

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所  
竞价撮合平台  
市场参与者接口规格说明书  
1.72 版



上海证券交易所  
二〇二五年八月

## 《市场参与者接口规格说明书》1.72 版发布说明

根据技术规划，要约（要约预受、要约撤销）/现金选择权、开放式基金相关业务（申赎、分红选择、份额转出）、融资融券非交易业务（余券划转、还券划转、担保品划入、担保品划出、券源划入、券源划出）、网络密码服务（密码激活（注销）），从竞价撮合平台迁移至互联网交易平台。

2025 年 8 月进行了修订，主要接口变更如下：

1、修订申报接口 ordwth：删除本次迁移业务的相关说明，对应申报填写说明请参见《IS122 上海证券交易所交易网关 STEP 接口规格说明书（互联网交易平台）1.13 版》；删除已下线业务的相关说明，包括开放式基金认购（含货币市场基金实时申赎业务的认购）。

2、修订产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt：

（1）要约和开放式基金相关业务的非交易基础信息仍通过该文件发布，同时取消两类业务的非交易代码信息，要约非交易业务“申报编号”信息填写于“备注”字段；

（2）融资融券非交易业务和密码激活（注销）的非交易基础信息不再通过该文件发布，删除相关业务描述说明；

3、修订开放式基金交易确认接口 kghXXXXX.txt：

（1）调整由上交所发送的 T 日业务申请回执中的基金代码为 519xxx；

（2）调整字段 AppSheetSerialNo（申请单编号）的填写说明。

4、修订产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt：

（1）本次迁移的开放式基金产品数据（不包括开放式货币市场基金）不再通过该接口发布。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.71 版发布说明

2025 年 7 月进行了修订，主要有：

根据科创成长层相关规则，

1、更新产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt，调整特殊标识“U”的相关描述；

2、更新产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt，“备注”字段增加注册制股票（含存托凭证）的“尚未盈利”信息。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.70 版发布说明

2025 年 6 月进行了修订，主要有：

1、删除席位联通接口 zxwXXXXX.dbf 的相关描述。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.69 版发布说明

2025 年 5 月进行了修订，主要有：

根据 ETF 网上发行的末日比例配售业务需求，

1、更新产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt，新增“ETF 比例配售日”信息并调整相关描述；

2、更新过户数据接口 ghXXXXX.dbf，补充 ETF 网上发行的相关数据中不包括中签数量为 0 的记录。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.68 版发布说明

2024 年 8 月进行了修订，主要有：

1、删除产品非交易基础信息接口 fjyMMDD.txt 的相关描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.67 版发布说明

2024 年 6 月进行了修订，主要有：

配合北交所股票纳入 ETF 成分证券范围，调整产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt 备注字段中基金产品细分类别相关描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.66 版发布说明

2024 年 3 月进行了修订，主要有：

1. 修订产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt:
  - a) 调整“可流通证券未上市数量”字段相关描述说明；
  - b) 调整“备注”字段中关于“市场流通总量”的标的范围。
2. 修订产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt：调整“除权比例”字段的描述说明，明确基金份额折算场景的取值范围。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.65 版发布说明

2023 年 8 月进行了修订，主要有：

- 1、修订行情接口 mktdt00.txt:
  - a) 明确 PreCloseIOPV（基金 T-1 日收盘时刻 IOPV）、IOPV（基金 IOPV）字段适用范围以及和 ETF 公告文件的关联关系；
  - b) 更正 MDTime（行情时间）、Timestamp（时间戳）
- 2、根据 EzSR 下线安排，下线“行情数据库 STEP”接口；
- 3、修订申报接口 ordwth，删除已下线的买入回购注销业务相关描述；
- 4、修订申报确认接口 remark 字段取值说明，详见《IS111 上海证券交易所报盘软件错误代码表》。

此处仅保留近一年的修订记录，历史修订记录详见文末历史修订记录部分。



# 目 录

1 数据格式约定 .....	1
2 实时文件和数据库接口规范 .....	2
2.1 行情接口 MKTDT00.TXT .....	2
2.2 申报接口 ORDWTH .....	8
2.3 申报确认接口 ORDWTH2 .....	15
2.4 成交回报接口 CJHB .....	17
3 盘后数据接口规范 .....	22
3.1 过户数据接口 GHXXXXX.DBF .....	22
3.2 证券帐户资料接口 ZZHXXXXX.DBF .....	26
3.3 证券权益接口 ZQYXXXXX.DBF .....	26
3.4 新股发行过户数据接口 IPOGHXXXXX.TXT .....	27
3.5 减持控制数据接口 JCKZXXXXX.TXT .....	28
3.6 已开通科创板交易权限账户资产信息接口 KCBZHCxxXXXXX001YYYYMMDD.TXT .....	31
4 广播文件接口规范 .....	34
4.1 上市公司公告文件 .....	34
4.2 国债利息接口 GZLX.MDD .....	34
4.3 标准券折算率变更接口 ZSLMMDD.TXT .....	34
4.4 标准券折算率变更公告文件 ZSLWMMDD.TXT .....	35
4.5 标准券折算比率接口 XZSLMMDD.TXT .....	36
4.6 权证信息接口 QZXXMMDD.TXT .....	36
4.7 交易公开信息公告文件 JYGKXXMMDD.TXT .....	37
4.8 科创板交易公开信息公告文件 JYGKXX02MMDD.TXT .....	37
4.9 产品非交易基础信息接口 FJYYYYYMMDD.TXT .....	37
4.10 担保品及标的证券清单接口 DBPMMDD.TXT .....	42
4.11 产品基础信息第二版第一批次文件接口 CPXX0201MMDD.TXT .....	42
4.12 产品基础信息第二版第二批次文件接口 CPXX0202MMDD.TXT .....	51
4.13 质押式报价回购折算率文件 BZSL01MMDD.TXT .....	51
5 开放式基金数据接口规范 .....	53
5.1 开放式基金净值数据接口 KXXMMDD.TXT .....	54

5.2 开放式基金分红数据接口 KHLXXXXX.TXT .....55

5.3 开放式基金帐户对帐数据接口 KYEXXXXX.TXT .....57

5.4 开放式基金交易确认接口 KGHXXXXX.TXT .....58

5.5 取值附表 .....64

6 后记 .....84

7 附录 .....85

7.1 营业部代码换码算法示例 .....85

7.2 申报确认接口 REMARK 字段取值说明 .....86

7.3 交易单元说明 .....86

历史修订记录 .....87

## 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；

（四）无特别声明，对于数字字段数值溢出，将填写全 9 数值，如 N6(2) 填写 999.99。

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

其他补充约束参见字段具体描述。

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 mktdt00.txt

mktdt00.txt	行情文件接口
<p><b>描述：</b></p> <p>本文件为行情文件接口。对于竞价撮合平台，行情文件名为 mktdt00.txt，当日开市前至交易结束期间实时发送。（对于港交所，仅提供一档数据，其他档数据填充格）</p> <p>行情文件为文本 txt 文件，格式约定如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>（一）竖线(" ")为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符；</li> <li>（二）竖线(" ")不应用在每条记录的开头和结尾；</li> <li>（三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序；</li> <li>（四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以 CX 格式表示，其中 X 代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以 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，整数部分最多不超过 X-Y-1 位，小数部分最多不超过 Y 位，不足部分右对齐，左补空格；</li> <li>（五）每行以二进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。</li> </ul> <p><b>文件描述：</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>（一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分；</li> <li>（二）注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；注意根据文件体首字段 MDStreamID 取值解析不同的文件体记录格式；</li> <li>（三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应根据行情数据类型识别处理；</li> <li>（四）文件体记录按行情数据类型递增，同一行情数据类型按证券代码递增；</li> <li>（五）对于暂停上市的股票，文件中不包含该股票的记录。发行期内对于未设定开始上市交易的产品，文件中不包含该产品的记录。对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录；</li> <li>（六）如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如 N10 取 9999999999；</li> <li>（七）前收盘价格，在开市之前即行发布。</li> <li>（八）当产品代码为债券分销时，由于债券交易的数量以千元面额为单位，成交金额为该债券每笔成交的价格*数量*10 的总和；</li> </ul>	



mktdt00.txt	行情文件接口
<p>(九) 对于产品价格、金额数据单位,除 B 股为美元外,其他为人民币元。对于产品数量数据单位,股票为股,基金、权证、公募 REITs 为份,债券分销为千元面额。对于产品 TradeVolume 成交数量单位,股票为股,基金、公募 REITs 为份,债券分销为千元面额,权证为 100 份;对于指数价格、金额、数量单位,详见表格具体定义说明;</p> <p>(十) 在集合竞价时段内,当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格,即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量;</p> <p>(十一) 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;</p> <p>(十二) 临时停牌期间不揭示五档行情;</p> <p>(十三) 字段无意义或无该字段行情数据时,字符填充空格,数值填 0;</p> <p>(十四) 交易所具体产品代码,参见相关发文通知,并参考以上处理。</p>	

结构图如下:



文件结构描述参考:

**BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSesStatus**

**MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|BuyPrice2|BuyVolume2|SellPrice2|SellVolume2|BuyPrice3|BuyVolume3|SellPrice3|SellVolume3|BuyPrice4|BuyVolume4|SellPrice4|SellVolume4|BuyPrice5|BuyVolume5|SellPrice5|SellVolume5|TradingPhaseCode|Timestamp**

.....

.....

.....

**EndString|Checksum**

文件头定义, 第一行特殊记录:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	MTP1.00
3	BodyLength	数据长度	N10	计算出的长度字段分隔符后面的字节数

				(不包含本字段后面的分隔符), 包含其他字段后面的分隔符、换行符。
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号(预留, 暂不填)
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符, 取XSHG01
7	MDDTime	行情时间	C21	行情时间, 格式为YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental (暂不支持)
9	MDSesStatus	市场行情状态	C8	全市场行情状态 <sup>1</sup> : 该字段为 8 位字符串, 左起每位表示特定的含义, 无定义则填充格。 第 1 位: ‘S’表示全市场启动期间(开市前), ‘T’表示全市场处于交易期间(含中间休市), ‘E’表示全市场处于闭市期间。 第 2 位: ‘1’表示开盘集合竞价结束标志, 未结束取‘0’。 第 3 位: ‘1’表示全市场行情结束标志, 未结束取‘0’。 第 4 位: ‘1’表示上海市场行情结束标志, 未结束取‘0’。第 5 位-第 8 位预留。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件体定义, 多条记录。

行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号, 当取值为 MD001 时, 文件体记录格式如下:

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符, 取值MD001 表示指数行情数据格式类型, 其中指数目前实际精度为 4 位小数;

<sup>1</sup> 上海市场: 包括股票、基金、债券分销。全市场: 包括上海市场及指数

2	SecurityID	产品代码	C6	指数代码
3	Symbol	产品名称	C8	指数简称
4	TradeVolume	成交数量	N16	参与计算相应指数的交易数量，股票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千元面额。
5	TotalValueTraded	成交金额	N16(2)	参与计算相应指数的成交金额，单位均为人民币元。
6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(4)	前收盘指数
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(4)	今开盘指数
8	HighPrice	最高价	N11(4)	最高指数
9	LowPrice	最低价	N11(4)	最低指数
10	TradePrice	最新价	N11(4)	最新指数
11	ClosePx	今收盘价	N11(4)	今收盘指数，无取值取空格
12	TradingPhaseCode	指数实时阶段及标志	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 (预留)
13	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.sss
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号，当取值为 MD002、MD003、MD004 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD002 表示股票（A、B 股）行情数据格式类型； MD003 表示债券分销行情数据格式类型； MD004 表示基金行情数据格式类型（含公募 REITs）；

2	SecurityID	产品代码	C6	证券代码
3	Symbol	产品名称	C8	证券简称
4	TradeVolume	成交数量	N16	
5	TotalValueTraded	成交金额	N16(2)	
6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(3)	
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(3)	
8	HighPrice	最高价	N11(3)	
9	LowPrice	最低价	N11(3)	
10	TradePrice	最新价	N11(3)	最新成交价
11	ClosePx	今收盘价	N11(3)	
12	BuyPrice1	申买价一	N11(3)	当前买入价
13	BuyVolume1	申买量一	N12	
14	SellPrice1	申卖价一	N11(3)	当前卖出价
15	SellVolume1	申卖量一	N12	
16	BuyPrice2	申买价二	N11(3)	
17	BuyVolume2	申买量二	N12	
18	SellPrice2	申卖价二	N11(3)	
19	SellVolume2	申卖量二	N12	
20	BuyPrice3	申买价三	N11(3)	
21	BuyVolume3	申买量三	N12	
22	SellPrice3	申卖价三	N11(3)	
23	SellVolume3	申卖量三	N12	
24	BuyPrice4	申买价四	N11(3)	
25	BuyVolume4	申买量四	N12	
26	SellPrice4	申卖价四	N11(3)	
27	SellVolume4	申卖量四	N12	
28	BuyPrice5	申买价五	N11(3)	

