>非交易证券名称</u>	<u>非交易证券名称</u>	<u>C8</u>
<u>4</u>	<u>产品证券代码</u>	<u>产品证券代码，如无则为空</u>	<u>C6</u>
<u>5</u>	<u>产品证券名称</u>	<u>产品证券名称，如无则为空</u>	<u>C8</u>
<u>6</u>	<u>非交易业务类型</u>	<u>非交易业务类型：</u> <u>IN 上网证券发行申购</u> <u>IS 老股东增发证券发行申购</u> <u>PH IPO 配号</u> <u>KK IPO 扣款</u> <u>HK IPO 还款</u> <u>R1 股票配股或科创板股票配售行权</u>	<u>C2</u>

序号	字段名称	描述	类型
		<u>R2 股票转配股配股行权</u> <u>R3 职工股转配股配股行权</u> <u>R4 股票配转债行权</u> <u>OC 开放式基金申购</u> <u>OR 开放式基金赎回</u> <u>OD 开放式基金分红选择</u> <u>OT 开放式基金份额转出</u> <u>FS 要约预受</u> <u>FC 要约撤销</u> <u>QT 其它</u>	
<u>7</u>	<u>非交易订单输入开始日期</u>	<u>订单输入开始日期。</u>	<u>C8 YYYYMMDD</u>
<u>8</u>	<u>非交易订单输入结束日期</u>	<u>订单输入结束日期。</u>	<u>C8 YYYYMMDD</u>
<u>9</u>	<u>非交易订单整手数</u>	<u>整手数。指订单的数量必须为该字段取值的整数倍。</u>	<u>N12</u>
<u>10</u>	<u>非交易订单最小订单数量</u>	<u>非交易订单的最小订单数量。指订单的数量必须比该字段取值大。</u>	<u>N12</u>
<u>11</u>	<u>非交易订单的最大订单数量</u>	<u>非交易订单的最大订单数量。指订单的数量必须比该字段取值小。</u>	<u>N12</u>
<u>12</u>	<u>非交易价格</u>	<u>当非交易业务类型为 IN、IS 时，为发行价格。</u> <u>当非交易业务类型为 PH、KK、HK 时，为产品发行价格。</u> <u>当非交易业务类型为 FS、FC 时，为要约预受和撤销的固定价格。</u> <u>当非交易业务类型为 R1、R2、R3、R4 时，为配股、配债、科创板配售方式减持价格。</u> <u>其他非交易业务，该字段默认填写为 1.00000，无实际意义。</u>	<u>N13(5)</u>
<u>13</u>	<u>IPO 总量</u>	<u>当非交易业务类型为 IN、IS 时，发行总量。</u>	<u>N16</u>

序号	字段名称	描述	类型
14	IPO 分配方法	当非交易业务类型为 IN、IS 时，IPO 分配方法。 L-摇号抽签 A-竞价分配 P-ETF 末日比例配售	C1
15	IPO 竞价分配或 ETF 认购确认日期	当非交易业务类型为 IN、IS 时，执行竞价分配或 ETF 末日比例配售的日期。	C8 YYYYMMDD
16	IPO 验资或配号日期	当非交易业务类型为 IN、IS 时，进行验资或配号的日期。	C8 YYYYMMDD
17	IPO 摇号抽签日期或 ETF 比例配售日	当非交易业务类型为 IN、IS 时，进行摇号抽签的日期或为 ETF 比例配售日（对于 ETF 网上发行，该日的认购订单，在“ETF 认购确认日”按照“ETF 末日配售比例”进行比例配售。）。)	C8 YYYYMMDD
18	IPO 申购价格区间下限	当非交易业务类型为 IN、IS 时，IPO 申购价格区间的下限。	N11(3)
19	IPO 申购价格区间上限	当非交易业务类型为 IN、IS 时，IPO 申购价格区间的上限。	N11(3)
20	ETF 末日配售比例	当非交易业务类型为 IN、IS 时，对于 ETF 网上发行，为 ETF 末日比例配售的比例，初始默认值为-100.000。 有效值范围：最小值为 0.000；最大值为 100.000。	N11(3)
21	配股股权登记日	当非交易业务类型为 R1、R2、R3、R4 时，配股的股权登记日，科创板配售方式减持业务此字段无意义。	C8 YYYYMMDD
22	配股除权日	当非交易业务类型为 R1、R2、R3、R4 时，配股的除权日，科创板配售方式减持业务此字段无意义。	C8 YYYYMMDD
23	配股比例	当非交易业务类型为 R1、R2、R3、R4 时，配股比例，科创板配售方式减持业务此字段无意义。	N11(6)
24	配股总量	当非交易业务类型为 R1、R2、R3、R4 时，配股总量/科创板配售方式减持总量。	N16
25	T-2 日基金收益/基金净值	当非交易业务类型为 OC、OR 时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为 T-2 日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为 T-2 日每百份基金净值；	N13(5)

序号	字段名称	描述	类型
26	T-1 日基金收益/基金净值	当非交易业务类型为 OC、OR 时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为 T-1 日每百万份基金收益； 如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为 T-1 日每百份基金净值；	N13(5)
27	发行方式	当非交易业务类型为 IN、IS 且分配方法为 L（摇号中签）时，发行方式。 001-按市值限额申购 002-增发资金申购 003-信用申购 新股网上发行采用 001，可转债、可交换债网上发行采用 003，以上两种发行方式均取消预缴款。	C3
28	备注	保留字段，用于扩展。备注中补充以下字段，每个字段根据格式定义，参照本文档 txt 文件对齐方式约定，字段定长，字段间以&分隔。 发行申购非交易产品信息 对于非交易业务类型为 IN，定义如下： 1、尚未盈利标识 C1，取值为'U'时，表示尚未盈利。该字段仅针对注册制股票（含存托凭证）有效。 二、要约非交易产品信息 对于非交易业务类型为 FS、FC，定义如下： 1、要约预受和要约撤销的申报编号（770***），字段类型为 C6，取值为 6 位数字。	C46

2.11. 权证信息文件

文件名：qzxxMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为权证的相关信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
<u>1</u>	<u>行权代码</u>	<u>权证行权时使用的证券代码</u>	<u>C6</u>
<u>2</u>	<u>权证代码</u>	<u>权证代码</u>	<u>C6</u>
<u>3</u>	<u>标的证券</u>	<u>权证对应的标的证券</u>	<u>C6</u>
<u>4</u>	<u>权证类型</u>	<u>若为认购权证，则本字段为“认购”；若为认沽权证，则本字段为“认沽”</u>	<u>C4</u>
<u>5</u>	<u>权证余额</u>	<u>当前权证的流通总余额</u>	<u>N17</u>
<u>6</u>	<u>结算方式</u>	<u>若为现金结算，则本字段为“现金”；若为实物结算，则本字段为“实物”</u>	<u>C4</u>
<u>7</u>	<u>行权方式</u>	<u>若为欧式行权，则本字段为“欧式”；若为美式行权，则本字段为“美式”</u>	<u>C4</u>
<u>8</u>	<u>行权结算价格</u>	<u>右对齐，单位：元</u>	<u>N20(9)</u>
<u>9</u>	<u>行权价格</u>	<u>右对齐</u>	<u>N8(3)</u>
<u>10</u>	<u>行权比例</u>	<u>右对齐</u>	<u>N6(3)</u>
<u>11</u>	<u>权证到期日期</u>	<u>格式为 YYYYMMDD</u>	<u>C8</u>
<u>12</u>	<u>结算价使用日期</u>	<u>格式为 YYYYMMDD</u>	<u>C8</u>

2.12. 交易申报错误码信息文件

文件名：errinfoMMDD

扩展名：xml

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为交易申报错误码信息文件，包含了上交所交易系统返回的申报错误码及错误描述信息，目前

