

上海证券交易所固定收益证券综合 电子平台外部数据接口开发指引

Ver 1.1 版

2007 年 8 月 15 日

修改记录

版本号	操作	日期	说明
V1.0	创建	2007-07-27	
V1.1	修改	2007-08-15	<p>见文件中标为红色的地方：</p> <p>1.成交数据文件中增加申报编号、申报时间、成交时间字段，删去了对手方相关三个字段，交易产品字段说明调整，增加了对场内和场外的区分，证券信息字段的证券简称为 8 位长度，成交日期修改了字段类型；</p> <p>2.对行情文件，补充了单向卫星发送的盘后行情文件名</p>

目录

1. 概述	4
2. 本方成交数据文件接口规范	4
2.1 本方成交数据下载实现方式	4
2.2 本方成交数据文件定义	4
2.3 本方成交数据文件格式	4
3. 行情数据文件接口规范	6
3.1 行情数据文件下载方式	6
3.2 行情下载文件定义	6
3.3 行情文件格式	7
3.3.1 确定报价行情记录格式	7
3.3.2 成交行情记录格式	8
3.3.3 成交明细记录格式	9

1. 概述

上证所固定收益证券综合电子平台外部数据接口规范包括以下几部分：

1. 本方成交数据文件接口规范（对交易商）
2. 行情数据文件接口规范（对信息提供商，盘后部分行情文件通过单向卫星提供交易商和托管银行）

2. 本方成交数据文件接口规范

2.1 本方成交数据下载实现方式

交易商登录系统以后，可以在菜单上选择“服务—〉成交数据下载”，指定期望文件保存的目录，当日成交数据将以 dbf 文件的形式保存到该目录。

2.2 本方成交数据文件定义

本方成交数据文件名称为 zgh[xxx].dbf，其中[xxx]为该交易商代码。

本方成交数据文件采用 dbf 格式，与上证所其它系统成交数据文件格式保持一致。该文件可使用 FoxPro、Access、Excel 等工具导入进行后续处理。

2.3 本方成交数据文件格式

	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
1	trade_no	成交编号	TEXT	10		
2	order_no	申报编号	TEXT	10		
3	trade_date	成交日期	TEXT	8		YYYYMMDD
4	order_time	申报时间	TEXT	6		HHMMSS
5	trade_time	成交时间	TEXT	6		HHMMSS
6	trade_id	交易员代码	TEXT	6		
7	proc	交易产品	TEXT	2		01：场内现券 02：场外现券 03：出入库

						04: 客户出入库 05: 隔夜回购 06: 转托管
8	account	本方股东账号	TEXT	10		
9	firm	本方交易席位号	TEXT	5		
10	stock_code	证券代码	TEXT	6		
11	stock_name	证券信息	TEXT	30		交易类型为转托管时: 证券简称(8 位)+ 银行间托管账户(11 位); 其它情况: 证券简称(8 位)
12	dir	买卖方向	TEXT	1		B: 买入 S: 卖出
13	net_price	成交净价价格	NUMBER	10	3	单位: 元
14	vol	成交数量	NUMBER	10	0	单位: 手
15	intr	应计利息	NUMBER	10	4	单位: 元
16	full_price	成交全价价格	NUMBER	10	3	单位: 元
17	face	券面总额	NUMBER	10	0	单位: 万元
18	net_sum	成交净价金额	NUMBER	12	2	单位: 万元
19	full_sum	结算金额	NUMBER	12	2	单位: 万元
20	profi	到期收益率	NUMBER	10	4	
21	mkt_quote	是否做市报价	TEXT	1		M: 做市报价 N: 非做市报价

说明:

- a. 在本方成交数据文件中, 按照成交时间顺序排列各条成交记录。
- b. 在本方成交数据文件中, 包含了由确定报价、待定报价、询价、场外申报、场务应急录入、隔夜回购、出入库、客户质押库出入库、转托管等方式达成的成交。

3. 行情数据文件接口规范

3.1 行情数据文件下载方式

上证所为每个行情提供商提供一个独立的用户账号，以及初始登录口令。行情商使用该账号和口令登录固定收益平台的交易端，用户可以在登录后更改口令。

用户在指定网站上下载并安装了固定收益平台的交易端软件后，运行该软件，能够看到登录画面。在界面下方输入上证所提供的服务器地址和端口，在界面上方输入上证所提供的用户账号和登录口令，选择使用数据库口令，点击登录后可以进入固定收益平台系统。

注：行情提供商的用户账号信息由上证所统一维护和管理，其类型为“行情提供商”，并以大写字母“I”为首字母。信息提供商的账号只能在交易时段登录系统。

行情提供商用户登录系统后，能看到如下信息。

在界面的上方为系统的报价信息区，其中包括：确定报价和待定报价。

在界面的下方为系统的行情信息窗口，可以看到实时的成交行情和逐笔成交。

行情提供商可以通过这些内容了解固定收益平台的当前交易情况。

目前盘后通过单向卫星发送确定报价行情和成交明细行情，需要的交易商可自行下载。

3.2 行情下载文件定义

目前系统提供的可下载内容包括：确定报价、成交行情、成交明细。

每一类内容对应一个独立文件，分别定义如下：

信息类型	文件名称
确定报价	ZQ_QDBJyyyyymmdd.txt
成交行情	ZQ_CJHQyyyyymmdd.txt
成交明细	ZQ_CJMXyyyyymmdd.txt