29	BuyVolume5	申买量五	N12	
30	SellPrice5	申卖价五	N11(3)	
31	SellVolume5	申卖量五	N12	
32	PreCloseIOPV	基金 T-1 日收盘时刻 IOPV	N11 (3)	<p>可选字段, 仅当 MDStreamID=MD004 时存在该字段。</p> <p>仅对 ETF 产品, 此字段有效。</p> <p>该字段取 0.000 时, 无意义。</p> <p>该字段不作除权除息等调整。</p>
33	IOPV	基金 IOPV	N11 (3)	<p>可选字段, 仅当 MDStreamID=MD004 时存在该字段。</p> <p>仅对 ETF 产品, 此字段有效。</p> <p>当 ETF 公告文件2 Publish 字段(是否需要发布 IOPV)取值为 1 时, 此字段为对应产品的 IOPV 值;</p> <p>当 ETF 公告文件 Publish 字段取值为 0 时, 此字段固定取 0.000, 无意义;</p>
34	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志	C8	<p>该字段为 8 位字符串, 左起每位表示特定的含义, 无定义则填空格。</p> <p>第 1 位: ‘S’表示启动(开市前)时段, ‘C’表示开盘集合竞价时段, ‘T’表示连续交易时段, ‘E’表示闭市时段, ‘P’表示产品停牌, ‘M’表示可恢复交易的熔断时段(盘中集合竞价), ‘N’表示不可恢复交易的熔断时段(暂停交易至闭市), ‘U’表示收盘集合竞价时段。</p> <p>第 2 位: ‘0’表示此产品不可正常交易, ‘1’表示此产品可正常交易, 无意义填空格。</p> <p>第 3 位: ‘0’表示未上市, ‘1’表示已上市。</p> <p>第 4 位: ‘0’表示此产品在当前时段不接受订单申报, ‘1’表示此产品在当前时</p>

<sup>2</sup> ETF 公告文件接口详见《IS118 上海证券交易所特定参与者接口规格说明书(基金公司卷)》。

				段可接受订单申报。无意义填充格。
35	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.sss
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

说明：当日交易时段内，产品可能出现的状态包括：开盘集合竞价，连续交易，停牌，收盘集合竞价，熔断（盘中集合竞价，暂停交易至闭市）。对于上述字段 34（TradingPhaseCode），其取值的第 2 位（是否可正常交易）在产品进入开盘集合竞价、连续交易、收盘集合竞价，熔断（盘中集合竞价）状态时值为‘1’，在产品进入停牌、熔断（暂停交易至闭市）状态时值为‘0’，且闭市后保持该产品闭市前的是否可正常交易状态。其取值的第 4 位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

序号	序号	字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	Checksum	校验和	C3	<p>校验和，3 位校验和</p> <p>校验和是通过计算不包括校验和字段(也不包括该字段后的换行符)数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换行符）之和然后模 256 得出，然后转化为 3 位 ASCII 码。例如，如果经计算校验和为 274，则模 256 后的数为 18，校验和域将取为 ASCII 字符串 018</p> <p>校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间，因文件按记录循环写入覆盖，校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。</p>

## 2.2 申报接口 ordwth

Ordwth	申报接口
<p><b>描述：</b></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。<b>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。</b></p>	

Ordwth	申报接口
<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><del>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。</del></p> <p>(1) 买入发行申购、按市值资金申购代码（730***、780***；700***、760***；731***、781***；737***、787***；733***、783***、732***、754***等等）或者 ETF 认购代码转义为对对应证券参与申购；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）。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（已停止）首发为 737***、787***；可转债资金申购为 733***、783***。</p> <p>(2) 卖出配股代码（700***、760***；702***、762***；704***、764***、742***、753***等等）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>(3) 卖出科创板配售代码（786***）转义为对对应证券参与配售。卖出价格为配售价。卖出数量为参加配售的数量。指令即时处理，不可撤单。</p> <p><del>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，需要根据土交所在要约收购业务开始之前发布的公告决定。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p>(4) 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>	



Ordwth	申报接口
<p><del>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。</del></p> <p><del>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。卖出时数量为赎回基金份额，单位为份，目前不支持小数。可撤单。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p>(5) 货币市场基金实时申赎业务的认购参照开放式基金认购，价格为1.000，货币市场基金实时申购赎回通过综合业务平台接口实现。</p> <p>(6) 交易所后续新增产品代码以及非交易代码，参见相关发文通知，本文档将逐步补充。</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“<b>投资者信用证券账户</b>”。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、科创板配售方式减持申报、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，也可进行发行类业务申报（具体参考交易所通知），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“<b>证券公司融券专用账户</b>”，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“<b>证券公司信用交易担保证券账户</b>”，该帐户与“<b>投资者信用证券账户</b>”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><del>买入融券划转代码(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。</del></p> <p><del>卖出融券划转代码(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</del></p>	



Ordwth	申报接口
<p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></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理。</p>	C8
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：营业部代码转换码算法示例。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 <a href="http://www.sse.com.cn">www.sse.com.cn</a>-&gt;会员专区-&gt;会员信息-&gt;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	<p>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。</p>	C1
8	price	<p>申报价格。债券分销交易申报价格为“每百元发行面值债券价格”，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 字段大于等于 1 万元的订单。</p> <p>针对市价订单(包括订单类型为最优五档即时成交剩余撤销市价订单、最优五档即时成交剩余转限价市价订单、本方最优市价订单、对手方最优市价订单)：该字段为保护限价，取值必须大于 0 且小于 1 万元，表示投资者能够接受的最高买入价或最低卖出价，即买入申报的成交价格 and 转限价的价格不高于保护限价，卖出申报的成交价格 and 转限价的价格不低于保护</p>	C8

		限价。	
9	qty	申报数量。债券分销交易申报数量的单位为千元面额（即 1000 元发行面值）。其它为股或者份。	C8
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。 <b>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。</b> 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> <p>为‘L’表示限价订单；</p> <p>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；</p> <p>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，则按本方最优报价转为限价订单；如无本方申报的，该市价订单自动撤销；</p> <p>为‘B’表示以本方最优价格申报的市价订单，该申报以其进入交</p>	C3

		<p>易主机时，集中申报簿中本方最优报价为其申报价格。如有本方申报的，则按本方最优报价转为限价订单；如无本方申报的，则该市价订单自动撤销；</p> <p>为‘C’表示以对手方最优价格申报的市价订单，该申报以其进入交易主机时，集中申报簿中对手方最优报价为其申报价格。如有对手方申报，以对手方最优价为成交价与对手方撮合成交，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，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> <p>取值为“PT”，表示普通的不参加融资融券的订单；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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</p>	
--	--	--	--

		代码) 必须为可卖券还款的证券。  为保持与以前接口的兼容, 对于普通限价订单和 <u>普通</u> 非交易业务申报( <del>比如要约收购等等</del> ), 该字段取值既可为“LPT”, 也可为“ORD”。	
12	ordrec	撤单编号	C8
13	firmid	B 股结算会员代码, 对于 A 股投资者取值无意义。  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。  对于 B 股境内投资者 C1 类帐户可以不填。	C5
14	branchid	营业部代码  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 <a href="http://www.sse.com.cn">www.sse.com.cn</a> -> 会员专区 -> 会员信息 -> 基本信息。  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。  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。	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><b>描述:</b></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 <b>rec_num</b> 字段进行定位, 故必须以 <b>rec_num</b> 为 <b>Key</b> 建立索引, 或者作为主键。</p> <p><b>rec_num</b> (字段 1: 记录编号)、<b>date</b> (字段 2: 记录写入日期)、<b>reff</b> (字段 4: 会员内部订单号)、<b>acc</b> (字段 5: 证券账户)、<b>stock</b> (字段 6: 证券代码)、<b>bs</b> (字段 7: 买卖方向)、<b>price</b> (字段 8: 申报价</p>	

ordwth2	申报确认接口
<p>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, 市场参与者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	C1



		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’。	
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
<b>描述:</b> 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。 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。	

Cjhb	实时成交回报接口
<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 <b>zqdm</b> 为配股代码，成交价格 <b>cjgg</b> 为配股价格，成交金额 <b>cjje</b> 为配股金额，成交数量 <b>cjsl</b> 为配股数量，买卖方向 <b>bs</b> 为 S 的实时成交回报记录。为承销商产生买卖方向 <b>bs</b> 为 B 的实时成交回报记录。</p> <p>(二) 科创板配售业务减持成功后，为配售者产生证券代码 <b>zqdm</b> 为配售代码，成交价格 <b>cjgg</b> 为配售价格，成交金额 <b>cjje</b> 为配售金额，成交数量 <b>cjsl</b> 为配售数量，买卖方向 <b>bs</b> 为 S 的实时成交回报记录。为承销商产生买卖方向 <b>bs</b> 为 B 的实时成交回报记录。</p> <p>(三) 对于 ETF 产品，系统分配如下一组证券代码：ETF 证券代码、ETF 认购代码、ETF 认购扣款还款代码。</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 <b>EzOes</b> 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 <b>sscj</b>（实时成交）。</p> <p>假设 2：市场参与人柜台系统为 <b>cjhb</b> 接口表增加了自增长字段 <b>xh</b> 序号，且柜台系统已经处理了 <b>xh</b> 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> <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 <b>cjhb</b> 表中，示例中'本次日期'请填写 YYYYMMDD 格式的日期。</p>	



Cjhb	实时成交回报接口
<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> <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	<p>成交编号</p> <p>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。</p> <p>由于数据库表作为 <b>ResultSet</b> 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人柜台系统处理该接口表，可在该表增加一个自增长字段（<b>Auto Incremental Identity</b>），比如为 <b>xh</b> 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。</p> <p>注：对于 <b>xh</b> 序号字段，由于采用自增长的方式，如果对该表进行手工 <b>Truncate</b> 操作，将导致该字段被重置，所以，如果进行手工 <b>Truncate</b> 操作后，需要手工设置 <b>xh</b> 序号字段的起始值。</p>	4 字节 <b>Integer</b>
5	gsdm	席位号	C5
6	cjsl	成交数量，单位为股(股票)或份(基金)或千元面额(债券分销)。	C10
7	bcye	<p>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 <b>SET</b> 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’。</p>	C10
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	cjlg	成交价格，单位为人民币元(A 股、基金、债券分销)或美元(B 股)。精度为小数点后 3 位。	C8
12	cjje	<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> <p style="padding-left: 40px;">对应股票、封闭式基金、ETF、权证产品，该字段为成交价格 <b>cjlg*成交数量 cjsl</b>。</p> <p style="padding-left: 40px;">对应债券分销产品，该字段为成交价格 <b>cjlg*成交数量 cjsl*10</b>。</p> <p>如果实际成交金额超过 <b>999,999,999.99</b>，系统会填写 -1，请使用该字段的市场参与者特殊处理，柜台系统应能识别并及时处理该字段溢出异常，可采取如自行计算或拆分调整，盘后采用登记结算数据或其他方式处理，做好该异常的识别和处理。</p>	C12
13	sqbh	会员内部订单号，同申报接口中的 <b>reff</b> （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 zzwXXXXX.dbf 和 zzhXXXXX.dbf 压缩为 zdXXXXX.all 文件。新交易系统上线后，zqyXXXXX.dbf 和 zzhXXXXX.dbf 分别压缩为 zqyXXXXX.zip 和 zzhXXXXX.zip。基金公司及托管行 gh 和 zqy 压缩至 sse 文件中。

