

上海证券交易所技术文档



新一代交易系统 市场参与者 接口规格说明书

(1.12 版)



上海证券交易所

二〇一一年二月

《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。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：021-58651399

通信地址：上海市浦东南路 528 号上海证券交易所技术规划与服务部

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> → 新交易系统专区

《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：

- （一） 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。
- （二） 将 STEP 部分暂时移出进行整体修订。

包括如下接口变动内容：

- （三） 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。
- （四） 增加错误代码 1102，表示营业部代码字段格式错误。
- （五） 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：

- (一) 增加了沪深 300 ETF 申购和赎回时成交回报的说明。
- (二) 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。
- (三) 修订错误代码 10932 的描述。
- (四) 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 cije 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：
 - a) 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。
 - b) 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：
 - a) 对于未即时生效的非交易类订单支持撤单。
 - b) 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记录 and 申报确认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。
 - c) 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。
 - d) 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，市场参与者启用备份数据库，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：
 - a) 申报确认记录不按照 rec_num 顺序严格递增的方式写入。
 - b) teordernum 字段只在同一个证券代码内唯一。

- c) 如果申报确认表损坏，市场参与者启用备份数据库，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：
- a) 成交记录不按照成交编号顺序严格递增的方式写入。
- b) **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。
- c) 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 $100 * \text{成交数量} * \text{cjsl} * 10$ 。
- d) 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 $\text{cjsl} * 10$ 。
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 **khIXXXXX.txt** 分别压缩为 **kghXXXXX.zip** 和 **khIXXXXX.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	8
2 实时文件和数据库接口规范	9
2.1行情接口 show2003.dbf	9
2.2申报接口 ordwth	14
2.3申报确认接口 ordwth2	22
2.4成交回报接口 cjhb	25
3 盘后数据接口规范.....	30
3.1过户数据接口 ghXXXXX.dbf	30
3.2证券帐户资料接口 zzhXXXXX.dbf	35
3.3席位联通接口 zxwXXXXX.dbf	35
3.4证券权益接口 zqyXXXXX.dbf	36
4 广播文件接口规范.....	38
4.1上市公司公告文件.....	38
4.2债券信息公告文件 biYYMMDD.txt	38
4.3国债利息接口 gzlx.MDD	39
4.4债券标准券折算率变更接口 zslMMDD.txt	40
4.5债券标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt	40
4.6债券标准券折算比率接口 xzslMMDD.txt	41
4.7 ETF 公告文件 1.0 版格式	41
4.8 ETF 公告文件 2.0 版格式	44
4.9权证信息接口 qzxxMMDD.txt	49
4.10交易公开信息公告文件 jygkxxMMDD.txt	50
4.11产品非交易基础信息接口 fjyMMDD.txt	52
4.12担保品及标的证券清单接口 dbpMMDD.txt	54
5 开放式基金数据接口规范	56
5.1开放式基金净值数据接口 kxxMMDD.txt	58
5.2开放式基金分红数据接口 khXXXXX.txt	59
5.3开放式基金帐户对帐数据接口 kyyXXXXX.txt	62
5.4开放式基金交易确认接口 kghXXXXX.txt	62
5.5取值附表	70

5.5.1.....基金业务代码与含义表70

5.5.2.....销售人代码表.....73

5.5.3.....返回代码表74

6 附录：营业部代码换码算法示例 97

7 附录：申报确认接口 remark 字段取值说明 99

8 后记 106

1 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；

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

开放式基金的 txt 文件格式另有约定。

2 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。

2.1 行情接口 show2003.dbf

Show2003.dbf	行情接口
<p>描述:</p> <p>该文件存储上交所向全市场发布的实时行情信息。内容包括整体行情、指数行情与单一证券的行情。该文件按照 S1 字段递增排序。</p> <p>(1) 第 1 条记录为特殊记录，称之为整体行情。S1 为“000000”；S2 为当前时间，格式为“HHMMSS ”左对齐，其最后为两个空格；S3 为最新 A 股指数；S4 为最新 B 股指数；S6 为当前日期；S11 为闭市标志，交易期间该字段为 0，闭市后该字段为“1111111111”，表示市场闭市，所有行情结束；S13 为最新上证指数；S15 为上海行情结束标志，“0”表示行情未结束，“1”表示行情结束；S17 为上海行情集合竞价结束标志，“0”表示集合竞价未结束，“1”表示集合竞价结束。S15 与 S17 的取值仅供深交所用来计算跨市场行情所用，会员柜台系统和行情系统请勿使用。该记录被标记为“删除”。</p> <p>(2) 对于指数代码（例如 000001），S1 为指数代码；S2 为指数名称；S3 为前收盘指数；S4 为今开盘指数；S5 为参与计算相应指数的成交金额，B 股指数中成交金额 S5 字段单位为人民币元；S6 为最高指数；S7 为最低指数；S8 为最新指数；S11 为参与计算相应指数的交易数量，S11 的单位和参与计算的证券类型相关，证券类型是股票的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。S13 为“-.-”，且右对齐。指数类记录被标记为“删除”。当指数点数过万的时候，（注意，包括第 1 条记录 000000 中的 S3、S4、S13 和指数代码对应的 S3、S4、S6、S7、S8），采用降低 1 位精度的方式，即在 N8(3)的字段内，按照 N8(2)的方式来存储，示例为 12345.67。</p> <p>(3) 对于证券交易行情，有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> 对于暂停上市的股票（也称为 PT 类股票），show2003 文件中不包含该股票的记录。 对于处于发行期内，且未设定开始上市买卖交易日期的产品，show2003 文件中不包含该产品的记录。已设定上市买卖交易日期，但日期还未到的产品，该产品出现在 show2003 文件中，且标注为“删除”。 对于最后交易日之后的产品，show2003 文件中不包含该产品的记录。 停牌证券被标记为“删除”。 	

