中国证监会

中央监管信息平台

债券监管——

中证机构报价数据接口规范

v1.0.1

2019年7月

**修订记录**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **版本号** | **修订内容** | **修订时间** |
| V1.0.0 | 新建文档 | 2019.07 |
| V1.0.1 | 基于中证机构报价数据现状，调整部分接口，具体变更内容如下：  1、报送频度调整周报，结构化数据文件报送格式调整为TXT。  2、修改接口“公司债券基本信息”：  删除字段“发行人ID”和“出具无异议函日期”。  3、删除接口“企业资产支持证券与原始权益人关系”。  4、修改接口“发行人（原始权益人）基本信息”：  （1）删除字段“发行人（原始权益人）ID”、“注册地址省代码”和“注册地址市代码”；  （2）新增字段“交易场所代码”和“债券代码”；  （3）接口的主键调整为“交易场所代码”、“债券代码”和“中文全称”。  5、修改接口“债券相关中介机构基本信息”：  （1）删除字段“中介机构ID”；  （2）接口的主键调整为“交易场所代码”、“债券代码”和“机构名称”。 | 2019.08.09 |
| V1.0.2 | 修改一般数据文件规范，变更接口文件的命名规范 | 2019.09.24 |

# 编写目的

为满足证监会对公司债券、企业资产支持证券以及其相关主体的监管需要，明确中证机构报价向中央监管信息平台报送债券监管相关数据的接口要求，特制订本规范。

# 数据范围

本接口规范所包含的数据范围为在中证机构报价挂牌交易的私募公司债券以及企业资产支持证券的相关数据。

# 术语

全量数据

指在每次数据传输时，传输数据源单位系统当前时点保有的最新最全数据。本规范第6章接口数据模型中对传输数据范围另有规定的，从其规定。

增量数据

是指以某一时点的数据为基准，当前某一时点比照该基准数据所产生的变化数据。

交易日（T日）

是指按照证券交易场所的规定，进行证券交易的日期。

# 数据文件规范

## 一般数据文件规范

本接口规范所涉及的数据，以文件为基本的存储与报送单位，具体的文件类型包括结构化与非结构化数据文件两种。两种类型所应共同遵循的数据文件规范如下：

字符编码格式

文件所采用的字符编码格式为UTF-8。

文件名

文件名应满足如下的命名规则：SAC-BOND\_[接口编号]\_[版本号]\_[数据日期]\_[当日序号]\_[增全量标志].[文件扩展名]。括号内的数据内容，具体规范要求如下：

* **接口编号。**本接口规范约定的接口编号，由1位的接口形态字符（J：结构化数据；B：半结构化数据；F：非结构化数据）+4位数字表示，如：J0001。本规范接口文件的接口编号详见6.1章节接口列表。
* **版本号。**表示在文件名的数据日期下，该文件报送的版本号。同一数据日期下的版本号，从V01开始编码，如需增加新的数据版本，则按照上一版本号加1的方式进行编码。
* **数据日期。**表示接口数据所承载的信息所处的时间维度，格式为YYYYMMDD。
* **当日序号。**2位字符，根据当天传输顺序递增，一般用于每隔几小时传输增量数据的文件。第一次传送是01，第二次传送是02，以此类推。对于每日只传送一次的接口，当日序号固定为01。
* **增全量标志。**传输数据为增量时，填写Z；传输数据为全量时，填写Q。
* **文件扩展名。**对于结构化文件，扩展名为TXT；对于非结构化文件，扩展名为ZIP。

