



特定参与者接口规格说明书  
(托管银行卷)

1.36 版



上海证券交易所  
二〇二六年一月

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.36 版发布说明：

2026 年 1 月：

1. 托管银行私有数据接口 YYYY.sse 新增新竞价过户数据文件（gh00PXXXXXX.txt）、新竞价发行过户数据文件（ipogh00PXXXXXX.txt）、指定过户数据文件（zdgh00PXXXXXX.txt），取消席位成交（ghXXXXXX.dbf）文件。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.35 版发布说明：

2025 年 11 月：

2. 基于《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》文档正式废止，相关内容迁移至《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》，更新相关引用描述。
3. 卫星发送盘后数据功能下线，调整相关描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.34 版发布说明：

2022 年 3 月 18 日：

- 1、固收平台成交数据、成交明细行情中增加竞买、合并申报业务相关描述。
- 2、指定对手方更名为协商成交。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.33 版发布说明：

2021 年 9 月 22 日：

- 1、固收平台成交明细行情说明中删除“不包含私募债券成交数据”。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.32 版发布说明：

2021 年 5 月，非交易改造相关内容修订。

- 1、盘后数据文件补充基金过户（JJGH）、债券过户（ZQGH）、综合业务过户（BGH）数据说明。
- 2、调整成交数据文件中关于非交易代码的描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.31 版发布说明：

2021 年 3 月，成交明细行情文件格式中成交方式中删除“5:”（仅为文档更正，不涉及程序变更）。

2021 年 3 月，确定报价行情文件格式说明中删除“不包含特定债券确定报价行情”。

2021 年 2 月，成交数据文件格式说明中删除“不包含私募债券成交数据”（仅为文档更正，不涉及程序

变更)。

2021年1月，增加公募REITs产品相关说明。文中所述“基金”包含公募REITs。

2020年12月，创新创业债更名为双非可转债。

2019年2月，增加债券回售撤销业务。2018年9月，增加特定债券转让业务。

2018年4月，三方面回购业务上线，该部分接口规范正式启用。

2018年1月，增加双非可转债转股业务。

2017年11月，增加三方回购业务，该业务尚未上线，相关接口规范为预发布版。

2016年8月，增加非公开公司债券回售相关内容；固定收益平台关于非公开公司债券回售业务尚未上线，相关接口规范为预发布版。2016年11月，回售业务上线，该部分接口规范正式启用。

2016年7月，增加非公开可交换债券换股业务相关内容。固定收益平台非公开可交换债换股业务已于2016年1月上线，于2016年7月完成首单换股业务。该部分接口规范正式启用。

2016年6月创建：

1、IS110固定收益平台托管银行数据接口规范废止，相关内容整合至本文档。

2、IS104托管银行(含基金公司)系统接口规范的托管银行部分章节整合至本文档。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：4008888400-2

通信地址：上海市浦东东南路528号上交所技术公司技术开发总部

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> — 服务 — 交易技术支持专区

# 目录

<b>1 概述 .....</b>	<b>1</b>
1.1 本文编写目的 .....	1
<b>2 托管银行私有数据接口 .....</b>	<b>2</b>
2.1 文件结构 .....	2
2.2 数据流图 .....	2
2.3 固定收益平台数据接口（私有） .....	3
2.3.1 成交数据文件接口规范 .....	3
2.4 竞价撮合平台数据接口 .....	8
2.5 综合业务平台数据接口 .....	8
2.6 托管银行数据文件解密工具 .....	9
2.6.1 数据文件解密工具功能 .....	9
2.6.2 解密使用示例 .....	9
2.6.3 重要提示（FAQ） .....	10
<b>3 托管银行公共数据接口 .....</b>	<b>11</b>
3.1 固定收益平台数据接口（公共） .....	11
3.1.1 数据流图 .....	11
3.1.2 收盘价文件接口规范 .....	11
3.1.3 成交明细行情文件接口规范 .....	12
3.1.4 确定报价行情文件接口规范 .....	14
<b>4 后记 .....</b>	<b>16</b>