Show2003.dbf	行情接口
<ul style="list-style-type: none"> • 对于 S3 前收盘价格、S4 今开盘价格、S5 今成交金额、S6 最高价、S7 最低价、S8 最新价、S9 当前买入价、S10 当前卖出价、S16 申买价二、S18 申买价三、S22 申卖价二、S24 申卖价三、S26 申买价四、S28 申买价五、S30 申卖价四、S32 申卖价五，它们的单位除 B 股为美元外，其他均为人民币元。对于 S5，如果累计总量超过 999999999999，显示为 999999999999。 • 对于 S15 申买量一、S17 申买量二、S19 申买量三、S21 申卖量一、S23 申卖量二、S25 申卖量三、S27 申买量四、S29 申买量五、S31 申卖量四、S33 申卖量五，它们的单位对股票为股，基金、权证为份，债券与回购为手。对于 S15、S17、S19、S21、S23、S25、S27、S29、S31、S33，如果累计总量超过 9999999999，统一显示为 9999999999。 • S11 成交数量的单位对股票为股，基金为份，债券与回购为手，权证为 100 份。如果累计总量超过 9999999999，显示为 9999999999。 • S13 为“-.-”，且右对齐。 • 对于 S3 前收盘价格，在开市之前即行发布。 • 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。 • 当 S1 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，S5 为该债券每笔成交的价格*数量*10 的总和。 • 当 S1 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，S5 为 100*S11*10。 • 当 S1 为买断式国债回购代码 203***时，（2009 年 11 月 23 日前，S5 为 100*S11*10）。新交易系统切换后，S5 为其基础产品昨日收盘价*S11*10。 • 在集合竞价时段（从 9:15 至 9:25 期间）内，S9 当前买入价和 S10 当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时 S15 申买量一和 S21 申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。S17 申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。S23 申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量。 <p>(4) 对于当日的其他交易类对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 深发行沪配售卖出，该业务已停止。 • 国债分销，同普通交易。 	

Show2003.dbf	行情接口
<p>(5) 对于当日的账户注册类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 回购注销/回购登记，回购登记业务已经停止，代码 799997 摘牌；当 S1 为回购注销代码 799996 时，S3 为 1.000，S2 为“回购注销”。 • 网络密码激活/网络密码注销，当 S1 为密码服务代码 799988 或者 939988 时，S3 为 1.000，S2 为“密码服务”。 • 指定撤销/指定登记，当 S1 为指定撤销代码 799998 时，S3 为 1.000，S2 为“撤销指定”。当 S1 为指定登记代码 799999 时，S3 为 1.000，S2 为“登记指定”。 <p>(6) 对于当日的登记行权类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 发行登记， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为发行代码 700***、760***；730***、780***；731***、781***；737***、787***；733***、783***；ETF 代码组第 4 个代码时，S3 为发行价格。该代码在发行和中签时使用。 ○ 增加对应的配号代码：741***、791***；747***、797***；744***、794***，S3 为发行价格。并置位为“删除”。（对于比例配售发行业务不产生配号代码。） ○ 增加对应的扣款/还款代码：740***、790***，S2 为“申购款”，S3 为发行价格；743***、793***，S2 为“发债款”，S3 为发行价格；ETF 代码组第 5 个代码，S2 为“认购款”，S3 为发行价格；并置位为“删除”。 ○ 恒定设置一个置位为“删除”的记录，其 S1 为 799990，S2 为“市值股数”，S3 为 1.000。 • 配股/配转债， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为配股代码 700***或者 760***等等时，S3 与 S4 为配股价格。 ○ 当 S1 为配转债代码 704***或者 764***时，S3 与 S4 为配债价格。 • 股票要约收购登记/股票要约收购撤销，当 S1 为股票要约收购代码 706***时，S3 为公布要约收购价格。 • 网上投票，S1 为投票代码 738***、788***或者 938***。 • 可转债转股，当 S1 为可转债转股代码 181***、190***或 191***时，S3 为 	

Show2003.dbf	行情接口
<p>100.000。</p> <ul style="list-style-type: none"> • 可转债回售，当 S1 为可转债的回售代码 1009**时，S3 为公布的回售价格。 • 权证行权，当 S1 为权证行权代码 582***时，S3 为行权价格。新交易系统切换后，增加披露 S15 为行权申报总量/1000。 • 开放式基金路由， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为货币市场开放式基金申购赎回代码 519***时，S3 为 T-2 日每百万份基金收益；S8 存放 T-1 日每百万份基金收益（注：若基金百万份收益为负，将变为 0 以便处理）。 ○ 当 S1 为非货币市场开放式基金申购赎回代码 519***时，S3 为 T-2 日每百份的基金净值；S8 存放 T-1 日每百份的基金净值。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金认购代码 521***时，S3 为 1.000。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金份额转托管代码 522***时，S3 为 0.000。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金分红设置代码 523***时，S3 为 0.000。 ○ 当 S1 为货币市场开放式基金转换代码 524***时，S3 为 0.000。 <p>(7) 对于当日的转换类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 账户式质押回购入库/出库，当 S1 为账户质押式回购入库/出库代码 09****/104***/1059**（105000-105899 用于分离 126***的出入库，105900-105999 用于企业债 120***、129***的出入库）时，S3 为 1.000。 <ul style="list-style-type: none"> ○ 恒定设定一个置位为“删除”的记录，其 S1 为 888880，S2 为“新标准券”，S3 为 1.000。 • ETF 申购/赎回， <ul style="list-style-type: none"> ○ 当 S1 为 ETF 申购赎回代码时（例如 510051），S3 为 T-1 日该 ETF 的 IOPV，S8 为该 ETF 的 IOPV。 ○ 当 S1 为 ETF 申购赎回资金代码时（例如 510052）。该记录被标记为删除。 <p>(8) 融资融券业务启用之后，对于当日的融资融券非交易过户类非交易业务对应的证券代码，行情有如下约定：</p>	