该文件仅包含新债券交易系统返回的错误码信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期

***编码规范：**UTF-8 编码

接口格式：XML 文件，每条错误码信息对应文件中的一条 ErrInfo 元素记录，示例如下：

序号	字段名称	字段描述	类型
元素名 1	ErrCode	申报错误代码	C5
元素名 2	ErrDesc	错误描述信息	变长，最大长度为 C200

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<ErrInfos>
  <ErrInfo>
    <ErrCode>10000</ErrCode>
    <ErrDesc>Error Code Description</ErrDesc>
  </ErrInfo>
  <ErrInfo>
    <ErrCode>11000</ErrCode>
    <ErrDesc>Error Code Description</ErrDesc>
  </ErrInfo>
</ErrInfos>
```

2.13. 产品与销售机构对应关系文件

文件名：xsscpxxMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布（交易日六点）

发布渠道：ztDisk

文件说明：互联网交易平台使用该文件向做市商发送销售机构与基金通挂牌产品对应关系文件，为全量文件（包含停牌数据）。文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期

接口格式：

序号	字段名	字段类型	备注
1	序号	C20	唯一确定一条记录，不能重复
2	交易日期	C8	格式为：YYYYMMDD
3	证券代码	C6	
4	产品集	N4	
5	销售机构编码	C8	销售机构在交易所的唯一标识

2.14. 产品与做市商对应关系文件

文件名：zsscpxxMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布（交易日六点）

发布渠道：ztDisk

文件说明：互联网交易平台使用该文件向做市商发送做市商与基金通挂牌产品对应关系文件，为全量文件（包含停牌数据）。文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期

接口格式：

序号	字段名	字段类型	备注
1	序号	C20	唯一确定一条记录，不能重复
2	交易日期	C8	格式为：YYYYMMDD
3	证券代码	C6	
4	做市商会员代码	C8	
5	做市商会员名称	C200	

2.15. 国际化产品信息文件

文件名：ifjyyyyymmdd

扩展名：xml

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：本文件包含国际化产品相关基础信息数据，文件名中 yyyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期

接口格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	Inst_ID	证券代码	C6
2	Inst_Nam	证券简称	C8
3	Underlying_ID	辅助证券代码	C6
4	Busi_Typ	业务类型： BTH=B 转 H 业务	C3

说明：

1. 证券代码为 B 转 H 股虚拟证券代码；
2. 辅助证券代码为 B 转 H 股的香港证券代码。

2.16. 债券产品信息文件

文件名：bondinfoYYYYMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为债券产品信息文件，包含了全量存续期内债券产品的信息。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券代码		C6
2	银行间代码		C10
3	证券简称		C8
4	扩位证券简称		C50
5	上市日期	YYYYMMDD	C8
6	面值（元）		N19(2)
7	发行价格（元）		N19(4)
8	票面利率（%）		N19(4)
9	起息日	YYYYMMDD	C8
10	到期日	YYYYMMDD	C8
11	付息频率	对于不规则付息的债券，该字段固定为 N，对于其他债券类别则取值如下： 0：按年付息 1：按半年付息 2：按季度付息 3：到期一次还本付息	C1

12	期限		N19(4)
13	期限单位	取值如下： BYDAY：按日计算 BYYEAR：按年推算	C50
14	证券全称		C300
15	债券类型	取值如下： 0：国债 1：地方债 2：政策性金融债 3：企业债 4：中小企业私募债 5：公司债 6：可转债 8：非公开发行公司债 9：次级债券 10：ABS 11：可交换债 12：政府支持机构债 16：新企业债券	C2
16	利率类型	取值如下： 0：固定利率 1：浮动利率	C1
17	发行方式	取值如下： 0：大公募 1：小公募 2：私募	C1
18	发行人/原始权益人		C200
19	发行人类型	取值如下： 财政部	C20

		地方政府 农业发展银行 国家开发银行 进出口银行 国有-中央 国有-省级（含直辖市） 国有-市级 国有-区县级 国有-乡镇级 民营企业 外商独资 中外合资 全民所有制 集体所有制 中外合作 境外 其他	
20	主体评级	取值如下： A A+ A- AA AA+ AA- AAA B B+ B- BB BB+	C50

		BB- BBB BBB+ BBB- C C+ C- CC CC+ CC- CCC CCC+ CCC- O O 代表“无评级”	
21	债项评级	取值如下： A A+ A- AA AA+ AA- AAA B B+ B- BB BB+	C50

		BB- BBB BBB+ BBB- C C+ C- CC CC+ CC- CCC CCC+ CCC- O O 代表“无评级”	
22	评级机构	取值如下： ZCXGJ：中诚信国际信用评级有限公司 DGGJ：大公国际资信评估有限公司 PYZX：中证鹏元资信评估股份有限公司 SHXSJZX：上海新世纪资信评估投资服务有限公司 SHYDZX：远东资信评估有限公司 DFJCGJ：东方金诚国际信用评级有限公司 LHZX：联合信用评级有限公司 LHZXPG：联合资信评估有限公司 BPXY：标普信用评级（中国）有限公司 OTHER：其他 NONE：无	C100
23	是否本所上市公司	取值如下： N：否	C1

		Y: 是	
24	发行量 (亿元)		N19(5)
25	特殊债券类型	每一位均为“Y”或“N”，代表特定位置上是否是某一类特殊债券，具体类别如下： 第 1 位：永续期债券 第 2 位：绿色债券 第 3 位：熊猫债券 第 4 位：一带一路债券 第 5 位：创新创业债券 第 6 位：证券公司短期债券 第 7 位：证券公司次级债券 第 8 位：项目收益债券 第 9 位：全民所有制企业债券 第 10 位：社会责任债券 第 11 位：纾困债 第 12 位：短期公司债券 第 13 位：乡村振兴债券 第 14 位：科技创新债券 第 15 位：低碳转型债券 第 16 位：中小微企业支持债券 第 17~20 位：预留备用	C20
26	结构化分档	取值如下： 0：优先档 1：次级档	C1
27	资产支持专项计划名称		C100
28	交易方式	取值如下： PPCJ：匹配成交 DJCJ：点击成交 XJCJ：询价成交	C50

		JMCJ: 竞买成交 XSCJ: 协商成交 多个取值使用英文半角符号 “,” 进行分割	
29	结算方式	取值如下: JEJS: 净额结算 RTGS: RTGS 多个取值使用英文半角符号 “,” 进行分割	C50
30	价格方式	取值如下: 0: 净价 1: 全价	C1
31	投资者适当性要求	取值如下: 00: 普通投资者 02: 专业投资者 04: 专业机构投资者	C2
32	特殊转让板	取值如下: N: 否 Y: 是	C1
33	是否基准做市品种	取值如下: N: 否 Y: 是	C1
34	摘牌日	YYYYMMDD	C8
35	含权类型	取值如下: NONE: 无 HS: 回售 SH: 赎回 LLTZ: 利率调整 TQCH: 提前偿还 LJLL: 累进利率	C50

		KXQZCDJ: 永续期债重定价 多个取值使用英文半角符号 “,” 进行分割	
36	回售选择权		C200
37	赎回选择权		C200
38	主承销商/计划管理人		C300
39	发行起始日	YYYYMMDD	C8
40	发行终止日	YYYYMMDD	C8
41	出库起始日	YYYYMMDD	C8
42	入库起始日	YYYYMMDD	C8
43	标准券折算率		N19(4)
44	ISIN 代码		C12
45	回售起始日	YYYYMMDD	C8
46	回售终止日	YYYYMMDD	C8
47	回售资金发放日	YYYYMMDD	C8
48	回售可撤销起始日	YYYYMMDD	C8
49	回售可撤销结束日	YYYYMMDD	C8
50	是否转售	取值如下: N: 否 Y: 是	C1
51	转股类型		C20
52	A 股证券代码 (转股)		C6
53	A 股证券简称 (转股)		C8
54	转股价格		N19(5)
55	转股起始日	YYYYMMDD	C8
56	转股终止日	YYYYMMDD	C8
57	A 股证券代码 (换股)		C6
58	A 股证券简称 (换股)		C8
59	换股价格		N19(2)

60	换股起始日	YYYYMMDD	C8
61	换股结束日	YYYYMMDD	C8

2.17. 单一股票担保物比例信息

文件名：dygpdbblYYYYMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：揭示沪市单一 A 股股票及存托凭证作为信用账户担保物总量（持仓数量）占其上市可流通量的比例。

文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。

接口格式：

序号	字段名	字段类型	备注
1	交易日期	C8	格式为：YYYYMMDD
2	证券代码	C6	
3	证券简称	C8	
4	单一股票担保物比例	N20(2)	单位为%，保留两位小数。

2.18. 期权基础信息文件

文件名：reff03MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为期权合约信息文件，包含了全量未摘牌的期权合约信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 R0301 表示期权基础信息	C5
2	合约编码	期权合约的合约编码	C8
3	合约交易代码		C19
4	期权合约简称		C20
5	标的证券代码		C6
6	基础证券证券名称		C8
7	标的证券类型	EBS 表示标的类型为 ETF，ASH 表示标的类型为股票	C3
8	欧式美式	若为欧式期权，则本字段为“E”；若为美式期权，则本字段为“A”	C1
9	认购认沽	认购，则本字段为“C”；若为认沽，则本字段为“P”	C1
10	合约单位	经过除权除息调整后的合约单位	N11
11	期权行权价	经过除权除息调整后的期权行权价，精确到 0.0001 元	N11(4)
12	首个交易日	期权首个交易日,YYYYMMDD	C8
13	最后交易日	期权最后交易日/行权日，YYYYMMDD	C8
14	期权行权日	期权行权日，YYYYMMDD	C8
15	行权交割日	行权交割日，默认为行权日的下一个交易日，YYYYMMDD	C8
16	期权到期日	期权到期日，YYYYMMDD	C8
17	合约版本号	期权合约的版本号	C1
18	当前合约未平仓数	单位是（张） 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。	N12
19	合约前收盘价	昨日收盘价，右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
20	合约前结算价	昨日结算价，如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价），右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
21	标的证券前收盘	期权标的证券除权除息调整后的前收盘价格，右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)

22	涨跌幅限制类型	‘N’有涨跌幅限制类型	C1
23	涨幅上限价格	当日期权涨停价格，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
24	跌幅下限价格	当日期权跌停价格，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
25	单位保证金	当日持有一张合约所需要的保证金数量，精确到分	N16(2)
26	保证金计算比例参数一	保证金计算参数，单位：%	N6(2)
27	保证金计算比例参数二	保证金计算参数，单位：%	N6(2)
28	整手数	一手对应的合约数	N12
29	单笔限价申报下限	单笔限价申报的申报张数下限。	N12
30	单笔限价申报上限	单笔限价申报的申报张数上限。	N12
31	单笔市价申报下限	单笔市价申报的申报张数下限。	N12
32	单笔市价申报上限	单笔市价申报的申报张数上限。	N12
33	最小报价单位	单位：元，精确到 0.0001 元	N11(4)
34	期权合约状态信息标签	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充空格。 第 1 位：‘0’表示可开仓，‘1’表示限制卖出开仓（不包括备兑开仓）和买入开仓。 第 2 位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填 0） 第 3 位：‘0’表示未临近到期日，‘1’表示距离到期日不足 5 个交易日。 第 4 位：‘0’表示近期未做调整，‘1’表示最近 5 个交易日内合约发生过调整。 第 5 位：‘A’表示当日新挂牌的合约，‘E’表示存续的合约 第 6 位：‘1’表示合约不能进行垂直价差组合策略，‘0’表示可以进行所有的组合策略。	C8
35	垂直价差组合策略到期解除日期	该日期表示垂直价差组合策略到期解除的日期，YYYYMMDD。 对于 E-2 后波动加挂的合约，此字段仍为 E-2 日。到期日调整时，此字段信息自动同步调整。	C8

	扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定
--	------	-------------------	----

2.19. 期权基础信息第二版文件

文件名：reff0302YYYYMMDD

扩展名：xml

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为期权合约信息文件，包含了全量未摘牌期权合约的信息。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期。中文字符采用 GBK 编码，每个期权合约信息对应 XML 中一条 OptionContract_Rec 记录，各元素中取值以实际业务长度为准，不补空格。

接口格式：

序号	字段名称	字段中文名称	字段描述	字段类型
1	RStreamID	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 R0301 表示期权基础信息	C5
2	SecurityID	合约编码	期权合约的合约编码	C8
3	ContractID	合约交易代码		C40
4	ContractSymbol	期权合约简称		C60
5	UnderlyingSecurityID	标的证券代码		C6
6	UnderlyingSymbol	基础证券证券名称		C8
7	UnderlyingType	标的证券类型	EBS 表示标的类型为 ETF，ASH 表示标的类型为股票	C3
8	OptionType	欧式美式	若为欧式期权，则本字段为“E”；若为美式期权，则本字段为“A”	C1
9	CallOrPut	认购认沽	认购，则本字段为“C”；若为认沽，则本字段为“P”	C1
10	ContractMultiplierUnit	合约单位	经过除权除息调整后的合约单位	N11
11	ExercisePrice	期权行权价	经过除权除息调整后的期权行权价，精确到 0.0001 元	N11(4)
12	StartDate	首个交易日	期权首个交易日,YYYYMMDD	C8
13	EndDate	最后交易日	期权最后交易日/行权日，YYYYMMDD	C8

14	ExerciseDate	期权行权日	期权行权日，YYYYMMDD	C8
15	DeliveryDate	行权交割日	行权交割日，默认为行权日的下一个交易日，YYYYMMDD	C8
16	ExpireDate	期权到期日	期权到期日，YYYYMMDD	C8
17	UpdateVersion	合约版本号	期权合约的版本号	C1
18	TotalLongPosition	当前合约未平仓数	单位是（张） 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。	N12
19	SecurityClosePx	合约前收盘价	昨日收盘价,右对齐,单位:元(精确到 0.0001 元)	N11(4)
20	SettlPrice	合约前结算价	昨日结算价，如遇除权除息则为调整后的结算价（合约上市首日填写参考价），右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
21	UnderlyingClosePx	标的证券前收盘	期权标的证券除权除息调整后的前收盘价格，右对齐，单位：元（精确到 0.0001 元）	N11(4)
22	PriceLimitType	涨跌幅限制类型	‘N’有涨跌幅限制类型	C1
23	DailyPriceUpLimit	涨幅上限价格	当日期权涨停价格,单位:元(精确到 0.0001 元)	N11(4)
24	DailyPriceDownLimit	跌幅下限价格	当日期权跌停价格,单位:元(精确到 0.0001 元)	N11(4)
25	MarginUnit	单位保证金	当日持有一张合约所需要的保证金数量，精确到分	N16(2)
26	MarginRatioParam1	保证金计算比例参数一	保证金计算参数，单位：%	N6(2)
27	MarginRatioParam2	保证金计算比例参数二	保证金计算参数，单位：%	N6(2)
28	RoundLot	整手数	一手对应的合约数	N12
29	LmtOrdMinFloor	单笔限价申报下限	单笔限价申报的申报张数下限。	N12

30	LmtOrdMaxFloor	单笔限价申报上限	单笔限价申报的申报张数上限。	N12
31	MktOrdMinFloor	单笔市价申报下限	单笔市价申报的申报张数下限。	N12
32	MktOrdMaxFloor	单笔市价申报上限	单笔市价申报的申报张数上限。	N12
33	TickSize	最小报价单位	单位：元，精确到 0.0001 元	N11(4)
34	SecurityStatusFlag	期权合约状态信息 标签	左起每位表示特定的含义。 第 1 位：‘0’表示可开仓，‘1’表示限制 卖出开仓（不包括备兑开仓）和买入开仓。 第 2 位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示 连续停牌。（预留，暂填 0） 第 3 位：‘0’表示未临近到期日，‘1’表 示距离到期日不足 5 个交易日。 第 4 位：‘0’表示近期未做调整，‘1’表 示最近 5 个交易日内合约发生过调整。 第 5 位：‘A’表示当日新挂牌的合约，‘E’ 表示存续的合约 第 6 位：‘1’表示合约不能进行垂直价差组合 策略，‘0’表示可以进行所有的组合策略。	C8
35	AutoSplitDate	垂直价差组合策略 到期解除日期	该日期表示垂直价差组合策略到期解除的 日期，YYYYMMDD。 对于 E-2 后波动加挂的合约，此字段仍为 E-2 日。到期日调整时，此字段信息自动同步调 整。	C8
36	UnderlyingSymbolEx	基础证券证券名称 （长）	期权标的证券的长简称，若无长简称，与基 础证券证券名称字段内容一致。	C32

2.20. 期权组合策略文件

文件名：zhcl03MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为期权当日的组合策略信息的信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。记录采用行格式，字段以分隔符 ‘|’ 来区分，固定长度。成分合约数量未达到最大值时，仅填写有效的合约信息，不足部分的合约信息填空。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

序号	字段名		字段描述	字段类型
1	参考数据类型		参考数据类型标识符，取值 C0301 表示组合策略信息	C5
2	组合策略名称		认购牛市价差策略 认沽熊市价差策略 认沽牛市价差策略 认购熊市价差策略 跨式空头 宽跨式空头 认购期权普通卖出开仓转备兑开仓	C32
3	组合策略编码		目前为 7 种组合策略： CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSC、KS、KKS、ZBD	C8
4	成分合约个数		策略的成分合约数，为 1-4 个	N2
5	策略标志位		第一位：S 为同到期日，D 为不同到期日，N 为到期日无要求 第二位：S 为相同标的，D 为不同标的，N 为标的无要求 第三位：‘0’ 为到期日自动解除，‘1’ 为 E-1 日自动解除，依次类推。‘N’ 表示无不适用。 第四位至第十六位预留	C16
合约信息	6	认购还是认沽期权	C 为认购期权，P 为认沽期权	C1
	7	持仓类型	L 为权利仓，S 为义务仓	C1

	8	备兑期权标志	备兑标签，取值范围： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
	9	行权价高低顺序	从 1 开始，1 表示行权价最高，2 次之。如果行权价相同， 则填写相同数字	C1
	10	合约的到期日顺序	仅当“策略标志位”第 1 位为 D 时有效。 从 1 开始，1 表示到期日最近，2 次之。如果到期日相同， 则填写相同数字	N1
	11	单份组合策略中包含的此合约张数	单份组合策略中包含的此合约张数	N2

第三章 实时数据

3.1. 竞价撮合系统行情文件

文件名：mktdt00

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为竞价撮合系统行情文件，包括股票、基金、指数及债券分销行情。

接口格式：~~参见《IS101-上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及行情接口相关章节。~~行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分。

文件结构图如下：



文件结构描述参考：

BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSes
Status
MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePri
ce|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|BuyPrice2|BuyVolume2|SellPrice2|SellVolume2|BuyPrice3|BuyVol
ume3|SellPrice3|SellVolume3|BuyPrice4|BuyVolume4|SellPrice4|SellVolume4|BuyPrice5|BuyVolume5|SellPrice5|Sell
Volume5|TradingPhaseCode|Timestamp
.....
.....
.....
EndString|Checksum

(1) 文件头定义：第一行特殊记录

序 号	域名	字段名称	字段 类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER

<u>2</u>	<u>Version</u>	<u>版本</u>	<u>C8</u>	<u>MTP1.00</u>
<u>3</u>	<u>BodyLength</u>	<u>数据长度</u>	<u>N10</u>	<u>计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。</u>
<u>4</u>	<u>TotNumTradeReports</u>	<u>文件体记录数</u>	<u>N5</u>	<u>文件体记录数</u>
<u>5</u>	<u>MDReportID</u>	<u>行情序号</u>	<u>N8</u>	<u>行情文件序号（预留，暂不填）</u>
<u>6</u>	<u>SenderCompID</u>	<u>发送方</u>	<u>C6</u>	<u>发送方标示符，取</u> <u>XSHG01</u>
<u>7</u>	<u>MDTime</u>	<u>行情时间</u>	<u>C21</u>	<u>行情时间，格式为</u> <u>YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss</u>
<u>8</u>	<u>MDUpdateType</u>	<u>发送方式</u>	<u>N1</u>	<u>0 = 快照 Full refresh</u> <u>1 = 增量 Incremental（暂不支持）</u>
<u>9</u>	<u>MDSesStatus</u>	<u>市场行情状态</u>	<u>C8</u>	<u>全市场行情状态1：</u> <u>该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。</u> <u>第 1 位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交易期间（含中间休市），‘E’表示全市场处于闭市期间。</u> <u>第 2 位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。</u> <u>第 3 位：‘1’表示全市场行情结束标志，未结束取‘0’。</u> <u>第 4 位：‘1’表示上海市场行情结束标志，未结束取‘0’。第 5 位-第 8 位预留。</u>
		<u>扩展区域</u>	<u>不定</u>	<u>系统应能支持记录尾部扩展新的字段。</u>

（2）文件体定义：多行记录

¹ 上海市场：包括股票、基金、债券分销。全市场：包括上海市场及指数

行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号，当取值为 MD001 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名称	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD001 表示指数行情数据格式类型，其中指数目前实际精度为 4 位小数；
2	SecurityID	产品代码	C6	指数
3	Symbol	产品名称	C8	指数简称
4	TradeVolume	成交数量	N16	参与计算相应指数的交易数量，股票指数交易数量单位是 100 股，基金指数的交易数量单位是 100 份，债券指数的交易数量单位是千元面额。
5	TotalValueTraded	成交金额	N16(2)	参与计算相应指数的成交金额，单位均为人民币元。
6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(4)	前收盘指数
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(4)	今开盘指数
8	HighPrice	最高价	N11(4)	最高指数
9	LowPrice	最低价	N11(4)	最低指数
10	TradePrice	最新价	N11(4)	最新指数
11	ClosePx	今收盘价	N11(4)	今收盘指数，无取值取空格
12	TradingPhaseCode	指数实时阶段及标志	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 (预留)
13	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.sss
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号，当取值为 MD002、MD003、MD004 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名称	字段类型	描述
----	----	------	------	----

1	<u>MDStreamID</u>	<u>行情数据类型</u>	<u>C5</u>	<u>行情数据类型标识符，取值</u> <u>MD002 表示股票（A、B 股）行情数</u> <u>据格式类型；</u> <u>MD003 表示债券分销行情数据格式</u> <u>类型；</u> <u>MD004 表示基金行情数据格式类型</u> <u>（含公募 REITs）；</u>
2	<u>SecurityID</u>	<u>产品代码</u>	<u>C6</u>	<u>证券代码</u>
3	<u>Symbol</u>	<u>产品名称</u>	<u>C8</u>	<u>证券简称</u>
4	<u>TradeVolume</u>	<u>成交数量</u>	<u>N16</u>	
5	<u>TotalValueTraded</u>	<u>成交金额</u>	<u>N16(2)</u>	
6	<u>PreClosePx</u>	<u>昨日收盘价</u>	<u>N11(3)</u>	
7	<u>OpenPrice</u>	<u>今日开盘价</u>	<u>N11(3)</u>	
8	<u>HighPrice</u>	<u>最高价</u>	<u>N11(3)</u>	
9	<u>LowPrice</u>	<u>最低价</u>	<u>N11(3)</u>	
10	<u>TradePrice</u>	<u>最新价</u>	<u>N11(3)</u>	<u>最新成交价</u>
11	<u>ClosePx</u>	<u>今收盘价</u>	<u>N11(3)</u>	
12	<u>BuyPrice1</u>	<u>申买价一</u>	<u>N11(3)</u>	<u>当前买入价</u>
13	<u>BuyVolume1</u>	<u>申买量一</u>	<u>N12</u>	
14	<u>SellPrice1</u>	<u>申卖价一</u>	<u>N11(3)</u>	<u>当前卖出价</u>
15	<u>SellVolume1</u>	<u>申卖量一</u>	<u>N12</u>	
16	<u>BuyPrice2</u>	<u>申买价二</u>	<u>N11(3)</u>	
17	<u>BuyVolume2</u>	<u>申买量二</u>	<u>N12</u>	
18	<u>SellPrice2</u>	<u>申卖价二</u>	<u>N11(3)</u>	
19	<u>SellVolume2</u>	<u>申卖量二</u>	<u>N12</u>	
20	<u>BuyPrice3</u>	<u>申买价三</u>	<u>N11(3)</u>	
21	<u>BuyVolume3</u>	<u>申买量三</u>	<u>N12</u>	

22	<u>SellPrice3</u>	<u>申卖价三</u>	<u>N11(3)</u>	
23	<u>SellVolume3</u>	<u>申卖量三</u>	<u>N12</u>	
24	<u>BuyPrice4</u>	<u>申买价四</u>	<u>N11(3)</u>	
25	<u>BuyVolume4</u>	<u>申买量四</u>	<u>N12</u>	
26	<u>SellPrice4</u>	<u>申卖价四</u>	<u>N11(3)</u>	
27	<u>SellVolume4</u>	<u>申卖量四</u>	<u>N12</u>	
28	<u>BuyPrice5</u>	<u>申买价五</u>	<u>N11(3)</u>	
29	<u>BuyVolume5</u>	<u>申买量五</u>	<u>N12</u>	
30	<u>SellPrice5</u>	<u>申卖价五</u>	<u>N11(3)</u>	
31	<u>SellVolume5</u>	<u>申卖量五</u>	<u>N12</u>	
32	<u>PreCloseIOPV</u>	<u>基金 T-1 日收盘时刻 IOPV</u>	<u>N11 (3)</u>	<u>可选字段，仅当 MDStreamID=MD004 时存在该字段。</u> <u>仅对 ETF 产品，此字段有效。</u> <u>该字段取 0.000 时，无意义。</u> <u>该字段不作除权除息等调整。</u>
33	<u>IOPV</u>	<u>基金 IOPV</u>	<u>N11 (3)</u>	<u>可选字段，仅当 MDStreamID=MD004 时存在该字段。</u> <u>仅对 ETF 产品，此字段有效。</u> <u>当 ETF 公告文件2 Publish (TXT 版) /PublishIOPVFlag (XML 版) 字段 (是否需要发布 IOPV) 取值为 1 时，此字段为对应产品的 IOPV 值；</u> <u>当 ETF 公告文件 Publish (TXT 版) /PublishIOPVFlag (XML 版) 字段取值为 0 时，此字段固定取 0.000，无意义；</u>
34	<u>TradingPhaseCode</u>	<u>产品实时阶段及标志</u>	<u>C8</u>	<u>该字段为 8 位字符串,左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。</u>

² ETF 公告文件接口详见《IS118 上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》。

				<u>第 1 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示开盘集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示产品停牌，‘M’表示可恢复交易的熔断时段（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断时段（暂停交易至闭市），‘U’表示收盘集合竞价时段。</u> <u>第 2 位：‘0’表示此产品不可正常交易，‘1’表示此产品可正常交易，无意义填充空格。</u> <u>第 3 位：‘0’表示未上市，‘1’表示已上市。</u> <u>第 4 位：‘0’表示此产品在当前时段不接受订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受订单申报。无意义填充空格。</u>
35	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.sss
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

说明：当日交易时段内，产品可能出现的状态包括：开盘集合竞价，连续交易，停牌，收盘集合竞价，熔断（盘中集合竞价，暂停交易至闭市）。对于上述字段 34（TradingPhaseCode），其取值的第 2 位（是否可正常交易）在产品进入开盘集合竞价、连续交易、收盘集合竞价，熔断（盘中集合竞价）状态时值为‘1’，在产品进入停牌、熔断（暂停交易至闭市）状态时值为‘0’，且闭市后保持该产品闭市前的是否可正常交易状态。其取值的第 4 位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