按照上述要求，参考的数据文件名样例为：

SAC-BOND\_J0001\_V01\_20190617\_01\_Z.TXT

SAC-BOND\_F0001\_V01\_20190617\_01\_Z.ZIP

## 结构化数据文件规范

对于结构化数据文件，除应满足上述一般文件规范外，还应满足如下的结构化数据文件规范。

### 记录级规范

首行记录

首行记录不留空，不含列名。

换行符

每一行记录以换行符0x0A分割。

尾行记录

文件中的最后一行记录结尾不含换行符。

### 字段级规范

字段分隔符

文件格式为以尖角号及竖线（即^|）为分隔符的TXT文件。

空字符型字段

当字符型字段不适用或值为空时也要表达其存在，即NULL字段用连续两个字段分隔符表示。

空数值型字段

当数值型字段不适用或值为空时报送NULL，即用连续两个字段分隔符表示，不能用0填充。

转义

当字段中含有换行符、双引号或者逗号时，应对该符号进行转义处理。具体转义处理方式应为：

（1）若存在半角双引号（即"），应替换成一对半角双引号（即""）进行转义，同时应用另一对半角双引号（即""）将该字段值包含起来；

（2）若存在半角逗号（即,）应用一对半角双引号（即""）将该字段值包含起来；

（3）若存在上述约定的换行符时，以0x1E对其进行替换。

数据类型

字段所对应的数据类型如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **数据类型** | **接口数据类型** | **接口数据长度** | **说明** |
| 字符型 | CHAR(n) | n | 固定长度，最大可填写n个字符 |
| VARCHAR(n) | n | 变长，最大可填写n个字符 |
| 数值型 | DECIMAL(n,m) | 实际内容长度 | n:1～19；m:0～n |
| INTEGER | 11 |  |

行尾字段

行尾字段结束处，不加分隔符。

## 非结构化数据文件规范

对于非结构化数据文件，以ZIP包的形式打包存储。在ZIP包中，包括一个结构化数据文件和若干非结构化数据文件。对于ZIP包中的结构化数据文件，其存储的是从非结构化数据文件中所提取的结构化数据，并满足上述结构化数据文件的相应规范；对于ZIP包中的非结构化数据文件，由数据源方自行命名，但应确保同一个ZIP包内的非结构化文件无重名，且能与对应的结构化文件中的记录相关联。

# 数据报送场景

在数据报送过程中，涉及首次报送、日常报送和异常报送3类报送场景。

## 首次报送

首次报送是指数据源单位按照本规范规定，向中央监管信息平台第一次报送数据的场景。

首次报送场景下，数据源单位应按照接口数据模型，生成全量数据文件，在约定报送日期的14:00前报送至中央监管信息平台，首次报送具体时间另行约定。

## 日常报送

日常报送是指数据源单位按照本规范规定，在向中央监管信息平台完成首次报送后，进行日常周期性数据报送的场景。

日常报送场景下，数据源单位应按照接口数据模型，以上个数据报送日的数据为基准，生成该报送日的增量数据文件，在约定报送日7:00前报送至中央监管信息平台，若遇节假日，报送日顺延至其后的第一个交易日。如某数据日期未产生新的增量数据，仍需将空文件报送至中央监管信息平台。

## 异常情况报送

异常情况报送是指数据源单位未能按照本接口规范的规定，将数据正常报送至中央监管信息平台的场景。

### 数据重报

当数据源单位报送至中央监管信息平台的数据接口文件未满足相应的数据质量约束条件时，需进行数据重报。数据重报时，数据源单位应产生新的数据接口文件，新的数据接口文件版本号应为上一次报送数据文件的版本号加1。

