



工程技术标准

深圳证券交易所数据文件交换接口规范

(Ver1.08)



深圳证券交易所
二〇一八年五月

文档说明

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

2014-9	1.00 Y	证券信息（securities）中权证特有字段“结算方式（WarrantClearingType）”更名为“交割方式（DeliveryType）”；期权特有字段“交割月份（DeliveryMonth）”更名为“交割日期（DeliveryDay）”；期权特有字段增加交割方式（DeliveryType），行权方式（ExerciseType）字段； 指数信息（indexinfo）增加计算币种（Currency）字段； 衍生品集中竞价交易类业务参考信息（derivativeauctionparams）增加保证金比例计算参数一（MarginRatioParam1）和保证金比例计算参数二（MarginRatioParam2）字段； 协议交易业务参考信息（negotiationparams）增加价格档位（PriceTick）字段； 盘后定价交易业务参考信息（afterhoursparams）删除数量门槛和金额门槛字段； 证券收盘行情（securityclosemd）增加证券类别（SecurityType）、昨收价（PrevClosePx）以及合约持仓量（ContractPosition）字段
--------	--------	--

2015-1	1.00 δ	增加文件交换流程说明。 增加优先股证券信息定义。 增加pcf文件格式描述。 静态交易参考信息每个交易日前发送两遍,增加相关说明。 收盘行情文件拆分为现货证券收盘行情文件和衍生品证券收盘行情文件。 证券信息文件中增加“基础证券代码源(UnderlyingSecurityIDSource)” ; “是否支持当日回转交易”字段英文名由“DayTrade”改为“DayTrading” ; 证券状态删除“未股改”和“股改复牌上市首日”,增加“公司再融资”、“网络投票”以及“合约调整”三个状态;增加“提价检查方式(PriceCheckMode)” ; “对回购标准券折算率”字段类型由N6(5)改为N5(4);增加“投资者适当性管理标志(QualificationFlag)”字段;“每百元应计利息Interest”字段类型由N8(4)改为N12(8);期权特有字段增加“挂牌类型(ListType)”、“交割月份(DeliveryMonth)”,删除“是否调整(Adjusted)”。 指数信息文件增加“证券代码源(SecurityIDSource)”字段。 统计量指标信息文件增加“证券代码源(SecurityIDSource)”字段。 现货集中竞价交易类业务参考信息文件增加“证券代码源(SecurityIDSource)”字段。 衍生品集中竞价交易类业务参考信息文件增加“证券代码源(SecurityIDSource)”字段,“涨停价格”字段英文名由“RisePrice”改为“PriceUpperLimit”,“跌停价格”字段英文名由“FallPrice”改为“PriceLowerLimit”。 协议交易业务参考信息文件增加“证券代码源(SecurityIDSource)”字段,“涨停价格”字段英文名由“PriceUpLimit”改为“PriceUpperLimit”,“跌停价格”字段英文名由“PriceDownLimit”改为“PriceLowerLimit”。 盘后定价交易业务参考信息文件增加“证券代码源(SecurityIDSource)”字段。
--------	--------	--

		转融通证券出借业务参考信息文件增加“证券代码源 (SecurityIDSource)”字段,“费率”字段英文名由“Price”改为“Rate”。 网上发行认购业务参考信息文件增加“证券代码源 (SecurityIDSource)”、“英文简称 (EnglishName)”字段,“认购价格上限”字段英文名由“PriceUpLimit”改为“PriceUpperLimit”,“认购价格下限”字段英文名由“PriceDownLimit”改为“PriceLowerLimit”。 债券分销业务参考信息文件增加“证券代码源 (SecurityIDSource)”、“英文简称 (EnglishName)”、“基础证券代码源 (UnderlyingSecurityIDSource)”、“证券类别 (SecurityType)”字段,“债券代码”字段改为“基础证券代码 (UnderlyingSecurityID)”,“认购委托限量”字段英文名由“UpQty”改为“QtyUpperLimit”,“代为挂牌总量”字段英文名由“ProxyIssueQty”改为“ProxyListQty”,“自行挂牌总量”字段英文名由“SelfIssueQty”改为“SelfListQty”,删除“承销商名称 (BrokerName)”字段。 网络投票业务参考信息文件增加“证券代码源 (SecurityIDSource)”、“英文简称 (EnglishName)”、“基础证券代码源 (UnderlyingSecurityIDSource)”。 配股业务参考信息文件增加“证券代码源 (SecurityIDSource)”、“英文简称 (EnglishName)”、“基础证券代码源 (UnderlyingSecurityIDSource)”。
2015-8	1.00	删除网络投票业务参考信息evoteparams文件,该接口由《上市公司股东大会数据接口》代替。 增加Cx字符串的说明。 点对点数据交换的业务规则名变更。 增加证券公司短期债、现金债券ETF、可交换公司债的信息定义。

