

上海证券交易所 LDDS 系统静态数据接口说明书

文档 状态	☐ 初稿	文档标识	LDDS 系统接口说明书静态数据分册
	☐ 评审通过	当前版本	1.1.15（期权基础信息文件下线技术开发稿）
	☐ 修改	作 者	市场数据部
	☒ 发布	发 布 者	上证所信息网络有限公司
	☐ 作废	完成日期	2022/08/05

文档变动说明

日期	版本	说明
2017-02-09	1.0.0	首次发布
2018-06-08	1.0.1	不再提供基金净值文件
2018-07-04	1.0.2	修改中证指数公司债券估值文件的产品类别号及标示号
2018-09-13	1.0.3	新增沪伦通 CDR 相关静态文件
2018-10-31	1.0.4	1. 新增产品基础信息第二批次文件 CPXX002MMDD.txt 2. 调整静态文件发布时间 3. 增加沪伦通 CDR 基本信息文件中时间的说明
2018-11-8	1.0.5	新增沪伦通收盘行情文件
2018-11-26	1.0.6	1. 修改沪伦通收盘行情文件描述 2. 新增沪伦通 GDR 基本信息增量文件和沪伦通 GDR 基本信息全量文件 3. 调整沪伦通 CDR 盘前持仓变更累计文件的发布时间
2018-12-17	1.1.0	1. 部分沪伦通相关静态文件（沪伦通 CDR 盘前持仓变更累计和沪伦通 GDR 基本信息增量文件）可能为 0 字节 2. 修改 GDR 基本信息增量文件和全量文件中备用 2 字段描述
2019-06-05	1.1.1	1. 取消 cpxx002MMDD.txt 文件 2. 新增产品基础信息 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 3. 新增主板交易公开信息公告文件 jygxMMDD.txt 和科创板交易公开信息公告文件 jygx02MMDD.txt 4. 不建议使用文件标识号来获取静态文件
2019-06-11	1.1.1	修改 GDR 基本信息增量文件和全量文件中备用 2 字段描述
2019-12-30	1.1.2	1. 股票期权静态文件中新增期权组合策略文件 zhcl03MMDD.txt 2. 取消股票期权（全真）静态文件 reff73mmdd.txt 和期权收盘价格 clpr73mmdd.txt 3. 调整中证指数公司债券估值文件为 YYYYMMDDbond_valuation_new.txt 及参考文档说明
2020-02-12	1.1.3	1. 新增产品简称 cpjcMMDD.txt 文件接口 2. 调整中证指数公司债券估值文件名称为 YYYYMMDDbond_valuation.txt

2020-08-06	1.1.4	新增巴交所指数收盘行情文件 Index_TradeInformationIndexFile_YYYYMMDD_1.csv
2020-12-16	1.1.5	1. 新增基金非交易基础信息文件和债券非交易基础信息文件，将产品非交易基础信息文件中有关债券 ETF 申赎信息与部分债券相关信息迁移到上述文件中 2. 新增定向可转债成交明细信息文件
2021-05-07	1.1.6	新增基金及公募 REITs 业务参数公告文件 sfpm01MMDD.txt
2021-07-09	1.1.7	产品基础信息第一版第一批和产品基础信息第一版第二批文件下线
2021-07-21	1.1.8	1. 新增债券行情文件 mktdt02.txt 2. 期权静态文件（reff03MMDD.txt、zhcl03MMDD.txt 和 clpr03MMDD.txt）的产品类别号从 30 调整为 10
2021-09-23	1.1.9	增加交易参与者清单文件和交易员清单文件
2021-10-08	1.1.10	不再支持使用文件标识号对静态文件进行 Rebuild
2021-11-11	1.1.11	新增国际化产品信息文件
2022-02-08	1.1.12	更新重点指数表现文件字段类型及描述，主要为： 1. 字段不适用时（如样本均价、平均股本、总市值、占比%、静态市盈率等），由填写“N/A”调整为填写“空格” 2. 指数级别标识字段填写方式由右对齐调整为左对齐
2022-05-09	1.1.13	1. 新增债券产品信息文件 2. 新增证券信息参考文件，用于支持证券扩位简称
2022-06-06	1.1.13a	新增国债利息文件 gzlz.MDD
2022-06-28	1.1.14	新增期权基础信息第二版文件
2022-08-05	1.1.15	期权基础信息文件 reff03mmdd.txt 下线

