

工程技术标准

深圳证券交易所数据文件交换接口规范

(Ver1.00~~β~~~~α~~)

带格式的：两端对齐



深圳证券交易所

二〇一四年四月六月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2014-1	0.90	创建
2014-4	1.00 α	根据0.9版征求意见反馈修订
<u>2014-6</u>	<u>1.00β</u>	<u>证券信息中的证券类别SecurityType字段类型由N2改为N4；增加数量单位QtyUnit字段；证券状态Status增加“增发股份上市（12）”“状态；对应回购标准券字段更名为RegularShare；增加期权相关字段；</u> <u>“集中竞价交易类业务参考信息（auctionparams）”文件更名为“现货集中竞价交易类业务参考信息（cashauctionparams）”，不再包含期权竞价参数信息；</u> <u>“参数类型Type”字段取值定义改为同行情快照中的证券所处交易阶段类型保持一致；</u> <u>增加“衍生品集中竞价交易类业务参考信息（derivativeauction）”文件；</u> <u>证券收盘行情文件增加“英文简称EnglishName”、“证券代码源SecurityIDSource”、“结算价ClearingPrice”字段</u>

名词释义

词汇缩写	含义
FDEP	金融数据交换平台

目 录

一、前言	1
二、FDEP 接入方式	1
三、静态交易参考信息	1
3.1 证券信息 (SECURITIES)	12
3.2 指数信息 (INDEXINFO)	6
3.3 统计量指标信息 (STAT)	6
3.4 现货集中竞价交易类业务参考信息 (CASHAUCTIONPARAMS)	67
3.5 衍生品集中竞价交易类业务参考信息 (DERIVATIVEAUCTIONPARAMS)	8
3.6 协议交易业务参考信息 (NEGOTIATIONPARAMS)	8
3.7 盘后定价大宗交易业务参考信息 (AFTERHOURSPARAMS)	9
3.8 转融通证券出借业务参考信息 (SECURITYLENDING)	9
3.9 ETF 实时申购赎回业务参考信息	10
3.10 网上发行认购业务参考信息 (ISSUEPARAMS)	10
3.11 债券分销业务参考信息 (BONDDISTRIBUTIONPARAMS)	10
3.12 网络投票业务参考信息 (EVOTEPARAMS)	11
3.13 配股业务参考信息 (RIGHTSISSUEPARAMS)	11
四、日终静态行情信息	12
4.1 证券收盘行情 (SECURITYCLOSEMD)	12
五、数据类型说明	12
一、前言	1
二、FDEP 接入方式	1
三、静态交易参考信息	1
3.1 证券信息 (SECURITIES)	1
3.2 指数信息 (INDEXINFO)	6
3.3 统计量指标信息 (STAT)	6
3.4 集中竞价交易类业务参考信息 (AUCTIONPARAMS)	6
3.5 协议交易业务参考信息 (NEGOTIATIONPARAMS)	7
3.6 盘后定价大宗交易业务参考信息 (AFTERHOURSPARAMS)	8
3.7 转融通证券出借业务参考信息 (SECURITYLENDING)	8
3.8 ETF 实时申购赎回业务参考信息	9
3.9 网上发行认购业务参考信息 (ISSUEPARAMS)	9
3.10 债券分销业务参考信息 (BONDDISTRIBUTIONPARAMS)	10
3.11 网络投票业务参考信息 (EVOTEPARAMS)	10
3.12 配股业务参考信息 (RIGHTSISSUEPARAMS)	10
四、日终静态行情信息	11
4.1 证券收盘行情 (SECURITYCLOSEMD)	11
五、数据类型说明	11