### 数据补报

当数据源单位未能按照本接口规范约定，在日常报送过程中按照正常的数据报送时点要求进行数据报送，需进行数据补报。

如T日数据未能按时报送，T+N日开始可恢复正常报送，则在报送T+N日的数据时，需补报T至T+N-1日的数据至中央监管信息平台。

# 接口数据模型

## 接口列表

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **数据文件** | | | | | **日常报送**  **（如遇节假日，顺延至交易日）** | | |
| **序号** | **数据接口名称** | **接口编号** | **结构化标志** | **传输文件格式** | **传输频度** | **传输时间** | **增全量标志** |
| 1 | 公司债券基本信息 | J0001 | 结构化 | TXT | 周 | 每周一7:00前传输上周数据 | 全量 |
| 2 | 企业资产支持证券基本信息 | J0002 | 结构化 | TXT | 周 | 每周一7:00前传输上周数据 | 全量 |
| 3 | 发行人（原始权益人）基本信息 | J0003 | 结构化 | TXT | 周 | 每周一7:00前传输上周数据 | 全量 |
| 4 | 债券相关中介机构基本信息 | J0004 | 结构化 | TXT | 周 | 每周一7:00前传输上周数据 | 全量 |
| 5 | 债券风险违约信息 | J0005 | 结构化 | TXT | 周 | 每周一7:00前传输上周数据 | 增量 |

## 债券基本信息

### 公司债券基本信息

#### 接口说明

|  |
| --- |
| * 用途：报送本交易场所挂牌的全部私募公司债券的基本信息。 * 首次报送范围：全部私募公司债券的基本信息。 * 日常报送范围：全部未到期的私募公司债券的基本信息。 |

#### 接口内容

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **数据类型** | **是否必填** | **主键** | **备注说明** |
| 1 | 交易场所代码 | CHAR(4) | Y | Y | 详见附录-交易场所代码 |
| 2 | 债券代码 | CHAR(6) | Y | Y |  |
| 3 | 债券简称 | CHAR(20) | N |  |  |
| 4 | 债券全称 | VARCHAR(500) | N |  |  |
| 5 | 债券类别代码 | CHAR(4) | N |  | 详见附录-债券类别代码0101-0104 |
| 6 | 增信措施 | VARCHAR(50) | N |  | 详见附录-公司债券增信措施代码，当存在多个时用英文半角逗号分隔 |
| 7 | 发行方式代码 | CHAR(2) | N |  | 详见附录-发行方式代码 |
| 8 | 实际发行规模 | DECIMAL(20,2) | N |  | 单位：元 |
| 9 | 期限 | DECIMAL(5,2) | N |  | 单位：年 |
| 10 | 发行利率 | DECIMAL(10,4) | N |  | 单位：%  只需填写单位前面的数值即可 |
| 11 | 发行起始日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |
| 12 | 起息日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |
| 13 | 到期日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |

### 企业资产支持证券基本信息

#### 接口说明

|  |
| --- |
| * 用途：报送本交易场所挂牌的全部企业资产支持证券的基本信息。 * 首次报送范围：全部企业资产支持证券的基本信息。 * 日常报送范围：全部未到期的企业资产支持证券的基本信息。 |

#### 接口内容

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **数据类型** | **是否必填** | **主键** | **备注说明** |
| 1 | 交易场所代码 | CHAR(4) | Y | Y | 详见附录-交易场所代码 |
| 2 | 证券代码 | CHAR(6) | Y | Y |  |
| 3 | 证券简称 | CHAR(20) | N |  |  |
| 4 | 专项计划全称 | VARCHAR(500) | N |  |  |
| 5 | 债券类别代码 | CHAR(4) | Y |  | 详见附录-债券类别代码0201 |
| 6 | 基础资产类型 | VARCHAR(50) | N |  | 详见附录-基础资产类型代码，当存在多个时，采用英文半角逗号分隔 |
| 7 | 首次债项评级 | CHAR(20) | N |  |  |
| 8 | 期限 | DECIMAL(5,2) | N |  | 单位：年 |
| 9 | 出具无异议函日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |
| 10 | 挂牌日期 | CHAR(8) | N |  | 格式为：YYYYMMDD |
| 11 | 起息日期 | CHAR(8) | N |  | 格式为：YYYYMMDD |
| 12 | 到期日期 | CHAR(8) | Y |  | 格式为：YYYYMMDD |

### 发行人（原始权益人）基本信息

#### 接口说明

|  |
| --- |
| * 用途：报送私募公司债券发行人和企业资产支持证券涉及的原始权益人的基本信息。其中，当企业资产支持证券采用双SPV（指特殊目的实体）结构或出现代理原始权益人情况时，报送真实原始权益人的信息；当出现联合原始权益人情况时，报送全部原始权益人的信息。 * 首次报送范围：全部私募公司债券发行人及企业资产支持证券涉及的原始权益人信息。 * 日常报送范围：全部未到期的私募公司债券发行人及企业资产支持证券涉及的原始权益人信息。 |