Show2003.dbf	行情接口
<ul style="list-style-type: none"> • 余券划转，S1 为 799981，S2 为“余券划转”； • 还券划转，S1 为 799982，S2 为“还券划转”； • 担保品划转，S1 为 799983，S2 为“担保划转”； • 券源划转，S1 为 799984，S2 为“券源划转”。 	

序号	字段名称	描述	类型
1	S1	证券代码	C6
2	S2	证券名称	C8
3	S3	前收盘价格	N8(3)
4	S4	今开盘价格	N8(3)
5	S5	今成交金额	N12
6	S6	最高价格	N8(3)
7	S7	最低价格	N8(3)
8	S8	最新价格	N8(3)
9	S9	当前买入价格	N8(3)
10	S10	当前卖出价格	N8(3)
11	S11	成交数量	N10
12	S13	市盈率	N8(3)
13	S15	申买量一	N10
14	S16	申买价二	N8(3)
15	S17	申买量二	N10
16	S18	申买价三	N8(3)
17	S19	申买量三	N10
18	S21	申卖量一	N10
19	S22	申卖价二	N8(3)
20	S23	申卖量二	N10

21	S24	申卖价三	N8(3)
22	S25	申卖量三	N10
23	S26	申买价四	N8(3)
24	S27	申买量四	N10
25	S28	申买价五	N8(3)
26	S29	申买量五	N10
27	S30	申卖价四	N8(3)
28	S31	申卖量四	N10
29	S32	申卖价五	N8(3)
30	S33	申卖量五	N10

2.2 申报接口 ordwth

Ordwth	申报接口
<p>描述:</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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”。</p> <p>对于非交易业务，有如下约定：</p> <p>(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。</p>	

Ordwth	申报接口
<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(5) 买入发行申购代码(730***、780***; 700***、760***; 731***、781***; 737***、787***; 733***、783***)或者 ETF 认购代码(ETF 代码组第 4 个代码)转义为对应证券参与申购;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***;股票市值配售首发为 737***、787***;可转债资金申购为 733***、783***。</p> <p>(6) 卖出配股代码(700***、760***; 702***、762***; 704***、764***)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***。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(9) 买入网上投票代码(738***; 788***; 938***)转义为对对应证券投票。不可撤单。买入价格代表股东大会议案,如有多个待表决的议案,则 1 元代表议案 1,2 元代表议案 2,依此类推。99 元代表所有议案。多个需逐项表决的议案可以组成一个议案组,用含两位小数的价格代表该议案组下的各个议案或者所有议案。如 2.01 元代表议案组 2 的第 1 个议案,2.02 元代表议案组 2 的第 2 个议案,2.00 元代表议案组 2 的全部议案;小数点后可以到 3 位,即 2.000 和 2.010 这样格式的输入也是可以被处理的。不采用累积投票制的议案,买入数量中 1 代表同意,2 代表反对,3 代表弃权。采用累积投票</p>	

Ordwth	申报接口
	<p>制的议案，买入数量代表选举票数。600***、601***、900***股票对应的网上投票代码为 738***、788***、938***。</p> <p>(10) 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***。</p> <p>(11) 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。</p> <p>(12) 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***。</p> <p>(13) 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。</p> <p>(14) 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。</p> <p>(15) 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。</p> <p>(16) 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。</p> <p>(17) 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。</p> <p>(18) 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。</p> <p>(19) 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****。</p> <p>(20) 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</p>

Ordwth	申报接口
<p>1.000。数量以手为最小单位。不可撤单。</p> <p>(21) 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。</p> <p>(22) 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。</p> <p>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, 订单类型必须为“LXY”。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(23) 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。</p> <p>(24) 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。</p> <p>(25) 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</p>	

Ordwth	申报接口
<p>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。</p> <p>（26） 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。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	rec_num	<p>记录编号，连续递增且唯一。</p> <p>（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。</p> <p>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。</p> <p>但是，如果申报表完全损坏，市场参与者启用备份数据库，那么为继续后续的报单业务，需要在新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：</p> <p>第一次订单申报到 8978 笔，sql 数据库发生故障需要进行切换。</p> <p>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。</p>	4 字节 Integer
2	date	<p>记录写入日期，格式为 YYYYMMDD</p> <p>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</p>	C8

		理。	
3	time	记录写入时间，格式为 HH:MM:SS	C8
4	reff	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	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	<p>申报价格。债券交易申报价格为“每百元面值债券价格”，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。</p> <p>对于交易业务，不能输入 price 字段超过 1 万元的订单。</p> <p>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。</p>	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	C8

		元面值为一手)。其它为股或者份。	
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	<p>订单类型标志, 该字段取值大小写不敏感。</p> <p>"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。</p> <p>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。</p> <p>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:</p> <p>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:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 	C3

