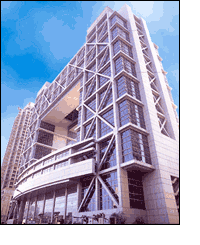
上海证券交易所技术文档



**竞价撮合平台**

**市场参与者**

**接口规格说明书**

**（1.40版）**

**上海证券交易所**

**二〇一八年九月**

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释, 以上变更启用安排参见相关业务或测试通知。

服务电话：021-4009003600

通信地址：上海市浦东南路528号上交所技术公司技术开发总部

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

**《市场参与者接口规格说明书》1.40版发布说明**

2018年9月进行了修订，主要有：

1、产品基础信息文件中证券子类别字段新增密码服务产品的子类别说明。

**《市场参与者接口规格说明书》1.39版发布说明**

2018年7月进行了修订，主要有：

1. 行情接口文件mktdt00.txt中TradingPhaseCode字段：新增收盘集合竞价时段‘U’取值；删除休市时段‘B’、开盘集合竞价阶段结束到连续竞价阶段开始之前的时段‘D’状态取值，由连续交易时段取值‘T’替代。
2. 行情数据库STEP接口中TradingPhaseCode字段：新增收盘集合竞价时段‘U’取值；删除休市时段‘B’、开盘集合竞价阶段结束到连续竞价阶段开始之前的时段‘D’状态取值，由连续交易时段取值‘T’替代。

**《市场参与者接口规格说明书》1.38版发布说明**

2018年5月进行了修订，主要有：

1、 产品基础信息文件中证券子类别字段新增控制指令的子类别说明。

2、 移除过时的网络投票接口，移除show2003接口，修订目录格式。

**《市场参与者接口规格说明书》1.37版发布说明**

2017年7月进行了修订，主要有：

1、 新增减持控制数据接口、示例及前端控制说明。

**《市场参与者接口规格说明书》1.36版发布说明**

2017年7月进行了修订，主要有：1、 修订FJYYYYYMMDD文件发行方式字段描述。

2、 修订IPOGH文件部分字段描述。

**《市场参与者接口规格说明书》1.35版发布说明**

1、　　2017年4月进行了修订，主要有：

产品基础信息文件接口cpxxMMDD.txt，更新“产品状态标志”字段相应描述。

**《市场参与者接口规格说明书》1.34版发布说明**

2016年1月进行了修订，主要有：

1. 产品非交易集成信息接口fjyYYYYMMDD中，增加“发行方式”字段，并更新相应描述。
2. 调整行情接口mktdt00.txt中相关字段取值，增加上海市场行情结束标记。

**《市场参与者接口规格说明书》1.33版发布说明**

2015年12月进行了修订，主要有：

1. 新增新股发行过户数据ipoghXXXXX.txt接口，并更新相应代码段描述。
2. 调整行情接口mktdt00.txt中TradingPhaseCode字段第1位取值，及第2位含义。

需要说明，此次接口更新于2016年1月1日正式生效。

**《市场参与者接口规格说明书》1.32版发布说明**

2015年10月进行了修订，主要有：

1. 行情接口mktdt00.txt中，当行情数据类型取值标识字母MD加类型编号取值为MD002、MD003、MD004时，增加了TradingPhaseCode（行情实时阶段及标志）的熔断相关类型。
2. 4.1节中“上市公司公告文件”中序列号由原先的3位NNN扩展至4位NNNN。正式启用时间以交易所通知为准。

**《市场参与者接口规格说明书》1.31版发布说明**

2015年7月进行了修订，主要有：

1. cpxxMMDD.txt中产品状态标志字段，第4位原定义为对应：’S’表示债券风险警示类。因本所不再实施债券风险警示制度，本次正式改为第4位不启用。
2. 可交换公司债换股参考可转债转股实现，在本文档中已有的可转债转股描述处进行扩展以纳入支持可交换公司债换股的文字描述。可交换公司债换股的业务放开时间具体以交易所通知为准。

**《市场参与者接口规格说明书》1.30版发布说明**

2015年4月进行了修订，主要有：

1、正式发布产品非交易基础信息接口fjyYYYYMMDD.txt

**《市场参与者接口规格说明书》1.29版发布说明**

2015年1月进行了修订，主要有：

1. kxxMMDD.txt中基金状态FundStatus修改值为“0”和“4”时的含义描述。
2. 修订了5.5.3返回代码表。

**《市场参与者接口规格说明书》1.28版发布说明**

2015年1月进行了修订，主要有：

1. cpxxMMDD.txt中产品状态标志字段，第4位现定义为对应：’S’表示债券风险警示类。未来改为不启用，此改动暂未实施，具体以交易所通知为准。

**《市场参与者接口规格说明书》1.27版发布说明**

2014年9月初进行了修订，主要有：

1. 增加竞价撮合平台行情接口mktdt00.txt，即合并文档《上海证券交易所EzSR竞价撮合平台行情mktdt00文件接口(预发布稿)\_20140916》。增加基于数据库的STEP行情接口。
2. cpxxMMDD.txt除市场外，有其他单位部分使用，特此说明。

**《市场参与者接口规格说明书》1.26版发布说明**

2014年6月初进行了修订，主要有：

1. 修订并完善产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，增加债券风险警示和债券市场投资者适当性要求标识。
2. 修订申报接口，增加信用账户支持发行类功能说明。
3. 针对港交所申报，修订沪股通投票分段规则。

**中间开发版本1.25版的变更，**主要有：

2014年5月初进行了修订，主要有：

1. 针对港交所申报，增加沪股通投票业务。

2014年1月初进行了修订，主要有：

1. 修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，增加无任何价格涨跌幅控制类型取值。
2. 修订本文中对交易规则的章节号引用，增加交易规则版本描述。
3. 补充说明基金公司zqy压缩打包方式。

**《市场参与者接口规格说明书》1.24版发布说明**

2013年12月中旬进行了修订，主要有：

1. 配合优先股业务，修改盘后过户文件中关于发行日的描述，优先股其他变更参见1.23版第2条修订。
2. 增加转发指数公司的质押式报价回购质押券折算率（值）文件接口。

**《市场参与者接口规格说明书》1.23版发布说明**

2013年12月进行了修订，主要有：

1. 补充说明实时成交回报和盘后过户接口中成交金额字段溢出处理。
2. 修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，增加优先股产品类型和板块类型取值。
3. 修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口说明，补充说明包含停牌产品。

**中间开发版本1.22版的变更，**2013年10月进行了修订，主要有：

1. 修订证券权益接口zqyXXXXX.dbf，启用该接口，并删除、修改相关字段。
2. 修订过户库接口市值配售发行(更改为按市值资金申购)、资金申购发行记录定义，扣款、还款记录支持通过成交时间cjsj字段扩位。
3. 补充数据格式约定中数值溢出时处理方式。补充描述产品信息面值字段。

**中间开发版本1.21版的变更，**2013年10月中旬进行了修订，主要有：

1. 修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，新增IPO上市首日的涨跌幅控制类型，并描述具体的上下限价格字段取值。

**《市场参与者接口规格说明书》1.20版发布说明**

2013年9月进行了修订，主要有：

1. 因变更未部署，暂不实施关于新股发行过户库接口的修订（即修订2、3），并做修订回退。

2013年8月进行了修订，主要有：

1. 过户数据接口中，在新股发行时，扣款还款记录cjbh字段，新增与成交时间字段组合规则，从而扩展编号范围（注：本修订取消）。
2. 过户数据接口中，在新股发行时（具体新规则待正式发布），配号记录由原来的1条变更为1～2条，区分账户配号记录和申购量配号记录。不分配配号或无配号的，不生成配号记录（注：本修订取消）。
3. 补充产品信息涨跌幅限制类型取值。

**中间开发版本1.19版的变更，**2013年7月进行了修订，主要有：

1. 产品基础信息接口cpxxMMDD.txt，新增LOF产品子类型，梳理删除无效的产品子类型。

2013年6月进行了修订，主要有：

1. 修订产品基础信息接口cpxxMMDD.txt，增加发布国债预发行业务保证金比例、基准价格、参考久期、最后交易日、招标方式信息。其中使用了部分预留字段和备注字段。
2. 修订产品基础信息接口cpxxMMDD.txt，增加国债预发行业务当期发行量，补充相关说明。
3. 调整CPXX中关于国债预发行招标方式到备注字段，调整最后交易日字段数据类型为字符型，长度不变。

**中间开发版本1.18版的变更，**2013年4月进行了修订，主要有：

1. 修订产品基础信息接口cpxxMMDD.txt，增加集合资产管理计划产品相关字段描述。

**中间开发版本1.17版的变更：**

1. 修订产品基础信息接口cpxxMMDD.txt，增加退市转让版标识，增加集合资产管理计划产品子类型取值。

**《市场参与者接口规格说明书》1.16版发布说明**

2013年2月进行了修订，主要有：

1. 修订产品基础信息接口cpxxMMDD.txt，启用预留字段发布债券面值，长度不变支持小数。
2. 其他关于面值的文字描述。

**中间开发版本1.15版的变更：**

1. 修订转发中登的折算率接口，配合债券ETF回购，修订标准券折算率变更接口和标准券折算比率接口。
2. 修订ETF公告文件修改描述股票为证券。
3. 因国债预发行变更为在综业实现，国债预发行相关需求回退。

**《市场参与者接口规格说明书》1.14版发布说明**

2012年10月进行了修订，主要有：

1、增加13456错误代码定义。

2、补充cjhb表ETF申赎现金替代金额计算方法，补充说明跨境ETF申赎业务通过综合业务平台实现。

3、补充说明货币市场基金（即“汇添富收益快线”模式）认购及申赎业务实现平台，货币市场基金产品行情中发布每百万元收益，补充产品信息中货币市场基金收盘价格字段描述。

4、补充603代码段辅助代码对应信息。

5、增加cpxx关于风险警示板产品的标识，并正式发布cpxx。

**《市场参与者接口规格说明书》1.13版发布说明**

2011年10月进行了修订，并用红字标明，主要有：

更改文档名称为《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》（原文档名：《SSE301 上海证券交易所新一代交易系统市场参与者 接口规格说明书》）,本文档主要描述本所竞价撮合平台接口规格及其他平台公共接口规格。

修定了ETF1.0公告文件内容，完善标识头说明，补充跨境跨市场ETF公告文件替代类型取值扩展，删除实时成交回报接口关于跨境ETF申赎的成交回报描述，修订跨市场ETF成交回报描述，明确成交回报非沪市资金记录为1-2条（原为0-2条）。

ETF公告文件2.0版暂不启用，为避免混淆暂删除此文件接口定义。

修正行情接口中IOPV描述，S3为T-1日“上海市场收盘时刻”该ETF的IOPV。

修改过户数据ghXXXXX.dbf转债转股记录说明，交易所不再向券商发送转股数据，转股数据以登记公司的相关数据为准（供参考，暂未实施，具体以交易所通知为准）。

增加产品基础信息接口，增加新非交易信息接口，现有的非交易信息文件（fjyMMDD.txt）将逐步停止发布（供参考，暂未对市场发送，具体以交易所通知为准）。

**《市场参与者接口规格说明书》1.12版发布说明**

2011年2月进行了修订，并用红字标明，主要有：

增补错误代码13458的描述。

可转换债券转换登记目前配置上不允许撤单，故修改相应描述。

修改ETF公告文件2.0版文件格式和描述，新版公告文件启用时间将另行通知。

**《市场参与者接口规格说明书》1.11版发布说明**

2010年5月发布1.11版。

包括如下文字修改内容：

1. 强调了委托表、委托确认表、成交回报表中索引或者主键的设置方式。
2. 将STEP部分暂时移出进行整体修订。

包括如下接口变动内容：

1. 委托表和委托确认表增加了营业部代码字段branchid。对于使用EzOES 2010版及之后的版本， branchid字段可直接填写有效的营业部代码，当取值为[01000，59999]时，reff字段的第1和第2字节不再填写营业部代码的转换码，reff整个字段全部作为会员内部订单号使用，取值为数字，区间为[0000000001，3999999999]；如果branchid字段的取值为NULL、空或者若干空格时，报盘程序取reff中第1和第2字节仍按照原营业部代码转码算法得出[1000，4843]范围内的营业部代码。
2. 增加错误代码1102，表示营业部代码字段格式错误。
3. 增加一个章节：ETF公告文件2.0版。该2.0版格式把ETF基金管理公司用的定义文件和向市场参与者发布的公告文件进行了统一，并开始支持**跨境ETF**业务。由于每个ETF基金都有一个对应的该文件，故该文件的启用时间根据各个ETF基金公司的进度分别安排。

**《市场参与者接口规格说明书》1.10版发布说明**

2009年10月进行了修订，包括如下内容：

1. 增加了沪深300 ETF申购和赎回时成交回报的说明。
2. 对向全市场转发的ETF基金公司ETF公告文件，给出了详细说明。
3. 修订错误代码10932的描述。
4. 增补错误代码10596、11042、13424、13454的描述。

**《市场参与者接口规格说明书》1.09版发布说明**

为贯彻落实证监会公告[2009]13号文《关于进一步改革和完善新股发行体制的指导意见》以及上海证券交易所上证发字[2009]3号文《关于修改〈上海市场首次公开发行网下发行电子化实施细则〉和〈沪市股票上网发行资金申购实施办法〉的请示》，修订了本文档，并于2009年7月向市场参与者发布版本1.09。

修改描述如下：

1. 新交易系统切换后，对各种不即刻产生成交回报记录的申购/认购订单，系统支持配置为可撤单或者不可撤单。具体采用可撤单或者不可撤单的业务规则，以实施办法和发行公告为准。
2. 违反《沪市股票上网发行资金申购实施办法》中第二条条款二约定和违反第四条条款二约定的无效申报，在发行T日GH库中，成交编号cjbh、成交数量cjsl 为0，成交金额cjje为0.00，申请编号sqbh为“违规重复”和“网下在先”。

**《市场参与者接口规格说明书》1.08版2009年4月重印说明**

于2009年2月进行了勘误。含委托申报表中日期字段的格式和成交回报部分灾备恢复步骤示例中本次日期字段的取值说明。

于2009年4月对申报确认表中time字段的取值方法进行了补充描述。

由于2009年2月和4月的修改，没有对接口进行变动，只是文字的修订，故文件版本号仍维持在1.08 版本，文件名增加“2009年4月重印”的后缀。

**《市场参与者接口规格说明书》1.08版发布说明**

根据德邦证券、东方证券、光大证券、国泰君安、海通证券、南京证券、平安证券、申银万国、兴业证券、远东证券、银河证券、中投证券、中银国际（按照拼音排序）参加实验室测试和现场测试后反馈意见，上交所修订了本文档，于2009年1月向市场参与者发布版本1.08。

修改描述如下：

1.卖出可转债转换代码时卖出价格必须填100。

2.卖出可转债回售代码时卖出价格必须填公告的回售价格。

3.买入权证行权代码时买入价格必须填行权价格。

4.输入券源划转代码时订单类型从必须为“LPT”修改为必须为“LPT”或者“ORD”。

5.担保品及标的证券清单接口的余额字段从C15调整为N15。

6.对融资融券有关的错误代码进行了细化，修改236,237,276,10262的描述，增加10100, 10708,11068,11080,11082,11218,13440,13448的场景。

**《市场参与者接口规格说明书》1.07版发布说明**

为了配合市场参与者接入新一代交易系统有关技术系统就绪工作，上交所向市场参与者于2008年12月发布1.07版本。

一、新交易系统对接口概括起来有如下主要调整，详细参见有关章节：

1、对于行情接口show2003文件：

* 1. 买断式国债回购代码203\*\*\*的S5从无业务含义调整为其基础产品昨日收盘价\*S11\*10。
  2. 权证行权代码582\*\*\*的S15从无业务含义调整为行权申报总量/1000。

2、对于申报接口ordwth表：

* 1. 对于未即时生效的非交易类订单支持撤单。
  2. 为便于市场参与人在其柜台系统发生灾难性故障后的后续处理，不再要求待撤销申报所对应的申报表记录和申报确认表记录在数据库中存在。市场参与人在 rec\_num、date、time、reff、status、owflag字段提供本笔撤单申报自身的内容，在acc字段、stock字段、bs字段、price字段、qty字段提供待撤订单的原内容，在ordrec字段提供待撤订单的原rec\_num内容，可完成撤单。
  3. B股结算会员代码字段，可以直接填写中登公司公布的结算会员代码，即如果头两位为00，无需变换为空格。
  4. 申报表不再严格要求recnum从1开始，只要连续递增即可。如果申报表损坏，市场参与人启用备份数据库，不需要插入空记录，只要在新的申报表中直接插入后续订单即可申报。由于交易系统后台对同一个PBU同一个证券产品集SET内相同rec\_num的订单不会重复处理，所以切换时，后续订单的编号每切换1次必须超过已经向交易所发出的rec\_num号，市场参与者可以通过累加一个其业务上不可能发生的值比如1000万，来避免重单。

3、对于申报确认接口ordwth2表：

* 1. 申报确认记录不按照rec\_num顺序严格递增的方式写入。
  2. teordernum字段只在同一个证券代码内唯一。
  3. 如果申报确认表损坏，市场参与人启用备份数据库，可以通过重新设置申报表中status字段的值为‘R’来选择性地恢复申报确认数据。交易系统后台保证同一个PBU同一产品集SET内相同 rec\_num的订单不会被重复处理。

4、对于成交回报接口cjhb表和过户数据GHXXXXX文件：

* 1. 成交记录不按照成交编号顺序严格递增的方式写入。
  2. gdxm 股东姓名字段不再填写股东姓名，对于cjhb表填写该产品所属产品集SET的编号。在新交易系统上线点，A股产品集SET的取值为’1’、’2’、’3’、’4’、’5’、’6’、’991’。B股产品集SET的取值为’20’。在一个交易日内，SET的有关配置不会发生变化。未来如有产品集的扩充，另行通知。对于GHXXXXX文件填写空格。bcye本次余额字段不再填写本次余额，对于cjhb表填写该成交在对应产品集内的序列号。且按照同一SET内序列号“字典序”严格递增的方式写入成交记录，即会在左边补0，例如’10’存储为 ‘0000000010’。为提高访问速度，市场参与者可以为gdxm和bcye设立组合索引，便于快速取出特定SET内最后写入的记录。对于GHXXXXX文件填写0。
  3. 对应席位质押式国债回购代码201\*\*\*、席位质押式企业债回购代码202\*\*\*以及账户质押式国债回购代码204\*\*\*时，成交金额字段为100\*成交数量cjsl\*10。
  4. 对应买断式国债回购代码203\*\*\*时，成交金额字段为基础产品昨日收盘价\*成交数量cjsl\*10。

5、盘后数据压缩发送方式采用每个文件单独压缩的方式，变更部分为zxwXXXXX.dbf和zzhXXXXX.dbf分别压缩为zxwXXXXX.zip和zzhXXXXX.zip。kghXXXXX.txt和khlXXXXX.txt分别压缩为kghXXXXX.zip和khlXXXXX.zip。

6、证券帐户资料接口zzhXXXXX.dbf中股东姓名字段被置为空格。

7、权证信息接口 qzxxMMDD.txt，该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。

二、新交易系统提供给市场参与者使用的报盘程序EzOes和报表下载程序RptGet，须使用其PBU编号和其缺省的交易员000001来登录。

**目录**

[1 数据格式约定 13](#_Toc514675396)

[2 实时文件和数据库接口规范 14](#_Toc514675397)

[2.1 行情接口 mktdt00.txt 14](#_Toc514675398)

[2.2 行情数据库STEP接口 20](#_Toc514675399)

[2.3 申报接口ordwth 24](#_Toc514675400)

[2.4 申报确认接口 ordwth2 32](#_Toc514675401)

[2.5 成交回报接口 cjhb 35](#_Toc514675402)

[3 盘后数据接口规范 40](#_Toc514675403)

[3.1 过户数据接口 ghXXXXX.dbf 40](#_Toc514675404)

[3.2 证券帐户资料接口zzhXXXXX.dbf 44](#_Toc514675405)

[3.3 席位联通接口zxwXXXXX.dbf 45](#_Toc514675406)

[3.4 证券权益接口zqyXXXXX.dbf 45](#_Toc514675407)

[3.5 新股发行过户数据接口ipoghXXXXX.txt 46](#_Toc514675408)

[3.6 减持控制数据接口jckzXXXXX.txt 49](#_Toc514675409)

[4 广播文件接口规范 53](#_Toc514675410)

[4.1 上市公司公告文件 53](#_Toc514675411)

[4.2 债券信息公告文件biYYMMDD.txt 53](#_Toc514675412)

[4.3 国债利息接口gzlx.MDD 54](#_Toc514675413)

[4.4 标准券折算率变更接口zslMMDD.txt 55](#_Toc514675414)

[4.5 标准券折算率变更公告文件zslwMMDD.txt 55](#_Toc514675415)

[4.6 标准券折算比率接口 xzslMMDD.txt 56](#_Toc514675416)

[4.7 ETF公告文件1.0版格式 56](#_Toc514675417)

[4.8 权证信息接口 qzxxMMDD.txt 60](#_Toc514675418)

[4.9 交易公开信息公告文件jygkxxMMDD.txt 61](#_Toc514675419)

[4.10 产品非交易基础信息接口fjyMMDD.txt 62](#_Toc514675420)

[4.11 产品非交易基础信息接口fjyYYYYMMDD.txt 65](#_Toc514675421)

[4.12 担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt 69](#_Toc514675422)

[4.13 产品基础信息文件接口cpxxMMDD.txt 70](#_Toc514675423)

[4.14 质押式报价回购折算率文件bzsl01MMDD.txt 75](#_Toc514675424)

[5 开放式基金数据接口规范 76](#_Toc514675425)

[5.1 开放式基金净值数据接口kxxMMDD.txt 78](#_Toc514675426)

[5.2 开放式基金分红数据接口khlXXXXX.txt 79](#_Toc514675427)

[5.3 开放式基金帐户对帐数据接口kyeXXXXX.txt 81](#_Toc514675428)

[5.4 开放式基金交易确认接口kghXXXXX.txt 82](#_Toc514675429)

[5.5 取值附表 90](#_Toc514675430)

[5.5.1 基金业务代码与含义表 90](#_Toc514675431)

[5.5.2 销售人代码表 92](#_Toc514675432)

[5.5.3 返回代码表 93](#_Toc514675433)

[6 附录：营业部代码换码算法示例 115](#_Toc514675434)

[7 附录：申报确认接口remark字段取值说明 116](#_Toc514675435)

[8 后记 123](#_Toc514675436)

# 数据格式约定

该文档中描述文件分为两种类型，dbf格式与txt格式。dbf格式遵循DBF文件有关定义，采用特殊的文件头结构与记录行结构。

dbf与txt格式均遵循以下约定：

（一）对于字符型字段，不足部分左对齐，右补空格；以 CX格式表示，其中X代表长度。

（二）对于整数数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以NX格式格式表示，其中X代表数字型字符串总长度。