#### 接口内容

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **数据类型** | **是否必填** | **主键** | **备注说明** |
| 1 | 交易场所代码 | CHAR(4) | Y | Y | 详见附录-交易场所代码 |
| 2 | 债券代码 | CHAR(6) | Y | Y | 当报送发行人信息时，填写公司债券代码；当报送原始权益人信息时，填写企业资产支持证券代码。 |
| 3 | 中文全称 | VARCHAR(100) | Y | Y | 机构中文全称 |
| 4 | 发债主体类别代码 | CHAR(2) | Y |  | 详见附录-发债主体类别代码 |
| 5 | 企业性质代码 | CHAR(2) | N |  | 详见附录-企业性质代码 |
| 6 | 首次主体评级 | CHAR(20) | N |  |  |
| 7 | 主营业务 | VARCHAR(500) | N |  |  |
| 8 | 证监会行业类别代码 | CHAR(3) | N |  | 详见附录-证监会行业类别代码 |

### 债券相关中介机构基本信息

#### 接口说明

|  |
| --- |
| * 用途：报送私募公司债券及企业资产支持证券相关的全部中介机构的基本信息。 * 首次报送范围：所有私募公司债券及企业资产支持证券相关的全部中介机构的基本信息。 * 日常报送范围：所有未到期私募公司债券及企业资产支持证券相关的全部中介机构的基本信息。 |

#### 接口内容

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **数据类型** | **是否必填** | **主键** | **备注说明** |
| 1 | 交易场所代码 | CHAR(4) | Y | Y | 详见附录-交易场所代码 |
| 2 | 债券代码 | CHAR(6) | Y | Y | 当报送公司债券相关中介机构信息时，填写公司债券代码；当报送企业资产支持证券相关中介机构信息时，填写企业资产支持证券代码。 |
| 3 | 机构名称 | VARCHAR(100) | Y | Y | 机构中文全称 |
| 4 | 债券类别代码 | CHAR(4) | Y |  | 详见附录-债券类别代码 |
| 5 | 中介机构类型代码 | CHAR(2) | Y |  | 详见附录-中介机构类型代码 |
| 6 | 项目负责人姓名 | VARCHAR(200) | N |  | 当是会计师事务所时，填写签字会计师姓名；当是律师事务所时，填写签字律师姓名。  当存在多个时，采用英文半角逗号分隔。 |

## 债券风险及违约信息

### 债券风险违约信息

#### 接口说明

|  |
| --- |
| * 用途：报送本交易场所挂牌的私募公司债券及企业资产支持证券的风险违约信息及其历史变化过程信息。 * 首次报送范围：全部私募公司债券及企业资产支持证券的风险违约信息及其历史变化过程信息。 * 日常报送范围：私募公司债券及企业资产支持证券的风险违约信息及历史变化过程信息的增量数据。 |