		<p>转为限价订单；如无本方申报的，该市价订单自动撤销；</p> <p>2. 该字段的第二位和第三位为信用标签：</p> <ul style="list-style-type: none"> 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。 <p>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”。</p>	
--	--	--	--

12	ordrec	撤单编号	C8
13	firmed	<p>B 股结算会员代码，对于 A 股投资者取值无意义。</p> <p>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。</p> <p>对于 B 股境内投资者 C1 类帐户可以不填。</p>	C5
14	branchid	<p>营业部代码</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	C5
15	checkord	校验码，上交所内部使用	Binary

2.3 申报确认接口 ordwth2

ordwth2	申报确认接口
<p>描述：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>	

ordwth2	申报确认接口
<p>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。</p> <p>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。</p>	

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

2.4 成交回报接口 cjhb

Cjhb	实时成交回报接口
<p>描述:</p> <p>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。</p> <p>SSE 接口机程序访问该表时，主要通过 cjhb 和 bs 字段进行定位，该表必须以(cjhb,bs)为 Key 建立索引，或者作为主键。</p> <p>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。</p> <p>(一) 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 cijg 为配股价格，成交金额 cijje 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。</p> <p>(二) 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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 成交价格 cijg 与成交金额 cijje 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 cijg 与成交金额 cijje 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 cijg 与成交金额 cijje 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。 <p>(三) 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。</p> <p>(四) 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。对于跨市场或者跨境的 ETF，新设一个非交易代码：ETF 非沪市资金代码（可能是深市，也可能是境外其他市场）。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。）</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 成交价格 cijg 与成交金额 cijje 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) 对于跨市场或者跨境的 ETF，申购成功后，产生 0 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。 	

Cjhb	实时成交回报接口
<p>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 cjgg 为现金值；成交金额 cjje 为金额=$cjsl \times cjgg$。该值是替代标志为 3、4 和 5 的成分股实际替代金额之和。</p> <p>3) 成交价格 cjgg 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。</p> <p>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 cjgg 为现金值；成交金额 cjje 为金额=$cjsl \times cjgg$。该值是替代标志为 1 和 2 的成分股实际替代金额之和。</p> <p>5) 成交价格 cjgg 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。</p> <p>（五） 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>假设如下：</p> <p>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）。</p> <p>假设 2：市场参与人柜台系统为 cjhb 接口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。</p> <p>灾备恢复步骤，举例如下：</p> <p>步骤 1：利用如下类似 SQL 语句，从柜台系统中取出相关数据</p> <pre>SELECT gdxm, MAX(bcye) FROM sscj GROUP BY gdxm</pre>	

Cjhb	实时成交回报接口
<p>假设取回结果为</p> <pre> 3 0000034160 2 0000179343 1 0000162260 4 0000059770 </pre> <p>(注意，几条结果和当日实际成交情况有关)</p> <p>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。</p> <pre> 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 </pre> <p>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。</p>	

Cjhb	实时成交回报接口
<p>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。</p> <p>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。</p>	

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 cjbh 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者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	cjst	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	C10

		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’。	
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	cjig	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	cjie	<p>成交金额。精度为小数点后 2 位。</p> <p>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。</p> <p>普通交易时，该字段的取值方式如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 对应股票、封闭式基金、ETF、权证产品，该字段为成交价格 $cjig \times$ 成交数量 $cjsl$。 • 对应债券产品，该字段为成交价格 $cjig \times$ 成交数量 $cjsl \times 10$。 • 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 $cjig \times$ 成交数量 $cjsl \times 10$）。新交易系统切换后，将采用与行情一致的的计算方式，即 $100 \times$ 成交数量 $cjsl \times 10$。 • 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 $cjig \times$ 成交数量 $cjsl \times 10$）。新交易系统切换后，将采用与行情一致的的计算方式，即基础产品昨日收盘价 \times 成交数量 $cjsl \times 10$。 <p>如果实际成交金额超过 999,999,999.99，系统会填写-1，请使用该字段的参与者特殊处理。</p>	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