（三）对于浮点数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以NX (Y)格式表示，其中X代表数字型字符串总长度，Y代表小数位数。X包括一位小数点。带浮点的数字型字段包括小数位，如：123.00000 显示为123.00000；

（四）无特别声明，对于数字字段数值溢出，将填写全9数值，如N6（2）填写999.99。

txt格式遵循以下约定：

（一）竖线('|')为字段间分隔符。

（二）竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾。

（三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串。每个字段均为定长字段。

（四）每行以二进制0x0A结束

（五）最后一行也以0x0A结束

其他补充约束参见字段具体描述。

开放式基金的txt文件格式另有约定。

# 实时文件和数据库接口规范

本部分描述了市场参与者柜台系统同上交所交易系统之间的实时接口。

## 行情接口 mktdt00.txt

| **mktdt00.txt** | **行情文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  本文件为行情文件接口。对于竞价撮合平台，行情文件名为mktdt00.txt，当日开市前至交易结束期间实时发送。（对于港交所，仅提供一档数据，其他档数据填空格）  行情文件为文本txt文件，格式约定如下：  （一）竖线('|')为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符；  （二）竖线('|')不应用在每条记录的开头和结尾；  （三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序；  （四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以CX格式表示，其中X代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以NX格式表示，其中X代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以NX (Y)格式表示，其中X代表数字型字符串总长度，Y代表小数位数，X包括一位小数点，整数部分最多不超过X-Y-1位，小数部分最多不超过Y位，不足部分右对齐，左补空格；  （五）每行以二进制0x0A结束，最后一行也以0x0A结束。  文件描述：  （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；注意根据文件体首字段MDStreamID取值解析不同的文件体记录格式；  （三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应能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）对于暂停上市的股票，文件中不包含该股票的记录。发行期内对于未设定开始上市交易的产品，文件中不包含该产品的记录。对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录；  （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）当产品代码为债券（国债、企债、可转债）时，由于债券交易的数量以手为单位，成交金额为该债券每笔成交的价格\*数量\*10的总和；  当产品代码为席位质押式国债回购代码201\*\*\*、席位质押式企业债回购代码202\*\*\*以及账户质押式国债回购代码204\*\*\*时，成交金额为100\*成交数量\*10；  当产品代码为买断式国债回购代码203\*\*\*时，成交金额为其基础产品昨日收盘价\*成交数量\*10；  （九）对于产品价格、金额数据单位，除B股为美元外，其他为人民币元。对于产品数量数据单位，股票为股，基金、权证为份，债券与回购为手。对于产品TradeVolume成交数量单位，股票为股，基金为份，债券与回购为手，权证为100份；对于指数价格、金额、数量单位，详见表格具体定义说明；  （十）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；  （十一）在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息；  （十二）临时停牌期间不揭示五档行情；  （十三）字段无意义或无该字段行情数据时，字符填空格，数值填0；  （十四）交易所具体产品代码，参见相关发文通知，并参考以上处理。 | |

结构图如下：



文件结构描述参考：

**BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSesStatus**

**MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|BuyPrice2|BuyVolume2|SellPrice2|SellVolume2|BuyPrice3|BuyVolume3|SellPrice3|SellVolume3|BuyPrice4|BuyVolume4|SellPrice4|SellVolume4|BuyPrice5|BuyVolume5|SellPrice5|SellVolume5|TradingPhaseCode|Timestamp**

**……**

**……**

**……**

**EndString|CheckSum**

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 | MTP1.00 |
| 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。 |
| 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） |
| 6 | SenderCompID | 发送方 | C6 | 发送方标示符，取  XSHG01 |
| 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’表示市场行情结束标志，未结束取‘0’。  第4位：‘1’表示上海市场行情结束标志，未结束取‘0’。 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

文件文件体定义，多条记录。

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

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | MDStreamID | 行情数据类型 | C5 | 行情数据类型标识符，取值  MD001 表示指数行情数据格式类型，其中指数目前实际精度为4位小数； |
| 2 | SecurityID | 产品代码 | C6 | 指数代码 |
| 3 | Symbol | 产品名称 | C8 | 指数简称 |
| 4 | TradeVolume | 成交数量 | N16 | 参与计算相应指数的交易数量，股票指数交易数量单位是100股，基金指数的交易数量单位是100份，债券指数的交易数量单位是手。 |
| 5 | TotalValueTraded | 成交金额 | N16(2) | 参与计算相应指数的成交金额，单位均为人民币元。 |
| 6 | PreClosePx | 昨日收盘价 | N11(4) | 前收盘指数 |
| 7 | OpenPrice | 今日开盘价 | N11(4) | 今开盘指数 |
| 8 | HighPrice | 最高价 | N11(4) | 最高指数 |
| 9 | LowPrice | 最低价 | N11(4) | 最低指数 |
| 10 | TradePrice | 最新价 | N11(4) | 最新指数 |
| 11 | ClosePx | 今收盘价 | N11(4) | 今收盘指数，无取值取空格 |
| 12 | TradingPhaseCode | 指数实时阶段及标志 | C8 | 该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  （预留） |
| 13 | Timestamp | 时间戳 | C12 | HH:MM:SS.000 |
|  |  | 扩展区域 | 不定 | 系统应能支持记录尾部扩展新的字段。 |

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

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 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  MD002 表示股票（A、B股）行情数据格式类型；  MD003 表示债券行情数据格式类型；  MD004 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 | N16 |  |
| 5 | TotalValueTraded | 成交金额 | 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) | 最新成交价 |
| 11 | ClosePx | 今收盘价 | N11(3) |  |
| 12 | BuyPrice1 | 申买价一 | N11(3) | 当前买入价 |
| 13 | BuyVolume1 | 申买量一 | N12 |  |
| 14 | SellPrice1 | 申卖价一 | N11(3) | 当前卖出价 |
| 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 | PreCloseIOPV | 基金T-1日收盘时刻IOPV | N11（3） | 可选字段，仅当MDStreamID=MD004时存在该字段。取前一日nav净值。 |
| 33 | IOPV | 基金IOPV | N11（3） | 可选字段，仅当MDStreamID=MD004时存在该字段。 |
| 34 | TradingPhaseCode | 产品实时阶段及标志 | C8 | 该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第1位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示开盘集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示产品停牌，‘M’表示可恢复交易的熔断时段（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断时段（暂停交易至闭市），‘U’表示收盘集合竞价时段。  第2位： ‘0’表示此产品不可正常交易，‘1’表示此产品可正常交易，无意义填空格。  第3位：‘0’表示未上市，‘1’表示已上市。  第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’ 表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。无意义填空格。 |
| 35 | 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。 |

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

文件尾定义，最后一行特殊记录：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 域名 | 字段名 | 字段类型 | 描述 |
| 1 | EndString | 结束标识符 | C7 | TRAILER |
| 2 | CheckSum | 校验和 | C3 | 校验和，3位校验和  校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包刮该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模256得出，然后转化为3位ASCII码。例如，如果经计算校验和为274，则模256后的数为18，校验和域将取为ASCII字符串018  校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。 |

## 行情数据库STEP接口

本接口指通过EzSR软件，以数据库STEP消息方式发布竞价行情的方式；

**数据格式**约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档；**STEP消息**约定参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格说明书》文档；

**通用数据库接口**参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP通用数据库接口规格；

本业务产品集编号（setid）为：300；

数据广播类型（bcasttype），本业务取值：0H；

recordtimestamp：格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.000，如果没有成交，时间部分为00:00:00.000

| **MktDataFull**（MDText） | **公共数据消息** |
| --- | --- |
| **描述：**  本消息用来发送市场有效时段内的所有的竞价行情信息，由后台向市场参与者消息单向发送。每条消息对应单个竞价行情信息。  本接口描述了竞价的行情发布方式之一，即采用STEP消息，通过数据库MDText字段发布。STEP消息中主要包含日中会发生变化的字段，同时仅提供当前最优的一档行情；在另一种行情文件mktdt00.txt接口中，则提供完整的交易相关信息和五档的行情数据。 | |

行情数据类型取值为MD001时：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***标签*** | ***域名*** | ***说明*** | | ***类型*** |
| **9** | BodyLength | 消息体长度 | | N9 |
| **35** | MsgType | 取值为W | | C16 |
| **963** | MDReportID | 交易所行情信息编号(预留、暂不填) | | C16 |
| **1187** | RefreshIndicator | 用于标识消息中是否有新的行情数据，暂填0 | | N5 |
| **1500** | MDStreamID | 竞价行情数据类型标识符（MD001，表示指数行情数据格式类型） | | C5 |
| **48** | SecurityID | 证券代码（指数代码） | | C8 |
| **8538** | TradingPhaseCode | 竞价交易状态，取值范围如下：  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。（对指数无意义） | | C8 |
| **8504** | TotalValueTraded | 总成交金额，精确到分 | | N16(2) |
| **387** | TradeVolume | 成交量 | | N16 |
| **140** | PreClosePx | 昨收盘价，单位：元 | | N11(4) |
| **268** | NoMDEntries | 行情条目个数，取值=1，本重复组依此包括成交价(269=3)，今收盘价(269=5)其中价格由MDEntryPx表示，数量由MDEntrySize表示。 | | N5 |
| **行情条目明细** | **269** | MDEntryType | 行情条目类别：  指数=3  今收盘价=5 | C2 | |
| **270** | MDEntryPx | 行情条目价格，单位：元（精确到0.1厘） | N11(4) | |
| **271** | MDEntrySize | 行情条目数量, 如果重复组不含数量信息，则此字段不出现 | N12 | |
|  |  |  | |  |

行情数据类型取值为MD002、MD003、MD004时：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| ***标签*** | ***域名*** | ***说明*** | | ***类型*** |
| **9** | BodyLength | 消息体长度 | | N9 |
| **35** | MsgType | 取值为W | | C16 |
| **963** | MDReportID | 交易所行情信息编号(预留、暂不填) | | C16 |
| **1187** | RefreshIndicator | 用于标识消息中是否有新的行情数据，取值：有=1,无=0，推送已有行情信息为0，否则为1 | | N5 |
| **1500** | MDStreamID | 竞价行情数据类型标识符  MD002 表示股票（A、B股）行情数据格式类型；  MD003 表示债券行情数据格式类型；  MD004 表示基金行情数据格式类型； | | C5 |
| **48** | SecurityID | 证券代码 | | C8 |
| **8538** | TradingPhaseCode | 该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。  第1位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示开盘集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示产品停牌，‘M’表示可恢复交易的熔断时段（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断时段（暂停交易至闭市），‘U’表示收盘集合竞价时段。  第2位： ‘0’表示此产品不可正常交易，‘1’表示此产品可正常交易，无意义填空格。  第3位：‘0’表示未上市，‘1’表示已上市。  第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’ 表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。无意义填空格。 | | C8 |
| **8504** | TotalValueTraded | 总成交金额，精确到分 | | N16(2) |
| **387** | TradeVolume | 成交量 | | N16 |
| **140** | PreClosePx | 昨收盘价，单位：元 | | N11(3) |
| **268** | NoMDEntries | 行情条目个数，取值=18，本重复组依此包括今开盘价(269=4)、今收盘价(269=5)、最高价(269=7)、最低价(269=8)、动态参考价格(269=x)（该价格即为断路器参考价）、成交价(269=2)、IOPV(269=v)(适用于MD004)、PreCloseIOPV (269=w)(适用于MD004)、以及五档买入价量信息(269=0，MDEntryPositionNo从1至5)、五档卖出价量信息(269=1，MDEntryPositionNo从1至5)，其中价格由MDEntryPx表示，数量由MDEntrySize表示。 | | N5 |
| **行情条目明细** | **269** | MDEntryType | 行情条目类别：  今开盘价=4  今收盘价=5  最高价=7  最低价=8  动态参考价格=x  IOPV＝v（适用于MD004）  PreCloseIOPV = w（适用于MD004）  成交价=2  买入=0  卖出=1 | C2 | |
| **270** | MDEntryPx | 行情条目价格，单位：元（精确到厘） | N11(3) | |
| **271** | MDEntrySize | 行情条目数量, 如果数据组不含数量信息，则此字段不出现 | N12 | |
| **290** | MDEntryPositionNo | 行情条目买卖盘序号, 对应五档买入卖出价量的档位信息，否则此字段不出现 | N3 | |

说明，在集合竞价时段内：

1. 当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第一档行情同时为动态参考价格，即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格；

2. 同时，当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第一档行情数据中的申买量和申卖量分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟匹配量。

3. 同时，当前五档买入价（269=0）和当前五档卖出价（269=1）中的第二档行情数据中的申买量和申卖量分别为行情发布时刻的买方和卖方虚拟未匹配量。

## 申报接口ordwth

| **Ordwth** | **申报接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  数据库表接口为市场参与者提供一个单一的队列，市场参与者系统将委托写入接口数据库表，然后由SSE接口机程序按序读取接口数据库表中记录，依次发送到后台。**SSE接口机程序访问该表时，主要通过rec\_num字段进行定位，故必须以rec\_num为Key建立索引，或者作为主键。**  某些柜台系统采用插入空记录的方式来处理一些极端场景。为统一理解，判断空记录的依据是stock、acc、reff这3个字段为空。  该接口除了支持标准的“交易买卖、撤单”业务以外，还采用对特定的非交易代码进行买卖的方式来支持一系列的“非交易业务”。  对于非交易业务，有如下约定：   1. 买入网络密码服务代码（A股帐户：799988；B股帐户：939988）转义为激活或者注销网络密码业务。激活密码时买入价格1.000，买入数量为投资者在上交所网站注册时所获得的激活码。注销密码时买入价格2.000，买入数量为2。不可撤单。 2. 买入回购注销代码（799996）转义为回购注销。买入价格为1.000。买入数量为1。 3. 买入指定撤销代码（799998）转义为指定撤销。买入价格为1.000。买入数量为1。指令即时处理，不可撤单。 4. 买入指定登记代码（799999）转义为指定登记。买入价格为1.000。买入数量为1。指令即时处理，不可撤单。 5. 买入发行申购、按市值资金申购代码（730\*\*\*、780\*\*\*；700\*\*\*、760\*\*\*；731\*\*\*、781\*\*\*；737\*\*\*、787\*\*\*；733\*\*\*、783\*\*\*、732\*\*\*、754\*\*\*等等）或者ETF认购代码（ETF代码组第4个代码）转义为对对应证券参与申购；询价模式时输入价格，其他模式下输入发行价格（ETF网上现金认购买入价格为1.000）。买入数量以1000为最小单位。股票申购不可撤单，ETF认购可以撤单。新交易系统切换后，系统支持对除700\*\*\*、760\*\*\*\*的老股东定价增发之外的各种不即刻产生成交回报记录的申购/认购订单，配置为可撤单或者不可撤单，具体采用可撤单或者不可撤单的业务规则，以发行公告为准。600\*\*\*股票、601\*\*\*股票对应的新股资金定价/询价申购或者新股东定价/询价增发（摇号中签）发行代码为730\*\*\*、780\*\*\*；老股东定价增发（类似配股）发行代码为700\*\*\*、760\*\*\*；老股东询价增发（比例中签）为731\*\*\*、781\*\*\*；股票市值配售（已停止）首发为737\*\*\*、787\*\*\*；可转债资金申购为733\*\*\*、783\*\*\*。 6. 卖出配股代码（700\*\*\*、760\*\*\*； 702\*\*\*、762\*\*\*；704\*\*\*、764\*\*\*、742\*\*\*、753\*\*\*等等）转义为对对应证券参与配股。卖出价格为配股价。卖出数量为参加配股的数量。指令即时处理，不可撤单。600\*\*\*股票、601\*\*\*股票对应的配股代码为700\*\*\*、760\*\*\*；职工股配股代码为702\*\*\*、762\*\*\*；配转债代码为704\*\*\*、764\*\*\*。 7. 卖出要约收购代码（706\*\*\*）转义为对对应的股票进行要约收购登记。卖出价格为收购价。卖出数量以1股为最小单位。可撤单。股票的要约收购代码为706\*\*\*，与股票代码没有直接的对应关系，需要根据上交所在要约收购业务开始之前发布的公告决定。 8. 买入要约收购代码转义为对对应的股票进行要约收购撤销。买入价格为收购价。买入数量以1股为最小单位。可撤单。 9. 卖出可转债转换代码（181\*\*\*或者190\*\*\*、191\*\*\*）转义为对对应可转换债券进行转换登记。卖出价格填100。卖出数量以手为最小单位。目前暂配置为不支持撤单。100\*\*\*或者110\*\*\*可转债对应的股票代码为600\*\*\*，其对应的可转债转换代码为181\*\*\*或者190\*\*\*。113\*\*\*可转债产品对应的股票代码为601\*\*\*，其对应的可转债转换代码为191\*\*\*。   卖出可交换公司债换股代码（192\*\*\*）转义为对对应可交换公司债券进行换股登记。卖出价格填100。卖出数量以手为最小单位。目前暂配置为不支持撤单。   1. 卖出可转债回售代码（1009\*\*）转义为对对应的可转债进行回售登记。卖出价格填公告的回售价格。可转债回售代码为1009\*\*，与可转债没有直接的对应关系，需要根据上交所在回售业务开始之前发布的公告决定。 2. 买入权证行权代码（582\*\*\*）转义为对对应权证进行行权。买入价格为行权价格。买入数量以份为最小单位。可撤单。580\*\*\*权证对应的行权代码为582\*\*\*。 3. 买入开放式基金申购/赎回代码（519\*\*\*）转义为对对应的开放式基金的申购。买入价格为1.000。买入时数量为申购金额，单位为元，目前不支持小数。可撤单。 4. 卖出开放式基金申购/赎回代码（519\*\*\*）转义为对对应的开放式基金的赎回。卖出价格为1.000。卖出时数量为为赎回基金份额，单位为份，目前不支持小数。可撤单。 5. 买入开放式基金认购代码（521\*\*\*）转义为对对应的开放式基金的认购。价格为1.000。数量为认购金额，单位为元，目前不支持小数。可撤单。 6. 卖出开放式基金份额转托管代码（522\*\*\*）转义为对对应的开放式基金的转托管转出。价格字段的含义为对方对应的销售人代码，取值为000-999，可输入8.00这样小数点后为00的数字。数量为基金份额，单位为份，目前不支持小数。可撤单。 7. 买入开放式基金分红设置代码（523\*\*\*）转义为对对应的开放式基金设置分红方式。价格为分红方式代码（100元：红利转投，101元：现金分红），数量为100无意义，交易系统检验该数量不得大于100。可撤单。 8. 卖出开放式基金转换代码（524\*\*\*）转义为对对应的开放式基金转换为其他基金。价格字符串（519.\*\*\*）移去小数点后转义为目标基金代码。数量为基金份额，单位为份，目前不支持小数。可撤单。 9. 卖出账户式质押回购出入库代码（09\*\*\*\*）转义为对对应债券进行入库。价格为1.000。数量以手为最小单位。不可撤单。00\*\*\*\*国债和01\*\*\*\*国债对应的账户式质押回购出入库代码为09\*\*\*\*。 10. 买入账户式质押回购出入库代码（09\*\*\*\*）转义为对对应债券进行出库。价格为1.000。数量以手为最小单位。不可撤单。 11. 买入ETF申购赎回代码（ETF代码组第2个代码）转义为对对应ETF的申购，即把成分证券置换为ETF。价格为1.000。数量的最小单位以基金管理公司公布的信息为准。（比如510050以100万份为最小单位）。不可撤单。 12. 卖出ETF申购赎回代码（ETF代码组第2个代码）转义为对对应ETF的赎回，即把ETF置换为成分证券。价格为1.000。数量的最小单位以基金管理公司公布的信息为准。不可撤单。 13. 跨境ETF申赎业务通过综合业务平台接口实现，本接口不支持。 14. 货币市场基金实时申赎业务的认购参照开放式基金认购，价格为1.000，货币市场基金实时申购赎回通过综合业务平台接口实现。 15. 交易所后续新增产品代码以及非交易代码，参见相关发文通知，本文档将逐步补充。   投资者要进行融资融券信用交易，需向具备融资融券业务资格的证券公司申请，开设E 字头的**“投资者信用证券账户”**。E帐户所有的申报订单类型必须为信用交易类，即不得为“\_PT”或者“ORD”。E帐户可进行的非交易业务申报含：配股申报、配债申报、权证行权申报以及下文的4种证券划转业务申报，也可进行发行类业务申报（具体参考交易所通知），订单类型必须为“LXY”。  开展融券业务的证券公司必须在中登公司开设**“证券公司融券专用账户”**， 存放自有证券，供投资者进行融券交易。证券公司融券专用账户不得进行任何申报。  开展融券业务的证券公司还必须在中登公司开设**“证券公司信用交易担保证券账户”**，该帐户与**“投资者信用证券账户”**之间是总帐与二级明细帐的关系，用于记载投资者委托证券公司持有的担保证券的明细数据，对应明细数据由中登公司维护。证券公司信用交易担保证券账户不得进行任何申报。   1. 买入余券划转代码（799981）转义为从**“证券公司融券专用账户”**过户到**“证券公司信用交易担保证券账户”**。买入价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。买入数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。可撤单。 2. 卖出还券划转代码（799982）转义为从**“证券公司信用交易担保证券账户”**过户到**“证券公司融券专用账户”**。卖出价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。卖出数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。可撤单。 3. 买入担保品划转代码（799983）转义为从**“投资者普通证券账户”**过户到**“证券公司信用交易担保证券账户”**。卖出担保品划转代码（799983）转义从**“证券公司信用交易担保证券账户”**过户到**“投资者普通证券账户”**。申报价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。申报数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为投资者信用证券账户（E 字头账户），订单类型必须为“LXY”。可撤单。 4. 买入券源划转代码（799984）转义为从**“证券公司融券专用账户”**过户到**“证券公司自营账户”**。卖出券源划转代码（799984）转义为从**“证券公司自营账户”**过户到**“证券公司融券专用账户”**。申报价格转义为被划转的标的证券代码（例如：中国银行，对应为：601.988）。申报数量为申请划转数量，允许为零散股。申报帐户必须为证券公司自营证券账户，订单类型必须为“LPT”或者“ORD”。可撤单。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | rec\_num | 记录编号，连续递增且唯一。  （2009年11月23日前，规定必须从1开始）新交易系统切换后，不再严格要求rec\_num从1开始，只要连续递增即可。  新交易系统通过后台保证不重复处理前台提交的同一个PBU同一个产品相同rec\_num的订单的原理，提供在一些极端故障场景时，既不丢单，也不重单的能力。  但是，如果申报表完全损坏，市场参与人启用备份数据库，那么为继续后续的报单业务，需要在新的空申报表中直接插入后续订单。为避免后台认为是启用备份前某一个订单的重复提交，在切换时，后续订单的rec\_num编号必须超过已经向交易所发出的rec\_num号，市场参与者可以通过累加一个其业务上不可能发生的值比如1000万，来避免重单。举例如下：  第一次订单申报到8978笔，sql数据库发生故障需要进行切换。  到新的sql数据库的申报表中只需要直接从rec\_num 10000001开始插起便可重新登录报盘程序申报。如果之后还又需要进行切换，则直接从rec\_num 20000001开始插新订单。如此类推。但是，由于原接口设计中撤单编号字段最宽为C8，所以输入rec\_num超过1亿将无法撤单，故切换的次数是有限的。 | 4字节Integer |
| 2 | date | 记录写入日期，格式为YYYYMMDD  在报盘程序启动之时，系统检查如果存在不是当前交易日的订单申报，会直接报错，拒绝登录。在启动之后，如果市场参与者新插入的订单申报日期不是当前交易日，该订单申报将作为废单处理。 | C8 |
| 3 | time | 记录写入时间，格式为HH:MM:SS | C8 |
| 4 | reff | 会员内部订单号，在整个申报的生命周期中，比如成交回报中，都会附带此数据作为标识字段，柜台系统可以利用此编号进行对应处理。  对于EzOES 2009版（2009年5月发布）以及EzOES 2009Update2版（2009年12月发布）的版本，该字段第1和2字节填写营业部代码的转换码。营业部代码的转换码的生产方法可参见附录：营业部代码换码算法示例。此时营业部代码使用区间为[1000，4843]。各会员营业部代码可查阅本所网站www.sse.com.cn->会员专区->会员信息->基本信息。reff字段后8个字节必须为数字，区间为[00000001，99999999]，注意后8个字节数字长度不足8位时，填写时请在左侧补0。  对于EzOES 2010版（2010年5月发布）及之后的版本，如果新增的branchid字段的取值为NULL、空或者若干空格时，该字段的用法同以前版本；否则在第1和第2字节不再填写营业部代码的转换码，整个reff字段全部作为会员内部订单号使用，取值为数字，区间为[0000000001，3999999999]。注意数字长度不足10位，填写时请在左侧补0。 | C10 |
| 5 | acc | 证券账户 | C10 |
| 6 | stock | 证券代码，可能是一个实际的可交易产品，也可能是一个非交易业务所用的辅助代码。转义发生在证券代码为非交易代码时。 | C6 |
| 7 | bs | 买卖方向，当stock（字段6：证券代码）为一个实际的可交易产品时，‘B’或者‘b’代表买入，‘S’或者‘s’代表卖出。 | C1 |
| 8 | price | 申报价格。债券交易申报价格为“每百元发行面值债券价格”，债券质押式回购交易申报价格为“每百元资金到期年收益”, 债券买断式回购申报价格为“每百元面值债券到期购回价格”。其它为每股或者每份价格。如果该字段小数点后数字超过3位，3位之后必须为0。  对于交易业务，不能输入price字段超过1万元的订单。  当订单类型为最优五档即时成交剩余撤销市价订单或者最优五档即时成交剩余转限价市价订单时，该字段取值为1.000。 | C8 |
| 9 | qty | 申报数量。债券交易、债券回购交易申报数量的单位为手（1000元发行面值为一手）。其它为股或者份。 | C8 |
| 10 | status | 发送状态，‘R’或‘r’表示该记录还没有发送，‘P’表示已发往上交所后台。**该字段是本表中唯一会被上交所报盘接口程序修改的字段。**柜台系统可以通过该字段来判断是否已经向上交所发送该申报。 | C1 |
| 11 | owflag | 订单类型标志，该字段取值大小写不敏感。  “WTH”表示撤单。正常情况下，当取值为“WTH”时，acc（字段5：证券账户）、stock（字段6：证券代码）、bs（字段7：买卖方向）、price（字段8：申报价格）、qty（字段9：申报数量）取值必需与原申报相同，ordrec（字段12：撤单编号）取值为待撤单的rec\_num。  新交易系统切换后，为便于市场参与人在其柜台系统发生灾难性故障后的后续处理，上交所不再要求待撤销申报所对应的申报表记录和申报确认表记录在数据库中存在。如果待撤销申报所对应的申报表记录已不存在，市场参与人在 rec\_num、date、time、reff、status、owflag字段提供本笔撤单申报自身的内容，在acc字段、stock字段、bs字段、price字段、qty字段提供待撤订单的原内容，在ordrec字段提供待撤订单的原rec\_num内容，即可完成撤单。  对于限价订单、市价订单以及融资融券有关业务，该字段按下列规则取值：   1. 该字段的第一位取值作为区分限价订单与市价订单的标志，取值方式如下：  * 为‘L’表示限价订单； * 为‘M’表示最优五档即时成交剩余撤销的市价订单，含义为该申报在对手方实时最优五个价位内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销； * 为‘N’ 表示最优五档即时成交剩余转限价的市价订单，含义为该申报在对手方实时五个最优价位内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本申报最新成交价转为限价订单；如无对手方申报与该申报成交的，则按本方最优报价转为限价订单；如无本方申报的，该市价订单自动撤销；  1. 该字段的第二位和第三位为信用标签：  * 取值为“PT”，表示普通的不参加融资融券的订单； * 为“XY”表示担保品买卖，acc（字段5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当bs（字段7：买卖方向）为‘B’或‘b’表示买入担保品申报，stock（字段6：证券代码）必须为可作为担保品的证券；为‘S’ 或‘s’表示卖出担保品申报，stock（字段6：证券代码）为除回购外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证； * 为“RZ”表示融资交易，acc（字段5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户； 当bs（字段7：买卖方向）为‘B’ 或‘b’表示融资买入申报，stock（字段6：证券代码）必须为可融资买入的证券；为‘S’ 或‘s’表示在投资者信用证券账户中进行卖券还款申报，stock（字段6：证券代码）为除回购外的股票、封闭式基金、ETF、国债、转债、权证； * 为“RQ”表示融券交易，acc（字段5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户；当bs（字段7：买卖方向）为‘B’ 或‘b’表示买券还券申报 ，stock（字段6：证券代码）必须为可买券还券的证券；为‘S’ 或‘s’，表示融券卖出申报，stock（字段6：证券代码）必须为可融券卖出的证券。注：融券交易时不允许以市价订单的方式卖出； * 为“PC”表示平仓交易，acc（字段5：证券账户）必须为投资者信用证券帐户。当bs（字段7：买卖方向）为‘B’ 或‘b’表示市场参与者进行平仓买入申报，stock（字段6：证券代码）必须为融券卖出或被调出融券卖出范围但有合约未到期的证券；为‘S’ 或‘s’，表示市场参与者进行平仓卖出申报，stock（字段6：证券代码）必须为可卖券还款的证券。   为保持与以前接口的兼容，对于普通限价订单和非交易业务申报（比如指定登记、指定撤销等等），该字段取值既可为“LPT”，也可为“ORD”。 | C3 |
| 12 | ordrec | 撤单编号 | C8 |
| 13 | firmid | B股结算会员代码，对于A股投资者取值无意义。  对于B股境外投资者C9类帐户此记录不能为空，填写B股结算会员代码。（2009年11月23日之前，如果结算会员代码头两位为00，须替换为两个空格）新交易系统切换后，可以直接填写中登公司公布的结算会员代码，即如果头两位为00，无需变换，也可保持原方式将头两位为00的替换为两个空格。  对于B股境内投资者C1类帐户可以不填。 | C5 |
| 14 | branchid | 营业部代码  对于EzOES 2010版及之后的版本，该字段填写营业部代码的5位正式编码。营业部代码由本所统一编制，以五个数字表示，代码使用区间为[01000，59999]。各会员营业部代码可查阅本所网站www.sse.com.cn->会员专区->会员信息->基本信息。  如果该字段填写了营业部代码，请不要在reff字段的头两个字符处填写过时的营业部代码的转换码。填写时，若营业部代码数字不足5位的，请在填写时左侧补0。  对于不需要在该字段填写营业部代码的，该字段取值为NULL或者若干个空格。 | C5 |
| 15 | checkord | 校验码，上交所内部使用 | Binary |