		网上发行认购业务参考信息文件增加“证券类别（SecurityType）”字段。 证券信息（securities）中的证券状态Status增加“14-暂停上市后协议转让”状态，删除“11-暂停上市状态”；权证特有字段增加“最后交易日LastTradeDay”；优先股特有字段增加“是否处于转股回售期OfferingFlag”。 证券类别名称修订：“国债（5）”改为“国债（含地方债）”，“公司债（含分离债）（7）”改为“公司债”，“中小企业私募债（9）”改为“私募债”，“中小企业可交换私募债（10）”改为“可交换私募债”；增加“现金债券ETF（18）”和“证券公司短期债（34）”证券类别。 衍生品集中竞价交易类业务参考信息文件增加“市价买数量上限（MarketOrderBuyQtyUpperLimit）”、“市价卖数量上限（MarketOrderSellQtyUpperLimit）”、“报价买数量上限（QuoteOrderBuyQtyUpperLimit）”、“报价卖数量上限（QuoteOrderSellQtyUpperLimit）”，原买数量上限字段和卖数量上限字段名称改为限价买数量上限和限价卖数量上限。 增加证券业务开关信息（securityswitch）文件。 增加网络投票回报文件（evotereport）。
2016-6	1.01	增加成交汇总文件接口说明； 增加网络投票业务参考信息说明； PCF中证券代码源增加9999定义； 完善转股、回售、转股撤单、回售撤单四个证券业务开关适用证券范围说明
2016-6	1.02	增加国际市场互联状态信息（imcparams）文件。 增加国际市场互联标的信息（imcsecurityparams）文件。 增加港股通交易参考信息文件。 增加港股收盘价格文件（hkexclpr04）。
2016-10	1.03	增加港股通成交单据文件接口； 增加通过卫星线路可接收的港股通业务相关文件清单。

2017-5	1.04	证券信息（securities）增加“投资者适当性管理分类（QualificationClass）”字段； 债券分销业务参考信息（bonddistributionparams）增加“投资者适当性管理分类（QualificationClass）”字段。
2017-7	1.05	增加减持额度信息（reducequota）
2018-3	1.06	增加资金前端风险控制信息（fundquota）
2018-5	1.07	证券类别（SecurityType）字段增加取值“36-存托凭证”； 证券信息（securities）股票特有字段增加“股票属性（Attribute）”字段； 网上发行认购业务参考信息（issueparams）增加“证券属性（Attribute）”字段； 配股业务参考信息（rightsissueparams）增加“认购基数（Unit）”字段。
2018-5	1.08	（本档中橙色修订部分） 增加质押券篮子清单信息（tripartyrepobasket）； 证券信息（securities）增加资产支持证券的到期日信息； 增加减持额度信息示例。

名词释义

词汇缩写	含义
FTS	文件传输系统

目 录

一、 前言	1
二、 文件交换方式	1
2.1 文件传输系统 FTS	1
2.2 交易所群发	1
2.3 点对点数据交换	2
2.3.1 上传文件	2
2.3.2 下发文件	2
2.4 各类文件具体交换方式说明	2
三、 静态交易参考信息	3
3.1 证券信息 (SECURITIES)	4
3.2 指数信息 (INDEXINFO)	10
3.3 统计量指标信息 (STAT)	11
3.4 现货集中竞价交易业务参考信息 (CASHAUCTIONPARAMS)	11
3.5 衍生品集中竞价交易业务参考信息 (DERIVATIVEAUCTIONPARAMS)	12
3.6 协议交易业务参考信息 (NEGOTIATIONPARAMS)	13
3.7 盘后定价交易业务参考信息 (AFTERHOURSPARAMS)	13
3.8 转融通证券出借业务参考信息 (SECURITYLENDINGPARAMS)	14
3.9 ETF 实时申购赎回业务参考信息 (PCF)	14
3.10 网上发行认购业务参考信息 (ISSUEPARAMS)	17
3.11 债券分销业务参考信息 (BONDDISTRIBUTIONPARAMS)	18
3.12 配股业务参考信息 (RIGHTSISSUEPARAMS)	18
3.13 国际市场互联状态信息 (IMCPARAMS)	19
3.14 国际市场互联标的信息 (IMCSECURITYPARAMS)	19
3.15 国际市场互联汇率信息 (IMCEXCHANGERATE)	19
3.16 港股通交易参考信息	20
3.16.1 港股产品信息 (hkexreff04)	20
3.16.2 最小价差文件 (hkexzxjc)	22
3.17 证券业务开关信息 (SECURITYSWITCH)	23
3.18 网络投票业务参考信息 (EVOTEPARAMS)	25
3.19 三方回购质押券篮子信息 (TRIPARTYREPOBASKET)	25
四、 风险控制信息	25
4.1 减持额度信息 (REDUCEQUOTA)	25
4.2 资金前端风险控制信息 (FUNDQUOTA)	26
五、 日终静态行情信息	27
5.1 现货证券收盘行情 (CASHSECURITYCLOSEMD)	27
5.2 衍生品证券收盘行情 (DERIVATIVESECURITYCLOSEMD)	27
5.3 港股收盘价格文件 (HKEXCLPR04)	28
六、 日终回报数据	29
6.1 网络投票回报 (EVOTEREPORT)	29
6.2 成交汇总文件 (EXECUTION_AGGR)	31
6.3 港股通成交单据文件 (HKEXECUTION_TAX_MEMBERID)	33