1. 引言

1.1 目的

文档介绍了 LDDS 系统中静态数据的接入方式，详细说明了静态数据的数据格式，以方便信息商接收静态数据。

1.2 阅读对象

文档适用于信息商及其他接入方的开发人员和静态数据技术支持人员。

1.3 参考文档

表 1-1 参考文档表

文档名称	文档来源
《上海证券交易所低延时行情发布系统(LDDS)接口说明书》	上证所信息网络有限公司
《中证指数估值文件接口规范》	中证指数有限公司网站
《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》	上海证券交易所网站技术专区
《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》	上海证券交易所网站技术专区
《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》	上海证券交易所网站技术专区
《IS113 上海证券交易所股票期权模拟交易系统市场参与者接口规格说明书》	上海证券交易所网站技术专区
《IS117 上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书（港股交易）》	上海证券交易所网站技术专区
《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》	上海证券交易所网站技术专区
《End of Day Summary Technical Specifications》	伦敦证券交易所
《Catalogo-de-Taxonomia-UP2DATA-Ingles.pdf》	巴西证券交易所

上海证券交易所网站技术专区链接为：

<http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/technical/data/>

上海证券交易所网站技术专区（开发测试）链接为：

<http://www.sse.com.cn/services/tradingservice/tradingtech/technical/development/>

2. 系统接入

接入方只要已接入上交所 LDDS 系统，并与我公司签约，我方将在 IDC 开通相应权限，接入方无须添加设备及更改配置，就可以在 VDE 中获得静态数据。

有关 LDDS 系统架构及接入可以参考《上海证券交易所低延时行情发布系统(LDDS)接口说明书》。

3. 数据定义

3.1 范围

静态数据包括五类文件，分别是上交所静态文件、中证指数公司债券估值文件、港股通参考数据文件、股票期权静态文件以及巴交所指数收盘文件。

3.2 内容

表 3-1 静态数据内容表

产品类别号	业务名称	文件名称	时间表
10	上交所静态文件	融资融券文件 dbpMMDD.txt 重点指数表现文件 zsbxYYMMDD.txt 产品基础信息第二版第一批次文件 cpxx0201MMDD.txt 产品基础信息第二版第二批次文件 cpxx0202MMDD.txt 产品非交易基础信息文件 fjyYYYYMMDD.txt 基金非交易基础信息文件 jfjyYYYYMMDD.xml 债券非交易基础信息文件 zfjyYYYYMMDD.xml 竞价行情文件 mktdt00.txt 债券行情文件 mktdt02.txt 沪伦通 CDR 基本信息 se018cdrYYYYMMDD001.txt 沪伦通收盘行情文件	交易日 8:40

		Eod_sum_d_DDMMYYYY.csv 沪伦通 GDR 基本信息增量文件 se038gdrjbxxYYYYMMDD001.txt 产品简称文件 cpjcMMDD.txt 定向可转债成交明细信息文件 se060dxkzzcjYYYYMMDD001.txt 基金及公募 REITs 业务参数公告文件 sfpm01MMDD.txt 期权基础信息-ref03mmdd.txt 期权基础信息第二版文件 reff0302YYYYMMDD.xml 期权组合策略文件 zhcl03MMDD.txt 交易参与人清单 se015jycyrYYYYMMDD001.txt 交易员清单 se015jyyYYYYMMDD001.txt 国际化产品信息文件 ifjyyyymmdd.xml 债券产品信息文件 bondinfoYYYYMMDD.zip 证券信息参考文件 se015zqxxyymmdd002.txt	
		沪伦通 CDR 盘前持仓变更累计 se053pqccbgjYYYYMMDD001.txt 沪伦通 GDR 基本信息全量文件 se060gdrjbxxYYYYMMDD001.txt	交易日 9:30
		期权收盘价格 clpr03mmdd.txt	交易日 16:15
		主板交易公开信息公告文件 jygkxxMMDD.txt 科创板交易公开信息公告文件 jygkxx02MMDD.txt	交易日 17:30
12	中证指数公司债券估值文件	中证指数公司债券估值文件 YYYYMMDDbond_valuation.txt	交易日 17:30
18	港股通参考数据	港股通基础信息 reff04MMDD.txt 港股最小价差文件 zxjcMMDD.txt 港股通参考汇率文件 extra04MMDD.txt	交易日 8:40
45	巴交所指数收盘文件	巴交所指数收盘行情文件 Index_TradeInformationIndexFile_YYYYMMDD_1.csv	交易日 8:40