深圳证券交易所数据文件交换接口规范

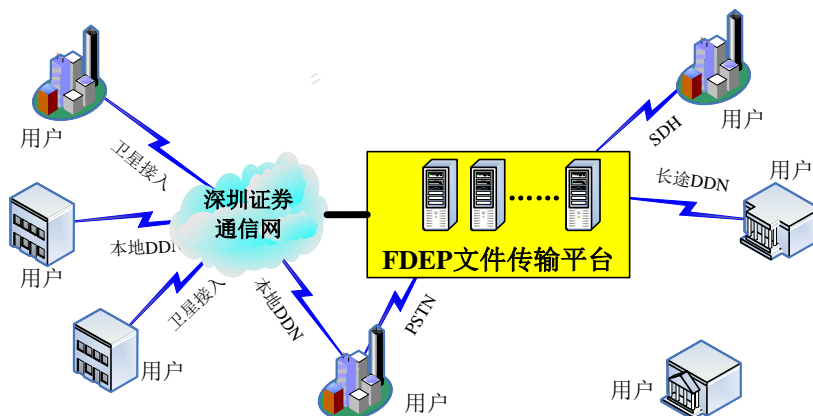
一、前言

本接口规范提供给会员及相关市场参与主体，用以指导开发通过金融数据交换平台 FDEP 与深圳证券交易所第五版交易系统进行数据文件交换。本接口规范描述内容包括数据文件内容、必要的运行指导以及详细的数据文件交换格式。

目前版本仅包含数据文件的内容及格式，数据文件的具体交换方式，交换时点等内容将在后续版本中补充。

二、FDEP 接入方式

FDEP 文件传输系统利用成熟的深圳证券通信网作为主要的底层网络设施,同时也接受其他开放的接入方式,如专线直接接入、拨号线路等。各证券公司、商业银行、基金公司和期货公司之间只需一条线路接入该平台即可从事各种金融合作业务,从而实现通信和业务上的“一点接入”。用户可根据自身需要选择合适的接入方式,也可同时申请多种接入方式,保有多种备份手段。



深圳证券通信网自身也支持多种方式的接入，比如双向宽带卫星、DDN、SDH等。各种接入手段为金融数据交换平台提供了灵活广泛的通信支持。

三、静态交易参考信息

该类信息主要在每个交易日开市前以文件的形式发布，其中 XML 文件的编码格式为 UTF-8。

3.1 证券信息 (securities)

文件名为 securities YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

证券信息包含所有在交易所上市挂牌的证券的基本信息，其中不含一些特殊业务临时挂牌的代码，比如网络投票，债券分销，网上发行认购等。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

	字段名称	字段英文名	类型	说明
所有证券都包含的字段	证券代码	SecurityID	C8	
	证券简称	Symbol	C40	
	英文简称	EnglishName	C40	<u>对于期权填写合约代码</u>
	ISIN 代码	ISIN	C12	
	证券代码源	SecurityIDSource	C4	4 = ISIN 102 = 深圳证券交易所
	基础证券代码	UnderlyingSecurityID	C8	
	上市日期	ListDate	N8	
	证券类别	SecurityType	N2 N4	
	货币种类	Currency	C4	币种 CNY = 人民币 HKD = 港币
	<u>数量单位</u>	<u>QtyUnit</u>	<u>N15(2)</u>	<u>对于某一证券申报的委托，其委托数量字段必须为该证券数量单位的整数倍</u>
	是否支持当日回转交易	DayTrade	C1	Y=支持 N=不支持
	昨日收盘价	PrevClosePx	N13(4)	
	证券状态	SecurityStatus		一只证券可能具有 0 个或多个状态
	→ 状态	Status	N2	证券状态代码: 1-停牌 2-除权 3-除息 4-ST 5-*ST 6-上市首日 7-未完成股改 8-恢复上市首日 9-股改复牌上市首日

				10-退市整理期 11-暂停上市 <u>12-增发股份上市</u>
	总发行量	OutstandingShare	N18(2)	
	流通股数	PublicFloatShareQuantity	N18(2)	
	面值	ParValue	N13(4)	
	是否可作为融资融券可充抵保证金证券	GageFlag	C1	Y=是 N=否
	可充抵保证金折算率	GageRatio	N5(2)	
	是否为融资标的	CrdBuyUnderlying	C1	Y=是 N=否
	是否为融券标的	CrdSellUnderlying	C1	Y=是 N=否
	是否可质押入库	PledgeFlag	C1	Y=是 N=否
	对回购标准券折算率	ContractMultiplier	N6(5)	
	对应回购标准券	<u>RegularShareContractSecurity</u>	C8	
股票特有字段 StockParams				
股票特有 字段	行业种类	IndustryClassification	C4	
	上年每股利润	PreviousYearProfitPerShare	N10(4)	
	本年每股利润	CurrentYearProfitPerShare	N10(4)	
	是否处于要约收购期	OfferingFlag	C1	Y=是 N=否
基金特有字段 FundParams				
基金特有 字段	T-1 日基金净值	NAV	N13(4)	
债券特有字段 BondParams				