## 申报确认接口 ordwth2

| **ordwth2** | **申报确认接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  SSE接口机在接收到后台返回的订单响应之后，写入到接口数据库表中。每一个申报记录都会有一个对应的申报确认记录。市场参与者系统可以从该表读取上交所处理申报后返回的确认数据。  **SSE接口机程序访问该表时，主要通过rec\_num字段进行定位，故必须以rec\_num为Key建立索引，或者作为主键。**  rec\_num（字段1：记录编号）、date（字段2：记录写入日期）、reff（字段4：会员内部订单号）、acc（字段5：证券账户）、stock（字段6：证券代码）、bs（字段7：买卖方向）、price（字段8：申报价格）、qty（字段9：申报数量）、owflag（字段14：撤单标志）、ordrec（字段15：撤单编号）、firmid（字段16：B股结算会员代码）、checkord（字段17：校验码）对应申报接口中同名字段。status1（字段12：发送标志）对应申报接口的status字段。以上字段供上交所内部使用，柜台系统不得使用以上字段。  新交易系统切换后，如果申报确认表ordwth2数据损坏，且申报表ordwth正常，那么基于交易系统后台保证同一个PBU同一个证券产品相同 rec\_num的订单不会被重复处理的原理，市场参与人可以重新设置申报表ordwth中有关记录的status字段为‘R’，通过重新登录报盘程序触发报盘机向后台重发该申报，从而选择性地恢复申报确认数据。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | rec\_num | 记录编号，上交所内部使用  新交易系统切换后，由于后台并行可扩展架构的特征，申报确认记录在写入申报确认接口表时，不是按照rec\_num顺序严格递增的方式写入。 | 4字节Integer |
| 2 | date | 记录写入日期，上交所内部使用 | C8 |
| 3 | time | 接收确认时间，记录报盘程序从后台收到委托确认或者在报盘机本地就判断为废单时，修改委托表中对应记录的status为‘P’，同时把确认记录写入委托确认表的时间。格式为HH:MM:SS  报盘程序更新委托表中status字段和在委托确认表中写入确认记录是在同一个事务内的。如果通过把委托表的status字段修改为“R”后，向后台重传委托记录，那么委托确认表中该字段填写的是后台收到重传后，给出再次确认的时间，而不是上一次委托发送时后台给出确认的时间。 | C8 |
| 4 | reff | 会员内部订单号，上交所内部使用 | C10 |
| 5 | acc | 证券账户，上交所内部使用 | C10 |
| 6 | stock | 证券代码，上交所内部使用 | C6 |
| 7 | bs | 买卖方向，上交所内部使用 | C1 |
| 8 | price | 申报价格，上交所内部使用 | C8 |
| 9 | qty | 申报数量，上交所内部使用 | C8 |
| 10 | status | 接收状态，  ‘F’表示交易所后台判断该订单为废单。  ‘E’表示交易所前台判断该订单为废单；此时remark（字段12：错误信息）给出错误代码。  ‘?’表示通信故障。  ‘O’表示上交所成功接收该笔申报。  ‘W’表示上交所成功接受该笔撤单；  当订单类型为最优五档即时成交剩余自动撤销的市价订单时，且订单有效时，该字段取值为‘W’。 | C1 |
| 11 | qty2 | 撤单数量，  对于限价订单申报记录，该字段为空；  对于撤单记录，该字段为实际撤单返回数量；  对于最优五档即时成交剩余自动撤销的市价订单，如果申报部分成交，该字段取值为自动撤单的数量；如果申报全部成交，则该字段取值为0。 | C8 |
| 12 | remark | 错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。详细说明参见附录：“申报确认接口remark字段取值说明”。 | C30 |
| 13 | status1 | 发送状态，上交所内部使用 | C1 |
| 14 | teordernum | 主机订单编号，上交所内部使用。  新交易系统切换后， teordernum（字段14：主机订单编号），只在同一个证券代码内唯一，不在整个市场内唯一。该字段供上交所内部使用，柜台系统不得使用。 | C8 |
| 15 | owflag | 订单类型标志，上交所内部使用 | C3 |
| 16 | ordrec | 撤单编号，上交所内部使用 | C8 |
| 17 | firmid | 席位编号，上交所内部使用 | C5 |
| 18 | branchid | 营业部代码，上交所内部使用 | C5 |
| 19 | checkord | 校验码，上交所内部使用 | Binary |

## 成交回报接口 cjhb

| **Cjhb** | **实时成交回报接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  SSE接口机在接收到后台返回的成交确认之后，写入到接口数据库表中。市场参与者系统可以从该表读取上交所处理申报后返回的成交确认数据。  **SSE接口机程序访问该表时，主要通过cjbh和bs字段进行定位，该表必须以(cjbh,bs)为Key建立索引，或者作为主键。**  除了标准的“交易”导致的成交确认外，实时成交回报接口进行“转义”支持一些其他业务。   1. 配股成功后，为配股者产生证券代码zqdm为配股代码，成交价格cjjg为配股价格，成交金额cjje为配股金额，成交数量cjsl为配股数量，买卖方向bs为S的实时成交回报记录。为承销商产生买卖方向bs为B的实时成交回报记录。 2. 账户式质押回购入库成功后，产生如下3条实时成交回报记录：   1） 成交价格cjjg与成交金额cjje为0，成交数量cjsl为申请入库数量，买卖方向bs为S，证券代码zqdm为出入库代码的成交记录；  2） 成交价格cjjg与成交金额cjje为0，成交数量cjsl为申请入库数量，买卖方向bs为S，证券代码zqdm为现券的成交记录；  3） 成交价格cjjg与成交金额cjje为0，成交数量cjsl为折算后数量，买卖方向bs为B，证券代码zqdm为标准券(888880)的成交记录。   1. 账户式质押回购出库成功后，产生与入库成功后买卖方向相反的实时成交回报记录。 2. 对于单一市场的ETF产品，系统分配如下一组证券代码：ETF证券代码、ETF申购赎回代码、ETF沪市资金代码、ETF认购代码、ETF认购扣款还款代码。对于跨市场ETF，新设一个非交易代码：ETF非沪市资金代码。ETF申购成功后，为申购者产生如下实时成交回报记录：（为ETF基金管理公司产生成交回报的方式参见ETF基金管理公司接口规格说明书。）   1） 成交价格cjjg与成交金额cjje为0，成交数量cjsl为申购数量，买卖方向bs为B，证券代码zqdm为基金（ETF代码组第1个代码，比如510050）的成交记录。  2）对于跨市场ETF，申购成功后，产生1到2条买卖方向bs为B，证券代码zqdm为非沪市资金代码（ETF代码组第6个代码，比如510305）的成交记录。当现金替代值超过1000元，会拆分为2条记录，其中成交数量cjsl为资金比例因子，填1或1000000。成交价格cjjg为现金值；成交金额cjje为金额=cjsl×cjjg。该值是替代标志为3、4的成分股实际替代金额之和。  3） 成交价格cjjg与成交金额cjje为0，成交数量cjsl为过户数量，买卖方向bs为S，证券代码zqdm为成分证券的成交记录；对于ETF基金管理公司规定的当日必须用现金替代的成分证券，没有该成分证券的成交记录。  4） 0到2条买卖方向bs为B，证券代码zqdm为沪市资金代码（ETF代码组第3个代码，比如510052）的成交记录。当现金替代值超过1000元，会拆分为2条记录，其中成交数量cjsl为资金比例因子，填1或1000000。成交价格cjjg为现金值；成交金额cjje为金额=cjsl×cjjg。该值是替代标志为1和2的成分股实际替代金额之和。  5） 成交价格cjjg与成交金额cjje为0，成交数量cjsl为申购数量，买卖方向bs为B，证券代码zqdm为ETF申购赎回代码（ETF代码组第2个代码，比如510051）的成交记录。   1. 替代金额的精度算法为：每个股票先计算出金额四舍五入到小数点后三位，然后将各个股票的替代金额相加，最后结果四舍五入到小数点后两位。 2. ETF赎回成功后，产生买卖方向与申购成功后相反的实时成交回报记录。 3. 对于跨境ETF申赎，在综合业务平台实现，本接口不支持。   如果最近收到的成交回报记录丢失，报盘机会在重新登录时自动从后台补回。但是，对于中间若干成交回报记录被人工删除，报盘机不会在登录时自动补回。  如果市场参与人发生灾难性故障，导致成交回报表完全损坏，需要启动其灾备系统时，那么为快速恢复，市场参与人可以按照如下方法控制报盘程序EzOes只从交易所后台恢复必要的成交数据。  假设如下：  假设1：市场参与者柜台系统的数据库中把与交易所成交回报表对应字段全部复制，其表名为 sscj （实时成交）。  假设2：市场参与人柜台系统为cjhb接口表表增加了自增长字段xh序号，且柜台系统已经处理了 xh为12345的记录。  灾备恢复步骤，举例如下：  步骤1：利用如下类似SQL语句，从柜台系统中取出相关数据  SELECT gdxm, MAX(bcye) FROM sscj GROUP BY gdxm  假设取回结果为  3 0000034160  2 0000179343  1 0000162260  4 0000059770  (注意，几条结果和当日实际成交情况有关)  步骤2：然后利用如下类似SQL语句，将以上数据插入到报盘接口的 cjhb表中，示例中'本次日期'请填写YYYYMMDD格式的日期。  SET IDENTITY\_INSERT cjhb ON  INSERT INTO ashare\_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cjjg, cjje, sqbh,bs, mjbh)  VALUES(12346, '3','0000034160','','本次日期', 3, '','','','','','','','','','') 。  INSERT INTO ashare\_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cjjg, cjje, sqbh,bs, mjbh)  VALUES(12347, '2','0000179343','','本次日期', 2, '','','','','','','','','','')  INSERT INTO ashare\_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cjjg, cjje, sqbh,bs, mjbh)  VALUES(12348, '1','0000162260','','本次日期', 1, '','','','','','','','','',''  INSERT INTO ashare\_cjhb(xh, gdxm,bcye, gddm, bcrq, cjbh, gsdm, cjsl, zqdm, sbsj, cjsj, cjjg, cjje, sqbh,bs, mjbh)  VALUES(12349, '4','0000059770','','本次日期', 4, '','','','','','','','','','')  SET IDENTITY\_INSERT cjhb OFF  注意，以上cjbh字段按照gdxm的数字来填写，目标是为了防止cjbh重复而导致冲突。  步骤3：在确认报盘接口的cjhb中相关记录插入正确后，开启报盘程序 EzOes，报盘程序可以继续从后台恢复柜台系统尚未处理的成交记录。  注：如果市场参与人不提供上述成交记录，开启报盘程序，报盘程序EzOes在发现cjhb表中，没有任何数据后，将从交易所后台恢复当日所有的成交数据，供市场参与者处理。此时，市场参与者可能需要逐条比对，确定哪一条记录已经在柜台里了，对柜台系统的性能有一定影响。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | gddm | 证券账户 | C10 |
| 2 | gdxm | 股东姓名，新交易系统切换后，上交所不再在该字段填写股东姓名，而在该字段填写该产品所属产品集SET的编号。在新交易系统上线点，A股产品集SET的取值为’1’、’2’、’3’、’4’、’5’、’6’、’991’。B股产品集SET的取值为’20’。 在一个交易日内，SET的有关配置不会发生变化。未来如有产品集的扩充，另行通知。 | C8 |
| 3 | bcrq | 成交日期，格式为YYYYMMDD | C8 |
| 4 | cjbh | 成交编号  新交易系统切换后，由于后台并行可扩展架构的特征，成交记录在写入cjhb接口表时，不是按照成交编号顺序严格递增的方式写入。  由于数据库表作为ResultSet的概念，与文件不同，没有物理序的概念，所以为便于市场参与人柜台系统处理该接口表，可在该表增加一个自增长字段（Auto Incremental Identity），比如为xh序号。柜台系统可以通过访问该字段来逐条处理成交回报记录。  注：对于xh序号字段，由于采用自增长的方式，如果对该表进行手工Truncate操作，将导致该字段被重置，所以，如果进行手工Truncate操作后，需要手工设置xh序号字段的起始值。 | 4字节Integer |
| 5 | gsdm | 席位号 | C5 |
| 6 | cjsl | 成交数量，单位为股(股票)或份(基金)或手(债券及回购)。 | C10 |
| 7 | bcye | 本次余额，新交易系统切换后，上交所不再在该字段填写本次余额，而在该字段填写该成交在对应产品集内的序列号。上交所按照同一SET内序列号“字典序”严格递增的方式写入成交记录，即会在左边补0，例如‘10’存储为 ‘0000000010’。 | C10 |
| 8 | zqdm | 证券代码 | C6 |
| 9 | sbsj | 申报时间，格式为HHMMSS | C6 |
| 10 | cjsj | 成交时间，格式为HHMMSS | C6 |
| 11 | cjjg | 成交价格，单位为人民币元(A股、基金、债券)或美元(B股)或每百元资金的年收益率(国债回购)。精度为小数点后3位。 | C8 |
| 12 | cjje | 成交金额。精度为小数点后2位。  对于证券代码为非交易业务代码的成交金额的取值，参见前文描述。  普通交易时，该字段的取值方式如下：   * 对应股票、封闭式基金、ETF、权证产品，该字段为成交价格cjjg\*成交数量cjsl。 * 对应债券产品，该字段为成交价格cjjg\*成交数量cjsl\*10。 * 对应席位质押式国债回购代码201\*\*\*、席位质押式企业债回购代码202\*\*\*以及账户质押式国债回购代码204\*\*\*时，（2009年11月23日前，该字段为成交价格cjjg\*成交数量cjsl\*10）。新交易系统切换后，将采用与行情一致的计算方式，即100\*成交数量cjsl\*10。 * 对应买断式国债回购代码203\*\*\*时，（2009年11月23日前，该字段为成交价格cjjg\*成交数量cjsl\*10）。新交易系统切换后，将采用与行情一致的计算方式，即基础产品昨日收盘价\*成交数量cjsl\*10。   **如果实际成交金额超过999,999,999.99，系统会填写-1，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，可采取如自行计算或拆分调整，盘后采用登记结算数据或其他方式处理，做好该异常的识别和处理。** | C12 |
| 13 | sqbh | 会员内部订单号，同申报接口中的reff（字段4：会员内部订单号）。 | C10 |
| 14 | bs | 买卖方向，同申报接口中的bs（字段7：买卖方向）。 | C1 |
| 15 | mjbh | 操作员代码 | C5 |

# 盘后数据接口规范

本部分描述了上交所交易系统发布给柜台系统的一些文件接口。

历史上把ghXXXXX.dbf压缩为ghXXXXX.zip，把zxwXXXXX.dbf和zzhXXXXX.dbf压缩为zdXXXXX.all文件。新交易系统上线后，zxwXXXXX.dbf和zzhXXXXX.dbf分别压缩为zxwXXXXX.zip和zzhXXXXX.zip。zqyXXXXX.dbf压缩为zqyXXXXX.zip。基金公司及托管行gh和zqy压缩至sse文件中。

