

上海证券交易所
市场数据文件交换接口规格说明书
22.1400 版



二〇二四年一五八月

文档修订记录

| 版本号 | 日期 | 修订说明 |
|----------------------|--------------------------|--|
| 2.40 | 2024-058 | <p>1、添加了债券质押式三方回购参考信息文件</p> <p>2、调整了 xml 文件的格式约定说明，添加了各新增 xml 格式文件的示例</p> <p>3、修改证券产品基础信息文件：调整关于前收盘价部分的描述，调整部分标签的命名方式，统一了转股或换股期、回售期和回售撤销其标签字段说明，将证券细分类别字段调整为证券细分标签</p> <p>4、修改一债通收盘价文件更名为债券非匹配成交价文件并调整相关中成交收盘价字段的标签</p> <p>5、债券现券交易参考信息(非匹配成交)和债券质押式协议回购参考信息中增加了 <BasicBusRefInfo> 标签</p> <p>6、一债通成交汇总文件(针对债券交易参与者)中增加了申报来源、结算周期预留字段，买卖方向字段(B/S)调整为(1/2)，新增了三方回购相关成交内容的描述，调整了备注字段的填写说明，对于各类非交易取消成交编号字段</p> |
| 2.30 | 2024-01 | <p>证券产品基础信息文件 (products_yyyymmdd.xml) 中区分了资产支持证券优先档和次级档</p> |
| 2.20 | 2024-01 | <p>● 新增固收迁移相关盘前参考数据和盘后数据文件</p> <p>盘前参考数据：</p> <p>债券交易参与者信息文件 (bondmbrs_yyyymmdd.xml)</p> <p>债券交易员信息文件 (bondtrdrs_yyyymmdd.xml)</p> <p>证券产品基础信息文件 (products_yyyymmdd.xml)</p> <p>债券现券交易业务参考信息 (非匹配成交) (bondnegoparams_yyyymmdd.xml)</p> <p>债券质押式协议回购业务参考信息 (bilateralrepoparams_yyyymmdd.xml)</p> <p>盘后文件：</p> <p>一债通成交汇总文件(zghXXXXXX.txt)</p> <p>一债通收盘价文件(unibondclspx_yyyymmdd.xml)</p> <p>● 删除了原固收行情相关文件 (新固收行情接口参见《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》或《IS120_上海证券交易所行情网关 STEP 数据接</p> |

| | | |
|------|---------|--|
| | | <p><u>口规范》），包括：</u></p> <p><u>固定收益平台确定报价行情文件（se015qdbjyyyymmdd001.txt）</u></p> <p><u>固定收益平台成交行情文件（se015cjhqyyyymmdd001.txt）</u></p> <p><u>固定收益平台成交明细行情文件（se015cjmxyyyyymmdd001.txt）</u></p> <p><u>固定收益平台证券信息行情文件（se015zqxxyyyyymmdd001.txt）</u></p> |
| 2.10 | 2024-01 | <ol style="list-style-type: none"> 1、证通云盘增加发送债券盘中停牌公告文件 ztxxxxhmmss.txt 2、补充证通云盘已在发送的国债利息文件 gzlx.MDD、标准券折算率变更文件 zslMMDD.txt、标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt、标准券折算比率文件 xzslMMDD.txt、产品基础信息第二版第一批次 cpxx0201MMDD.txt、产品基础信息第二版第二批次 cpxx0202MMDD.txt 相关描述。 |
| 2.00 | 2023-11 | <p>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。</p> |
| 1.90 | 2023-10 | <p>调整“债券产品信息文件”接口：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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 | <ol style="list-style-type: none"> 1、增加行情网关作为基金通行情 mktDt06.txt 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 | <p>新增单一股票担保物比例信息接口。</p> |
| 1.60 | 2022-08 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 调整债券盘中停牌公告文件 ztxxxxhmmss.txt 的说明 |
| 1.50 | 2022-06 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 更新债券产品信息文件 bondinfoYYYYMMDD.txt 部分字段说明； 2. 取消通过 UT 发送债券产品信息文件 bondinfoYYYYMMDD.txt，新增通过 UT 发送债券产品信息文件压缩包 archive_bondinfoYYYYMMDD.zip； 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 | <ol style="list-style-type: none"> 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 |

| | | |
|------|---------|--|
| | | <p>第二批文件接口 <code>cpxx0102MMDD.txt</code>;</p> <p>5. 调整债券行情文件中市场行情状态的说明</p> |
| 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 | <p>调整债券盘中停牌公告信息文件；</p> <p>补充债券行情文件的文件说明以及成交金额字段说明</p> |
| 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 | <p>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；</p> <p>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”</p> |
| 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 |

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. 产品基础信息第二版第一批次 | 4 |
| 2.6. 产品基础信息第二版第二批 | 4 |
| 2.7. 交易申报错误码信息文件 | 5 |
| 2.8. 产品与销售机构对应关系文件 | 5 |
| 2.9. 产品与做市商对应关系文件 | 6 |
| 2.10. 国际化产品信息文件 | 6 |
| 2.11. 债券产品信息文件 | 7 |
| 2.12. 债券产品信息文件压缩包 | 15 |
| 2.13. 单一股票担保物比例信息 | 15 |
| 2.14. 期权基础信息文件 | 16 |
| 2.15. 期权基础信息第二版文件 | 20 |
| 2.16. 期权组合策略文件 | 23 |
| 2.17. 债券交易参与者信息文件 | 25 |
| 2.18. 债券交易员信息文件 | 25 |
| 2.19. 证券产品基础信息文件 | 26 |
| 2.20. 债券现券交易参考信息(非匹配成交) | 31 |
| 2.21. 债券质押式协议回购参考信息 | 33 |
| 2.22. 债券质押式三方回购参考信息 | 35 |
| 第三章 实时数据 | 38 |
| 3.1. 竞价撮合系统行情文件 | 38 |
| 3.2. 综合业务系统行情文件 | 38 |
| 3.3. 债券行情文件 | 38 |
| 3.4. 期权交易系统行情文件 | 42 |
| 3.5. 港股实时行情文件 | 47 |
| 3.6. 港股通交易盘实时状态行情文件 | 47 |
| 3.7. 竞价撮合系统盘中停牌公告文件 | 48 |
| 3.8. 债券盘中停牌公告文件 | 49 |
| 3.9. 基金通行情文件 | 51 |
| 3.10. B转H行情文件 | 56 |
| 3.11. 指数通行情文件 | 66 |

| | |
|-----------------------------------|-----------|
| 第四章 盘后数据 | 67 |
| 4.1. 债券过户数据文件..... | 67 |
| 4.2. 重点指数表现文件..... | 68 |
| 4.3. 份额过户文件..... | 70 |
| 4.4. 国际化产品过户数据文件..... | 71 |
| 4.5. 期权收盘价格文件..... | 71 |
| 4.6. 期权过户文件压缩包..... | 72 |
| 4.7. 期权成交过户数据文件..... | 72 |
| 4.8. 期权持仓余额对账文件..... | 76 |
| 4.9. 期权其他业务文件..... | 77 |
| 4.10. 期权市场参与者数据报送文件..... | 78 |
| 4.11. 期权结算价试算结果文件..... | 80 |
| 4.12. 债券非匹配成交参考价文件..... | 81 |
| 4.13. 债券非匹配成交汇总文件(针对债券交易参与者)..... | 82 |
| 4.14. 债券非匹配成交汇总文件(针对托管银行)..... | 85 |
| 第五章 后记 | 86 |