债券特有 字段	票面年利率	CouponRate	N8(4)	
	贴现发行价	IssuePrice	N13(4)	
	每百元应计利息	Interest	N8(4)	
	发行起息日或本 次付息起息日	InterestAccrualDate	N8	
	到期日	MaturityDate	N8	
	国债到期年收益 率	ExpirationRate	N8(4)	
	是否处于转股回 售期	OfferingFlag	C1	Y=是 N=否
权证特有字段 WarrantParams				
权证特有 字段	行权价	ExercisePrice	N13(4)	
	行权比例	ExerciseRatio	N10(4)	
	行权起始日	ExerciseBeginDate	N8	
	行权截止日	ExerciseEndDate	N8	
	认购或认沽	CallOrPut	C1	C = Call P = Put
	结算方式	WarrantClearingType	C1	S = 证券结算 C = 现金结算
	结算价格	ClearingPrice	N13(4)	
	行权方式	ExerciseType	C1	A = 美式 E = 欧式 B = 百慕大式
质押式回购交易代码特有字段 RepoParams				
质押式回 购交易代 码特有字 段	购回期限	ExpirationDays	N4	
期权特有字段 OptionParams				
期权特有 字段	认购或认沽	CallOrPut	C1	C = Call P = Put
	交割月份	DeliveryMonth	N4	格式为 YYMM
	行权起始日期	ExerciseBeginDate	N8	
	行权结束日期	ExerciseDayExerciseEnd	N8	

		Date		
	行权价	ExercisePrice	N13(4)	
	最后交易日	LastTradeDay	N8	
	是否调整	Adjusted	C1	Y=是 N=否
	调整次数	AdjustTimes	N2	
	合约单位	ContractUnit	N15(2)	
	昨日结算价	PrevClearingPrice	N13(4)	
	合约持仓量	ContractPosition	N18(2)	

注：

1) 证券类别代码定义如下：

类别名称	类别代码
主板 A 股	1
中小板股票	2
创业板股票	3
主板 B 股	4
国债	5
企业债	6
公司债（含分离 债）	7
可转债	8
中小企业私募债	9
中小企业可交换 私募债	10
证券公司次级债	11
质押式回购	12
资产支持证券	13
本市场股票 ETF	14
跨市场股票 ETF	15
跨境 ETF	16
本市场实物债券 ETF	17
现金债券 ETF	18
黄金 ETF	19

货币 ETF	20
标准 LOF	23
分级子基金	24
封闭式基金	25
仅申赎基金	26
仅实时申赎货币 基金	27
权证	28
股票期权	29
ETF 期权	30
资管产品	31
报价回购	32

3.2 指数信息 (indexinfo)

文件名为 indexinfo_YYYYMMDD.xml，其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含了交易所发布的指数的基本信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，一只证券对于 xml 中的一条 index 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
指数代码	SecurityID	C8	
指数简称	Symbol	C40	
英文简称	EnglishName	C40	
昨收指数点位	PrevCloseIdx	N18(5)	

3.3 统计量指标信息 (stat)

文件名为 stat_YYYYMMDD.xml，其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含了交易所发布的统计量指标的基本信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，一只证券对于 xml 中的一条 stat 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
指标代码	SecurityID	C8	
指标简称	Symbol	C40	
英文简称	EnglishName	C40	

3.4 现货集中竞价交易类业务参考信息 (cashauctionparams)

