

中证指数指数通 (IndexPress) 行情传输接口规范 (Ver 2.0)

中证指数有限公司

二〇一二年一月

一. 概要

中证指数公司为了向市场发布公司所有的指数行情信息，定义了该接口文件，客户可通过中证指数公司指数行情接收程序接收指数行情信息。指数行情信息以文件的形式存放在指数行情接收程序所在的客户端。客户端程序提供对 Linux 操作系统和 Windows 操作系统的支持。

二. 指数行情信息文件说明

- 文件名

每个文件都被上传到或下载于指定给外部系统的文件夹。文件名称遵循规格说明中指定的文件名称。文件名称参照下面命名格式：

指数行情文件名称：

csiYYYYMMDD.txt (其中YYYYMMDD 分别为年月日，表示指数行情文件的交易日期)。

- 统一的文件结构

所有文件都为 GB18030 编码的文本，并必须遵循本章定义的统一的文件结构。

- 行

指数行情文件第一行用来存放表示文件作用的交易日期、自然日期和本文件记录数目的信息。属于特殊的一行，在任何情况下（包括该文件没有记录的情况）都须存在。

从第二行开始，每行为一个数据单元，由多个字段组成，各字段间以分隔符分隔。每行描述一条指数或其他类型的基本信息。一行以 “New Line” 字符，即以代码 “0xA” 结束。

- 字段分隔符

各行中的字段由分隔符分隔。所有文件均采用标准的分隔符 “|”。各行开始和结尾不包括分隔符 “|”。

- 字段

各字段均为一个遵循字段格式定义的字符串。如果某一字段为空，则该字段应为一个定长的空字符串。

字段类型为字符串型，左对齐，右补空格。

数字型右对齐，左补空格。数字型的长度包含小数点和符号位。

- 文件内容

指数行情文件不允许有空文件存在。作为有内容的文件，必须符合指数行情文件的定义。文件第一行是表示本文件基本信息的内容，从第二行开始表示指数行情文件的内容定义记录。

三. 指数行情信息文件格式

指数行情文件名称: csiYYYYMMDD.txt. 各文件中字段的顺序按照以下字段定义顺序为准。各文件第一行用来放置一些标识以及文件信息, 从第二行开始为信息记录, 信息记录有多种类型, 头两个字符代表信息类型。

文件头信息具体定义如下:

字段名	类型	长度	数据含义
BBH	字符型	2	每日传递的版本号, 目前固定为“02”。
JYRQ	字符型	8	行情文件所代表交易日期, 内容为被用于计算的那天的交易日期。日期的格式为“YYYYMMDD”。其中, YYYY: 年, MM: 月, DD: 日。
JSRQ	字符型	8	行情文件所代表的自然日期(北京时间), 内容为被用于计算的那天的自然日期(北京时间)。日期的格式为“YYYYMMDD”。如交易日为2012年1月19日的全球指数收盘时北京时间已经是2012年1月20日。
GXSJ	字符型	6	行情文件的更新时间戳(北京时间), 格式为“HHMMSS”。HH: 小时, MM: 分钟, SS: 秒

JLS	字符型	10	表示本文件拥有的记录条数， 不包括文件信息。
-----	-----	----	---------------------------

表 3-1: 文件信息数据结构表

信息记录定义如下:

1. 指数行情信息定义:

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
JLLX	字符型	2	记录类型	01: 指数行情信息 02: 指数权重信息 03: ETF 的 IOPV (参考净值)
		4	备用字段	备用字段始终为空格
ZSDM	字符型	6	指数代码	指数代码。
JC	字符型	20	指数简称	指数简称
SCDM	字符型	1	市场代码	1: 上证所; 2: 深交所; 3: 沪深; 4: 香港; 5: 亚太; 0: 全球 (附加说明见注)
SSZS	数值型	11, 4	实时指数	实时指数, 当前指数值
DRKP	数值型	11, 4	当日开盘值	当日开盘值, 当前交易日开盘指数值。初始值为 0.0000。 当值为 0.0000 时, 说明指数未开盘
DRZD	数值型	11, 4	当日最大值	当日最大值, 当前交易日最大指数值
DRZX	数值型	11, 4	当日最小值	当日最小值, 当前交易日最小指数值
DRSP	数值型	11, 4	当日收盘值	当日收盘值, 当前交易日收盘值。初始值为 0.0000。当值不为 0.0000 时, 说明指数已收盘。