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 |
| 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 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；如涉及成交金额字段溢出，请使用该字段的市场参与者特殊处理，柜台系统应能识别并及时处理该字段

溢出异常，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；

- (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。

(9) 除特别说明，均采用 GB18030 编码。

其他补充约束参见字段具体描述。

xml 格式数据文件均遵循以下约定：

- (1) 如果某一字段为空或未启用，则该字段 xml 标签不应出现。
- (2) xml 版本每个字段为变长字段，字段不足最大长度左右两端无需补空。
- (3) 除特别说明，均为 UTF-8 编码。

第二章 盘前参考数据

2.1. 国债利息文件

文件名: gzlz

扩展名: MDD

发布时间: 开市前发布

发布渠道: UT、ztDisk

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、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, 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、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，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、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，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. 产品基础信息第二版第一批次

文件名：cpxx0201MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT、MDGW、ztDisk

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

2.6. 产品基础信息第二版第二批次

文件名：cpxx0202MMDD

扩展名：txt

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT、MDGW、ztDisk

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》中产品基础信息第二版第二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二批次文件接口相关章节

2.7. 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~~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>
```

2.8. 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 |

2.9. 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 | |

2.10. 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: UT、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 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期

编码规范: GBK18030 编码

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。

2.11. 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 | C2 |

| | | | |
|----|-----------|--|------|
| | | <p>9: 次级债券</p> <p>10: ABS</p> <p>11: 可交换债</p> <p>12: 政府支持机构债</p> <p>16: 新企业债券</p> | |
| 16 | 利率类型 | <p>取值如下:</p> <p>0: 固定利率</p> <p>1: 浮动利率</p> | C1 |
| 17 | 发行方式 | <p>取值如下:</p> <p>0: 大公募</p> <p>1: 小公募</p> <p>2: 私募</p> | C1 |
| 18 | 发行人/原始权益人 | | C200 |
| 19 | 发行人类型 | <p>取值如下:</p> <p>财政部</p> <p>地方政府</p> <p>农业发展银行</p> <p>国家开发银行</p> <p>进出口银行</p> <p>国有-中央</p> <p>国有-省级 (含直辖市)</p> <p>国有-市级</p> <p>国有-区县级</p> <p>国有-乡镇级</p> <p>民营企业</p> <p>外商独资</p> <p>中外合资</p> <p>全民所有制</p> <p>集体所有制</p> | C20 |

| | | | |
|----|------|--|-----|
| | | 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+ BB- BBB BBB+ BBB- C C+ C- CC CC+ CC- CCC CCC+ CCC- O | C50 |

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

| | | | |
|----|----------|---|--------|
| | | O 代表“无评级” | |
| 22 | 评级机构 | <p>取值如下：</p> <p>ZCXGJ：中诚信国际信用评级有限公司</p> <p>DGGJ：大公国际资信评估有限公司</p> <p>PYZX：中证鹏元资信评估股份有限公司</p> <p>SHXSJZX：上海新世纪资信评估投资服务有限公司</p> <p>SHYDZX：远东资信评估有限公司</p> <p>DFJCGJ：东方金诚国际信用评级有限公司</p> <p>LHZX：联合信用评级有限公司</p> <p>LHZXPG：联合资信评估有限公司</p> <p>BPXY：标普信用评级（中国）有限公司</p> <p>OTHER：其他</p> <p>NONE：无</p> | C100 |
| 23 | 是否本所上市公司 | <p>取值如下：</p> <p>N：否</p> <p>Y：是</p> | C1 |
| 24 | 发行量（亿元） | | N19(5) |
| 25 | 特殊债券类型 | <p>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：</p> <p>第 1 位：永续期债券</p> <p>第 2 位：绿色债券</p> <p>第 3 位：熊猫债券</p> <p>第 4 位：一带一路债券</p> <p>第 5 位：创新创业债券</p> <p>第 6 位：证券公司短期债券</p> <p>第 7 位：证券公司次级债券</p> <p>第 8 位：项目收益债券</p> <p>第 9 位：全民所有制企业债券</p> <p>第 10 位：社会责任债券</p> | C20 |

| | | | |
|----|------------|---|------|
| | | <p>第 11 位：纾困债</p> <p>第 12 位：短期公司债券</p> <p>第 13 位：乡村振兴债券</p> <p>第 14 位：科技创新债券</p> <p>第 15 位：低碳转型债券</p> <p>第 16 位：中小微企业支持债券</p> <p>第 17~20 位：预留备用</p> | |
| 26 | 结构化分档 | <p>取值如下：</p> <p>0：优先档</p> <p>1：次级档</p> | C1 |
| 27 | 资产支持专项计划名称 | | C100 |
| 28 | 交易方式 | <p>取值如下：</p> <p>PPCJ：匹配成交</p> <p>DJCJ：点击成交</p> <p>XJCJ：询价成交</p> <p>JMCJ：竞买成交</p> <p>XSCJ：协商成交</p> <p>多个取值使用英文半角符号“,”进行分割</p> | C50 |
| 29 | 结算方式 | <p>取值如下：</p> <p>JEJS：净额结算</p> <p>RTGS：RTGS</p> <p>多个取值使用英文半角符号“,”进行分割</p> | C50 |
| 30 | 价格方式 | <p>取值如下：</p> <p>0：净价</p> <p>1：全价</p> | C1 |
| 31 | 投资者适当性要求 | <p>取值如下：</p> <p>00：普通投资者</p> <p>02：专业投资者</p> | C2 |

| | | | |
|----|------------|---|--------|
| | | 04: 专业机构投资者 | |
| 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 KXQZCDJ: 永续期债重定价 多个取值使用英文半角符号“,”进行分割 | C50 |
| 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 |

2.12. 债券产品信息文件压缩包

文件名：archive_bondinfoYYYYMMDD

扩展名：zip

发布时间：开市前发布

发布渠道：UT

文件说明：该文件为债券产品信息文件（bondinfoYYYYMMDD.txt）压缩包版本，解压后内容上与债券产品信息文件一致。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的日期

接口格式：解压后与债券产品信息文件（bondinfoYYYYMMDD.txt）一致

2.13. 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。 |

2.14. 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：UT、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, YYYMMDD | C8 |
| 13 | 最后交易日 | 期权最后交易日/行权日, YYYMMDD | C8 |
| 14 | 期权行权日 | 期权行权日, YYYMMDD | 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, YYYMMDD | C8 |
| 16 | 期权到期日 | 期权到期日, YYYMMDD | 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 | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>第 2 位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填 0）</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>第 5 位：‘A’表示当日新挂牌的合约，‘E’表示存续的合约</p> <p>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。</p> | 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 |

2.15. 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：UT、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~~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。~~

编码规范：GBK 编码

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 | RFFStreamID | 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 | ContractMulti | 合约单位 | 经过除权除息调整后的合约单位 | N11 |

| | | | | |
|----|---------------------|----------|---|--------|
| | plierUnit | | | |
| 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 | SettlePrice | 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 | MarginRatioParameter1 | 保证金计算比例参数一 | 保证金计算参数，单位：% | N6(2) |
| 27 | MarginRatioParameter2 | 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 | <p>左起每位表示特定的含义。</p> <p>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。</p> <p>第 2 位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填 0）</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>第 5 位：‘A’表示当日新挂牌的合约，‘E’表示存续的合约</p> | C8 |

| | | | | |
|----|--------------------|----------------|--|-----|
| | | | 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。 | |
| 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 |

2.16. 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: UT、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 | C32 |

| | | | | |
|------|--------|-----------------|---|-----|
| | | | 宽跨式空头 认购期权普通卖出开仓转备兑开仓 | |
| 3 | 组合策略编码 | | 目前为 7 种组合策略： CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、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 |

2.17. 债券交易参与者信息文件

文件名: bondmbrs_yyyymmdd

扩展名: xml

发布时间: 开市前发布

发布渠道: ztDisk

文件说明: 文件名中 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期。

接口格式:

| 字段名称 | 英文名 | 长度 | 是否必填 | 字段描述 |
|--------|------------------|-------------|----------|------|
| 证券机构代码 | <u>MemberID</u> | <u>C12</u> | <u>Y</u> | |
| 机构简称 | <u>ShortName</u> | <u>C40</u> | <u>Y</u> | |
| 机构名称 | <u>LongName</u> | <u>C200</u> | <u>Y</u> | |

示例:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BondMbrs>
  <BondMbr>
    <MemberID>CH4SHZT12345</MemberID>
    <ShortName>测试机构</ShortName>
    <LongName>测试示例机构</LongName>
  </BondMbr>
</BondMbrs>
```