3 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。

3.1 过户数据接口 ghXXXXX.dbf

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p>描述：</p> <p>文件名中 XXXXX 表示席位号。闭市后发送。</p> <p>该接口文件的组织形式同实时成交回报数据接口类似。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。</p> <p>新交易系统切换后，不再按照 cjbh 字段排序。</p> <p>新交易系统切换后，对于 B 股 PBU 同样产生该接口文件。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(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 cijg 为 0，成交金额 cje 为 0，成交时间 cjsj 为 150000，买卖方向 bs 为 B 的过户记录。</p> <p>(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 cijg 为 0，成交金额 cje 为 0，成交时间 cjsj 为 150000，买卖方向 bs 为 B 的过户记录。</p> <p>(3) 对于发行业务，过户库会在多日均含有有关数据。</p> <p>市值配售发行过户库记录说明：</p> <ul style="list-style-type: none"> T 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 747***）；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 cijg 为 0；成交金额 cje 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；买卖方向 bs 为 B。 	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<ul style="list-style-type: none"> T+1 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 737***）；成交编号 cjbh 指中签号；成交数量 cjsl 指中签数量；成交价格 cjig 指中签价格；成交金额 cjie 等于分配数量乘以结算价格；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。 <p>资金申购发行过户库记录说明：</p> <ul style="list-style-type: none"> T 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 cjbh 为 -1,-2,...）成交数量 cjsl 为申购数量；成交价格 cjig 为申购价格；成交金额 cjie 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。 T+2 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 cjig 为 0；成交金额 cjie 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。 T+3 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 cjbh 为 -1,-2,...；）成交数量 cjsl 为 T 日申购数量；成交价格 cjig 为 T 日申购价格；成交金额 cjie 为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 S。 T+3 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 cjig 指最终确定的发行价格；成交金额 cjie 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。 <p>ETF 认购返回数据说明：</p> <ul style="list-style-type: none"> T 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 cjig 为申购价格；成交金额 cjie 为扣款金额等于申购 	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p>数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 B 的记录。</p> <ul style="list-style-type: none"> • T+2 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 cjig 为 T 日申购价格；成交金额 cjie 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。 • T+2 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 cjig 指最终确定的发行价格；成交金额 cjie 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。 <p>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 cjie 为 0.00，申请编号 sqbh 为“重复申报”。</p> <p>2009 年 6 月本所发布《沪市股票上网发行资金申购实施办法》。</p> <p>其中第二条的条款二约定：‘投资者参与网上公开发行股票申购，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 cjie 为 0.00，申请编号 sqbh 为“违规重复”。</p> <p>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 cjie 为 0.00，申请编号 sqbh 为“网下在先”。</p> <p>（4） 网上投票成功输入后，产生“过户”记录。证券代码 zqdm 为投票代码；成交编号 cjbh 填写交易所订单编号的后 8 位；成交数量为订单数量；成交价格 cjig 为订单价格；成交金额 cjie 为 0；成交时间 cjsj 为 150000。</p>	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p>(5) 可转债转股成功后，产生两条过户记录：卖出债券记录与买入转换后股票记录。为避免与正常的债券或者股票交易的成交编号 cjbh 重复，成交编号 cjbh 从 90000001 开始编号；（这两条过户记录的成交编号相同）成交数量 cjsl 填写持仓变化情况；成交价格 cjg 为 0；成交金额 cje 为 0；成交时间 cjsj 为 150000。</p> <p>(6) 配股成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。</p> <p>(7) 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。</p> <p>(8) 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。</p> <p>(9) ETF 申购成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。</p> <p>(10) ETF 赎回成功后，产生与实时成交回报记录相同的过户记录。</p>	

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	cjg	成交价格	N8(3)
12	cje	成交金额	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	C1

		<p>对于 E 类型帐户的融资融券业务，对应关系如下：</p> <p>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");</p> <p>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");</p> <p>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");</p> <p>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");</p> <p>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");</p> <p>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");</p> <p>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");</p> <p>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");</p>	
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。

	新股资金定价 /询价申购 新股东定价/ 询价增发 (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	可转债资金申 购
发行申购/中 签代码	730*** 780***	700*** 760***	731*** 781***	737*** 787***	733*** 783***
发行配号代	741***		741***	747***	744***

码	791***		791***	797***	794***
发行扣款/还款代码	740*** 790***		740*** 790***		743*** 793***

3.2 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

3.3 席位联通接口 zxwXXXXX.dbf

zxwXXXXX.DBF	席位联通接口
--------------	--------

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

3.4 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。只在市值配售进行前一日闭市后发送。由于市值配售业务已经停止，不再发送该文件。 该接口文件说明有关投资者所拥有股票的市值。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券帐户	C10
2	zqdm	证券代码，为空	C6
3	zqye	登记日的证券余额，为空	N12
4	qydm	权益代码，为 '799990'，表示市值	C6

5	qymc	权益名称，为空	C10
6	qybl	权益比例，为空	N12(8)
7	qysl	权益数量，为投资者投资者的股票市值除以 1 万再乘以 1 千后的结果。	N12
8	qyjg	权益价格，为空	N8(3)
9	gsdm	指定席位号（PBU）	C5
10	qsdm	停用	C5
11	djrq	权益登记日期，为空	C8
12	clbz	处理标志，柜台系统自由使用	C1

4 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。

4.1 上市公司公告文件

MMDDfNNN.TXT, MMDDzNNN.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，NNN 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。	

4.2 债券信息公告文件 biYYMMDD.txt

biYYMMDD.txt	国债利息接口
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

4.3 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)

4.4 债券标准券折算率变更接口 zsIMMDD.txt

zsIMMDD.txt	席位式质押回购债券标准券折算率接口
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。 该接口文件说明债券品种在折算率启用日期所在星期开始适用的债券标准券折算率。	

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	C20
3	标准券折算率	标准券折算率	N15
4	开始适用日	YYYYMMDD	C8
5	结束适用日	YYYYMMDD	C8

4.5 债券标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt

zslwMMDD.txt	席位式质押回购债券标准券折算率公告文件
描述: 转发中登上海分公司 zsgg1yyyyymmdd001.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	

4.6 债券标准券折算比率接口 xzsIMMDD.txt

xzsIMMDD.txt	账户式质押回购折算率接口
<p>描述:</p> <p>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。</p> <p>该接口文件说明债券参加账户式质押回购业务时折算为标准券比例。</p> <p>字段间用分隔符' '定位。</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	国债证券代码	国债证券代码	C6
2	标准券比例	标准券比例	N15(3)

4.7 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
---	----------

50_MMDD.ETF, 180_MMDD.ETF, HL_MMDD.ETF, YQ50MMDD.ETF 510???MMDD.ETF	ETF 公告文件
<p>描述:</p> <p>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。</p> <p>央企 50ETF 文件名为 YQ50MMDD.ETF。</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的日期。</p> <p>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)。</p> <p>开市前发送。</p> <p>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。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。</p>	