（3）文件尾定义：最后一行特殊记录

序号	域名	字段名称	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	Checksum	校验和	C3	校验和，3 位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段 (也不包括该字段后的换行符)数值的

				<u>文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274,则模 256 后的数为 18,校验和域将取为 ASCII 字符串 018</u> <u>校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖,校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。</u>
--	--	--	--	--

数据说明：

1. 注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；注意根据文件体首字段 MDStreamID 取值解析不同的文件体记录格式；
2. 文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应根据行情数据类型识别处理；
3. 文件体记录按行情数据类型递增，同一行情数据类型按证券代码递增；
4. 对于暂停上市的股票，文件中不包含该股票的记录。发行期内对于未设定开始上市交易的产品，文件中不包含该产品的记录。对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录；
5. 如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如 N10 取 9999999999；
6. 前收盘价格，在开市之前即行发布；
7. 当产品代码为债券分销时，由于债券交易的数量以千元面额为单位，成交金额为该债券每笔成交的价格*数量*10 的总和；
8. 对于产品价格、金额数据单位，除 B 股为美元外，其他为人民币元。对于产品数量数据单位，股票为股，基金、权证、公募 REITs 为份，债券分销为千元面额。对于产品 TradeVolume 成交数量单位，股票为股，基金、公募 REITs 为份，债券分销为千元面额，权证为 100 份；对于指数价格、金额、数量单位，详见表格具体定义说明；
9. 在集合竞价时段内，当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量；

- 10. 在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息；
- 11. 临时停牌期间不揭示五档行情；
- 12. 字段无意义或无该字段行情数据时，字符填充格，数值填 0；
- 13. 交易所具体产品代码，参见相关发文通知，并参考以上处理；
- 14. 对于港交所，仅提供一档数据，其他档数据填充格。

3.2. 综合业务系统行情文件

文件名：mktdt01

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为综合业务系统行情文件，包括国债预发行行情、盘后固定价格交易行情

接口格式：参见《IS105 上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及行情文件接口相关章节。

3.3. 债券行情文件

文件名：mktdt02

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为债券行情文件，包括债券现券行情、质押式回购行情

接口格式：行情文件包括文件头、文件体和文件尾三部分

（1）文件头：单行记录

序号	字段名称	字段描述	类型
1	BeginString	起始标识符，填“HEADER”	C6
2	Version	版本，填“XBTP1.00”	C8
3	BodyLength	数据长度：以该字段分隔符后的字节数（不包含本字段后面的分隔符）	N10

		进行计算，包含其他字段后面的分隔符、换行符	
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5
5	MDReportID	行情序号（预留，暂不填）	N8
6	SenderCompID	发送方，填“XSHG01”	C6
7	MDTime	交易所行情发送时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
8	MDUpdateType	发送方式： 0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental（暂不支持）	N1
9	MDSesStatus	市场行情状态，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格，具体参见 下方市场行情状态取值	C8
		扩展区域，市场参与主体的技术系统应能支持记录尾部扩展新的字段	不定

市场行情状态取值：

市场行情状态	字段取值
第 1 位	‘S’表示债券市场启动期间（开市前），‘T’表示债券市场处于交易期间（含中间休市），‘E’表示债券市场处于闭市期间
第 2 位	‘1’表示债券市场开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’
第 3 位	‘1’表示债券市场行情结束标志，未结束取‘0’
第 4 位	‘1’表示债券现券（可转债及新标准券）行情结束标志，未结束取‘0’
第 5 位	‘1’表示债券质押回购、债券现券（除可转债及新标准券）行情结束标志，未结束取‘0’。

（2）文件体：多行记录

序号	字段名称	字段描述	类型
1	MDStreamID	行情数据类型，取“MD201”，表示债券行情	C5
2	SecurityID	产品代码	C6
3	Symbol	产品名称	C8
4	TradeVolume	成交数量	N16
5	TotalValueTraded	成交金额，对于债券现券，成交金额为每笔成交的价格*数量*10 的总和；对于质押式回购，成交金额为 100*成交数量*10	N16(2)

6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(3)
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(3)
8	HighPrice	最高价	N11(3)
9	LowPrice	最低价	N11(3)
10	TradePrice	最新价	N11(3)
11	ClosePx	今收盘价	N11(3)
12	BuyPrice1	申买价一	N11(3)
13	BuyVolume1	申买量一	N12
14	SellPrice1	申卖价一	N11(3)
15	SellVolume1	申卖量一	N12
16	BuyPrice2	申买价二	N11(3)
17	BuyVolume2	申买量二	N12
18	SellPrice2	申卖价二	N11(3)
19	SellVolume2	申卖量二	N12
20	BuyPrice3	申买价三	N11(3)
21	BuyVolume3	申买量三	N12
22	SellPrice3	申卖价三	N11(3)
23	SellVolume3	申卖量三	N12
24	BuyPrice4	申买价四	N11(3)
25	BuyVolume4	申买量四	N12
26	SellPrice4	申卖价四	N11(3)
27	SellVolume4	申卖量四	N12
28	BuyPrice5	申买价五	N11(3)
29	BuyVolume5	申买量五	N12

30	SellPrice5	申卖价五	N11(3)
31	SellVolume5	申卖量五	N12
32	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志，4 位有效，剩余位填充空格，参见下方产品实时阶段及标志取值	C8
33	Timestamp	最新成交时间，格式为 HH:MM:SS.sss	C12
		扩展区域	不定

产品实时阶段及标志取值：

产品实时阶段及标志	字段取值
第 1 位	‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示开盘集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示产品停牌
第 2 位	‘0’表示此产品不可正常交易，‘1’表示此产品可正常交易，无意义填充空格。在产品进入开盘集合竞价、连续交易状态时值为‘1’，在产品进入停牌状态时值为‘0’，且闭市后保持该产品闭市前的是否可正常交易状态
第 3 位	‘0’表示未上市，‘1’表示已上市
第 4 位	‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报，无意义填充空格。仅在交易时段有效，在非交易时段无效

行情字段单位说明：

债券现券行情、质押式回购行情的产品价格、金额数据单位均为人民币元，产品数量单位为千元面额。

（3）文件尾：单行记录

序号	字段名称	字段描述	类型
1	EndString	结束标识符，填“TRAILER”	C7
2	Checksum	3 位校验和，校验和计算逻辑参见下方校验和计算	C3

校验和计算：

校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符(包含分隔符、换行符)之和然后模 256 得出,然后转化为 3 位 ASCII 码。例如,如果经计算校验和为 274,则模 256 后的数为 18,校验和域将取为 ASCII 字符串 018。

校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间,因文件按记录循环写入覆盖,校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。

3.4. 期权交易系统行情文件

文件名: mktdt03

扩展名: txt

发布时间: 实时发布

发布渠道: MDGW

文件说明: 该文件为期权交易系统行情文件。

(一) 行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分;

(二) 注意行情文件可扩展性,文件记录尾部可能随时增加扩展字段,接收处理方应能向下兼容处理,即增加扩展字段后,对新增字段无需识别处理的用户,不需要升级系统;

(三) 文件体中,对于不同的行情数据类型,分别定义记录格式,接收处理方应根据行情数据类型识别处理;

(四) 文件体记录按行情数据类型递增,同一行情数据类型按证券代码递增;

(五) 对于摘牌后的产品,文件中不包含该产品的记录;

(六) 如文件中数值字段取值超过约定格式最大值,取最大值,如 N10 取 9999999999;

(七) 前收盘价格,在开市之前即行发布;

(八) 对于价格、金额数据,单位为人民币元。对于数量数据,合约单位为张;

(九) 在集合竞价时段内,当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格,即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量;

(十) 字段无意义或无该字段行情数据时,填空格;

(十一) 交易所具体产品代码,参见相关发文通知,并参考以上处理。

接口格式:

文件头定义,第一行特殊记录:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	DTP1.00
3	BodyLength	数据长度	N12	计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N12	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号（预留，暂不填）
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符，取 XSHG03
7	MDTime	行情时间	C21	行情时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental（暂不支持）
9	MDSesStatus	市场行情状态	C8	全市场行情状态： 该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。 第 1 位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交易期间（含中间休市），‘E’表示全市场处于闭市期间。 第 2 位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。 第 3 位：‘1’表示市场行情闭市标志，未闭市取‘0’。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母 M 加类型编号。

当取值为 M0301 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
----	----	-----	------	----

1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 M0301 表示行情数据格式类型，目前该类型包含期权交易行情
2	SecurityID	合约编码	C8	期权合约的产品代码
3	TotalLongPosition	总持仓量	N12	单位是（张） 此处总持仓量值为持仓余额轧差之前的数值。
4	TradeVolume	当日累计成交数量	N16	
5	TotalValueTraded	当日累计成交金额	N16(2)	精确到分
6	PreSettlPrice	昨日结算价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
8	AuctionPrice	动态参考价格	N11(4)	波动性中断参考价，单位：元（精确到 0.0001 元）
9	AuctionQty	虚拟匹配数量	N12	
10	HighPrice	当日最高成交价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
11	LowPrice	当日最低成交价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）
12	TradePrice	最新成交价格	N11(4)	最新成交价，单位：元（精确到 0.0001 元）
13	BuyPrice1	申买价一	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
14	BuyVolume1	申买量一	N12	
15	SellPrice1	申卖价一	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
16	SellVolume1	申卖量一	N12	
17	BuyPrice2	申买价二	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
18	BuyVolume2	申买量二	N12	
19	SellPrice2	申卖价二	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）

20	SellVolume2	申卖量二	N12	
21	BuyPrice3	申买价三	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
22	BuyVolume3	申买量三	N12	
23	SellPrice3	申卖价三	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
24	SellVolume3	申卖量三	N12	
25	BuyPrice4	申买价四	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
26	BuyVolume4	申买量四	N12	
27	SellPrice4	申卖价四	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
28	SellVolume4	申卖量四	N12	
29	BuyPrice5	申买价五	N11(4)	当前买入价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
30	BuyVolume5	申买量五	N12	
31	SellPrice5	申卖价五	N11(4)	当前卖出价（当前最优价），单位：元（精确到 0.0001 元）
32	SellVolume5	申卖量五	N12	
33	SettlPrice	今日结算价	N11(4)	单位：元（精确到 0.0001 元）

34	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志	C4	该字段为 4 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 第 1 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘V’表示波动性中断，‘P’表示临时停牌、‘U’表示收盘集合竞价。‘M’表示可恢复交易的熔断（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断（暂停交易至闭市） 第 2 位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填空格） 第 3 位：‘0’表示不限制开仓，‘1’表示限制备兑开仓，‘2’表示限制卖出开仓，‘3’表示限制卖出开仓、备兑开仓，‘4’表示限制买入开仓，‘5’表示限制买入开仓、备兑开仓，‘6’表示限制买入开仓、卖出开仓，‘7’表示限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓 第 4 位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。
35	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.000
36	ReservedWord	预留时间字段	C12	预留字段暂填 00:00:00.000
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

说明：

在集合竞价时段内：

1. 申买价一（BuyPrice1）和申卖价一（SellPrice1）中同时为虚拟动态参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格；

2. 同时，申买量一（BuyVolume1）和申卖量一（SellVolume1）分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟匹配量。

3. 同时，申买量二（BuyVolume2）和申卖量二（SellVolume2）分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟未匹配量。

在闭市时段内：

1. 最新价（TradePrice）为收盘价
2. 今日结算价（SettlePrice）暂为 0
3. 今日结算价通过期权收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）揭示

产品实时阶段及标志中，第 4 位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	Checksum	校验和	C3	校验和，3 位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段（不包括该字段后的换行符）数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018

3.5. 港股实时行情文件

文件名：mkttdt04

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为上海证券交易所转发的港股实时行情文件，包括港股通标的及特别证券的交易行情

接口格式：参见《IS117 上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书(港股交易)》中数据格式约定以及港

股实时行情接口相关章节。

3.6. 港股通交易盘实时状态行情文件

文件名：trdses04.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为沪港通系统港股通交易盘实时状态行情文件，包括港股通实时额度数据行情、上交所港股通系统可接收订单并转发的产品状态数据

接口格式：参见《IS117 上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书(港股交易)》中数据格式约定以及港股通交易盘实时状态相关章节。

3.7. 固定收益平台确定报价行情文件

文件名：se015qdbjyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为固定收益平台确定报价行情文件，包括确定报价业务行情数据。

接口格式：参见《上海证券交易所 LDDS 系统固定收益行情接口说明书》中数据格式约定以及确定报价相关章节。

3.8. 固定收益平台成交行情文件

文件名：se015cjhqyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为固定收益平台成交行情文件，包含固定收益平台除特定债券及债券 ETF 的产品的成交统计信息。

接口格式：参见《上海证券交易所 LDDS 系统固定收益行情接口说明书》中数据格式约定以及成交行情相关章节。

3.9. 固定收益平台成交明细行情文件

文件名：se015cjmxyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为固定收益平台除特定债券的产品成交明细行情（逐笔行情），包括确定报价、待定报价、询价、协商成交、合并申报、竞买等方式达成成交的数据；不包含质押式协议回购业务、三方回购的成交数据。

接口格式：参见《上海证券交易所 LDDS 系统固定收益行情接口说明书》中数据格式约定以及成交明细相关章节。

3.10. 固定收益平台证券信息行情文件

文件名：se015zqxxyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为固定收益平台债券信息行情文件，包含固定收益平台挂牌产品信息及产品实时状态。

接口格式：参见《上海证券交易所 LDDS 系统固定收益行情接口说明书》中数据格式约定以及证券信息相关章节。

3.11. 竞价撮合系统盘中停牌公告文件

文件名：tpxxxxhhmmss.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW、ztDisk

文件说明：该文件为竞价撮合系统主板、科创板盘中停牌公告文件，文件名中 xxxx 为盘中停牌公告序号，从 0001

开始递增编号；hhmmss 为时间戳

接口格式：文本文件，示例如下：

1) 停牌公告模板一（复牌时间早于 14: 57 的盘中停牌）：

关于{证券名称}（{证券代码}）盘中临时停牌的公告 {证券名称}（{证券代码}）今日{上午/下午，根据停牌起始时间而定}交易触及盘中临时停牌。根据《上海证券交易所交易规则》的有关规定，本所决定，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分开始暂停{证券名称}（{证券代码}）交易，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分起恢复交易。 本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。 上海证券交易所 {YYYY}年{MM}月{DD}日

2) 停牌公告模板二（复牌时间晚于 14: 57（含）的盘中停牌）：

关于{证券名称}（{证券代码}）盘中临时停牌的公告 {证券名称}（{证券代码}）今日{上午/下午，根据停牌起始时间而定}交易触及盘中临时停牌。根据《上海证券交易所交易规则》的有关规定，本所决定，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分开始暂停{证券名称}（{证券代码}）交易，自{YYYY}年{MM}月{DD}日 14 时 57 分起恢复交易。 本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。 上海证券交易所 {YYYY}年{MM}月{DD}日

3.12. 债券盘中停牌公告文件

文件名：ztxxxxhhmmss

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW、ztDisk

文件说明：该文件为债券盘中停牌公告文件，文件名中 xxxx 为债券盘中停牌公告序号，从 0001 开始递增编号；

hhmmss 为时间戳

接口格式：文本文件，示例如下：

(1) 停牌公告模板一（除可转债外的其他债券现券触发停牌，且复牌时间早于 15:27）

关于{证券名称}（{证券代码}）盘中临时停牌的公告

上证公告（债券临停）[{YYYYMMDD}]{停牌公告序号}号

{证券名称}（{证券代码}）今日{上午/下午，根据停牌起始时间而定}交易出现异常波动。根据《上海证券交易所债券交易规则》和《关于债券匹配成交盘中临时停牌及有关事项的通知》的有关规定，本所决定，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分开始暂停{证券名称}（{证券代码}）交易，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分起恢复交易。

本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。恢复交易后，如该债券交易再次出现异常波动，本所可实施第二次盘中临时停牌，停牌时间持续至今日{HH}时{MM}分。

上海证券交易所

{YYYY}年{MM}月{DD}日

(2) 停牌公告模板二（除可转债外的其他债券现券触发停牌，且复牌时间为 15:27）

关于{证券名称}（{证券代码}）盘中临时停牌的公告

上证公告（债券临停）[{YYYYMMDD}]{停牌公告序号}号

{证券名称}（{证券代码}）今日{上午/下午，根据停牌起始时间而定}交易出现异常波动。根据《上海证券交易所债券交易规则》和《关于债券匹配成交盘中临时停牌及有关事项的通知》的有关规定，本所决定，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分开始暂停{证券名称}（{证券代码}）交易，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分起恢复交易。

本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。

上海证券交易所

{YYYY}年{MM}月{DD}日

(3) 停牌公告模板三（可转债触发停牌，且复牌时间早于 14:57）

关于{证券名称}（{证券代码}）盘中临时停牌的公告

上证公告（债券临停）[{YYYYMMDD}]{停牌公告序号}号

{证券名称}（{证券代码}）今日{上午/下午，根据停牌起始时间而定}交易出现异常波动。根据《上海证券交易所可转换公司债券交易实施细则》的有关规定，本所决定，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分开始暂停{证券名称}（{证券代码}）交易，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分起恢复交易。

本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。恢复交易后，如该债券交易再次出现异常波动，本所可实施第二次盘中临时停牌，停牌时间持续至今日{HH}时{MM}分。

上海证券交易所

{YYYY}年{MM}月{DD}日

（4）停牌公告模板四（可转债触发停牌，且复牌时间为 14:57）

关于{证券名称}（{证券代码}）盘中临时停牌的公告

上证公告（债券临停）[{YYYYMMDD}]{停牌公告序号}号

{证券名称}（{证券代码}）今日{上午/下午，根据停牌起始时间而定}交易出现异常波动。根据《上海证券交易所可转换公司债券交易实施细则》的有关规定，本所决定，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分开始暂停{证券名称}（{证券代码}）交易，自{YYYY}年{MM}月{DD}日{HH}时{MM}分起恢复交易。

本所提醒投资者注意交易风险，理性投资。

上海证券交易所

{YYYY}年{MM}月{DD}日

3.13. 基金通行情文件

文件名：mktdt06

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：发送基金通行行情文件

接口格式：行情文件包括文件头、文件体和文件尾三部分。午间休市同样揭示各档买卖价格和数量等信息；临时停牌期间不揭示五档行情。字段无意义或无该字段行情数据时，字符填空格，数值填 0

(1) 文件头定义，第一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	FEX1.00
3	BodyLength	数据长度	N10	计算出的长度字段分隔符后面的字节数 (不包含本字段后面的分隔符)，包含其他字段后面的分隔符、换行符。 (暂不启用)
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号(暂不启用)
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符，取 SSEIN
7	MDTime	行情文件时间	C21	行情时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 [为每次文件更新的时间，不论是否盘中均要更新] 市场参与者系统注意根据此日期判断数据准确性，避免误用测试数据。
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental (暂不支持)
9	MktStatus	市场状态	C8	0 = 全日收市 1 = 输入买卖盘(开盘集合竞价时段) 2 = 对盘(开盘集合竞价时段) 3 = 持续交易 4 = 对盘(收盘集合竞价时段) 5 = 输入买卖盘(收盘集合竞价时段)

				7 = 暂停 100 = 未开市 101 = 不可取消(开盘集合竞价时段) 102 = Exchange Intervention 103 = 收市 104 = 取消买卖盘 105 = 参考价定价(收盘集合竞价时段) 106 = 不可取消(收盘集合竞价时段) 107 = 随机收市(收盘集合竞价时段) 108=随机对盘（开盘集合竞价时段）
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

(2)文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号。

当取值为 MD601 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD601 表示基金行情数据格式类型；
2	SecurityID	产品代码	C6	证券代码
3	Symbol	产品名称	C8	证券简称
4	TradeVolume	成交数量	N15(2)	
5	NumTrades	成交笔数	N16	
6	TotalValueTraded	成交金额	N19(5)	单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
7	PreClosePx	昨日收盘价	N14(5)	单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
8	OpenPrice	今日开盘价	N14(5)	单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
9	HighPrice	最高价	N14(5)	单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
10	LowPrice	最低价	N14(5)	单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
11	TradePrice	现价	N14(5)	最新成交价，单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
12	Perprice	均价	N14(5)	加权平均价，单位元，小数点 5 位，实

				际有效位三位
13	ClosePx	今收盘价	N14(5)	单位元，小数点 5 位，实际有效位三位
14	BuyPrice1	申买价一	N14(5)	当前买入价
15	BuyVolume1	申买量一	N15(2)	单位份
16	SellPrice1	申卖价一	N14(5)	当前卖出价
17	SellVolume1	申卖量一	N15(2)	单位份
18	BuyPrice2	申买价二	N14(5)	
19	BuyVolume2	申买量二	N15(2)	单位份
20	SellPrice2	申卖价二	N14(5)	
21	SellVolume2	申卖量二	N15(2)	单位份
22	BuyPrice3	申买价三	N14(5)	
23	BuyVolume3	申买量三	N15(2)	单位份
24	SellPrice3	申卖价三	N14(5)	
25	SellVolume3	申卖量三	N15(2)	单位份
26	BuyPrice4	申买价四	N14(5)	
27	BuyVolume4	申买量四	N15(2)	单位份
28	SellPrice4	申卖价四	N14(5)	
29	SellVolume4	申卖量四	N15(2)	单位份
30	BuyPrice5	申买价五	N14(5)	
31	BuyVolume5	申买量五	N15(2)	单位份
32	SellPrice5	申卖价五	N14(5)	
33	SellVolume5	申卖量五	N15(2)	单位份
34	InvestorSellingPrice	投资者卖出均价	N14(5)	单位元
35	InvestorSellVolume	投资者卖出总量	N15(2)	单位份
36	InvestorBestSellPrice	投资者卖出最优价	N14(5)	单位元
37	InvestorSellVolumeAtBestPrice	投资者卖出最优价 数量	N15(2)	单位份
38	InvestorBuyingPrice	投资者买入均价	N14(5)	单位元
39	InvestorBuyVolume	投资者买入总量	N15(2)	单位份

40	InvestorBestBuyPrice	投资者买入最优价	N14(5)	单位元
47	InvestorBuyVolumeAtBestPrice	投资者买入最优价 数量	N15(2)	单位份
42	IOPV	基金 IOPV	N14(5)	MDStreamID=MD601 时存在该字段。