3.3 数据格式

静态数据以文件方式提供，直接把文件内容放到 tag96 中，解析请参考具体的消息说明。

4. 数据说明

LDDS 系统获取静态数据的有两种方式，一种是自动获取，VSS 可自动获取 VDE 静态文件目录下的静态文件，若 VDE 异常时，盘前建议重启 VDE 来重新获取静态文件；另一种是 Rebuild 方式。

文件内容及格式与文件的原始发布者保持一致。

LDDS 系统中静态数据 Rebuild 方式的请求消息都是 UA1201，返回消息有两类。一类是以文件方式返回（UA2001），另一种是以特定的消息类型返回。

LDDS 系统中的静态数据大多数都是以文件方式提供，系统根据发送的产品类别（tag10142）和消息序列号（tag10072）的请求参数，直接把文件内容放到返回消息的 tag96 中，需要信息商根据不同的文件种类解析实际内容。

VSS 请求静态数据必须连接 VDE 的数据重建端口 9130。连接成功后，可直接发送 UA1201 的 Rebuild 请求，请求完成后断开连接。

所有静态文件数据返回的 UA2001 消息都是 STEP 消息数据，没有经过 FAST 编码。

表 4-1 静态文件消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType = UA2001
10142	CategoryID	Y	int	产品类别
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序列号
10178	DataTimeStamp	Y	Int	时间，单位（秒） 143025 表示 14:30:25
1472	File ID	Y	Int	文件标示号
16001	FileName	Y	String	文件名
1474	FileEncoding	Y	String	文件编码（空缺，暂不使用此字段）
61	Level			1 普通的数据文件 2 重要的数据文件，请将内容尽快在客户端展示（弹出窗口或跑马灯）
16003	TotalFragment	Y	Int	总的分片数 如果文件大于 2 兆，将分片传输。
16005	FragmentNo	Y	Int	目前的分片号，从 1 开始。
10097	FileStatus	Y	Int	1 表示新文件

				2 表示更新文件
95	RawDataLength	N	Int	Tag96 所包含的文件长度
96	RawData	N	Data	文件内容
	Standard Trailer	Y		

静态文件数据是根据 Rebuild 服务器（DRS）加载文件时获得的产品类别及消息序列号来请求的。每天 DRS 加载文件顺序并不一定相同，所以每个文件的消息序列号（tag10072）并不确定。每天的消息序列号都从 0 开始，例如重点指数文件当天第一个被加载，那当天消息序列号就是 0；如果第二天重点指数文件第二个被加载，则消息序列号就不会是 0。VSS 可以通过文件名（tag16001）来判断返回的文件类型。返回的 UA1201 中的 tag58 将告知该产品类别中所有的消息数量（考虑到文件可能会分片传输，消息数量会大于等于文件数量）。

静态数据文件大小如果大于 2 兆，将分片传输，每条 UA2001 消息传输文件的一个分片。当静态数据文件小于 2 兆时，一条 UA2001 消息对应一个文件，否则多条消息为一组对应一个文件。

系统支持盘中对静态数据的更新，如果文件内容需要修正，DRS 不会删除或更新原来的消息，而是产生新消息，来发布更新文件。所以如果当日收到同一文件主题名称的多组消息，请以消息序列号（tag10072）大的一组消息为准。信息商系统也应支持盘中重取静态数据，对旧数据进行修复或重新初始化。