2.18. 债券交易员信息文件

文件名: bondtrdrs_yyyymmdd

扩展名: xml

发布时间: 开市前发布

发布渠道: ztDisk

文件说明: 文件名中 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期。

接口格式:

| 名称 | 英文名 | 长度 | 是否必填 | 字段描述 |
|----------|-------------------|------------|----------|------|
| 交易员一债通账户 | <u>TraderCode</u> | <u>C10</u> | <u>Y</u> | |

| | | | | |
|----------|------------|------|---|--|
| 交易员姓名 | TraderName | C100 | Y | |
| 所属证券机构代码 | MemberID | C12 | Y | |
| 联系人电话号码 | Contact | C40 | N | |

示例：

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BondTrdrs>
  <BondTrdr>
    <TraderCode>i021234501</TraderCode>
    <TraderName>交易员 1</TraderName>
    <MemberID>CH4SHZT12345</MemberID>
  </BondTrdr>
  <BondTrdr>
    <TraderCode>i021234502</TraderCode>
    <TraderName>交易员 2</TraderName>
    <MemberID>CH4SHZT12345</MemberID>
    <Contact>01012345678</Contact>
  </BondTrdr>
</BondTrdrs>
    
```

2.19. 证券产品基础信息文件

文件名：products_yyyymmdd

扩展名：xml

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 yyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期，该信息以 XML+xml 文件的形式在闭市后发布，一只证券对应 xml 中的一条记录。首批上线支持原固收交易平台各类产品。

接口格式：

| | 字段名称 | 字段英文名 | 类型 | 必填 | 说明 |
|------------------------|---------|---------------|-----|----|-------------|
| 所有产 品都包 含的字 段 | 证券代码 | SecurityID | C12 | Y | 证券代码 |
| | 证券代码源 | SecurityIDSrc | C4 | Y | 101=上海证券交易所 |
| | ISIN 代码 | ISIN | C12 | N | 预留，暂不启用 |
| | 证券简称 | Symbol | C40 | Y | 中文证券名称 |
| | 扩位简称 | LongName | C60 | Y | |

| | | | | |
|------------|--------------------------------|---------------|----------|---|
| 基础证券代码 | <u>UnderlyingSecurityID</u> | <u>C12</u> | <u>N</u> | 当产品为可转债、可交换债等衍生品时,该字段为其标的产品的证券代码。 |
| 基础证券代码源 | <u>UnderlyingSecurityIDSrc</u> | <u>C4</u> | <u>N</u> | 101=上海证券交易所 |
| 证券类别 | <u>SecType</u> | <u>C6</u> | <u>Y</u> | 填写说明参见附表 |
| 证券子类别 | <u>SecSubType</u> | <u>C3</u> | <u>Y</u> | 填写说明参见附表 |
| 证券细分标签 | <u>SecSegTag</u> | <u>C4</u> | <u>N</u> | 仅对部分产品生效,填写说明参见附表 |
| 面值(元) | <u>ParValue</u> | <u>N15(5)</u> | <u>Y</u> | 暂仅对债券产品生效,其他产品填‘0.00000’ |
| 融资标的标志 | <u>CrdBuyUnderlying</u> | <u>C1</u> | <u>Y</u> | Y= 是 N= 否 |
| 融券标的标志 | <u>CrdSellUnderlying</u> | <u>C1</u> | <u>Y</u> | Y= 是 N= 否 |
| 支持当日回转交易标志 | <u>DayTrading</u> | <u>C1</u> | <u>Y</u> | Y= 是 N= 否 |
| 货币类型标签 | <u>Currency</u> | <u>C3</u> | <u>Y</u> | 货币代码取值(参考ISO4217): USD= 美元 CNY= 人民币 |
| 除息金额 | <u>ExDividend</u> | <u>N15(5)</u> | <u>N</u> | 对于股票,表示每股分红金额;对于基金表示每份除息金额;对于债券,表示每百元面额除息金额 |
| 前收盘价格 | <u>PrevClosePx</u> | <u>N15(5)</u> | <u>N</u> | 此价格暂已经过除权除息调整 |
| 上市日期 | <u>ListDate</u> | <u>C8</u> | <u>Y</u> | YYYYMMDD |
| 投资者适当性管理标志 | <u>QualiFlag</u> | <u>C1</u> | <u>N</u> | 是否需要对该证券作投资者适当性管理 Y= 是 N= 否 |

| | | | | | |
|---|---------------|---------------|----|----|--|
| | 投资者适当性管理标签 | QualiClass | C1 | N | <u>投资者适当性管理分类</u> 1 = 投资者适当性要求类 2 = 机构投资者适当性要求类 |
| | 证券状态 | SecStatus | | | 每只证券可以有 0 个或多个状态， 如为 0 个状态，则无此标签 |
| | → 状态 | Status | C2 | N | 1 = 上市首日 2 = 除息 3 = 除权（预留） 4 = 特定债券或特定资产支持证券转让 5 = 交易停牌 |
| 以下为债券产品特有字段（BondParams） （相关证券子类别：GBF、CBF、CPF、CCF、OLF、ABS、BBS、CBS） | | | | | |
| 债券产品特有 字段 | 最后交易日期（到期登记日） | LastDate | C8 | Y | YYYYMMDD |
| | 到期日期 | MaturityDate | C8 | Y | YYYYMMDD |
| | 计价方式 | PxType | C1 | Y | 0 = 净价 1 = 全价 |
| | 非担保债券标签 | NOGuarantFlag | C1 | Y | Y = 是 N = 否 |
| | 转股或换股期标签 | SwapFlag | C1 | N | N = 未处于对应时段，不支持相关申报 1 = 互联网交易平台支持 2 = 综合业务系统支持（预留） 3 = 互联网交易平台和综合业务平台均支持（预留） |
| | 回售期标签 | PutbackFlag | C1 | YN | N = 未处于对应时段，不支持相关申报 1 = 互联网交易平台支持 |

| | | | | | |
