

上海证券交易所技术文档



**IS118 上海证券交易所特定参与者  
接口规格说明书（转发卷）  
1.3 版**



上海证券交易所

二〇二四年一月

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.3版 发布说明

2024年1月修订内容：

下线产品非交易基础数据报表 fjyMMDD.txt 接口。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.2版 发布说明

2023年10月修订内容：

- 1、 根据 UT 下线第一阶段安排，下线深交所静态文件转发功能；
- 2、 删除已下线的债券估值文件相关描述。
- 3、 根据 ETF 定义文件 2.0 版下线安排，删除 ETF 公告文件 1.0 版相关描述。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.1版 发布说明

2022年7月修订内容：

- 1、 配合 BT 下线，去除 BT 相关描述；
- 2、 根据目前 UT 发送内容进行修订。

## 《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.0版 发布说明

2016年9月修订内容：

- 1、 新建文档 IS118 上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）

2016年10月形成正式版本。

# 目录

|       |                       |   |
|-------|-----------------------|---|
| 1     | 简介 .....              | 1 |
| 1.1   | 本文的目的 .....           | 1 |
| 1.2   | 概要 .....              | 1 |
| 2     | 接口信息流 .....           | 2 |
| 2.1   | 上海市场 .....            | 2 |
| 2.1.1 | 基于文件的接口 .....         | 2 |
| 2.2   | 深圳市场 .....            | 5 |
| 2.2.1 | 深交所 V5 流式行情数据接口 ..... | 5 |
| 3     | 后记 .....              | 6 |

# 1 简介

上海证券交易所特定参与者接口规格说明书含多卷。

本文为上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）。

## 1.1 本文的目的

本文为用于描述向市场特定参与者转发行情等文件接口的功能和技术规格说明书。

本文包括以下部分：

第 1 部分：概述

即本节，这部分说明本文编写目的、概括介绍转发的数据接口类型。

第 2 部分：转发的文件数据接口

描述了行情类数据文件、公共类数据文件及私有数据文件结构及规格说明。

包括沪港通行行情数据文件接口等规范。

第 3 部分：转发的流式数据接口

概述了深圳 V5 行情数据接口等技术规范。

## 1.2 概要

本文用于描述本所转发（目前基于 UT 系统）文件和流式数据的接口规范。

UT（UniTransServer）业务分发平台系统是基于单向卫星链路的行情数据传输系统，支持多市场的数据转发，适配不同市场的协议实现数据的无缝对接。系统支持基于文件的接口方式和数据流的接口方式，文件类型分三种：行情类、公共文件类（文件公共广播）；私有文件类（文件点播）。数据流式支持深交所 V5-Binary 行情。

## 2 接口信息流

### 2.1 上海市场

#### 2.1.1 基于文件的接口

本章节用于描述 UT 系统转发上交所的基于文件接口的技术规格说明。

UT 系统相关接口读取的数据文件的来源有以下三种：上证所内各系统经卫星向市场发出的文件；交易系统发送至 UT 系统及自身业务处理的文件；新一代交易系统转发其他系统(信息公司)经由卫星发出的文件。

文件类型分三种（成交回报为私有消息，不属文件分类）：行情类、公共文件类（文件公共广播）、私有文件类（文件点播）。

| 文件名（中文）        | 文件名              | 参见接口   |
|----------------|------------------|--------|
| 行情类文件          |                  |        |
| 竞价撮合平台行情文件     | mktdt00.txt      | IS101  |
| 综合业务平台行情文件     | mktdt01.txt      | IS105  |
| 债券行情文件         | mktdt02.txt      | IS124  |
| 期权行情文件         | mktdt03.txt      | IS113  |
| 港股通行情文件        | mktdt04.txt      | IS117  |
| 港股通交易盘实时状态     | trdses04.txt     | IS117  |
| 指数通行情文件        | csiYYYYMMDD.txt  | 中证指数接口 |
| 基金通行情文件        | mktdt06.txt      | IS124  |
| B 转 H 行情文件     | mktdth.txt       | IS124  |
| 公共文件类          |                  |        |
| 交易公开信息公告文件     | jygekxMMDD.txt   | IS101  |
| 司法执行公告文件       | sf*****.pdf      | -      |
| 科创板交易公开信息公告文件  | jygekx02MMDD.txt | IS101  |
| 债券标准券折算率变更接口   | zslMMDD.txt      | IS101  |
| 债券标准券折算率变更公告文件 | zslwMMDD.txt     | IS101  |
| 基金和净值数据文件      | kxxMMDD.txt      | IS101  |