如果在开盘前发起静态文件请求，建议 UA1201 的开始序列号（tag10073）设为 0，结束序列号（tag10074）设为 10000（或其他较大值），可以一次获得该产品类别下的所有文件。由于请求的消息数量大于实际数量，所以返回的 UA1201 中 tag10076 会等于 2（返回部分数据），这是正常现象。

如果是盘中发起静态文件请求，建议 UA1201 的开始序列号和结束序列号设为相等的值，一个一个文件请求，以免占用过多带宽，影响实时数据接收。

需要注意的是，静态数据文件不再进行转码。

4.1 融资融券文件

融资融券文件名为 dbpMMDD.txt，具体内容见下表。

表 4-2 融资融券文件格式

编号	域名称	必须	类型	注释
----	-----	----	----	----

1	SecurityID	Y	C6(String)	证券代码
2	FinancingType	Y	C3(String)	001: Margin buying 融资 002: Short sale 融券 003: Collateral 担保品
3	FinanciongQty	Y	N15(64Bit Int)	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;

请求消息示例:

```
8=STEP.1.0.0<SOH>9=90<SOH>35=UA1201<SOH>49=VSS<SOH>56=VDE<SOH>34=0<SOH>52=20110820-15:29:52<SOH>10075=1<SOH>10142=10<SOH>10073=0<SOH>10074=10000<SOH>10=191<SOH>
```

返回消息示例 (部分):

```
8=STEP.1.0.0<SOH>9=43945<SOH>35=UA2001<SOH>49=VDE<SOH>56=VDR<SOH>34=0<SOH>52=20110822-09:11:32<SOH>347=UTF-8<SOH>10142=10<SOH>10072=3<SOH>10178=81510<SOH>1472=10000<SOH>16001=dbp0822.txt<SOH>1474=utf-8<SOH>61=1<SOH>16003=1<SOH>16005=1<SOH>10097=1<SOH>95=43767<SOH>96=010107|003|0
010110|003|0
010112|003|0
010203|003|0
010213|003|0
010303|003|0
010308|003|0
010407|003|0
010410|003|0
010601|003|0.....<SOH>10=117<SOH>
8=STEP.1.0.0<SOH>9=101<SOH>35=UA1201<SOH>49=VDE<SOH>56=VDR<SOH>34=0<SOH>52=<SOH>347=UTF-8<SOH>10075=1<SOH>10142=10<SOH>10077=0<SOH>10073=0<SOH>10074=10000<SOH>10076=2<SOH>58=3<SOH>10=244<SOH>
8=STEP.1.0.0<SOH>9=73<SOH>35=5<SOH>49=VDE<SOH>56=VDR<SOH>34=0<SOH>52=<SOH>347=UTF-8<SOH>58=Data rebuild request responded.<SOH>10=185<SOH>
```

4.2 重点指数表现文件

重点指数¹表现文件名称为 zsbxYYMMDD.txt, 具体内容见表 4-3。

表 4-3 重点指数表现文件格式

¹ 重点指数包括: 上证指数 (000001)、科创 50 (000688)、上证 180 (000010)、上证 50 (000016)、上证 380 (000009)、上证 100 (000132)、上证 150 (000133)、B 股指数 (000003)、国债指数 (000012)、基金指数 (000011)

编号	字段名	字段类型	描述
1	指数代码	C6	指数代码，为主键
2	指数名称	C8	指数名称
3	样本数量	N10	指数当前的样本数量
4	收盘点位	N12(2)	指数当日收盘点位
5	样本均价	N8(2)	指数当前样本的均价，单位：元人民币 特殊的，当为 B 股指数（000003）时，单位：美元
6	成交金额	N12(2)	指数当日样本的成交金额汇总,单位：亿元人民币
7	平均股本	N12(2)	指数当前样本的平均股本，单位：亿股
8	总市值	N12(2)	指数当前样本的总市值汇总，单位：万亿元人民币
9	占比%	N6(2)	指数当前样本的总市值占上证指数全样本的总市值百分比
10	静态市盈率	N8(2)	指数当前样本的静态市盈率
11	指数级别标识	C6	取值如下： 上证指数:011 科创 50 :100 上证 180:101 上证 50 :201 上证 380:301 上证 100:401 上证 150:501 B 股指数:1102 国债指数:2002 基金指数:3002