#### 3.1 过户数据接口 ghXXXXX.dbf

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p><b>描述：</b></p> <p>文件名中 XXXXXX 表示席位号。闭市后发送。</p> <p>该接口文件的组织形式和主要内容同实时成交回报数据接口。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 cijc 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 cijc 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><b>资金申购发行过户库记录说明：</b></p> <p>申购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***）；全市场成交编号不超过 7 位，成交时间 cjsj 填写 150000，全市场成交编号超过 7 位，成交时间 cjsj 为 111111~999999，分别对应成交编号超过 7 位时，第 8 位为 1~9 的情况（成交编号 cjbh 为 -1,-2,...-999999）。成交数量 cjsl 为申购数量；成交价格 cijg 为申购价格；成交金额 cijc 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。</p> <p>配号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 cijg 为 0；成交金额 cijc 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，</p>	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<p>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> <p>还款中签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***）；全市场成交编号不超过 7 位，成交时间 cjsj 填写 150000，全市场成交编号超过 7 位，成交时间 cjsj 为 111111~999999，分别对应成交编号超过 7 位时，第 8 位为 1~9 的情况（成交编号 cjbh 为 -1,-2,...-9999999）。成交数量 cjsl 为 T 日申购数量；成交价格 cijg 为 T 日申购价格；成交金额 cije 为还款金额等于申购数量乘以申购价格；买卖方向 bs 为 S。</p> <p>还款中签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 cijg 指最终确定的发行价格；成交金额 cije 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> <p><b>ETF 认购返回数据说明（成交编号扩位规则同上）：</b></p> <p>申购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 cijg 为申购价格；成交金额 cije 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。</p> <p>还款中签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 cijg 为 T 日申购价格；成交金额 cije 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。</p> <p>还款中签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 cijg 指最终确定的发行价格；成交金额 cije 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。本文件中不包含中签数量为 0 的中签记录。</p> <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 cije 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>	

ghXXXXX.dbf	过户数据接口
<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 <b>cjbh</b>、成交数量 <b>cjsl</b> 为 0，成交金额 <b>cjje</b> 为 0.00，申请编号 <b>sqbh</b> 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 <b>cjbh</b>、成交数量 <b>cjsl</b> 为 0，成交金额 <b>cjje</b> 为 0.00，申请编号 <b>sqbh</b> 为“网下在先”。</p> <p>（4） 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>（5） 科创板配售方式减持成功后，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	cjgg	成交价格	N8(3)
12	cjje	成交金额，溢出处理参见实时成交回报接口成交金额字段	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  对于 E 类型帐户的融资融券业务，对应关系如下： 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”);	C1

		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”); 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”); 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”); 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”); 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”); 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”); 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”);	
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，第三行表示对应 603\*\*\*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 按市值资金申购 (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(已停止)	可转债资金申购
发行申购/中签 代码	730*** 780*** 732***	700*** 760*** 742***	731*** 781***	737*** 787***	733*** 783*** 754***
发行配号代码	741*** 791*** 736***		741*** 791***	747*** 797***	744*** 794*** 756***
发行扣款/还款 代码			740*** 790***		743*** 793*** 755***



### 3.2 证券帐户资料接口 zzhXXXXX.dbf

zzhXXXXX.dbf	证券账户资料接口
<b>描述:</b> 文件名中 XXXXXX 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，仅下个交易日有效，其他交易日供参考。 该文件按照上交所的运行计划向市场发布，通常是每周发布一次。	

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 证券权益接口 zqyXXXXX.dbf

zqyXXXXX.dbf	证券权益接口
<b>描述:</b> 文件名中 XXXXXX 表示席位号。 该接口文件描述投资者所拥有股票的总市值和新股申购额度的相关信息。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	gddm	证券帐户	C10
2	zsz	总市值，登记日该投资者的股票总市值，单位为分	N18
3	zbqy	主板权益，登记日该投资者主板申购额度，单位为股	N18
4	kcqy	科创板权益，登记日该投资者科创板申购额度，单位为股	N18
5	gsdm	指定席位号（PBU）	C5
6	zhxh	账户组序号	C10
7	djrq	权益登记日期，格式 YYYYMMDD	C8
8	clbz	处理标志，柜台系统自由使用	C1



### 3.4 新股发行过户数据接口 ipoghXXXXX.txt

ipoghXXXXX.txt	新股发行过户数据接口
<p><b>描述:</b></p> <p>描述:</p> <p>文件名中 XXXXXX 表示席位号。闭市后发送。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 申购配号日盘后过户文件中包含配号记录。证券代码 <b>zqdm</b> 为发行配号代码（比如 741***）；成交编号 <b>cjbh</b> 指配号的首个号码；成交数量 <b>cjsl</b> 指配号成功的数量；申购数量 <b>sgsl</b> 为 T 日有效申购数量；成交价格 <b>cjig</b> 为 0；成交金额 <b>cjje</b> 为 0；买卖方向 <b>bs</b> 为 B。</li> <li>2) 中签日盘后过户文件中包含中签记录。证券代码 <b>zqdm</b> 为申购/中签代码（比如 730***）；成交编号 <b>cjbh</b> 指中签号；成交数量 <b>cjsl</b> 指中签数量；成交价格 <b>cjig</b> 指最终确定的发行价格；成交金额 <b>cjje</b> 等于分配数量乘以发行价格；买卖方向 <b>bs</b> 为 B。</li> </ol> <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 <b>cjbh</b> 为 0，处理结果 <b>cljg</b> 为“01”。</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》。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，在发行 T 日的过户库中，会设定无效申报的记录的成交编号 <b>cjbh</b> 为 0，处理结果 <b>cljg</b> 为“02”。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，在发行 T 日的过户库中，会设定无效申报的记录的成交编号 <b>cjbh</b> 为 0，处理结果 <b>cljg</b> 为“03”。</p> <p>根据 2015 年发布的《新股业务规则》第二十条约定：‘投资者连续 12 个月内累计出现三次中签但未足额缴纳认购资金的情形，自最近一次其结算参与人申报放弃认购的次日起 6 个月内不得参与网上新股申购’。对于违反该条款的不良账户申报，在发行 T 日的过户库中，会设定不良账户申报的记录的成交编号 <b>cjbh</b> 为 0，处理结果 <b>cljg</b> 为“04”。</p> <p>根据 2017 年发布的《上海证券交易所上市公司可转换债券发行实施细则》第六条约定：‘同一投资者使用多个证券账户参与同一可转债申购的，以该投资者的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，在发行 T 日的过户库中，会设定无效申报的记录的成交编号 <b>cjbh</b> 为 0，处理结果 <b>cljg</b> 为“02”（注：该约定适用于可交换债网上发行）。第十四条约定：‘投资者连续 12 个月内累计出现 3 次中签但未足额缴款的情形时，自中国结算上海分公司收到弃购申报的次日起 6 个月（按 180 个自然日计算，含次日）内不得参与新股、可转债、可交换公司债券的申购’。对于违反该条款的不良账户申报，在发行 T 日的过户库中，会设定不良账户申报的记录的成交编号 <b>cjbh</b> 为 0，处理结果 <b>cljg</b> 为“04”（注：该约定适用于可交换债网上发行）。</p>	

序号	字段名	字段描述	配号	中签	类型
1.	gddm	证券账户			C10
2.	cjrq	成交日期，格式为 YYYYMMDD			C8
3.	cjbh	成交编号	配号首个号码	中签号	N12
4.	jydy	交易单元			C5
5.	cjsl	成交数量	配号成功的数量	中签股数 单位： 股票为股 债券为千元面额	N8
6.	sgsl	申购数量	有效申购数量 单位： 股票为股 债券为千元面额	0	N15
7.	zqdm	证券代码	配号代码	中签代码	C6
8.	sbsj	申报时间，格式为 HHMMSS			C6
9.	cjgg	成交价格	0	最终发行价： 股票为每股价格 债券为每张面值。	N8(3)
10.	cjje	成交金额	0	分配数量*发行价	N15(2)
11.	sqbh	会员内部订单号。			C10
12.	bs	B 普通订单，买卖方向：买入 S 普通订单，买卖方向：卖出	B	B	C1
13.	cljg	处理结果	00:成功 01:重复申购 02:违规重复 03:网下在先 04:不良记录		C2

### 3.5 减持控制数据接口 jckzXXXXXX.txt

jckzXXXXXX.txt	减持控制数据接口
描述：	

jckzXXXXX.txt	减持控制数据接口
<p>(1) 数据文件名: jckzxxxxx.txt; xxxxx 为 PBU 代码。</p> <p>(2) 数据内容: 股东受控股份 (包括特定股份及受控股份中非特定的部分) 当日认定数量、次日限制减持数量、及大宗减持受让方限制转让数量。</p> <p>(3) 若股份认定数量 1+股份认定数量 2 不为 0, 则表示该账户持有受控股份; 股份认定数量 1 不为 0, 标识该账户持有特定股份; 股份认定数量 2 不为 0, 标识该账户属于大股东账户, 所持有的受控股份中包括非特定股份。</p> <p>(4) 根据大宗减持受让方限制数量, 控制大宗交易减持受让方股份 6 个月内不允许进行转让。</p> <p>(5) 该文件闭市后发送, 下载时间窗口为当日 20:00 至次日 06:00</p> <p><b>股东减持示例:</b></p> <p>减持额度计算以投资者为粒度进行, 若该投资者拥有多个股东账户, 则应汇总计算总可用额度, 再按受控股份的比例分配到每个具体账户。此外, 若股票发生送股等公司行为导致总股本变动, 历史减持需要进行复权计算。为方便举例, 假设总股本未发生变动, 且该投资者仅拥有 1 个股东账户 (不含关联账户)。</p> <p>股票 S 有总股本 1,000,000 股, 其中 1% 总股本为 10000 股。</p> <p>股东账户 A 当前持有股票 S 的持仓, 其中股份认定数量 1: 12000 股, 其中因非公开发行不满 1 年导致竞价限制减持部分 1000 股; 股份认定数量 2: 7500 股。股东在前 89 个自然日内已通过竞价交易渠道减持 3000 股, 通过大宗交易渠道减持 5000 股。</p> <p>则受控股份中竞价撮合可卖数量=Min(股份认定数量 1 中竞价可卖部分+股份认定数量 2, (1%总股本 - 前 89 个自然日内累计竞价减持数量))= Min((12000-1000+7500),(10000-3000))=7000。</p> <p>受控股份中大宗交易可卖数量=Min(股份认定数量 1+股份认定数量 2, (2%总股本 - 前 89 个自然日内累计大宗减持数量))=Min(12000+7500, 20000-5000)=15000。</p> <p>以上例子对应到数据表中的说明如下:</p> <p>股份认定数量 1=12000</p> <p>股份认定数量 2=7500</p> <p>限制减持数量 1=股份认定数量 1+股份认定数量 2-认定限售股份中竞价撮合可卖数量 =12000+7500-7000=12500</p> <p>限制减持数量 2=股份认定数量 1+股份认定数量 2-认定限售股份中大宗交易可卖数量 =12000+7500-15000=4500</p>	

序号	字段名	字段描述	类型
1	控制日期	为数据使用日	C8
2	指定席位号	PBU 代码	C5
3	证券账户		C10

序号	字段名	字段描述	类型
4	证券代码		C6
5	股份认定数量 1	该账户当日日终处理后被认定为受控股份中特定股份（首次公开发行前股份、上市公司非公开发行股份）的数量	N12
6	股份认定数量 2	该账户当日日终处理后被认定为受控股份中非特定股份的数量	N12
7	限制减持数量 1	该账户次日在认定股份数量范围内竞价撮合被限制减持的数量（1%额度内）	N12
8	限制减持数量 2	该账户次日在认定股份数量范围内大宗交易被限制减持的数量（2%额度内）	N12
9	证券余额	已上市的无限售流通股的持仓余额	N12
10	大宗减持受让方限制数量	该账户由于成为大宗减持受让方后 6 个月内被限制转让的数量	N13
11	其他冻结	持仓余额中需要实施冻结的证券，包含司法冻结、质押冻结、董监高限制卖出等。	N13
12	备注	预留字段，暂不启用。	C20

**\*关于会员柜台系统前端控制的说明：**

委托类型	日初可用余额	说明
集中竞价交易卖出 股票 ETF 申购 转融通证券出借 大宗普通交易卖出 盘后固定价格交易卖出	$M1 = M - \max(D1 + D3, D0)$ $J1 = N1 + N2 - D1$ $M0 = \max(0, M1 - J1)$ M: 已上市的无限售流通股的持仓余额 D1: 限制减持数量 1 D3: 大宗减持受让方限制数量 D0: 其他冻结	M1 为集中竞价交易日初持仓，该部分持仓可用于集中竞价交易卖出、股票 ETF 申购、转融通证券出借、大宗普通交易卖出、盘后固定价格交易卖出前端控制。J1 为日初竞价可减持额度（不考虑冻结），M0 为集中竞价交易日初自由流通持仓。其中大宗普通交易卖出仅允许投资者卖出其持有的自由流通部分股份。  ETF 赎回后卖出股份，前端控制时视作占用自由流通余额。

