

上海证券交易所技术文档



**IS118 上海证券交易所特定参与者
接口规格说明书（转发卷）
1.4 版**



上海证券交易所
二〇二四年八月

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.4版 发布说明

2024年8月修订内容：

下线产品非交易基础数据报表 fyyMMDD.txt 接口。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.3版 发布说明

2024年3月修订内容：

根据 UT 下线第二阶段安排，下线深交所 V5 行情转发功能。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.2版 发布说明

2023年10月修订内容：

- 1、 根据 UT 下线第一阶段安排，下线深交所静态文件转发功能；
- 2、 删除已下线的债券估值文件相关描述。
- 3、 根据 ETF 定义文件 2.0 版下线安排，删除 ETF 公告文件 1.0 版相关描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.1版 发布说明

2022年7月修订内容：

- 1、 配合 BT 下线，去除 BT 相关描述；
- 2、 根据目前 UT 发送内容进行修订。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）》1.0版 发布说明

2016年9月修订内容：

- 1、 新建文档 IS118 上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）

2016年10月形成正式版本。

目录

1	简介	1
1.1	本文的目的	1
1.2	概要	1
2	接口信息流	2
2.1	上海市场	2
2.1.1	基于文件的接口	2
3	后记	6

1 简介

上海证券交易所特定参与者接口规格说明书含多卷。

本文为上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（转发卷）。

1.1 本文的目的

本文为用于描述向市场特定参与者转发行情等文件接口的功能和技术规格说明书。

本文包括以下部分：

第 1 部分：概述

即本节，这部分说明本文编写目的、概括介绍转发的数据接口类型。

第 2 部分：转发的文件数据接口

描述了行情类数据文件、公共类数据文件及私有数据文件结构及规格说明。

包括沪港通行行情数据文件接口等规范。

1.2 概要

本文用于描述本所转发（目前基于 UT 系统）文件和流式数据的接口规范。

UT（UniTransServer）业务分发平台系统是基于单向卫星链路的行情数据传输系统，支持多市场的数据转发，适配不同市场的协议实现数据的无缝对接。系统支持基于文件的接口方式和数据流的接口方式，文件类型分三种：行情类、公共文件类（文件公共广播）；私有文件类（文件点播）。

2 接口信息流

2.1 上海市场

2.1.1 基于文件的接口

本章节用于描述 UT 系统转发上交所的基于文件接口的技术规格说明。

UT 系统相关接口读取的数据文件的来源有以下三种：上证所内各系统经卫星向市场发出的文件；交易系统发送至 UT 系统及自身业务处理的文件；新一代交易系统转发其他系统(信息公司)经由卫星发出的文件。

文件类型分三种（成交回报为私有消息，不属文件分类）：行情类、公共文件类（文件公共广播）、私有文件类（文件点播）。

文件名（中文）	文件名	参见接口
行情类文件		
竞价撮合平台行情文件	mktdt00.txt	IS101
综合业务平台行情文件	mktdt01.txt	IS105
债券行情文件	mktdt02.txt	IS124
期权行情文件	mktdt03.txt	IS113
港股通行情文件	mktdt04.txt	IS117
港股通交易盘实时状态	trdses04.txt	IS117
指数通行情文件	csiYYYYMMDD.txt	中证指数接口
基金通行情文件	mktdt06.txt	IS124
B 转 H 行情文件	mktdth.txt	IS124
公共文件类		
交易公开信息公告文件	jygekxMMDD.txt	IS101
司法执行公告文件	sf*****.pdf	-
科创板交易公开信息公告文件	jygekx02MMDD.txt	IS101
债券标准券折算率变更接口	zslMMDD.txt	IS101
债券标准券折算率变更公告文件	zslwMMDD.txt	IS101
基金和净值数据文件	kxxMMDD.txt	IS101