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	申购/赎回时使用的一级市场基金代码 比如 510051	C6
2	CreationRedemptionUnit	每个篮子 (最小申购赎回单位) 对应的 ETF 份数, 目前为 1000000 份 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 Y 表示由交易主机计算 IOPV 并通过行情发布 N 表示不由交易主机计算也无需通过行情发布	C1
5	CreationRedemption	申购和赎回允许状态，每日开始交易后不允许改变	C1
6	Recordnum	表示下面的股票记录数	C3
7	EstimateCashComponet	T 日每个篮子的现金差额，总长为 11 位（包括小数点）， 2 位小数 取值范围：[-99999999.99, 99999999.99]	C11
8	TradingDay	T 日日期，格式 YYYYMMDD	C8
9	PreTradingDay	T-1 日日期，格式 YYYYMMDD	C8
10	CashComponent	T-1 日申购赎回基准单位的现金余额 取值范围：[-99999999.99, 99999999.99]	C11
11	NAVperCU	T-1 日申购赎回基准单位净值，总长为 12 位，包括小数点，其中小数部分为 2 位。 取值范围：[0, 999999999.99]	C12
12	NAV	T-1 日基金的单位净值。总长为 8 位，包括小数点，其中小数部分为 4 位。 取值范围：[0, 999.9999]	C8

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	股票代码	关键字，递增排序	C6
2	股票简称	四位中文，左对齐，右补空，对正确性不校验	C8

3	股票数量	每个申购篮子中该成分股的数量，数据右对齐，左补空	C8
4	替代标志	<p>表示该股票是否允许用现金进行替代。</p> <p>0 表示该股票为沪市股票，禁止现金替代（必须有股票）</p> <p>1 表示该股票为沪市股票，可以进行现金替代（先用股票，股票不足的话用现金替代）</p> <p>2 表示该股票为沪市股票，必须用现金替代。</p> <p>3 表示该股票为深市股票，退补现金替代。</p> <p>4 表示该股票为深市股票，必须现金替代。</p>	C1
5	溢价比例	<p>股票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），小数点后 5 位，数据右对齐，左补空，小数必须为 5 位，例如：2.551% 在文件中用 0.02551 表示；2.1% 在文件中用 0.02100 表示。</p> <p>此字段只有当替代标志为 ‘1’ 、 ‘3’ 、 ‘4’ 时才使用。</p>	C7
6	总金额	<p>当某只股票必须用现金替代的时候，该股票所需总金额。</p> <p>总长为 12 位（包括小数点），小数点后 3 位</p> <p>数据右对齐，左补空，小数必须为 3 位，例如：2000 在文件中用 2000.000 表示</p> <p>此字段只有当替代标志为 ‘2’ 、 ‘3’ 、 ‘4’ 时才使用。</p>	C12

4.8 ETF 公告文件 2.0 版格式

510???MMDD.ET2	ETF 公告文件 2.0 版
----------------	----------------

510???MMDD. ET2	ETF 公告文件 2.0 版
<p>描述:</p> <p>转发 ETF 基金管理公司 2.0 版定义文件 fm0xxetfdYYYYMMDD001.txt，并重新命名。文件名更改为 510???MMDD.ET2，文件名中 510???为 ETF 二级市场交易证券代码，MMDD 表示月日格式的日期，开市前发送。</p> <p>向市场转发的基金管理公司 ETF 公告文件 2.0 版，用于替代 ETF 公告文件 1.0 版。</p> <p>2.0 版文件由多个节段组成，每个节段由多个字段行组成，代表同一类型的待处理条目。</p> <p>一个节段以行“\\<SectionName Version=“Version Number”>\\”起始，以“\\</SectionName>\\”结束。SectionName 为节段名，取值 Version Number 用于描述本节段数据的版本号。</p> <p>文件至少包括一个节段。如果某一节段为空，该节段可被简化为一行“\\<SectionName Version=“Version Number”/>\\”</p> <p>各节段均由字段行组成。每字段行为一个数据单元，由多个字段组成，各字段间以分隔符 “ ” 分隔，每字段行开头和结束包括分隔符，每一行用 “0x0A” 来结束。</p> <p>各字段均为一个遵循接口规格定义的字符串。如果某一字段为空，则该字段为接口规格中约定的定长空格字符串。例如对市场发布的文件中投资者账户字段和 PBU 字段为空，故置为定长的空格字符串。</p> <p>文件的具体节段和字段数据格式同本所外网新交易专区发布的《IS103 ETF 基金公司系统接口规格说明书》最新版本（1.1 版起）“基于文件的接口-ETF 定义文件 2.0 版格式”章节中关于 ETF2.0 定义文件接口规格的描述。</p>	

编号	字段名	字段类型	描述	必选项
ETFMaster Version="2.0"				
1	Version	C 2	ETF 每日传递的版本号，从 01 开始，供比较用，必须递增（可以不连续） 若上传失败，可以不增加	是
2	ISIN Code	C 12	ETF 产品国际代码	否
3	Fund Instrument ID 1	C 6	基金申赎代码 必须与交易代码对应	是