43	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志	C8	该字段为 8 位字符串,左起每位表示特定的含义,无定义则填充空格。 第 1 位:‘S’表示启动(开市前)时段,‘C’表示开盘集合竞价时段,‘T’表示连续交易时段,‘E’表示闭市时段,‘P’表示产品停牌,‘M’表示可恢复交易的熔断时段(盘中集合竞价),‘N’表示不可恢复交易的熔断时段(暂停交易至闭市),‘U’表示收盘集合竞价时段。 第 2 位:‘0’表示此产品不可正常交易,‘1’表示此产品可正常交易,无意义填充空格。 第 3 位:‘0’表示未上市,‘1’表示已上市。 第 4 位:‘0’表示此产品在当前时段不接受订单申报,‘1’表示此产品在当前时段可接受订单申报。无意义填充空格。
44	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.000
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

(3) 文件尾定义,最后一行特殊记录:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	CheckSum	校验和	C3	校验和,3 位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换

				行符)数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018 校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。
--	--	--	--	---

3.14. B 转 H 行情文件

文件名：mktdth

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：转发港股行情文件，仅包含 B 转 H 标的行情

接口格式：行情文件包括文件头、文件体和文件尾三部分

（1）文件头定义，第一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	BTH1.00
3	BodyLength	数据长度	N10	计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。 (暂不填写，填空格)
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号（预留，暂不填，填空格）
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符，取 SSEIN
7	MDTime	行情文件时间	C21	行情时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000 [为每次文件更新的时间，不论是否盘中均要更

				新] 市场参与者系统注意根据此日期判断数据准确性，避免误用测试数据。
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental（暂不支持）
9	MktStatus	市场状态	C8	0 = 全日收市 1 = 输入买卖盘(开盘集合竞价时段) 2 = 对盘(开盘集合竞价时段) 3 = 持续交易 4 = 对盘(收盘集合竞价时段) 5 = 输入买卖盘(收盘集合竞价时段) 7 = 暂停 100 = 未开市 101 = 不可取消(开盘集合竞价时段) 102 = Exchange Intervention 103 = 收市 104 = 取消买卖盘 105 = 参考价定价(收盘集合竞价时段) 106 = 不可取消(收盘集合竞价时段) 107 = 随机收市(收盘集合竞价时段) 108 = 随机对盘（开盘集合竞价时段）
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

（2）文件体定义，多条行情记录，行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号。

当取值为 MD401 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD401 表示为 B 转 H 证券行情数据格式
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码,不足五位左补零。 例：00012

				(对应 MMDH 定义域名: SecurityCode) 注: 本接口中 MMDH 对应关系仅供参考。
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称 [简体中文, 最多 8 个汉字, UTF-16LE 编码 (每个汉字编码可为 2 至 4 个字符)](注意汉字编码可能包含分隔符、换行符) (对应 MMDH 定义域名: SecurityNameGB)
4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位] (对应 MMDH 定义域名: SecurityShortName)
5	TradeVolume	成交数量	N16	(对应 MMDH 定义域名: SharesTraded)
6	TotalValueTraded	成交金额	N16(3)	(对应 MMDH 定义域名: Turnover)
7	PreClosePx	昨日收盘价	N11(3)	(对应 MMDH 定义域名: PreviousClosingPrice)
8	NominalPrice	按盘价	N11(3)	收市竞价交易时段开始时为参考价格 收市后为收市价 其余时段为按盘价 (对应 MMDH 定义域名: NominalPrice)
9	HighPrice	最高价	N11(3)	全日最高价 (对应 MMDH 定义域名: HighPrice)
10	LowPrice	最低价	N11(3)	全日最低价 (对应 MMDH 定义域名: LowPrice)
11	TradePrice	最新价	N11(3)	最新成交价 (对应 MMDH 定义域名: LastPrice)
12	BuyPrice1	申买价一	N11(3)	最佳买入价 集合竞价时段内, 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下), 为参考平衡价格; 未有参考平衡价格: 已有买盘, 为最佳买入价, 否则为零 (对应 MMDH 定义域名: BidPrice1)
13	BuyVolume1	申买量一	N12	最佳买入价的申买量

				集合竞价时段内， 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下)，为参考平衡成交量； 未有参考平衡价格：已有买盘，为最佳买入价的申买量，否则为零 (对应 MMDH 定义域名：AggregateBidQuantity1)
14	SellPrice1	申卖价一	N11(3)	最佳卖出价 集合竞价时段内， 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下)，为参考平衡价格； 未有参考平衡价格：已有卖盘，为最佳卖出价，否则为零 (对应 MMDH 定义域名：AskPrice1)
15	SellVolume1	申卖量一	N12	最佳卖出价的申卖量 集合竞价时段内， 已有参考平衡价格(BuyPrice1 等于 SellPrice1 并为非零的情况下)，为参考平衡成交量； 未有参考平衡价格：已有卖盘，为最佳卖出价的申卖量，否则为零 (对应 MMDH 定义域名：AggregateAskQuantity1)
16	SecTradingStatus	证券交易状态	C8	第 0 位：‘0’表示正常，‘1’表示暂停交易。 (对应 MMDH 定义域名：SecurityTradingStatus)
17	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此证券行情最近的更新时间 一般盘前或当天收市价更新后，此更新时间固定不变。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 MD404 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD404 表示为 B 转 H 证券市调机制(VCM)数据格式 (只包含于交易时段内，因 VCM 被触发而启动冷静期之 B 转 H 证券的相关信息)
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码,不足五位左补零。 例：00012 (对应 MMDH 定义域名：SecurityCode)
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称[简体中文，最多 8 个汉字，UTF-16LE 编码（每个汉字编码可为 2 至 4 个字符） (对应 MMDH 定义域名：SecurityNameGB)
4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位]
5	VCMStartTime	市调机制开始时间	C8	VCM 冷静期开始的时间 HH:MM:SS (对应 MMDH 定义域名：CoolingOffStartTime)
6	VCMEndTime	市调机制结束时间	C8	VCM 冷静期结束的时间 HH:MM:SS (对应 MMDH 定义域名：CoolingOffEndTime)
7	VCMRefPrice	市调机制参考价	N11(3)	VCM 冷静期内的参考价格（对应 MMDH 定义域名：VCMReferencePrice)
8	VCMLowerPrice	市调机制下限价	N11(3)	VCM 冷静期内的价格下限（对应 MMDH 定义域名：VCMLowerPrice)
9	VCMUpperPrice	市调机制上限价	N11(3)	VCM 冷静期内的价格上限（对应 MMDH 定义域名：VCMUpperPrice)
10	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此 B 转 H 证券 VCM 信息最近的更新时间
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 MD405 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD405 表示为 B 转 H 证券收市竞价交易时段 (CAS)数据格式 (于收市竞价交易时段开始发放及只包含 CAS 涵盖的 B 转 H 证券的相关信息)
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码,不足五位左补零。 例：00012 (对应 MMDH 定义域名：SecurityCode)
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称[简体中文，最多 8 个汉字， UTF-16LE 编码（每个汉字编码可为 2 至 4 个字符） (对应 MMDH 定义域名：SecurityNameGB)
4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位]
5	CASRefPrice	收盘集合竞价时段参考价	N11(3)	CAS 的参考价格 (对应 MMDH 定义域名：ReferecePrice)
6	CASLowerPrice	收盘集合竞价时段下限价	N11(3)	CAS 的价格下限 (对应 MMDH 定义域名：LowerPrice)
7	CASUpperPrice	收盘集合竞价时段上限价	N11(3)	CAS 的价格上限 (对应 MMDH 定义域名：UpperPrice)
8	OrdImbDirection	不能配对买卖盘方向	C1	CAS 未能配对买卖盘的方向 N = 买卖盘量相等 B = 买盘比卖盘多 S = 卖盘比买盘多 <空格> = 不适用(未有参考平衡价格) (对应 MMDH 定义域名：OrderImbalanceDirection)
9	OrdImbQty	不能配对买卖盘	N12	CAS 未能配对买卖盘的数量

		量		(对应 MMDH 定义域名: OrderImbalanceQuantity)
10	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此 B 转 H 证券收市竞价交易时段信息最近的更新时间 当天收市价更新后, 此更新时间固定不变。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

当取值为 MD406 时, 文件体记录格式如下:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDSStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符, 取值 MD406 表示为 B 转 H 证券开市竞价交易时段 (POS) 数据格式 (只于开市竞价交易时段发放及只包含 POS 涵盖的 B 转 H 证券的相关信息)
2	SecurityID	证券代码	C5	证券代码, 不足五位左补零。 例: 00012 (对应 MMDH 定义域名: SecurityCode)
3	Symbol	中文证券简称	C32	中文证券简称[简体中文, 最多 8 个汉字, UTF-16LE 编码 (每个汉字编码可为 2 至 4 个字符)] (对应 MMDH 定义域名: SecurityNameGB)
4	SymbolEn	英文证券简称	C15	英文证券简称[最多 15 位]
5	POSRefPrice	开盘集合竞价时段参考价	N11(3)	POS 的参考价格, 于不可取消(开盘集合竞价时段)提供, 之前数值为 0 (对应 MMDH 定义域名: ReferecePrice)
6	POSLowerBidPrice	开盘集合竞价时段买盘下限价	N11(3)	POS 买盘的价格下限 (对应 MMDH 定义域名: POSLowerPrice)
7	POSUpperBidPrice	开盘集合竞价时段卖盘上限价	N11(3)	POS 卖盘的价格上限

		段买盘上限价		(对应 MMDH 定义域名: UpperLimit / POSUpperLimit)
8	POSLowerAskPrice	开盘集合竞价时段卖盘下限价	N11(3)	POS 卖盘的价格下限 (对应 MMDH 定义域名: LowerPrice / POSLowerPrice)
9	POSUpperAskPrice	开盘集合竞价时段卖盘上限价	N11(3)	POS 卖盘的价格上限 (对应 MMDH 定义域名: POSUpperPrice)
10	OrdImbDirection	不能配对买卖盘方向	C1	POS 未能配对买卖盘的方向 N = 买卖盘量相等 B = 买盘比卖盘多 S = 卖盘比买盘多 <空格> = 不适用(未有参考平衡价格) (对应 MMDH 定义域名: OrderImbalanceDirection)
11	OrdImbQty	不能配对买卖盘量	N12	POS 未能配对买卖盘的数量 (对应 MMDH 定义域名: OrderImbalanceQuantity)
12	Timestamp	行情时间	C12	HH:MM:SS.000 为此 B 转 H 证券开市竞价交易时段信息最近的更新时间 当天收市价更新后, 此更新时间固定不变。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

(3) 文件尾定义, 最后一行特殊记录:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	Checksum	校验和	C3	校验和, 3 位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符(包含分隔符、换行符)之和然后模 256 得出,

				然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018 校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。
--	--	--	--	---

市场状态取值说明：

市场状态	描述
100 = 未开市	市场早展开市前的状态，不含开盘集合竞价时段 （一般为 9:00 前）
1 = 输入买卖盘 （开盘集合竞价时段）	开盘集合竞价时段，竞价盘下单时的状态 （一般为 9:00 至 9:15）
101 = 不可取消 （开盘集合竞价时段）	开盘集合竞价时段暂停订单取消或修改的状态 （一般为 9:15 至 9:20）
108 = 随机对盘 （开盘集合竞价时段）	开盘集合竞价时段，于 9:20 开始后 2 分钟期间随机收盘时的状态 （一般为 9:20 至 9:22）
2 = 对盘 （开盘集合竞价时段）	开盘集合竞价时段，竞价盘配对时的状态 （一般为 9:20 至 9:22，紧接随机对盘后）
7 = 暂停	开盘集合竞价时段结束后，至全市场开市前的状态。此时段暂停任何下单及交易活动 （一般为 9:22 至 9:30，紧接对盘后）
3 = 持续交易	全市场处于交易期间，不含开盘集合竞价时段（市场状态为 1、101、2、7 和 102）及中间休市时段(市场状态为 103)及下午开市前订单取消时段(市场状态为 104） （一般 9:30 至 12:00 及 13:00 至 16:00）
102 = Exchange Intervention	交易所介入时段，暂停任何下单及交易活动 （一般为 12:00 至 12:05 及 16:00 至 16:01）
103 = 收市	中间休市时段

	(一般为 12:05 至 12:30)
104 = 取消买卖盘	下午开市前订单取消时段 (一般为 12:30 至 13:00)
105 = 参考价定价 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段, 计算及公布参考价时的状态 (一般为 16:00 至 16:01)
5 = 输入买卖盘 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段, 竞价盘下单时的状态 (一般为 16:01 至 16:06)
106 = 不可取消 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段, 暂停订单取消或修改的状态 (一般为 16:06 至 16:08)
107 = 随机收市 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段, 于 16:08 开始后 2 分钟期间随机收盘时的状态 (一般为 16:08 至 16:10)
4 = 对盘 (收盘集合竞价时段)	收盘集合竞价时段, 竞价盘配对时的状态 (一般为 16:08 至 16:10, 紧接随机收市后)
0 = 全日收市	全市场处于闭市期间, 收盘集合竞价时段结束后的状态 (一般为 16:10 后)

3.15. 指数通行情文件

文件名: csiYYYYMMDD

扩展名: txt

发布时间: 实时发布

发布渠道: MDGW

文件说明: 该文件为上海证券交易所转发中证指数公司指数通行情文件。

接口格式: 参见《中证指数行情传输接口规范》³中数据格式约定以及指数通行情文件接口相关描述。

3.16. 外部源行情文件

文件名: mktcte

³ 详见中证指数公司官网 <https://www.csindex.com.cn/>

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW

文件说明：该文件为外部源行情文件，包括 IOPV 行情。

接口格式：行情文件包括文件头、文件体和文件尾三部分

(1) 文件头：单行记录

序号	字段名称	字段描述	类型
1	BeginString	起始标识符，填“HEADER”	C6
2	Version	版本，填“E1.00”	C8
3	BodyLength	数据长度：以该字段分隔符后的字节数（不包含本字段后面的分隔符）进行计算，包含其他字段后面的分隔符、换行符	N10
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5
5	MDReportID	行情序号（预留，暂不填）	N8
6	SenderCompID	发送方，填“XSHG01”	C6
7	MDDTime	交易所行情发送时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
8	MDUpdateType	发送方式： 0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental（暂不支持）	N1
9	MDSesStatus	市场行情状态，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格，具体参见下方市场行情状态取值	C8
		扩展区域，市场参与主体的技术系统应能支持记录尾部扩展新的字段	不定

市场行情状态取值：

市场行情状态	字段取值
第 1 位-第 8 位	全空格

(2) 文件体：多行记录

序号	域名	字段描述	字段类型
1	MDStreamID	行情数据类型，行情数据类型标识符，取值 MDE01 表示 IOPV 行情	C5
2	SecurityID	证券代码，ETF 二级市场交易代码	C6

3	Symbol	证券简称	C8
4	IOPV	基金 IOPV，单位为人民币元。该字段取 0.00000 时，无意义。 当 ETF 公告文件 ⁴ Publish 字段（是否需要发布 IOPV）取值为 1 时，此字段为对应产品的 IOPV 值； 当 ETF 公告文件 Publish 字段取值为 0 时，此字段固定取 0.00000，无意义。	N14(5)
5	Timestamp	时间戳，HH:MM:SS.sss	C12
6	Reserved	预留字段	N14(5)
		扩展区域，系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

（3）文件尾：单行记录

序号	字段名称	字段描述	类型
1	EndString	结束标识符，填“TRAILER”	C7
2	Checksum	3 位校验和，校验和计算逻辑参见下方校验和计算	C3

校验和计算：

校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018。

校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。

⁴ ETF 公告文件接口详见《IS118 上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（基金公司卷）》。

第四章 盘后数据

4.1. 竞价过户数据文件

文件名：ghXXXXXX

扩展名：dbf

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件主要为竞价过户数据记录，具体包括现货（股票基金）竞价交易、配股配债科创板配售、发行业务（股票公开增发、ETF 网上现金发行）、指定撤指定的过户记录。文件名中 XXXXX 为 PBU（5 位）。该文件不按照 cjbh 字段排序。对于 B 股 PBU 同样产生该接口文件。

该接口文件的组织形式和主要内容同实时成交回报数据接口。由于数据库表与 DBF 文件表述的不同，成交编号、成交数量、本次余额、成交价格、成交金额的类型略有不同。

对于需要转义的非交易业务，一些没有包含在实时成交回报数据接口中的记录，通过盘后过户数据接口传送给参与者。

下文，未申明特别填写方式的字段，均填写对应订单输入时的原始信息。

1. 指定撤销成功后，产生证券代码 zqdm 为 799998，（全市场成交编号 cjbh 从当前 A 股最大成交编号+1 开始连续递增，）成交数量 cjsl 为 0，成交价格 cijg 为 0，成交金额 cije 为 0，成交时间 cjsj 为 150000，买卖方向 bs 为 B 的过户记录。
2. 指定登记成功后，产生证券代码 zqdm 为 799999，（全市场成交编号 cjbh 从指定撤销最大成交编号+1 开始连续递增，）成交数量 cjsl 为 0，成交价格 cijg 为 0，成交金额 cije 为 0，成交时间 cjsj 为 150000，买卖方向 bs 为 B 的过户记录。
3. 对于发行业务，过户库会在多日均含有有关数据。

资金申购发行过户库记录说明：

- (1) 申购日盘后过户文件中包含发行扣款记录。证券代码 zqdm 为发行扣款/还款代码（比如 740***）；全市场成交编号不超过 7 位，成交时间 cjsj 填写 150000，全市场成交编号超过 7 位，成交时间 cjsj 为 111111~999999，分别对应成交编号超过 7 位时，第 8 位为 1~9 的情况（成交编号 cjbh 为 -1,-2,...-9999999）。成交数量 cjsl 为申购数量；成交价格 cijg 为申购价格；成交金额 cije 为扣款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 B 的记录。

- (2) 配号日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码 **zqdm** 为发行配号代码（比如 741***）；成交编号 **cjbh** 指配号的首个号码；成交数量 **cjsl** 指配号成功的数量；成交价格 **cjig** 为 0；成交金额 **cjie** 为 0；当配号不超过 8 位时，成交时间 **cjsj** 填写 150000，当成交时间 **cjsj** 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 **bs** 为 B。
- (3) 还款中签日盘后过户文件中包含还款记录。证券代码 **zqdm** 为发行扣款/还款代码（比如 740***）；全市场成交编号不超过 7 位，成交时间 **cjsj** 填写 150000，全市场成交编号超过 7 位，成交时间 **cjsj** 为 111111~999999，分别对应成交编号超过 7 位时，第 8 位为 1~9 的情况（成交编号 **cjbh** 为 -1,-2,...-9999999）。成交数量 **cjsl** 为 T 日申购数量；成交价格 **cjig** 为 T 日申购价格；成交金额 **cjie** 为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 **bs** 为 S。
- (4) 还款中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码 **zqdm** 为申购/中签代码（比如 730***）；成交编号 **cjbh** 指中签号；成交数量 **cjsl** 指中签数量；成交价格 **cjig** 指最终确定的发行价格；成交金额 **cjie** 等于分配数量乘以发行价格；当配号不超过 8 位时，成交时间 **cjsj** 填写 150000，当成交时间 **cjsj** 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 **bs** 为 B。

ETF 认购返回数据说明（成交编号扩位规则同上）：

- (1) 申购日盘后过户文件中包含认购扣款记录。证券代码 **zqdm** 为 ETF 现金认购扣款/还款代码（ETF 代码组第 5 个代码例如 510054）；（全市场成交编号 **cjbh** 为 -1,-2,...；）成交数量 **cjsl** 为申购数量；成交价格 **cjig** 为申购价格；成交金额 **cjie** 为扣款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 **bs** 为 B 的记录。
- (2) 还款中签日盘后过户文件中包含认购还款记录。证券代码为 ETF 现金认购扣款/还款代码（ETF 代码组第 5 个代码，比如 510054）；（全市场成交编号 **cjbh** 为 -1,-2,...；）成交数量 **cjsl** 为 T 日申购数量；成交价格 **cjig** 为 T 日申购价格；成交金额 **cjie** 为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向为 S 的记录。
- (3) 还款中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码为 ETF 现金认购申请/中签代码（ETF 代码组第 4 个代码，比如 510053）；成交编号 **cjbh** 指中签号；成交数量 **cjsl** 指中签数量；成交价格 **cjig** 指最终确定的发行价格；成交金额 **cjie** 等于分配数量乘以发行价格；当配号不超过 8 位时，成交时间 **cjsj** 填写 150000，当成交时间 **cjsj** 为 111111~999999 时，分别对应配号超过 8 位时，第 9 位为 1~9 的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向 **bs** 为 B 的记录。本文件中不包含中签数量为 0 的中签记录。

对于不允许重复申报的发行情况，一旦发生同一个证券账户重复申报，在发行 T 日的过户库中，会设定重复申报的记录成交编号 **cjbh**、成交数量 **cjsl** 为 0，成交金额 **cije** 为 0.00，申请编号 **sqbh** 为“重复申报”。

2009 年 6 月本所发布《沪市股票上网发行资金申购实施办法》。

其中第二条的条款二约定：‘投资者参与网上公开发行股票申购，只能使用一个证券账户。证券账户注册资料中“账户持有人名称”相同且“有效身份证明文件号码”相同的多个证券账户（以 T-1 日账户注册资料为准）参与同一只新股申购的，以及同一证券账户多次参与同一只新股申购的，以第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购。’对于违反该条款的无效申报，成交编号 **cjbh**、成交数量 **cjsl** 为 0，成交金额 **cije** 为 0.00，申请编号 **sqbh** 为“违规重复”。

其中第四条条款二约定：“网下发行参与对象不得参与网上发行”。对于违反该条款的无效申报，成交编号 **cjbh**、成交数量 **cjsl** 为 0，成交金额 **cije** 为 0.00，申请编号 **sqbh** 为“网下在先”。

4. 配股成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。

5. 科创板配售方式减持成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	Gddm	证券账户	C10
2	Gdxm	股东姓名，新交易系统切换后，上交所会将该字段置为空格。请以中国证券登记结算有限责任公司发布的数据为准。	C8
3	Bcrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD	C8
4	Cjbh	成交编号	N8
5	Gsdm	席位号	C5
6	Cjsl	成交数量	N10
7	Bcye	本次余额，新交易系统切换后，该字段被置为 0。	N10
8	zqdm	证券代码	C6
9	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
10	cjsj	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
11	cjlg	成交价格	N8(3)
12	cije	成交金额，溢出处理参见实时成交回报接口成交金额字段	N12(2)
13	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 reff（字段 4：会员内部订单号）。	C10
14	bs	B 普通订单，买卖方向：买入	C1

		<u>S 普通订单，买卖方向：卖出</u> <u>对于 E 类型帐户的融资融券业务，对应关系如下：</u> <u>1 担保品买入订单，券入投资者信用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ XY”,“B”);</u> <u>2 担保品卖出订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ XY”,“S”);</u> <u>3 融资买入订单，券入投资者信用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ RZ”,“B”);</u> <u>4 卖券还款订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ RZ”,“S”);</u> <u>5 买券还券订单，券入证券公司融券专用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ RQ”,“B”);</u> <u>6 融券卖出订单，券从证券公司融券专用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ RQ”,“S”);</u> <u>7 平仓买入订单，券入证券公司融券专用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ PC”,“B”);</u> <u>8 平仓卖出订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为 (“ PC”,“S”);</u>	
<u>15</u>	<u>mjbh</u>	<u>操作员代码</u>	<u>C5</u>

股票发行时，辅助证券代码定义见下表，表格单元中第一行表示对应 600***股票的临时非交易代码，第二行表示对应 601***股票的临时非交易代码，第三行表示对应 603***股票的临时非交易代码。

	<u>新股资金定价/询价申购</u> <u>新股东定价/询价增发</u> <u>按市值资金申购（摇号中签）</u>	<u>老股东定价增发（类似配股）</u>	<u>老股东询价增发（比例中签）</u>	<u>股票市值配售首发（已停止）</u>	<u>可转债资金申购</u>
<u>发行申购/中签</u>	<u>730***</u>	<u>700***</u>	<u>731***</u>	<u>737***</u>	<u>733***</u>

<u>代码</u>	<u>780***</u>	<u>760***</u>	<u>781***</u>	<u>787***</u>	<u>783***</u>
	<u>732***</u>	<u>742***</u>			<u>754***</u>
<u>发行配号代码</u>	<u>741***</u>		<u>741***</u>	<u>747***</u>	<u>744***</u>
	<u>791***</u>		<u>791***</u>	<u>797***</u>	<u>794***</u>
	<u>736***</u>				<u>756***</u>
<u>发行扣款/还款</u> <u>代码</u>			<u>740***</u>		<u>743***</u>
			<u>790***</u>		<u>793***</u>
					<u>755***</u>

4.2. 新股发行过户数据文件

文件名：ipoghXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为新股发行过户数据，包括新股、可转债可交换债的发行过户记录，文件名中 XXXXX 为 PBU（5 位）。

1. 申购配号日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码 zqdm 为发行配号代码（比如 741***）；成交编号 cjbh 指配号的首个号码；成交数量 cjsl 指配号成功的数量；申购数量 sgs1 为 T 日有效申购数量；成交价格 cijg 为 0；成交金额 cije 为 0；买卖方向 bs 为 B。
2. 中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码 zqdm 为申购/中签代码（比如 730***）；成交编号 cjbh 指中签号；成交数量 cjsl 指中签数量；成交价格 cijg 指最终确定的发行价格；成交金额 cije 等于分配数量乘以发行价格；买卖方向 bs 为 B。