#### 接口内容

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名称** | **数据类型** | **是否必填** | **主键** | **备注说明** |
| 1 | 债券风险违约ID | CHAR(32) | Y | Y | 唯一区分债券风险违约的标识 |
| 2 | 交易场所代码 | CHAR(4) | Y |  | 详见附录-交易场所代码 |
| 3 | 债券代码 | CHAR(6) | Y |  | 指公司债券代码或企业资产支持证券代码 |
| 4 | 债券类别代码 | CHAR(4) | Y |  | 详见附录-债券类别代码 |
| 5 | 数据更新时间 | CHAR(17) | Y |  | 填写风险违约信息的更新时间。  格式：  YYYYMMDDBHH24:MI:SS，其中HH24指24小时制，B指一个空格字符。 |
| 6 | 增信代偿情况 | VARCHAR(500) | N |  |  |
| 7 | 风险状态代码 | CHAR(4) | N |  | 公司债券：详见附录-风险状态代码中的0101-0106；  企业资产支持证券：详见附录-风险状态代码中的0201-0204 |
| 8 | 违约日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |
| 9 | 违约性质 | VARCHAR(200) | N |  |  |
| 10 | 风险或违约原因 | VARCHAR(500) | N |  |  |
| 11 | 已偿金额 | DECIMAL(20,2) | N |  | 单位：元 |
| 12 | 未偿金额 | DECIMAL(20,2) | N |  | 单位：元 |
| 13 | 风险化解日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |
| 14 | 全部清偿日期 | CHAR(8) | N |  | 格式：YYYYMMDD |
| 15 | 有效标志 | CHAR(1) | Y |  | 区分数据是否有效的标志。  0 无效  1 有效 |

## 代码表

### 交易场所代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 0114 | 中证报价市场（机构间私募产品报价与服务系统） |  |

### 债券类别代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 0101 | 公司债券 |  |
| 0102 | 可转换公司债券 |  |
| 0103 | 分离交易的可转换公司债券 |  |
| 0104 | 可交换公司债券 |  |
| 0201 | 企业资产支持证券 |  |

### 公司债券增信措施代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 01 | 无 |  |
| 02 | 信用担保 |  |
| 03 | 抵质押 |  |
| 04 | 混合增信 |  |
| 99 | 其他 |  |

### 发行方式代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 03 | 非公开发行 |  |

### 基础资产类型代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 0101 | 应收账款 |  |
| 0102 | 小额贷款债权 |  |
| 0103 | 融资融券债权 |  |
| 0104 | 保理融资债权 |  |
| 0105 | 证券融资融券债权 |  |
| 0106 | 股票质押回购债权 |  |
| 0107 | 保单质押贷款债权 |  |
| 0108 | 个人住房公积金贷 |  |
| 0109 | 购房尾款 |  |
| 0110 | 信托受益权 |  |
| 0111 | 委贷贷款债权 |  |
| 0112 | 同业借款债权 |  |
| 0113 | 商业物业抵押贷款（CMBS） |  |
| 0114 | 银行间信贷资产 |  |
| 0199 | 其他债权类 |  |
| 0201 | 基础设施收费 |  |
| 0202 | 保障房 |  |
| 0203 | 物业费 |  |
| 0204 | 商业物业租金 |  |
| 0205 | 物业+商业租金（综合） |  |
| 0299 | 其他未来经营收入类 |  |
| 0301 | REITS类 |  |
| 0401 | 知识产权 |  |
| 9999 | 其他 |  |

### 发债主体类别代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 01 | 债券发行人 |  |
| 02 | 原始权益人 |  |

### 企业性质代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 01 | 中央国企 |  |
| 02 | 地方国企 |  |
| 03 | 民企 |  |
| 04 | 外商独资 |  |
| 05 | 中外合资 |  |
| 06 | 中外合作 |  |
| 07 | 境外企业 |  |
| 99 | 其他 |  |

### 证监会行业类别代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
|  |  | 参见《上市公司行业分类指引》中对行业的分类 |

### 中介机构类型代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 01 | 主承销商 |  |
| 02 | 会计师事务所 |  |
| 03 | 律师事务所 |  |
| 04 | 受托管理人 |  |
| 05 | 资信评级机构 |  |
| 06 | 专项计划管理人 |  |
| 07 | 资产评估机构 |  |
| 99 | 其他 |  |

### 风险状态代码

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **代码** | **代码值** | **备注** |
| 0101 | 一般 |  |
| 0102 | 次高 |  |
| 0103 | 高 |  |
| 0104 | 违约 |  |
| 0105 | 违约已化解 |  |
| 0106 | 风险已化解 |  |
| 0201 | 正常类 |  |
| 0202 | 关注类 |  |
| 0203 | 风险类 |  |
| 0204 | 违约类 |  |