# 1 概述

本文为上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）。

## 1.1 本文编写目的

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。

第 2 部分：托管银行私有数据接口

概述了托管银行私有数据文件结构及数据流图。

包括固定收益平台成交数据文件接口等规范。

同时介绍了托管银行数据文件解密工具的功能及使用方法。

第 3 部分：托管银行公共数据接口

包括固定收益平台数据接口（含收盘价文件接口、成交明细行情文件接口、确定报价行情文件接口）等规范。概述了其文件结构及数据流图。

## 2 托管银行私有数据接口

### 2.1 文件结构

文件名：YYYY.sse。其中 YYYY 为托管银行英文简称，长度为 4 位；

功能描述：新交易将需要发给托管银行的 PBU 过户数据、固定收益平台成交数据文件、大宗交易过户数据、综合业务过户数据、ZQY 数据、IPOGH 数据、ZQGH 数据、JJGH 数据、新竞价过户数据文件、新竞价发行过户数据文件、指定过户数据文件，按照要发往的银行分别压缩打包并加密，再按需要根据托管银行配置文件向市场发送。

时间和频率：每个交易日 15:00 之后。

数据格式：

1) 新一代交易系统根据配置文件，将托管银行对应的席位成交(~~ghXXXXXX.dbf~~)文件、大宗交易过户数据文件(dghXXXXXXXXYYYYMMDD.dbf)、综合业务过户数据(bghXXXXXX.dbf)、固定收益平台成交文件(bjYYYY.dbf)、ZQY 数据(zqyXXXXXX.dbf)、IPOGH 数据(IPOGHXXXXXX.txt)、ZQGH 数据(ZQGHXXXXXX.txt)、JJGH 数据(JJGHXXXXXX.txt)、新竞价过户数据文件(gh00PXXXXXX.txt)、新竞价发行过户数据文件(ipogh00PXXXXXX.txt)、指定过户数据文件(zdgh00PXXXXXX.txt)一起使用 zip 压缩，形成 YYYY.gz 文件。这里 XXXXX 为 PBU 号，YYYY 为托管银行简称。托管银行简称统一为 4 位；

2) 新一代交易系统调用 encryptfile 工具，对前面生成的 YYYY.gz 文件加密为 YYYY.sse。此文件发送托管银行；

3) ~~席位成交(ghXXXXXX.dbf)文件~~、大宗交易过户数据文件(dghXXXXXXXXYYYYMMDD.dbf)、综合业务过户数据(bghXXXXXX.dbf)、固定收益平台成交文件、ZQY 数据(zqyXXXXXX.dbf)、IPOGH 数据(IPOGHXXXXXX.txt)、ZQGH 数据(ZQGHXXXXXX.txt)、JJGH 数据(JJGHXXXXXX.txt)、新竞价过户数据文件(gh00PXXXXXX.txt)、新竞价发行过户数据文件(ipogh00PXXXXXX.txt)、指定过户数据文件(zdgh00PXXXXXX.txt)相关格式参见各相关系统接口文件。

处理：

托管银行收到盘后数据文件 YYYY.sse 后，首先运行 encryptfile 工具解密成.zip 文件：

```
encryptfile -d -p 12345678 -i YYYY.sse -o YYYY.zip
```

然后运行 unzip 解压缩软件解压缩。

### 2.2 数据流图

如图 1 所示，上海证券交易所通过证通云盘在盘后发送托管银行打包加密后的盘后数据。托管银行收到此文件后，运行上海证券交易所提供的解密程序，输入预设密码解密并解包出所需数据文件，进行后续处理。