## 过户数据接口 ghXXXXX.dbf

| **ghXXXXX.dbf** | **过户数据接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示席位号。闭市后发送。  该接口文件的组织形式和主要内容同实时成交回报数据接口。由于数据库表与DBF文件表述的不同，成交编号、成交数量、本次余额、成交价格、成交金额的类型略有不同。  新交易系统切换后，不再按照cjbh字段排序。  新交易系统切换后，对于B股PBU同样产生该接口文件。  对于需要转义的非交易业务，一些没有包含在实时成交回报数据接口中的记录，通过盘后过户数据接口传送给参与者。  下文中，未申明特别填写方式的字段，均填写对应订单输入时的原始信息。   1. 指定撤销成功后，产生证券代码zqdm为799998，（全市场成交编号cjbh从当前A股最大成交编号+1开始连续递增，）成交数量cjsl为0，成交价格cjjg为0，成交金额cjje为0，成交时间cjsj为150000，买卖方向bs为B的过户记录。 2. 指定登记成功后，产生证券代码zqdm为799999，（全市场成交编号cjbh从指定撤销最大成交编号+1开始连续递增，）成交数量cjsl为0，成交价格cjjg为0，成交金额cjje为0，成交时间cjsj为150000，买卖方向bs为B的过户记录。 3. 对于发行业务，过户库会在多日均含有有关数据。   **资金申购发行过户库记录说明：**   * 申购日盘后过户文件中包含发行扣款记录。证券代码zqdm为发行扣款/还款代码（比如740\*\*\*）；全市场成交编号不超过7位，成交时间cjsj填写150000，全市场成交编号超过7位，成交时间cjsj为111111~999999，分别对应成交编号超过7位时，第8位为1~9的情况（成交编号cjbh为-1,-2,…-9999999）。成交数量cjsl为申购数量；成交价格cjjg为申购价格；成交金额cjje为扣款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向bs为B的记录。 * 配号日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码zqdm为发行配号代码（比如741\*\*\*）；成交编号cjbh指配号的首个号码；成交数量cjsl指配号成功的数量；成交价格cjjg为0；成交金额cjje为0；当配号不超过8位时，成交时间cjsj填写150000，当成交时间cjsj为111111~999999时，分别对应配号超过8位时，第9位为1~9的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向bs为B。 * 还款中签日盘后过户文件中包含还款记录。证券代码zqdm为发行扣款/还款代码（比如740\*\*\*）；全市场成交编号不超过7位，成交时间cjsj填写150000，全市场成交编号超过7位，成交时间cjsj为111111~999999，分别对应成交编号超过7位时，第8位为1~9的情况（成交编号cjbh为-1,-2,…-9999999）。成交数量cjsl为T日申购数量；成交价格cjjg为T日申购价格；成交金额cjje为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向bs为S。 * 还款中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码zqdm为申购/中签代码（比如730\*\*\*）；成交编号cjbh指中签号；成交数量cjsl指中签数量；成交价格cjjg指最终确定的发行价格；成交金额cjje等于分配数量乘以发行价格；当配号不超过8位时，成交时间cjsj填写150000，当成交时间cjsj为111111~999999时，分别对应配号超过8位时，第9位为1~9的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向bs为B。   **ETF认购返回数据说明（成交编号扩位规则同上）：**   * 申购日盘后过户文件中包含认购扣款记录。证券代码zqdm为ETF现金认购扣款/还款代码（ETF代码组第5个代码例如510054）；（全市场成交编号cjbh为-1,-2,…；）成交数量cjsl为申购数量；成交价格cjjg为申购价格；成交金额cjje为扣款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向bs为B的记录。 * 还款中签日盘后过户文件中包含认购还款记录。证券代码为ETF现金认购扣款/还款代码（ETF代码组第5个代码，比如510054）；（全市场成交编号cjbh为-1,-2,…；）成交数量cjsl为T日申购数量；成交价格cjjg为T日申购价格；成交金额cjje为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向为S的记录。 * 还款中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码为ETF现金认购申请/中签代码（ETF代码组第4个代码，比如510053)；成交编号cjbh指中签号；成交数量cjsl指中签数量；成交价格cjjg指最终确定的发行价格；成交金额cjje等于分配数量乘以发行价格；当配号不超过8位时，成交时间cjsj填写150000，当成交时间cjsj为111111~999999时，分别对应配号超过8位时，第9位为1~9的情况，当配号总数超过该方案可表达范围时，交易所将启动备用方案，备用方案暂不公布；买卖方向bs为B的记录。   对于不允许重复申报的发行情况，一旦发生同一个证券账户重复申报，在发行T日的过户库中，会设定重复申报的记录的成交编号cjbh、成交数量cjsl 为0，成交金额cjje为0.00，申请编号sqbh为“重复申报”。  2009年6月本所发布《沪市股票上网发行资金申购实施办法》。  其中第二条的条款二约定：‘投资者参与网上公开发行股票的申购，只能使用一个证券账户。证券账户注册资料中“账户持有人名称”相同且“有效身份证明文件号码”相同的多个证券账户（以T-1日账户注册资料为准）参与同一只新股申购的，以及同一证券账户多次参与同一只新股申购的，以第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购。’对于违反该条款的无效申报，成交编号cjbh、成交数量cjsl 为0，成交金额cjje为0.00，申请编号sqbh为“违规重复”。  其中第四条条款二约定：“网下发行参与对象不得参与网上发行”。对于违反该条款的无效申报，成交编号cjbh、成交数量cjsl 为0，成交金额cjje为0.00，申请编号sqbh为“网下在先”。   1. 转债转股或可交换公司债换股成功，不产生任何过户记录，转股/换股数据以登记公司的相关数据为准。 2. 配股成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 3. 账户式质押回购入库成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 4. 账户式质押回购出库成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 5. ETF申购成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 6. ETF赎回成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | Gddm | 证券账户 | C10 |
| 2 | Gdxm | 股东姓名，新交易系统切换后，上交所会将该字段置为空格。请以中国证券登记结算有限责任公司发布的数据为准。 | C8 |
| 3 | Bcrq | 成交日期，格式为YYYYMMDD | C8 |
| 4 | Cjbh | 成交编号 | N8 |
| 5 | Gsdm | 席位号 | C5 |
| 6 | Cjsl | 成交数量 | N10 |
| 7 | Bcye | 本次余额，新交易系统切换后，该字段被置为0。 | N10 |
| 8 | zqdm | 证券代码 | C6 |
| 9 | sbsj | 申报时间，格式为HHMMSS | C6 |
| 10 | cjsj | 成交时间，格式为HHMMSS | C6 |
| 11 | cjjg | 成交价格 | N8(3) |
| 12 | cjje | 成交金额，溢出处理参见实时成交回报接口成交金额字段 | N12(2) |
| 13 | sqbh | 会员内部订单号，同申报接口中的reff（字段4：会员内部订单号）。 | C10 |
| 14 | bs | B 普通订单，买卖方向：买入  S 普通订单，买卖方向：卖出  对于E类型帐户的融资融券业务，对应关系如下：  1 担保品买入订单，券入投资者信用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_XY”,“B”)；  2 担保品卖出订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_XY”,“S”)；  3 融资买入订单，券入投资者信用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_RZ”,“B”)；  4 卖券还款订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_RZ”,“S”)；  5 买券还券订单，券入证券公司融券专用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_RQ”,“B”)；  6 融券卖出订单，券从证券公司融券专用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_RQ”,“S”)；  7 平仓买入订单，券入证券公司融券专用帐户，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_PC”,“B”)；  8 平仓卖出订单，券从投资者信用帐户出，申报接口中(owflag, BS)字段取值为(“\_PC”,“S”)； | C1 |
| 15 | mjbh | 操作员代码 | C5 |

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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 新股资金定价/询价申购  新股东定价/询价增发  按市值资金申购  （摇号中签） | 老股东定价增发（类似配股） | 老股东询价增发（比例中签） | 股票市值配售首发（已停止） | 可转债资金申购 |
| 发行申购/中签代码 | 730\*\*\*  780\*\*\*  732\*\*\* | 700\*\*\*  760\*\*\*  742\*\*\* | 731\*\*\*  781\*\*\* | 737\*\*\*  787\*\*\* | 733\*\*\*  783\*\*\*  754\*\*\* |
| 发行配号代码 | 741\*\*\*  791\*\*\*  736\*\*\* |  | 741\*\*\*  791\*\*\* | 747\*\*\*  797\*\*\* | 744\*\*\*  794\*\*\*  756\*\*\* |
| 发行扣款/还款代码 |  |  | 740\*\*\*  790\*\*\* |  | 743\*\*\*  793\*\*\*  755\*\*\* |

## 证券帐户资料接口zzhXXXXX.dbf

| **zzhXXXXX.dbf** | **证券账户资料接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示席位号。闭市后发送。  该文件接口提供指定交易关系数据给参与者，说明指定在席位（PBU）上的证券账户以及当前所处的状态。  该文件按照上交所的运行计划向市场发布，通常是每隔两周发布一次。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | gddm | 证券帐户 | C10 |
| 2 | gdxm | 股东姓名，新交易系统切换后，该字段被置为空格。 | C8 |
| 3 | zhzt | 证券帐户状态， ‘N’为正常，‘S’为挂起，‘F’为冻结。 | C1 |
| 4 | gsdm | 指定席位号 | C5 |
| 5 | qsdm | 停用 | C5 |
| 6 | jzrq | 截止日期，发送数据生成日期。格式为YYYYMMDD | C8 |
| 7 | clbz | 处理标志，柜台系统自由使用 | C1 |

## 席位联通接口zxwXXXXX.dbf

| **zxwXXXXX.DBF** | **席位联通接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示席位号。  该接口文件说明席位（PBU）联通圈。在进行指定交易有效性检查时，同一联通圈内的不同席位（PBU）可被视为同一个席位（PBU）。  该文件按照上交所的运行计划向市场发布，通常是每隔两周发布一次。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | gsdm | 席位号 | C5 |
| 2 | sxwh | 联通首席位号 | C5 |
| 3 | qsdm | 停用 | C5 |
| 4 | jzrq | 截止日期，格式为YYYYMMDD | C8 |
| 5 | clbz | 处理标志，柜台系统自由使用 | C1 |

## 证券权益接口zqyXXXXX.dbf

| **zqyXXXXX.dbf** | **证券权益接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中XXXXX表示席位号。  该接口文件说明有关投资者所拥有股票的权益。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | gddm | 证券帐户 | C10 |
| 2 | zqye | 登记日的本账户权益（本账户市值/10000\*1000，再按申购单位取整） | N16 |
| 3 | qysl | 权益数量，为投资者的股票市值除以1万再乘以1千后的结果。  （投资者账户组各账户的总市值/10000\*1000，再按申购单位取整） | N16 |
| 4 | gsdm | 指定席位号（PBU） | C5 |
| 5 | zhxh | 账户组序号 | C10 |
| 6 | djrq | 权益登记日期，格式YYYYMMDD | C8 |
| 7 | clbz | 处理标志，柜台系统自由使用 | C1 |

## 新股发行过户数据接口ipoghXXXXX.txt

| **ipoghXXXXX.txt** | **新股发行过户数据接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  描述：  文件名中XXXXX表示席位号。闭市后发送。   1. 申购配号日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码zqdm为发行配号代码（比如741\*\*\*）；成交编号cjbh指配号的首个号码；成交数量cjsl指配号成功的数量；申购数量sgsl为T日有效申购数量；成交价格cjjg为0；成交金额cjje为0；买卖方向bs为B。 2. 中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码zqdm为申购/中签代码（比如730\*\*\*）；成交编号cjbh指中签号；成交数量cjsl指中签数量；成交价格cjjg指最终确定的发行价格；成交金额cjje等于分配数量乘以发行价格；买卖方向bs为B。   对于不允许重复申报的发行情况，一旦发生同一个证券账户重复申报，在发行T日的过户库中，会设定重复申报的记录的成交编号cjbh为0，处理结果cljg为“01”。  2009年6月本所发布《沪市股票上网发行资金申购实施办法》。其中第二条的条款二约定：‘投资者参与网上公开发行股票的申购，只能使用一个证券账户。证券账户注册资料中“账户持有人名称”相同且“有效身份证明文件号码”相同的多个证券账户（以T-1日账户注册资料为准）参与同一只新股申购的，以及同一证券账户多次参与同一只新股申购的，以第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购。’对于违反该条款的无效申报，在发行T日的过户库中，会设定无效申报的记录的成交编号cjbh为0，处理结果cljg为“02”。其中第四条条款二约定：“网下发行参与对象不得参与网上发行”。对于违反该条款的无效申报，在发行T日的过户库中，会设定无效申报的记录的成交编号cjbh为0，处理结果cljg为“03”。  根据2015年发布的《新股业务规则》第二十条约定:‘投资者连续12个月内累计出现三次中签但未足额缴纳认购资金的情形，自最近一次其结算参与人申报放弃认购的次日起6个月内不得参与网上新股申购’。对于违反该条款的不良账户申报，在发行T日的过户库中，会设定不良账户申报的记录的成交编号cjbh为0，处理结果cljg为“04”。  根据2017年发布的《上海证券交易所上市公司可转换债券发行实施细则》第六条约定：‘同一投资者使用多个证券账户参与同一可转债申购的，以该投资者的第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购’。对于违反该条款的无效申报，在发行T日的过户库中，会设定无效申报的记录的成交编号cjbh为0，处理结果cljg为“02”（注：该约定适用于可交换债网上发行）。第十四条约定：‘投资者连续12个月内累计出现3次中签但未足额缴款的情形时，自中国结算上海分公司收到弃购申报的次日起6个月（按180个自然日计算，含次日）内不得参与新股、可转债、可交换公司债券的申购’。 对于违反该条款的不良账户申报，在发行T日的过户库中，会设定不良账户申报的记录的成交编号cjbh为0，处理结果cljg为“04” （注：该约定适用于可交换债网上发行）。 | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **配号** | **中签** | **类型** |
|  | gddm | 证券账户 |  |  | C10 |
|  | cjrq | 成交日期，格式为YYYYMMDD |  |  | C8 |
|  | cjbh | 成交编号 | 配号首个号码 | 中签号 | N12 |
|  | jydy | 交易单元 |  |  | C5 |
|  | cjsl | 成交数量 | 配号成功的数量 | 中签股数  单位：  股票为股  债券为手 | N8 |
|  | sgsl | 申购数量 | 有效申购数量  单位： 股票为股  债券为手 | 0 | N15 |
|  | zqdm | 证券代码 | 配号代码 | 中签代码 | C6 |
|  | sbsj | 申报时间，格式为HHMMSS |  |  | C6 |
|  | cjjg | 成交价格 | 0 | 最终发行价：  股票为每股价格  债券为每张面值。 | N8(3) |
|  | cjje | 成交金额 | 0 | 分配数量\*发行价 | N15(2) |
|  | sqbh | 会员内部订单号。 |  |  | C10 |
|  | bs | B 普通订单，买卖方向：买入  S 普通订单，买卖方向：卖出 | B | B | C1 |
|  | cljg | 处理结果 | 00:成功  01:重复申购  02:违规重复  03:网下在先  04:不良记录 |  | C2 |

## 减持控制数据接口jckzXXXXX.txt

| **jckzXXXXX.txt** | **减持控制数据接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  （1）数据文件名：jckz*xxxxx*.txt；*xxxxx*为PBU代码。  （2）数据内容：包括IPO老股东、参与非公开发行股份股东当日认定数量、次日限制减持数量、及大宗减持受让方限制转让数量。  （3）若股份认定数量1+股份认定数量2不为0，则表示该账户持有特定股份。  （4）根据大宗减持受让方限制数量，控制大宗交易减持受让方股份6个月内不允许进行转让。  （5）该文件闭市后发送，下载时间窗口为当日19:30至次日06:00  **股东减持示例：**  减持额度计算以投资者为粒度进行，若该投资者拥有多个股东账户，则应汇总计算总可用额度，再按特定股份的比例分配到每个具体账户。此外，若股票发生送股等公司行为导致总股本变动，历史减持需要进行复权计算。为方便举例，假设总股本未发生变动，且该投资者仅拥有1个股东账户（不含关联账户）。  股票S有总股本1,000,000股，其中1%总股本为10000股。  股东账户A当前持有股票S的持仓，其中IPO前股份：12000股；一年以上非公开发行股份：0股；一年以内非公开发行股份15000，其中可卖部分：7500股。股东在前89个自然日内已通过竞价交易渠道减持3000股，通过大宗交易渠道减持5000股。  则认定特定股份中竞价撮合可卖数量=Min((IPO前股份+一年以上非公开发行股份+一年以内非公开发行股份可卖部分), (1%总股本 - 前89个自然日内累计竞价减持数量))= Min((12000+0+7500),(10000-3000))=7000。  认定特定股份中大宗交易可卖数量=Min((IPO前股份+一年以上非公开发行股份+一年以内非公开发行股份), (2%总股本 - 前89个自然日内累计大宗减持数量))=Min(12000+0+15000, 20000-5000)=15000。  以上例子对应到数据表中的说明如下：  股份认定数量1=12000 + 0 = 12000  股份认定数量2=15000  限制减持数量1=股份认定数量1+股份认定数量2-认定限售股份中竞价撮合可卖数量=12000+15000-7000=20000  限制减持数量2=股份认定数量1+股份认定数量2-认定限售股份中大宗交易可卖数量=12000+15000-15000=12000 | |

| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 控制日期 | 为数据使用日 | C8 |
| 2 | 指定席位号 | PBU代码 | C5 |
| 3 | 证券账户 |  | C10 |
| 4 | 证券代码 |  | C6 |
| 5 | 股份认定数量1 | 该账户当日日终处理后被认定为符合IPO及1年以上非公开发行条件的股份数量 | N12 |
| 6 | 股份认定数量2 | 该账户当日日终处理后被认定为符合1年内非公开发行条件的股份数量 | N12 |
| 7 | 限制减持数量1 | 该账户次日在认定股份数量范围内竞价撮合被限制减持的数量（1%额度内） | N12 |
| 8 | 限制减持数量2 | 该账户次日在认定股份数量范围内大宗交易被限制减持的数量（2%额度内） | N12 |
| 9 | 证券余额 | 已上市的无限售流通股的持仓余额 | N12 |
| 10 | 大宗减持受让方限制数量 | 该账户由于成为大宗减持受让方后6个月内被限制转让的数量 | N13 |
| 11 | 其他冻结 | 持仓余额中需要实施冻结的证券，包含司法冻结、质押冻结、董监高限制卖出等。 | N13 |
| 12 | 备注 | 预留字段，暂不启用。 | C20 |

**\*关于会员柜台系统前端控制的说明：**

| **委托类型** | **日初可用余额** | **说明** |
| --- | --- | --- |
| 集中竞价交易卖出  股票ETF申购  转融通证券出借  大宗普通交易卖出 | M1=M–Max(D1+D3, D0)  J1=N1+N2-D1  M0=Max(0，M1-J1)  M: 已上市的无限售流通股的持仓余额  D1:限制减持数量1  D3:大宗减持受让方限制数量  D0:其他冻结 | M1为集中竞价交易日初持仓，该部分持仓可用于集中竞价交易卖出、股票ETF申购、转融通证券出借、大宗普通交易卖出前端控制。J1为日初竞价可减持额度（不考虑冻结），M0为集中竞价交易日初自由流通持仓。  其中大宗普通交易卖出仅允许投资者卖出其持有的自由流通部分股份。  ETF赎回后卖出股份，前端控制时视作占用自由流通余额。 |
| 大宗交易减持  (特定股份减持) | M2=M1+Min(D1, Max(D1+D3-D0, 0))  Q2=N1+N2-D2  Md=Min(M2, Q2)  M2:为大宗交易减持日初可用持仓  Q2:大宗2%可用额度  N1:股份认定数量1  N2:股份认定数量2  D2:限制减持数量2 | Md为大宗减持日初前端控制数量  大宗减持时优先扣减Min(D1, Max(D1+D3-D0, 0))部分  而后扣减M1部分，其中M1为竞价日中实时维护持仓。  Q2为大宗日初2%可用额度。 |

\*上表数据说明：

（1）证券余额为全部可流通已上市余额；（2）可流通已上市余额分为：自由流通余额，特定股份余额，大宗减持受让余额；

（3）其他冻结为持仓余额中需要实施冻结的证券，包含司法冻结、质押冻结、董监高限制卖出等。

# 广播文件接口规范

广播文件指全市场均相同的文件，通常是公开信息。该章节描述文件均通过单向卫星信道传送，其中描述的开市前目前指上午9:15分开盘前。

## 上市公司公告文件

| MMDDfNNNN.TXT, MMDDzNNNN.TXT | **上市公司公告文件** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发上证信息公司文件**。文件名中MMDD表示月日格式的日期，NNNN表示序列号，SSSSSS表示证券代码，YYYYMMDD表示年月日格式的日期。开市前发送。 | |

## 债券信息公告文件biYYMMDD.txt

| **biYYMMDD.txt** | **债券信息公告文件** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发上证信息公司文件**。文件名中YYMMDD表示月日格式的日期，其中YY为年的后2位。开市前发送。  该接口文件说明债券公开信息。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | 债券证券代码 | 债券证券代码 | C6 |
| 2 | 债券名称 | 债券名称 | C8 |
| 3 | 债券发行日 | YYYYMMDD | C8 |
| 4 | 本次付息起息日 | YYYYMMDD | C8 |
| 5 | 上次派息日 | YYYYMMDD | C8 |
| 6 | 预计下次派息日 | YYYYMMDD | C8 |
| 7 | 兑付日期 | YYYYMMDD | C8 |
| 8 | 票面利率 | YYYYMMDD | N4(3) |
| 9 | 年计息天数 |  | N3 |
| 10 | 债券简短描述 | 说明按半年付息或者按年付息等信息 | C20 |
| 11 | 发行价 |  | N6(3) |
| 12 | 债券面值 |  | N6(3) |
| 13 | 发行总数量 |  | N20 |
| 14 | 发行人 |  | C100 |
| 15 | 日计息基准 |  | N7(5) |
| 16 | 年派息次数 |  | N1 |

## 国债利息接口gzlx.MDD

| **gzlx.MDD** | **国债利息接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发中登上海分公司gzlxYYYYMMDD001.txt**，并重新命名，转换为DBF格式。当10月份时，M为‘a’；11月份时，M为‘b’；12月份时，M为‘c’；DD为日期。开市前发送。  该接口文件说明国债应计利息。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | gzdm | 国债证券代码 | C6 |
| 2 | jxrq | 计息日期 | C8 |
| 3 | yjlx | 每百元应计利息额 | N15(8) |
| 4 | lxts | 利息天数 | N6 |
| 5 | pmll | 票面利率 | N8(5) |

## 标准券折算率变更接口zslMMDD.txt

| **zslMMDD.txt** | **席位式质押回购标准券折算率接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发中登上海分公司bzqz1YYYYMMDD001.txt**，并重新命名**。**文件名中MMDD表示月日格式的日期。开市前发送。  该接口文件说明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。 | |