4	Fund Instrument ID 2	C 6	基金交易代码	是
5	Investor Account ID	C 10	ETF 基金在申购/赎回中使用的投资者账户 ID	是
6	PBU ID	C 5	投资者账户指定的 PBU，可以是联通 PBU	是
7	Fund Name	C10	基金名称	否
8	Fund Company Name	C20	基金公司名称	否
9	Underlying Index	C6	标的指数代码	否
10	Underlying Index ISIN Code	C 12	标的指数国际代码	否
11	Creation Redemption Unit	N 8	每个篮子（最小申购、赎回单位）对应的 ETF 份数 必须大于 0	是
12	Trading Day	C8	当前交易日	否
13	Pre Trading Day	C8	前一交易日，具体由业务含义约定	否
14	NAVperCU	N12 (2)	前一日最小申赎单位净值 最大长度为 12 位（含小数点），2 位小数	否
15	NAV	N10 (4)	前一日基金份额净值 最大长度为 10 位（含小数点），4 位小数	否
16	Pre Cash Component	N11 (2)	前一日现金差额 最大长度为 11 位（含小数点），2 位小数	否
17	Cash Dividend	N8 (4)	最小基金单位现金分红 最大长度为 8 位（含小数点），4 位小数	否
18	Estimated cash	N 11 (2)	T 日每个篮子的预估现金	是

	component		差额，最大长度为 11 位 (包括小数点)，2 位小数	
19	Max Cash Ratio	N 7 (5)	总的现金替代比例，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 必须大于等于 0	是
20	CreationLimit	N12	当日申购限额 必须大于等于每个篮子对应的 ETF 份数 (Creation Redemption Unit) 字段 为 0 表示不做控制	是
21	RedemptionLimit	N12	当日赎回限额 必须大于等于每个篮子对应的 ETF 份数 (Creation Redemption Unit) 字段 为 0 表示不做控制	是
22	Publish IOPV Flag	C 1	用以表示单位净参考值是否需要公布的标志位 Y - 由交易主机计算 IOPV 且通过行情发布 B - 交易主机不计算 IOPV 但要通过行情发布 跨境 ETF，此字段取值应为 B，但系统不进行校验	是
23	Creation Redemption Switch	C 1	申购/赎回切换 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	是

24	Record Number	N 3	成份产品的数目 必须大于等于 0，且与后续成份股数量相同	是
ETFConstituent Version="2.0"（注：重复该字段数据表示多个成分股信息）				
1	ISIN Code	C 12	国际产品代码	否
2	Instrument ID	C 6	产品 ID 对于替代标志为 0,1,2,3 的产品，为必填项，且必须按照字段递增排序 若替代标志为 0,1,2，必须为沪市股票 若替代标志为 3，必须为跨市场指数的深市股票 对于替代标志为 4, 5 的产品，只检查字段长度，且不检查是否排序	否
3	IstrumentName	C15	产品简称	否
4	Quantity	N 10	该产品数量 必须大于等于 0，且为 100 的整数倍	是
5	Substitution Flag	C 1	替代标志。表示该成份产品是否可被现金替代 0 – 沪市不可被替代 1 – 沪市可以被替代 2 – 沪市必须被替代 3 – 深市退补现金替代 4 – 深市必须现金替代 5 – 非沪深市场成分股退补现金替代	是
6	Premium Rate	N 7 (5)	溢价比例。股票用现金进行替代的时候，计算价格	否

			时增加的比例（不含100%）。总长为7位（包括小数点），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) 替代标志为0、2、4时，为非必填项，该值无意义	
7	Substitution cash amount	N 12 (3)	替代金额。当某只股票必须用现金替代的时候，该股票所需总金额。 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时此字段必填，且必须大于等于0 替代标志为0、1时，为非必填项，该值无意义	否

4.9 权证信息接口 qzxxMMDD.txt

qzxxMMDD.txt	权证信息接口
--------------	--------

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

4.10 交易公开信息公告文件 jygkxxMMDD.txt

jygkxxMMDD. txt	交易公开信息公告文件
-----------------	------------

jygkxxMMDD.txt	交易公开信息公告文件
<p>描述:</p> <p>转发上交所信息中心文件。按照交易规则 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。</p> <p>该文件为文本文件。</p>	

4.11 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: 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
1.	上交所证券标识代码	上交所证券标识代码	C12
2.	产品证券代码	产品证券代码	C6
3.	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 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	C2

fjyMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
		ER ETF赎回 WE 权证行权 VT 投票 BD 回购入库 BW 回购出库 FS 要约预受 FC 要约撤销	
4.	非交易订单输入开始日期	订单输入开始日期。	8 YYYYMMDD
5.	非交易订单输入结束日期	订单输入结束日期。	8 YYYYMMDD
6.	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)
7.	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)
8.	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)
9.	IPO总量	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，发行总量。	N17(3)
10.	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
11.	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
12.	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

fjyMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
13.	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
14.	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)
15.	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)
16.	IPO发行价格	当非交易业务类型为IN、IS、IE时，发行价格。	N13(5)
17.	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)
18.	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)
19.	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
20.	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
21.	配股比例	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股比例。	N10(6)
22.	配股价格	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股价格。	N13(5)
23.	配股总量	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股总量。	N16(3)

4.12 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
-------------	--------------

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

5 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 khIXXXXX.txt 压缩为 kghXXXXX.zip 一个文件。新交易系统切换后, kghXXXXX.txt 和 khIXXXXX.txt 分别压缩为 kghXXXXX.zip 和 khIXXXXX.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

5.1 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-交易, 1-发行 2-发行成功, 3-发行失败 4-基金停止交易 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	C1

ID	字段名	描述	类型
		1-价外费	
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)

5.2 开放式基金分红数据接口 khIXXXXX.txt

khIXXXXX.txt	开放式基金分红数据文件接口
<p>描述:</p> <p>转发自中登总公司。闭市后发送。</p> <p>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 and 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。</p> <p>对于货币市场基金，基金分红不作取整处理。</p> <p>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。</p> <p>对于现金分红方式：DividenAmount 项=ConfirmeAmount 项（分红的现金）</p> <p>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）</p>	