|--|-------------------------|--------------------------|---------------|-----------|---|
| | | | | | <u>2 = 综合业务系统支持（预留）</u> <u>3 = 互联网交易平台和综合业务系统均支持（预留）</u> |
| | <u>回售撤销期标签</u> | <u>PutbackCancelFlag</u> | <u>C1</u> | <u>N¥</u> | <u>N = 未处于对应时段，不支持相关申报</u> <u>1 = 互联网交易平台支持</u> <u>2 = 综合业务系统支持（预留）</u> <u>3 = 互联网交易平台和综合业务系统均支持（预留）</u> |
| | <u>前协商成交收盘价非匹配成交收盘价</u> | <u>PrevNegoClsPx</u> | <u>N15(5)</u> | <u>N</u> | <u>此价格仅计入非匹配成交部分（包含点击成交、协商成交、询价成交和竞买成交）且经过除权除息</u> |
| | <u>前加权平均价格</u> | <u>PrevAvgPx</u> | <u>N15(5)</u> | <u>N</u> | <u>此价格仅计入非匹配成交部分（包含点击成交、协商成交、询价成交和竞买成交）且经过除权除息</u> |

说明：

1. 对于基础证券代码，暂只在双边挂牌的可转债或可交换债在转股或换股期开始后提供
2. 证券类别（SecType）、证券子类别（SecSubType）和证券细分标签（SecSegTag）填写说明

| <u>SecType</u> | <u>说明</u> | <u>SecSubType</u> | <u>SecSegTag</u> | <u>产品说明</u> |
|----------------|-----------|-------------------|------------------|--------------------------------|
| <u>D</u> | <u>债券</u> | <u>GBF</u> | <u>/</u> | <u>国债、地方债、政府支持债、政策性金融债</u> |
| | | <u>CBF</u> | <u>/</u> | <u>企业债（不含政府支持债）</u> |
| | | <u>CPF</u> | <u>/</u> | <u>公司债、企业债（不含政府支持债）、公募可交换债</u> |
| | | <u>CCF</u> | <u>/</u> | <u>主板公募可转债</u> |
| | | | <u>B010</u> | <u>科创板公募可转债</u> |
| | | <u>OLF</u> | <u>/</u> | <u>私募债</u> |
| | | <u>ABS</u> | <u>/</u> | <u>资产支持证券优先级</u> |

| | | | | |
|-----------|---------------------|------------|-------------|---------------------------|
| | | <u>BBS</u> | <u>/</u> | <u>资产支持证券次级</u> |
| | | <u>CBS</u> | <u>/</u> | <u>信贷资产支持证券</u> |
| <u>L</u> | <u>融资类产 品</u> | <u>ARP</u> | <u>/</u> | <u>债券质押式协议回购</u> |
| | | <u>TRP</u> | <u>/</u> | <u>债券质押式三方回购</u> |
| <u>SC</u> | <u>风险管理 类产品</u> | <u>CDS</u> | <u>/</u> | <u>信用保护合约 (CDS 合约)</u> |
| | | <u>CDX</u> | <u>/</u> | <u>组合式信用保护合约 (CDX 合约)</u> |
| | | <u>CDW</u> | <u>/</u> | <u>信用保护凭证</u> |
| <u>CB</u> | <u>公募 REITs</u> | <u>RET</u> | <u>/</u> | <u>公募 REITs</u> |
| <u>EU</u> | <u>基金</u> | <u>EBS</u> | <u>F121</u> | <u>单市场债券 (沪) ETF</u> |
| | | | <u>F122</u> | <u>跨市场债券 (沪深) ETF</u> |
| | | | <u>F123</u> | <u>现金申赎类债券 ETF</u> |

3. 对于证券子类别为 GBF、CBF、CPF、CCF、RET、EBS 的产品，其前收盘价填写匹配成交的收盘价；证券子类别为 OLF、ABS、BBS、CBS、ARP、TRP、CDW 的产品，其前收盘价填写前协商成交收盘价非匹配成交收盘价；对于 CDS、CDX、~~CDW~~ 产品无此字段。

4. 对于证券子类别为公募可转债 (CCF) 产品，债券特有字段中，无协商成交收盘价非匹配成交收盘价和加权平均价格。

5. 投资者适当性管理标志及投资者适当性管理标签初期仅适用于债券产品、融资类产品和风险管理类产品。

6. 证券状态字段如为停牌，此状态因场务操作或其他原因可能变更，实际以实时行情状态为准。对于双边挂牌产品，此处指新债券交易系统或竞价撮合系统挂牌产品处于停牌。

7. 最后交易日期 (到期登记日) 表示在此日 (含) 前的最后一个 A 股交易日，债券可以交易，日终将进行摘牌处理。

示例：

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Products>
  <Product>
    <SecurityID>123456</SecurityID>
    <SecurityIDSource>101</SecurityIDSource>
```

```
<Symbol>示例转债</Symbol>
<LongName>示例转债</LongName>
<SecType>D</SecType>
<SecSubType>CCF</SecSubType>
<SecSegTag>B010</SecSegTag>
<ParValue>100.00000</ParValue>
<CrdBuyUnderlying>Y</CrdBuyUnderlying>
<CrdSellUnderlying>Y</CrdSellUnderlying>
<DayTrading>N</DayTrading>
<Currency>CNY</Currency>
<ExDividend>1.00000</ExDividend>
<PrevClosePx>123.45600</PrevClosePx>
<ListDate>20190329</ListDate>
<QualiFlag>Y</QualiFlag>
<QualiClass>1</QualiClass>
<SecStatus>
  <Status>2</Status>
</SecStatus>
<BondParams>
  <LastDate>20250424</LastDate>
  <MaturityDate>20250425</MaturityDate>
  <PxType>1</PxType>
  <NOGuarantFlag>Y</NOGuarantFlag>
  <SwapFlag>1</SwapFlag>
  <PutbackFlag>1</PutbackFlag>
  <PutbackCancelFlag>1</PutbackCancelFlag>
  <PrevNegoClsPx>121.86000</PrevNegoClsPx>
  <PrevAvgPx>121.86000</PrevAvgPx>
</BondParams>
</Product>
</Products>
```