文件名为 cashauctionparams_YYYYMMDD.xml，其中 YYYYMMDD 为对应的交易

带格式的： 缩进： 左侧： 0 厘米，
首行缩进： 0.74 厘米

日。

本信息包含了参与~~现货~~竞价交易类业务的证券的业务相关参数，包括现货~~和~~、质押式回购~~，以及股票期权~~。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
买数量上限	BuyQtyUpperLimit	N15(2)	买委托数量的上限
卖数量上限	SellQtyUpperLimit	N15(2)	卖委托数量的上限
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
价格档位	PriceTick	N13(4)	
竞价限价参数	PriceLimitSetting		
→ 参数类型	Type	C1	+Q=开盘集合竞价 T2=连续竞价 C3=收盘集合竞价 4=临时停牌
→ 是否有涨跌限制	HasPriceLimit	C1	Y=是 N=否
→ 基准价类型	ReferPriceType	C1	1=昨收价
→ 涨跌限制类型	LimitType	C1	1=幅度（百分比） 2=价格（绝对值）
→ 上涨幅度	LimitUpRate	N10(3)	
→ 下跌幅度	LimitDownRate	N10(3)	
→ 上涨限价	LimitUpAbsolute	N10(4)	
→ 下跌限价	LimitDownAbsolute	N10(4)	
→ 是否有有效竞价范围限制	HasAuctionLimit	C1	Y=是 N=否
→ 有效范围限制类型	AuctionLimitType	C1	1=幅度（百分比） 2=价格（绝对值）
→ 有效范围涨跌幅度	AuctionUpDownRate	N10(3)	
→ 有效范围涨跌价格	AuctionUpDownAbsolute	N10(4)	
做市商标志	MarketMakerFlag	C1	标识是否有做市商 Y=是

N=否

3.5 衍生品集中竞价交易类业务参考信息 (derivativeauctionparams)

文件名为 derivativeauctionparams YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

带格式的: 缩进: 左侧: 0 厘米, 首行缩进: 0.74 厘米

本信息包含了参与衍生品竞价交易类业务的证券的业务相关参数, 目前仅包括期权。
该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
买数量上限	BuyQtyUpperLimit	N15(2)	买委托数量的上限
卖数量上限	SellQtyUpperLimit	N15(2)	卖委托数量的上限
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
价格档位	PriceTick	N13(4)	
涨停价	RisePrice	N13(4)	
跌停价	FallPrice	N13(4)	
昨卖开每张保证金	LastSellMargin	N18(4)	
今卖开每张保证金	SellMargin	N18(4)	
做市商标志	MarketMakerFlag	C1	标识是否有做市商 Y=是 N=否

3.5.3.6 协议交易业务参考信息 (negotiationparams)

文件名为 negotiationparams_YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含了参与协议交易业务的证券的业务相关参数, 该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍

卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
数量门槛	BuyQtyLowerLimit	N15(2)	必须满足数量门槛或金额门槛
金额门槛	BuyAmtLowerLimit	N18(4)	
涨停价格	PriceUpLimit	N13(4)	
跌停价格	PriceDownLimit	N13(4)	
做市商标志	MarketMakerFlag	C1	标识是否有做市商 Y=是 N=否

3.63.7 盘后定价大宗交易业务参考信息 (afterhoursparams)

文件名为 afterhoursparams_YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含了参与盘后定价大宗交易业务的证券的业务相关参数, 该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID		
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
数量门槛	BuyQtyLowerLimit	N15(2)	必须满足数量门槛或金额门槛
金额门槛	BuyAmtLowerLimit	N18(4)	

3.73.8 转融通证券出借业务参考信息 (securitylending)

文件名为 securitylendingparams_YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含了转融通标的证券信息, 该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 一条标的证券信息对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
期限类型	ExpirationType	C1	期限类型 1 表示固定期限
期限	ExpirationDays	N4	
费率	Price	N13(4)	

3.83.9 ETF 实时申购赎回业务参考信息

每只 ETF 对应一个 PCF 文件。

PCF 文件名为 etfcr_NNNNNNNN_YYYYMMDD.txt，其中 NNNNNNNN 为 ETF 代码，YYYYMMDD 为对应的交易日。

3.93.10 网上发行认购业务参考信息 (issueparams)