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

## 标准券折算率变更公告文件zslwMMDD.txt

| **zslwMMDD.txt** | **席位式质押回购标准券折算率公告文件** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发中登上海分公司zsgg1yyyymmdd001.txt**，并重新命名**。**文件名中MMDD表示月日格式的日期。开市前发送。  该文件为关于发布债券适用的标准券折算率通知的文本文件**。**  若为债券标准券折算率计算日,则发送调整后的债券折算率；  若当日有新上市债券的折算率数据或非计算日但需调整债券折算率，则发送新上市债券和调整后的债券折算率数据；  否则，发送空文件 | |

## 标准券折算比率接口 xzslMMDD.txt

| **xzslMMDD.txt** | **账户式质押回购折算率接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发中登上海分公司**ngzz1YYYYMMDD001.txt，并重新命名**。**文件名中MMDD表示月日格式的日期。开市前发送。  该接口文件说明产品参加账户式质押回购业务时折算为标准券比例。  字段间用分隔符‘|’定位。 | |

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

## ETF公告文件1.0版格式

| **50\_\_MMDD.ETF, 180\_MMDD.ETF, HL\_\_MMDD.ETF，YQ50MMDD.ETF**  **510???MMDD.ETF** | **ETF公告文件** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发ETF基金管理公司1.0版定义文件，**上证50ETF，上证180ETF，红利ETF原文件名分别为ETF50CAMBulletinYYYYMMDD.TXT，ETF180HAFMBulletinYYYYMMDD.TXT， ETFHLAIGBulletinYYYYMMDD.TXT，经本所重新命名为50\_\_MMDD.ETF, 180\_MMDD.ETF, HL\_\_MMDD.ETF。  央企50ETF文件名为YQ50MMDD.ETF。  文件名中MMDD表示月日格式的日期。  从2009年12月起新上市的ETF，公告文件的命名采用新规则：统一用ETF二级市场基金代码作为称前缀，再加月份和日期，例如：上证180公司治理ETF的公告文件为510010MMDD.ETF(MM为月份，DD为日期)。  开市前发送。  本接口引用与本所外网发布的《IS103 ETF 基金公司系统接口规格说明书》中关于“ETF公告文件1.0版格式”章节描述的接口定义，可参阅该文档相关定义（注：未来本接口文档将不再重复描述文件具体格式定义）。  该文件分为两个部分：  第一部分说明基本信息，用[ETF50]、[ETF180]、[ETFHL]等标识开头，具体产品与其开头标识对应关系如下：  510050:[ETF50]  510180:[ETF180]  510880:[ETFHL]  510060:[ETFYQ]  510010:[ETFZL]  510020:[ETFCD]  510130:[中盘ETF]  510030:[ETF绝对价值]  510090:[ETF社会责任]  510070:[ETFMQ]  510160:[ETFXK]  510110:[ETFZQ]  510190:[ETFLT]  510170:[ETFDZSP]  510150:[ETFXF80]  510220:[ETFZXP]  510210:[ETF上证综指]  510230:[ETFJR]  510260:[ETFXXCY]  其余后续新发行的ETF统一开头标识为[ETF]。  第一部分和第二部分之间的分隔行为TAGTAG。  第二部分的结束行为ENDENDEND。  每一行之间用0D0A来分隔。 | |

[开头标识符]

第一部分采用item=value这样的方式。英文字母，大小写无关。比如：

“Fundid1=510011”

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | Fundid1 | ETF一级市场申购赎回代码 | C6 |
| 2 | CreationRedemptionUnit | 每个篮子（最小申购赎回单位）对应的ETF份数  取值范围：[0，99999999] | C8 |
| 3 | MaxCashRatio | 最大现金替代比例，总长为7位（包括小数点），小数点后5位，例如：5.551％在文件中用0.05551表示  取值范围：[0.00001，1] | C7 |
| 4 | Publish | 是否需要发布IOPV  1表示计算IOPV并通过行情发布  0表示不计算IOPV也无需通过行情发布 | C1 |
| 5 | CreationRedemption | 申购和赎回允许状态  0 - 不允许申购/赎回 1 - 申购和赎回皆允许 2 - 仅允许申购 3 - 仅允许赎回 | C1 |
| 6 | Recordnum | 成分证券数量 | C3 |
| 7 | EstimateCashComponet | 每个篮子的预估现金差额，总长为11位（包括小数点），**2位小数**  取值范围：[-9999999.99，99999999.99] | C11 |
| 8 | TradingDay | 当前交易日，格式YYYYMMDD | C8 |
| 9 | PreTradingDay | 前一交易日，具体由业务含义约定，格式YYYYMMDD | C8 |
| 10 | CashComponent | 前一日现金差额  最大长度为11位 | C11 |
| 11 | NAVperCU | 前一日最小申赎单位净值  最大长度为12位 | C12 |
| 12 | NAV | 前一日基金的单位净值。总长为8位。 | C8 |

TAGTAG

第二部分采用|在不同字段间分隔。比如：

“600000|浦发银行| 5200|1|0.10000| |”

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段描述** | **类型** |
| 1 | 证券代码 | 关键字，递增排序 | C6 |
| 2 | 证券简称 | 四位中文，左对齐，右补空，对正确性不校验 | C8 |
| 3 | 证券数量 | 每个申购篮子中该成分证券的数量，数据右对齐，左补空，债券为手，其他为股或份 | C8 |
| 4 | 替代标志 | 表示该成份产品是否允许用现金进行替代。  0表示该证券为沪市证券，禁止现金替代（必须有证券）  1表示该证券为沪市证券，可以进行现金替代（先用证券，证券不足的话用现金替代）  2表示该证券为沪市证券，必须用现金替代。  3表示该证券为深市证券，退补现金替代。  4表示该证券为深市证券，必须现金替代。  5表示非沪深市场成分证券退补现金替代。  6表示非沪深市场成份证券必须现金替代。 | C1 |
| 5 | 溢价比例 | 证券用现金进行替代的时候，计算价格时增加的比例（不含100%）。总长为7位（包括小数点），右对齐，左补空，小数点后5位，例如：2.551％在文件中用0.02551表示，2.1%用0.02100表示 替代标志为1、3、5时，此字段必填，且取值范围为[0,1） | C7 |
| 6 | 总金额 | 当某只证券必须用现金替代的时候，该证券所需总金额。 总长为12位（包括小数点），小数点后3位 数据右对齐，左补空，小数必须为3位 替代标志为2、3、4、5、6时此字段必填，且必须大于等于0 | C12 |

ENDENDEND

## 权证信息接口 qzxxMMDD.txt

| **qzxxMMDD.txt** | **权证信息接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示月日格式的日期。开市前发送。  该接口文件说明权证的相关信息。  字段间用分隔符‘|’来定位。  新交易系统切换后，该文件换行方式为Unix方式，即通过0x0A表示换行。 | |

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

## 交易公开信息公告文件jygkxxMMDD.txt

| **jygkxxMMDD.txt** | **交易公开信息公告文件** |
| --- | --- |
| **描述：**  转发上交所信息中心文件。按照交易规则（2013修订版）5.4.1、5.4.2、5.4.3向全市场公布有关信息。文件名中MMDD表示月日格式的日期。闭市后发送。  该文件为文本文件。 | |

## 产品非交易基础信息接口fjyMMDD.txt

| **fjyMMDD.txt** | **产品非交易基础信息接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  **本接口文件将逐步停止发布，新接口文件为fjyYYYYMMDD.txt。**  新交易系统切换后，增加该接口文件。本文件为与产品相关的非交易基础信息数据。文件名中MMDD表示月日格式的日期。开市前发送。 | |

| **fjyMMDD.txt** | | | **产品非交易基础信息** | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **描述** | | **类型** |
|  | 上交所证券标识代码 | 上交所证券标识代码 | | C12 |
|  | 产品证券代码 | 产品证券代码 | | C6 |
|  | 非交易业务类型 | 非交易业务类型：  IN 上网证券发行申购  IE 市值配售证券发行申购  IS 老股东增发证券发行申购  CV 可转债转股/可交换公司债换股  CR 可转债回售  R1 股票配股行权行权  R2 股票转配股配股行权  R3 职工股转配股配股行权  R4 股票配转债行权  OS 开放式基金认购  OC 开放式基金申购  OR 开放式基金赎回  OD 开放式基金分红选择  OT 开放式基金份额转出  OV 开放式基金转换  EC ETF申购  ER ETF赎回  WE 权证行权  BD 回购入库  BW 回购出库  FS 要约预受  FC 要约撤销 | | C2 |
|  | 非交易订单输入开始日期 | 订单输入开始日期。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | 非交易订单输入结束日期 | 订单输入结束日期。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | 非交易订单整手数 | 整手数。指订单的数量必须为该字段取值的整数倍。 | | N10(3) |
|  | 非交易订单最小订单数量 | 非交易订单的最小订单数量。指订单的数量必须比该字段取值大。 | | N10(3) |
|  | 非交易订单的最大订单数量 | 非交易订单的最大订单数量。指订单的数量必须比该字段取值小。 | | N17(3) |
|  | IPO总量 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，发行总量。 | | N17(3) |
|  | IPO分配方法 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，IPO分配方法。  L –摇号抽签  A -竞价分配  P –比例配售 | | C1 |
|  | IPO竞价分配或比例配售日期 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，执行竞价分配或比例配售的日期。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | IPO验资或配号日期 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，进行验资或配号的日期。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | IPO摇号抽签的日期 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，进行摇号抽签的日期。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | IPO申购价格区间下限 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，IPO申购价格区间的下限。 | | N13(5) |
|  | IPO申购价格区间上限 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，IPO申购价格区间的上限。 | | N13(5) |
|  | IPO发行价格 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，发行价格。 | | N13(5) |
|  | IPO比例配售比例 | 当非交易业务类型为IN、IS、IE时，比例配售的比例。  最小值为0.001；最大值为100.000。 | | N7(3) |
|  | 要约价格 | 当非交易业务类型为FS、FC时，要约预受和撤销的固定价格。 | | N13(3) |
|  | 配股股权登记日 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股的股权登记日。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | 配股除权日 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股的除权日。 | | 8 YYYYMMDD |
|  | 配股比例 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股比例。 | | N10(6) |
|  | 配股价格 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股价格。当非交易业务类型为CV时，为转股/换股价格。 | | N13(5) |
|  | 配股总量 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股总量。 | | N16(3) |

## 产品非交易基础信息接口fjyYYYYMMDD.txt

| **fjyYYYYMMDD.txt** | **产品非交易基础信息接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  本文件为与产品相关的非交易基础信息数据。文件名中YYYYMMDD表示年月日格式的文件适用日期，在交易日开市前通过单向卫星发送。（交易日内不更新） | |

| **fjyYYYYMMDD.txt** | | | **产品非交易基础信息** | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **描述** | | **类型** |
| 1 | 参考数据类型 | 技术实现固定值  竞价撮合平台非交易，该值固定填写为R0001  后续格式仅当参考数据类型字段为R0001时对应格式类型  后续若加入其他平台非交易数据，则该字段有新的取值，对于不同的参考数据类型取值，后续字段格式则可能不一样。 | | C5 |  |
| 2 | 非交易证券代码 | 非交易证券代码，如无则为空 | | C6 |
| 3 | 非交易证券名称 | 非交易证券名称 | | C8 |
| 4 | 产品证券代码 | 产品证券代码，如无则为空 | | C6 |
| 5 | 产品证券名称 | 产品证券名称，如无则为空 | | C8 |
| 6 | 非交易业务类型 | 非交易业务类型：  IN 上网证券发行申购  IS 老股东增发证券发行申购  PH IPO配号  KK IPO扣款  HK IPO还款  CV 可转债转股/可交换公司债换股  CR 可转债回售  R1 股票配股行权行权  R2 股票转配股配股行权  R3 职工股转配股配股行权  R4 股票配转债行权  OS 开放式基金认购  OC 开放式基金申购  OR 开放式基金赎回  OD 开放式基金分红选择  OT 开放式基金份额转出  OV 开放式基金转换  EC ETF申购  ER ETF赎回  EZ 申赎资金代码  BD 回购入库  BW 回购出库  FS 要约预受  FC 要约撤销  ST 余券划转  SR 还券划转  CI 担保品划入  CO 担保品划出  SI 券源划入  SO 券源划出  PA 密码激活(注销)  DT 指定登记  DC 指定撤销  QT 其它  当非交易类型为PA, DT, DC时，除非交易证券代码外的其余字段无实际意义。 | | C2 |
| 7 | 非交易订单输入开始日期 | 订单输入开始日期。 | | C8 YYYYMMDD |
| 8 | 非交易订单输入结束日期 | 订单输入结束日期。 | | C8 YYYYMMDD |
| 9 | 非交易订单整手数 | 整手数。指订单的数量必须为该字段取值的整数倍。 | | N12 |
| 10 | 非交易订单最小订单数量 | 非交易订单的最小订单数量。指订单的数量必须比该字段取值大。 | | N12 |
| 11 | 非交易订单的最大订单数量 | 非交易订单的最大订单数量。指订单的数量必须比该字段取值小。 | | N12 |
| 12 | 非交易价格 | 当非交易业务类型为IN、IS时，为发行价格。  当非交易业务类型为PH、KK、HK时，为产品发行价格。  当非交易业务类型为FS、FC时，为要约预受和撤销的固定价格。  当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，为配股、配债价格。  当非交易业务类型为CR时，为回售价格。  当非交易业务类型为CV时，为转股/换股价格。  其他非交易业务，该字段默认填写为1.00000，无实际意义。 | | N13(5) |
| 13 | IPO总量 | 当非交易业务类型为IN、IS时，发行总量。 | | N16 |
| 14 | IPO分配方法 | 当非交易业务类型为IN、IS时，IPO分配方法。  L –摇号抽签  A -竞价分配  P –比例配售 | | C1 |
| 15 | IPO竞价分配或比例配售日期 | 当非交易业务类型为IN、IS时，执行竞价分配或比例配售的日期。 | | C8 YYYYMMDD |
| 16 | IPO验资或配号日期 | 当非交易业务类型为IN、IS时，进行验资或配号的日期。 | | C8 YYYYMMDD |
| 17 | IPO摇号抽签的日期 | 当非交易业务类型为IN、IS时，进行摇号抽签的日期。 | | C8 YYYYMMDD |
| 18 | IPO申购价格区间下限 | 当非交易业务类型为IN、IS时，IPO申购价格区间的下限。 | | N11(3) |
| 19 | IPO申购价格区间上限 | 当非交易业务类型为IN、IS时，IPO申购价格区间的上限。 | | N11(3) |
| 20 | IPO比例配售比例 | 当非交易业务类型为IN、IS时，比例配售的比例。  最小值为0.001；最大值为100.000。 | | N11(3) |
| 21 | 配股股权登记日 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股的股权登记日。 | | C8 YYYYMMDD |
| 22 | 配股除权日 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股的除权日。 | | C8 YYYYMMDD |
| 23 | 配股比例 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股比例。 | | N11(6) |
| 24 | 配股总量 | 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，配股总量。 | | N16 |
| 25 | T-2日基金收益/基金净值 | 当非交易业务类型为OC、OR时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-2日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-2日每百份基金净值； | | N13(5) |
| 26 | T-1日基金收益/基金净值 | 当非交易业务类型为OC、OR时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-1日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-1日每百份基金净值； | | N13(5) |
| 27 | 发行方式 | 当非交易业务类型为IN、IS且分配方法为L（摇号中签）时，发行方式。  001-按市值限额申购  002-增发资金申购  003-信用申购  新股网上发行采用001，可转债、可交换债网上发行采用003，以上两种发行方式均取消预缴款。 | | C3 |
| 28 | 备注 | 保留字段，用于扩展 | | C46 |

## 担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt

| **dbpMMDD.txt** | **担保品及标的证券清单接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示月日格式的日期。融资融券业务启用之后，开市前发送。  该接口文件说明融资融券业务相关证券信息。  字段间用分隔符‘|’来定位。 | |

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

## 产品基础信息文件接口cpxxMMDD.txt

| **cpxxMMDD.txt** | **产品信息文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  本文件为与产品相关的基础信息数据（包含停牌的产品，不含非交易信息、未发行上市产品），仅供参考。文件名中MMDD表示月日格式的交易日使用的日期。开市前生成并通过单向卫星定时发送。  对于集合资产管理计划产品，基础证券代码、面值、买卖数量单位、申报数量上下限、价格档位、融资融券标的标识、除权比例、除息金额字段对该业务无意义，取定长空格。  预留字段用于未来扩展，目前暂无意义。  对于其他仅在综合业务平台挂牌的撮合产品，通常参照竞价撮合平台产品在本文件中发布，  其中对于国债预发行产品，基础证券代码、申报数量上下限、除息金额、融资融券标志对该业务无意义，取定长空格。  对于控制指令类产品，基础证券代码、证券类别、面值、买卖数量单位、申报数量上下限、前收盘价格、价格档位、涨跌幅类型、涨幅上下限、除权比例、除息金额、融资融券标的标识、产品状态标志字段无意义，取定长空格或取0。 | |

| **cpxxMMDD.txt** | | | **产品信息文件接口** | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **描述** | | **类型** |
| **1** | 证券代码 | 证券代码  在show2003.dbf中为非交易业务（比如发行业务）而挂牌的“证券代码”（比如780\*\*\*），没有对应的产品基础信息数据记录，有关属性通过非交易信息文件获取。 | | C6 |
| **2** | ISIN代码 | ISIN代码（预留）。 | | C12 |
| **3** | 记录更新时间 | 标识接口中本记录更新时间HH:MM:SS | | C8 |
| 4 | 中文证券名称 | 中文证券名称 | | C8 |
| 5 | 英文证券名称 | 英文证券名称（预留） | | C10 |
| 6 | 基础证券代码 | 当产品为权证、可转债等衍生品时，该字段为其标的产品的证券代码。 | | C6 |
| 7 | 市场种类 | ‘ASHR’表示A股市场；‘BSHR’表示B股市场；‘CSHR’表示国际版市场  综业平台集合资产管理计划、债券预发行取‘ASHR’ | | C4 |
| 8 | 证券类别 | ‘ES’表示股票；‘EU’表示基金；‘D’表示债券； ‘RWS’表示权证；‘FF’表示期货。（参考ISO10962），集合资产管理计划、债券预发行取‘D’ | | C6 |
| 9 | 证券子类别 | 自定义详细证券类别  参考：  GBF 国债  GBZ 无息国债  DST 国债分销（仅用于分销阶段）  DVP 公司债（地方债）分销  CBF 企业债券  CCF 可转换企业债券  CPF 公司债券（或地方债券）  FBF 金融机构发行债券  CRP 质押式国债回购  BRP 质押式企债回购  ORP 买断式债券回购  CBD 分离式可转债  OBD 其它债券  CEF 封闭式基金  OEF 开放式基金  EBS 交易所交易基金（买卖）  FBL 跨市场/跨境资金  OFN 其它基金  ASH 以人民币交易的股票  BSH 以美元交易的股票  CSH 国际版股票  OEQ 其它股票  CIW 企业发行权证  COV 备兑权证  FEQ 个股期货  FBD 债券期货  OFT 其它期货  AMP 集合资产管理计划  WIT 国债预发行  LOF LOF基金  OPS 公开发行优先股  PPS 非公开发行优先股  QRP 报价回购  CMD 控制指令（中登身份认证密码服务产品复用CMD证券子类别） | | C3 |
| 10 | 货币种类 | 货币代码取值：  美元：USD；人民币：CNY；（参考ISO4217） | | C3 |
| 11 | 面值 | 债券当前面值，单位元，其他产品取0.000 | | N15(3) |
| 12 | 可流通证券未上市数量 | 预留 | | N15 |
| 13 | 最后交易日期 | 对于国债预发行产品，为最后交易日期，  格式为YYYYMMDD | | C15 |
| 14 | 上市日期 | 在上交所首日交易日期，YYYYMMDD | | C8 |
| 15 | 产品集SET编号 | 取值范围从1到999。  用来表明产品的一种分组方式，用于在多主机间进行负载均衡分配。该值在一个交易日内不会变化。 | | N3 |
| 16 | 买数量单位 | 买订单的申报数量必须是该字段的整数倍。 | | N12 |
| 17 | 卖数量单位 | 卖订单的申报数量必须是该字段的整数倍。 | | N12 |
| 18 | 申报数量下限 | 申报数量下限 | | N12 |
| 19 | 申报数量上限 | 申报数量上限 | | N12 |
| 20 | 前收盘价格 | 前收盘价格（如有除权除息，为除权除息后前收盘价）  对于货币市场基金实时申赎，取值为0.010  集合资产管理计划固定填写挂牌首日开盘参考价格 | | N11(3) |
| 21 | 价格档位 | 申报价格的最小变动单位 | | N11(3) |
| 22 | 涨跌幅限制类型 | ‘N’表示交易规则（2013修订版）3.4.13规定的有涨跌幅限制类型或者权证管理办法第22条规定  ‘R’表示交易规则（2013修订版）3.4.15和3.4.16规定的无涨跌幅限制类型  ‘S’表示回购涨跌幅控制类型  ‘F’表示基于参考价格的涨跌幅控制  ‘P’表示IPO上市首日的涨跌幅控制类型  ‘U’表示无任何价格涨跌幅控制类型 | | C1 |
| 23 | 涨幅上限价格 | 对于N类型涨跌幅限制的产品，该字段当日不会更改，基于前收盘价（已首日上市交易产品为发行价）计算。  对于R类型无涨跌幅限制的产品，该字段取开盘时基于参考价格计算的上限价格，无实际控制意义。  对于P类型IPO上市首日产品，取连续竞价期间基于参考价格计算最大范围的上限价格，因不是实时的实际控制价格，故仅供参考。 | | N11(3) |
| 24 | 跌幅下限价格 | 计算方式参考涨幅上限价格 | | N11(3) |
| 25 | 除权比例 | 每股送股比例  对于国债预发行产品，为保证金比例，单位为%。 | | N11(6) |
| 26 | 除息金额 | 每股分红金额 | | N11(6) |
| 27 | 融资标的标志 | ‘T’表示是融资标的证券  ‘F’表示不是融资标的证券。 | | C1 |
| 28 | 融券标的标志 | ‘T’表示是融券标的证券  ‘F’表示不是融券标的证券。 | | C1 |
| 29 | 产品状态标志 | 该字段为20位字符串，每位表示允许对应的业务，无定义则填空格。  第0位对应：‘N’表示首日上市。  第1位对应：‘D’表示除权。  第2位对应：‘R’表示除息。  第3位对应：’D’表示国内主板正常交易产品，’S’表示股票风险警示产品，’P’表示退市整理产品，’T’表示退市转让产品，’U’表示优先股产品。  第4位不启用。  第5位对应：’L’表示债券投资者适当性要求类，’M’表示债券机构投资者适当性要求类。 | | C20 |
| 30 | 备注 | 保留字段，用于扩展。  对于国债预发行产品，备注中补充以下字段，每个字段根据格式定义，参照本文档txt文件对齐方式约定，字段定长，字段间以&分隔，字段及格式定义依次为：  1、招标方式C1，‘1’表示国债预发行利率招标，‘2’表示国债预发行价格招标。  2、基准价格N11(3)，当价格招标时为基准价格，当利率招标时为基准收益率。  3、参考久期N6(2)，单位为年。  4、当期发行量N9，单位为手。 | | C50 |