2.20. 债券现券交易参考信息(非匹配成交)

文件名: bondnegoparams_yymmdd

扩展名: xml

发布时间: 开市前发布

发布渠道: ztDisk

文件说明: 文件名中 yyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期, 该信息以 XMLxml 文件的形式在闭市后发布,

一只证券对应 xml 中的一条记录。

接口格式：

| 字段名称 | 字段英文名 | 类型 | 必填 | 说明 |
|----------------|-------------------|--------|----|--------------------------------------|
| 基础业务参考信息 | BasicBusRefInfo | | | |
| 证券代码 | SecurityID | C12 | Y | |
| 证券代码源 | SecurityIDSource | C4 | Y | 101=上海证券交易所 |
| 交易参数列表 | TradingParams | | | |
| → 交易参数信息 | TradingParam | | | |
| → → 交易方式 | TradingType | N2 | Y | 2=协商成交 3=点击成交 4=询价成交 5=竞买成交 |
| → → 开盘时间 | OpenTime | C6 | Y | HHMMSS |
| → → 收盘时间 | CloseTime | C6 | Y | HHMMSS |
| → → 申买数量下限 | BuyQtyLowerLimit | N17(3) | Y | 最小买申报数量 |
| → → 申买数量最小变动单位 | BuyQtyUnit | N17(3) | Y | 买申报数量需要为该单位的整数倍 |
| → → 申买数量上限 | BuyQtyUpperLimit | N17(3) | Y | 最大买申报数量 |
| → → 申卖数量下限 | SellQtyLowerLimit | N17(3) | Y | 最小卖申报数量 |
| → → 申卖数量最小变动单位 | SellQtyUnit | N17(3) | Y | 卖申报数量需要为该单位的整数倍 |
| → → 申卖数量上限 | SellQtyUpperLimit | N17(3) | Y | 最大卖申报数量 |
| → → 成交金额最小变动单位 | AmtUnit | N20(5) | N | 申报或成交的金额应当为该单位的整数倍 |
| → → 成交金额下限 | AmtLowerLimit | N20(5) | N | 最小申报或成交的金额 |
| → → 最大订单价格 | PriceUpperLimit | N15(5) | Y | 当日允许申报的最高价格 |
| → → 最小订单价格 | PriceLowerLimit | N15(5) | Y | 当日允许申报的最低价格 |
| → → 价格最小变动单位 | PriceTick | N15(5) | Y | 申报价格的最小变动单位 |

说明：

1. 本文件包含了参与债券现券非匹配成交（包含协商成交、点击成交、询价成交和竞买成交）相关产品的交易业务参考信息，包括证券子类型为 GBF、CBF、CPF、CCF、OLF、ABS、BBS、CBS、CDW、RET 的相关产品；
2. 对于价格：单位为元；
3. 对于数量：如为债券现券，单位为千元面额；如为公募 REITs，单位为份；
4. 对于成交金额：仅对 CDW（信用保护凭证）生效，表示名义本金，单位为万元

示例：

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BondNegoParams>
  <BondNegoParam>
    <BasicBusRefInfo>
      <SecurityID>示例代码</SecurityID>
      <SecurityIDSource>101</SecurityIDSource>
    <TradingParams>
      <TradingParam>
        <TradingType>2</TradingType>
        <OpenTime>150000</OpenTime>
        <CloseTime>153000</CloseTime>
        <BuyQtyLowerLimit>1000.000</BuyQtyLowerLimit>
        <BuyQtyUnit>1.000</BuyQtyUnit>
        <BuyQtyUpperLimit>10000000.000</BuyQtyUpperLimit>
        <SellQtyLowerLimit>1000.000</SellQtyLowerLimit>
        <SellQtyUnit>1.000</SellQtyUnit>
        <SellQtyUpperLimit>10000000.000</SellQtyUpperLimit>
        <PriceUpperLimit>120.00000</PriceUpperLimit>
        <PriceLowerLimit>80.00000</PriceLowerLimit>
        <PriceTick>0.00100</PriceTick>
      </TradingParam>
    </TradingParams>
  </BasicBusRefInfo>
</BondNegoParam>
</BondNegoParams>
```

2.21. 债券质押式协议回购参考信息

文件名：bilateralrepoparams_yyymmdd

扩展名：xml

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 yyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期，该信息以 XMLxml 文件的形式在闭市后发布，一只证券对应 xml 中的一条记录。

接口格式：

| 字段名称 | 字段英文名 | 类型 | 必填 | 说明 |
|------------|-------------------|--------|----|--------------------|
| 基础业务参考信息 | BasicBusRefInfo | | | |
| 证券代码 | SecurityID | C12 | Y | |
| 证券代码源 | SecurityIDSource | C4 | Y | 101=上海证券交易所 |
| 开盘时间 | OpenTime | C6 | Y | HHMMSS |
| 收盘时间 | CloseTime | C6 | Y | HHMMSS |
| 申买数量下限 | BuyQtyLowerLimit | N17(3) | Y | 最小买申报数量 |
| 申买数量最小变动单位 | BuyQtyUnit | N17(3) | Y | 买申报数量需要为该单位的整数倍 |
| 申买数量上限 | BuyQtyUpperLimit | N17(3) | Y | 最大买申报数量 |
| 申卖数量下限 | SellQtyLowerLimit | N17(3) | Y | 最小卖申报数量 |
| 申卖数量最小变动单位 | SellQtyUnit | N17(3) | Y | 卖申报数量需要为该单位的整数倍 |
| 申卖数量上限 | SellQtyUpperLimit | N17(3) | Y | 最大卖申报数量 |
| 成交金额最小变动单位 | AmtUnit | N20(5) | Y | 申报或成交的金额应当为该单位的整数倍 |
| 成交金额下限 | AmtLowerLimit | N20(5) | Y | 最小申报或成交的金额 |
| 最大订单价格 | PriceUpperLimit | N15(5) | Y | 当日允许申报的最高价格 |
| 最小订单价格 | PriceLowerLimit | N15(5) | Y | 当日允许申报的最低价格 |
| 价格最小变动单位 | PriceTick | N15(5) | Y | 申报价格的最小变动单位 |

说明：

1. 对于价格：表示回购利率，单位为%；

2. 对于数量：表示单只质押券的数量。；如质押券为债券现券，单位为千元面额；如为公募 REITs 或基金，单位为份；

3. 对于成交金额：单位为元。

示例：

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BilateralRepoParams>
  <BilateralRepoParam>
    <BasicBusRefInfo>
      <SecurityID>206001</SecurityID>
      <SecurityIDSource>101</SecurityIDSource>
      <OpenTime>090000</OpenTime>
      <CloseTime>153000</CloseTime>
      <BuyQtyLowerLimit>1.000</BuyQtyLowerLimit>
      <BuyQtyUnit>1.000</BuyQtyUnit>
      <BuyQtyUpperLimit>10000000.000</BuyQtyUpperLimit>
      <SellQtyLowerLimit>1.000</SellQtyLowerLimit>
      <SellQtyUnit>1.000</SellQtyUnit>
      <SellQtyUpperLimit>10000000.000</SellQtyUpperLimit>
      <AmtUnit>0.01000</AmtUnit>
      <AmtLowerLimit>0.01000</AmtLowerLimit>
      <PriceUpperLimit>100.00000</PriceUpperLimit>
      <PriceLowerLimit>0.00100</PriceLowerLimit>
      <PriceTick>0.00100</PriceTick>
    </BasicBusRefInfo>
  </BilateralRepoParam>
</BilateralRepoParams>
```