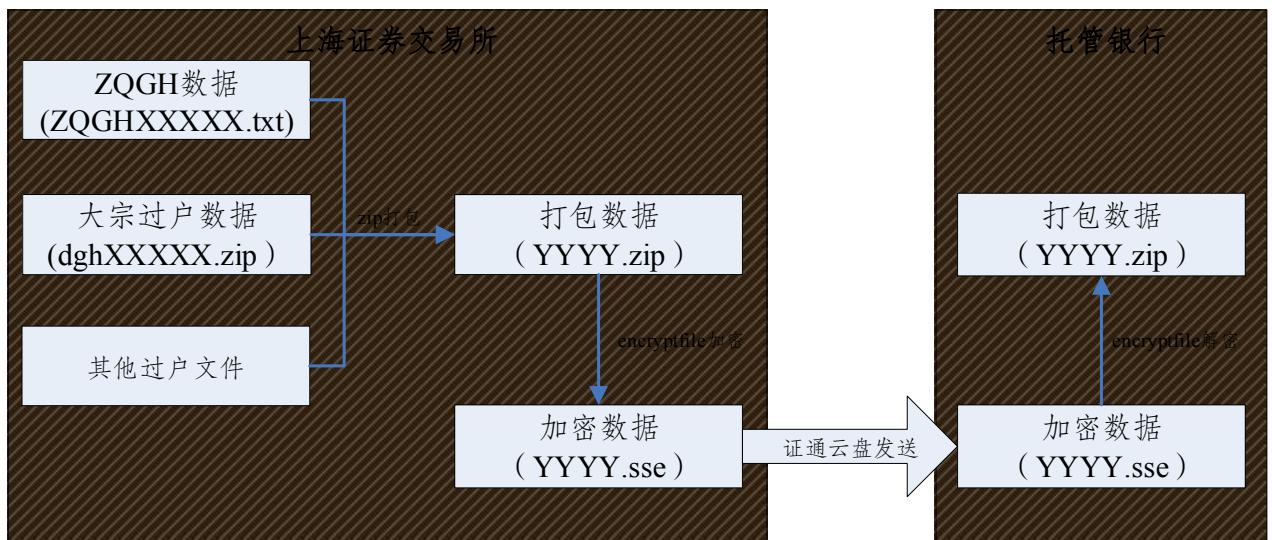


图 1 托管银行私有数据流图

## 2.3 固定收益平台数据接口（私有）

上证所固定收益证券综合电子平台（简称“固定收益平台”或“固收平台”）与托管银行之间私有数据接口规范包括以下几部分：

1. 成交数据文件接口规范（私有数据）

### 2.3.1 成交数据文件接口规范

#### 2.3.1.1 成交数据文件下载方式

提供给基金托管银行的成交数据，在每天闭市后，按不同的托管银行分别生成不同的文件 bjYYYY.dbf，该文件被打包进 YYYY.sse，通过证通云盘发送到托管银行。其中，YYYY 为托管银行简称。

#### 2.3.1.2 成交数据文件定义

成交数据文件名称为 bjYYYY.dbf，其中 YYYY 为托管银行的拼音首字母，例如：工商银行为 gsyh。

成交数据文件采用 dbf 格式，与上证所其它系统成交数据文件格式保持一致。该文件可使用 FoxPro、Access、Excel 等工具导入进行后续处理。

#### 2.3.1.3 成交数据文件格式

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
1	trade_no	成交编号	TEXT	10		
2	order_no	申报编号	TEXT	10		
3	trade_date	成交日期	TEXT	8		YYYYMMDD
4	order_time	申报时间	TEXT	6		HHMMSS
5	trade_time	成交时间	TEXT	6		HHMMSS
6	trader_id	交易员代码	TEXT	6		