对于不允许重复申报的发行情况，一旦发生同一个证券账户重复申报，在发行 T 日的过户库中，会设定重复申报的记录的成交编号 cjbh 为 0，处理结果 cljg 为“01”。

2009 年 6 月本所发布《沪市股票上网发行资金申购实施办法》。其中第二条的条款二约定：‘投资者参与网上公开发行股票申购，只能使用一个证券账户。证券账户注册资料中“账户持有人名称”相同且“有效身份证明

文件号码”相同的多个证券账户（以 T-1 日账户注册资料为准）参与同一只新股申购的，以及同一证券账户多次参与同一只新股申购的，以第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购。’对于违反该条款的无效申报，在发行 T 日的过户库中，会设定无效申报的记录的交易编号 **cjbh** 为 0，处理结果 **cljg** 为“02”。其中第四条条款二约定：“网下发行参与对象不得参与网上发行”。对于违反该条款的无效申报，在发行 T 日的过户库中，会设定无效申报的记录的交易编号 **cjbh** 为 0，处理结果 **cljg** 为“03”。

根据 2015 年发布的《新股业务规则》第二十条约定：‘投资者连续 12 个月内累计出现三次中签但未足额缴纳认购资金的情形，自最近一次其结算参与人申报放弃认购的次日起 6 个月内不得参与网上新股申购’。对于违反该条款的不良账户申报，在发行 T 日的过户库中，会设定不良账户申报的记录的交易编号 **cjbh** 为 0，处理结果 **cljg** 为“04”。

根据 2017 年发布的《上海证券交易所上市公司可转换债券发行实施细则》第六条约定：‘同一投资者使用多个证券账户参与同一可转债申购的，以该投资者的第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购’。对于违反该条款的无效申报，在发行 T 日的过户库中，会设定无效申报的记录的交易编号 **cjbh** 为 0，处理结果 **cljg** 为“02”（注：该约定适用于可交换债网上发行）。第十四条约定：‘投资者连续 12 个月内累计出现 3 次中签但未足额缴款的情形时，自中国结算上海分公司收到弃购申报的次日起 6 个月（按 180 个自然日计算，含次日）内不得参与新股、可转债、可交换公司债券的申购’。对于违反该条款的不良账户申报，在发行 T 日的过户库中，会设定不良账户申报的记录的交易编号 **cjbh** 为 0，处理结果 **cljg** 为“04”（注：该约定适用于可交换债网上发行）。

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	配号	中签	类型
	gddm	证券账户			C10
	cjrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD			C8
	cjbh	成交编号	配号首个号码	中签号	N12
	jydy	交易单元			C5
	cjzl	成交数量	配号成功的数量	中签股数 单位： 股票为股 债券为千元面额	N8
	sgsl	申购数量	有效申购数量 单位： 股票为股	0	N15

			债券为千元面额		
	zqdm	证券代码	配号代码	中签代码	C6
	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS			C6
	cjig	成交价格	0	最终发行价： 股票为每股价格 债券为每张面值。	N8(3)
	cjie	成交金额	0	分配数量*发行价	N15(2)
	sqbh	会员内部订单号。			C10
	bs	B 普通订单，买卖方向：买入 S 普通订单，买卖方向：卖出	B	B	C1
	cljg	处理结果	00:成功 01:重复申购 02:违规重复 03:网下在先 04:不良记录		C2

4.3. 减持控制数据文件

文件名：jckzXXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送，下载时间窗口为当日 20:00 至次日 06:00

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为股东受控股份（包括特定股份及受控股份中非特定的部分）当日认定数量、次日限制减持数量、及大宗减持受让方限制转让数量，文件名中 XXXXXX 为 PBU（5 位）

1. 若股份认定数量 1+股份认定数量 2 不为 0，则表示该账户持有受控股份；股份认定数量 1 不为 0，标识该账户持有特定股份；股份认定数量 2 不为 0，标识该账户属于大股东账户，所持有的受控股份中包括非特定股份。
2. 根据大宗减持受让方限制数量，控制大宗交易减持受让方股份 6 个月内不允许进行转让。

股东减持示例：

减持额度计算以投资者为粒度进行，若该投资者拥有多个股东账户，则应汇总计算总可用额度，再按受控股份的比例分配到每个具体账户。此外，若股票发生送股等公司行为导致总股本变动，历史减持需要进行复权计算。为方便举例，假设总股本未发生变动，且该投资者仅拥有 1 个股东账户（不含关联账户）。

股票 S 有总股本 1,000,000 股，其中 1% 总股本为 10000 股。

股东账户 A 当前持有股票 S 的持仓，其中股份认定数量 1：12000 股，其中因非公开发行不满 1 年导致竞价限制减持部分 1000 股；股份认定数量 2：7500 股。股东在前 89 个自然日内已通过竞价交易渠道减持 3000 股，通过大宗交易渠道减持 5000 股。

则受控股份中竞价撮合可卖数量= $\text{Min}(\text{股份认定数量 1 中竞价可卖部分} + \text{股份认定数量 2}, (\text{1\% 总股本} - \text{前 89 个自然日内累计竞价减持数量})) = \text{Min}((12000 - 1000 + 7500), (10000 - 3000)) = 7000$ 。

受控股份中大宗交易可卖数量= $\text{Min}(\text{股份认定数量 1} + \text{股份认定数量 2}, (\text{2\% 总股本} - \text{前 89 个自然日内累计大宗减持数量})) = \text{Min}(12000 + 7500, 20000 - 5000) = 15000$ 。

以上例子对应到数据表中的说明如下：

股份认定数量 1=12000

股份认定数量 2=7500

限制减持数量 1=股份认定数量 1+股份认定数量 2-认定限售股份中竞价撮合可卖数量
=12000+7500-7000=12500

限制减持数量 2=股份认定数量 1+股份认定数量 2-认定限售股份中大宗交易可卖数量
=12000+7500-15000=4500

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	控制日期	为数据使用日	C8
2	指定席位号	PBU 代码	C5
3	证券账户		C10
4	证券代码		C6
5	股份认定数量 1	该账户当日日终处理后被认定为受控股份中特定股份（首次公开发行前股份、上市公司非公开发行股份）的数量	N12
6	股份认定数量 2	该账户当日日终处理后被认定为受控股份中非特定	N12

序号	字段名称	字段描述	类型
		股份的数量	
7	限制减持数量 1	该账户次日在认定股份数量范围内竞价撮合被限制减持的数量（1%额度内）	N12
8	限制减持数量 2	该账户次日在认定股份数量范围内大宗交易被限制减持的数量（2%额度内）	N12
9	证券余额	已上市的无限售流通股的持仓余额	N12
10	大宗减持受让方限制数量	该账户由于成为大宗减持受让方后 6 个月内被限制转让的数量	N13
11	其他冻结	持仓余额中需要实施冻结的证券，包含司法冻结、质押冻结、董监高限制卖出等。	N13
12	备注	预留字段，暂不启用。	C20

*关于会员柜台系统前端控制的说明：

委托类型	日初可用余额	说明
集中竞价交易卖出 股票 ETF 申购 转融通证券出借 大宗普通交易卖出 盘后固定价格交易卖出	$M1 = M - \text{Max}(D1 + D3, D0)$ $J1 = N1 + N2 - D1$ $M0 = \text{Max}(0, M1 - J1)$ M: 已上市的无限售流通股的持仓余额 D1: 限制减持数量 1 D3: 大宗减持受让方限制数量 D0: 其他冻结	M1 为集中竞价交易日初持仓，该部分持仓可用于集中竞价交易卖出、股票 ETF 申购、转融通证券出借、大宗普通交易卖出、盘后固定价格交易卖出前端控制。J1 为日初竞价可减持额度（不考虑冻结），M0 为集中竞价交易日初自由流通持仓。 其中大宗普通交易卖出仅允许投资者卖出其持有的自由流通部分股份。 ETF 赎回后卖出股份，前端控制时视作占用自由流通余额。
大宗交易减持	$M2 = M1 + \text{Min}(D1, \text{Max}(D1 + D3 - D0, 0))$	Md 为大宗减持日初前端控制数量

委托类型	日初可用余额	说明
(受控股份减持)	$Q2=N1+N2-D2$ $Md=Min(M2, Q2)$ <u>M2:为大宗交易减持日初可用持仓</u> <u>Q2:大宗 2%可用额度</u> <u>N1:股份认定数量 1</u> <u>N2:股份认定数量 2</u> <u>D2:限制减持数量 2</u>	大宗减持时优先扣减 $Min(D1, Max(D1+D3-D0, 0))$ 部分 而后扣减 M1 部分，其中 M1 为竞价日中实时维护持仓。 Q2 为大宗日初 2%可用额度。

*上表数据说明：

- (1) 证券余额为全部可流通已上市余额；
- (2) 可流通已上市余额分为：自由流通余额，受控股份余额，大宗减持受让余额；
- (3) 其他冻结为持仓余额中需要实施冻结的证券，包含司法冻结、质押冻结、董监高限制卖出等。

4.4. 证券账户资料文件

文件名：zzhXXXXXX

扩展名：dbf

发布时间：闭市后发送。每周发布一次。

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件提供指定交易关系数据给参与者，说明指定在席位(PBU)上的证券账户以及当前所处的状态，仅下个交易日有效，其他交易日供参考。文件名中 XXXXXX 为 PBU(5 位)。

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	gddm	证券帐户	C10
2	gdxm	股东姓名，新交易系统切换后，该字段被置为空格。	C8
3	zhzt	证券帐户状态，‘N’为正常，‘S’为挂起，‘F’为冻结。	C1
4	gsdm	指定席位号	C5
5	qsdm	停用	C5
6	jzrq	截止日期，发送数据生成日期。格式为 YYYYMMDD	C8

<u>7</u>	<u>clbz</u>	<u>处理标志，柜台系统自由使用</u>	<u>C1</u>
----------	-------------	----------------------	-----------

4.5. 证券权益数据文件

文件名：zqyXXXXX

扩展名：dbf

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为投资者所拥有股票的总市值和新股申购额度的相关信息，文件名中 XXXXX 为 PBU（5 位）。

接口格式：

<u>序号</u>	<u>字段名称</u>	<u>字段描述</u>	<u>类型</u>
<u>1</u>	<u>gddm</u>	<u>证券帐户</u>	<u>C10</u>
<u>2</u>	<u>zsz</u>	<u>总市值，登记日该投资者的股票总市值，单位为分</u>	<u>N18</u>
<u>3</u>	<u>zbqy</u>	<u>主板权益，登记日该投资者主板申购额度，单位为股</u>	<u>N18</u>
<u>4</u>	<u>kcqy</u>	<u>科创板权益，登记日该投资者科创板申购额度，单位为股</u>	<u>N18</u>
<u>5</u>	<u>gsdm</u>	<u>指定席位号（PBU）</u>	<u>C5</u>
<u>6</u>	<u>zhxh</u>	<u>账户组序号</u>	<u>C10</u>
<u>7</u>	<u>djrq</u>	<u>权益登记日期，格式 YYYYMMDD</u>	<u>C8</u>
<u>8</u>	<u>clbz</u>	<u>处理标志，柜台系统自由使用</u>	<u>C1</u>

4.6. 交易公开信息公告文件

文件名：jygkxxMMDD

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为按照交易规则（2023 年修订）5.4.1、5.4.2、5.4.7 等向全市场公布的有关信息。文件名中

MMDD 表示月日格式的日期。

接口格式：无

4.7. 科创板交易公开信息公告文件

文件名：jygkxx02MMDD

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为按照交易规则（2023 年修订）5.4.7、6.1.9、6.1.10 等向全市场公布的有关信息。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。

接口格式：无

4.8. 债券过户数据文件

文件名：zqghXXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为债券过户数据，包括债券现券交易、质押式回购交易以及质押式回购出入库过户记录，文件名中 XXXXX 为 PBU（5 位）

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	证券账户		C13
2	成交日期	格式为 YYYYMMDD	C8
3	成交编号		C16
4	交易单元		C8
5	成交数量	债券及质押式回购单位为千元面额，基金单位为份 如溢出则取值为负	N16(3)
6	证券代码		C12

7	申报时间	格式为 HHMMSS	C6
8	成交时间	格式为 HHMMSS	C6
9	成交价格	单位为元 如溢出则取值为负	N16(5)
10	成交金额	单位为元 对债券该字段为成交价格*成交数量*10 对质押式回购该字段为 100*成交数量*10 *如溢出则取值为负，OMS 应能识别并及时处理，可采取如自行计算、拆分调整、采用登记结算数据或其他方式处理，做好该异常的识别和处理	N19(5)
11	会员内部订单号		C10
12	订单方向	B-买 S-卖	C1
13	业务类型	BTR-债券现券交易 CRP-质押式回购交易 BPD-质押式回购入库 BPW-质押式回购出库	C3
14	信用标签	当记录为信用交易时（证券账户为信用账户时），该字段有效（参见下方信用交易取值），否则填空格	C2

信用交易取值：

信用交易类型	字段取值
卖券还款	CreditTag="RZ", Side='S'
平仓卖出	CreditTag="PC", Side='S'
担保品买入	CreditTag="XY", Side='B'

担保品卖出	CreditTag="XY", Side='S'
-------	--------------------------

4.9. 重点指数表现文件

文件名：zsbxYYMMDD

扩展名：txt

发布时间：闭市后发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为重点指数⁵表现数据。文件名中 YYMMDD 表示年月日格式的日期

接口格式：

序号	字段名称	字段描述	类型
1	指数代码		C6
2	指数名称		C8
3	样本数量	指数当前的样本数量	N10
4	收盘点位	指数当日的收盘点位	N12(2)
5	样本均价	指数当前样本的均价，单位：元人民币 特殊的，当为 B 股指数（000003）时，单位：美元	N8(2)
6	成交金额	指数当日样本的成交金额汇总,单位：亿元人民币	N12(2)
7	平均股本	指数当前样本的平均股本，单位：亿股	N12(2)
8	总市值	指数当前样本的总市值汇总，单位：万亿元人民币	N12(2)
9	占比%	指数当前样本的总市值占上证指数全样本的总市值百分比	N6(2)
10	静态市盈率	指数当前样本的静态市盈率	N8(2)
11	指数级别标识	取值如下： 上证指数:011 上证收益:012 科创综指:090 科创 50:100	C6

⁵ 重点指数包括：上证指数（000001）、上证收益（000888）、科创综指（000680）、科创 50（000688）、上证 180（000010）、上证 50（000016）、上证 380（000009）、上证 100（000132）、上证 150（000133）、B 股指数（000003）、国债指数（000012）、基金指数（000011）。

		上证 180:101 上证 50:201 上证 380:301 上证 100:401 上证 150:501 B 股指数:1102 国债指数:2002 基金指数:3002	
--	--	---	--

4.10. 份额过户文件

文件名：ofghXXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后二小时内发送（17：00 前）

发布渠道：ztDisk

文件说明：本文件包含基金通成交明细的汇总过户数据，包括询价交易，文件名中 XXXXXX 表示席位号。未申明特别填写方式和单位的字段，均填写或参照对应订单输入时的原始信息，无意义字段不填。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码		C6
2	证券账户		C10
3	席位号		C5
4	开放式基金账户		C12
5	交易账号		C17
6	销售人代码		C9
7	成交编号		C16
8	成交日期	格式为 YYYYMMDD	C8
9	成交时间	格式为 HHMMSS	C6
10	成交数量	交易权限字段为转入、转出时，该字段表示为订单数量	N15(2)

11	成交价格	交易权限字段为转入、转出时，该字段为空	N14(5)
12	成交金额	溢出处理参见实时成交回报接口成交金额字段（交易权限字段为转入、转出时该字段为空）	N19(5)
13	申报时间	格式为 HHMMSS	C6
14	会员内部订单号	同申报接口中的 ClOrdID	C10
15	买卖方向	B: 买入 S: 卖出 I: 转入 O: 转出	C1
16	业务类型	0: 实时订单业务（包含转入、转出） 1: 询价交易业务	C1
17	备注	保留字段，暂不填	C30

4.11. 国际化产品过户数据文件

文件名：ighXXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXX 表示席位号。未申明特别填写方式和单位的字段，均填写或参照对应订单输入时的原始信息，无意义字段不填。过户数据同实时成交回报。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券账户		C13
2	成交日期	格式为 YYYYMMDD	C8
3	成交编号		C16
4	席位号		C8
5	成交数量	单位为股	N16(3)
6	证券代码		C12
7	申报时间	格式为 HHMMSS	C6

8	成交时间	格式为 HHMMSS	C6
9	成交价格	单位为港元	N16(5)
10	成交金额	单位为港元	N19(5)
11	会员内部订单号	同申报接口中的 reff（会员内部订单号）	C10
12	买卖方向	B：买 S：卖	C1
13	业务类型	BTH=B 转 H 业务	C3
14	备注	保留字段，暂不填	C30

4.12. 期权收盘价格文件

文件名：clpr03MMDD

扩展名：txt

发布时间：闭市后交易所向市场参与者发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：期权产品价格文件，包含收盘价和参考结算价。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期,在此表示当前交易日。记录采用行格式，字段以分隔符'|'来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 R0302 表示期权闭市价格信息	C5
2	合约编码	期权合约的编码，8 位字符	C8
3	期权收盘价	收盘价，单位为元，精确到 0.0001 元。	N11(4)
4	期权参考结算价	参考结算价，单位为元，精确到 0.0001 元。	N11(4)
5	未平仓合约数	该合约闭市轧差后的未平仓合约数，单位为张。	N12
	扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

4.13. 期权过户文件压缩包

文件名：OGHXXXXXX

扩展名：zip

发布时间：闭市后交易所向市场参与者发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXXX 表示席位号(PBU)。该文件为期权过户数据压缩包，包含成交过户数据文件（trns03XXXXXX.txt）、期权持仓余额对账文件（hold03XXXXXX.txt）、期权其他业务文件（qtyw03XXXXXX.txt），当日无记录时，不发送空文件。

接口格式：解压后文件定义参照各文件相关说明。

4.14. 期权成交过户数据文件

文件名：trns03XXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后交易所向市场参与者发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXXX 表示席位号（PBU），该席位号存在过户操作时，才会产生该文件记录。该文件通过 OGHXXXXXX.zip 解压后获取。记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，同数据类型固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

当参考数据类型取值为 T0305 时，文件体记录格式如下：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 T0305 表示期权成交过户数据	C5
2	期权的证券账户		C10
3	业务交易单元号	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致	C5
4	营业部代码	营业部代码	C5
5	证券账户的期权子账户编码	新增，证券账户的期权子账户编码。固定值” 888”	C3

6	会员内部订单号	会员内部订单号	C10
7	订单编号	交易所订单编号	C16
8	合约编码	期权合约的产品代码	C8
9	申报时间	申报时间，格式为 HHMMSS	C6
10	成交时间	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
11	过户日期	过户日期，格式为 YYYYMMDD	C8
12	成交编号	交易所给出的成交编号	C16
13	成交数量	成交数量。单位是（张）	N12
14	成交价格	成交价格，单位：元（精确到 0.0001 元）。	N11(4)
15	成交金额	成交金额，精确到分	N16(2)
16	买卖方向	买卖方向：B-买入,S-卖出	C1
17	开平标志	开平标志：O-开仓;C-平仓	C1
18	备兑期权标志	备兑标签，取值范围： 卖出开仓申报： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
19	执行类型	当前订单执行状态，取值： F=成交	C1
20	订单所有类型	订单所有类型，取值包括： 1=投资者发起 101=交易所发起 102=期权经营机构（包括其风险管理部门） 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起	N 3
21	币种	CNY - 人民币	C3
22	交易经手费	单位：元，精确到分	N16(2)
	扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

当参考数据类型取值为 T0306 时，文件体记录格式如下：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 T0306 表示期权冲销数据	C5
2	期权的证券账户		C10
3	业务交易单元号	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致	C5
4	证券账户的期权子账户编码	新增，证券账户的期权子账户编码。固定值” 888”	C3
5	合约编码	期权合约的产品代码	C8
6	成交时间	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
7	过户日期	过户日期，格式为 YYYYMMDD	C8
8	成交编号	交易所给出的成交编号，以 E 开头的单独编号。如： E000000000000001	C16
9	成交数量	成交数量。单位是（张）	N12
10	买卖方向	买卖方向：B- 买入,S- 卖出	C1
11	备兑期权标志	备兑标签，取值范围： 卖出开仓申报： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
12	执行类型	当前订单执行状态，取值： E=冲销	C1
13	订单所有类型	订单所有类型，取值包括： 101=交易所发起	N3
	扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

当参考数据类型取值为 T0307 时，文件体记录格式如下：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 T0307 表示期权当日组合拆分数据	C5
2	业务交易单元号	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致	C5

3	期权的证券账户		C10
4	证券账户的期权子账户编码	新增，证券账户的期权子账户编码。固定值” 888”	C3
5	会员内部订单号	会员内部订单号	C10
6	组合策略编码	目前为 7 种组合策略：ZBD、CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、KS、KKS	C8
7	组合编码	同执行报告中组合编码含义	C16
8	成交时间	成交时间，格式为 HHMMSS	C6
9	过户日期	过户日期，格式为 YYYYMMDD	C8
10	组合/分拆	取值：B 表示组合，C 表示拆分，F 表示交易所强制拆分，A 表示到期自动解除	C1
11	成交数量(份)	组合与拆分数值(分)	N10
12	成分合约数	取值不超过 4，后接重复组	N2
合约信息	13	合约编码	C8
	14	合约方向, L/S (权利仓/义务仓)	C1
	15	备兑期权标志， 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
	16	成交数量（张）	N10
	扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

4.15. 期权持仓余额对账文件

文件名：hold03XXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后交易所向市场参与者发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXXX 表示席位号（PBU），该席位号存在持仓余额时，才会产生该文件记录。该文件

通过 OGHXXXXX.zip 解压后获取。记录采用行格式，字段以分隔符'|'来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 H0301 表示持仓余额对账接口	C5
2	期权合约账户		C10
3	期权合约子账户编号	固定值（暂定 888）	C3
4	交易单元号	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致	C5
5	合约编码	期权合约的编码，8 位字符	C8
6	持仓方向	L/S (权利方/义务方)	C1
7	备兑期权标志	备兑标签，取值范围： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
8	持仓余额	单位：张 持仓余额是进行正常轧差后的持仓数额，包含组合所对应持仓数量以及组合持仓数额。组合持仓不参与轧差。	N12
9	组合持仓数量	单位：张 此帐户的单方向被用于组合的持仓数量	N12
	扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

4.16. 期权其他业务文件

文件名：qtyw03XXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后交易所向市场参与者发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXX 表示席位号（PBU）。该文件通过 OGHXXXXX.zip 解压后获取。记录采用行格式，字段以分隔符'|'来区分，不固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

当取值为 Q0301 时，为组合持仓信息，文件体记录格式如下：

序号		字段名	字段描述	字段类型
1		参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 Q0301 表示组合对账接口	C5
2		交易单元号	业务交易单元号，和文件名中的交易单元号一致	C5
3		期权合约账户		C10
4		期权合约子账户编号	固定值（暂定 888）	C3
5		组合策略编码	目前为 6 种组合策略：CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、 KS、KKS	C8
6		成交数量(份)	该组合的剩余数量(份)	N10
7		组合编码	组合编码。	C16
8		单份组合的保证金	指 T 日闭市后一份策略组合的单位保证金	N16（2）
9		成分合约数	取值不超过 4，后接重复组	N2
合 约 信 息	10	合约编码		C8
	11	合约方向	L 为权利仓,S 为义务仓	C1
	12	备兑期权标志	备兑标签，取值范围： 1 - Covered 备兑 空格 - Uncovered 非备兑	C1
	13	持仓数量（张）		N12
		扩展区域	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。	不定

期权市场参与者数据报送文件

文件名：~~cybsXXXXXXXXYYMMDD001~~

扩展名：~~txt~~

发布时间：~~每个交易日盘后 15:30(T 日)-16:30(T 日)市场参与者向交易所报送一次~~

报送渠道：~~ztDisk~~

~~文件说明：文件名中XXXXX表示会员有效的席位号（PBU），一个市场参与者使用向本所申报指定的PBU报备所有客户资料数据。文件名中YYYYMMDD表示年月日格式的日期，在此表示下一个交易日。闭市后由市场参与者向交易所报备，包括可买入额度、资金等相关信息。报送日期记为T日，上一交易日记为T-1日。记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。~~

~~接口格式：~~

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 A0302表示期权账户资料信息，此处为唯一值	C5
2	当前交易日	YYYYMMDD，为当前交易日	C8
3	市场参与者代码	第1第2位为国家代码，如中国为CH；第3位为地区代码，如华东区为4；第4第5位为省市代码，如上海为SH；第6位为市场参与者类别，如证券公司为S；第7位为固定值T，是保留字段，第8到第12位为该市场参与者公司的身份代码，如CH4SHST88128。	C12
4	市场参与者名称	市场参与者名称，可使用汉字 采用全称，如“***证券股份有限公司”	C48
5	业务交易单元号	业务交易单元号	C5
6	营业部代码	营业部代码	C5
7	期权合约账户信息	期权合约账户	C10
8	期权合约子账户编号	固定值（暂定888）	C3
9	沪市证券账户	沪市证券A股账户	C10
10	沪市E账户	沪市E账户	C10
11	衍生品资金账户保证金总额	T-1日结算后数据，精确到分。衍生品资金账户保证金总额为可用保证金和维持保证金等资金的总额，不含持仓市值。	N16(2)
12	沪市衍生品维持保证金金额	T-1日结算后数据，市场参与者按照自身实际收取的沪市维持保证金金额报送，精确到分	N16(2)
13	衍生品可用保证金金额	T-1日结算后数据，衍生品可用保证金，精确到分	N16(2)
14	当日资金划入划出净额	T-1日结算后数据，精确到分，为T-1日转账数据，正代表资金划入， 负数代表资金划出	N16(2)
15	衍生品合约市值权益	T-1日结算后数据，含沪深市场所有期权合约，按照T-1日合约最新结算价计算，精确到分。	N16(2)
16	证券市值总额	T-1日结算后数据，除港股通、B股之外的所有沪深市场证券市值（含融券），持有证券按照T-1日收盘价计算，精确到分。	N16(2)
17	证券资金账户可用资金余额	T-1日结算后数据，所有人民币资金（含融资），精确到分。	N16(2)
18	融资融券账户证券总市值	T-1日结算后数据，含沪深市场，持有证券按T-1日收盘价计算，精确到分	N16(2)

19	融资融券账户资金总额	T-1 日结算后数据，精确到分	N16(2)
20	融资融券账户融入资金总额	T-1 日结算后数据，精确到分	N16(2)
21	融资融券账户融券总市值	T-1 日结算后数据，含沪深市场,持有证券按 T-1 日收盘价计算，精确到分	N16(2)
22	分级级别	根据 T-1 日数据情况填写，不得为空 自然人账户需填写 ‘1’ 表示一级， ‘2’ 表示二级， ‘3’ 表示三级。 非自然人账户需填写 ‘4’	C1
23	可买入额度	T-1 日结算后数据，个人投资者限购总金额额度（买入额度，包括已使用和未使用），精确到分	N16(2)

数据内容说明：

- ~~1、当日资金划入划出净额=当日总资金划入金额-当日总资金划出金额；多银行合并计算。~~
- ~~2、衍生品合约市值权益=Σ（当日合约结算价*合约单位*权利仓张数）-Σ（当日合约结算价*义务仓张数(含备兑)*合约单位）。按所持有合约汇总。单位元，保留两位小数。~~
- ~~3、自营账户无需报备。~~
- ~~4、衍生品账户当日开户的，应在当日清算完成后，于下一交易日起进行报送；当日销户的，应于下一交易日起停止报送。~~

4.17. 期权结算价试算结果文件

文件名：prestlp03YYYYMMDD

扩展名：xml

发布时间：闭市后交易所向市场参与者发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：期权产品结算价试算结果文件，包含当日所有期权合约结算价的试算结果。本文件中的试算结算价为结算价正式发布前的试算结果，非最终结算价结果，不可用于实际的清算交收等各类业务，最终结算价格信息以期权收盘价格文件(clpr03MMDD.txt)为准。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期,在此表示当前交易日。每个期权合约信息对应 XML 中一条 ContractPreSetPrcRec 记录，各元素中取值以实际业务长度为准，不补空格。

接口格式：

序号	字段名称	字段中文名称	字段描述	字段类型
1	RFSreamID	参考数据类型	参考数据类型标识，取值 R0323 表示期权结算价格试算结果信息	C5

2	SecurityID	合约编码	期权合约的编码，8 位字符	C8
3	PreCalSettlPrice	期权试算结算价	试算结算价，单位为元，精确到 0.0001 元。 非结算价最终结果，当日结算价以收盘价格文件（clpr03MMDD.txt）为准	N11(4)

示例：