请求消息示例：

8=STEP.1.0.0<SOH>9=89<SOH>35=UA1201<SOH>49=VDE<SOH>56=VSS<SOH>34=0<SOH>52=<SOH>347=UTF-8<SOH>10075=1<SOH>10142=10<SOH>10077=0<SOH>10073=0<SOH>10074=10000<SOH>10=173<SOH>

应答消息示例：

8=STEP.1.0.0<SOH>9=986<SOH>35=UA2001<SOH>49=VDE<SOH>56=VDR<SOH>34=0<SOH>52=20110822-09:11:32<SOH>347=UTF-8<SOH>10142=10<SOH>10072=0<SOH>10178=81510<SOH>1472=10010<SOH>16001=zsbox110819.txt<SOH>1474=utf-8<SOH>61=1<SOH>16003=1<SOH>16005=1<SOH>10097=1<SOH>95=808<SOH>96=000010| 上 证 180 | 180| 6032.32| 6.9| 377.74| 100.62| 12.5| 72.6| 13.15| 101 000016| 上证 50| 50| 1862.89| 7.06| 197.66| 254.23| 8.98| 52.15| 12.16| 201

000009	上证 380	380	3982.8	9.43	274.46	8.8
3.15	18.32	28.79	301			
000001	上证综指	965	2608.17	7.45	906.11	23.93
17.21	100	15.62	1002			
000012	上证国债	117	129.17	N/A	7.47	N/A
N/A	N/A	N/A	2002			
000011	上证基金	33	4289.53	N/A	7.23	N/A
N/A	N/A	N/A	3002			
000013	上证企债	409	145.2	N/A	5.2	N/A
N/A	N/A	N/A	4002			

<SOH>10=112<SOH>

8=STEP.1.0.0<SOH>9=101<SOH>35=UA1201<SOH>49=VDE<SOH>56=VDR<SOH>34=0<SOH>52=<SOH>347=UTF-8<SOH>10075=1<SOH>10142=10<SOH>10077=0<SOH>10073=0<SOH>10074=10000<SOH>10076=2<SOH>58=3<SOH>10=244<SOH>

8=STEP.1.0.0<SOH>9=73<SOH>35=5<SOH>49=VDE<SOH>56=VDR<SOH>34=0<SOH>52=<SOH>347=UTF-8<SOH>58=Data rebuild request responded.<SOH>10=185<SOH>

4.3 中证指数公司债券估值文件

中证指数公司债券估值文件名称为 YYYYMMDDbond_valuation.txt, 具体的说明请参见《中证指数数据文件服务规范（资讯商专用）》。

4.4 产品基础信息第二版第一批次文件

产品基础信息第二版第一批次文件名称为 cpxx0201MMDD.txt, 文件名中 0201 分别代表第二版、第一批次。

本文件在 cpxxMMDD.txt 文件的基础上调整格式、增减字段及调整字段定义。科创板系统上线时, 新老格式 cpxx 文件（即第一版与第二版）同时发送, 全市场系统可分阶段上线。

具体的内容请参见《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》。

4.5 产品基础信息第二版第二批次文件

产品基础信息第二版第二批次文件名称为 cpxx0202MMDD.txt, 文件名中 0202 分别代表第二版、第二批次。本文件与 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会通过本文件发出，目前第一批次和第二批次内容一致。

具体的内容请参见《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》。

4.6 产品非交易基础信息文件

产品非交易基础信息文件名称为 fjyYYYYMMDD.txt，本文件为与产品相关的非交易基础信息数据，具体的内容请参见《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》。

4.7 基金非交易基础信息文件

基金非交易基础信息文件名称为 jfyYYYYMMDD.xml，本文件为与基金相关的非交易基础信息数据，具体的内容请参见《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》。

4.8 债券非交易基础信息文件

债券非交易基础信息文件名称为 zfyYYYYMMDD.xml，本文件为与债券相关的非交易基础信息数据，具体的内容请参见《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》。

