

上海证券交易所  
市场数据文件交换接口规格说明书  
**1.80 版**



二〇二三年八月

## 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）
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）
1.40	2022-03	1. 调整债券行情文件、债券过户数据文件中债券相关数量单位为“千元面额”； 2. 调整债券盘中停牌公告文件，区分可转债和其他债券现券的停牌公告模板； 3. 新增债券产品信息文件接口； 4. 删除产品基础信息第一版第一批次文件接口 cpxxMMDD.txt、产品基础信息第一版第二批次文件接口 cpxx0102MMDD.txt；

		5. 调整债券行情文件中市场行情状态的说明
1.50	2022-06	<p>1. 更新债券产品信息文件 bondinfoYYYYMMDD.txt 部分字段说明；</p> <p>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;</p> <p>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。</p>
1.60	2022-08	1. 调整债券盘中停牌公告文件 ztxxxhmmss.txt 的说明
1.70	2023-05	新增单一股票担保物比例信息接口。
<u>1.80</u>	<u>2023-07</u>	<p><u>1、增加行情网关作为基金通行情 mktDt06.txt 的发送渠道；</u></p> <p><u>2、补充上交所发送行情文件说明；</u></p> <p><u>3、删除已下线 BT 软件相关文件获取渠道描述。</u></p>

# 目 录

<b>第一章</b>	<b>概述</b> .....	<b>1</b>
1.1.	使用说明 .....	1
1.2.	名词定义 .....	1
1.3.	接口规范 .....	1
<b>第二章</b>	<b>盘前参考数据</b> .....	<b>3</b>
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 .....	7
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
<b>第三章</b>	<b>实时数据</b> .....	<b>16</b>
3.1.	竞价撮合系统行情文件 .....	16
3.2.	综合业务系统行情文件 .....	16
3.3.	债券行情文件 .....	16
3.4.	期权交易系统行情文件 .....	20
3.5.	港股实时行情文件 .....	20
3.6.	港股通交易盘实时状态行情文件 .....	21
3.7.	固定收益平台确定报价行情文件 .....	21
3.8.	固定收益平台成交行情文件 .....	21
3.9.	固定收益平台成交明细行情文件 .....	22
3.10.	固定收益平台证券信息行情文件 .....	22
3.11.	竞价撮合系统盘中停牌公告文件 .....	22
3.12.	债券盘中停牌公告文件 .....	23
3.13.	基金通行情文件 .....	25
3.14.	B 转 H 行情文件 .....	31
3.15.	指数通行情文件 .....	40
<b>第四章</b>	<b>盘后数据</b> .....	<b>41</b>
4.1.	债券过户数据文件 .....	41
4.2.	重点指数表现文件 .....	42
4.3.	份额过户文件 .....	44
4.4.	国际化产品过户数据文件 .....	45

---

第五章 后记.....	46
-------------	----

# 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
<del>BT 客户端</del>	<del>BT</del>	<del>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</del>
<del>易神系统通用文件传输软件</del>	<del>EzTrans</del>	<del>为用户提供文件上传、报表下载以及 PBU 权限管理等功能</del>
行情网关	MDGW	为用户提供 BINARY/STEP 行情接收功能
<del>轻型化行情接收软件</del>	<del>EzSR</del>	<del>为用户提供多市场 FAST 行情数据接收功能</del>
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: gzlz

扩展名: MDD

发布时间: 开市前发布

发布渠道: UT~~BT~~

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~~

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~~



**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~~

**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、~~BT~~、MDGW

**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、~~BT~~、MDGW

**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 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 yyyyymmdd 表示年月日格式的文件适用日期

接口格式:

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

说明:

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

## 2.11. 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 9：次级债券	C2

		<p>10: ABS</p> <p>11: 可交换债</p> <p>12: 政府支持机构债</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>金融机构</p> <p>政府支持机构</p> <p>央企</p> <p>地方国企</p> <p>民营企业</p> <p>外资企业</p> <p>其他</p>	C20
20	主体评级	<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>	C50

		<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> <p>O 代表“无评级”</p>	
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>	C50

		<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> <p>O 代表“无评级”</p>	
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>	C100



		<p>BPXY: 标普信用评级(中国)有限公司</p> <p>OTHER: 其他</p> <p>NONE: 无</p>	
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> <p>第11位: 纾困债</p> <p>第12位: 短期公司债券</p> <p>第13~20位: 预留备用</p>	C20
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>	C50