```
<?xml version="1.0" encoding="GBK"?>
```

```
<ContractPreSetPrcRecs>
```

```
  <ContractPreSetPrcRec>
```

```
    <RFStreamID>R0323</RFStreamID>
```

```
    <SecurityID>10000037</SecurityID>
```

```
    <PreCalSettlPrice>7448.2915</PreCalSettlPrice>
```

```
  </ContractPreSetPrcRec>
```

```
  <ContractPreSetPrcRec>
```

```
    <RFStreamID>R0323</RFStreamID>
```

```
    <SecurityID>100000038</SecurityID>
```

```
    <PreCalSettlPrice>7447.4368</PreCalSettlPrice>
```

```
  </ContractPreSetPrcRec>
```

```
</ContractPreSetPrcRecs>
```

第五章 开放式基金数据

上交所把从中登TA系统返回的开放式基金业务回执和确认文件、开放式基金分红文件、开放式基金对帐文件按照不同的席位(PBU)分解并发送到市场参与者。kyeXXXXX.txt、kghXXXXX.txt和khlXXXXX.txt分别压缩为kyeXXXXX.zip、kghXXXXX.zip和khlXXXXX.zip。

开放式基金数据接口中使用的数据类型定义如下：

类型	描述
C	字符型
A	数字字符型，限于0—9（如不够，右补空格）
N	数值型，并可参与数值计算

数据表示与处理规则如下：

- (1) 以文本文件定长记录方式；
- (2) 每行一条完整记录；
- (3) 换行必须用换行（ODH）、回车（OAH）字符；
- (4) 数值型字段（N类）左补零右对齐，字符型字段（C类与A类）右补空格左对齐。
- (5) 字符不区分大小写。
- (6) 带有小数点的数值型数据（N类），传输时不传小数点，小数点在数据字典中指定。数据字典中用x(y)表示不包括小数点的全长为x，小数点后位数为y，而整数则省略掉(0)。

每个开放式基金类文件数据由3个部分的内容组成。即标题行(1-14)、文件数据本身(15-21)和文件结束标识(22)。

3个部分之间没有空行。所有内容均由登记公司提供。如无特别注释，新交易系统不做任何数据改动。

以下是三个部分的描述。

文件组织方式如下：

名称	长度	值	描述
文件标识	8	“OFDCFDAT”	用以标明该文件的格式类型
文件版本号	4	10	1. 0 版本
文件创建人	4	空白	用于标明该文件的提交人
文件接收人	4	空白	用于标明该文件的接收人

<u>日期</u>	<u>8</u>	<u>日期</u>	<u>当天日期</u>
<u>发送人</u>	<u>8</u>	<u>空白</u>	
<u>接收人</u>	<u>8</u>	<u>席位号 XXXXX + 空格</u>	
<u>字段数</u>	<u>3</u>	<u>N</u>	<u>标明该数据文件的构成字段数</u>
<u>字段名 1</u>			<u>采用数据字典中的字段名</u>
<u>...</u>			
<u>字段名 N</u>			
<u>记录数</u>	<u>8</u>	<u>M</u>	<u>该数据文件包含的数据记录数，最多 99999999 条</u>
<u>记录 1</u>			
<u>...</u>			
<u>记录 M</u>			
<u>文件结束标识</u>	<u>8</u>	<u>“OFDCFEND”</u>	<u>文件结束</u>

5.1. 开放式基金净值数据文件

文件名：kxxMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为开放式基金净值数据，含公募 REITs 信息。文件名中 MMDD 表示年月日格式的日期。转发自中登总公司 ofd 99 101 YYYYMMDD 07.txt 文件。

接口格式：

<u>ID</u>	<u>字段名称</u>	<u>描述</u>	<u>类型</u>
<u>63</u>	<u>FundName</u>	<u>基金名称</u>	<u>C40</u>
<u>67</u>	<u>FundCode</u>	<u>基金代码</u>	<u>A6</u>
<u>68</u>	<u>FundStatus</u>	<u>基金状态</u> <u>0-允许申赎，1-发行</u> <u>2-发行成功，3-发行失败</u>	<u>C1</u>

ID	字段名称	描述	类型
		<u>4-基金停止申赎</u> <u>5-停止申购，6-停止赎回</u> <u>7-权益登记，8-红利发放</u> <u>9-基金封闭，a-基金终止</u>	
<u>86</u>	<u>NAV</u>	<u>基金单位净值</u>	<u>N7(4)</u>
<u>37</u>	<u>CurrencyType</u>	<u>结算币种</u> <u>156-人民币，840-美元</u> <u>344-港元，954-欧元</u> <u>392-日元，826-英镑</u> <u>250-法郎，280-马克</u>	<u>A3</u>
<u>82</u>	<u>FundManagerCode</u>	<u>基金管理人</u>	<u>A3</u>
<u>114</u>	<u>RegistrarCode</u>	<u>注册登记人代码</u>	<u>A2</u>
<u>149</u>	<u>UpdateDate</u>	<u>基金信息更改日期，格式为 YYYYMMDD。</u>	<u>A8</u>
<u>215</u>	<u>CollectFeeType</u>	<u>交易费收取方式</u> <u>0-价内费</u> <u>1-价外费</u>	<u>C1</u>
<u>216</u>	<u>NextTradeDate</u>	<u>下一交易日</u>	<u>A8</u>
<u>281</u>	<u>FundIncomeFlag</u>	<u>货币基金万份收益正负</u> <u>0：正；1：负</u>	<u>C1</u>
	<u>FundIncome</u>	<u>货币基金万份收益率</u>	<u>N8(5)</u>
<u>283</u>	<u>YieldFlag</u>	<u>货币基金七日年收益正负</u> <u>0：正；1：负</u>	<u>C1</u>
	<u>Yield</u>	<u>货币基金七日年收益</u>	<u>N8(5)</u>
	<u>GuaranteedNAV</u>	<u>保本净值</u>	<u>N7(4)</u>

5.2. 开放式基金分红数据文件

文件名：khXXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为开放式基金分红数据，转发自中登总公司。文件名中 XXXXX 为 PBU（5 位）。

红利/红利再投资发放是指基金注册登记人把对投资人发放红利/红利再投资的数据发送给基金销售人。对于冻结份额分红时产生的再投资份额，若继续冻结，分红时发送一笔红利再投资记录和一笔份额冻结确认记录，解冻时发送一笔份额解冻记录，每笔份额解冻记录与原份额冻结记录一一对应。

对于货币市场基金，基金分红不作取整处理。

对于非货币市场基金的基金分红，如果采用红利转投方式，对于再投资的红利进行份额取整，取整后的小数份额部分将直接转换成现金退还投资者。

对于现金分红方式：DividenAmount 项=ConfirmeAmount 项（分红的现金）

对于红利转投方式：DividenAmount 项=VolOfDividendforReinvestment 项×除权日的基金净值+手续费+

ConfirmAmount 项（应退还投资者的现金）

接口格式：

<u>ID</u>	<u>字段名称</u>	<u>描述</u>	<u>类型</u>	<u>是否必需</u>
<u>67</u>	<u>FundCode</u>	<u>基金代码</u>	<u>A6</u>	<u>Y</u>
<u>136</u>	<u>TAAccountID</u>	<u>投资人基金账号</u>	<u>C12</u>	<u>Y</u>
<u>22</u>	<u>BasisforCalculatingDividend</u>	<u>红利/红利再投资基数，登记日基金持有人的基金份数</u>	<u>N16(2)</u>	<u>Y</u>
<u>32</u>	<u>TransactionCfmDate</u>	<u>交易确认日期，格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>	<u>Y</u>
<u>41</u>	<u>VolOfDividendforReinvestment</u>	<u>基金账户红利再投资基金份额，取整处理</u>	<u>N16(2)</u>	<u>Y</u>
<u>42</u>	<u>DividentDate</u>	<u>分红日/发放日</u>	<u>A8</u>	<u>Y</u>
<u>43</u>	<u>DividendAmount</u>	<u>基金账户红利资金，红利总金额,含冻结红利及再投资的红利及份额取整后退还给投资者的部分</u>	<u>N16(2)</u>	<u>Y</u>
<u>46</u>	<u>XRDate</u>	<u>除权日</u>	<u>A8</u>	<u>Y</u>

<u>64</u>	<u>ConfirmedAmount</u>	<u>每笔交易确认金额，实发红利资金，不含冻结红利及再投资的红利。当采用红利再投分红方式时，该项是转投的份额小数部分换算成的现金金额，即份额取整后退还给投资者的部分</u>	<u>N16(2)</u>	<u>Y</u>
<u>113</u>	<u>RegistrationDate</u>	<u>权益登记日期，格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>	<u>Y</u>
<u>119</u>	<u>ReturnCode</u>	<u>交易处理返回代码，取值见附表：TA 系统返回代码表</u>	<u>A4</u>	<u>Y</u>
<u>120</u>	<u>TransactionAccountID</u>	<u>投资人基金交易帐号</u> <u>席位号(5 位，前补空格)+ 账号，席位号由于有一天的差别，未必是现在指定的席位号。</u>	<u>A17</u>	<u>Y</u>
<u>121</u>	<u>DistributorCode</u>	<u>销售人代码</u> <u>101 代码,表示上海证券交易所市场</u>	<u>A3</u>	<u>Y</u>
<u>135</u>	<u>BusinessCode</u>	<u>业务代码：143</u>	<u>A3</u>	<u>Y</u>
<u>155</u>	<u>DividendPerUnit</u>	<u>单位基金分红金额（含税）</u>	<u>N16(2)</u>	<u>Y</u>
<u>24</u>	<u>DefDividendMethod</u>	<u>默认分红方式，现设置为空</u>	<u>A1</u>	<u>N</u>
<u>52</u>	<u>Charge</u>	<u>手续费</u>	<u>N10(2)</u>	<u>N</u>
<u>53</u>	<u>AgencyFee</u>	<u>代理费</u>	<u>N10(2)</u>	<u>N</u>
<u>59</u>	<u>TotalFrozenVol</u>	<u>基金冻结总份数</u>	<u>N16(2)</u>	<u>N</u>
<u>86</u>	<u>NAV</u>	<u>基金单位净值</u>	<u>N7(4)</u>	<u>N</u>
<u>94</u>	<u>OtherFee1</u>	<u>其他费用 1</u>	<u>N10(2)</u>	<u>N</u>
<u>95</u>	<u>OtherFee2</u>	<u>其他费用 2</u>	<u>N16(2)</u>	<u>N</u>
<u>98</u>	<u>IndividualOrInstitution</u>	<u>个人/机构标志，0-机构，1-个人</u>	<u>A1</u>	<u>N</u>
<u>123</u>	<u>DividendRatio</u>	<u>红利比例</u>	<u>N16(2)</u>	<u>N</u>
<u>137</u>	<u>TASerialNO</u>	<u>TA 确认交易流水号</u>	<u>A20</u>	<u>N</u>
<u>138</u>	<u>StampDuty</u>	<u>印花税</u>	<u>N16(2)</u>	<u>N</u>
<u>187</u>	<u>FrozenBalance</u>	<u>冻结金额</u>	<u>N16(2)</u>	<u>N</u>
<u>255</u>	<u>TransferFee</u>	<u>过户费</u>	<u>N10(2)</u>	<u>N</u>
<u>260</u>	<u>ShareClass</u>	<u>收费方式</u>	<u>A1</u>	<u>N</u>

		0-前收费，1-后收费		
276	FeeCalculator	计费人 0-TA 计费 1-基金计费	A1	N
47	DownLoaddate	交易数据下传日期 格式为：YYYYMMDD	A8	N
37	CurrencyType	结算币种 156-人民币，840-美元 344-港元，954-欧元 392-日元，826-英镑 250-法郎，280-马克	A3	Y

5.3. 开放式基金账户对账数据文件

文件名：kyeXXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为开放式基金账户对账数据，用于核对投资人持有份额数据。转发自中登总公司。文件名中XXXXXX 为 PBU（5 位）。

接口格式：

ID	字段名称	描述	类型
67	FundCode	基金代码	A6
136	TAAccountID	投资人基金帐号 股票交易市场中的证券帐户，左对齐，后补空格	A12
13	AvailableVol	持有人可用基金份额	N16(2)
18	TotalVolOfDistributorInTA	基金总份数（含冻结）	N16(2)
59	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N16(2)
173	TotalBackendLoad	交易后端收费总额	N16(2)
268	AccountStatus	账户状态	A1

ID	字段名称	描述	类型
		0-正常，1-冻结，2-挂失	
	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未分配收益	N16(2)
	GuaranteedAmount	剩余保本份额	N16(2)

5.4. 开放式基金交易确认数据文件

文件名：kghXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件为开放式基金交易确认数据，包含由上交所发送的 T 日业务申请回执和由中登总公司发送的业务申请确认记录及其他业务记录。文件名中 XXXXX 为 PBU（5 位）。

由上交所发送的 T 日业务申请回执中的基金代码采用会员公司发送订单时的采用的基金代码（519xxx）。

由中国结算发送的业务确认和主动发起的业务中基金代码均为 519×××代码。

接口格式：

ID	字段名称	描述	类型
8	AppSheetSerialNo	申请单编号，对于上交所发起的业务和 TA 对于上交所业务申请的确认记录，是交易流水号(16 位)左对齐，编号<100000000000000。 该类数据申请单编号和 T-1 日的业务申请申请单编号一致。 由 TA 发起的冻结、非交易过户等业务，编号为 TA 流水号	A24
67	FundCode	基金代码	A6
136	TAAccountID	投资人基金账号，10 位股东账号，左对齐	C12
32	TransactionCfmDate	交易确认日期，格式为：YYYYMMDD，TA 确认的日期	A8
62	ConfirmedVol	基金账户交易确认份数	N16(2)

<u>64</u>	<u>ConfirmedAmount</u>	<u>每笔交易确认金额，为投资者实得金额</u>	<u>N16(2)</u>
<u>92</u>	<u>TransactionDate</u>	<u>交易发生日期，格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>
<u>132</u>	<u>ApplicationVol</u>	<u>赎回的份数/转托管份数</u>	<u>N16(2)</u>
<u>134</u>	<u>ApplicationAmount</u>	<u>申请金额</u>	<u>N16(2)</u>
<u>135</u>	<u>BusinessCode</u>	<u>业务代码，取值与含义参见附表：业务代码与含义表</u>	<u>A3</u>
<u>137</u>	<u>TASerialNO</u>	<u>TA 确认交易流水号</u>	<u>A20</u>
<u>177</u>	<u>BusinessFinishFlag</u>	<u>业务过程完全结束标识，</u> <u>0-中间过程</u> <u>1-业务过程结束</u>	<u>C1</u>
<u>119</u>	<u>ReturnCode</u>	<u>交易处理返回代码</u> <u>‘0000’为成功，其他出错原因见附表。</u>	<u>A4</u>
<u>16</u>	<u>BackendLoad</u>	<u>每笔交易后端收费</u>	<u>N16(2)</u>
<u>25</u>	<u>DiscountRateOfCommission</u>	<u>销售佣金折扣率</u> <u>对投资人的总佣金折扣率，取值为投资人实付佣金/</u> <u>投资人应付佣金</u>	<u>N5(2)</u>
<u>52</u>	<u>Charge</u>	<u>手续费，总手续费</u>	<u>N10(2)</u>
<u>53</u>	<u>AgencyFee</u>	<u>代理费</u>	<u>N10(2)</u>
<u>138</u>	<u>StampDuty</u>	<u>印花税</u>	<u>N16(2)</u>
<u>193</u>	<u>RateFee</u>	<u>费率，分段收费考虑</u>	<u>N5(4)</u>
<u>255</u>	<u>TransferFee</u>	<u>过户费</u>	<u>N10(2)</u>
<u>285</u>	<u>HandleCharge</u>	<u>经手费，上交所收费</u>	<u>N10(2)</u>
<u>94</u>	<u>OtherFee1</u>	<u>其他费用 1</u>	<u>N10(2)</u>
<u>86</u>	<u>NAV</u>	<u>基金单位净值</u>	<u>N7(4)</u>
<u>260</u>	<u>ShareClass</u>	<u>收费方式</u> <u>0-前收费，1-后收费</u>	<u>A1</u>
<u>173</u>	<u>TotalBackendLoad</u>	<u>后端收费总额</u> <u>收费方式为后端收费时使用</u>	<u>N16(2)</u>
<u>263</u>	<u>RedemptionReason</u>	<u>强行赎回原因</u> <u>0-小于最低持有数，1-司法执行，2-政策原因</u>	<u>A1</u>

<u>256</u>	<u>FromTAFlag</u>	是否注册登记人发起业务标志 <u>0-由销售人发起，</u> <u>1-由注册登记人发起，此时申请单编号为 TA 的流水号</u>	<u>A1</u>
<u>276</u>	<u>FeeCalculator</u>	计费人 <u>0-TA 计费 1-基金计费</u>	<u>A1</u>
<u>97</u>	<u>TargetDistributorCode</u>	对方销售人代码 <u>参见附表：销售人代码表</u>	<u>A3</u>
<u>176</u>	<u>TransferDirection</u>	转入/转出标示 <u>0-转入，1-转出</u>	<u>A1</u>
<u>58</u>	<u>FreezingDeadline</u>	冻结截止日期 <u>格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>
<u>60</u>	<u>FrozenCause</u>	冻结原因 <u>0-司法冻结，1-柜台冻结</u> <u>2-质押冻结，3-质押&司法冻结，4-柜台&司法冻结</u>	<u>A1</u>
<u>257</u>	<u>FrozenMethod</u>	冻结方式 <u>0-原份额冻结；1-原份额+红股/红利</u>	<u>A1</u>
<u>266</u>	<u>VolumeByInterest</u>	利息产生的基金份额	<u>N10(2)</u>
<u>24</u>	<u>DefDividendMethod</u>	默认分红方式（只在分红申请和确认业务类型中有效） <u>0-红利转投，1-现金分红</u>	<u>A1</u>
<u>8001</u>	<u>BrokReff</u>	券商自用字段 <u>和申请的 reff 字段一致</u>	<u>C10</u>
<u>37</u>	<u>CurrencyType</u>	结算币种 <u>156-人民币，840-美元</u> <u>344-港元，954-欧元</u> <u>392-日元，826-英镑</u> <u>250-法郎，280-马克</u>	<u>A3</u>
<u>80</u>	<u>LargeRedemptionFlag</u>	巨额赎回处理标志	<u>A1</u>

		<u>0-取消，1-顺延</u>	
<u>93</u>	<u>TransactionTime</u>	<u>交易发生时间</u> <u>格式为：HHMMSS</u>	<u>A6</u>
<u>120</u>	<u>TransactionAccountID</u>	<u>投资人基金交易帐号</u> <u>投资人在销售机构内开设的用于交易的帐号</u>	<u>A17</u>
<u>121</u>	<u>DistributorCode</u>	<u>销售人代码</u>	<u>A3</u>
<u>28</u>	<u>DepositAcct</u>	<u>投资人在销售人处用于交易的资金帐号</u>	<u>C19</u>
<u>29</u>	<u>RegionCode</u>	<u>交易所在地区编号</u> <u>具体编码依 GB13497-92</u>	<u>A4</u>
<u>47</u>	<u>DownLoaddate</u>	<u>交易数据下传日期</u> <u>格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>
<u>90</u>	<u>OriginalAppSheetNo</u>	<u>原申请单编号</u>	<u>A24</u>
<u>91</u>	<u>OriginalSubsDate</u>	<u>原申购日期</u> <u>格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>
<u>98</u>	<u>IndividualOrInstitution</u>	<u>个人/机构标志</u> <u>0-机构，1-个人</u>	<u>A1</u>
<u>102</u>	<u>RedemptionDateInAdvance</u>	<u>预约赎回日期</u> <u>格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>
<u>150</u>	<u>ValidPeriod</u>	<u>交易申请有效天数</u>	<u>N2</u>
<u>89</u>	<u>OriginalSerialNo</u>	<u>TA 的原确认流水号</u> <u>表示 TA 确认申购的流水号</u>	<u>A20</u>
<u>254</u>	<u>Specification</u>	<u>摘要说明</u> <u>强行赎回原因</u>	<u>C30</u>
<u>40</u>	<u>DateOfPeriodicSubs</u>	<u>定期定额申购日期</u> <u>格式为：YYYYMMDD</u>	<u>A8</u>
<u>141</u>	<u>TargetBranchCode</u>	<u>对方网点号</u> <u>转销售人/机构、非交易过户时使用</u>	<u>A9</u>
<u>142</u>	<u>TargetTransactionAccountID</u>	<u>对方销售人处投资人基金交易帐号</u> <u>在转销售人是一次完成时，为必须项</u>	<u>A17</u>

<u>152</u>	<u>TargetRegionCode</u>	<u>对方所在地区编号</u> <u>具体编码依 GB13497-92</u>	<u>A4</u>
<u>123</u>	<u>DividendRatio</u>	<u>红利比例</u>	<u>N16(2)</u>
<u>76</u>	<u>Interest</u>	<u>基金账户利息金额</u>	<u>N10(2)</u>
<u>133</u>	<u>TradingPrice</u>	<u>交易价格</u> <u>单位基金净值+各种费用</u>	<u>N7(4)</u>
<u>147</u>	<u>TargetTAAccountID</u>	<u>对方 TA 帐号</u> <u>转销售人、非交易过户时</u>	<u>A12</u>
<u>139</u>	<u>Tax</u>	<u>税金</u>	<u>N16(2)</u>
<u>162</u>	<u>TargetNAV</u>	<u>目标基金的单位净值</u>	<u>N7(4)</u>
<u>163</u>	<u>TargetFundPrice</u>	<u>目标基金的价格</u>	<u>N7(4)</u>
<u>161</u>	<u>CfmVolOfTargetFund</u>	<u>目标基金的确认份数</u>	<u>N16(2)</u>
<u>194</u>	<u>MinFee</u>	<u>最少收费</u>	<u>N10(2)</u>
<u>95</u>	<u>OtherFee2</u>	<u>其他费用 2</u>	<u>N16(2)</u>
<u>258</u>	<u>OriginalAppDate</u>	<u>原申请日期</u> <u>用于撤单、解冻时键入原申请日期</u>	<u>A8</u>
<u>264</u>	<u>DetailFlag</u>	<u>数据明细标志</u> <u>0-汇总；1-明细</u>	<u>C1</u>
<u>262</u>	<u>RedemptionInAdvanceFlag</u>	<u>预约赎回标志</u> <u>0-非预约赎回 1-预约赎回</u>	<u>A1</u>
<u>261</u>	<u>OriginalCfmDate</u>	<u>TA 的原确认日期</u> <u>表示 TA 确认申购的日期</u>	<u>A8</u>
<u>34</u>	<u>CodeOfTargetFund</u>	<u>转换时的目标基金代码</u>	<u>A6</u>
<u>55</u>	<u>TotalTransFee</u>	<u>交易确认费用合计</u>	<u>N10(2)</u>
<u>8000</u>	<u>Mark</u>	<u>记录类型</u> <u>1:上交所给出当日的申报回执 2:TA 返回的确认信息</u>	<u>N2</u>

由上交所当日发送的 T 日业务申请回执只填写了以下有效字段，其他均为空或 0；

<u>ID</u>	<u>字段名称</u>	<u>描述</u>	<u>备注</u>
<u>8</u>	<u>AppSheetSerialNo</u>	<u>申请单编号</u>	<u>交易流水号</u>

<u>67</u>	<u>FundCode</u>	<u>基金代码</u>	<u>与柜台申报证券代码一致</u>
<u>92</u>	<u>TransactionDate</u>	<u>交易发生日期</u>	<u>格式为：YYYYMMDD</u>
<u>132</u>	<u>ApplicationVol</u>	<u>份数</u>	<u>赎回时指赎回份数，基金转换时指转换的份数</u>
<u>134</u>	<u>ApplicationAmount</u>	<u>申请金额</u>	<u>认购申购时有效</u>
<u>135</u>	<u>BusinessCode</u>	<u>业务代码</u>	<u>取值与含义参见附表：业务代码与含义表</u>
<u>136</u>	<u>TAAccountID</u>	<u>投资人基金账号</u>	<u>10 位股东账号，左对齐</u>
<u>97</u>	<u>TargetDistributorCode</u>	<u>对方销售人代码</u>	<u>只在转托管时有效</u>
<u>34</u>	<u>CodeOfTargetFund</u>	<u>转换时的目标基金代码</u>	
<u>24</u>	<u>DefDividendMethod</u>	<u>默认分红方式(只在分红申请和确认业务类型中有效)</u>	<u>0-红利转投，1-现金分红</u>
<u>8001</u>	<u>BrokReff</u>	<u>券商自用字段</u>	<u>和申请的 reff 字段一致</u>
<u>8000</u>	<u>Mark</u>	<u>记录类型</u>	<u>‘1’</u>

不同业务有效字段说明如下表：

<u>字段号</u>	<u>订单</u>	<u>认购</u>	<u>申购</u>	<u>赎回</u>	<u>转托管</u>	<u>认购</u>	<u>分红</u>	<u>转换</u>	<u>强增</u>	<u>冻结</u>	<u>解冻</u>	<u>非交易</u>
	<u>确认</u>	<u>确认</u>	<u>确认</u>	<u>确认</u>	<u>确认</u>	<u>结果</u>	<u>方式</u>	<u>确认</u>	<u>强减</u>	<u>确认</u>	<u>确认</u>	<u>过户</u>
							<u>确认</u>					<u>确认</u>
<u>8</u>	●	●	●	●	●	●	●	●		●	●	●
<u>16</u>				●								
<u>24</u>	●						●					
<u>25</u>		●	●	●		●		●				
<u>32</u>		●	●	●	●		●	●	●	●	●	●
<u>34</u>	●							●				
<u>52</u>		●	●	●	●	●		●	●			●
<u>53</u>		●	●	●	●	●		●				●
<u>58</u>										●		

字段号	订单 确认	认购 确认	申购 确认	赎回 确认	转托管 确认	认购 结果	分红 方式 确认	转换 确认	强增 强减	冻结 确认	解冻 确认	非交易 过户 确认
<u>60</u>		<u>●</u>								<u>●</u>		
<u>62</u>			<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>64</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>			<u>●</u>			
<u>67</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>86</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>				<u>●</u>				
<u>92</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>94</u>			<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>			
<u>97</u>	<u>●</u>				<u>●</u>							<u>●</u>