2.22. 债券质押式三方回购参考信息

文件名：trirepoparams_yymmdd

扩展名：xml

发布时间：开市前发布

发布渠道：ztDisk

文件说明：文件名中 yymmdd 表示年月日格式的文件适用日期，该信息以 xml 文件的形式在闭市后发布，一只证券对应 xml 中的一条记录。

接口格式:

| 字段名名称 | 字段英文名 | 字段类型 | 必填 | 说明 |
|------------|--------------------------|---------------|----------|---|
| 基础业务参考信息 | <u>BasicBusRefInfo</u> | | | |
| 证券代码 | <u>SecurityID</u> | <u>C12</u> | <u>Y</u> | |
| 证券代码源 | <u>SecurityIDSource</u> | <u>C4</u> | <u>Y</u> | <u>101=上海证券交易所</u> |
| 开盘时间 | <u>OpenTime</u> | <u>C6</u> | <u>Y</u> | <u>HHMMSS</u> |
| 收盘时间 | <u>CloseTime</u> | <u>C6</u> | <u>Y</u> | <u>HHMMSS</u> |
| 申买数量下限 | <u>BuyQtyLowerLimit</u> | <u>N17(3)</u> | <u>Y</u> | <u>最小买申报数量</u> |
| 申买数量最小变动单位 | <u>BuyQtyUnit</u> | <u>N17(3)</u> | <u>Y</u> | <u>买申报数量需要为该单位的整数倍</u> |
| 申买数量上限 | <u>BuyQtyUpperLimit</u> | <u>N17(3)</u> | <u>Y</u> | <u>最大买申报数量</u> |
| 申卖数量下限 | <u>SellQtyLowerLimit</u> | <u>N17(3)</u> | <u>Y</u> | <u>最小卖申报数量</u> |
| 申卖数量最小变动单位 | <u>SellQtyUnit</u> | <u>N17(3)</u> | <u>Y</u> | <u>卖申报数量需要为该单位的整数倍</u> |
| 申卖数量上限 | <u>SellQtyUpperLimit</u> | <u>N17(3)</u> | <u>Y</u> | <u>最大卖申报数量</u> |
| 成交金额最小变动单位 | <u>AmtUnit</u> | <u>N20(5)</u> | <u>Y</u> | <u>申报或成交的金额应当为该单位的整数倍</u> |
| 成交金额下限 | <u>AmtLowerLimit</u> | <u>N20(5)</u> | <u>Y</u> | <u>最小申报或成交的金额</u> |
| 最大订单价格 | <u>PriceUpperLimit</u> | <u>N15(5)</u> | <u>Y</u> | <u>当日允许申报的最高价格</u> |
| 最小订单价格 | <u>PriceLowerLimit</u> | <u>N15(5)</u> | <u>Y</u> | <u>当日允许申报的最低价格</u> |
| 价格最小变动单位 | <u>PriceTick</u> | <u>N15(5)</u> | <u>Y</u> | <u>申报价格的最小变动单位</u> |
| 三方回购篮子信息 | <u>BasketInfo</u> | | | |
| 篮子编码 | <u>BasketID</u> | <u>C4</u> | <u>Y</u> | <u>第 1 到第 N 号篮子, 其中:</u> <u>B001 = 利率债</u> <u>B002 = AAA (公)</u> <u>B003 = AA+ (公)</u> <u>B004 = AA (公)</u> <u>B005 = AAA (私)</u> <u>B006 = AA+ (私)</u> <u>B007 = AA (私)</u> |

| | | | | |
|------------------|----------------------|---------------|----------|--------------------|
| | | | | <u>B008 = 其他</u> |
| <u>篮子简称</u> | <u>Name</u> | <u>C40</u> | <u>Y</u> | |
| <u>篮子折扣率 (%)</u> | <u>Ratio</u> | <u>N10(3)</u> | <u>Y</u> | |
| <u>债券清单列表</u> | <u>SecurityList</u> | | | |
| <u>→ 证券代码</u> | <u>SecurityID</u> | <u>C12</u> | <u>Y</u> | |
| <u>→ 证券代码源</u> | <u>SecurityIDSrc</u> | <u>C4</u> | <u>Y</u> | <u>101=上海证券交易所</u> |

说明：

1. 对于价格：表示回购利率，单位为%；
2. 对于数量：表示质押券数量，如质押券为债券现券，单位为千元面额；
3. 对于成交金额：单位为万元。

示例：

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<TriRepoParams>
  <TriRepoParam>
    <BasicBusRefInfo>
      <SecurityID>207001</SecurityID>
      <SecurityIDSource>101</SecurityIDSource>
      <OpenTime>090000</OpenTime>
      <CloseTime>153000</CloseTime>
      <BuyQtyLowerLimit>1.000</BuyQtyLowerLimit>
      <BuyQtyUnit>1.000</BuyQtyUnit>
      <BuyQtyUpperLimit>999999999.000</BuyQtyUpperLimit>
      <SellQtyLowerLimit>1.000</SellQtyLowerLimit>
      <SellQtyUnit>1.000</SellQtyUnit>
      <SellQtyUpperLimit>999999999.000</SellQtyUpperLimit>
      <AmtUnit>1000000.00000</AmtUnit>
      <AmtLowerLimit>1000000.00000</AmtLowerLimit>
      <PriceUpperLimit>24.00000</PriceUpperLimit>
      <PriceLowerLimit>0.00100</PriceLowerLimit>
      <PriceTick>0.00100</PriceTick>
    </BasicBusRefInfo>
    <BasketInfo>
      <BasketID>B001</BasketID>
      <Name>利率债</Name>
      <Ratio>0.000</Ratio>
    </BasketInfo>
  </TriRepoParam>
</TriRepoParams>
    