4.9 港股通参考数据

港股通参考数据包括 reff04MMDD.txt、zxjcMMDD.txt 和 extra04MMDD.txt，具体内容可参见《IS117 上海证券交易所港股通市场参与者接口规格说明书（港股交易）》中的港股基础信息 reff04MMDD.txt、最小价差文件 zxjcMMDD.txt 和港股通参考汇率文件 extra04MMDD.txt。

4.10 股票期权静态文件

股票期权静态文件包括 ~~reff03MMDD.txt~~、reff0302YYYYMMDD.xml、zhcl03MMDD.txt 和 clpr03MMDD.txt，具体内容可参见《IS113 上海证券交易所股票期权市场参与者接口规格说明书》中的~~期权基础信息-reff03MMDD.txt~~、期权基础信息第二版文件 reff0302YYYYMMDD.xml、期权组合策略文件 zhcl03MMDD.txt 及期权收盘价格文件 clpr03MMDD.txt。

4.11 竞价行情文件

竞价行情文件名称为 mkt00.txt，本文件为行情数据，具体的内容请参见《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》。

4.12 债券行情文件

债券行情文件名称为 mkt02.txt，本文件为行情数据，具体的内容请参见《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》。

4.13 沪伦通 CDR 基本信息

沪伦通 CDR 基本信息文件名称为 se018cdrYYYYMMDD001.txt，其中 YYYYMMDD 为前一交易日日期，具体内容见表 4-4。

表 4-4 沪伦通 CDR 基本信息文件格式

编号	字段名	字段类型	描述
1	CDR 证券代码	C6	
2	CDR 证券简称	C20	
3	CDR 证券全称	C100	即发行人全称
4	CDR 证券转换基数	N12	该字段份 CDR 可以转换成下字段份基础股票
5	基础证券转换基数	N12	该字段份基础股票可以转换成上字段份 CDR
6	基础证券代码	C10	

7	基础证券简称	C50	
8	基础证券 ISIN 代码	C20	
9	存托机构代码	C12	
10	存托机构简称	C20	
11	初始流动性生成起始日	C8	
12	初始流动性生成终止日	C8	
13	上市日期	C8	

4.14 沪伦通 CDR 盘前持仓变更累计

沪伦通 CDR 盘前持仓变更累计文件名称为 se053pqccbgjYYYYMMDD001.txt，此文件大小可能为 0 字节，其中 YYYYMMDD 为当前交易日，具体内容见表 4-5。

表 4-5 沪伦通 CDR 盘前持仓变更累计文件格式

编号	字段名	字段类型	描述
1	生效日期	C8	YYYYMMDD，当前交易日
2	证券代码	C6	
3	累计变更数量	N16	整数，0 表示不变，正数表示增加，负数表示减少 变更基数参见 cpxxMMDD.txt 文件中产品市场流通总量

4.15 沪伦通收盘行情文件

沪伦通收盘行情文件名称为 Eod_sum_d_DDMMYYYY.csv，其中 DDMMYYYY 为伦敦当地日期。具体的内容请参见《End of Day Summary Technical Specifications》。

4.16 沪伦通 GDR 基本信息增量文件

沪伦通 GDR 基本信息增量文件名称为 se038gdrjbxYYYYMMDD001.txt，

此文件大小可能为 0 字节,其中 YYYYMMDD 为当前交易日,具体内容见表 4-6。

表 4-6 沪伦通 GDR 基本信息增量文件格式

编号	字段名	字段类型	描述
1	GDR 上市代码	C10	交易代码
2	GDR 证券全称	C100	即发行人全称, 无则填空
3	本次上市对应的 GDR 份额数	N12	该字段份 GDR 可以转换成下字段份基础股票
4	本次上市的基础股票数	N12	该字段份基础股票可以转换成上字段份 GDR
5	基础证券代码	C6	
6	基础证券简称	C20	
7	新增股份的上市日期	C8	YYYYMMDD
8	GDR 上市日期	C8	YYYYMMDD
9	新增股份的产生原因	C100	
10	备用 1	C10	
11	备用 2	C50	GDR 转换比例 计算公式为: (本次上市对应的 GDR 份额数/最大公约数): (本次上市的基础股票数/最大公约数), 其中最大公约数是指本次上市的基础股票数和本次上市对应的 GDR 份额数的最大公约数