<u>119</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>132</u>	<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>134</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>						
<u>135</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>136</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>137</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>138</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>			<u>●</u>
<u>161</u>								<u>●</u>				
<u>162</u>								<u>●</u>				
<u>163</u>								<u>●</u>				
<u>173</u>				<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>
<u>176</u>		<u>●</u>			<u>●</u>			<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>
<u>177</u>			<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>							<u>●</u>
<u>193</u>			<u>●</u>	<u>●</u>				<u>●</u>	<u>●</u>			
<u>255</u>		<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>			<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>
<u>256</u>		<u>●</u>	<u>●</u>		<u>●</u>		<u>●</u>	<u>●</u>	<u>●</u>			<u>●</u>
<u>257</u>										<u>●</u>		

字段号	订单 确认	认购 确认	申购 确认	赎回 确认	转托管 确认	认购 结果	分红 方式 确认	转换 确认	强增 强减	冻结 确认	解冻 确认	非交易 过户 确认
260		●	●		●	●		●	●	●	●	●
263				●								
266						●						
276		●	●	●	●	●						●
285			●	●	●	●						
8000	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
8001	●	●	●	●	●	●	●	●	●			

5.5. 取值附表

5.5.1. 基金业务代码与含义表

BusinessCode(135)取值如下表：

类型	业务和其对应的业务代码
交易申请回执	<u>认购申请(020)</u> <u>认购申请是投资人在开放式基金募集期间提出购买该开放式基金的申请。</u>
	<u>申购申请(022)</u> <u>申购申请是投资人在开放式基金成立之后，在基金存续期间，通过开放式基金的销售人购买基金单位的申请。</u>
	<u>赎回申请(024)</u> <u>赎回申请是投资人在开放式基金成立之后，基金存续期间，通过销售人将持有的基金单位按一定价格卖给基金管理人并收回现金的申请。</u>
	<u>转托管转出申请(028)</u> <u>转托管转出申请是投资人从证券市场转出的申请。</u>

	<u>设置分红方式申请（029）</u> <u>设置分红方式是指投资人设置其基金账户下所持有某基金的分红处理方式。该业务需要在权益登记日之前提出申请。设置完成后，该基金除权时就以设定的分红处理方式进行处理。</u>
	<u>基金转换申请（036）</u>
<u>交易确认</u>	<u>认购确认(120)</u> <u>认购确认是基金注册登记人对投资人认购申请的接收情况的处理结果。认购确认只有认购确认金额（和认购申请的金额一样）和费用，不含基金确认份数，投资人的实际认购份数，要在该基金募集期满后才能确认。</u>
	<u>申购确认(122)</u> <u>申购确认是基金注册登记人对投资人申购申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。</u>
	<u>赎回确认(124)</u> <u>赎回确认是基金注册登记人对投资人赎回申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。</u>
	<u>转托管转出确认(128)</u> <u>对于转托管转出申报的确认信息。</u>
	<u>设置分红方式确认（129）</u> <u>对于分红方式设置的确认。</u>
	<u>基金转换确认（137和138）</u> <u>成功时返回两笔确认，业务代码分别为137、138代码,失败时返回一笔确认，业务代码为138代码。</u>
<u>TA发起的业务</u>	<u>认购结果(130)</u> <u>认购结果是指开放式基金认购成功后，基金注册登记人根据投资人提出的有效认购申请和认购规则，计算出投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，该返回数据包含投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，其中由于份数记整，实际确认的金额=认购基金份数×发行价格+认购费用等，实际确认的金额≤原认购申请的金额。</u>

<u>基金份额冻结确认(131)</u> <u>基金份额冻结确认是基金注册登记人对基金份额冻结申请的处理结果。基金份额冻结后不接受除基金份额解冻以外的业务申请。</u>
<u>基金份额解冻确认(132)</u> <u>基金份额解冻确认是基金注册登记人对基金份额解冻申请的处理结果。基金份额解冻后，对应的基金份额将恢复正常状态。解冻应根据原冻结申请具体情况，逐笔解冻及确认。</u>
<u>非交易过户转入确认(134)，非交易过户转出确认(135)</u> <u>非交易过户转入确认、非交易过户转出确认是基金注册登记人对投资人非交易过户申请的处理结果。基金注册登记人将处理结果分别发送给该业务涉及的申请方和申请方的对方。</u>
<u>转托管转入确认（127）</u> <u>从其他市场转入上交所市场的基金份额将通过本确认信息发送相应投资人指定的券商席位。</u>
<u>认购拉单（190）</u> <u>因认购资金不足引起的拉单处理。</u>
<u>强行调增(144)，强行调减(145)</u> <u>强行调增/调减是基金注册登记人在某种特定或契约预先规定的情况下，强制性地增加/减少投资人所持基金份额。</u>
<u>强行赎回（142）</u> <u>强行赎回确认是强行赎回的处理结果。</u>

5.5.2. 销售人代码表

DistributorCode(121)、TargetDistributorCode(97)的取值如下表：

<u>销售人</u>	<u>编码</u>
<u>中国工商银行</u>	<u>002</u>
<u>中国农业银行</u>	<u>003</u>
<u>中国银行</u>	<u>004</u>
<u>中国建设银行</u>	<u>005</u>
<u>交通银行</u>	<u>006</u>
<u>上海证券交易所</u>	<u>101</u>

<u>深圳证券交易所</u>	<u>102</u>
<u>国泰基金管理公司</u>	<u>201</u>
<u>南方基金管理公司</u>	<u>202</u>
<u>华夏基金管理公司</u>	<u>203</u>
<u>华安基金管理公司</u>	<u>204</u>
<u>博时基金管理公司</u>	<u>205</u>
<u>鹏华基金管理公司</u>	<u>206</u>
<u>嘉实基金管理公司</u>	<u>207</u>
<u>长盛基金管理公司</u>	<u>208</u>
<u>大成基金管理公司</u>	<u>209</u>
<u>富国基金管理公司</u>	<u>210</u>

5.5.3. 返回代码表

ReturnCode(119)取值如下表：

注意：

本表所述“交易”特指开放式基金除二级市场买卖交易外的其他交易。

如果找不到合适的返回代码，统一填写“9999”，即“其它错误”。

<u>返回代码</u>	<u>含义</u>	<u>备注</u>
<u>0000</u>	<u>成功</u>	
<u>0001</u>	<u>份数余额不足</u>	
<u>0002</u>	<u>账户已冻结</u>	
<u>0003</u>	<u>账户已挂失</u>	
<u>0004</u>	<u>发行期不受理</u>	
<u>0005</u>	<u>封闭期不受理</u>	
<u>0006</u>	<u>非开放日不受理</u>	
<u>0007</u>	<u>收到预约数据确认</u>	
<u>0008</u>	<u>巨额不受理</u>	
<u>0009</u>	<u>无此账户</u>	

<u>0010</u>	<u>其它原因失败</u>	
<u>0100</u>	<u>证件号码错误</u>	<u>包括无证件号码</u>
<u>0101</u>	<u>证件号码重复</u>	
<u>0102</u>	<u>地区号无效</u>	
<u>0103</u>	<u>业务种类非法</u>	
<u>0104</u>	<u>销售人交易基金账号非法</u>	
<u>0105</u>	<u>销售代理人代码错误</u>	
<u>0106</u>	<u>无户名</u>	
<u>0107</u>	<u>个人/法人标志非法</u>	
<u>0108</u>	<u>证件类型非法</u>	
<u>0109</u>	<u>无经办人姓名</u>	
<u>0110</u>	<u>经办人证件类型非法</u>	<u>包括无经办人证件号码</u>
<u>0111</u>	<u>经办人证件号码错误</u>	
<u>0112</u>	<u>无通讯地址</u>	
<u>0113</u>	<u>邮政编码非法</u>	<u>包括无邮政编码</u>
<u>0114</u>	<u>无电话</u>	
<u>0115</u>	<u>无住址电话</u>	
<u>0116</u>	<u>无单位电话</u>	
<u>0117</u>	<u>开户网点非法</u>	
<u>0118</u>	<u>冻结挂失截止日期无效</u>	
<u>0119</u>	<u>无 E-MAIL 地址</u>	
<u>0120</u>	<u>无法人代表姓名</u>	
<u>0121</u>	<u>法人代表证件类型非法</u>	
<u>0122</u>	<u>法人身份证件代码非法</u>	<u>包括无法人身份证件代码</u>
<u>0123</u>	<u>基金账号非法</u>	<u>包括无基金账号</u>
<u>0124</u>	<u>密函编号非法</u>	<u>包括无密函编号</u>
<u>0125</u>	<u>职业代码非法</u>	
<u>0126</u>	<u>学历代码无效</u>	
<u>0127</u>	<u>年收入代码</u>	

0128	性别非法	
0129	出生日期非法	
0130	传真号码非法	
0131	手机号码非法	
0132	传呼机号码非法	
0133	交收行代码非法	
0134	交收行账户名非法	
0135	交收行账号非法	
0136	上交所账号非法	
0137	深交所账号非法	
0138	开户日期非法	
0139	申请单编号非法	包括无申请单编号
0140	冻结标志非法	
0141	默认分红方式非法	
0200	基金代码非法	
0201	交易日期非法	
0202	交易时间非法	
0203	销售人流水号非法	
0204	币种代码非法	
0205	资金账号非法	
0206	交易数量非法	
0207	交易金额非法	
0208	对方销售人基金账号非法	
0209	受理日期已变为下一个工作日	
0210	对方基金账号非法	
0211	过户代理地点代码非法	
0212	股东账户代码非法	
0213	指定券商席位号非法	
0214	预约赎回日期非法	

<u>0215</u>	<u>网点号非法</u>	
<u>0216</u>	<u>折扣率非法</u>	
<u>0217</u>	<u>有效天数非法</u>	
<u>0218</u>	<u>原申请单编号非法</u>	
<u>0219</u>	<u>巨额赎回处理标志非法</u>	
<u>0220</u>	<u>冻结原因非法</u>	
<u>0221</u>	<u>对方网点号非法</u>	
<u>0222</u>	<u>再投资类型非法</u>	
<u>0223</u>	<u>目标基金代码非法</u>	
<u>0224</u>	<u>手续费率非法</u>	
<u>0225</u>	<u>手续费非法</u>	
<u>0226</u>	<u>对方销售人代码非法</u>	
<u>0227</u>	<u>原申购日期非法</u>	
<u>0228</u>	<u>账户未挂失</u>	
<u>0229</u>	<u>账户未冻结</u>	
<u>0301</u>	<u>账户申请日期无效</u>	
<u>0302</u>	<u>账户申请不存在</u>	
<u>0303</u>	<u>投资人已注册基金账户</u>	
<u>0304</u>	<u>账户申请注册失败</u>	
<u>0305</u>	<u>赎回份数过小</u>	
<u>0306</u>	<u>因投资人未在转入方开户致使转销售人/机构失败</u>	
<u>0307</u>	<u>持有份数超过持有上限</u>	
<u>0308</u>	<u>基金账户已注销</u>	
<u>0309</u>	<u>单笔申购低于申购下限</u>	
<u>0310</u>	<u>赎回后剩余份数低于持有下限</u>	
<u>0311</u>	<u>转出方余额不足</u>	
<u>0312</u>	<u>确认异常</u>	
<u>0313</u>	<u>投资人名或证件类型或证件代码与股东资料不符</u>	
<u>0314</u>	<u>基金账户已挂账</u>	

<u>0315</u>	<u>证券账户不存在</u>	
<u>0316</u>	<u>基金账户不存在</u>	
<u>0317</u>	<u>基金非认购期</u>	
<u>0318</u>	<u>基金非申购期</u>	
<u>0319</u>	<u>基金非赎回期</u>	
<u>0320</u>	<u>基金禁止转销售人/机构</u>	
<u>0321</u>	<u>证券账户已注册为基金账户</u>	
<u>0322</u>	<u>基金账户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转销售人/机构</u>	
<u>0323</u>	<u>有在途份数，不能全转销售人/机构</u>	
<u>0324</u>	<u>转出方余额为零</u>	
<u>0325</u>	<u>原申请日期无效</u>	
<u>0326</u>	<u>转入转出是同一代理人</u>	
<u>0327</u>	<u>销售代理人不能代理此基金</u>	
<u>0328</u>	<u>销售代理人无效</u>	
<u>0329</u>	<u>性别代码无效</u>	
<u>0330</u>	<u>申请日期无效</u>	
<u>0331</u>	<u>投资人名无效</u>	
<u>0332</u>	<u>投资人证件类型无效</u>	
<u>0333</u>	<u>投资人证件号码无效</u>	
<u>0334</u>	<u>通讯地址无效</u>	
<u>0335</u>	<u>法人代表姓名无效</u>	
<u>0336</u>	<u>经办人姓名无效</u>	
<u>0337</u>	<u>单笔认购低于认购下限</u>	
<u>0338</u>	<u>单笔认购高于认购上限</u>	
<u>0339</u>	<u>基金处于权益分配期间，不允许更改分红方式</u>	
<u>0340</u>	<u>单笔赎回高于预约下限</u>	
<u>0341</u>	<u>单笔赎回低于赎回下限</u>	
<u>0342</u>	<u>取基金信息错误</u>	
<u>0343</u>	<u>写权益登记错误</u>	

0344	<u>写基金明细表出错</u>	
0345	<u>撤单申请无效</u>	
0346	<u>转销售人/机构类型错</u>	
0347	<u>转销售人/机构类型与申报数据不符</u>	
0348	<u>旧基金账号个人资料不存在</u>	
0349	<u>旧基金账号机构资料不存在</u>	
0350	<u>无效分红方式</u>	
0351	<u>该基金账号有份数允许注销</u>	
0352	<u>赎回金额不足以支付手续费</u>	
0353	<u>证券账户类型非法</u>	
0354	<u>同一网点申报相同数据</u>	
0355	<u>管理人拒绝</u>	
0356	<u>管理人配售确认撤销</u>	
0357	<u>认购金额过少</u>	
0358	<u>经办人识别方式非法</u>	
0359	<u>CALLCENTER 交易标志非法</u>	
0360	<u>INTERNET 交易标志非法</u>	
0361	<u>账单寄送选择方式非法</u>	
0362	<u>有基金份额，销户非法</u>	
0363	<u>基金账号信息未作改动，拒绝申请</u>	
0364	<u>基金账号凭证号非法</u>	
0365	<u>有当日申请，销户非法</u>	
0366	<u>基金净值非法</u>	
0367	<u>转销售人/机构中转出与转入交易账户的基金账户不同</u>	
0368	<u>基金不能转入</u>	
0369	<u>基金不能转出</u>	
0370	<u>持有份数小于最低持有份数，应全部赎回或转换</u>	
0371	<u>税率非法</u>	
0372	<u>分红方案错误</u>	

<u>0373</u>	<u>基金发行失败，退回认购</u>	
<u>0374</u>	<u>该预约赎回单已失效</u>	
<u>0375</u>	<u>手续费分成非法</u>	
<u>0376</u>	<u>基金终止</u>	
<u>0377</u>	<u>基金不在发行期或认购结束，认购不受理</u>	
<u>0378</u>	<u>基金在正常交易期</u>	
<u>0379</u>	<u>基金已发行或发行失败</u>	
<u>0380</u>	<u>基金停止交易</u>	
<u>0381</u>	<u>基金停止申购</u>	
<u>0382</u>	<u>基金停止赎回</u>	
<u>0383</u>	<u>基金正在权益登记</u>	
<u>0384</u>	<u>红利发放，业务不受理</u>	
<u>0385</u>	<u>无法识别的基金状态</u>	
<u>0386</u>	<u>非交易过户对方账号未登记</u>	
<u>0387</u>	<u>本日有冻结、挂失申请，交易无效</u>	
<u>0388</u>	<u>一天仅接受一次重要资料修改</u>	
<u>0389</u>	<u>分红期间有在途权益，不能处理</u>	
<u>0390</u>	<u>基金账号已登记</u>	
<u>0391</u>	<u>基金账号未登记</u>	
<u>0392</u>	<u>该交易账号已开户</u>	
<u>0393</u>	<u>有重复的冻结申请</u>	
<u>0394</u>	<u>非交易过户必须逐笔确认</u>	
<u>0395</u>	<u>交易后，入方余额低于最低限制</u>	
<u>0396</u>	<u>交易后，出方余额低于最低限制</u>	
<u>0397</u>	<u>基金转换对方基金停止交易</u>	
<u>0398</u>	<u>基金无份数可冻结解冻</u>	
<u>0399</u>	<u>无此冻结申请</u>	
<u>0400</u>	<u>解冻份数与原冻结数不匹配</u>	
<u>0401</u>	<u>超过最高赎回份数限制</u>	

<u>0402</u>	<u>申购金额低于手续费</u>	
<u>0403</u>	<u>总份额已超过募集金额，不能再认购</u>	
<u>0404</u>	<u>按份数认购，金额计算错误</u>	
<u>0405</u>	<u>不允许机构认购</u>	
<u>0406</u>	<u>不允许个人认购</u>	
<u>0407</u>	<u>逐笔人工处理为无效</u>	
<u>0408</u>	<u>逐笔人工处理为成功</u>	
<u>0409</u>	<u>已撤单</u>	
<u>0410</u>	<u>巨额赎回延续部分</u>	
<u>0411</u>	<u>重复开户</u>	
<u>0412</u>	<u>不支持预约申请</u>	
<u>0413</u>	<u>有份数冻结，不允许账户冻结</u>	
<u>0414</u>	<u>没有指定赎回的基金份额</u>	
<u>0415</u>	<u>小于初次投资金额限制</u>	
<u>0416</u>	<u>小于追加投资限制</u>	
<u>0417</u>	<u>转销售人/机构对方销售商或网点不存在</u>	
<u>0418</u>	<u>不能修改客户类型</u>	
<u>0419</u>	<u>重要资料修改当天不能赎回转销售人/机构</u>	
<u>0420</u>	<u>申请日期大于最后认购日期</u>	
<u>0421</u>	<u>巨额赎回，不能基金转换</u>	
<u>0422</u>	<u>当天多次开户(交易账号重)</u>	
<u>0423</u>	<u>当天多次开户(基金账号重)</u>	
<u>0424</u>	<u>不存在要转出的份数</u>	
<u>0425</u>	<u>经办人识别方式非法</u>	
<u>0426</u>	<u>账单寄送选择方式非法</u>	
<u>0427</u>	<u>基金账号信息未作改动，拒绝申请</u>	
<u>0428</u>	<u>持有份数小于最低持有份数，应全部赎回或转换</u>	
<u>0429</u>	<u>分红方案错误</u>	
<u>0430</u>	<u>该预约赎回单已失效</u>	

<u>0431</u>	<u>持有份数小于等于最低赎回份数，应全部赎回或转换</u>	
<u>0432</u>	<u>基金在个人认购期，不接受机构认购</u>	
<u>0433</u>	<u>基金在机构认购期，不接受个人认购</u>	
<u>0434</u>	<u>认购金额小于机构最低认购金额</u>	
<u>0435</u>	<u>认购申请金额小于个人最低认购金额</u>	
<u>0436</u>	<u>认购金额大于机构最高认购金额</u>	
<u>0437</u>	<u>认购申请金额大于个人最高认购金额</u>	
<u>0438</u>	<u>基金处于不允许申购状态</u>	
<u>0439</u>	<u>申购申请金额小于机构最低追加投资金额</u>	
<u>0440</u>	<u>申购申请金额小于个人最低追加投资金额</u>	
<u>0441</u>	<u>申购申请金额小于机构最低首次投资金额</u>	
<u>0442</u>	<u>申购申请金额小于个人最低首次投资金额</u>	
<u>0443</u>	<u>定时定额申购申请金额小于最低定额</u>	
<u>0444</u>	<u>定时定额申购申请金额超出最低定额部分不是级差的整数倍</u>	
<u>0445</u>	<u>定时定额申购合约终止</u>	
<u>0446</u>	<u>定时定额申购金额与原合约不符</u>	
<u>0447</u>	<u>持有份数大于最低赎回份数，申请赎回份数不小于最低赎回份数</u>	
<u>0448</u>	<u>柜员登录注销错误</u>	
<u>0449</u>	<u>柜员代码不能为空</u>	
<u>0450</u>	<u>没有此柜员</u>	
<u>0451</u>	<u>此柜员已被冻结</u>	
<u>0452</u>	<u>此柜员已被删除</u>	
<u>0453</u>	<u>柜员密码不符</u>	
<u>0454</u>	<u>此柜员已经登录系统;或者此前非正常退出系统，请与系统管理员联系</u>	
<u>0455</u>	<u>登录柜员记录出现异常，请与系统管理员联系</u>	
<u>0456</u>	<u>注销柜员状态出现异常，请与系统管理员联系</u>	
<u>0457</u>	<u>操作员过期</u>	
<u>0458</u>	<u>柜员管理类错误</u>	

<u>0459</u>	<u>柜员代码长度必须为 3 位</u>	
<u>0460</u>	<u>此柜员代码已经存在</u>	
<u>0461</u>	<u>柜员姓名不能为空</u>	
<u>0462</u>	<u>存在同名的有效柜员，系统不允许姓名重复</u>	
<u>0463</u>	<u>柜员密码不能为空</u>	
<u>0464</u>	<u>柜员所属部门不能为空</u>	
<u>0465</u>	<u>有效天数必须是大于 0 的整数</u>	
<u>0466</u>	<u>起始日期不能为空</u>	
<u>0467</u>	<u>确认密码不能为空</u>	
<u>0468</u>	<u>组代码不能为空</u>	
<u>0469</u>	<u>组的成员已经存在</u>	
<u>0470</u>	<u>权限代码不能为空</u>	
<u>0471</u>	<u>组的权限已经存在</u>	
<u>0472</u>	<u>柜员的权限已经存在</u>	
<u>0473</u>	<u>组名称不能为空</u>	
<u>0474</u>	<u>此组已经存在</u>	
<u>0475</u>	<u>柜员角色不能为空</u>	
<u>0476</u>	<u>组非空不能删除</u>	
<u>0477</u>	<u>组的成员不存在</u>	
<u>0478</u>	<u>组的权限不存在</u>	
<u>0479</u>	<u>根用户不能删除</u>	
<u>0480</u>	<u>操作员代码不能为空</u>	
<u>0481</u>	<u>没有此组</u>	
<u>0482</u>	<u>此柜员代码不存在</u>	
<u>0483</u>	<u>确认密码不正确</u>	
<u>0484</u>	<u>修改柜员资料时柜员状态不允许被设置为"删除"</u>	
<u>0485</u>	<u>柜员已被删除，操作被禁止</u>	
<u>0486</u>	<u>柜员处于活动状态，操作被禁止</u>	
<u>0487</u>	<u>交易密码错误</u>	

<u>0488</u>	<u>交易账号凭证号错误</u>	
<u>0489</u>	<u>交易账户处于等待确认状态</u>	
<u>0490</u>	<u>交易账户已挂失</u>	
<u>0491</u>	<u>确认密码不正确</u>	
<u>0492</u>	<u>基金账户处于等待确认状态</u>	
<u>0493</u>	<u>当天有账户申请</u>	
<u>0494</u>	<u>当天有交易申请</u>	
<u>0495</u>	<u>案号非法</u>	
<u>0496</u>	<u>该交易申请已经提交</u>	
<u>0497</u>	<u>定时定额申购日期非法</u>	
<u>0498</u>	<u>定时定额申购类型错误</u>	
<u>0499</u>	<u>定时定额申购状态非法</u>	
<u>0500</u>	<u>该定时定额申购已完成</u>	
<u>0501</u>	<u>该定时定额申购已撤单</u>	
<u>0502</u>	<u>该定时定额申购已撤消</u>	
<u>0503</u>	<u>定时定额申请不存在或其它数据库错误</u>	
<u>0504</u>	<u>解冻份数大于已冻结份数</u>	
<u>0505</u>	<u>在同一工作日同一投资者有相同的更改基金分红方式申请</u>	
<u>0506</u>	<u>交易账户已作废</u>	
<u>0507</u>	<u>交易账户凭证号状态错误</u>	
<u>0508</u>	<u>交易账户已销户</u>	
<u>0509</u>	<u>交易账户已冻结</u>	
<u>0510</u>	<u>交易账户已撤销</u>	
<u>0511</u>	<u>交易账户待确认</u>	
<u>0512</u>	<u>交易账户未开基金账户</u>	
<u>0513</u>	<u>基金账户挂失</u>	
<u>0514</u>	<u>基金账户冻结</u>	
<u>0515</u>	<u>基金账户销户</u>	
<u>0516</u>	<u>转销售人/机构对方机构代码与发起机构代码相同</u>	

<u>0517</u>	<u>基金转换转出基金与目标基金相同</u>	
<u>0518</u>	<u>交易账户与基金账户不匹配</u>	
<u>0519</u>	<u>禁止此模式基金转换</u>	
<u>0520</u>	<u>存在逆向基金转换</u>	
<u>0521</u>	<u>无要复核的申请合同号</u>	
<u>0522</u>	<u>要复核的合同号不属于本机构</u>	
<u>0523</u>	<u>要复核的合同号不属于本网点</u>	
<u>0524</u>	<u>要复核的合同号业务类型不一致</u>	
<u>0525</u>	<u>复核人员与受理人员相同</u>	
<u>0526</u>	<u>要复核的合同号已复核</u>	
<u>0527</u>	<u>要复核的合同号已作废</u>	
<u>0528</u>	<u>要复核的合同号已撤单</u>	
<u>0529</u>	<u>复核流水的基金代码不对</u>	
<u>0530</u>	<u>复核流水的申请金额不对</u>	
<u>0531</u>	<u>复核流水的交易账号不对</u>	
<u>0532</u>	<u>写更改申请流水的复核标志失败</u>	
<u>0533</u>	<u>复核流水的操作员代码不对</u>	
<u>0534</u>	<u>复核流水的申请份数不对</u>	
<u>0535</u>	<u>复核流水的巨额赎回处理方式不对</u>	
<u>0536</u>	<u>复核流水的对方机构代码不对</u>	
<u>0537</u>	<u>复核流水的转换目标基金代码不对</u>	
<u>0538</u>	<u>复核流水的申请费用不对</u>	
<u>0539</u>	<u>复核流水的分红方式不对</u>	
<u>0540</u>	<u>复核流水的分红比例不对</u>	
<u>0541</u>	<u>无此交易码</u>	
<u>0542</u>	<u>该操作现不可用</u>	
<u>0543</u>	<u>该申请已撤单</u>	
<u>0544</u>	<u>该申请已作废</u>	
<u>0545</u>	<u>该申请还未复核</u>	

<u>0546</u>	<u>电话委托受理业务不能通过柜面撤单</u>	
<u>0547</u>	<u>该申请已复核</u>	
<u>0548</u>	<u>系统通用参数查询失败</u>	
<u>0549</u>	<u>查询表单列值信息失败</u>	
<u>0550</u>	<u>查询报表输出固定数据配置信息失败</u>	
<u>0551</u>	<u>查询表单输入条件的配置信息失败</u>	
<u>0552</u>	<u>未定义的表单查询</u>	
<u>0553</u>	<u>查询表单数据集信息失败</u>	
<u>0554</u>	<u>请选择输入查询表单号</u>	
<u>0555</u>	<u>未定义的查询类别</u>	
<u>0556</u>	<u>查询表单数据集信息失败</u>	
<u>0557</u>	<u>取申请账页失败</u>	
<u>0558</u>	<u>发布日期不能为空</u>	
<u>0559</u>	<u>利率生效时间非法</u>	
<u>0560</u>	<u>利率非法</u>	
<u>0561</u>	<u>利息税率非法</u>	
<u>0562</u>	<u>实施时间不能为空</u>	
<u>0563</u>	<u>最小手续费比率不能小于 0</u>	
<u>0564</u>	<u>最大手续费比率不能大于 1</u>	
<u>0565</u>	<u>最小手续费比率不能大于最大手续费比率</u>	
<u>0566</u>	<u>注册登记人手续费分成比率不能为空</u>	
<u>0567</u>	<u>此业务不能设置进入基金资产手续费比率</u>	