		<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>	
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> <p>04: 专业机构投资者</p>	C2
32	特殊转让板	<p>取值如下:</p> <p>N: 否</p> <p>Y: 是</p>	C1
33	是否基准做市品种	<p>取值如下:</p> <p>N: 否</p> <p>Y: 是</p>	C1
34	摘牌日	YYYYMMDD	C8
35	含权类型	<p>取值如下:</p> <p>NONE: 无</p> <p>HS: 回售</p> <p>SH: 赎回</p> <p>LLTZ: 利率调整</p> <p>TQCH: 提前偿还</p>	C50

		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	
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：dygpdbbYYYYMMDD

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。

## 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。

#### 3.1.3.3. 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，无定义则填充格，具体参见下方市场行情状态取值	C8
		扩展区域，市场参与主体的技术系统应能支持记录尾部扩展新的字段	不定

市场行情状态取值：

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

## (2) 文件体：多行记录

序号	字段名称	字段描述	类型
1	MDStreamID	行情数据类型，取“MD201”，表示债券行情	C5

2	SecurityID	产品代码	C6
3	Symbol	产品名称	C8
4	TradeVolume	成交数量	N16
5	TotalValueTraded	成交金额，对于债券现券，成交金额为每笔成交的价格*数量*10的总和；对于质押式回购，成交金额为100*成交数量*10	N16(2)
6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(3)
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(3)
8	HighPrice	最高价	N11(3)
9	LowPrice	最低价	N11(3)
10	TradePrice	最新价	N11(3)
11	ClosePx	今收盘价	N11(3)
12	BuyPrice1	申买价一	N11(3)
13	BuyVolume1	申买量一	N12
14	SellPrice1	申卖价一	N11(3)
15	SellVolume1	申卖量一	N12
16	BuyPrice2	申买价二	N11(3)
17	BuyVolume2	申买量二	N12
18	SellPrice2	申卖价二	N11(3)
19	SellVolume2	申卖量二	N12
20	BuyPrice3	申买价三	N11(3)
21	BuyVolume3	申买量三	N12
22	SellPrice3	申卖价三	N11(3)
23	SellVolume3	申卖量三	N12

24	BuyPrice4	申买价四	N11(3)
25	BuyVolume4	申买量四	N12
26	SellPrice4	申卖价四	N11(3)
27	SellVolume4	申卖量四	N12
28	BuyPrice5	申买价五	N11(3)
29	BuyVolume5	申买量五	N12
30	SellPrice5	申卖价五	N11(3)
31	SellVolume5	申卖量五	N12
32	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志，4位有效，剩余位填充格，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，包括期权交易行情

接口格式：参见《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中数据格式约定以及期权行情文件接口相关章节。

### 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。

### 3.7. 固定收益平台确定报价行情文件

文件名：se015qdbjyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW、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。

### 3.8. 固定收益平台成交行情文件

文件名：se015cjhqyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW、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。

### 3.9. 固定收益平台成交明细行情文件

文件名：se015cjmxyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW、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 LDDS 系统固定收益行情接口说明书》中数据格式约定以及成交明细相关章节。

### 3.10. 固定收益平台证券信息行情文件

文件名：se015zqxxyyyymmdd001.txt

扩展名：txt

发布时间：实时发布

发布渠道：MDGW、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 LDDS 系统固定收益行情接口说明书》中数据格式约定以及证券信息相关章节。

### 3.11. 竞价撮合系统盘中停牌公告文件

文件名：tpxxxhhmmss.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

### 3.2.3.12. 债券盘中停牌公告文件

文件名：ztxxxxhhmmss

扩展名：txt

发布时间：实时发布

**发布渠道：**MDGW、UT

**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

### **3.3.3.13. 基金通行行情文件**

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，填充格)
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，填充格）
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)	MStreamID=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>

### 3.4.3.14. B 转 H 行情文件

文件名: mktddh

扩展名: txt

发布时间: 实时发布

发布渠道: UT、MDGW ~~(MDGW 暂不支持)~~

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	MStreamID	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, 校验和域将取为 ASCII 字符串 018 校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性

				校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。
--	--	--	--	---

市场状态取值说明：

市场状态	描述
100 = 未开市	市场早晨开市前的状态，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)

### 3.15. 指数通行情文件

**文件名:** csiYYYYMMDD

**扩展名:** txt

**发布时间:** 实时发布

**发布渠道:** MDGW、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》<sup>1</sup>中数据格式约定以及指数通行情文件接口相关描述。

<sup>1</sup> 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：zqghXXXXXX

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），否则填充格	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<sup>2</sup>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

<sup>2</sup> 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：ighXXXXX

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

## 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](mailto: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