4.17 沪伦通 GDR 基本信息全量文件

沪伦通 GDR 基本信息全量文件名称为 se060gdrjbxYYYYMMDD001.txt, 其中 YYYYMMDD 为当前交易日, 具体内容见表 4-7。

表 4-7 沪伦通 GDR 基本信息全量文件格式

编号	字段名	字段类型	描述
1	GDR 上市代码	C10	交易代码
2	GDR 证券全称	C100	即发行人全称, 无则填空
3	本次上市对应的 GDR 份额数	N12	该字段份 GDR 可以转换成下字段份基础股票
4	本次上市的基础股票数	N12	该字段份基础股票可以转换成上字段份

			GDR
5	基础证券代码	C6	
6	基础证券简称	C20	
7	新增股份的上市日期	C8	YYYYMMDD
8	GDR 上市日期	C8	YYYYMMDD
9	新增股份的产生原因	C100	
10	备用 1	C10	
11	备用 2	C50	GDR 转换比例 计算公式为：（本次上市对应的 GDR 份额数/最大公约数）：（本次上市的基础股票数/最大公约数），其中最大公约数是指本次上市的基础股票数和本次上市对应的 GDR 份额数的最大公约数

4.18 主板交易公开信息公告文件

主板交易公开信息公告文件名称为 jygkxxMMDD.txt，具体的内容请参见《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》。

4.19 科创板交易公开信息公告文件

科创板交易公开信息公告文件名称为 jygkxx002MMDD.txt，具体的内容请参见《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》。

4.20 产品简称文件

产品简称文件名称为 cpjcMMDD.txt，提供产品基础信息文件中所有证券的主用简称。本文件编码格式为 GBK。

表 4-8 产品简称文件格式

编号	字段名	字段类型	描述
1	证券代码	C6	
2	主用简称	C32	各证券的主用简称

4.21 巴交所指数收盘行情文件

巴交所指数收盘行情文件名称为 Index_TradeInformationIndexFile_YYYYMMDD_1.csv，其中 YYYYMMDD 为巴西交易所当地日期。具体的内容请参见《Catalogo-de-Taxonomia-UP2DATA-Ingles.pdf》中的 TradeInformationIndexFile 文件格式说明。

4.22 定向可转债成交明细信息文件

定向可转债成交明细信息文件名称为 se060dxkzzcjYYYYMMDD001.txt，其中 YYYYMMDD 为前一交易日，具体内容见表 4-9。

表 4-9 定向可转债成交明细信息文件格式

编号	字段名	数据类型	输出文本宽度	描述
1	交易日期	DATE	8	右对齐，左补空，格式“YYYYMMDD”
2	证券代码	CHAR(6)	6	左对齐，右补空
3	证券简称	CHAR(8)	8	左对齐，右补空
4	成交价	DECIMAL(18,5)	20	右对齐，左补空，单位元
5	成交金额（万元）	DECIMAL(18,3)	20	右对齐，左补空，单位万元
6	成交数量（手）	DECIMAL(19,0)	20	右对齐，左补空，单位手

4.23 基金及公募 REITs 业务参数公告文件

基金及公募 REITs 业务参数公告文件名称为 sfpm01MMDD.txt，具体的内容请参见《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》。

4.24 交易参与人清单

交易参与人清单文件名称为 se015jycyrYYYYMMDD001.txt，其中

YYYYMMDD 为前一交易日，具体内容见表 4-10。

表 4-10 交易参与者清单文件格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	交易参与者编号	TEXT	3	
2	交易参与者简称	TEXT	10	左对齐右补空
3	交易参与者全称	TEXT	120	左对齐右补空

说明：

a. 文件内容为当日的全量交易参与者（即交易商）清单；若无数据则发送空文件。

4.25 交易员清单

交易员清单文件名称为 se015jyyYYYYMMDD001.txt，其中 YYYYMMDD 为前一交易日，具体内容见表 4-11。

表 4-11 交易员清单文件格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	交易员编号	TEXT	6	
2	交易员名称	TEXT	30	左对齐右补空
3	所属交易参与者编号	TEXT	3	
4	所属交易参与者简称	TEXT	10	左对齐右补空
5	联系电话	TEXT	40	左对齐右补空