## 质押式报价回购折算率文件bzsl01MMDD.txt

| **bzsl01MMDD.txt** | **质押式报价回购折算率文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  本文件为转发指数公司文件，内容**为质押式报价回购质押券折算率（**值）。  文件名中MMDD表示月日格式的交易日使用的日期。开市前通过单向卫星定时发送。  允许标准券比率/标准券折算值为零。若标准券比率/标准券折算值为零，则出入库时现券发生增减变化，标准券不变化。  本文件含债券的标准券比率及ETF的标准券折算值。 | |

| **bzsl01MMDD.txt** | | **质押式报价回购折算率文件接口** | |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名称** | **描述** | | **类型** |
| 证券代码 | 证券代码，不足6位左边补0 | | C6 |
| 标准券比率/标准券折算值 | 右对齐，不足左补空格  保留三位小数，最大值为999.999  当证券代码为债券时本字段为标准券折算率.  当证券代码为ETF时本字段为标准券折算值, 折算值单位为元。 | | N15(3) |

# 开放式基金数据接口规范

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

2009年11月23日前把kyeXXXXX.txt压缩为kyeXXXXX.zip，把kghXXXXX.txt和khlXXXXX.txt压缩为kghXXXXX.zip一个文件。新交易系统切换后，kghXXXXX.txt和khlXXXXX.txt分别压缩为kghXXXXX.zip和khlXXXXX.zip。

开放式基金数据接口中使用的数据类型定义如下：

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

数据表示与处理规则如下：

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

每个开放式基金类文件数据由3个部分的内容组成。即标题行(1-14)、文件数据本身(15-21)和文件结束标识(22)。  
3个部分之间没有空行。所有内容均由登记公司提供。如无特别注释，新交易系统不做任何数据改动。  
以下是三个部分的描述。

文件组织方式如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **名称** | **长度** | **值** | **描述** |
| 文件标识 | 8 | “OFDCFDAT” | 用以标明该文件的格式类型 |
| 文件版本号 | 4 | 10 | 1．0版本 |
| 文件创建人 | 4 | 空白 | 用于标明该文件的提交人 |
| 文件接收人 | 4 | 空白 | 用于标明该文件的接收人 |
| 日期 | 8 | 日期 | 当天日期 |
| 发送人 | 8 | 空白 |  |
| 接收人 | 8 | 席位号XXXXX＋空格 |  |
| 字段数 | 3 | N | 标明该数据文件的构成字段数 |
| 字段名1 |  |  | 采用数据字典中的字段名 |
| … |  |  |  |
| 字段名N |  |  |  |
| 记录数 | 8 | M | 该数据文件包含的数据记录数，最多99999999条 |
| 记录1 |  |  |  |
| … |  |  |  |
| 记录M |  |  |  |
| 文件结束标识 | 8 | “OFDCFEND” | 文件结束 |

## 开放式基金**净值数据**接口kxxMMDD.txt

| **kxxMMDD.txt** | **开放式基金净值数据文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  文件名中MMDD表示年月日格式的日期。**转发自中登总公司ofd\_99\_101\_YYYYMMDD\_07.txt文件。**开市前发送。 | |

| **ID** | **字段名** | **描述** | **类型** |
| --- | --- | --- | --- |
| 63 | FundName | 基金名称 | C40 |
| 67 | FundCode | 基金代码 | A6 |
| 68 | FundStatus | 基金状态  0-允许申赎，1-发行  2-发行成功，3-发行失败  4-基金停止申赎  5-停止申购，6-停止赎回  7-权益登记，8-红利发放  9-基金封闭，a-基金终止 | C1 |
| 86 | NAV | 基金单位净值 | N7(4) |
| 37 | CurrencyType | 结算币种  156-人民币，840-美元  344-港元，954-欧元  392-日元，826-英镑  250-法郎，280-马克 | A3 |
| 82 | FundManagerCode | 基金管理人 | A3 |
| 114 | RegistrarCode | 注册登记人代码 | A2 |
| 149 | UpdateDate | 基金信息更改日期，格式为YYYYMMDD。 | A8 |
| 215 | CollectFeeType | 交易费收取方式  0-价内费  1-价外费 | C1 |
| 216 | NextTradeDate | 下一交易日 | A8 |
| 281 | FundIncomeFlag | 货币基金万份收益正负  0：正；1：负 | C1 |
|  | FundIncome | 货币基金万份收益率 | N8(5) |
| 283 | YieldFlag | 货币基金七日年收益正负  0：正；1：负 | C1 |
|  | Yield | 货币基金七日年收益 | N8(5) |
|  | GuaranteedNAV | 保本净值 | N7(4) |

## 开放式基金分红数据接口khlXXXXX.txt

| **khlXXXXX.txt** | **开放式基金分红数据文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发自中登总公司。**闭市后发送。  红利/红利再投资发放是指基金注册登记人把对投资人发放红利/红利再投资的数据发送给基金销售人。对于冻结份额分红时产生的再投资份额，若继续冻结，分红时发送一笔红利再投资记录和一笔份额冻结确认记录，解冻时发送一笔份额解冻记录，每笔份额解冻记录与原份额冻结记录一一对应。  对于货币市场基金，基金分红不作取整处理。  对于非货币市场基金的基金分红，如果采用红利转投方式，对于再投资的红利进行份额取整，取整后的小数份额部分将直接转换成现金退还投资者。  对于现金分红方式：DividenAmount项=ConfirmeAmount项（分红的现金）  对于红利转投方式：DividenAmount项=VolOfDividendforReinvestment项×除权日的基金净值＋手续费＋ConfirmAmount项（应退还投资者的现金） | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ID** | **字段名** | **描述** | **类型** | **是否必需** |
| 67 | FundCode | 基金代码 | A6 | Y |
| 136 | TAAccountID | 投资人基金账号 | C12 | Y |
| 22 | BasisforCalculatingDividend | 红利/红利再投资基数，登记日基金持有人的基金份数 | N16(2) | Y |
| 32 | TransactionCfmDate | 交易确认日期，格式为：YYYYMMDD | A8 | Y |
| 41 | VolOfDividendforReinvestment | 基金账户红利再投资基金份数，取整处理 | N16(2) | Y |
| 42 | DividentDate | 分红日/发放日 | A8 | Y |
| 43 | DividendAmount | 基金账户红利资金，红利总金额,含冻结红利及再投资的红利及份额取整后退还给投资者的部分 | N16(2) | Y |
| 46 | XRDate | 除权日 | A8 | Y |
| 64 | ConfirmedAmount | 每笔交易确认金额，实发红利资金，不含冻结红利及再投资的红利。当采用红利再投分红方式时，该项是转投的份额小数部分换算成的现金金额，即份额取整后退还给投资者的部分 | N16(2) | Y |
| 113 | RegistrationDate | 权益登记日期，格式为：YYYYMMDD | A8 | Y |
| 119 | ReturnCode | 交易处理返回代码，取值见附表：TA系统返回代码表 | A4 | Y |
| 120 | TransactionAccountID | 投资人基金交易帐号  席位号(5位，前补空格)＋账号，席位号由于有一天的差别，未必是现在指定的席位号。 | A17 | Y |
| 121 | DistributorCode | 销售人代码  101代码,表示上海证券交易所市场 | A3 | Y |
| 135 | BusinessCode | 业务代码：143 | A3 | Y |
| 155 | DividendPerUnit | 单位基金分红金额（含税） | N16(2) | Y |
| 24 | DefDividendMethod | 默认分红方式，现设置为空 | A1 | N |
| 52 | Charge | 手续费 | N10(2) | N |
| 53 | AgencyFee | 代理费 | N10(2) | N |
| 59 | TotalFrozenVol | 基金冻结总份数 | N16(2) | N |
| 86 | NAV | 基金单位净值 | N7(4) | N |
| 94 | OtherFee1 | 其他费用1 | N10(2) | N |
| 95 | OtherFee2 | 其他费用2 | N16(2) | N |
| 98 | IndividualOrInstitution | 个人/机构标志，0-机构，1-个人 | A1 | N |
| 123 | DividendRatio | 红利比例 | N16(2) | N |
| 137 | TASerialNO | TA确认交易流水号 | A20 | N |
| 138 | StampDuty | 印花税 | N16(2) | N |
| 187 | FrozenBalance | 冻结金额 | N16(2) | N |
| 255 | TransferFee | 过户费 | N10(2) | N |
| 260 | ShareClass | 收费方式  0-前收费，1-后收费 | A1 | N |
| 276 | FeeCalculator | 计费人  0-TA计费 1-基金计费 | A1 | N |
| 47 | DownLoaddate | 交易数据下传日期  格式为：YYYYMMDD | A8 | N |
| 37 | CurrencyType | 结算币种  156-人民币，840-美元  344-港元，954-欧元  392-日元，826-英镑  250-法郎，280-马克 | A3 | Y |

## 开放式基金**帐户**对帐数据接口kyeXXXXX.txt

| **kyeXXXXX.txt** | **开放式基金帐户对帐数据文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  **转发自中登总公司。**闭市后发送。  用于核对投资人持有份额数据。 | |

| **ID** | **字段名** | **描述** | **类型** |
| --- | --- | --- | --- |
| 67 | FundCode | 基金代码 | A6 |
| 136 | TAAccountID | 投资人基金帐号  股票交易市场中的证券帐户，左对齐，后补空格 | A12 |
| 13 | AvailableVol | 持有人可用基金份数 | N16(2) |
| 18 | TotalVolOfDistributorInTA | 基金总份数（含冻结） | N16(2) |
| 59 | TotalFrozenVol | 基金冻结总份数 | N16(2) |
| 173 | TotalBackendLoad | 交易后端收费总额 | N16(2) |
| 268 | AccountStatus | 账户状态  0-正常，1-冻结，2-挂失 | A1 |
|  | UndistributeMonetaryIncome | 货币基金未分配收益 | N16(2) |
|  | GuaranteedAmount | 剩余保本份额 | N16(2) |

## 开放式基金**交易**确认**接口kghXXXXX.txt**

| **kghXXXXX.txt** | **开放式基金交易确认文件接口** |
| --- | --- |
| **描述：**  该数据文件包含由上交所发送的T日业务申请回执和由中登总公司发送的业务申请确认记录及其他业务记录。闭市后发送。  由上交所发送的T日业务申请回执中的基金代码采用会员公司发送订单时的采用的非交易代码。  由中国结算发送的业务确认和主动发起的业务中基金代码均为519×××代码。 | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **ID** | **字段名** | **描述** | **类型** |
| 8 | AppSheetSerialNo | 申请单编号，对于上交所发起的业务和TA对于上交所业务申请的确认记录，是交易流水号(10位)左对齐，编号<100000000。  该类数据申请单编号和T-1日的业务申请申请单编号一致。  由TA发起的冻结、非交易过户等业务，编号为TA流水号 | A24 |
| 67 | FundCode | 基金代码 | A6 |
| 136 | TAAccountID | 投资人基金账号，10位股东账号，左对齐 | C12 |
| 32 | TransactionCfmDate | 交易确认日期，格式为：YYYYMMDD，TA确认的日期 | A8 |
| 62 | ConfirmedVol | 基金账户交易确认份数 | N16(2) |
| 64 | ConfirmedAmount | 每笔交易确认金额，为投资者实得金额 | N16(2) |
| 92 | TransactionDate | 交易发生日期，格式为：YYYYMMDD | A8 |
| 132 | ApplicationVol | 赎回的份数/转托管份数 | N16(2) |
| 134 | ApplicationAmount | 申请金额 | N16(2) |
| 135 | BusinessCode | 业务代码，取值与含义参见附表：业务代码与含义表 | A3 |
| 137 | TASerialNO | TA确认交易流水号 | A20 |
| 177 | BusinessFinishFlag | 业务过程完全结束标识,  0-中间过程  1-业务过程结束 | C1 |
| 119 | ReturnCode | 交易处理返回代码  ‘0000’为成功，其他出错原因见附表。 | A4 |
| 16 | BackendLoad | 每笔交易后端收费 | N16(2) |
| 25 | DiscountRateOfCommission | 销售佣金折扣率  对投资人的总佣金折扣率，取值为投资人实付佣金/投资人应付佣金 | N5(2) |
| 52 | Charge | 手续费, 总手续费 | N10(2) |
| 53 | AgencyFee | 代理费 | N10(2) |
| 138 | StampDuty | 印花税 | N16(2) |
| 193 | RateFee | 费率, 分段收费考虑 | N5(4) |
| 255 | TransferFee | 过户费 | N10(2) |
| 285 | HandleCharge | 经手费, 上交所收费 | N10(2) |
| 94 | OtherFee1 | 其他费用1 | N10(2) |
| 86 | NAV | 基金单位净值 | N7(4) |
| 260 | ShareClass | 收费方式  0-前收费，1-后收费 | A1 |
| 173 | TotalBackendLoad | 后端收费总额  收费方式为后端收费时使用 | N16(2) |
| 263 | RedemptionReason | 强行赎回原因  0-小于最低持有数，1-司法执行，2-政策原因 | A1 |
| 256 | FromTAFlag | 是否注册登记人发起业务标志  0-由销售人发起，  1-由注册登记人发起，此时申请单编号为TA的流水号 | A1 |
| 276 | FeeCalculator | 计费人  0-TA计费 1-基金计费 | A1 |
| 97 | TargetDistributorCode | 对方销售人代码  参见附表：销售人代码表 | A3 |
| 176 | TransferDirection | 转入/转出标示  0-转入，1-转出 | A1 |
| 58 | FreezingDeadline | 冻结截止日期  格式为：YYYYMMDD | A8 |
| 60 | FrozenCause | 冻结原因  0－司法冻结，1-柜台冻结  2-质押冻结， 3-质押&司法冻结，4-柜台&司法冻结 | A1 |
| 257 | FrozenMethod | 冻结方式  0-原份额冻结；1-原份额+红股/红利 | A1 |
| 266 | VolumeByInterest | 利息产生的基金份数 | N10(2) |
| 24 | DefDividendMethod | 默认分红方式（只在分红申请和确认业务类型中有效）  0－红利转投，1-现金分红 | A1 |
| 8001 | BrokReff | 券商自用字段  和申请的reff字段一致 | C10 |
| 37 | CurrencyType | 结算币种  156-人民币，840-美元  344-港元，954-欧元  392-日元，826-英镑  250-法郎，280-马克 | A3 |
| 80 | LargeRedemptionFlag | 巨额赎回处理标志  0-取消，1-顺延 | A1 |
| 93 | TransactionTime | 交易发生时间  格式为：HHMMSS | A6 |
| 120 | TransactionAccountID | 投资人基金交易帐号  投资人在销售机构内开设的用于交易的帐号 | A17 |
| 121 | DistributorCode | 销售人代码 | A3 |
| 28 | DepositAcct | 投资人在销售人处用于交易的资金帐号 | C19 |
| 29 | RegionCode | 交易所在地区编号  具体编码依GB13497-92 | A4 |
| 47 | DownLoaddate | 交易数据下传日期  格式为：YYYYMMDD | A8 |
| 90 | OriginalAppSheetNo | 原申请单编号 | A24 |
| 91 | OriginalSubsDate | 原申购日期  格式为：YYYYMMDD | A8 |
| 98 | IndividualOrInstitution | 个人/机构标志  0-机构，1-个人 | A1 |
| 102 | RedemptionDateInAdvance | 预约赎回日期  格式为：YYYYMMDD | A8 |
| 150 | ValidPeriod | 交易申请有效天数 | N2 |
| 89 | OriginalSerialNo | TA的原确认流水号  表示TA确认申购的流水号 | A20 |
| 254 | Specification | 摘要说明  强行赎回原因 | C30 |
| 40 | DateOfPeriodicSubs | 定期定额申购日期  格式为：YYYYMMDD | A8 |
| 141 | TargetBranchCode | 对方网点号  转销售人/机构、非交易过户时使用 | A9 |
| 142 | TargetTransactionAccountID | 对方销售人处投资人基金交易帐号  在转销售人是一次完成时，为必须项 | A17 |
| 152 | TargetRegionCode | 对方所在地区编号  具体编码依GB13497-92 | A4 |
| 123 | DividendRatio | 红利比例 | N16(2) |
| 76 | Interest | 基金账户利息金额 | N10(2) |
| 133 | TradingPrice | 交易价格  单位基金净值+各种费用 | N7(4) |
| 147 | TargetTAAccountID | 对方TA帐号  转销售人、非交易过户时 | A12 |
| 139 | Tax | 税金 | N16(2) |
| 162 | TargetNAV | 目标基金的单位净值 | N7(4) |
| 163 | TargetFundPrice | 目标基金的价格 | N7(4) |
| 161 | CfmVolOfTargetFund | 目标基金的确认份数 | N16(2) |
| 194 | MinFee | 最少收费 | N10(2) |
| 95 | OtherFee2 | 其他费用2 | N16(2) |
| 258 | OriginalAppDate | 原申请日期  用于撤单、解冻时键入原申请日期 | A8 |
| 264 | DetailFlag | 数据明细标志  0-汇总；1-明细 | C1 |
| 262 | RedemptionInAdvanceFlag | 预约赎回标志  0-非预约赎回 1-预约赎回 | A1 |
| 261 | OriginalCfmDate | TA的原确认日期  表示TA确认申购的日期 | A8 |
| 34 | CodeOfTargetFund | 转换时的目标基金代码 | A6 |
| 55 | TotalTransFee | 交易确认费用合计 | N10(2) |
| 8000 | Mark | 记录类型  1:上交所给出当日的申报回执2:TA返回的确认信息 | N2 |

由上交所当日发送的T日业务申请回执只填写了以下有效字段，其他均为空或0;

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **ID** | **字段名** | **描述** | **备注** |
| 8 | AppSheetSerialNo | 申请单编号 | 交易流水号 |
| 67 | FundCode | 基金代码 | 与柜台申报证券代码一致 |
| 92 | TransactionDate | 交易发生日期 | 格式为：YYYYMMDD |
| 132 | ApplicationVol | 份数 | 赎回时指赎回份数，基金转换时指转换的份数 |
| 134 | ApplicationAmount | 申请金额 | 认购申购时有效 |
| 135 | BusinessCode | 业务代码 | 取值与含义参见附表：业务代码与含义表 |
| 136 | TAAccountID | 投资人基金账号 | 10位股东账号，左对齐 |
| 97 | TargetDistributorCode | 对方销售人代码 | 只在转托管时有效 |
| 34 | CodeOfTargetFund | 转换时的目标基金代码 |  |
| 24 | DefDividendMethod | 默认分红方式（只在分红申请和确认业务类型中有效） | 0－红利转投，1-现金分红 |
| 8001 | BrokReff | 券商自用字段 | 和申请的reff字段一致 |
| 8000 | Mark | 记录类型 | ‘1’ |

不同业务有效字段说明如下表：

| **字段号** | **订单**  **确认** | **认购**  **确认** | **申购**  **确认** | **赎回**  **确认** | **转托管**  **确认** | **认购**  **结果** | **分红**  **方式**  **确认** | **转换**  **确认** | **强增**  **强减** | **冻结**  **确认** | **解冻**  **确认** | **非交易**  **过户**  **确认** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 8 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  | 1 | 1 | 1 |
| 16 |  |  |  | 1 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 24 | 1 |  |  |  |  |  | 1 |  |  |  |  |  |
| 25 |  | 1 | 1 | 1 |  | 1 |  | 1 |  |  |  |  |
| 32 |  | 1 | 1 | 1 | 1 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 34 | 1 |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |  |  |
| 52 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  | 1 | 1 |  |  | 1 |
| 53 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  | 1 |  |  |  | 1 |
| 58 |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |
| 60 |  | 1 |  |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |
| 62 |  |  | 1 | 1 | 1 | 1 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 64 |  | 1 | 1 | 1 |  | 1 |  |  | 1 |  |  |  |
| 67 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 86 |  | 1 | 1 | 1 |  |  |  | 1 |  |  |  |  |
| 92 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  | 1 | 1 | 1 |
| 94 |  |  | 1 | 1 | 1 | 1 |  |  | 1 |  |  |  |
| 97 | 1 |  |  |  | 1 |  |  |  |  |  |  | 1 |
| 119 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 132 | 1 | 1 |  | 1 | 1 | 1 |  | 1 |  | 1 | 1 | 1 |
| 134 | 1 | 1 | 1 |  |  | 1 |  |  |  |  |  |  |
| 135 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 136 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 137 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 138 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  |  | 1 |  |  | 1 |
| 161 |  |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |  |  |
| 162 |  |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |  |  |
| 163 |  |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |  |  |
| 173 |  |  |  | 1 | 1 |  |  | 1 | 1 |  |  | 1 |
| 176 |  | 1 |  |  | 1 |  |  | 1 | 1 |  |  | 1 |
| 177 |  |  | 1 | 1 | 1 |  |  |  |  |  |  | 1 |
| 193 |  |  | 1 | 1 |  |  |  | 1 | 1 |  |  |  |
| 255 |  | 1 | 1 |  | 1 |  |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 256 |  | 1 | 1 |  | 1 |  | 1 | 1 | 1 |  |  | 1 |
| 257 |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 1 |  |  |
| 260 |  | 1 | 1 |  | 1 | 1 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 263 |  |  |  | 1 |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 266 |  |  |  |  |  | 1 |  |  |  |  |  |  |
| 276 |  | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  |  |  |  |  | 1 |
| 285 |  |  | 1 | 1 | 1 | 1 |  |  |  |  |  |  |
| 8000 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 8001 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |  |  |  |