```

```
<SecurityList>  
  <SecurityID>示例代码</SecurityID>  
  <SecurityIDSrc>101</SecurityIDSrc>  
</SecurityList>  
</BasketInfo>  
</TriRepoParam>  
</TriRepoParams>
```

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、UT

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。

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、UT

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、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（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，无意义填充格。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：mkttdt03

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，无定义则填空格。 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 | SettlePrice | 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, 无定义则填充格。 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, |

| | | | | |
|----|--------------|--------|-----|--|
| | | | | <p>‘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）</p> <p>第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填充格）</p> <p>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</p> <p>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。</p> |
| 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、UT

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、UT

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。

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、UT~~

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。~~

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、UT~~

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。~~

固定收益平台成交明细行情文件

~~文件名：se015ejmxyyyymmdd001.txt~~

~~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LDSS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。~~

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、UT~~

~~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LDSS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。~~

3.7. 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、UT、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

3.8. 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、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

3.9. 基金通行情文件

文件名：mkttdt06

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：UT、MDGW

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，字符填充格，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 | TotNumTrade Reports | 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 |

| | | | | |
|----|-------------|------|--------|-------------------------|
| | | | | 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 | InvestorSelling Price | 投资者卖出均 价 | N14(5) | 单位元 |
| 35 | InvestorSellVol ume | 投资者卖出总 量 | N15(2) | 单位份 |
| 36 | InvestorBestSel lPrice | 投资者卖出最 优价 | N14(5) | 单位元 |
| 37 | InvestorSellVol umeAtBestPric e | 投资者卖出最 优价数量 | N15(2) | 单位份 |
| 38 | InvestorBuying Price | 投资者买入均 价 | N14(5) | 单位元 |
| 39 | InvestorBuyVol ume | 投资者买入总 量 | N15(2) | 单位份 |
| 40 | InvestorBestBu yPrice | 投资者买入最 优价 | N14(5) | 单位元 |
| 47 | InvestorBuyVol umeAtBestPric e | 投资者买入最 优价数量 | N15(2) | 单位份 |
| 42 | IOPV | 基金 IOPV | N14(5) | MDSStreamID=MD601 时存在该字段。 |
| 43 | TradingPhaseC ode | 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 |

| | | | | |
|----|-----------|------|-----|---|
| | | | | <p>易, '1'表示此产品可正常交易, 无意义填充格。</p> <p>第 3 位: '0'表示未上市, '1'表示已上市。</p> <p>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。无意义填充格。</p> |
| 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 | <p>校验和, 3 位校验和</p> <p>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</p> <p>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。</p> |

3.10. 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: UT、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 | 不能配对买卖盘量 | N12 | CAS 未能配对买卖盘的数量 (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 | MDStreamID | 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 段买盘上限价 | N11(3) | POS 买盘的价格上限 (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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>将取为 ASCII 字符串 018</p> <p>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。</p> |
|--|--|--|--|---|

市场状态取值说明：

| 市场状态 | 描述 |
|-----------------------------|---|
| 100 = 未开市 | 市场早晨开市前的状态，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) |

3.11. 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、UT

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》¹中数据格式约定以及指数通行情文件接口相关描述。

¹ 详见中证指数公司官网 <https://www.csindex.com.cn/>

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 | 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，做好该异常的认识和处理 | |
| 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

文件说明：该文件为重点指数²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 |

² 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：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 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 |

4.4. 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：UT、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 |

4.5. 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：UT、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 |

4.6. 期权过户文件压缩包

文件名：OGHXXXXX

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：UT、ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXX 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 (trns03XXXXX.txt)、期权持仓余额对账文件 (hold03XXXXX.txt)、期权其他业务文件 (qtyw03XXXXX.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。

4.7. 期权成交过户数据文件

文件名：trns03XXXXX

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：UT、ztDisk

文件说明：文件名中 XXXXX 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 OGHXXXXX.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： E00000000000001 | 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) | 组合与拆分数量(分) | N10 |
| 12 | 成分合约数 | 取值不超过 4，后接重复组 | N2 |
| 合 | 13 | 合约编码 | C8 |

| | | | | |
|-------------|----|---------------------|--------------------------------------|-----|
| 约 信 息 | 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 |

4.8. 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: UT、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 |

4.9. 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：UT、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 |

4.10. 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 XXXXXX 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。

4.11. 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-xml](#) 中一条 ContractPreSetPrcRec 记录

编码规范：GBK 编码，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 | RFFStreamID | 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>
```



```

    <RFSStreamID>R0323</RFSStreamID>
    <SecurityID>10000037</SecurityID>
    <PreCalSettlPrice>7448.2915</PreCalSettlPrice>
</ContractPreSetPrcRec>
<ContractPreSetPrcRec>
    <RFSStreamID>R0323</RFSStreamID>
    <SecurityID>100000038</SecurityID>
    <PreCalSettlPrice>7447.4368</PreCalSettlPrice>
</ContractPreSetPrcRec>
</ContractPreSetPrcRecs>
    
```

4.12. 债券非匹配成交一债通收盘参考价文件

文件名： bondunibondelspxnegorefp_x_yyyymmdd

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： 包含互联网交易平台一债通模块挂牌产品的协商成交收盘价非匹配成交参考价和加权平均价，相关价格中仅统计除匹配成交外的成交方式且未经过除权除息。文件名中 YYYMMDD 表示年月日格式的日期,在此表示当前交易日。

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 | <u>SecurityID</u> | <u>证券代码</u> | | <u>C12</u> |
| 2 | <u>NegoClsRefPx</u> | <u>协商非匹配成交收盘参考价</u> | | <u>N15(5)</u> |
| 3 | <u>AvgPx</u> | <u>加权平均价</u> | | <u>N15(5)</u> |

说明：

1. 对于债券现券产品，此价格表示净价还是全价可参考证券产品基础信息文件（products_yyyymmdd）中的计价方式字段。对于协议回购和三方回购产品，单位为%，表示回购利率；对于其他产品，单位为元。