说明：

a. 文件内容为当日全量交易员清单；若无数据则发送空文件。

4.26 国际化产品信息文件

国际化产品信息文件名称为 ifjyyyyymmdd.xml，具体内容见表 4-12。

表 4-12 国际化产品信息文件格式

序号	字段	字段描述	类型
1	Inst_ID	证券代码	C6
2	Inst_Nam	证券简称	C8

序号	字段	字段描述	类型
3	Underlying_ID	辅助证券代码	C6
4	Busi_Typ	业务类型: BTH=B 转 H 业务	C3

说明:

1. 证券代码为 B 转 H 股虚拟证券代码;
2. 辅助证券代码为 B 转 H 股的香港证券代码。

4.27 债券产品信息文件

债券产品信息文件为 bondinfoYYYYMMDD.zip，压缩文件内部为 bondinfoYYYYMMDD.txt，具体的内容请参见《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》。

4.28 证券信息参考文件

证券信息参考文件名称为: se015zqxxyyyymmdd002.txt，其中 yyyymmdd 为当前交易日，具体内容见表 4-13。

表 4-13 证券信息参考文件格式

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	证券代码	TEXT	6	对债券质押式协议回购、三方回购，为回购代码
2	证券名称	TEXT	8	证券简称 对债券质押式协议回购、三方回购，为回购简称
3	扩位简称	TEXT	30	
4	交易产品	TEXT	2	01: 国债现券 03: 公司债现券 05: 债券质押式协议回购 06: 中小企业私募债券 10: 三方回购

				15: 公募 REITs 21: 特定债券 22: 公募可转债
5	证券属性	TEXT	1	N: 国债 E: 公司债 P: 私募债券 A: 信贷资产支持证券 T: 特定债券 R: 公募 REITs C: 公募可转债 空格: 其他
6	证券状态	TEXT	1	N: 正常 S: 挂起(禁止) Z: 摘牌 D: 到期 对债券质押式协议回购、三方回购适用
7	质押券代码	TEXT	6	无效
8	开盘时间	TIME	6	HHMMSS 对债券质押式协议回购、三方回购适用
9	收盘时间	TIME	6	HHMMSS 对债券质押式协议回购、三方回购适用
10	证券发行方式	TEXT	1	A: 付息 Z: 零息/贴现 P: 一次还本付息
11	证券面额	NUMBER	10	单位: 厘 对基金无效
12	发行价格	NUMBER	10	单位: 厘
13	利息类型	TEXT	1	X: 固定利率 F: 浮动利率

				12-20 对基金无效
14	付息频率	TEXT	1	Y: 年付 H: 半年付 Q: 季付
15	票面利率/保底利率	NUMBER	10	单位: 厘
16	基本利率	NUMBER	10	单位: 厘 当前付息周期的基本利率
17	基本利差	NUMBER	10	单位: 厘
18	期限	NUMBER	3	单位: 年
19	实际发行总量	NUMBER	6	单位: 亿元
20	发行开始日期	DATE	8	YYYYMMDD
21	发行结束日期	DATE	8	YYYYMMDD
22	上市日期	DATE	8	YYYYMMDD
23	到期日期	DATE	8	YYYYMMDD 22-28 对基金无效
24	国债类型	TEXT	1	A: 记帐式 R: 实物式 V: 凭证式
25	发行方法	TEXT	1	S: 包销 R: 代销 B: 招标 O: 其他
26	是否跨市场	TEXT	1	Y: 跨市场 N: 不跨市场
27	能否做空	TEXT	1	Y: 可以做空 N: 不能做空
28	总做空额度	NUMBER	10	单位: 手
29	交易商做空额度	NUMBER	10	单位: 手
30	上日收盘价	NUMBER	10	单位: 厘
31	上日加权平均价	NUMBER	10	单位: 厘 对公募可转债, 为上一交易日 竞价收盘价

说明：

1. 对债券质押式协议回购、三方回购，除明确说明的字段外，其它字段均无效；
2. 只包含结算场所为中国结算的债券；
3. 本文件主要用于支持证券扩位简称。