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
7	proc	交易产品	TEXT	2		01: 场内现券 02: 协议交易 05: 隔夜回购 06: 转托管 08: 债券质押式协议回购 09: 可交换债换股 10: 债券回售、债券回售撤销 11: 三方回购 12: 双非可转债转股 99: 其它
8	account	本方股东账号	TEXT	10		
9	firm	本方交易席位号	TEXT	5		
10	stock_code	证券代码	TEXT	6		对债券质押式协议回购，为质押券现券代码；对可交换债换股，填现券代码；对债券回售、债券回售撤销填现券代码；对双非可转债转股填现券代码；对于三方回购转入、转出填现券代码；对三方回购其他业务填回购代码；
11	stock_name	证券信息	TEXT	30		交易类型为转托管时：证券简称(8位)+银行间托管账户(11位)； 对债券质押式协议回购： 证券简称(8位)+到期日(8位)+业务子类型(3位)+空格(1位)+券商报盘标记字段(10位) 其中业务子类型取值： '619': 债券质押式协议回购成交申报 '613': 债券质押式协议回购到期确认 '614': 债券质押式协议回购到期续做前期合约了结 '615': 债券质押式协议回购到期续做 '616': 债券质押式协议回购换券申报

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						<p>'617': 债券质押式协议回购提前终止          '618': 债券质押式协议回购解除质押          其它情况：证券简称(8位);          交易类型为可交换债换股时：证券简称(8位)+空格(5位)+换股状态(1位)+空格(16位); 交易类型为债券回售、债券回售撤销时：证券简称(8位)+空格(2位)+回售批次号(4位)+空格(16位); 交易类型为双非可转债转股时：证券简称(8位)+空格(5位)+转股状态(1位)+空格(16位);          对三方回购：          证券简称(8位, 转入, 转出填现券简称, 其他业务为空)+到期日(8位, 转入、转出填交易日, 三方回购其他类型填到期日)+业务子类型(3位)+空格(1位)+券商报盘标记字段(10位)          其中业务子类型取值：          '680':债券质押式三方回购回购交易          '681':债券质押式三方回购到期购回          '682':债券质押式三方回购到期续做合约新开          '683':债券质押式三方回购提前终止          '684':债券质押式三方回购转入申报          '685':债券质押式三方回购转出申报          '686':债券质押式三方回购换券申报          '687':债券质押式三方回购补券申报          '688':债券质押式三方回购解除质押          '689':债券质押式三方回购到期续做合约了结       </p>
12	dir	买卖方向	TEXT	1		B: 买入 S: 卖出

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						<p>对债券质押式协议回购，B 为正回购，S 为逆回购；对可交换债换股填 S；对债券回售填 S，对债券回售撤销填 B；对双非可转债转股冻结，填 S，对双非可转债转股解冻，填 B。</p> <p>三方回购转入专户填 B，普通账户填 S；对于三方回购转出专户填 S，普通账户填 B；对于三方回购其他业务，B 为正回购，S 为逆回购；</p>
13	net_price	成交净价价格	NUMBER	10	3	<p>单位：元</p> <p>对债券质押式协议回购，代表回购利率，精确到%小数点后 3 位，只填写%左边的数值，省略%，例如：现实中的 3.456%在此字段中填 3.456，右对齐左补空；对可交换债换股填换股价格；对债券回售填回售价格，对债券回售撤销无效；对双非可转债转股填转股价格；</p> <p>对于三方回购，代表回购利息，精确到%小数点后 3 位，只填写%左边的数值，省略%，例如：现实中的 3.456%在此字段中填 3.456，右对齐做补空；转入转出填 0</p>
14	vol	成交量	NUMBER	10	0	<p>单位：手</p> <p>对债券质押式协议回购，成交申报和换券申报时填写质押数量，到期确认、到期续做前期合约了结、到期续做合约新开、解除质押、提前终止时填 0，右对齐左补空</p> <p>三方回购业务转入转出、换券、补券填数量，其他填 0</p> <p>对基金单位为份</p>
15	intr	应计利息	NUMBER	10	4	<p>单位：元</p> <p>对债券质押式协议回购无效；对可交换债</p>