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
ZRSP	数值型	11, 4	昨日收盘值	昨日收盘值，上一交易日收盘值
ZD	数值型	11, 4	涨跌	涨跌
ZDF	数值型	11, 4	涨跌幅	涨跌幅
CJL	数值型	14	成交量（股）	成交量单位为股，如该指数为债券指数，则成交量的单位为张。
CJJE	数值型	16, 5	成交金额（万元）	成交金额（万元）
HL	数值型	12, 8	汇率	汇率，该汇率在盘中时为 0.00000000，收盘后，该汇率值为该指数收盘时计算指数所使用的汇率。例：若该指数为日经 225 指数以人民币计价的指数，则汇率为人民币对日元的汇率。若该指数为沪深 300 指数以美元计价的指数，则汇率为美元对人民币的汇率。其他若该指数不涉及汇率的情况下，则始终为 1.00000000。
BZBZ	字符型	1	币种标志	使用货币。0：人民币；1：港币；2：美元；3：台币；4：日元
ZSXH	数值型	4	指数展示序号	
DRSP2	数值型	11, 4	当日收盘值 2	当日收盘值 2，若该指数为全球指数，该收盘值为当日亚太区收盘值。初始值为 0.0000。当值不为 0.0000 时，说明指数亚太区已收盘。

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
DRSP3	数值型	11, 4	当日收盘值 3	当日收盘值 3, 若该指数为全球指数, 该收盘值为当日欧洲区收盘值。初始值为 0.0000。当值不为 0.0000 时, 说明指数欧洲区已收盘。

注 1:

市场代码说明: 市场代码表示该指数的样本所在的市场范围, 可能是单市场指数, 也可能是区域市场指数, 甚至全球市场指数, 由于各市场交易时间的不同, 因此指数也在不同的时段进行计算。各市场的交易时段:

亚太: 8:00-17:00

全球: 7:00-4:00, 指数是全球指数时, 将有三个收盘值: 亚太区收盘值, 欧洲区收盘值, 全球指数收盘值

其他各具体交易所的交易时段请参考各交易所公开信息。

注 2:

在行情软件的中证指数列表中, 展示指数的顺序按指数展示序号进行排列。

2. 指数权重信息定义:

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
JLLX	字符型	2	记录类型	01: 指数行情信息 02: 指数权重信息 03: ETF 的 IOPV(参考净值)
		4	备用字段	备用字段始终为空格
ZSDM	字符型	6	指数代码	指数代码。
ZSMC	字符型	20	指数名称	指数名称
ZQDM	字符型	8	证券代码	股票代码, 例: SH600028
ZQMC	字符型	8	证券名称	证券名称, 例: 中国石化
QZ	数值型	8, 5	个股在指数中的权重比	例: 2.02075 例 (%)
DQZS	数值型	11, 4	当前指数值	

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
YXDS	数值型	11, 4	影响点数值	该股票在当前时点对指数的贡献点数 例 1: 2.5862 例 2: -3.2568

特别说明：证券代码为交易所代码+原始代码组成，如果原始代码不足 6 位，则左侧 0 补足。

交易所代码表：

交易所	代码
上海证券交易所	SH
深圳证券交易所	SZ
香港联交所	HK
纽约证券交易所	NY
纳斯达克交易所	NA
德交所	DB
伦敦证券交易所	LS
新加坡交易所	SS

如浦发银行：SH600000;新东方：NY000EDU;中国铝业：HK002600;

3. ETF 参考净值 (IOPV) 信息定义：

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
JLLX	字符型	2	记录类型	01: 指数行情信息 02: 指数权重信息 03: ETF 的 IOPV(参考净值)
		4	备用字段	备用字段始终为空格
ZQDM	字符型	6	ETF 的证券代码	ETF 的证券代码
ZQMC	字符型	20	ETF 的证券名称	ETF 的证券名称
SCDM	字符型	1	市场代码	1: 上证所; 2: 深交所; 3: 沪深; 4: 香港; 5: 亚太;

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
				0: 全球
IOPV	字符型	11, 4	基金参考净值	基金参考净值 (IOPV)