委托类型	日初可用余额	说明
大宗交易减持 (受控股份减持)	$M2 = M1 + \min(D1, \max(D1 + D3 - D0, 0))$ $Q2 = N1 + N2 - D2$ $Md = \min(M2, Q2)$ M2: 为大宗交易减持日初可用持仓 Q2: 大宗 2% 可用额度 N1: 股份认定数量 1 N2: 股份认定数量 2 D2: 限制减持数量 2	Md 为大宗减持日初前端控制数量 大宗减持时优先扣减 $\min(D1, \max(D1 + D3 - D0, 0))$ 部分 而后扣减 M1 部分, 其中 M1 为竞价日中实时维护持仓。 Q2 为大宗日初 2% 可用额度。

\*上表数据说明:

(1) 证券余额为全部可流通已上市余额; (2) 可流通已上市余额分为: 自由流通余额, 受控股份余额, 大宗减持受让余额;

(3) 其他冻结为持仓余额中需要实施冻结的证券, 包含司法冻结、质押冻结、董监高限制卖出等。

### 3.6 已开通科创板交易权限账户资产信息接口 kcbzhzcxxXXXXX001YYYYMMDD.txt

kcbzhzcxxXXXXX001YYYYMMDD.txt	已开通科创板交易权限账户资产信息接口
<b>描述:</b> 文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的交易日日期 (T 日), XXXXX 代表会员唯一码, 由会员编号的后 5 位数字组成。 1). 账户筛选标准: T+1 日提供截至 T 日 16:00 前所有已开通科创板交易权限的全量账户, 16:00 后开通权限的, 在 T+2 日报送的 T+1 日数据中体现; 若某个账户在 T 日 16:00 前关闭科创板交易权限, 则 T 日的数据文件中不需要提供该账户数据, 16:00 后关闭权限的, T 日的数据文件仍需提供该账户数据。 2). 资产范围: 包含投资者所有的资产, 包括沪深两市场内产品市值、场外产品公允价值、资金等。当涉及借贷业务时, 应收部分、应付部分需单独列示。 3). 所报送的证券账户包括所有自然人、私募以及一般机构。其中一般机构指除会员自营账户、资管账户、基金账户、保险账户、社保账户、QFII 账户等专业机构账户以外的一般法人账户。 4). 对于场外产品的范围、资金、公允价值等统计口径, 按会员针对科创板投资者适当性管理中, 开户资格认定的标准进行统计。 5). 涉及到汇率的, 使用 T 日外汇管理局人民币汇率中间价。 6). 一个投资者一条记录, 股东代码需填写沪市股东代码。因特殊原因, 一个投资者在同一家会员开通多个普通账户对科创板交易权限的, 在本表中的序号 3 字段填入持有证券市值最大的一个普通账户代码即可; 因特殊原因, 一个投资者在同一家会员开通多个信用账户对科创板交易权限的, 在本表中的序号 4 字段填入持有证券市值最大的一个信用账户代码即可; 序号 5~13 的指标都应该包括该投资者名下所有证券账户、资金账户的数值。	

<b>kcbzhzcxxXXXXX001YYYYMMDD.txt</b>	<b>已开通科创板交易权限账户资产信息接口</b>
<p><b>上传方式：</b></p> <p>数据通过证通云盘传输，T+1 日 12:00 之前上传 T 日数据。</p> <p>软件下载，相关文档可参考网页 <a href="https://istock.ssetech.com.cn/wiki/doku.php?id=ssesystem:software:sdep">https://istock.ssetech.com.cn/wiki/doku.php?id=ssesystem:software:sdep</a></p> <p>证通云盘中接收该数据的用户为上交所用户 sse002(用户 sse001 是接收交易数据的，请勿报送给该用户)。本业务的业务标签是 kcbzhzcxx。请参考用户手册拟定自动上传任务或手动上传。</p> <p>云盘“传输监控”界面可以查看文件报送结果。若自动化监控，可监控云盘 logs 目录下日志文件。</p> <p>该业务目前仅限于交易专网上传，暂不开放互联网上传。</p> <p><b>数据重传要求：</b></p> <p>会员单位应当保证所报送数据格式、内容的准确性，当会员单位自行发现或收到本所反馈有漏报、误报情况的，需在 T+1 日上传时，将修正日重报的全量数据连同 T 日的全量数据放入一个文件中（文件名日期为 T 日，文件内容中的交易日字段分别填修正日及 T 日）。</p>	

序号	字段名	字段类型	描述
1	交易日	C8	YYYYMMDD，若发生修正、补充历史数据情况，应该放入修补历史当天的全量数据。
2	会员编号	C5	会员唯一码，由会员编号后五位数字组成
3	沪市证券账户	C10	填沪市普通账户股东代码，若该投资者只针对信用账户开立科创板权限而没有对普通账户开通权限，则本字段填空值。 无论该投资者仅开通一个账户权限，还是两类账户权限都开通，下述序号 5~13 的指标都应该包括 <b>该投资者名下</b> 所有证券账户、资金账户的数值。
4	信用证券账户	C10	填沪市信用账户股东代码，若该投资者只针对普通账户开立科创板权限而没有对信用账户开通权限，则本字段填空值。 无论该投资者仅开通一个账户权限，还是两类账户权限都开通，下述序号 5~13 的指标都应该包括 <b>该投资者名下</b> 所有证券账户、资金账户的数值。
5	证券资金账户资金总额	N18（2）	当前交易日收盘后数据，单位：元。填写证券资金账户总额+信用资金账户总额+衍生品资金账户总额。
6	应付资金	N18（2）	对于场内，包括因回购、质押等原因借入资金尚未归还的；融资买入后尚未归还的等。对于场外，若发生相应业务，也需计入。填正值。



7	应收资金	N18(2)	对于场内，包括因回购、质押等原因借出资金尚未归还的等。对于场外，若发生相应业务，也需计入。填正值。
8	A 股及 CDR 市值总额	N18(2)	沪深两市数据；包括 A 股及 CDR 市值，包括限售及非限售部分；当前交易日结算后数据，单位：元
9	A 股及 CDR 应付余量市值	N18(2)	沪深两市数据；当前交易日结算后数据，单位：元。包括各类标的为 A 股及 CDR 融券余额、因约定购回式等原因证券暂存在本账户但不享有相关权益的证券市值等；填正值。
10	A 股及 CDR 应收余量市值	N18(2)	沪深两市数据；当前交易日结算后数据，单位：元；包括转融券出借方出借证券市值、因约定购回式等原因证券不在本账户但享有相关权益的证券市值等；填正值
11	其他证券公允价值	N18(2)	沪深两市场内产品及场外产品，单位：元。其中，场内产品包括沪深两市 B 股（人民币）、优先股、债券托管量、场内基金、期权权利方持仓市值、沪深交易所的港股通市值（人民币，包括在途部分市值）等；场外产品的公允价值也需统计入内。
12	其他证券应付余量公允价值	N18(2)	单位：元。对于场内，包括各类标的为其他证券的融券余额、因约定购回式等原因证券暂存在本账户但不享有相关权益的证券市值等；对于场外，若发生相应业务，也需计入；填正值。
13	其他证券应收余量公允价值	N18(2)	单位：元。对于场内，包括各类标的为其他证券的因回购入库、约定购回式等原因证券不在本账户但享有相关权益的证券市值等；对于场外，若发生相应业务，也需计入；填正值

## 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卫星信道或证通云盘传送，其中描述的开市前目前指上午 9:15 分开盘前。

### 4.1 上市公司公告文件

MMDDfNNNN.TXT, MMDDzNNNN.TXT	上市公司公告文件
<b>描述：</b> 转发上证信息公司文件。文件名中 MMDD 表示月日格式的日期，NNNN 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 国债利息接口 gzlx.MDD

gzlx.MDD	国债利息接口
<b>描述：</b> 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)

### 4.3 标准券折算率变更接口 zslMMDD.txt

zslMMDD.txt	席位式质押回购标准券折算率接口
<b>描述：</b> 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。 该接口文件说明产品在折算率启用日期所在星期开始适用的标准券折算率。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码	债券、债券 ETF 证券代码	C6



2	证券名称	债券、债券 ETF 名称	C20
3	标准券折算率/折算值	标准券折算率 当证券代码为债券代码时本字段为标准券折算率。 当证券代码为债券 ETF 代码时本字段为标准券折算值	N15
4	开始适用日	YYYYMMDD	C8
5	结束适用日	YYYYMMDD	C8

#### 4.4 标准券折算率变更公告文件 zslwMMDD.txt

zslwMMDD.txt	席位式质押回购标准券折算率公告文件
<p><b>描述：</b></p> <p>转发中登上海分公司 zsgg1yyyymmdd001.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。</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>否则，发送空文件</p>	

#### 4.5 标准券折算比率接口 xzslMMDD.txt

xzslMMDD.txt	账户式质押回购折算率接口
<b>描述：</b> 转发中登上海分公司 ngzzlYYYYMMDD001.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。 该接口文件说明产品参加账户式质押回购业务时折算为标准券比例。 字段间用分隔符' '定位。	

序号	字段名	字段描述	类型
1	证券代码	国债、债券 ETF 证券代码	C6
2	标准券比例/标准券折算值	标准券比例 当证券代码为债券代码时本字段为标准券折算率。 当证券代码为债券 ETF 代码时本字段为标准券折算值	N15(3)

#### 4.6 权证信息接口 qzxxMMDD.txt

qzxxMMDD.txt	权证信息接口
<b>描述：</b> 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	C4

		字段为“美式”	
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

#### 4.7 交易公开信息公告文件 jygekxxMMDD.txt

jygekxxMMDD.txt	交易公开信息公告文件
<b>描述：</b> 按照交易规则（2023 年修订）5.4.1、5.4.2、5.4.7 等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。 该文件为文本文件。	

#### 4.8 科创板交易公开信息公告文件 jygekxx02MMDD.txt

jygekxx02MMDD.txt	科创板交易公开信息公告文件
<b>描述：</b> 按照交易规则（2023 年修订）5.4.7、6.1.9、6.1.10 等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。 该文件为文本文件。	

#### 4.9 产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt

fjyYYYYMMDD.txt	产品非交易基础信息接口
<b>描述：</b> 本文件为与产品相关的非交易基础信息数据。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的文件适用日期，在交易日开市前发送。（交易日内不更新）	

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
1	参考数据类型	技术实现固定值 竞价撮合平台非交易，该值固定填写为R0001； <u>互联网交易平台非交易，该值固定填写为R0006；</u>  后续格式仅当参考数据类型字段为R0001 <u>或R0006</u> 时 对应格式类型  后续若加入其他平台非交易数据，则该字段有新的 取值，对于不同的参考数据类型取值，后续字段格 式则可能不一样。	C5
2	非交易证券代码	非交易证券代码，如无则为空	C6
3	非交易证券名称	非交易证券名称	C8
4	产品证券代码	产品证券代码，如无则为空	C6
5	产品证券名称	产品证券名称，如无则为空	C8
6	非交易业务类型	非交易业务类型： IN 上网证券发行申购 IS 老股东增发证券发行申购 PH IPO配号 KK IPO扣款 HK IPO还款 R1 股票配股或科创板股票配售行权 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 <del>OS 开放式基金认购</del> 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 <del>OV 开放式基金转换</del>	C2

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
		FS 要约预受 FC 要约撤销 <del>ST 余券划转</del> <del>SR 还券划转</del> <del>CI 担保品划入</del> <del>CO 担保品划出</del> <del>SI 券源划入</del> <del>SO 券源划出</del> <del>PA 密码激活(注销)</del> QT 其它  <del>当非交易类型为PA时，除非交易证券代码外的其余 字段无实际意义。</del>	
7	非交易订单输入开始日期	订单输入开始日期。	C8 YYYYMMDD
8	非交易订单输入结束日期	订单输入结束日期。	C8 YYYYMMDD
9	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。	N12
10	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。	N12
11	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。	N12