<u>0568</u>	<u>手续费分成比率不能大于最小手续费比率</u>	
<u>0569</u>	<u>手续费分成比率不能小于 0</u>	
<u>0570</u>	<u>权益登记日非法</u>	
<u>0571</u>	<u>除权日非法</u>	
<u>0572</u>	<u>派息日非法</u>	
<u>0573</u>	<u>利得比例不能为空</u>	
<u>0574</u>	<u>利得比例必须在 0, 1 之间</u>	

<u>0575</u>	<u>分红方案编码非法</u>	
<u>0576</u>	<u>费率方案编号不能为空</u>	
<u>0577</u>	<u>手续费计算方案起始时间非法</u>	
<u>0578</u>	<u>基金名称不能为空</u>	
<u>0579</u>	<u>基金状态非法</u>	
<u>0580</u>	<u>基金转换状态非法</u>	
<u>0581</u>	<u>基金认购价格非法</u>	
<u>0582</u>	<u>费率方案不完整</u>	
<u>0583</u>	<u>存在未确认记录,不能提交</u>	
<u>0584</u>	<u>此操作员未输入费率方案,不能输入费率</u>	
<u>0585</u>	<u>金额非法</u>	
<u>0586</u>	<u>持有天数非法</u>	
<u>0587</u>	<u>手续费率段重叠</u>	
<u>0588</u>	<u>此操作员未输入费率方案,不能删除费率</u>	
<u>0589</u>	<u>基金账户受理方式不能为空</u>	
<u>0590</u>	<u>不存在的基金账户受理方式</u>	
<u>0591</u>	<u>到账情况不能为空</u>	
<u>0592</u>	<u>证件唯一性不能为空</u>	
<u>0593</u>	<u>系统状态不能为空</u>	
<u>0594</u>	<u>强行签退时间不能为空</u>	
<u>0595</u>	<u>强行签退持续时间不能为空</u>	
<u>0596</u>	<u>强行签退持续时间不能小于 0</u>	
<u>0597</u>	<u>基金净值路径不能为空</u>	
<u>0598</u>	<u>销售点代码不能为空</u>	
<u>0599</u>	<u>清算日期不能为空</u>	
<u>0600</u>	<u>工作日期不能为空</u>	
<u>0601</u>	<u>巨额赎回比例不能为空</u>	
<u>0602</u>	<u>巨额赎回比例必须在 0-1 之间</u>	
<u>0603</u>	<u>未知的系统参数</u>	

<u>0604</u>	<u>定时定额申购日期不能为</u>	
<u>0605</u>	<u>按定时定额申购日期错</u>	
<u>0606</u>	<u>印花税率非法</u>	
<u>0607</u>	<u>审批日期不能为空</u>	
<u>0608</u>	<u>审批人不能为空</u>	
<u>0609</u>	<u>审批数量不能为空</u>	
<u>0610</u>	<u>审批数量不能小于 0</u>	
<u>0611</u>	<u>批准的基金转换份数应小于等于基金总份数</u>	
<u>0612</u>	<u>待确认的记录超过一条</u>	
<u>0613</u>	<u>确认审批内容与第一次输入内容不符</u>	
<u>0614</u>	<u>不支持的基金发行方案</u>	
<u>0615</u>	<u>待确认的基金发行记录超过一条</u>	
<u>0616</u>	<u>到款日期不能为空</u>	
<u>0617</u>	<u>预售规模不能为空</u>	
<u>0618</u>	<u>预售规模不能小于 0</u>	
<u>0619</u>	<u>认购价格不能小于 0</u>	
<u>0620</u>	<u>销售机构设置错误</u>	
<u>0621</u>	<u>销售机构接收目录不能为空</u>	
<u>0622</u>	<u>销售机构发送目录不存在</u>	
<u>0623</u>	<u>销售机构接收目录不能为空</u>	
<u>0624</u>	<u>销售机构接收目录不存在</u>	
<u>0625</u>	<u>销售机构代码不能为空</u>	
<u>0626</u>	<u>销售机构名称不能为空</u>	
<u>0627</u>	<u>销售机构状态不能为空</u>	
<u>0628</u>	<u>销售机构类型不能为空</u>	
<u>0629</u>	<u>销售机构接受目录长度大于 120</u>	
<u>0630</u>	<u>销售机构发送目录长度大于 120</u>	
<u>0631</u>	<u>网点代码不能为空</u>	
<u>0632</u>	<u>网点名称不能为空</u>	

<u>0633</u>	<u>区域代码不能为空</u>	
<u>0634</u>	<u>区域代码不存在</u>	
<u>0635</u>	<u>银行名称不能为空</u>	
<u>0636</u>	<u>银行状态不能为空</u>	
<u>0637</u>	<u>公告状态不能为空</u>	
<u>0638</u>	<u>公告已输入,未复核</u>	
<u>0639</u>	<u>公告已复核成功</u>	
<u>0640</u>	<u>未定义的公告状态</u>	
<u>0641</u>	<u>此公告不存在</u>	
<u>0642</u>	<u>公告标题不能为空</u>	
<u>0643</u>	<u>公告日期不能为空</u>	
<u>0644</u>	<u>公告日期不能比当前日期小</u>	
<u>0645</u>	<u>公告内容不能为空</u>	
<u>0646</u>	<u>公告类型不能为空</u>	
<u>0647</u>	<u>取公告编号流水号失败</u>	
<u>0648</u>	<u>操作员相同,不能复核公告</u>	
<u>0649</u>	<u>操作员不同,不能修改公告</u>	
<u>0650</u>	<u>公告已经发布</u>	
<u>0651</u>	<u>公告复核错误</u>	
<u>0652</u>	<u>不支持的传输状态</u>	
<u>0653</u>	<u>未解上传包</u>	
<u>0654</u>	<u>未打包上传包</u>	
<u>0655</u>	<u>未解下传包</u>	
<u>0656</u>	<u>未打包下传包</u>	
<u>0657</u>	<u>包传输状态不存在</u>	
<u>0658</u>	<u>第一次输入</u>	
<u>0659</u>	<u>第一次删除</u>	
<u>0660</u>	<u>第一次修改</u>	
<u>0661</u>	<u>未生效</u>	

<u>0662</u>	<u>已生效</u>	
<u>0663</u>	<u>已实施</u>	
<u>0664</u>	<u>未知状态</u>	
<u>0665</u>	<u>记录只有一条</u>	
<u>0666</u>	<u>记录不存在</u>	
<u>0667</u>	<u>记录多于一条</u>	
<u>0668</u>	<u>不是本操作员输入,不能修改,请先清屏</u>	
<u>0669</u>	<u>本操作员输入,不能再次输入</u>	
<u>0670</u>	<u>不是本操作员输入,不能删除</u>	
<u>0671</u>	<u>第二次输入内容与第一次输入内容不符</u>	
<u>0672</u>	<u>第二次修改内容与第一次修改内容不符</u>	
<u>0673</u>	<u>数据库错误</u>	
<u>0674</u>	<u>写日志失败</u>	
<u>0675</u>	<u>取交易账户编号失败</u>	
<u>0676</u>	<u>取基金账户流水号失败</u>	
<u>0677</u>	<u>取系统日期失败</u>	
<u>0678</u>	<u>存在认购或未完成的赎回申请</u>	
<u>0679</u>	<u>清算步骤错误</u>	
<u>0680</u>	<u>取系统时间失败</u>	
<u>0681</u>	<u>取参数 ACCPTMD(受理方式)的值失败</u>	
<u>0682</u>	<u>取交易账号凭证流水号失败</u>	
<u>0683</u>	<u>取销售机构代码失败</u>	
<u>0684</u>	<u>存在冻结的基金份额</u>	
<u>0685</u>	<u>正在清算,不能处理到账操作</u>	
<u>0686</u>	<u>存在未审批的巨额赎回</u>	
<u>0687</u>	<u>取交易账号凭证号失败</u>	
<u>0688</u>	<u>取交易账号失败</u>	
<u>0689</u>	<u>取交易密码失败</u>	
<u>0690</u>	<u>取基金余额失败</u>	

<u>0691</u>	<u>更改余额失败</u>	
<u>0692</u>	<u>写资金回款流水失败</u>	
<u>0693</u>	<u>交易清算类型错误</u>	
<u>0694</u>	<u>取清算日失败</u>	
<u>0695</u>	<u>修改投资者基金分红信息失败</u>	
<u>0696</u>	<u>取市场标志失败</u>	
<u>0697</u>	<u>市场标志错误</u>	
<u>0698</u>	<u>现为收市状态，还未日初，不能进行业务受理</u>	
<u>0699</u>	<u>现为日终状态，还未日初，不能进行业务受理</u>	
<u>0700</u>	<u>系统步骤错误</u>	
<u>0701</u>	<u>取市场状态描述错误</u>	
<u>0702</u>	<u>设置市场状态错误</u>	
<u>0703</u>	<u>设置下一工作日错误</u>	
<u>0704</u>	<u>生成工作日表错误</u>	
<u>0705</u>	<u>系统日初错误</u>	
<u>0706</u>	<u>系统日终错误</u>	
<u>0707</u>	<u>设置上一工作日错误</u>	
<u>0708</u>	<u>取收市处理状态失败</u>	
<u>0709</u>	<u>收市处理步骤错误</u>	
<u>0710</u>	<u>取收市处理状态描述失败</u>	
<u>0711</u>	<u>设置收市处理状态失败</u>	
<u>0712</u>	<u>收市初始化错误</u>	
<u>0713</u>	<u>收市复核错误</u>	
<u>0714</u>	<u>收市写账页错误</u>	
<u>0715</u>	<u>取系统状态失败</u>	
<u>0716</u>	<u>取系统状态描述失败</u>	
<u>0717</u>	<u>设置系统状态失败</u>	
<u>0718</u>	<u>系统当前状态不允许操作</u>	
<u>0719</u>	<u>取清算处理状态失败</u>	

<u>0720</u>	<u>清算处理步骤错误</u>	
<u>0721</u>	<u>取清算处理状态描述失败</u>	
<u>0722</u>	<u>设置清算处理状态失败</u>	
<u>0723</u>	<u>清算初始化错误</u>	
<u>0724</u>	<u>清算数据备份错误</u>	
<u>0725</u>	<u>清算数据恢复错误</u>	
<u>0726</u>	<u>账户清算错误</u>	
<u>0727</u>	<u>交易清算错误</u>	
<u>0728</u>	<u>清算复核错误</u>	
<u>0729</u>	<u>清算结束错误</u>	
<u>0730</u>	<u>预清算错误</u>	
<u>0731</u>	<u>清算数据汇总错误</u>	
<u>0732</u>	<u>审批赎回份数大于允许的最大审批份数</u>	
<u>0733</u>	<u>审批申购份数大于允许的最大审批份数</u>	
<u>0734</u>	<u>基金未发生巨额或超规模不用进行审批</u>	
<u>0735</u>	<u>基金发生巨额或超规模请进行审批</u>	
<u>0736</u>	<u>取募集期日处理状态失败</u>	
<u>0737</u>	<u>募集期日处理步骤错误</u>	
<u>0738</u>	<u>取募集期日处理状态描述失败</u>	
<u>0739</u>	<u>设置募集期日处理状态失败</u>	
<u>0740</u>	<u>募集期日处理初始化错误</u>	
<u>0741</u>	<u>募集期日处理数据备份错误</u>	
<u>0742</u>	<u>募集期日处理数据检查错误</u>	
<u>0743</u>	<u>募集期日处理当日有效认购统计错误</u>	
<u>0744</u>	<u>募集期日处理错误</u>	
<u>0745</u>	<u>募集期日处理发行统计错误</u>	
<u>0746</u>	<u>募集期日处理数据汇总错误</u>	
<u>0747</u>	<u>募集期日处理复核开始错误</u>	
<u>0748</u>	<u>募集期日处理复核结束错误</u>	

<u>0749</u>	<u>募集期日处理数据恢复错误</u>	
<u>0750</u>	<u>募集期日处理结束错误</u>	
<u>0751</u>	<u>基金认购费率未设置或无有效费率</u>	
<u>0752</u>	<u>基金交易费率未设置或无有效费率</u>	
<u>0753</u>	<u>基金 NAV 值未设置或无有效 NAV 值</u>	
<u>0754</u>	<u>没有基金可进行募集处理</u>	
<u>0755</u>	<u>取发行处理状态失败</u>	
<u>0756</u>	<u>发行处理步骤错误</u>	
<u>0757</u>	<u>取发行处理状态描述失败</u>	
<u>0758</u>	<u>设置发行处理状态失败</u>	
<u>0759</u>	<u>发行处理初始化错误</u>	
<u>0760</u>	<u>发行处理数据备份错误</u>	
<u>0761</u>	<u>发行处理错误</u>	
<u>0762</u>	<u>发行处理复核开始错误</u>	
<u>0763</u>	<u>发行处理复核结束错误</u>	
<u>0764</u>	<u>发行处理数据恢复错误</u>	
<u>0765</u>	<u>发行处理结束错误</u>	
<u>0766</u>	<u>发行预处理错误</u>	
<u>0767</u>	<u>计算发行利息错误</u>	
<u>0768</u>	<u>发行失败处理错误</u>	
<u>0769</u>	<u>发行成功处理错误</u>	
<u>0770</u>	<u>利率未设置或不存在</u>	
<u>0771</u>	<u>没有基金可进行发行处理</u>	
<u>0772</u>	<u>分红方案非法</u>	
<u>0773</u>	<u>分红方案状态错误</u>	
<u>0774</u>	<u>取投资者分红信息错误</u>	
<u>0775</u>	<u>计算投资者分红权益错误</u>	
<u>0776</u>	<u>权益登记错误</u>	
<u>0777</u>	<u>红利发放错误</u>	

<u>0778</u>	<u>红利统计错误</u>	
<u>0779</u>	<u>统计认购清算确认数据错误</u>	
<u>0780</u>	<u>统计认购数据(给核算)错误</u>	
<u>0781</u>	<u>统计发行确认数据错误</u>	
<u>0782</u>	<u>统计发行确认数据(给核算)错误</u>	
<u>0783</u>	<u>汇总业务申请数据错误</u>	
<u>0784</u>	<u>汇总业务确认数据错误</u>	
<u>0785</u>	<u>汇总统计固定收费错误</u>	
<u>0786</u>	<u>读数据库失败，请查看错误日志</u>	
<u>0787</u>	<u>写数据库错误，请查看错误日志</u>	
<u>0788</u>	<u>数据操作失败，请查看系统日志</u>	
<u>0789</u>	<u>写交易申请流水失败</u>	
<u>0790</u>	<u>写账页失败</u>	
<u>0791</u>	<u>数据历史备份与清除失败</u>	
<u>0792</u>	<u>按申请编号检查申请数据错误</u>	
<u>0793</u>	<u>按基金状态检查申请数据错误</u>	
<u>0794</u>	<u>按申请数量检查申请数据错误</u>	
<u>0795</u>	<u>写确认流水错误</u>	
<u>0796</u>	<u>累计投资者认购金额错误</u>	
<u>0797</u>	<u>写认购队列错误</u>	
<u>0798</u>	<u>更改申请流水处理状态错误</u>	
<u>0799</u>	<u>系统错误</u>	
<u>9999</u>	<u>其它错误</u>	

第六章 上传数据

6.1. 期权市场参与者数据报送文件

文件名：cybsXXXXXXYYYYMMDD001

扩展名：txt

发布时间：每个交易日盘后 15:30(T 日)-16:30(T 日)市场参与者向交易所报送一次

报送渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXX 表示会员有效的席位号（PBU），一个市场参与者使用向本所申报指定的 PBU 报备所有客户资料数据。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期,在此表示下一个交易日。闭市后由市场参与者向交易所报备，包括可买入额度、资金等相关信息。报送日期记为 T 日，上一交易日记为 T-1 日。记录采用行格式，字段以分隔符 ‘|’ 来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

接口格式：

序号	字段名	字段描述	字段类型
1	参考数据类型	参考数据类型标识符，取值 A0302 表示期权账户资料信息，此处为唯一值	C5
2	当前交易日	YYYYMMDD，为当前交易日	C8
3	市场参与者代码	第 1 第 2 位为国家代码，如中国为 CH；第 3 位为地区代码， 如华东区为 4；第 4 第 5 位为省市代码，如上海为 SH；第 6 位为市场参与者类别，如证券公司为 S；第 7 位为固定值 T， 是保留字段,第 8 到第 12 位为该市场参与者公司的身份代码， 如 CH4SHST88128。	C12
4	市场参与者名称	市场参与者名称,可使用汉字 采用全称，如 “***证券股份有限公司”	C48
5	业务交易单元号	业务交易单元号	C5
6	营业部代码	营业部代码	C5
7	期权合约账户信息	期权合约账户	C10
8	期权合约子账户编号	固定值（暂定 888）	C3
9	沪市证券账户	沪市证券 A 股账户	C10
10	沪市 E 账户	沪市 E 账户	C10
11	衍生品资金账户保证金总额	T-1 日结算后数据，精确到分。衍生品资金账户保证金总额 为可用保证金和维持保证金等资金的总额，不含持仓市值。	N16（2）
12	沪市衍生品维持保证金金额	T-1 日结算后数据，市场参与者按照自身实际收取的沪市维 持保证金金额报送，精确到分	N16（2）
13	衍生品可用保证金金额	T-1 日结算后数据，衍生品可用保证金，精确到分	N16（2）
14	当日资金划入划出净额	T-1 日结算后数据，精确到分，为 T-1 日转账数据，正代表资 金划入， 负数代表资金划出	N16(2)
15	衍生品合约市值权益	T-1 日结算后数据，含沪深市场所有期权合约，按照 T-1 日合 约最新结算价计算，精确到分。	N16(2)

16	证券市值总额	T-1 日结算后数据,除港股通、B 股之外的所有沪深市场证券市值(含融券),持有证券按照 T-1 日收盘价计算,精确到分。	N16(2)
17	证券资金账户可用资金余额	T-1 日结算后数据,所有人民币资金(含融资),精确到分。	N16(2)
18	融资融券账户证券总市值	T-1 日结算后数据,含沪深市场,持有证券按 T-1 日收盘价计算,精确到分	N16(2)
19	融资融券账户资金总额	T-1 日结算后数据,精确到分	N16(2)
20	融资融券账户融入资金总额	T-1 日结算后数据,精确到分	N16(2)
21	融资融券账户融券总市值	T-1 日结算后数据,含沪深市场,持有证券按 T-1 日收盘价计算,精确到分	N16(2)
22	分级级别	根据 T-1 日数据情况填写,不得为空 自然人账户需填写 ‘1’表示一级, ‘2’表示二级, ‘3’表示三级。 非自然人账户需填写 ‘4’	C1
23	可买入额度	T-1 日结算后数据,个人投资者限购总金额额度(买入额度,包括已使用和未使用),精确到分	N16(2)

数据内容说明:

- 1、当日资金划入划出净额=当日总资金划入金额-当日总资金划出金额;多银行合并计算。
- 2、衍生品合约市值权益= $\sum$ (当日合约结算价*合约单位*权利仓张数)- $\sum$ (当日合约结算价*义务仓张数(含备兑)*合约单位)。按所持有合约汇总。单位元,保留两位小数。
- 3、自营账户无需报备。
- 4、衍生品账户当日开户的,应在当日清算完成后,于下一交易日起进行报送;当日销户的,应于下一交易日起停止报送。

6.2. 已开通科创板交易权限账户资产信息接口

文件名: kcbzhzcxxXXXXX001YYYYMMDD

扩展名: txt

发布时间: T+1 日 12:00 之前上传 T 日数据

报送渠道: ztDisk

证通云盘软件下载,相关文档可参考网页 <https://istock.ssetech.com.cn/wiki/doku.php?id=ssesystem:software:sdep>

证通云盘中接收该数据的用户为上交所用户 sse002(用户 sse001 是接收交易数据的,请勿报送给该用户)。本业务的业务标签是 kcbzhzcxx。请参考用户手册拟定自动上传任务或手动上传。

云盘“传输监控”界面可以查看文件报送结果。若自动化监控,可监控云盘 logs 目录下日志文件。

该业务目前仅限于交易专网上传,暂不开放互联网上传。

数据重传要求：

会员单位应当保证所报送数据格式、内容的准确性，当会员单位自行发现或收到本所反馈有漏报、误报情况的，需在 T+1 日上传时，将修正日重报的全量数据连同 T 日的全量数据放入一个文件中（文件名日期为 T 日，文件内容中的交易日字段分别填修正日及 T 日）。

文件说明：文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的交易日日期（T 日），XXXXXX 代表会员唯一码，由会员编号的后 5 位数字组成。

接口格式：

序号	字段名称	字段类型	描述
1	交易日	C8	YYYYMMDD，若发生修正、补充历史数据情况，应该放入修补历史当天的全量数据。
2	会员编号	C5	会员唯一码，由会员编号后五位数字组成
3	沪市证券账户	C10	填沪市普通账户股东代码，若该投资者只针对信用账户开立科创板权限而没有对普通账户开通权限，则本字段填空值。无论该投资者仅开通一个账户权限，还是两类账户权限都开通，下述序号 5~13 的指标都应该包括该投资者名下所有证券账户、资金账户的数值。
4	信用证券账户	C10	填沪市信用账户股东代码，若该投资者只针对普通账户开立科创板权限而没有对信用账户开通权限，则本字段填空值。无论该投资者仅开通一个账户权限，还是两类账户权限都开通，下述序号 5~13 的指标都应该包括该投资者名下所有证券账户、资金账户的数值。
5	证券资金账户资金总额	N18（2）	当前交易日收盘后数据，单位：元。填写证券资金账户总额+信用资金账户总额+衍生品资金账户总额。
6	应付资金	N18（2）	对于场内，包括因回购、质押等原因借入资金尚未归还的；融资买入后尚未归还的等。对于场外，若发生相应业务，也需计入。填正值。
7	应收资金	N18（2）	对于场内，包括因回购、质押等原因借出资金尚未归还的等。对于场外，若发生相应业务，也需计入。填正值。

<u>8</u>	<u>A 股及 CDR 市值总额</u>	<u>N18(2)</u>	<u>沪深两市数据；包括 A 股及 CDR 市值，包括限售及非限售部分；当前交易日结算后数据，单位：元</u>
<u>9</u>	<u>A 股及 CDR 应付余量市值</u>	<u>N18(2)</u>	<u>沪深两市数据；当前交易日结算后数据，单位：元。包括各类标的为 A 股及 CDR 融券余额、因约定购回式等原因证券暂存在本账户但不享有相关权益的证券市值等；填正值。</u>
<u>10</u>	<u>A 股及 CDR 应收余量市值</u>	<u>N18(2)</u>	<u>沪深两市数据；当前交易日结算后数据，单位：元；包括转融券出借方出借证券市值、因约定购回式等原因证券不在本账户但享有相关权益的证券市值等；填正值</u>
<u>11</u>	<u>其他证券公允价值</u>	<u>N18(2)</u>	<u>沪深两市场内产品及场外产品，单位：元。其中，场内产品包括沪深两市 B 股（人民币）、优先股、债券托管量、场内基金、期权权利方持仓市值、沪深交易所的港股通市值（人民币，包括在途部分市值）等；场外产品的公允价值也需统计入内。</u>
<u>12</u>	<u>其他证券应付余量公允价值</u>	<u>N18(2)</u>	<u>单位：元。对于场内，包括各类标的为其他证券的融券余额、因约定购回式等原因证券暂存在本账户但不享有相关权益的证券市值等；对于场外，若发生相应业务，也需计入；填正值。</u>
<u>13</u>	<u>其他证券应收余量公允价值</u>	<u>N18(2)</u>	<u>单位：元。对于场内，包括各类各类标的为其他证券的因回购入库、约定购回式等原因证券不在本账户但享有相关权益的证券市值等；对于场外，若发生相应业务，也需计入；填正值</u>

数据说明：

1. 账户筛选标准：T+1 日提供截至 T 日 16:00 前所有已开通科创板交易权限的全量账户，16:00 后开通权限的，在 T+2 日报送的 T+1 日数据中体现；若某个账户在 T 日 16:00 前关闭科创板交易权限，则 T 日的数据文件中不需要提供该账户数据，16:00 后关闭权限的，T 日的数据文件仍需提供该账户数据。
2. 资产范围：包含投资者所有的资产，包括沪深两市场内产品市值、场外产品公允价值、资金等。当涉及借贷业务时，应收部分、应付部分需单独列示。
3. 所报送的证券账户包括所有自然人、私募以及一般机构。其中一般机构指除会员自营账户、资管账户、基金账户、保险账户、社保账户、QFII 账户等专业机构账户以外的一般法人账户。
4. 对于场外产品的范围、资金、公允价值等统计口径，按会员针对科创板投资者适当性管理中，开户资格认定的标准进行统计。
5. 涉及到汇率的，使用 T 日外汇管理局人民币汇率中间价。

6. 一个投资者一条记录，股东代码需填写沪市股东代码。因特殊原因，一个投资者在同一家会员开通多个普通账户对科创板交易权限的，在本表中的序号 3 字段填入持有证券市值最大的一个普通账户代码即可；因特殊原因，一个投资者在同一家会员开通多个信用账户对科创板交易权限的，在本表中的序号 4 字段填入持有证券市值最大的一个信用账户代码即可；序号 5~13 的指标都应该包括该投资者名下所有证券账户、资金账户的数值。

第七章 后记

上海证券交易所对本文档享有知识产权，未经上海证券交易所书面许可，任何单位和个人不得将本文档用于其他商业目的。

本文档编写过程中，深受证券业界信息技术同仁讨论启发，特此致谢。对本文档有任何批评指正意见，可通过电子邮件或服务电话进行反馈。

电子邮件：tech_support@sse.com.cn

服务电话：400888400-2

网站地址：<https://www.sse.com.cn/> - 交易技术支持专区

通讯地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号 上交所技术公司技术开发总部

历史修订记录

版本号	日期	修订说明
2.30	2024-09	1、根据 UT 下线第三阶段安排，下线 UT 对于港股实时行情 <code>mkttdt04.txt</code> 、港股通交易盘实时状态行情 <code>trdses04.txt</code> 转发功能。 2、调整“基金通行情文件”数据长度、行情序号字段描述。
2.20	2024-07	1、调整重点指数表现文件 <code>zsbxYYMMDD.txt</code> ，新增上证收益（000888）产品。 2、修订债券行情文件 <code>mkttdt02.txt</code> ，更正 <code>MDTime</code> （行情时间）和 <code>Timestamp</code> （时间戳）描述。
2.10	2024-01	1、证通云盘增加发送债券盘中停牌公告文件 <code>ztxxxxhmmss.txt</code> 2、补充证通云盘已在发送的国债利息文件 <code>gzlx.MDD</code> 、标准券折算率变更文件 <code>zslMMDD.txt</code> 、标准券折算率变更公告文件 <code>zslwMMDD.txt</code> 、标准券折算比率文件 <code>xzslMMDD.txt</code> 、产品基础信息第二版第一批次 <code>cpxx0201MMDD.txt</code> 、产品基础信息第二版第二批次 <code>cpxx0202MMDD.txt</code> 相关描述。
2.00	2023-11	期权平台易神系统通用报盘软件（EzSTEP）下线，《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中文件接口说明迁移至本文档。
1.90	2023-10	调整“债券产品信息文件”接口： 1、“债券类型（15）”字段：新增枚举值“16”，表示新企业债券； 2、“发行人类型（19）”字段：调整枚举值描述； 3、“特殊债券类型（25）”字段：调整字段描述；
1.80	2023-07	1、增加行情网关作为基金通行情 <code>mkttdt06.txt</code> 的发送渠道； 2、补充上交所发送行情文件说明； 3、删除已下线 BT 软件相关文件获取渠道描述。
1.70	2023-05	新增单一股票担保物比例信息接口。
1.60	2022-08	1. 调整债券盘中停牌公告文件 <code>ztxxxxhmmss.txt</code> 的说明
1.50	2022-06	1. 更新债券产品信息文件 <code>bondinfoYYYYMMDD.txt</code> 部分字段说明； 2. 取消通过 UT 发送债券产品信息文件 <code>bondinfoYYYYMMDD.txt</code> ，新增通过 UT 发送债券产品信息文件压缩包 <code>archive_bondinfoYYYYMMDD.zip</code> ；

		3. 单向卫星应用系统相关服务已下线，去除 EzSR 及 SR 的文件接收途径相关描述。
1.40	2022-03	1. 调整债券行情文件、债券过户数据文件中债券相关数量单位为“千元面额”； 2. 调整债券盘中停牌公告文件，区分可转债和其他债券现券的停牌公告模板； 3. 新增债券产品信息文件接口； 4. 删除产品基础信息第一版第一批次文件接口 cpxxMMDD.txt、产品基础信息第一版第二批次文件接口 cpxx0102MMDD.txt； 5. 调整债券行情文件中市场行情状态的说明
1.30	2022-03	新增 B 转 H 业务相关文件：国际化产品信息文件、B 转 H 行情文件、国际化产品过户数据文件（字段名调整为中文描述）
1.20	2022-02	增加基金通业务接口：产品与销售机构对应关系文件、产品与做市商对应关系文件、基金通行情文件、份额过户文件（字段名调整为中文描述）
1.10	2021-12	补充“重点指数表现文件”的接口说明
1.00	2021-11	调整债券过户数据文件，合并债券非交易（质押式回购出入库）过户记录信息
0.91	2021-09	调整债券行情文件中行情时间字段的说明
0.90	2021-08	调整债券盘中停牌公告信息文件； 补充债券行情文件的文件说明以及成交金额字段说明
0.80	2021-03	调整交易申报错误码信息文件的发布渠道：移除 UT 发布渠道
0.70	2021-01	更新债券过户数据文件接口，将成交编号字段类型由 NX 型调整为 CX 型； 更新交易网关申报错误码信息文件接口（章节 2.9），将其变更为“交易申报错误码信息文件”
0.60	2020-12	新增交易网关申报错误码信息文件接口
0.50	2020-11	更新接口规范中十进制浮点数字型字段的说明
0.40	2020-09	更新债券过户数据文件接口
0.30	2020-08	在盘前参考数据章节中补充国债利息文件、标准券折算率变更文件、标准券折算率变更公告文件、标准券折算比率文件、产品基础信息文件（多版本多批次）的相关内容
0.20	2020-07	更新接口规范
0.10	2020-07	创建文档