2. 如果产品当日停牌或无成交数据，则取其上一交易日的协商非匹配成交参考收盘价作为当日值；计算方式为：取当日 15:30（含）前最后一笔交易（含）前一小时内的成交量加权平均价。
3. 加权平均价指当天所有交易的加权平均价格，如果该债券当日停牌或无成交数据，则取该债券上一交易日的加权平均价。
4. 不包含公募可转债、公募 REITs、信用保护合约、组合式信用保护合约、信用保护凭证和各类债券 ETF 产品。

示例：

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BondNegoRefPxs>
  <BondNegoRefPx>
    <SecurityID>示例代码</SecurityID>
    <NegoRefPx>100.86000</ClosePx>
    <AvgPx>99.86000</AvgPx>
  </BondNegoRefPx>
</BondNegoRefPxs>
```

4.13. 债券非匹配—债通成交汇总文件(针对债券交易参与者)

文件名：zghXXXXXX

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 XXXXXX 表示席位号。

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 |
|----|---------|------------------------------|-----|
| 1 | 成交编号 | | C16 |
| 2 | 交易所订单编号 | | C16 |
| 3 | 会员内部编号 | | C10 |
| 4 | 申报来源 | 1 = 网页端申报 2 = 接口端（TDGW）申报 | C1 |
| 5 | 成交日期 | YYYYMMDD | C8 |
| 6 | 成交时间 | HHMMSS | C6 |
| 7 | 申报时间 | HHMMSS | C6 |
| 8 | 证券账户识别码 | 本方证券账户 | C13 |

| | | | |
|----|----------|--|--------|
| 9 | 席位代码 | 本方交易单元 | C8 |
| 10 | 交易员一债通账户 | | C10 |
| 11 | 证券代码 | 对现券交易，填证券代码； 对协议回购，填质押券代码，对于换券，填写换入券代码； 对三方回购，转入和转出填写标的券代码，其他交易填写三方回购合约虚拟代码。 | C12 |
| 12 | 业务类型 | 即申报中的 ApplID | C6 |
| 13 | 业务子类型 | 仅对部分业务有效，见后文描述 | C3 |
| 14 | 买卖方向 | 1 = 买入或正回购或转入； 2 = 卖出或逆回购或转出。 对转托管、转股冻结、换股和回售，填 2，对回售撤销、转股解冻填 1。 | C1 |
| 15 | 成交价格 | 单位：元或% 对协议回购或三方回购成交申报或到期续作合约新开或提前终止，代表回购利率或提前终止后的回购利率；其他无效。 对私募可交换债换股，填换股价格；对债券回售填回售价格； 对双非可转债转股填转股价格。 对于各类现券交易，填写实际交易价格，具体为全价还是净价以证券产品基础信息文件中计价方式字段的取值为准。 | N15(5) |
| 16 | 成交数量 | 对于债券，单位为千元面额；对于基金或公募 REITs，单位为份；对于信用保护凭证，单位为 10 张。 对协议回购，成交申报、到期续作合约新开和换券申报时填写质押数量，协议回购其他申报或三方回购无效。 | N17(3) |
| 17 | 成交金额 | 单位为元。 对债券现券或信用保护凭证交易，成交金额=成交价格*成交数量*10；对于基金或公募 REITs，成交金额=成交价格*成交数量。 对协议回购或三方回购成交申报和到期续作申报合约新开，填写回购成交金额，其他无效。 对各类非交易申报，无效。 | N20(5) |
| 18 | 结算方式 | 1 = 净额结算 2 = RTGS | C1 |
| 19 | 结算周期 | 0 = T+0 1 = T+1 2 = T+2 | C1 |

| | | | |
|-----------|-----------|---|------------|
| | | <u>3 = T+3</u> <u>预留字段，暂不启用</u> | |
| <u>20</u> | <u>备注</u> | <u>对三方回购和协议回购合约交易，填写回购期限；</u> <u>对转托管，填写银行间托管账户；</u> <u>其他无效。</u> | <u>C20</u> |

说明：

1. 对于转托管、转股、换股、回售和回售撤销类有效申报数据，结算方式字段无意义，如已撤销成功，则不包含在此文件中。
2. 对于一债通网页端申报的各类通道业务（包括新债券交易系统的匹配成交申报和综合业务系统的非交易备用通道等）不包含在此文件中。
3. 对于三方回购转入转出，将对转入转出账户各生成一笔记录。买卖方向字段，三方回购转入专户填 1，普通账户填 2；对于三方回购转出专户填 2，普通账户填 1。
4. 成交汇总中的业务类型及业务子类型数据说明：

| <u>业务类型</u> | <u>业务子类型</u> | <u>业务描述</u> |
|---------------|--------------|----------------------------|
| <u>600130</u> | <u>131</u> | <u>债券质押式协议回购成交申报</u> |
| | <u>132</u> | <u>债券质押式协议回购到期确认</u> |
| | <u>134</u> | <u>债券质押式协议回购提前终止</u> |
| | <u>135</u> | <u>债券质押式协议回购换券申报</u> |
| | <u>136</u> | <u>债券质押式协议回购解除质押</u> |
| | <u>137</u> | <u>债券质押式协议回购到期续做前期合约了结</u> |
| | <u>138</u> | <u>债券质押式协议回购到期续做合约新开</u> |
| <u>600140</u> | <u>141</u> | <u>债券质押式三方回购成交申报</u> |
| | <u>142</u> | <u>债券质押式三方回购到期购回</u> |
| | <u>144</u> | <u>债券质押式三方回购提前终止</u> |
| | <u>145</u> | <u>债券质押式三方回购换券申报</u> |
| | <u>146</u> | <u>债券质押式三方回购解除质押</u> |
| | <u>147</u> | <u>债券质押式三方回购补券申报</u> |
| <u>600180</u> | <u>-</u> | <u>确定报价</u> |
| <u>600190</u> | <u>-</u> | <u>一债通询价</u> |

| 业务类型 | 业务子类型 | 业务描述 |
|--------|-------|-----------|
| 600200 | = | 待定报价 |
| 600210 | = | 协商成交 |
| 600220 | = | 合并申报 |
| 600230 | = | 双非可转债转股 |
| 600240 | = | 私募可交换债换股 |
| 600250 | = | 债券回售（一债通） |
| 600251 | = | 债券回售撤销 |
| 600260 | = | 债券转托管 |
| 600270 | = | 三方回购转入转出 |
| 600290 | = | 竞买 |
| 600310 | = | 场务应急成交录入 |

4.14. 债券非匹配一债通成交汇总文件(针对托管银行)

文件名：zghXXXXX

扩展名：txt

发布时间：闭市后发送

发布渠道：ztDisk

文件说明：该文件被打包进 YYYY.sse 中，YYYY 为托管银行的拼音首字母，例如：工商银行为 gsyh。

接口格式：

接口格式同一债通成交汇总文件（针对债券交易参与者）。

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：4008888400-2

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