权证信息接口	qzxxMMDD.txt	IS101
债券标准券折算比率接口	xzslMMDD.txt	IS101
盘中停牌公告文件	tpxxxxhhmms.txt	IS101
国债利息接口	gzlx.MDD	IS101
产品非交易基础数据报表	fjyMMDD.txt	IS101
产品非交易基础数据	fjyYYYYMMDD.txt	IS101
担保品及标的证券清单公告	dbpMMDD.txt	IS101
紧急通知文件	*.*	IS101
公告摘要文件	MMDDFNNN.txt MMDDZNNN.txt	IS101
产品基础信息文件第二版第一批次	cpxx0201MMDD.txt	IS101
产品基础信息文件第二版第二批次	cpxx0202MMDD.txt	IS101
基金业务参数公告文件	sfpm01MMDD.txt	IS105
债券非交易基础信息文件	zfjyYYYYMMDD.xml	IS105
基金非交易基础信息文件	jfjyYYYYMMDD.xml	IS105
转融通标的证券清单	zrtbdMMDD.txt	IS105
债券报价式回购折算率文件	bzsl01MMDD.txt	IS105
网络投票议案结构文件	vtlsMMDD.xml	IS105
报价收盘文件	bjspMMDD.txt	IS109
成交明细文件	bjmxMMDD.txt	IS109 IS118（托管银行卷）
报价全部文件	bjqbMMDD.txt	IS109
期权基础信息文件	reff03MMDD.txt	IS113
期权基础信息文件	reff0302YYYYMMDD.xml	IS113
期权收盘价格文件	clpr03MMDD.txt	IS113
期权组合策略文件	zhcl03MMDD.txt	IS113
港股基础信息	reff04MMDD.txt	IS117
港股通参考汇率文件	extra04MMDD.txt	IS117
港股最小价差文件	zxjcMMDD.txt	IS117

ETF 公告文件 2.1 版格式	*****MMDD2.etf	IS118 (基金公司卷)
债券盘中停牌公告文件	ztxxxhhmss.txt	IS124
国际化产品信息接口	ifjyYYYYMMDD.xml	IS124
重点指数及样本表现	zsbxYYMMDD.txt	IS124
债券产品信息 (压缩包)	archive_bondinfoYYYYMMDD.zip	IS124
交易参与人清单	se015jycyrYYYYMMDD001.txt	LDDS 系统静态数据接口
交易员清单	se015jyyYYYYMMDD001.txt	LDDS 系统静态数据接口
私有文件类		
过户数据接口	ghXXXXXX.zip	IS101
开放式基金分红数据接口	khlXXXXXX.zip	IS101
开放式基金账户对账数据接口	kyeXXXXXX.zip	IS101
开放式基金交易确认接口	kghXXXXXX.zip	IS101
证券账户资料接口	zzhXXXXXX.zip(月中数据)	IS101
席位联通接口	zxwXXXXXX.zip(月中数据)	IS101
新股发行过户数据接口	ipoghXXXXXX.zip	IS101
减持控制数据接口	jckzXXXXXX.zip	IS101
过户数据接口	dghXXXXXX.zip	IS105
基金过户数据接口	jjghXXXXXX.zip	IS105
过户数据接口 ¹	oghXXXXXX.zip	IS113
债券过户数据文件	zqghXXXXXX.zip	IS124
国际化产品过户数据文件	ighXXXXXX.zip	IS124
过户数据接口	hghXXXXXX.zip	IS117
托管银行和基金公司数据文件	XXXX.sse	IS118 (基金公司卷) IS118 (托管银行卷)

参见接口：

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

¹ 上交所向市场发送的 oghXXXXXX.zip 文件中包含 trns03XXXXXX.txt、hold03xxxxx.txt、qtyw03XXXXXX.txt 三个文件，具体文件接口定义参照 IS113_上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书。

IS105_上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书

IS109_上海证券交易所固定收益平台外部数据接口规范

IS113_上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书

IS117_上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书

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）

IS118_上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）

IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书

上海证券交易所 LDDS 系统静态数据接口说明书

中证指数行情传输接口规范

3 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：400888400-2

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