文件名为 issueparams_YYYYMMDD.xml，其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含每个交易日挂牌的网上发行认购代码的相关信息，包括新股发行，增发，LOF 发行，可转债申购发行等。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，每只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券简称	Symbol	C40	
正股代码	UnderlyingSecurityID	C8	增发使用
总发行量	OutStandingShare	N18(2)	
认购价格上限	PriceUpLimit	N13(4)	
认购价格下限	PriceDownLimit	N13(4)	
申购基数	Unit	N15(2)	申购数量必须为基数的整数倍
单笔申购上限	UpQty	N15(2)	
单笔申购下限	DownQty	N15(2)	
发行起始日	StartDate	N8	
发行结束日	EndDate	N8	
是否允许撤单	CancelPermit	C1	Y=是 N=否
是否允许重复申购	ReApplyPermit	C1	Y=是 N=否
累计申购数量限制	AccumulatedLimit	N18(2)	

如果当天没有发行业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

3.103.11 债券分销业务参考信息 (bonddistributionparams)

文件名为 bonddistributionparams_YYYYMMDD.xml，其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含每个交易日挂牌的债券分销代码的相关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，每只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
分销代码	SecurityID	C8	
证券简称	Symbol	C40	
债券代码 债券上市挂牌代码	BondID	C8	
认购委托限量	UpQty	N15(2)	
代为挂牌总量	ProxyIssueQty	N18(2)	
自行挂牌总量	SelfIssueQty	N18(2)	
分销起始日	StartDate	N8	
分销截止日	EndDate	N8	
承销商交易单元	BrokerPBU	C6	
承销商名称	BrokerName	C80	

如果当天没有债券分销业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

3.113.12 网络投票业务参考信息 (evoteparams)

文件名为 evoteparams_YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含每个交易日挂牌的网络投票代码的相关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 每只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券简称	Symbol	C40	
正股代码	UnderlyingSecurityID	C8	
议案数	ProposalNum	N2	

如果当天没有网络投票业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

3.123.13 配股业务参考信息 (rightsissueparams)

文件名为 rightsissueparams_YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

本信息包含每个交易日挂牌的股票配股发行及可转债配售发行代码的相关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 每只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券简称	Symbol	C40	
正股代码	UnderlyingSecurityID	C8	

配股价	Price	N13(4)	
-----	-------	--------	--

如果当天没有配股业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

四、 日终静态行情信息

该类信息主要包括在每个交易日收市后发布的静态行情信息文件。

4.1 证券收盘行情 (securityclosemd)

文件名为 securityclosemd_YYYYMMDD.xml, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

证券收盘行情文件中包含所有证券信息文件 (securities) 中的证券的收盘行情。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布 文件的形式在交易日闭市后发布, 一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券简称	Symbol	C40	
<u>英文简称</u>	<u>EnglishName</u>	<u>C40</u>	<u>对于期权填写合约代码</u>
<u>证券代码源</u>	<u>SecurityIDSource</u>	<u>C4</u>	<u>4 = ISIN</u> <u>102 = 深圳证券交易所</u>
收盘价	ClosePx	N13(4)	
成交总量	TotalVolumeTrade	N15(2)	
成交总金额	TotalValueTrade	N18(4)	
<u>结算价</u>	<u>ClearingPrice</u>	<u>N13(4)</u>	<u>仅适用于期权</u>

带格式表格

五、 数据类型说明

文件中字段的数据类型说明如下:

- ✓ Cx 表示字符串, x 表示字符串最大长度, 除非特别声明, 字段串均可包含数字, 大写字母以及小写字母;
- ✓ Nx 表示十进制整数, x 表示整数最大位数 (不包括正负号), 除非特别声明, 整数类型均有正负;
- ✓ Nx(y) 表示浮点数, x 表示整数与小数总计位数, 不包括小数点, y 表示小数位数, 小数位数不足时在后面补 0; 除非特别声明, 浮点数类型均有正负。