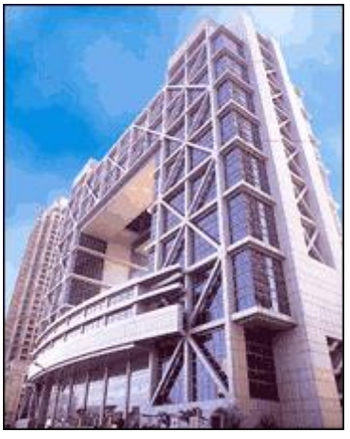
上海证券交易所

市场数据文件交换接口规格说明书



2022 年 02 月

文档修订记录

版本号	日期	修订说明
0.10	2020-07	创建文档
0.20	2020-07	更新接口规范
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
0.40	2020-09	更新债券过户数据文件接口
0.50	2020-11	更新接口规范中十进制浮点数字型字段的说明
0.60	2020-12	新增交易网关申报错误码信息文件接口
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”
0.80	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
0.90	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；
0.91	2021-09	调整债券行情文件中行情时间字段的说明
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
1.10	2021-12	补充“重点指数表现文件”的接口说明。
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）。

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. 国债利息文件 3
2.2. 标准券折算率变更文件 3
2.3. 标准券折算率变更公告文件 3
2.4. 标准券折算比率文件 4
2.5. 产品基础信息文件 4
2.6. 第一版第二批次产品基础信息文件 5
2.7. 第二版第一批次产品基础信息文件 5
2.8. 第二版第二批次产品基础信息文件 5
2.9. 交易申报错误码信息文件 6
2.10. 产品与销售机构对应关系文件 6
2.11. 产品与做市商对应关系文件 7
第三章 实时数据 8
3.1. 债券行情文件 8
3.2. 债券盘中停牌公告文件 11
3.3. 基金通行情文件 13
第四章 盘后数据 19
4.1. 债券过户数据文件 19
4.2. 重点指数表现文件 20
4.3. 份额过户文件 22
第五章 后记 23

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
UT 客户端	UT	基于单向卫星链路为用户提供行情数据接收以及文件接收等功能
BT 客户端	BT	基于本所地面传输链路为用户提供行情数据接收以及文件接收等功能
易神系统通用文件传输软件	EzTrans	为用户提供文件上传、报表下载以及 PBU 权限管理等功能
易神系统行情网关软件	MDGW	为用户提供 BINARY/STEP 行情接收功能
轻型化行情接收软件	EzSR	为用户提供多市场 FAST 行情数据接收以及单向卫星 SR 接口数据接收等功能
行情接收软件	SR	为用户提供单向卫星 SR 接口数据接收功能
会员订单管理系统	OMS	

1.3. 接口规范

本接口支持 txt、xml 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。

txt 格式数据文件均遵循以下约定：

（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。

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. 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：UT/BT/EzSR/SR

文件说明：该文件包含国债应计利息，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

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

2.2. 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：UT/BT/EzSR/SR

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，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

2.3. 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：UT/BT/EzSR/SR

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，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：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

2.4. 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：UT/BT/EzSR/SR

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，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

2.5. 产品基础信息文件

文件名：cpxxMMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT/BT/EzSR/SR

文件说明：该文件为产品的基础信息数据文件，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》中产品基础信息文件相关章节

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产品基础信息文件相关章节

2.6. 第一版第二批次产品基础信息文件

文件名：cpxx0102MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT/BT/EzSR/SR

文件说明：该文件为产品的基础信息数据文件，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》中第一版第二批次产品基础信息文件相关章节

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第一版第二批次产品基础信息文件相关章节

2.7. 第二版第一批次产品基础信息文件

文件名：cpxx0201MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT/BT/MDGW/EzSR/SR

文件说明：该文件为产品的基础信息数据文件，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》中第二版第一批次产品基础信息文件相关章节

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第二版第一批次产品基础信息文件相关章节

2.8. 第二版第二批次产品基础信息文件

文件名：cpxx0202MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT/BT/MDGW/EzSR/SR

文件说明：该文件为产品的基础信息数据文件，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》中第二版第二批次产品基础信息文件相关章节

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第二版第二批次产品基础信息文件相关章节

2.9. 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
<?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>
```

2.10. 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

2.11. 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	

第三章　实时数据

3.1. 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/UT

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）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	MDTime	交易所行情发送时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	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	‘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’表示债券现券行情结束标志，未结束取‘0’
第 5 位	‘1’表示债券质押回购行情结束标志，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.000	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，产品数量单位为手。

（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(也不包刮该字段后的换行符)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。

3.2. 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/UT

文件说明：该文件为债券盘中停牌公告文件，文件命中 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（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《上海证券交易所交易规则》和《上海证券交易所证券异常交易实时监控细则》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

（2）停牌公告模板二（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《上海证券交易所交易规则》和《上海证券交易所证券异常交易实时监控细则》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

3.3. 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： UT

文件说明：发送基金通行情文件

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 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	InvestorSel	投资者卖出最优	N15(2)	单位份

	lVolumeAtBestPrice	价数量		
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(也不包刮该字段后的换行符)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。

第四章　盘后数据

4.1. 债券过户数据文件

文件名：zqghXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk/UT

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手，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	N19(5)

		*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	
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’

4.2. 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/UT/EzSR

文件说明：该文件为重点指数[1]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 科创 50 :100 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	C6

[1] 重点指数包括：上证指数（000001）、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）。

4.3. 份额过户文件

文件名：ofghXXXXX

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 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。

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

第五章　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：021-4009003600

网站地址：http://www.sse.com.cn/，　参见交易技术支持专区