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
12	非交易价格	当非交易业务类型为IN、IS时，为发行价格。 当非交易业务类型为PH、KK、HK时，为产品发行价格。 当非交易业务类型为FS、FC时，为要约预受和撤销的固定价格。 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，为配股、配债、科创板配售方式减持价格。 其他非交易业务，该字段默认填写为 1.00000，无实际意义。	N13(5)
13	IPO总量	当非交易业务类型为IN、IS时，发行总量。	N16
14	IPO分配方法	当非交易业务类型为IN、IS时，IPO分配方法。 L-摇号抽签 A-竞价分配 P-ETF末日比例配售	C1
15	IPO竞价分配或ETF认购确认日期	当非交易业务类型为IN、IS时，执行竞价分配或ETF末日比例配售的日期。	C8 YYYYMMDD
16	IPO验资或配号日期	当非交易业务类型为IN、IS时，进行验资或配号的日期。	C8 YYYYMMDD
17	IPO摇号抽签日期或ETF比例配售日	当非交易业务类型为IN、IS时，进行摇号抽签的日期或为ETF比例配售日（对于ETF网上发行，该日的认购订单，在“ETF认购确认日”按照“ETF末日配售比例”进行比例配售。）。	C8 YYYYMMDD
18	IPO申购价格区间下限	当非交易业务类型为IN、IS时，IPO申购价格区间的下限。	N11(3)
19	IPO申购价格区间上限	当非交易业务类型为IN、IS时，IPO申购价格区间的上限。	N11(3)
20	ETF末日配售比例	当非交易业务类型为IN、IS时，对于ETF网上发行，为ETF末日比例配售的比例，初始默认值为-100.000。 有效值范围：最小值为 0.000；最大值为 100.000。	N11(3)

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
21	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，科创板配售方式减持业务此字段无意义。	C8 YYYYMMDD
22	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，科创板配售方式减持业务此字段无意义。	C8 YYYYMMDD
23	配股比例	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股比例，科创板配售方式减持业务此字段无意义。	N11(6)
24	配股总量	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股总量/科创板配售方式减持总量。	N16
25	T-2 日基金收益/基金净值	当非交易业务类型为OC、OR时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-2 日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-2 日每百份基金净值；	N13(5)
26	T-1 日基金收益/基金净值	当非交易业务类型为OC、OR时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-1 日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-1 日每百份基金净值；	N13(5)
27	发行方式	当非交易业务类型为IN、IS且分配方法为L（摇号中签）时，发行方式。  001-按市值限额申购  002-增发资金申购  003-信用申购  新股网上发行采用 001，可转债、可交换债网上发行采用 003，以上两种发行方式均取消预缴款。	C3

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
28	备注	<p>保留字段，用于扩展。备注中补充以下字段，每个字段根据格式定义，参照本文档 txt 文件对齐方式约定，字段定长，字段间以&amp;分隔。</p> <p>一、发行申购非交易产品信息</p> <p>对于非交易业务类型为 IN，定义如下：</p> <p>1、尚未盈利标识 C1，取值为'U'时，表示尚未盈利。</p> <p>该字段仅针对注册制股票（含存托凭证）有效。</p> <p><u>二、要约非交易产品信息</u></p> <p><u>对于非交易业务类型为 FS、FC，定义如下：</u></p> <p><u>1、要约预受和要约撤销的申报编号（770***），字段类型为 C6，取值为 6 位数字。</u></p>	C46

#### 4.10 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
<b>描述：</b> 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

#### 4.11 产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt

cpxx0201MMDD.txt	产品信息文件接口
<b>描述：</b>	



cpxx0201MMDD.txt	产品信息文件接口
<p>本文件为与产品相关的基础信息数据（包含停牌的产品，不含非交易信息、未发行上市产品），仅供参考。文件名中 0201 分别代表第二版、第一批次，文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期。开市前生成并定时发送。</p> <p>对于集合资产管理计划产品，基础证券代码、面值、买卖数量单位、申报数量上下限、价格档位、融资融券标的标识、除权比例、除息金额字段对该业务无意义，取定长空格。</p> <p>对于其他仅在综合业务平台挂牌的撮合产品，通常参照竞价撮合平台产品在本文件中发布，其中对于国债预发行产品，基础证券代码、申报数量上下限、除息金额、融资融券标志对该业务无意义，取定长空格。</p> <p>对于控制指令类产品，基础证券代码、证券类别、面值、买卖数量单位、申报数量上下限、前收盘价格、价格档位、涨跌幅类型、涨幅上下限、除权比例、除息金额、融资融券标的标识、产品状态标志字段无意义，取定长空格或取 0。</p>	

cpxx0201MMDD.txt			产品信息文件接口
序号	字段名称	描述	类型
1	证券代码	证券代码  在show2003.dbf中为非交易业务（比如发行业务）而挂牌的“证券代码”（比如 780***），没有对应的产品基础信息数据记录，有关属性通过非交易信息文件获取。	C6
2	ISIN代码	ISIN代码（预留）。	C12
3	记录更新时间	标识接口中本记录更新时间HH:MM:SS	C8
4	中文证券名称（短）	中文证券名称（短）	C8
5	英文证券名称	英文证券名称（预留）	C10
6	基础证券代码	当产品为权证、可转债、可交换债等衍生品时，该字段为其标的产品的证券代码。	C6
7	市场种类	‘ASHR’表示A股市场；‘BSHR’表示B股市场。  科创板股票、综业平台集合资产管理计划、债券预发行、定向可转债取‘ASHR’。	C4
8	证券类别	‘ES’表示股票；‘EU’表示基金；‘D’表示债券；‘CB’表示公募REITs。（参考ISO10962），集合资产管理计划、债券预发行、定向可转债取‘D’	C6
9	证券子类别	自定义详细证券类别，取值请参考数据说明部分	C3
10	货币种类	货币代码取值：	C3

cpxx0201MMDD.txt		产品信息文件接口	
序号	字段名称	描述	类型
		美元：USD；人民币：CNY；（参考ISO4217）	
11	面值	债券当前面值，单位元，其他产品取 0.000	N15(3)
12	可流通证券未上市数量	对于A股股票（含存托凭证）、B股股票，取值为可流通证券未上市数量 对于其它证券产品（含优先股），预留，暂不启用	N15
13	最后交易日期	对于国债预发行产品，为最后交易日期，格式为YYYYMMDD	C15
14	上市日期	在上交所首日交易日期，YYYYMMDD	C8
15	产品集SET编号	取值范围从 1 到 999。 用来表明产品的一种分组方式，用于在多主机间进行负载均衡分配。该值在一个交易日内不会变化。	N3
16	买数量单位	买订单的申报数量必须是该字段的整数倍。	N12
17	卖数量单位	卖订单的申报数量必须是该字段的整数倍。	N12
18	限价申报数量下限	限价申报数量下限	N12
19	限价申报数量上限	限价申报数量上限	N12
20	前收盘价格	前收盘价格（如有除权除息，为除权除息后前收盘价） 对于货币市场基金实时申赎，取值为 0.010 集合资产管理计划固定填写挂牌首日开盘参考价格 定向可转债如果处于转让期，则为除权除息前的前收盘价，否则为 0	N11(3)
21	价格档位	申报价格的最小变动单位	N11(3)
22	涨跌幅限制类型	‘N’表示有涨跌幅限制类型； ‘R’表示无涨跌幅限制类型（进入退市整理期交易的退市整理股票首日、退市后重新上市的股票首日。根据交易规则（2023 年修订）3.3.13 规定）； ‘S’表示回购涨跌幅控制类型 ‘F’表示基于参考价格的涨跌幅控制 ‘P’表示IPO上市无涨跌幅限制类型（首次公开发行上市的股票上市前 5 日。根据交易规则（2023 年修订）3.3.13 规定）； ‘U’表示无任何价格涨跌幅控制类型	C1

cpxx0201MMDD.txt		产品信息文件接口	
序号	字段名称	描述	类型
23	涨幅上限价格	对于N类型涨跌幅限制的产品，该字段当日不会更改，基于前收盘价（首日上市交易产品为发行价）计算。 对于其他涨跌幅限制类型，该字段仅供参考，无实际控制意义。	N11(3)
24	跌幅下限价格	计算方式参考涨幅上限价格	N11(3)
25	除权比例	每股送股比例 对于国债预发行产品，为保证金比例，单位为%。 对于基金产品，为份额折算的变动比例。当为份额拆分时，变动比例>0；当为份额合并时，-1<变动比例<0。	N11(6)
26	除息金额	每股分红金额	N11(6)
27	融资标的标志	‘T’表示是融资标的证券 ‘F’表示不是融资标的证券。	C1
28	融券标的标志	‘T’表示是融券标的证券 ‘F’表示不是融券标的证券。	C1
29	产品状态标志	该字段为 20 位字符串，每位表示含义如下，无定义则填空格。 第 1 位对应：‘N’表示首日上市。 第 2 位对应：‘D’表示除权。 第 3 位对应：‘R’表示除息。 第 4 位对应：‘D’表示国内正常交易产品，‘S’表示股票风险警示产品，‘P’表示退市整理产品（主板），‘T’表示退市转让产品，‘U’表示优先股产品。 第 5 位：‘Y’表示该产品为存托凭证。 第 6 位对应：‘L’表示债券投资者适当性要求类，‘M’表示债券机构投资者适当性要求类。 第 7 位对应：‘F’表示 15:00 闭市的产品，‘S’表示 15:30 闭市的产品，为空表示非竞价撮合平台且非新债券交易系统挂牌产品，无意义。 第 8 位对应：‘U’表示上市时尚未盈利的上市公司股票（含存托凭证），科创板科创成长层上市公司被调出科创板成长层，或者其他上市公司上市后首次实现盈利的，	C20

cpxx0201MMDD.txt		产品信息文件接口	
序号	字段名称	描述	类型
		<p>取消该特殊标识。该字段仅针对注册制股票（含存托凭证）有效。</p> <p>第 9 位对应：‘W’表示具有表决权差异安排的发行人的股票（含存托凭证）。该字段仅针对注册制股票（含存托凭证）有效。</p> <p>第 10 位对应：‘Y’表示支持当日交易回转，‘N’表示不支持当日交易回转。</p> <p>第 11 位对应：‘Y’表示该产品为注册制股票（含存托凭证）。</p>	
30	市价申报数量下限	市价申报数量下限	N12
31	市价申报数量上限	市价申报数量上限	N12
32	中文证券名称（长）	中文证券名称（长）	C32
33	备注	<p>保留字段，用于扩展。备注中补充以下字段，每个字段根据格式定义，参照本文档txt文件对齐方式约定，字段定长，字段间以&amp;分隔。</p> <p>一、产品属性区间（第 1-40 位）</p> <p>1、对于债券类产品（证券类别为“D”），定义如下： 对于国债预发行产品（证券子类别为“WIT”）：</p> <p>1）招标方式C1，‘1’表示国债预发行利率招标，‘2’表示国债预发行价格招标。</p> <p>2）基准价格N11(3)，当价格招标时为基准价格，当利率招标时为基准收益率。</p> <p>3）参考久期N6(2)，单位为年。</p> <p>4）当期发行量N9，单位为千元面额。</p> <p>其他位预留，暂不启用。</p> <p>对于非国债预发行产品：</p> <p>1）产品细分类别C4，“B010”表示科创板可转债，其他债券产品暂不标识。</p> <p>其他位预留，暂不启用。</p> <p>2、对于股票类产品（证券类别为“ES”），定义如下：</p>	C100

cpxx0201MMDD.txt		产品信息文件接口	
序号	字段名称	描述	类型
		<p>1) 市场流通总量N15, 单位为股。</p> <p>上述字段仅对A股股票(含存托凭证)、B股股票有效。</p> <p>其他位预留, 暂不启用。</p> <p>3、对于基金类产品(证券类别为“EU”), 定义如下:</p> <p>1) 产品细分类别C4,</p> <p>“F111”表示单市场股票(沪)ETF;</p> <p>“F112”表示跨市场股票(沪深京)ETF;</p> <p>“F113”表示跨市场股票(沪港深京)ETF;</p> <p>“F114”表示单市场股票(科创板)ETF;</p> <p>“F115”表示跨市场股票(含科创板)ETF;</p> <p>“F121”表示单市场债券(沪)ETF;</p> <p>“F122”表示跨市场债券(沪深)ETF;</p> <p>“F123”表示现金申赎类债券ETF;</p> <p>“F131”表示跨境ETF;</p> <p>“F141”表示黄金ETF;</p> <p>“F142”表示商品期货ETF;</p> <p>“F150”表示交易型货币基金;</p> <p>“F220”表示科创板相关LOF。</p> <p>其他位预留, 暂不启用。</p> <p>二、交易属性区间(第 41-60 位)</p> <p>对所有产品, 定义如下:</p> <p>1、盘后固定价格交易标志C1, “Y”表示支持盘后固定价格交易, “N”表示不支持盘后固定价格交易</p> <p>2、其他位预留, 暂不启用。</p> <p>交易属性区间在本文件中不提供, 在cpxx0202mmdd.txt中提供。</p>	