其中 yyyyymmdd 为当前日期。

单向卫星盘后发送的确定报价行情文件名称为 bjqbmmdd.txt，其中 mmdd 为当天月日；成交明细行情文件名称为 bjmxmmdd.txt，其中 mmdd 为当天月日。

格式同行情下载文件相应文件格式。

3.3 行情文件格式

行情文件每日生成一个单独的文件，当日刷新时采用覆写方式。

每个文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。
在刷新行情内容前清空，在刷新行情内容后回填，可作为刷新完成的标志。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录为定长数据，各字段的长度固定，内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

以下是不同信息类型的每行记录的格式定义。

3.3.1 确定报价行情记录格式

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
1	债券代码		TEXT	6	
2	债券简称		TEXT	30	
3	买入报价时间	发出报价的时间	TIME	8	hh:mm:ss
4	买入报价方		TEXT	10	交易商简称
5	买入价(净价)		NUMBER	10	单位：厘
6	买入数量		NUMBER	10	单位：手
7	买入全价		NUMBER	10	单位：厘
8	买入到期收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数） 如：2.1234
9	卖出报价时间	发出报价的时间	TIME	8	hh:mm:ss
10	卖出报价方		TEXT	10	交易商简称
11	卖出价(净价)		NUMBER	10	单位：厘
12	卖出数量		NUMBER	10	单位：手
13	卖出全价		NUMBER	10	单位：厘
14	卖出到期收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
15	应计利息		NUMBER	10	单位：厘

说明：

- a. 在确定报价行情文件中，按照每个债券的代码从小到大依次排列各债券的所有当前报价。
- b. 在每个债券的报价记录中，分别按最优买、卖报价的方式排序。
- c. 在报价记录中，数量为当前剩余数量，如果是冰山订单，则当实际数量大于冰山订单值，在数量一栏显示冰山订单值，而不是实际数量。
- d. 在报价记录中，如果是匿名报价，则在报价方一栏显示“匿名”。
- e. 确定报价行情文件在系统开盘后开始刷新，刷新时间为 5 秒钟，若刷新时间段内报价数据没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。

3.3.2 成交行情记录格式

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
1	债券代码		TEXT	6	
2	债券简称		TEXT	30	
3	时间	该记录生成时间	TIME	8	hh:mm:ss
4	昨日收盘价		NUMBER	10	单位：厘
5	昨日加权平均价		NUMBER	10	单位：厘
6	当日开盘价	当日开盘后的第一笔成交价格；交易首日为发行价；若当日无成交，则为上日收盘价	NUMBER	10	单位：厘
7	当日最高价		NUMBER	10	单位：厘
8	当日最低价		NUMBER	10	单位：厘
9	当日最新价	最近的一条成交的价格，收盘后为收盘价；若当日无成交，则为上日收盘价	NUMBER	10	单位：厘
10	当日加权平均价	累加该债券（每笔成交的价格乘以该笔成交数量）之和除以（总成交数量）	NUMBER	10	单位：厘
11	当日总成交量		NUMBER	10	单位：手
12	当日总成交金额	累加该债券（每笔成交的价格乘以该笔成交数量）之和	NUMBER	10	单位：万元（四舍五入到万）
13	当日总成交笔数		NUMBER	10	

14	昨日收盘收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
15	昨日加权平均收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
16	当日开盘收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
17	当日最高收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
18	当日最低收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
19	当日最新收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
20	当日加权平均收益率	累加该债券（每笔成交的收益率乘以该笔成交数量）之和除以（总成交数量）	NUMBER	10	百分数（4 位小数）

说明：

- a. 在成交行情文件中，按照每个债券的代码从小到大依次排列各债券的当前成交行情，每个债券一条记录。
- b. 每个债券的统计行情包含了由确定报价、待定报价、询价或者是场务应急录入等方式达成的成交，但不包括场外申报的成交。
- c. 在行情记录中，所有价格均为净价。
- d. 成交行情文件在系统开市后开始刷新，开盘前刷新的数据字段包括：最优买、最优卖、上日均价，开盘后所有字段都将被刷新。成交行情数据刷新时间为 5 秒钟，不论在刷新时间段内成交数据有无变化，该文件都会被刷新。

3.3.3 成交明细记录格式

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
1	债券代码		TEXT	6	
2	债券简称		TEXT	30	
3	成交日期		DATE	10	yyyy-mm-dd
4	成交时间		TIME	8	hh:mm:ss
5	成交净价		NUMBER	10	单位：厘
6	应计利息		NUMBER	10	单位：厘

7	成交全价		NUMBER	10	单位：厘
8	到期收益率		NUMBER	10	百分数（4 位小数）
9	成交量		NUMBER	10	单位：手
10	成交金额		NUMBER	10	单位：万元（四舍五入到万）
11	成交方式		TEXT	1	1：确定 2：待定 3：询价 5：应急

说明：

- a. 在成交明细行情文件中，按照成交时间顺序排列各条成交记录。
- b. 在成交明细行情文件中，包含了由确定报价、待定报价、询价或者是场务应急录入等方式达成的成交，但不包括场外申报的成交。
- c. 成交明细行情文件在系统开盘后开始刷新，刷新时间为 5 秒钟，若刷新时间段内成交数据没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。