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/红利再投资基金数，登记日基金持有人的基金份额	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

5.3 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	持有人可用基金份额	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)

5.4 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
--------------	---------------

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 519xxx 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，	C1

		0-中间过程 1-业务过程结束	
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	利息产生的基金份额	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	A17

		在转销售人是一次完成时，为必须项	
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	N2

		确认信息	
--	--	------	--

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					

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
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

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
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			

5.5 取值附表

5.5.1 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。

	<p>赎回申请 (024)</p> <p>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。</p>
	<p>转托管转出申请 (028)</p> <p>转托管转出申请是投资人从证券市场转出的申请。</p>
	<p>设置分红方式申请 (029)</p> <p>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。</p>
	<p>基金转换申请 (036)</p>
交易确认	<p>认购确认 (120)</p> <p>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。</p>
	<p>申购确认 (122)</p> <p>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。</p>
	<p>赎回确认 (124)</p> <p>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。</p>
	<p>转托管转出确认 (128)</p> <p>对于转托管转出申报的确认信息。</p>
	<p>设置分红方式确认 (129)</p> <p>对于分红方式设置的确认。</p>
	<p>基金转换确认 (137 和 138)</p> <p>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。</p>

TA 发起的业务	<p>认购结果(130)</p> <p>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=认购基金份额×发行价格+认购费用等，实际确认的金额≤原认购申请的金额。</p>
	<p>基金份额冻结确认(131)</p> <p>基金份额冻结确认是基金注册登记人对基金份额冻结申请的处理结果。基金份额冻结后不接受除基金份额解冻以外的业务申请。</p>
	<p>基金份额解冻确认(132)</p> <p>基金份额解冻确认是基金注册登记人对基金份额解冻申请的处理结果。基金份额解冻后，对应的基金份额将恢复正常状态。解冻应根据原冻结申请具体情况，逐笔解冻及确认。</p>
	<p>非交易过户转入确认(134)，非交易过户转出确认(135)</p> <p>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。</p>
	<p>转托管转入确认(127)</p> <p>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。</p>
	<p>认购拉单(190)</p> <p>因认购资金不足引起的拉单处理。</p>
	<p>强行调增(144)，强行调减(145)</p> <p>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额。</p>
	<p>强行赎回(142)</p> <p>强行赎回确认是强行赎回的处理结果。</p>

5.5.2 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

5.5.3 返回代码表

ReturnCode(119)取值如下表:

返回代码	含 义
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	销售人交易基金帐号非法
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	TA 基金帐号非法（包括无 Ta 基金帐号）
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	交收行帐号非法
0136	上交所帐号非法
0137	深交所帐号非法

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	资金帐号非法
0206	交易数量非法
0207	交易金额非法
0208	对方销售人基金帐号非法
0209	受理日期已变为下一个工作日
0210	对方 TA 帐号非法
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	帐户申请日期无效
0302	帐户申请不存在
0303	投资人已注册基金帐户
0304	帐户申请注册失败
0305	赎回份数过小
0306	因投资人未在转入方开户致使转托管失败
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	基金账户已挂帐
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	基金禁止转托管
0321	证券账户已注册为基金账户
0322	基金帐户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转托管
0323	有在途份数，不能全转托管
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	转托管类型错
0347	转托管类型与申报数据不符
0348	旧基金帐号个人资料不存在
0349	旧基金帐号机构资料不存在
0350	无效分红方式
0351	该基金帐号有份数允许注销
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	有基金份额，销户非法
0363	基金账号信息未作改动，拒绝申请
0364	TA 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	转托管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	基金帐号已登记
0391	基金帐号未登记
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	转托管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托管
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(交易帐号重)

0423	当天多次开户(基金帐号重)
0424	不存在要转出的份数
0425	经办人识别方式非法
0426	帐单寄送选择方式非法
0427	基金帐号信息未作改动, 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	交易帐号凭证号错误
0489	交易帐户处于等待确认状态
0490	交易帐户已挂失
0491	确认密码不正确
0492	基金帐户处于等待确认状态
0493	当天有帐户申请
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	交易帐户已作废
0507	交易帐户凭证号状态错误
0508	交易帐户已销户
0509	交易帐户已冻结
0510	交易帐户已撤销
0511	交易帐户待确认
0512	交易帐户未开基金帐户
0513	基金帐户挂失
0514	基金帐户冻结
0515	基金帐户销户
0516	转托管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	交易帐户与基金帐户不匹配
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	复核流水的交易帐号不对
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	取申请帐页失败
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	TA 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	基金帐户受理方式不能为空
0590	不存在的基金帐户受理方式
0591	到帐情况不能为空
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空

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
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	取交易帐户编号失败
0676	取基金帐户流水号失败
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	取交易帐号凭证流水号失败

0683	取销售机构代码失败
0684	存在冻结的基金份额
0685	正在清算，不能处理到帐操作
0686	存在未审批的巨额赎回
0687	取交易帐号凭证号失败
0688	取交易帐号失败
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	收市写帐页错误
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	帐户清算错误
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	写帐页失败
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
0900~0999	自定义返回代码

6 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;
}
```

7 附录：申报确认接口 remark 字段取值说明

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	帐户没有权限进行帐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

13458	交易主机繁忙
-------	--------

8 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 jfwu@sse.com.cn 及 spwu@sse.com.cn 或者致电 021-68813189、68827268。