**数据说明:**
**一、各证券子类别取值说明:**

业务分类	证券子类别取值
股票	ASH 以人民币交易的股票(主板)

	KSH 以人民币交易的股票（科创板） BSH 以美元交易的股票 OEQ 其它股票 OPS 公开发行优先股 PPS 非公开发行优先股
基金	CEF 封闭式基金 OEF 开放式基金（ <u>仅含开放式货币市场基金</u> ） EBS 交易所交易基金（ETF） OFN 其它基金 LOF LOF基金
债券	GBF 国债、地方债、政府支持债、政策性金融债 DST 国债分销（仅用于分销阶段） DVP 公司债（地方债）分销 CBF 企业债 CCF 可转换企业债 CPF 公司债、企业债、可交换债、政府支持债 CRP 通用质押式回购 OBD 其它债券 WIT 国债预发行 QRP 报价回购 AMP 集合资产管理计划 TCB 定向可转债
公募 REITs	RET 公募REITs
其他	CMD 控制指令（中登身份认证密码服务产品、指定登记、指定撤销复用CMD证券子类别）

## 二、产品涨跌幅说明

### （一）股票（“证券类别”=“ES”）

证券 子类 别	产 品 状 态 标 志 第 4 位	涨跌幅限制类型			
		N（有涨跌幅限制类 型）	R（无涨跌幅限制类 型）	P（IPO 上市无涨跌幅 限制类型）	U（无任何价格 涨跌幅控制类 型）
ASH	D	主板股票（A 股）（涨	主板股票（A 股）	新股上市前五日主板	不适用

		跌幅为前收价 10%)	(例: 重新上市首日)	股票(A股)(无涨跌幅限制)	
	S	风险警示板股票(A股)(涨跌幅为前收价 5%)	不适用	不适用	
	P	退市整理股票(A股)(涨跌幅为前收价 10%)	退市整理股票(A股)(退市整理期首日)	不适用	
BSH	D	主板股票(B股)(涨跌幅为前收价 10%)	主板股票(B股)(例: 重新上市首日)	新股上市前五日主板股票(B股)(无涨跌幅限制)	
	S	风险警示板股票(B股)(涨跌幅为前收价 5%)	不适用	不适用	
	P	退市整理股票(B股)(涨跌幅为前收价 10%)	退市整理股票(B股)(退市整理期首日)	不适用	
KSH	D	科创板股票(涨跌幅为前收价 20%)	科创板股票(例: 退市整理期首日)	新股上市前五日科创板股票(无涨跌幅限制)	
PPS	U	不适用			非公开发行优先股

注:

1、产品状态第 4 位对应: 'D' 表示国内正常交易产品, 'S' 表示股票风险警示产品, 'P' 表示退市整理产品(主板), 'U' 表示优先股产品。

(二) 基金(“证券类别”=“EU”)

证券子类别	产品状态标志第 4 位	涨跌幅限制类型	
		N(有涨跌幅限制类型)	R(无涨跌幅限制类型)
EBS	D	ETF(涨跌幅为前收价 10%, 科创板相关 ETF 为 20%)	不适用
LOF	D	LOF(涨跌幅为前收价 10%, 科创板相关 LOF 为 20%)	不适用

CEF	D	封闭式基金（涨跌幅为前收价 10%）	不适用
OEF	D	不适用	不适用

## （三）债券（“证券类别”=“D”）

证券子类别	产品状态标志第 4 位	涨跌幅限制类型				
		N( 有涨跌幅限制类型 )	R ( 无涨跌幅限制类型 )	F( 基于参考价格的涨跌幅控制类型 )	S( 回购涨跌幅控制类型 )	U( 无任何价格涨跌幅控制类型 )
GBF	D	不适用	国债	不适用	不适用	不适用
CBF	D	不适用	企业债券			
CCF	D	可转换企业债券（上市首日涨幅为发行价 57.3%，跌幅为发行价 43.3%，上市次日起涨跌幅为前收价 20%）	不适用			
CPF	D	不适用	公司债券（或地方债券）			
DST	D	国债分销（涨跌幅为前收价 30%）	不适用			
DVP	D	公司债（地方债）分销（固定价格）				
CRP	D	不适用	不适用	不适用	质押式国债回购	
BRP	D				质押式企债回购	
WIT	D				国债预发行	
TCB	D	不适用	不适用	不适用	不适用	定向可转债

## （四）公募 REITs（“证券类别”=“CB”）



证券子类别	产品状态标志第 4 位	涨跌幅限制类型
		N (有涨跌幅限制类型)
RET	D	公募 REITs (上市首日涨跌幅为发行价 30%, 后续为前收价 10%)

注：

- 1、涨跌幅类型“S”、“F”不适用于股票产品；涨跌幅类型“S”、“P”、“F”、“U”、“R”不适用于基金产品；涨跌幅类型“P”不适用于债券产品；涨跌幅类型“S”、“P”、“F”、“U”、“R”不适用于公募 REITs 产品。
- 2、对于上市首日的股票、基金、公募 REITs 和债券，产品状态标志第 1 位取值为“N”。
- 3、对于有价格涨跌幅和无价格涨跌幅证券，其动态价格笼子限制参见交易规则。
- 4、对于国债预发行产品，采用价格申报的，国债预发行交易的价格申报区间为该期国债招标日前第六个法定工作日理论估值价格加减 3 元；采用收益率申报的，国债预发行的收益率申报区间为该期国债招标日前第六个法定工作日该期限国债到期收益率加减 0.75 个百分点。
- 5、对于定向可转债产品，上市日期为转让、转股和回售起始日中最早的日期。
- 6、对于当日交易回转标志，仅对分离式可转债 CBD、企业债券 CBF、可转换企业债券 CCF、公司债券 CPF、金融机构发行债券 FBF、国债 GBF、无息国债 GBZ、A 股股票 ASH、科创板股票 KSH、B 股股票 BSH、公开发行优先股 OPS、其它股票 OEQ、封闭式基金 CEF、交易所交易基金 EBS、上市型开放式基金 LOF、其它基金 OFN 有效。

#### 4.12 产品基础信息第二版第二批次文件接口 cpxx0202MMDD.txt

cpxx0202MMDD.txt	产品信息文件接口
<b>描述：</b> 本文件为与产品相关的基础信息数据（包含停牌的产品，不含非交易信息、未发行上市产品），仅供参考。文件名中 0202 分别代表第二版、第二批次，文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期。开市前生成并定时发送。 本文件与产品基础信息文件接口 cpxx0201MMDD.txt 文件格式、字段含义一致。 本文件与 cpxx0201MMDD.txt 文件的区别是：第一批次发出后，对 cpxx 价格相关内容的更新以及备注字段中的交易属性区间会通过本文件发出。	

#### 4.13 质押式报价回购折算率文件 bzsl01MMDD.txt

bzsl01MMDD.txt	质押式报价回购折算率文件接口
<b>描述：</b>	

bzsl01MMDD.txt	质押式报价回购折算率文件接口
<p>本文件为转发指数公司文件，内容为<b>质押式报价回购质押券折算率（值）</b>。</p> <p>文件名中 MMDD 表示月日格式的交易日使用的日期。开市前定时发送。</p> <p>允许标准券比率/标准券折算值为零。若标准券比率/标准券折算值为零，则出入库时现券发生增减变化，标准券不变化。</p> <p>本文件含债券的标准券比率及 ETF 的标准券折算值。</p>	

bzsl01MMDD.txt		质押式报价回购折算率文件接口
字段名称	描述	类型
证券代码	证券代码，不足 6 位左边补 0	C6
标准券比率/标准券折算值	右对齐，不足左补空格  保留三位小数，最大值为 999.999  当证券代码为债券时本字段为标准券折算率。  当证券代码为ETF时本字段为标准券折算值，折算值单位为元。	N15(3)

## 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 khlXXXXX.txt 压缩为 kghXXXXX.zip 一个文件。新交易系统切换后, kghXXXXX.txt 和 khlXXXXX.txt 分别压缩为 kghXXXXX.zip 和 khlXXXXX.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
<b>描述：</b> 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。含公募 REITs 信息。	

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-允许申赎，1-发行 2-发行成功，3-发行失败 4-基金停止申赎 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	A3

ID	字段名	描述	类型
		250-法郎，280-马克	
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 1-价外费	C1
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 khlXXXXX.txt

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

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
<b>描述:</b> 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)

ID	字段名	描述	类型
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
<b>描述：</b> 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 <u>基金非交易代码</u> (519xxx)。 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(169位)左对齐，编号<1000000000000000。 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， 0-中间过程 1-业务过程结束	C1
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	A1

		0-TA 计费 1-基金计费	
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	A4

		具体编码依 GB13497-92	
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 在转销售人是一次完成时，为必须项	A17
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 返回的确认信息	N2

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	●	●	●	●	●	●	●	●		●	●	●
16				●								
24	●						●					
25		●	●	●		●		●				
32		●	●	●	●		●	●	●	●	●	●
34	●							●				
52		●	●	●	●	●		●	●			●
53		●	●	●	●	●		●				●
58										●		
60		●								●		
62			●	●	●	●		●	●	●	●	●
64		●	●	●		●			●			
67	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
86		●	●	●				●				
92	●	●	●	●	●	●	●	●		●	●	●
94			●	●	●	●			●			
97	●				●							●
119		●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
132	●	●		●	●	●		●		●	●	●
134	●	●	●			●						
135	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
136	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
137		●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
138		●	●	●	●	●			●			●
161								●				
162								●				
163								●				
173				●	●			●	●			●
176		●			●			●	●			●
177			●	●	●							●
193			●	●				●	●			
255		●	●		●			●	●	●	●	●
256		●	●		●		●	●	●			●

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	增强 强减	冻结 确认	解冻 确认	非交易 过户 确认
257										●		
260		●	●		●	●		●	●	●	●	●
263				●								
266						●						
276		●	●	●	●	●						●
285			●	●	●	●						
8000	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●	●
8001	●	●	●	●	●	●	●	●	●			

## 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	<b>认购申请(020)</b> 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。
	<b>申购申请(022)</b> 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。
	<b>赎回申请(024)</b> 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。
	<b>转托管转出申请(028)</b> 转托管转出申请是投资人从证券市场转出的申请。
	<b>设置分红方式申请（029）</b> 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。
	<b>基金转换申请（036）</b>
交易确认	<b>认购确认(120)</b> 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。

	<b>申购确认(122)</b> 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。
	<b>赎回确认(124)</b> 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。
	<b>转托管转出确认(128)</b> 对于转托管转出申报的确认信息。
	<b>设置分红方式确认 (129)</b> 对于分红方式设置的确认。
	<b>基金转换确认 (137 和 138)</b> 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。
	<b>认购结果(130)</b> 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。
TA 发起的业务	<b>基金份额冻结确认(131)</b> 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。
	<b>基金份额解冻确认(132)</b> 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。
	<b>非交易过户转入确认(134)，非交易过户转出确认(135)</b> 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。
	<b>转托管转入确认 (127)</b> 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。
	<b>认购拉单 (190)</b> 因认购资金不足引起的拉单处理。
	<b>强行调增(144) ， 强行调减(145)</b> 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。
	<b>强行赎回 (142)</b> 强行赎回确认是强行赎回的处理结果。