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对双非可转债转股无效；对三方回购、基金无效
16	full_price	成交全价价格	NUMBER	10	3	单位：元 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对双非可转债转股无效；对三方回购无效
17	face	券面总额	NUMBER	10	0	单位：万元 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对双非可转债转股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；
18	net_sum	成交净价金额	NUMBER	12	2	单位：万元 对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；双非可转债转股无效；对三方回购无效
19	full_sum	结算金额	NUMBER	12	2	单位：万元 对债券质押式协议回购填回购利息，单位为元；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对双非可转债转股无效；对三方回购填回购利息，单位为元
20	prof1	到期收益率	NUMBER	10	4	对债券质押式协议回购，为折算比例（百分比，精确到%小数点后2位），只填写%左边的数值，省略%，最右两位填00，例如：现实中的95.27%填写95.2700；对可交换债换股无效；对债券回售无效；对双非可转债转股无效；对三方回购回购交易，填写指定篮子编号 左对齐，1至8位有效，代表第1号至第8号篮子。例如指定1, 2, 5号篮子，左边8

序号	英文字段	中文说明	数据类型	长度	小数	单位/格式
						位填“11001000”，对于三方回购其他业务无效 对基金无效
21	mkt_quote	是否做市报价	TEXT	1		M: 做市报价 N: 非做市报价  对债券质押式协议回购无效；对可交换债换股无效；对债券回售、债券回售撤销无效；对双非可转债转股无效；对三方回购无效

说明：

- a. 在成交数据文件中，按照成交时间顺序排列各条成交记录。
- b. 在成交数据文件中，包含了由确定报价、待定报价、询价、场务应急录入、协议交易、协商成交、隔夜回购、转托管、债券质押式协议回购、可交换债换股、债券回售、双非可转债转股、三方回购、竞买、合并申报方式达成的成交。
- c. 换股状态取值：Y 表示当日可换股，N 表示当日不可换股；转股状态取值：Y 表当日可转股，N 表示当日不可转股。

## 2.4 竞价撮合平台数据接口

上证所竞价撮合平台与托管银行之间私有数据接口规范包括以下几部分：

### 1. 竞价过户数据接口(ghXXXXXX.dbf)

1. 新股发行过户数据接口(ipoghXXXXXX.txt)
2. 证券权益接口 (zqyXXXXXX.dbf)
3. 新竞价过户数据文件 (gh00PXXXXXX.txt)
4. 新竞价发行过户数据文件 (ipogh00PXXXXXX.txt)
5. 指定过户数据文件 (zdgh00PXXXXXX.txt)

以上接口详细规范可详见如下文档：

<https://www.sse.com.cn/services/tradingtech/home/>

IS124 上海证券交易所市场数据文件交换 接口规格说明书

## 2.5 综合业务平台数据接口

上证所综合业务平台与托管银行之间私有数据接口规范包括以下几部分：

1. 过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf
2. 过户数据接口 bghXXXXX.dbf