## 取值附表

### 基金业务代码与含义表

BusinessCode(135)取值如下表：

|  |  |
| --- | --- |
| **类型** | **业务和其对应的业务代码** |
| 交易申请回执 | 认购申请(020)  认购申请是投资人在开放式基金募集期间提出购买该开放式基金的申请。 |
| 申购申请(022)  申购申请是投资人在开放式基金成立之后，在基金存续期间，通过开放式基金的销售人购买基金单位的申请。 |
| 赎回申请(024)  赎回申请是投资人在开放式基金成立之后，基金存续期间，通过销售人将持有的基金单位按一定价格卖给基金管理人并收回现金的申请。 |
| 转托管转出申请(028)  转托管转出申请是投资人从证券市场转出的申请。 |
| 设置分红方式申请（029）  设置分红方式是指投资人设置其基金账户下所持有某基金的分红处理方式。该业务需要在权益登记日之前提出申请。设置完成后，该基金除权时就以设定的分红处理方式进行处理。 |
| 基金转换申请（036） |
| 交易确认 | 认购确认(120)  认购确认是基金注册登记人对投资人认购申请的接收情况的处理结果。认购确认只有认购确认金额（和认购申请的金额一样）和费用，不含基金确认份数，投资人的实际认购份数，要在该基金募集期满后才能确认。 |
| 申购确认(122)  申购确认是基金注册登记人对投资人申购申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。 |
| 赎回确认(124)  赎回确认是基金注册登记人对投资人赎回申请的处理结果，包括交易确认份数、交易确认金额等信息。 |
| 转托管转出确认(128)  对于转托管转出申报的确认信息。 |
| 设置分红方式确认（129）  对于分红方式设置的确认。 |
| 基金转换确认（137和138）  成功时返回两笔确认，业务代码分别为137、138代码,失败时返回一笔确认，业务代码为138代码。 |
| TA发起的业务 | 认购结果(130)  认购结果是指开放式基金认购成功后，基金注册登记人根据投资人提出的有效认购申请和认购规则，计算出投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，该返回数据包含投资人的每一笔认购的确认金额、确认份数、认购费用等数据，其中由于份数记整，实际确认的金额=认购基金份数×发行价格＋认购费用等，实际确认的金额<=原认购申请的金额。 |
| 基金份额冻结确认(131)  基金份数冻结确认是基金注册登记人对基金份数冻结申请的处理结果。基金份数冻结后不接受除基金份数解冻以外的业务申请。 |
| 基金份额解冻确认(132)  基金份数解冻确认是基金注册登记人对基金份数解冻申请的处理结果。基金份数解冻后，对应的基金份数将恢复正常状态。解冻应根据原冻结申请具体情况，逐笔解冻及确认。 |
| 非交易过户转入确认(134)，非交易过户转出确认(135)  非交易过户转入确认、非交易过户转出确认是基金注册登记人对投资人非交易过户申请的处理结果。基金注册登记人将处理结果分别发送给该业务涉及的申请方和申请方的对方。 |
| 转托管转入确认（127）  从其他市场转入上交所市场的基金份额将通过本确认信息发送相应投资人指定的券商席位。 |
| 认购拉单（190）  因认购资金不足引起的拉单处理。 |
| 强行调增(144) ，强行调减(145)  强行调增/调减是基金注册登记人在某种特定或契约预先规定的情况下，强制性地增加/减少投资人所持基金份数。 |
| 强行赎回（142）  强行赎回确认是强行赎回的处理结果。 |

### 销售人代码表

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

|  |  |
| --- | --- |
| **销售人** | **编码** |
| 中国工商银行 | 002 |
| 中国农业银行 | 003 |
| 中国银行 | 004 |
| 中国建设银行 | 005 |
| 交通银行 | 006 |
| 上海证券交易所 | 101 |
| 深圳证券交易所 | 102 |
| 国泰基金管理公司 | 201 |
| 南方基金管理公司 | 202 |
| 华夏基金管理公司 | 203 |
| 华安基金管理公司 | 204 |
| 博时基金管理公司 | 205 |
| 鹏华基金管理公司 | 206 |
| 嘉实基金管理公司 | 207 |
| 长盛基金管理公司 | 208 |
| 大成基金管理公司 | 209 |
| 富国基金管理公司 | 210 |

### 返回代码表

ReturnCode(119)取值如下表：

注意：

1. 本表所述“交易”特指开放式基金除二级市场买卖交易外的其他交易。
2. 如果找不到合适的返回代码，统一填写“9999”，即“其它错误”。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 返回代码 | 含义 | 备注 |
| 0000 | 成功 |  |
| 0001 | 份数余额不足 |  |
| 0002 | 账户已冻结 |  |
| 0003 | 账户已挂失 |  |
| 0004 | 发行期不受理 |  |
| 0005 | 封闭期不受理 |  |
| 0006 | 非开放日不受理 |  |
| 0007 | 收到预约数据确认 |  |
| 0008 | 巨额不受理 |  |
| 0009 | 无此账户 |  |
| 0010 | 其它原因失败 |  |
| 0100 | 证件号码错误 | 包括无证件号码 |
| 0101 | 证件号码重复 |  |
| 0102 | 地区号无效 |  |
| 0103 | 业务种类非法 |  |
| 0104 | 销售人交易基金账号非法 |  |
| 0105 | 销售代理人代码错误 |  |
| 0106 | 无户名 |  |
| 0107 | 个人/法人标志非法 |  |
| 0108 | 证件类型非法 |  |
| 0109 | 无经办人姓名 |  |
| 0110 | 经办人证件类型非法 | 包括无经办人证件号码 |
| 0111 | 经办人证件号码错误 |  |
| 0112 | 无通讯地址 |  |
| 0113 | 邮政编码非法 | 包括无邮政编码 |
| 0114 | 无电话 |  |
| 0115 | 无住址电话 |  |
| 0116 | 无单位电话 |  |
| 0117 | 开户网点非法 |  |
| 0118 | 冻结挂失截止日期无效 |  |
| 0119 | 无E-MAIL地址 |  |
| 0120 | 无法人代表姓名 |  |
| 0121 | 法人代表证件类型非法 |  |
| 0122 | 法人身份证件代码非法 | 包括无法人身份证件代码 |
| 0123 | 基金账号非法 | 包括无基金账号 |
| 0124 | 密函编号非法 | 包括无密函编号 |
| 0125 | 职业代码非法 |  |
| 0126 | 学历代码无效 |  |
| 0127 | 年收入代码 |  |
| 0128 | 性别非法 |  |
| 0129 | 出生日期非法 |  |
| 0130 | 传真号码非法 |  |
| 0131 | 手机号码非法 |  |
| 0132 | 传呼机号码非法 |  |
| 0133 | 交收行代码非法 |  |
| 0134 | 交收行账户名非法 |  |
| 0135 | 交收行账号非法 |  |
| 0136 | 上交所账号非法 |  |
| 0137 | 深交所账号非法 |  |
| 0138 | 开户日期非法 |  |
| 0139 | 申请单编号非法 | 包括无申请单编号 |
| 0140 | 冻结标志非法 |  |
| 0141 | 默认分红方式非法 |  |
| 0200 | 基金代码非法 |  |
| 0201 | 交易日期非法 |  |
| 0202 | 交易时间非法 |  |
| 0203 | 销售人流水号非法 |  |
| 0204 | 币种代码非法 |  |
| 0205 | 资金账号非法 |  |
| 0206 | 交易数量非法 |  |
| 0207 | 交易金额非法 |  |
| 0208 | 对方销售人基金账号非法 |  |
| 0209 | 受理日期已变为下一个工作日 |  |
| 0210 | 对方基金账号非法 |  |
| 0211 | 过户代理地点代码非法 |  |
| 0212 | 股东账户代码非法 |  |
| 0213 | 指定券商席位号非法 |  |
| 0214 | 预约赎回日期非法 |  |
| 0215 | 网点号非法 |  |
| 0216 | 折扣率非法 |  |
| 0217 | 有效天数非法 |  |
| 0218 | 原申请单编号非法 |  |
| 0219 | 巨额赎回处理标志非法 |  |
| 0220 | 冻结原因非法 |  |
| 0221 | 对方网点号非法 |  |
| 0222 | 再投资类型非法 |  |
| 0223 | 目标基金代码非法 |  |
| 0224 | 手续费率非法 |  |
| 0225 | 手续费非法 |  |
| 0226 | 对方销售人代码非法 |  |
| 0227 | 原申购日期非法 |  |
| 0228 | 账户未挂失 |  |
| 0229 | 账户未冻结 |  |
| 0301 | 账户申请日期无效 |  |
| 0302 | 账户申请不存在 |  |
| 0303 | 投资人已注册基金账户 |  |
| 0304 | 账户申请注册失败 |  |
| 0305 | 赎回份数过小 |  |
| 0306 | 因投资人未在转入方开户致使转销售人/机构失败 |  |
| 0307 | 持有份数超过持有上限 |  |
| 0308 | 基金账户已注销 |  |
| 0309 | 单笔申购低于申购下限 |  |
| 0310 | 赎回后剩余份数低于持有下限 |  |
| 0311 | 转出方余额不足 |  |
| 0312 | 确认异常 |  |
| 0313 | 投资人名或证件类型或证件代码与股东资料不符 |  |
| 0314 | 基金账户已挂账 |  |
| 0315 | 证券账户不存在 |  |
| 0316 | 基金账户不存在 |  |
| 0317 | 基金非认购期 |  |
| 0318 | 基金非申购期 |  |
| 0319 | 基金非赎回期 |  |
| 0320 | 基金禁止转销售人/机构 |  |
| 0321 | 证券账户已注册为基金账户 |  |
| 0322 | 基金账户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转销售人/机构 |  |
| 0323 | 有在途份数，不能全转销售人/机构 |  |
| 0324 | 转出方余额为零 |  |
| 0325 | 原申请日期无效 |  |
| 0326 | 转入转出是同一代理人 |  |
| 0327 | 销售代理人不能代理此基金 |  |
| 0328 | 销售代理人无效 |  |
| 0329 | 性别代码无效 |  |
| 0330 | 申请日期无效 |  |
| 0331 | 投资人名无效 |  |
| 0332 | 投资人证件类型无效 |  |
| 0333 | 投资人证件号码无效 |  |
| 0334 | 通讯地址无效 |  |
| 0335 | 法人代表姓名无效 |  |
| 0336 | 经办人姓名无效 |  |
| 0337 | 单笔认购低于认购下限 |  |
| 0338 | 单笔认购高于认购上限 |  |
| 0339 | 基金处于权益分配期间，不允许更改分红方式 |  |
| 0340 | 单笔赎回高于预约下限 |  |
| 0341 | 单笔赎回低于赎回下限 |  |
| 0342 | 取基金信息错误 |  |
| 0343 | 写权益登记错误 |  |
| 0344 | 写基金明细表出错 |  |
| 0345 | 撤单申请无效 |  |
| 0346 | 转销售人/机构类型错 |  |
| 0347 | 转销售人/机构类型与申报数据不符 |  |
| 0348 | 旧基金账号个人资料不存在 |  |
| 0349 | 旧基金账号机构资料不存在 |  |
| 0350 | 无效分红方式 |  |
| 0351 | 该基金账号有份数允许注销 |  |
| 0352 | 赎回金额不足以支付手续费 |  |
| 0353 | 证券账户类型非法 |  |
| 0354 | 同一网点申报相同数据 |  |
| 0355 | 管理人拒绝 |  |
| 0356 | 管理人配售确认撤销 |  |
| 0357 | 认购金额过少 |  |
| 0358 | 经办人识别方式非法 |  |
| 0359 | CALLCENTER交易标志非法 |  |
| 0360 | INTERNET交易标志非法 |  |
| 0361 | 账单寄送选择方式非法 |  |
| 0362 | 有基金份数，消户非法 |  |
| 0363 | 基金账号信息未作改动, 拒绝申请 |  |
| 0364 | 基金账号凭证号非法 |  |
| 0365 | 有当日申请，销户非法 |  |
| 0366 | 基金净值非法 |  |
| 0367 | 转销售人/机构中转出与转入交易账户的基金账户不同 |  |
| 0368 | 基金不能转入 |  |
| 0369 | 基金不能转出 |  |
| 0370 | 持有份数小于最低持有份数, 应全部赎回或转换 |  |
| 0371 | 税率非法 |  |
| 0372 | 分红方案错误 |  |
| 0373 | 基金发行失败，退回认购 |  |
| 0374 | 该预约赎回单已失效 |  |
| 0375 | 手续费分成非法 |  |
| 0376 | 基金终止 |  |
| 0377 | 基金不在发行期或认购结束，认购不受理 |  |
| 0378 | 基金在正常交易期 |  |
| 0379 | 基金已发行或发行失败 |  |
| 0380 | 基金停止交易 |  |
| 0381 | 基金停止申购 |  |
| 0382 | 基金停止赎回 |  |
| 0383 | 基金正在权益登记 |  |
| 0384 | 红利发放，业务不受理 |  |
| 0385 | 无法识别的基金状态 |  |
| 0386 | 非交易过户对方账号未登记 |  |
| 0387 | 本日有冻结、挂失申请，交易无效 |  |
| 0388 | 一天仅接受一次重要资料修改 |  |
| 0389 | 分红期间有在途权益，不能处理 |  |
| 0390 | 基金账号已登记 |  |
| 0391 | 基金账号未登记 |  |
| 0392 | 该交易账号已开户 |  |
| 0393 | 有重复的冻结申请 |  |
| 0394 | 非交易过户必须逐笔确认 |  |
| 0395 | 交易后，入方余额低于最低限制 |  |
| 0396 | 交易后，出方余额低于最低限制 |  |
| 0397 | 基金转换对方基金停止交易 |  |
| 0398 | 基金无份数可冻结解冻 |  |
| 0399 | 无此冻结申请 |  |
| 0400 | 解冻份数与原冻结数不匹配 |  |
| 0401 | 超过最高赎回份数限制 |  |
| 0402 | 申购金额低于手续费 |  |
| 0403 | 总份额已超过募集金额，不能再认购 |  |
| 0404 | 按份数认购，金额计算错误 |  |
| 0405 | 不允许机构认购 |  |
| 0406 | 不允许个人认购 |  |
| 0407 | 逐笔人工处理为无效 |  |
| 0408 | 逐笔人工处理为成功 |  |
| 0409 | 已撤单 |  |
| 0410 | 巨额赎回延续部分 |  |
| 0411 | 重复开户 |  |
| 0412 | 不支持预约申请 |  |
| 0413 | 有份数冻结，不允许账户冻结 |  |
| 0414 | 没有指定赎回的基金份数 |  |
| 0415 | 小于初次投资金额限制 |  |
| 0416 | 小于追加投资限制 |  |
| 0417 | 转销售人/机构对方销售商或网点不存在 |  |
| 0418 | 不能修改客户类型 |  |
| 0419 | 重要资料修改当天不能赎回转销售人/机构 |  |
| 0420 | 申请日期大于最后认购日期 |  |
| 0421 | 巨额赎回，不能基金转换 |  |
| 0422 | 当天多次开户(交易账号重) |  |
| 0423 | 当天多次开户(基金账号重) |  |
| 0424 | 不存在要转出的份数 |  |
| 0425 | 经办人识别方式非法 |  |
| 0426 | 账单寄送选择方式非法 |  |
| 0427 | 基金账号信息未作改动, 拒绝申请 |  |
| 0428 | 持有份数小于最低持有份数, 应全部赎回或转换 |  |
| 0429 | 分红方案错误 |  |
| 0430 | 该预约赎回单已失效 |  |
| 0431 | 持有份数小于等于最低赎回份数, 应全部赎回或转换 |  |
| 0432 | 基金在个人认购期，不接受机构认购 |  |
| 0433 | 基金在机构认购期，不接受个人认购 |  |
| 0434 | 认购金额小于机构最低认购金额 |  |
| 0435 | 认购申请金额小于个人最低认购金额 |  |
| 0436 | 认购金额大于机构最高认购金额 |  |
| 0437 | 认购申请金额大于个人最高认购金额 |  |
| 0438 | 基金处于不允许申购状态 |  |
| 0439 | 申购申请金额小于机构最低追加投资金额 |  |
| 0440 | 申购申请金额小于个人最低追加投资金额 |  |
| 0441 | 申购申请金额小于机构最低首次投资金额 |  |
| 0442 | 申购申请金额小于个人最低首次投资金额 |  |
| 0443 | 定时定额申购申请金额小于最低定额 |  |
| 0444 | 定时定额申购申请金额超出最低定额部分不是级差的整数倍 |  |
| 0445 | 定时定额申购合约终止 |  |
| 0446 | 定时定额申购金额与原合约不符 |  |
| 0447 | 持有份数大于最低赎回份数, 申请赎回份数不小于最低赎回份数 |  |
| 0448 | 柜员登录注销错误 |  |
| 0449 | 柜员代码不能为空 |  |
| 0450 | 没有此柜员 |  |
| 0451 | 此柜员已被冻结 |  |
| 0452 | 此柜员已被删除 |  |
| 0453 | 柜员密码不符 |  |
| 0454 | 此柜员已经登录系统;或者此前非正常退出系统，请与系统管理员联系 |  |
| 0455 | 登录柜员记录出现异常，请与系统管理员联系 |  |
| 0456 | 注销柜员状态出现异常，请与系统管理员联系 |  |
| 0457 | 操作员过期 |  |
| 0458 | 柜员管理类错误 |  |
| 0459 | 柜员代码长度必须为3位 |  |
| 0460 | 此柜员代码已经存在 |  |
| 0461 | 柜员姓名不能为空 |  |
| 0462 | 存在同名的有效柜员，系统不允许姓名重复 |  |
| 0463 | 柜员密码不能为空 |  |
| 0464 | 柜员所属部门不能为空 |  |
| 0465 | 有效天数必须是大于0的整数 |  |
| 0466 | 起始日期不能为空 |  |
| 0467 | 确认密码不能为空 |  |
| 0468 | 组代码不能为空 |  |
| 0469 | 组的成员已经存在 |  |
| 0470 | 权限代码不能为空 |  |
| 0471 | 组的权限已经存在 |  |
| 0472 | 柜员的权限已经存在 |  |
| 0473 | 组名称不能为空 |  |
| 0474 | 此组已经存在 |  |
| 0475 | 柜员角色不能为空 |  |
| 0476 | 组非空不能删除 |  |
| 0477 | 组的成员不存在 |  |
| 0478 | 组的权限不存在 |  |
| 0479 | 根用户不能删除 |  |
| 0480 | 操作员代码不能为空 |  |
| 0481 | 没有此组 |  |
| 0482 | 此柜员代码不存在 |  |
| 0483 | 确认密码不正确 |  |
| 0484 | 修改柜员资料时柜员状态不允许被设置为"删除" |  |
| 0485 | 柜员已被删除，操作被禁止 |  |
| 0486 | 柜员处于活动状态，操作被禁止 |  |
| 0487 | 交易密码错误 |  |
| 0488 | 交易账号凭证号错误 |  |
| 0489 | 交易账户处于等待确认状态 |  |
| 0490 | 交易账户已挂失 |  |
| 0491 | 确认密码不正确 |  |
| 0492 | 基金账户处于等待确认状态 |  |
| 0493 | 当天有账户申请 |  |
| 0494 | 当天有交易申请 |  |
| 0495 | 案号非法 |  |
| 0496 | 该交易申请已经提交 |  |
| 0497 | 定时定额申购日期非法 |  |
| 0498 | 定时定额申购类型错误 |  |
| 0499 | 定时定额申购状态非法 |  |
| 0500 | 该定时定额申购已完成 |  |
| 0501 | 该定时定额申购已撤单 |  |
| 0502 | 该定时定额申购已撤消 |  |
| 0503 | 定时定额申请不存在或其它数据库错误 |  |
| 0504 | 解冻份数大于已冻结份数 |  |
| 0505 | 在同一工作日同一投资者有相同的更改基金分红方式申请 |  |
| 0506 | 交易账户已作废 |  |
| 0507 | 交易账户凭证号状态错误 |  |
| 0508 | 交易账户已销户 |  |
| 0509 | 交易账户已冻结 |  |
| 0510 | 交易账户已撤销 |  |
| 0511 | 交易账户待确认 |  |
| 0512 | 交易账户未开基金账户 |  |
| 0513 | 基金账户挂失 |  |
| 0514 | 基金账户冻结 |  |
| 0515 | 基金账户销户 |  |
| 0516 | 转销售人/机构对方机构代码与发起机构代码相同 |  |
| 0517 | 基金转换转出基金与目标基金相同 |  |
| 0518 | 交易账户与基金账户不匹配 |  |
| 0519 | 禁止此模式基金转换 |  |
| 0520 | 存在逆向基金转换 |  |
| 0521 | 无要复核的申请合同号 |  |
| 0522 | 要复核的合同号不属于本机构 |  |
| 0523 | 要复核的合同号不属于本网点 |  |
| 0524 | 要复核的合同号业务类型不一致 |  |
| 0525 | 复核人员与受理人员相同 |  |
| 0526 | 要复核的合同号已复核 |  |
| 0527 | 要复核的合同号已作废 |  |
| 0528 | 要复核的合同号已撤单 |  |
| 0529 | 复核流水的基金代码不对 |  |
| 0530 | 复核流水的申请金额不对 |  |
| 0531 | 复核流水的交易账号不对 |  |
| 0532 | 写更改申请流水的复核标志失败 |  |
| 0533 | 复核流水的操作员代码不对 |  |
| 0534 | 复核流水的申请份数不对 |  |
| 0535 | 复核流水的巨额赎回处理方式不对 |  |
| 0536 | 复核流水的对方机构代码不对 |  |
| 0537 | 复核流水的转换目标基金代码不对 |  |
| 0538 | 复核流水的申请费用不对 |  |
| 0539 | 复核流水的分红方式不对 |  |
| 0540 | 复核流水的分红比例不对 |  |
| 0541 | 无此交易码 |  |
| 0542 | 该操作现不可用 |  |
| 0543 | 该申请已撤单 |  |
| 0544 | 该申请已作废 |  |
| 0545 | 该申请还未复核 |  |
| 0546 | 电话委托受理业务不能通过柜面撤单 |  |
| 0547 | 该申请已复核 |  |
| 0548 | 系统通用参数查询失败 |  |
| 0549 | 查询表单列值信息失败 |  |
| 0550 | 查询报表输出固定数据配置信息失败 |  |
| 0551 | 查询表单输入条件的配置信息失败 |  |
| 0552 | 未定义的表单查询 |  |
| 0553 | 查询表单数据集信息失败 |  |
| 0554 | 请选择输入查询表单号 |  |
| 0555 | 未定义的查询类别 |  |
| 0556 | 查询表单数据集信息失败 |  |
| 0557 | 取申请账页失败 |  |
| 0558 | 发布日期不能为空 |  |
| 0559 | 利率生效时间非法 |  |
| 0560 | 利率非法 |  |
| 0561 | 利息税率非法 |  |
| 0562 | 实施时间不能为空 |  |
| 0563 | 最小手续费比率不能小于0 |  |
| 0564 | 最大手续费比率不能大于1 |  |
| 0565 | 最小手续费比率不能大于最大手续费比率 |  |
| 0566 | 注册登记人手续费分成比率不能为空 |  |
| 0567 | 此业务不能设置进入基金资产手续费比率 |  |
| 0568 | 手续费分成比率不能大于最小手续费比率 |  |
| 0569 | 手续费分成比率不能小于0 |  |
| 0570 | 权益登记日非法 |  |
| 0571 | 除权日非法 |  |
| 0572 | 派息日非法 |  |
| 0573 | 利得比例不能为空 |  |
| 0574 | 利得比例必须在0, 1之间 |  |
| 0575 | 分红方案编码非法 |  |
| 0576 | 费率方案编号不能为空 |  |
| 0577 | 手续费计算方案起始时间非法 |  |
| 0578 | 基金名称不能为空 |  |
| 0579 | 基金状态非法 |  |
| 0580 | 基金转换状态非法 |  |
| 0581 | 基金认购价格非法 |  |
| 0582 | 费率方案不完整 |  |
| 0583 | 存在未确认记录,不能提交 |  |
| 0584 | 此操作员未输入费率方案, 不能输入费率 |  |
| 0585 | 金额非法 |  |
| 0586 | 持有天数非法 |  |
| 0587 | 手续费率段重叠 |  |
| 0588 | 此操作员未输入费率方案, 不能删除费率 |  |
| 0589 | 基金账户受理方式不能为空 |  |
| 0590 | 不存在的基金账户受理方式 |  |
| 0591 | 到账情况不能为空 |  |
| 0592 | 证件唯一性不能为空 |  |
| 0593 | 系统状态不能为空 |  |
| 0594 | 强行签退时间不能为空 |  |
| 0595 | 强行签退持续时间不能为空 |  |
| 0596 | 强行签退持续时间不能小于0 |  |
| 0597 | 基金净值路径不能为空 |  |
| 0598 | 销售点代码不能为空 |  |
| 0599 | 清算日期不能为空 |  |
| 0600 | 工作日期不能为空 |  |
| 0601 | 巨额赎回比例不能为空 |  |
| 0602 | 巨额赎回比例必须在0-1之间 |  |
| 0603 | 未知的系统参数 |  |
| 0604 | 定时定额申购日期不能为 |  |
| 0605 | 按定时定额申购日期错 |  |
| 0606 | 印花税率非法 |  |
| 0607 | 审批日期不能为空 |  |
| 0608 | 审批人不能为空 |  |
| 0609 | 审批数量不能为空 |  |
| 0610 | 审批数量不能小于0 |  |
| 0611 | 批准的基金转换份数应小于等于基金总份数 |  |
| 0612 | 待确认的记录超过一条 |  |
| 0613 | 确认审批内容与第一次输入内容不符 |  |
| 0614 | 不支持的基金发行方案 |  |
| 0615 | 待确认的基金发行记录超过一条 |  |
| 0616 | 到款日期不能为空 |  |
| 0617 | 预售规模不能为空 |  |
| 0618 | 预售规模不能小于0 |  |
| 0619 | 认购价格不能小于0 |  |
| 0620 | 销售机构设置错误 |  |
| 0621 | 销售机构接收目录不能为空 |  |
| 0622 | 销售机构发送目录不存在 |  |
| 0623 | 销售机构接收目录不能为空 |  |
| 0624 | 销售机构接收目录不存在 |  |
| 0625 | 销售机构代码不能为空 |  |
| 0626 | 销售机构名称不能为空 |  |
| 0627 | 销售机构状态不能为空 |  |
| 0628 | 销售机构类型不能为空 |  |
| 0629 | 销售机构接受目录长度大于120 |  |
| 0630 | 销售机构发送目录长度大于120 |  |
| 0631 | 网点代码不能为空 |  |
| 0632 | 网点名称不能为空 |  |
| 0633 | 区域代码不能为空 |  |
| 0634 | 区域代码不存在 |  |
| 0635 | 银行名称不能为空 |  |
| 0636 | 银行状态不能为空 |  |
| 0637 | 公告状态不能为空 |  |
| 0638 | 公告已输入,未复核 |  |
| 0639 | 公告已复核成功 |  |
| 0640 | 未定义的公告状态 |  |
| 0641 | 此公告不存在 |  |
| 0642 | 公告标题不能为空 |  |
| 0643 | 公告日期不能为空 |  |
| 0644 | 公告日期不能比当前日期小 |  |
| 0645 | 公告内容不能为空 |  |
| 0646 | 公告类型不能为空 |  |
| 0647 | 取公告编号流水号失败 |  |
| 0648 | 操作员相同,不能复核公告 |  |
| 0649 | 操作员不同,不能修改公告 |  |
| 0650 | 公告已经发布 |  |
| 0651 | 公告复核错误 |  |
| 0652 | 不支持的传输状态 |  |
| 0653 | 未解上传包 |  |
| 0654 | 未打包上传包 |  |
| 0655 | 未解下传包 |  |
| 0656 | 未打包下传包 |  |
| 0657 | 包传输状态不存在 |  |
| 0658 | 第一次输入 |  |
| 0659 | 第一次删除 |  |
| 0660 | 第一次修改 |  |
| 0661 | 未生效 |  |
| 0662 | 已生效 |  |
| 0663 | 已实施 |  |
| 0664 | 未知状态 |  |
| 0665 | 记录只有一条 |  |
| 0666 | 记录不存在 |  |
| 0667 | 记录多于一条 |  |
| 0668 | 不是本操作员输入,不能修改, 请先清屏 |  |
| 0669 | 本操作员输入,不能再次输入 |  |
| 0670 | 不是本操作员输入,不能删除 |  |
| 0671 | 第二次输入内容与第一次输入内容不符 |  |
| 0672 | 第二次修改内容与第一次修改内容不符 |  |
| 0673 | 数据库错误 |  |
| 0674 | 写日志失败 |  |
| 0675 | 取交易账户编号失败 |  |
| 0676 | 取基金账户流水号失败 |  |
| 0677 | 取系统日期失败 |  |
| 0678 | 存在认购或未完成的赎回申请 |  |
| 0679 | 清算步骤错误 |  |
| 0680 | 取系统时间失败 |  |
| 0681 | 取参数ACCPTMD(受理方式)的值失败 |  |
| 0682 | 取交易账号凭证流水号失败 |  |
| 0683 | 取销售机构代码失败 |  |
| 0684 | 存在冻结的基金份数 |  |
| 0685 | 正在清算, 不能处理到账操作 |  |
| 0686 | 存在未审批的巨额赎回 |  |
| 0687 | 取交易账号凭证号失败 |  |
| 0688 | 取交易账号失败 |  |
| 0689 | 取交易密码失败 |  |
| 0690 | 取基金余额失败 |  |
| 0691 | 更改余额失败 |  |
| 0692 | 写资金回款流水失败 |  |
| 0693 | 交易清算类型错误 |  |
| 0694 | 取清算日失败 |  |
| 0695 | 修改投资者基金分红信息失败 |  |
| 0696 | 取市场标志失败 |  |
| 0697 | 市场标志错误 |  |
| 0698 | 现为收市状态，还未日初，不能进行业务受理 |  |
| 0699 | 现为日终状态，还未日初，不能进行业务受理 |  |
| 0700 | 系统步骤错误 |  |
| 0701 | 取市场状态描述错误 |  |
| 0702 | 设置市场状态错误 |  |
| 0703 | 设置下一工作日错误 |  |
| 0704 | 生成工作日表错误 |  |
| 0705 | 系统日初错误 |  |
| 0706 | 系统日终错误 |  |
| 0707 | 设置上一工作日错误 |  |
| 0708 | 取收市处理状态失败 |  |
| 0709 | 收市处理步骤错误 |  |
| 0710 | 取收市处理状态描述失败 |  |
| 0711 | 设置收市处理状态失败 |  |
| 0712 | 收市初始化错误 |  |
| 0713 | 收市复核错误 |  |
| 0714 | 收市写账页错误 |  |
| 0715 | 取系统状态失败 |  |
| 0716 | 取系统状态描述失败 |  |
| 0717 | 设置系统状态失败 |  |
| 0718 | 系统当前状态不允许操作 |  |
| 0719 | 取清算处理状态失败 |  |
| 0720 | 清算处理步骤错误 |  |
| 0721 | 取清算处理状态描述失败 |  |
| 0722 | 设置清算处理状态失败 |  |
| 0723 | 清算初始化错误 |  |
| 0724 | 清算数据备份错误 |  |
| 0725 | 清算数据恢复错误 |  |
| 0726 | 账户清算错误 |  |
| 0727 | 交易清算错误 |  |
| 0728 | 清算复核错误 |  |
| 0729 | 清算结束错误 |  |
| 0730 | 预清算错误 |  |
| 0731 | 清算数据汇总错误 |  |
| 0732 | 审批赎回份数大于允许的最大审批份数 |  |
| 0733 | 审批申购份数大于允许的最大审批份数 |  |
| 0734 | 基金未发生巨额或超规模不用进行审批 |  |
| 0735 | 基金发生巨额或超规模请进行审批 |  |
| 0736 | 取募集期日处理状态失败 |  |
| 0737 | 募集期日处理步骤错误 |  |
| 0738 | 取募集期日处理状态描述失败 |  |
| 0739 | 设置募集期日处理状态失败 |  |
| 0740 | 募集期日处理初始化错误 |  |
| 0741 | 募集期日处理数据备份错误 |  |
| 0742 | 募集期日处理数据检查错误 |  |
| 0743 | 募集期日处理当日有效认购统计错误 |  |
| 0744 | 募集期日处理错误 |  |
| 0745 | 募集期日处理发行统计错误 |  |
| 0746 | 募集期日处理数据汇总错误 |  |
| 0747 | 募集期日处理复核开始错误 |  |
| 0748 | 募集期日处理复核结束错误 |  |
| 0749 | 募集期日处理数据恢复错误 |  |
| 0750 | 募集期日处理结束错误 |  |
| 0751 | 基金认购费率未设置或无有效费率 |  |
| 0752 | 基金交易费率未设置或无有效费率 |  |
| 0753 | 基金NAV值未设置或无有效NAV值 |  |
| 0754 | 没有基金可进行募集处理 |  |
| 0755 | 取发行处理状态失败 |  |
| 0756 | 发行处理步骤错误 |  |
| 0757 | 取发行处理状态描述失败 |  |
| 0758 | 设置发行处理状态失败 |  |
| 0759 | 发行处理初始化错误 |  |
| 0760 | 发行处理数据备份错误 |  |
| 0761 | 发行处理错误 |  |
| 0762 | 发行处理复核开始错误 |  |
| 0763 | 发行处理复核结束错误 |  |
| 0764 | 发行处理数据恢复错误 |  |
| 0765 | 发行处理结束错误 |  |
| 0766 | 发行预处理错误 |  |
| 0767 | 计算发行利息错误 |  |
| 0768 | 发行失败处理错误 |  |
| 0769 | 发行成功处理错误 |  |
| 0770 | 利率未设置或不存在 |  |
| 0771 | 没有基金可进行发行处理 |  |
| 0772 | 分红方案非法 |  |
| 0773 | 分红方案状态错误 |  |
| 0774 | 取投资者分红信息错误 |  |
| 0775 | 计算投资者分红权益错误 |  |
| 0776 | 权益登记错误 |  |
| 0777 | 红利发放错误 |  |
| 0778 | 红利统计错误 |  |
| 0779 | 统计认购清算确认数据错误 |  |
| 0780 | 统计认购数据(给核算)错误 |  |
| 0781 | 统计发行确认数据错误 |  |
| 0782 | 统计发行确认数据(给核算)错误 |  |
| 0783 | 汇总业务申请数据错误 |  |
| 0784 | 汇总业务确认数据错误 |  |
| 0785 | 汇总统计固定收费错误 |  |
| 0786 | 读数据库失败，请查看错误日志 |  |
| 0787 | 写数据库错误，请查看错误日志 |  |
| 0788 | 数据操作失败，请查看系统日志 |  |
| 0789 | 写交易申请流水失败 |  |
| 0790 | 写账页失败 |  |
| 0791 | 数据历史备份与清除失败 |  |
| 0792 | 按申请编号检查申请数据错误 |  |
| 0793 | 按基金状态检查申请数据错误 |  |
| 0794 | 按申请数量检查申请数据错误 |  |
| 0795 | 写确认流水错误 |  |
| 0796 | 累计投资者认购金额错误 |  |
| 0797 | 写认购队列错误 |  |
| 0798 | 更改申请流水处理状态错误 |  |
| 0799 | 系统错误 |  |
| 9999 | 其它错误 |  |