### 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：

注意：

- 1、 本表所述“交易”特指开放式基金除二级市场买卖交易外的其他交易。
- 2、 如果找不到合适的返回代码，统一填写“9999”，即“其它错误”。

返回代码	含义	备注
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	销售人交易基金账号非法	
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	基金账号非法	包括无基金账号
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	交收行账号非法	
0136	上交所账号非法	
0137	深交所账号非法	
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	资金账号非法	
0206	交易数量非法	
0207	交易金额非法	
0208	对方销售人基金账号非法	
0209	受理日期已变为下一个工作日	
0210	对方基金账号非法	
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	账户申请日期无效	
0302	账户申请不存在	
0303	投资人已注册基金账户	
0304	账户申请注册失败	
0305	赎回份数过小	
0306	因投资人未在转入方开户致使转销售人/机构失败	
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	基金账户已挂账	
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	基金禁止转销售人/机构	
0321	证券账户已注册为基金账户	
0322	基金账户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转销售人/机构	
0323	有在途份数，不能全转销售人/机构	
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	转销售人/机构类型错	
0347	转销售人/机构类型与申报数据不符	
0348	旧基金账号个人资料不存在	
0349	旧基金账号机构资料不存在	
0350	无效分红方式	
0351	该基金账号有份数允许注销	
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	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	转销售人/机构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	基金账号已登记	
0391	基金账号未登记	
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额	
0415	小于初次投资金额限制	
0416	小于追加投资限制	
0417	转销售人/机构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销售人/机构	
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(交易账号重)	
0423	当天多次开户(基金账号重)	
0424	不存在要转出的份数	
0425	经办人识别方式非法	

0426	账单寄送选择方式非法	
0427	基金账号信息未作改动, 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	交易账号凭证号错误	
0489	交易账户处于等待确认状态	
0490	交易账户已挂失	
0491	确认密码不正确	
0492	基金账户处于等待确认状态	
0493	当天有账户申请	
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销	
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	交易账户已作废	
0507	交易账户凭证号状态错误	
0508	交易账户已销户	
0509	交易账户已冻结	
0510	交易账户已撤销	
0511	交易账户待确认	
0512	交易账户未开基金账户	
0513	基金账户挂失	
0514	基金账户冻结	
0515	基金账户销户	
0516	转销售人/机构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	交易账户与基金账户不匹配	
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	复核流水的交易账号不对	
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	取申请账页失败	
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	注册登记人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	基金账户受理方式不能为空	
0590	不存在的基金账户受理方式	
0591	到账情况不能为空	
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	

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	销售机构设置错误	
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	取交易账户编号失败	
0676	取基金账户流水号失败	

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	取交易账号凭证流水号失败	
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，不能处理到账操作	
0686	存在未审批的巨额赎回	
0687	取交易账号凭证号失败	
0688	取交易账号失败	
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	收市写账页错误	
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	账户清算错误	
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	写账页失败	
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	
9999	其它错误	