3. ZQGH 数据 ZQGHXXXXX.txt

4. JJGH 数据 JJGHXXXXX.txt

以上接口详细规范可详见如下文档：

<https://www.sse.com.cn/services/tradingtech/home/>

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

## 2.6 托管银行数据文件解密工具

### 2.6.1 数据文件解密工具功能

操作系统	客户端解密工具：兼容 Windows95/98/2000/xp 操作系统																									
界面形式	命令行界面																									
参数输入形式	所有参数作为开关与主命令共同一次输入																									
信息输出形式	屏幕输出，错误能够反馈给批处理调用。																									
功能开关设置	<p>命令格式：</p> <p>encryptfile [SW] [INFO] [SW] [INFO] ... -i srcFileName -o destFileName</p> <p>SW:开关 INFO:信息 srcFileName:源文件 destFileName:目的文件</p> <table border="1"><thead><tr><th>开关</th><th>描述</th><th>举例</th></tr></thead><tbody><tr><td>-p</td><td>指定加/解密的密码</td><td></td></tr><tr><td>-e</td><td>指定为加密</td><td>encryptfile -e -p password -i 123.txt -o 123.sec</td></tr><tr><td>-d</td><td>指定为解密</td><td>encryptfile -d -p password -i 123.sec -o 123.txt</td></tr><tr><td>-i</td><td>指定源文件</td><td></td></tr><tr><td>-o</td><td>指定目标文件</td><td></td></tr><tr><td>-t</td><td>加密文本文件</td><td></td></tr><tr><td>-r</td><td>加密/解密后删除源文件</td><td>如果不加此开关，默认保留源文件</td></tr></tbody></table>		开关	描述	举例	-p	指定加/解密的密码		-e	指定为加密	encryptfile -e -p password -i 123.txt -o 123.sec	-d	指定为解密	encryptfile -d -p password -i 123.sec -o 123.txt	-i	指定源文件		-o	指定目标文件		-t	加密文本文件		-r	加密/解密后删除源文件	如果不加此开关，默认保留源文件
开关	描述	举例																								
-p	指定加/解密的密码																									
-e	指定为加密	encryptfile -e -p password -i 123.txt -o 123.sec																								
-d	指定为解密	encryptfile -d -p password -i 123.sec -o 123.txt																								
-i	指定源文件																									
-o	指定目标文件																									
-t	加密文本文件																									
-r	加密/解密后删除源文件	如果不加此开关，默认保留源文件																								
安装要求	<p>工具为绿色软件，复制成功就能使用。包含文件：</p> <p>encryptfile.exe, libeay32.dll</p>																									
下载	<p>上海证券交易所-新交易系统专区 - 软件下载</p> <p><a href="http://www.sse.com.cn/sseportal/cs/zhs/ywyy/hyb/ngtrade/support/download/06_bank_2009.zip">http://www.sse.com.cn/sseportal/cs/zhs/ywyy/hyb/ngtrade/support/download/06_bank_2009.zip</a></p>																									
其他要求	文件加密保证文件本身没有任何改变。应该能保证对于批处理生成的文件 (dbf, zip, Steam LF 格式的 txt 文本)，加密后在 Windows 环境下解密后仍保持不变。																									

### 2.6.2 解密使用示例

encryptfile -d -p password -i 123.sse -o 123.zip

输入需要解密的文件：123.sse

输出解密完成的文件：123.zip

密钥：password (此密码各基金公司与托管银行自行设定)

encryptfile -d -r -p password -i 123.sse -o 123.zip

输入需要解密的文件：123.sse

输出解密完成的文件：123.zip

密钥：password (此密码各基金公司与托管银行自行设定)

解密完成后并删除 123.sse

### 2.6.3 重要提示（FAQ）

为何解密生成的.zip 文件无法解压缩？

请检查所输入的密码是否正确。当解密密码错误时，命令行窗口会提示“cannot decrypt file XXXX.sse”，但会生成目标.zip 文件，只是此文件无法解压缩。