|                        |                               |                       |
|------------------------|-------------------------------|-----------------------|
| 权证信息接口                 | qzxxMMDD.txt                  | IS101                 |
| 债券标准券折算比率接口            | xzslMMDD.txt                  | IS101                 |
| 盘中停牌公告文件               | tpxxxxhhmms.txt               | IS101                 |
| 国债利息接口                 | gzlx.MDD                      | IS101                 |
| <del>产品非交易基础数据报表</del> | <del>fjyMMDD.txt</del>        | <del>IS101</del>      |
| 产品非交易基础数据              | fjyYYYYMMDD.txt               | IS101                 |
| 担保品及标的证券清单公告           | dbpMMDD.txt                   | IS101                 |
| 紧急通知文件                 | *.*                           | IS101                 |
| 公告摘要文件                 | MMDDFNND.txt<br>MMDDZNNND.txt | IS101                 |
| 产品基础信息文件第二版第一批次        | cpxx0201MMDD.txt              | IS101                 |
| 产品基础信息文件第二版第二批次        | cpxx0202MMDD.txt              | IS101                 |
| 基金业务参数公告文件             | sfpm01MMDD.txt                | IS105                 |
| 债券非交易基础信息文件            | zfjyYYYYMMDD.xml              | IS105                 |
| 基金非交易基础信息文件            | jfjyYYYYMMDD.xml              | IS105                 |
| 转融通标的证券清单              | zrtbdMMDD.txt                 | IS105                 |
| 债券报价式回购折算率文件           | bzsl01MMDD.txt                | IS105                 |
| 网络投票议案结构文件             | vtlsMMDD.xml                  | IS105                 |
| 报价收盘文件                 | bjspMMDD.txt                  | IS109                 |
| 成交明细文件                 | bjmxMMDD.txt                  | IS109<br>IS118（托管银行卷） |
| 报价全部文件                 | bjqbMMDD.txt                  | IS109                 |
| 期权基础信息文件               | reff03MMDD.txt                | IS113                 |
| 期权基础信息文件               | reff0302YYYYMMDD.xml          | IS113                 |
| 期权收盘价格文件               | clpr03MMDD.txt                | IS113                 |
| 期权组合策略文件               | zhcl03MMDD.txt                | IS113                 |
| 港股基础信息                 | reff04MMDD.txt                | IS117                 |
| 港股通参考汇率文件              | extra04MMDD.txt               | IS117                 |
| 港股最小价差文件               | zxjcMMDD.txt                  | IS117                 |

|                     |                              |                                |
|---------------------|------------------------------|--------------------------------|
| ETF 公告文件 2.1 版格式    | *****MMDD2.etf               | IS118 (基金公司卷)                  |
| 债券盘中停牌公告文件          | ztxxxhhmmss.txt              | IS124                          |
| 国际化产品信息接口           | ifjyYYYYMMDD.xml             | IS124                          |
| 重点指数及样本表现           | zsbxYYMMDD.txt               | IS124                          |
| 债券产品信息 (压缩包)        | archive_bondinfoYYYYMMDD.zip | IS124                          |
| 交易参与人清单             | se015jycyrYYYYMMDD001.txt    | LDDS 系统静态数据接口                  |
| 交易员清单               | se015jyyYYYYMMDD001.txt      | LDDS 系统静态数据接口                  |
| 私有文件类               |                              |                                |
| 过户数据接口              | ghXXXXXX.zip                 | IS101                          |
| 开放式基金分红数据接口         | khlXXXXXX.zip                | IS101                          |
| 开放式基金账户对账数据接口       | kyeXXXXXX.zip                | IS101                          |
| 开放式基金交易确认接口         | kghXXXXXX.zip                | IS101                          |
| 证券账户资料接口            | zzhXXXXXX.zip(月中数据)          | IS101                          |
| 席位联通接口              | zxwXXXXXX.zip(月中数据)          | IS101                          |
| 新股发行过户数据接口          | ipoghXXXXXX.zip              | IS101                          |
| 减持控制数据接口            | jckzXXXXXX.zip               | IS101                          |
| 过户数据接口              | dghXXXXXX.zip                | IS105                          |
| 基金过户数据接口            | jjghXXXXXX.zip               | IS105                          |
| 过户数据接口 <sup>1</sup> | oghXXXXXX.zip                | IS113                          |
| 债券过户数据文件            | zqghXXXXXX.zip               | IS124                          |
| 国际化产品过户数据文件         | ighXXXXXX.zip                | IS124                          |
| 过户数据接口              | hghXXXXXX.zip                | IS117                          |
| 托管银行和基金公司数据文件       | XXXX.sse                     | IS118 (基金公司卷)<br>IS118 (托管银行卷) |

参见接口：

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

<sup>1</sup> 上交所向市场发送的 oghXXXXXX.zip 文件中包含 trns03XXXXXX.txt、hold03xxxxx.txt、qtyw03XXXXXX.txt 三个文件，具体文件接口定义参照 IS113\_上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书。

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  
IS109\_上海证券交易所固定收益平台外部数据接口规范  
IS113\_上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书  
IS117\_上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书  
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）  
IS118\_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）  
IS124\_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书  
上海证券交易所 LDDS 系统静态数据接口说明书  
中证指数行情传输接口规范

## 2.2 深圳市场

### 2.2.1 深交所 V5 流式行情数据接口

具体格式请参见《深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范》。



### 3 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](mailto: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