# 附录：营业部代码换码算法示例

BOOL branchid2ReffPrefix(char \*branchid, char \*reff)

{

int x,m,n,p,q;

char temp[2];

x = atoi(branchid);

if ( x<1000 || x>4843 ) return FALSE;

m = ( x - 1000 ) / 62;

n = ( x - 1000 ) % 62;

if ( m>=0 && m<=9 ) p = m+48;

else if ( m >=10 && m<=35) p = m+55;

else if ( m >=36 && m<=61) p = m+61;

if ( n>=0 && n<=9 ) q = n+48;

else if ( n >=10 && n<=35) q = n+55;

else if ( n >=36 && n<=61) q = n+61;

temp[0] = p;

temp[1] = q;

memcpy(reff,temp,2);

return TRUE;

}

BOOL reffPrefix2Branchid(char \*reff, char \*branchid)

{

int x=0,m=0,n=0,p=0,q=0;

p = \*reff;

q = \*(reff+1);

if (p>=97 && p<=122) m = p-61;

else if (p>=65 && p<=90) m = p-55;

else if (p>=48 && p<=57) m = p-48;

if (q>=97 && q<=122) n = q-61;

else if (q>=65 && q<=90) n = q-55;

else if (q>=48 && q<=57) n = q-48;

if (m==0 || n==0) return 2;

x = m\*62 + n + 1000;

sprintf(branchid, "%d", x);

return TRUE;

}

# 附录：申报确认接口remark字段取值说明

本表仅供参考，后续更新的错误代码见本所外网IS111报盘软件错误代码表。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **错误代码** | **含义** |  |
| 202 | 无效操作员代码 |  |
| 203 | 无效证券代码 |  |
| 204 | 申报时间为该证券的非交易时间 |  |
| 208 | 无效买卖标志，非‘B’或者‘S’ |  |
| 209 | 交易品种不对 |  |
| 211 | 此账号不能进行该证券交易 |  |
| 212 | 价格申报出错 |  |
| 213 | 证券已被挂起 |  |
| 214 | 该股票不参与集合竞价 |  |
| 215 | 无效帐号 |  |
| 216 | 该帐号未指定在你席位 |  |
| 217 | 帐号已被挂起 |  |
| 218 | 无效申报价格 |  |
| 219 | 申报价不能为零 |  |
| 220 | 申报价格不符合最小价格步长要求 |  |
| 222 | 申报价格超出范围 |  |
| 223 | 申报买入数量必须是1000的整数倍 |  |
| 224 | 无效的申报数量 |  |
| 225 | 申报数量必须大于0 |  |
| 226 | 新股申报数量至少1000 |  |
| 227 | 申报数量不符合最小步长要求 |  |
| 228 | 申报数量超过单笔最大允许申报的上限 |  |
| 231 | 账号可卖出的余额不足 |  |
| 234 | 股票持有量超出限量 |  |
| 236 | PBU没有买入权限 |  |
| 237 | PBU没有卖出权限 |  |
| 243 | 基金帐号\机构帐号不能买卖此证券 |  |
| 244 | 'S'帐号不能买入 |  |
| 245 | 不能撤销指定（有卖空股票，请先补回卖空股票） |  |
| 246 | 不能撤销指定（有申报） |  |
| 247 | 不能撤销指定（公司卖空） |  |
| 248 | 中国证券登记结算公司不允许撤销指定 |  |
| 250 | B股结算会员代码（数据库接口中的firmid）错，可从中登公司上海分公司查询。 |  |
| 252 | 无效操作员代码 |  |
| 253 | 操作员权限不够 |  |
| 257 | 操作员申报的rec\_num序号不连续 |  |
| 263 | 市价订单不参加集合竞价 |  |
| 264 | 最优五档即时成交剩余撤销市价订单对手方无未成交订单 |  |
| 265 | 最优五档即时成交剩余转限价市价订单对手方和本方均无未成交订单 |  |
| 266 | 该券种不允许做市价订单 |  |
| 267 | 帐户没有权限进行账户式质押回购的交易及出入库 |  |
| 268 | 场内报盘对于出入库申报的统一出错代码 |  |
| 269 | 申报类型错误 |  |
| 270 | 申报类型错误 |  |
| 271 | 该帐号已指定在你席位 |  |
| 272 | 未做指定不能交易 |  |
| 273 | E 帐号不能通过场内申报进行交易 |  |
| 274 | 信用交易的申报帐户必须是E 帐户 |  |
| 275 | 普通交易的申报帐户必须不是E 帐户 |  |
| 276 | 该证券不允许担保品买入 |  |
| 277 | 信用卖出权限不足 |  |
| 278 | 该证券不允许融资买入 |  |
| 279 | 卖券还款或融资平仓权限不足 |  |
| 280 | 买券还券或融券平仓权限不足 |  |
| 281 | 该证券不允许融券卖出 |  |
| 282 | 融券卖出申报价格低于最新成交价 |  |
| 283 | 买券还券、融券卖出、融券平仓申报的信用帐户必须配置证券公司融券专用帐户 |  |
| 401 | 无效操作员代码 |  |
| 403 | 无效申报序号 |  |
| 404 | 撤单对应申报序号检验失败 |  |
| 405 | 撤单对应的证券帐号检验失败 |  |
| 406 | 撤单对应的股票代码检验失败 |  |
| 407 | 撤单对应的买卖方向检验失败 |  |
| 408 | 对应的申报已经被撤单 |  |
| 409 | 只能通过买799998撤销指定 |  |
| 410 | 只能通过买799999重新指定 |  |
| 411 | 对应的申报已成交，不能撤单 |  |
| 412 | 不允许撤单 |  |
| 413 | 撤单失败,对应的申报已成交或者已经被撤单 |  |
| 499 | 无申报可撤 |  |
| 731 | 基金公司未上传ETF申购赎回清单 |  |
| 732 | ETF状态不对 |  |
| 733 | ETF投资者持股不足 |  |
| 734 | ETF现金替代比例超过基金公司规定的比例 |  |
| 735 | ETF基金账号持股余额不足，投资者不能赎回 |  |
| 736 | ETF基金账户不能申购或赎回 |  |
| 752 | 账户中没有现券 |  |
| 753 | 账户中现券余额不足 |  |
| 754 | 账户中没有标准券 |  |
| 755 | 账户中标准券余额不足 |  |
| 756 | 账户没有质押券 |  |
| 757 | 账户的质押券余额不足 |  |
| 758 | 标准券折算率未初始化 |  |
| 759 | 标准券代码不存在 |  |
| 1005 | 登录主机失败 |  |
| 1021 | rec\_num 必须连续递增 |  |
| 1022 | 股票代码错误或者非本市场产品 |  |
| 1023 | 账号错误 |  |
| 1024 | 买卖方向错误 |  |
| 1025 | 价格错误 |  |
| 1026 | 数量错误 |  |
| 1027 | 日期错误 |  |
| 1028 | 申报单或撤消单的标志错误 |  |
| 1029 | 结算会员代码错误 |  |
| 1030 | 撤消单的ordrec域错误 |  |
| 1031 | 撤消单的ordrec域大于等于撤消单的rec\_num域 |  |
| 1034 | 撤消的申报单是失败的数据单 |  |
| 1039 | 刚读入待处理的单子的status是’P’或’p’ |  |
| 1040 | 刚读入待处理的单子的status不是’R’，也不是’P’ |  |
| 1042 | 底层通讯接收时发生错 |  |
| 1043 | 接收到的数据包内容错误 |  |
| 1050 | 撤消的申报单不存在或者撤单申报的证券代码错误 |  |
| 1100 | 申报号太大 |  |
| 1101 | 记录不匹配 |  |
| 1102 | 营业部代码格式错误，格式必须为1到65535的整数 |  |
| 2000 | 与交易所的网络连接出错 |  |
| 2001 | 被撤单的日期不是今天 |  |
| 2004 | 被撤单的帐号不是本人 |  |
| 2006 | 撤单记录中被撤单的股票代码与被撤单不一致 |  |
| 2007 | 撤单记录中被撤单的股票价格不正确，与被撤单不一致 |  |
| 2008 | 只有申报才可被撤单 |  |
| 2101 | 撤单记录和被撤单记录的股票买卖方向不同 |  |
| 2102 | 撤单记录和被撤单记录的股票数量不同 |  |
| 10000 | 内部错误，请联系上交所 |  |
| 10100 | 无效的产品子类型 |  |
| 10252 | 该交易时段内禁用该功能 |  |
| 10262 | 融券卖出不允许申报市价订单 |  |
| 10508 | PBU状态为停止状态 |  |
| 10512 | PBU交易标识为未激活（暂停状态，权限不足） |  |
| 10516 | 交易员处于不活动状态 |  |
| 10596 | 申报价格不符合最小价格步长要求 |  |
| 10708 | 投资者帐户类型对该产品无效 |  |
| 10796 | 该帐户类型不允许指定 |  |
| 10804 | 该帐号已指定在其它席位 |  |
| 10806 | 该帐户类型不允许撤销指定 |  |
| 10930 | 不正确的市场状态 |  |
| 10932 | 该交易时段内禁用此业务申报 |  |
| 11034 | 该产品此非交易类型业务今日不开放 |  |
| 11038 | 无效的分红选择 |  |
| 11040 | 无效的转托管来源或目的 |  |
| 11042 | 该业务申报不可用 |  |
| 11068 | 该PBU无权限交易此产品 |  |
| 11080 | 投资者对该产品没有买权限 |  |
| 11082 | 投资者对该产品没有卖权限 |  |
| 11128 | 投资者无此非交易类型业务权限 |  |
| 11130 | 该产品此非交易类型业务已经被暂停 |  |
| 11150 | 无效的转换基金 |  |
| 11152 | 正在进行撤销指定（可能发生在联通PBU对该帐户进行撤销指定的同时，本PBU进行订单输入的场景；也可能发生在先输入一笔普通交易，然后输入一笔该帐户撤销指定交易的场景） |  |
| 11166 | 该帐号已指定在其它席位 |  |
| 11218 | 不正确的信用标签类型 |  |
| 11236 | 该PBU无融资买入权限 |  |
| 11238 | 该PBU无融券卖出权限 |  |
| 11240 | 集合竞价最后五分钟不允许删除订单 |  |
| 11266 | 投资者无此类型产品买权限 |  |
| 11268 | 投资者无此类型产品卖权限 |  |
| 13304 | 产品未到上市日 |  |
| 13338 | 无效的订单类型和产品组合 |  |
| 13360 | 不能在集合竞价时输入国债分销买单 |  |
| 13398 | 禁止限价订单交易 |  |
| 13424 | 超过集合竞价最大订单配置量 |  |
| 13440 | 该证券不允许买券还券或融券平仓 |  |
| 13448 | 该证券不允许进行担保品卖出/卖券还款/平仓卖出 |  |
| 13454 | 不允许撤销非交易订单 |  |
| 13456 | ETF申赎上限超出 |  |
| 13458 | 交易主机繁忙 |  |

# 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，请发电子邮件到[tech\_support@sse.com.cn](mailto:tech_support@sse.com.cn)或者致电4009003600。