请用正确的密码解密，即可获得正确的.zip 文件。

### 3 托管银行公共数据接口

#### 3.1 固定收益平台数据接口（公共）

上证所固定收益证券综合电子平台与托管银行之间公共数据接口规范包括以下几部分：

1. 收盘价文件接口规范（公共数据）
2. 成交明细行情文件接口规范（公共数据）
3. 确定报价行情文件接口规范（公共数据）

##### 3.1.1 数据流图

如图 3 所示，来自固定收益平台的盘后数据文件，通过证通云盘发送到托管银行与基金公司。托管银行收到此文件后，进行后续处理。

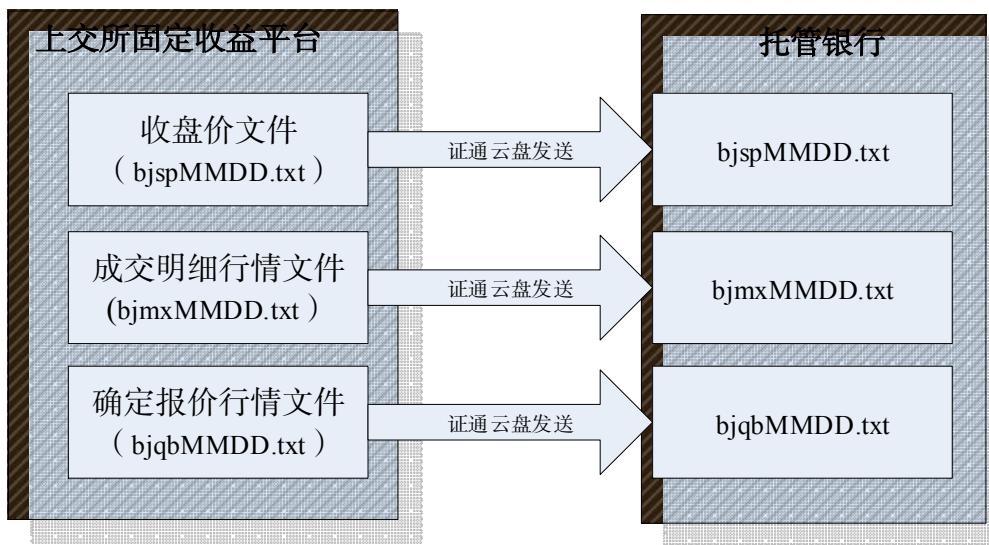


图 2 托管银行公共数据流图

##### 3.1.2 收盘价文件接口规范

###### 3.1.2.1 收盘价文件下载方式

提供给基金托管银行的收盘价数据，在每天闭市后，通过证通云盘传送到托管银行。

###### 3.1.2.2 收盘价文件定义

收盘价文件名称为 bjspMMDD.txt，对应的标志文件为 bjspMMDD.flg，其中 MMDD 为当前日期。

文件的每条记录为定长数据，各字段的长度固定，若无特殊说明内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

###### 3.1.2.3 收盘价文件格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	证券代码（品种）	TEXT	6	对债券质押式协议回购为回购代码 对三方回购为回购代码

序号	字段	数据类型	长度	格式
2	收盘价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购、三方回购为回购利率，精确到%小数点后3位，现实中的利率放大100000倍即为该字段的表示形式。例如：现实中3.456%在此字段应填3456。右对齐左补空格。
3	当天加权平均价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购、三方回购为当天加权平均利率，精确到%小数点后3位，具体填写规则同上。

说明：

- a. 收盘价指最后一笔交易的价格。
- b. 当天加权平均价指当天所有交易的加权平均价。
- c. 此文件内容是装入交易主机的所有报价系统交易品种，含停牌。

#### 3.1.2.4 收盘价标志文件格式

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
1	数据文件名称	文件名	TEXT	60	左对齐，右补空
2	数据文件大小	以字节为单位的文件大小	NUMBER	16	左对齐，右补空
3	日期	文件生成日期	DATE	8	YYYYMMDD
4	时间	文件生成时间	TIME	6	HHMMSS
5	记录数		NUMBER	12	左对齐，右补空
6	文件校验码	根据文件内容采用MD5算法生成	TEXT	64	左对齐，右补空
7	预留字段	暂为空格	TEXT	64	

### 3.1.3 成交明细行情文件接口规范

#### 3.1.3.1 成交明细行情文件下载方式

提供给基金托管银行的成交明细行情数据，在每天闭市后，通过证通云盘传送到托管银行。

#### 3.1.3.2 成交明细行情文件定义

成交明细行情文件名称为bjmxMMDD.txt，对应的标志文件为bjmxMMDD.flg，其中MMDD为当前日期。

文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔，数据文件的实际记录内容从第二行开始。文件的每条记录为定长数据，各字段的长度固定，若无特殊说明内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线(|)分隔。

### 3.1.3.3 成交明细行情文件格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	债券代码	TEXT	6	
2	债券简称	TEXT	30	
3	成交日期	DATE	10	yyyy-mm-dd
4	成交时间	TIME	8	hh:mm:ss
5	成交净价	NUMBER	10	单位：厘
6	应计利息	NUMBER	10	单位：0.1 厘 对基金无效
7	成交全价	NUMBER	10	单位：厘
8	到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 对基金无效
9	成交量	NUMBER	10	单位：手
10	成交金额	NUMBER	10	单位：万元（四舍五入到万）
11	成交方式	TEXT	1	1: 确定 2: 待定 3: 询价 6: 协商成交（含合并申报） 7: 竞买