## 6 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，可通过电子邮件或服务电话进行反馈。

电子邮件：tech\_support@sse.com.cn

服务电话：4008888400-2

网站地址：<https://www.sse.com.cn/> - 交易技术支持专区

通讯地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号 上交所技术公司技术开发总部

## 7 附录

### 7.1 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;
}
```

## 7.2 申报确认接口 remark 字段取值说明

详见《IS111 上海证券交易所报盘软件错误代码表》。

## 7.3 交易单元说明

本文提到的“交易单元”、“席位号”、“PBU”为同一含义，在相关业务数据接口文件中，均表示业务归属单元（通常为账户的指定 PBU 或指定 PBU 同一联通圈内的 PBU）。

若盘中调整指定关系，对于通过竞价撮合平台申报的所有业务，均实时生效。

## 历史修订记录

### 《市场参与者接口规格说明书》1.64 版发布说明

2023 年 4 月进行了修订，主要有：

- 1、修订申报接口 `ordwth` 中“Price”字段的填写说明；
- 2、修订产品基础信息第二版第一批次文件接口 `cpxx0201MMDD.txt`：调整“涨跌幅限制类型”字段及涨跌幅相关字段的描述说明；
- 3、修订交易公开信息公告文件 `jygkxxMMDD.txt` 和科创板交易公开信息公告文件 `jygkxx02MMDD.txt` 的相关描述说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.63 版发布说明

2023 年 3 月进行了修订，主要有：

- 1、修订申报接口 `ordwth` 中非交易发行业务的填写说明；
- 2、修订产品基础信息第二版第一批次文件接口 `cpxx0201MMDD.txt`：调整“产品状态标志”字段第 8 位和第 9 位的适用范围，并启用第 11 位表示“注册制股票（含存托凭证）”的标签位。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.62 版发布说明

2022 年 11 月进行了修订，主要有：

- 1、修订产品基础信息文件 `cpxx0201MMDD.txt`，变更 ETF 细分类型 F131 含义为“跨境 ETF”，取消 F132、F133 分类。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.61 版发布说明

2022 年 10 月进行了修订，主要有：

- 1、根据指定交易迁移计划，指定登记和指定撤销业务迁移至综合业务平台进行申报（对应业务的盘后过户数据仍记录在 `ghXXXXX.dbf` 中）：删除申报接口 `ordwth` 中相关描述；删除 `fjyYYYYMMDD.txt` 中指定登记和指定撤销的非交易记录；`cpxx0201.txt` 中增加指定登记和指定撤销（子类型为 CMD）的产品记录。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.60 版发布说明

2022 年 8 月进行了修订，主要有：

- 1、修订产品基础信息文件 `cpxx0201MMDD.txt`，更新除权比例字段的相关描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.59 版发布说明

2022 年 6 月进行了修订，主要有：

- 1、根据可转债交易机制调整业务的需求，修订产品基础信息文件 cpxx0201MMDD.txt，调整涨跌幅限制类型的相关描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.58 版发布说明

2022 年 5 月进行了修订，主要有：

- 1、根据多码合一业务需求，调整申报接口和成交回报接口，删除 ETF 申赎相关说明。
- 2、删除过户数据接口 ghXXXXX.dbf 中关于 ETF 申赎过户记录的相关说明。
- 3、调整产品非交易基础信息接口 fjyMMDD.txt 和 fjyYYYYMMDD.txt，删除 ETF 申赎和申赎资金代码相关说明。
- 4、删除 ETF 公告文件 1.0 版本格式和 ETF 公告文件 2.1 版格式的相关说明。
- 5、修订产品基础信息文件，增加 ETF 产品细分类别标识。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.57 版发布说明

2022 年 3 月进行了修订，主要有：

- 1、根据 ETF 份额拆分业务的需求，修订产品基础信息文件，更新除权比例字段的描述说明。
- 2、补充“指定关系”调整生效时间说明。
- 3、删除债券信息公告文件 biYYMMDD.txt。
- 4、根据单向卫星应用系统下线计划，调整相关接口描述。
- 5、行情接口 mktdt00.txt 中“市场行情状态”字段：调整“上海市场”与“全市场”的产品范围描述，移除第 5 位债券质押回购行情结束标志相关描述。
- 6、调整债券相关数量单位为千元面额。
- 7、删除产品基础信息第一版第一批次文件接口 cpxxMMDD.txt、产品基础信息第一版第二批次文件接口 cpxx0102MMDD.txt，调整产品基础信息第二版第一批次文件接口 cpxx0201MMDD.txt 的相关描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.56 版发布说明

2021 年 12 月进行了修订，主要有：

- 1、补充“证券账户资料接口”、“席位联通接口”的描述说明。
- 2、补充“交易单元”的相关说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.55 版发布说明

2021 年 11 月进行了修订，主要有：

- 1、配合新债券交易系统上线，调整行情接口中债券相关的行情数据说明。
- 2、配合新债券交易系统上线，调整债券产品子类型业务分类含义。新债券交易系统上线后，企业债为“CPF”(存量企业债中部分延用“CBF”)，政府支持债为“GBF”(存量政府支持债中部分延用“CPF”)。
- 3、删除债券非交易业务(转股、换股、回售、质押式回购出入库)相关的申报接口、过户数据和非交易基础信息。删除债券现券交易和债券质押式回购交易相关接口说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.54 版发布说明

2021 年 8 月进行了修订，主要有：

- 1、根据退市新规，修订产品基础信息文件，调整产品涨跌幅说明。
- 2、修订产品基础信息文件，增加产品当日回转交易标识。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.53 版发布说明

2021 年 6 月进行了修订，主要有：

- 1、根据科创板相关 ETF 需求，修订产品基础信息文件，调整备注字段中产品细分类别的相关说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.52 版发布说明

2021 年 03 月进行了修订，主要有：

- 1、配合非交易迁移需求，修订产品基础信息文件，在基础证券代码中增加可交换债相关说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.51 版发布说明

2021 年 02 月进行了修订，主要有：

- 1、配合公募 REITs 业务需求，修订产品基础信息文件，增加相关证券类别。
- 2、补充 CPXX 备注字段关于股票产品流通总量信息的说明。
- 3、配合科创板可转债业务需求，修订产品基础信息文件，增加科创板可转债产品细分类别属性信息。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.50 版发布说明

2021 年 1 月进行了修订，主要有：

- 1、修订产品基础信息文件，调整定向可转债相关描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.49 版发布说明

2020 年 10 月进行了修订，主要有：

- 1、配合定向可转债业务需求，修订产品基础信息文件，增加相关证券子类别。



## 《市场参与者接口规格说明书》1.48 版发布说明

2020 年 9 月进行了修订，主要有：

- 1、配合科创板 ETF 和科创板相关 LOF 业务需求，修订产品基础信息文件说明，在备注中增加产品细分类别和盘后固定价格交易标志，增加 cpxx0201MMDD.txt 的数据说明。
- 2、配合科创板配售方式减持业务需求，修订申报接口 ordwth、成交回报接口 cjhb、盘后过户数据接口 ghXXXXX.dbf 和产品非交易基础信息接口 fjyMMDD.txt/fjyYYYYMMDD.txt，增加了对配售业务的描述。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.47 版发布说明

2020 年 5 月进行了修订，主要有：

- 1、配合科创板减持业务需求，修订减持控制数据接口 jckzXXXXX.txt，修改\*关于会员柜台系统前端控制的说明，增加盘后固定价格交易卖出的委托类型。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.46 版发布说明

2020 年 1 月进行了修订，主要有：

- 1、配合跨沪深港 ETF 业务需求，新增 ETF 公告文件 2.1 版。ETF 公告文件 2.1 版在 1.0 版的基础上调整了部分字段：1) 成分证券代码长度由 8 扩充为 20；2) 原“溢价比例”字段分列为“申购溢价比例”和“赎回折价比例”两个字段 3) 现金替代标志增加值“7”和“8”表示港市资金替代；4) 预留部分字段。
- 2、配合跨沪深港 ETF 业务需求，成交回报接口新增港市资金的成交记录。
- 3、因产品基础信息文件中实际不包括证券子类别为“FBL”的数据，因此删除证券子类别字段中的描述“FBL 跨市场/跨境资金”。
- 4、配合跨沪深港 ETF 业务需求，增加港市资金代码。由于深市资金代码已存在，为揭示并区分深市和港市资金代码，在产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt 的字段“非交易业务类型”中增加描述“EX 非沪市资金申赎代码”，启用“备注”字段前两个字符区分资金代码代表的市场，“SZ”表示深圳市场，“HK”表示香港市场。修改字段“非交易业务类型”中描述“EZ 资金申赎代码”为“EZ 沪市资金申赎代码”。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.45 版发布说明

2019 年 8 月进行了修订，主要有：

- 1、因大股东减持，修改减持控制数据接口说明。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.44 版发布说明

2019 年 7 月进行了修订，主要有：

1、新增接口文件已开通科创板交易权限账户资产信息接口(kcbzhzcxxXXXXX001YYYYMMDD.txt), 用于会员报送已开通科创板交易权限账户资产信息数据。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.43 版发布说明

2019 年 6 月进行了修订, 主要有:

1、调整产品基础信息 cpxx0201MMDD.txt 文件接口中“中文证券名称(长)”字段的描述说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.42 版发布说明

2019 年 5 月进行了修订, 主要有:

- 1、增加了产品基础信息 cpxx0102MMDD.txt、cpxx0201MMDD.txt、cpxx0202MMDD.txt 文件接口。cpxx0201MMDD.txt 文件在 cpxxMMDD.txt 基础上调整了相关字段描述, 新增证券子类别取值“KSH”, 启用“产品状态标志”字段第 5 位、第 8 位、第 9 位分别标识“存托凭证”、“上市未盈利”和“具有表决权差异安排”信息, 新增“市价申报数量下限”、“市价申报数量上限”、“中文证券名称(长)”字段, 扩展了备用字段长度;
- 2、申报接口 ordwth 中“owflag”字段第 1 位, 新增订单类型取值“B”、“C”; 调整“price”字段的填写规则说明;
- 3、调整证券权益接口 zqyXXXXX.dbf 的字段和相关说明;
- 4、新增科创板交易公开信息公告文件 jygx02MMDD.txt 接口, 该文件用于存放科创板股票的交易公开信息数据。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.41 版发布说明

2019 年 1 月进行了修订, 主要有:

- 1、根据市场反馈, 为了与其他接口描述方式保持一致, 对 cpxxMMDD.txt 的“产品状态标志”描述进行调整, 由从“第 0 位”开始改为从“第 1 位”开始, 实际位置不变;
- 2、修订了 cpxxMMDD.txt 文件中“产品状态标志”字段, 新增闭市信息标志位;
- 3、修订了 mktdt00.txt 文件中“市场行情状态”字段, 新增债券质押回购结束标志。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.40 版发布说明

2018 年 9 月进行了修订, 主要有:

- 1、产品基础信息文件中证券子类别字段新增密码服务产品的子类别说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.39 版发布说明

2018 年 7 月进行了修订, 主要有:

- 1、行情接口文件 mktdt00.txt 中 TradingPhaseCode 字段: 新增收盘集合竞价时段‘U’取值; 删除休市竞价撮合平台

时段‘B’、开盘集合竞价阶段结束到连续竞价阶段开始之前的时段‘D’状态取值，由连续交易时段取值‘T’替代。

2、行情数据库 STEP 接口中 TradingPhaseCode 字段：新增收盘集合竞价时段‘U’取值；删除休市时段‘B’、开盘集合竞价阶段结束到连续竞价阶段开始之前的时段‘D’状态取值，由连续交易时段取值‘T’替代。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.38 版发布说明

2018 年 5 月进行了修订，主要有：

- 1、产品基础信息文件中证券子类别字段新增控制指令的子类别说明。
- 2、移除过时的网络投票接口，移除 show2003 接口，修订目录格式。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.37 版发布说明

2017 年 7 月进行了修订，主要有：

- 1、新增减持控制数据接口、示例及前端控制说明。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.36 版发布说明

2017 年 7 月进行了修订，主要有：

- 1、修订 FJYYYYMMDD 文件发行方式字段描述。
- 2、修订 IPOGH 文件部分字段描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.35 版发布说明

2017 年 4 月进行了修订，主要有：

- 1、产品基础信息文件接口 cpxxMMDD.txt，更新“产品状态标志”字段相应描述。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.34 版发布说明

2016 年 1 月进行了修订，主要有：

- 1、产品非交易集成信息接口 fjyYYYYMMDD 中，增加“发行方式”字段，并更新相应描述。
- 2、调整行情接口 mkttdt00.txt 中相关字段取值，增加上海市场行情结束标记。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.33 版发布说明

2015 年 12 月进行了修订，主要有：

- 1、新增新股发行过户数据 ipoghXXXXX.txt 接口，并更新相应代码段描述。
- 2、调整行情接口 mkttdt00.txt 中 TradingPhaseCode 字段第 1 位取值，及第 2 位含义。

需要说明，此次接口更新于 2016 年 1 月 1 日正式生效。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.32 版发布说明

2015 年 10 月进行了修订，主要有：

- 1、行情接口 mkttdt00.txt 中，当行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号取值为 MD002、MD003、MD004 时，增加了 TradingPhaseCode（行情实时阶段及标志）的熔断相关类型。
- 2、4.1 节中“上市公司公告文件”中序列号由原先的 3 位 NNN 扩展至 4 位 NNNN。正式启用时间以交易所通知为准。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.31 版发布说明

2015 年 7 月进行了修订，主要有：

- 1、cpxxMMDD.txt 中产品状态标志字段，第 4 位原定义为对应：‘S’表示债券风险警示类。因本所不再实施债券风险警示制度，本次正式改为第 4 位不启用。
- 2、可交换公司债换股参考可转债转股实现，在本文档中已有的可转债转股描述处进行扩展以纳入支持可交换公司债换股的文字描述。可交换公司债换股的业务放开时间具体以交易所通知为准。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.30 版发布说明

2015 年 4 月进行了修订，主要有：

- 1、正式发布产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt

### 《市场参与者接口规格说明书》1.29 版发布说明

2015 年 1 月进行了修订，主要有：

- 1、kxxMMDD.txt 中基金状态 FundStatus 修改值为“0”和“4”时的含义描述。
- 2、修订了 5.5.3 返回代码表。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.28 版发布说明

2015 年 1 月进行了修订，主要有：

- 1、cpxxMMDD.txt 中产品状态标志字段，第 4 位现定义为对应：‘S’表示债券风险警示类。未来改为不启用，此改动暂未实施，具体以交易所通知为准。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.27 版发布说明

2014 年 9 月初进行了修订，主要有：

- 1、增加竞价撮合平台行情接口 mkttdt00.txt，即合并文档《上海证券交易所 EzSR 竞价撮合平台行情

mktdt00 文件接口(预发布稿)\_20140916》。增加基于数据库的 STEP 行情接口。

2、cpxxMMDD.txt 除市场外，有其他单位部分使用，特此说明。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.26 版发布说明

2014 年 6 月初进行了修订，主要有：

- 1、修订并完善产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，增加债券风险警示和债券市场投资者适当性要求标识。
- 2、修订申报接口，增加信用账户支持发行类功能说明。
- 3、针对港交所申报，修订沪股通投票分段规则。

中间开发版本 1.25 版的变更，主要有：

2014 年 5 月初进行了修订，主要有：

- 1、针对港交所申报，增加沪股通投票业务。

2014 年 1 月初进行了修订，主要有：

- 1、修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，增加无任何价格涨跌幅控制类型取值。
- 2、修订本文中对交易规则的章节号引用，增加交易规则版本描述。
- 3、补充说明基金公司 zqy 压缩打包方式。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.24 版发布说明

2013 年 12 月中旬进行了修订，主要有：

- 1、配合优先股业务，修改盘后过户文件中关于发行日的描述，优先股其他变更参见 1.23 版第 2 条修订。
- 2、增加转发指数公司的质押式报价回购质押券折算率（值）文件接口。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.23 版发布说明

2013 年 12 月进行了修订，主要有：

- 1、补充说明实时成交回报和盘后过户接口中成交金额字段溢出处理。
- 2、修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，增加优先股产品类型和板块类型取值。
- 3、修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口说明，补充说明包含停牌产品。

中间开发版本 1.22 版的变更，2013 年 10 月进行了修订，主要有：

- 1、修订证券权益接口 zqyXXXXX.dbf，启用该接口，并删除、修改相关字段。
- 2、修订过户库接口市值配售发行(更改为按市值资金申购)、资金申购发行记录定义，扣款、还款记录支持通过成交时间 cjsj 字段扩位。
- 3、补充数据格式约定中数值溢出时处理方式。补充描述产品信息面值字段。

中间开发版本 1.21 版的变更，2013 年 10 月中旬进行了修订，主要有：

- 1、修订产品信息（cpxxMMDD.txt）接口，新增 IPO 上市首日的涨跌幅控制类型，并描述具体的上下限价格字段取值。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.20 版发布说明

2013 年 9 月进行了修订，主要有：

- 1、因变更未部署，暂不实施关于新股发行过户库接口的修订（即修订 2、3），并做修订回退。

2013 年 8 月进行了修订，主要有：

- 1、过户数据接口中，在新股发行时，扣款还款记录 cjbh 字段，新增与成交时间字段组合规则，从而扩展编号范围（注：本修订取消）。
- 2、过户数据接口中，在新股发行时（具体新规则待正式发布），配号记录由原来的 1 条变更为 1~2 条，区分账户配号记录和申购量配号记录。不分配配号或无配号的，不生成配号记录（注：本修订取消）。
- 3、补充产品信息涨跌幅限制类型取值。

中间开发版本 1.19 版的变更，2013 年 7 月进行了修订，主要有：

- 1、产品基础信息接口 cpxxMMDD.txt，新增 LOF 产品子类型，梳理删除无效的产品子类型。

2013 年 6 月进行了修订，主要有：

- 1、修订产品基础信息接口 cpxxMMDD.txt，增加发布国债预发行业务保证金比例、基准价格、参考久期、最后交易日、招标方式信息。其中使用了部分预留字段和备注字段。
- 2、修订产品基础信息接口 cpxxMMDD.txt，增加国债预发行业务当期发行量，补充相关说明。
- 3、调整 CPXX 中关于国债预发行招标方式到备注字段，调整最后交易日字段数据类型为字符型，长度不变。

中间开发版本 1.18 版的变更，2013 年 4 月进行了修订，主要有：

- 1、修订产品基础信息接口 cpxxMMDD.txt，增加集合资产管理计划产品相关字段描述。

中间开发版本 1.17 版的变更：

- 1、修订产品基础信息接口 cpxxMMDD.txt，增加退市转让版标识，增加集合资产管理计划产品子类型取值。

## 《市场参与者接口规格说明书》1.16 版发布说明

2013 年 2 月进行了修订，主要有：

- 1、修订产品基础信息接口 cpxxMMDD.txt，启用预留字段发布债券面值，长度不变支持小数。
- 2、其他关于面值的文字描述。

中间开发版本 1.15 版的变更：



- 1、修订转发中登的折算率接口，配合债券 ETF 回购，修订标准券折算率变更接口和标准券折算比率接口。
- 2、修订 ETF 公告文件修改描述股票为证券。
- 3、因国债预发行变更为在综业实现，国债预发行相关需求回退。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.14 版发布说明

2012 年 10 月进行了修订，主要有：

- 1、增加 13456 错误代码定义。
- 2、补充 cjhb 表 ETF 申赎现金替代金额计算方法，补充说明跨境 ETF 申赎业务通过综合业务平台实现。
- 3、补充说明货币市场基金（即“汇添富收益快线”模式）认购及申赎业务实现平台，货币市场基金产品行情中发布每百万元收益，补充产品信息中货币市场基金收盘价格字段描述。
- 4、补充 603 代码段辅助代码对应信息。
- 5、增加 cpxx 关于风险警示板产品的标识，并发布 cpxx。

### 《市场参与者接口规格说明书》1.13 版发布说明

2011 年 10 月进行了修订，并用红字标明，主要有：

- 1、更改文档名称为《IS101 上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》（原档名：《SSE301 上海证券交易所新一代交易系统市场参与者接口规格说明书》），本文档主要描述本所竞价撮合平台接口规格及其他平台公共接口规格。
- 2、修定了 ETF1.0 公告文件内容，完善标识头说明，补充跨境跨市场 ETF 公告文件替代类型取值扩展，删除实时成交回报接口关于跨境 ETF 申赎的成交回报描述，修订跨市场 ETF 成交回报描述，明确成交回报非沪市资金记录为 1-2 条（原为 0-2 条）。
- 3、ETF 公告文件 2.0 版暂不启用，为避免混淆暂删除此文件接口定义。
- 4、修正行情接口中 IOPV 描述，S3 为 T-1 日“上海市场收盘时刻”该 ETF 的 IOPV。
- 5、修改过户数据 ghXXXXX.dbf 转债转股记录说明，交易所不再向券商发送转股数据，转股数据以登记公司的相关数据为准（供参考，暂未实施，具体以交易所通知为准）。
- 6、增加产品基础信息接口，增加新非交易信息接口，现有的非交易信息文件（fjyMMDD.txt）将逐步停止发布（供参考，暂未对市场发送，具体以交易所通知为准）。

### 《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：

- 1、增补错误代码 13458 的描述。

- 2、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。
- 3、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。

### 《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：

- 1、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。
- 2、将 STEP 部分暂时移出进行整体修订。

包括如下接口变动内容：

- 1、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。
- 2、增加错误代码 1102，表示营业部代码字段格式错误。
- 3、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：

- 1、增加了沪深 300 ETF 申购和赎回时成交回报的说明。
- 2、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。
- 3、修订错误代码 10932 的描述。
- 4、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上证发字[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 `cjje` 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、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表记录和申报确认表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，市场参与人启用备份数据库，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，市场参与人启用备份数据库，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 `GHXXXXXX` 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 `GHXXXXXX` 文件填写空格。`beye` 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 `beye` 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 `GHXXXXXX` 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*成交数量 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 `cjsl*10`。

zzhXXXXX.dbf 分别压缩为 zxwXXXXX.zip 和 zzhXXXXX.zip。kghXXXXX.txt 和 khlXXXXX.txt 分别压缩为 kghXXXXX.zip 和 khlXXXXX.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。