说明：

- a. 在成交明细行情文件中，按照成交时间顺序排列各条成交记录。
- b. 在成交明细行情文件中，包含了由确定报价、待定报价、询价、协商成交、竞买、合并申报方式达成的成交。
- c. 不包含特定债券成交数据。

### 3.1.3.4 成交明细行情标志文件格式

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
1	数据文件名称	文件名	TEXT	60	左对齐，右补空
2	数据文件大小	以字节为单位的文件大小	NUMBER	16	左对齐，右补空
3	日期	文件生成日期	DATE	8	YYYYMMDD
4	时间	文件生成时间	TIME	6	HHMMSS
5	记录数		NUMBER	12	左对齐，右补空
6	文件校验码	根据文件内容采用 MD5 算法生成	TEXT	64	左对齐，右补空

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
7	预留字段	暂为空格	TEXT	64	

### 3.1.4 确定报价行情文件接口规范

#### 3.1.4.1 确定报价行情文件下载方式

提供给基金托管银行的确定报价行情数据，在每天闭市后，通过证通云盘传送到托管银行。

#### 3.1.4.2 确定报价行情文件定义

确定报价行情文件名称为 bjqbMMDD.txt，对应的标志文件为 bjqbMMDD.flg，其中 MMDD 为当前日期。

文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔，数据文件的实际记录内容从第二行开始。文件的每条记录为定长数据，各字段的长度固定，若无特殊说明内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

#### 3.1.4.3 确定报价行情文件格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	债券代码	TEXT	6	
2	债券简称	TEXT	30	
3	买入报价时间	TIME	8	hh:mm:ss
4	买入报价方	TEXT	10	交易商简称
5	买入价（净价）	NUMBER	10	单位：厘
6	买入数量	NUMBER	10	单位：手 对基金单位为“份”
7	买入全价	NUMBER	10	单位：厘
8	买入到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 对基金无效
9	卖出报价时间	TIME	8	hh:mm:ss
10	卖出报价方	TEXT	10	交易商简称
11	卖出价（净价）	NUMBER	10	单位：厘
12	卖出数量	NUMBER	10	单位：手 对基金单位为“份”
13	卖出全价	NUMBER	10	单位：厘
14	卖出到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 对基金无效
15	应计利息	NUMBER	10	单位：0.1 厘

序号	字段	数据类型	长度	格式
				对基金无效

说明：

- a. 在确定报价行情文件中，按照每个债券的代码从小到大依次排列各债券的所有当前报价。在每个债券的报价记录中，分别按最优买、卖报价的方式排序。
- b. 报价记录中的买入、卖出数量为当前剩余数量。如果是冰山订单，则当实际数量大于冰山订单值时，显示冰山订单值，而不是实际数量。
- c. 如果是匿名报价，则在对应买入/卖出报价方一栏显示“匿名”。

#### 3.1.4.4 确定报价行情标志文件格式

序号	字段	说明	数据类型	长度	格式
1	数据文件名称	文件名	TEXT	60	左对齐，右补空
2	数据文件大小	以字节为单位的文件大小	NUMBER	16	左对齐，右补空
3	日期	文件生成日期	DATE	8	YYYYMMDD
4	时间	文件生成时间	TIME	6	HHMMSS
5	记录数		NUMBER	12	左对齐，右补空
6	文件校验码	根据文件内容采用 MD5 算法生成	TEXT	64	左对齐，右补空
7	预留字段	暂为空格	TEXT	64	

## 4 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。

对本文档有任何批评指正意见，请发电子邮件到 [tech\\_support@sse.com.cn](mailto:tech_support@sse.com.cn)。