七、 数据类型说明	34
八、 TSV 文件格式规范说明	34
九、 附件	34
9.1 减持额度信息示例	34

深圳证券交易所数据文件交换接口规范

一、前言

本接口规范约定提供给证券公司等会员及相关市场参与主体（下面简称“市场参与主体”），用以指导开发通过文件传输系统 FTS 与深圳证券交易所新一代交易系统（即第五版交易系统）进行数据文件交换。本接口规范描述内容包括数据文件内容、必要的运行指导以及详细的数据文件交换格式。

文件的编码格式为 UTF-8。

如无特别说明，xml 文件内容一般都大小写敏感。

二、文件交换方式

2.1 文件传输系统 FTS

文件交换通过 FTS 进行，FTS 基于深圳证券交易所（简称“深交所”）新一代交易系统交易接入网络实现数据文件传输。各证券公司、商业银行、基金公司和期货公司（统称为“接入用户”）之间只需一条通道接入该平台即可从事各种金融合作业务，从而实现通信和业务上的“一点接入”。用户可根据自身需要选择合适的接入方式（托管接入或广域接入），也可同时申请多条通道，保有多种备份手段。

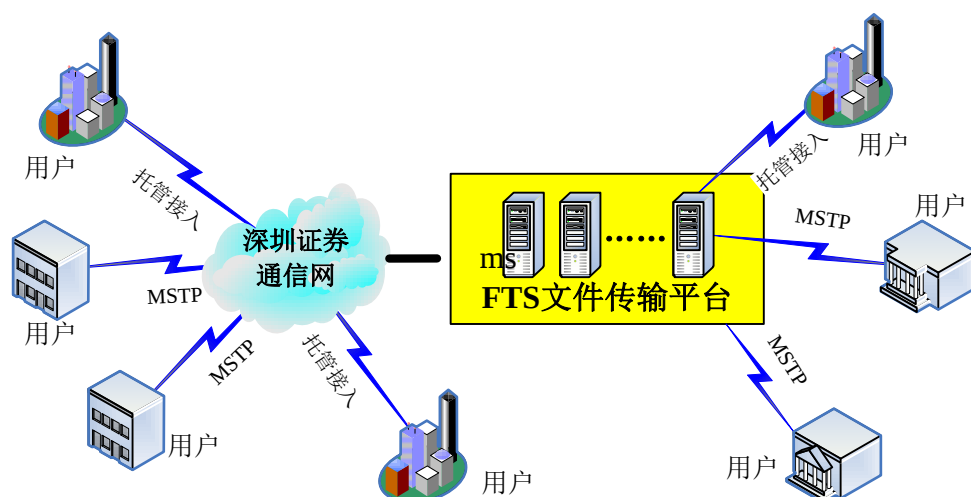


图 2-1 FTS 用户接入网络图

2.2 交易所群发

群发是指交易所将数据文件通过 FTS 发送给所有接入用户。

群发业务只支持交易所发送给接入用户，不支持接入用户上传文件给交易所。

2.3 点对点数据交换

点对点文件交换是指交易所与单个接入用户进行的文件交换，点对点业务支持用户上传文件和接收交易所下发的文件。

2.3.1 上传文件

上传文件指某个市场参与主体向交易所发送文件。

市场参与主体在每日规定的时间内将源文件传送到交易所，随源文件还必须一起上传用于描述源文件的*.flag 文件（通配符“*”代表源文件名不带扩展名的部分），交易所收到源文件及标志文件后，对源文件进行检查，如检查通过，则回传*.suc 文件，内容为空；如检查发现错误，则回传*.err 文件，其中包含具体错误描述，市场参与主体在收到该文件后需重新向深交所发送数据文件。

交易所收到市场参与主体发送源文件后，如检查无误，则在发送上述的*.suc 文件之后，还会从交易主机读取已导入的源文件并回传给市场参与主体以供其确认，文件名为*.reply，内容和格式同相应的源文件。

市场参与主体在规定的规定时间之前可以向交易所多次重发源文件，交易所对重发的文件执行同首次接收文件一样的处理流程，交易所最后一次接收到的文件为准。

标志文件*.flag 为 xml 文件，其内容格式如下：

表 2-1 市场参与主体上传标志文件*.flag 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
文件名称	FileName	C128	源文件名
生成日期	FileDate	N8	YYYYMMDD 格式，暂时不校验
生成时间	FileTime	N6	HHMMSS 格式，暂时不校验
文件字节数	FileBytes	N9	文件的字节数
校验码	Checksum	C32	32 字节的 MD5 校验码，16 进制字符表示，每个字节表示一个 16 进制字符

错误反馈文件*.err 为 xml 文件，其内容格式如下：

表 2-2 交易所回传错误文件*.err 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
错误信息列表	Errors		
→ 错误信息	Error	C256	

2.3.2 下发文件

下发文件是指交易所向某个市场参与主体发送文件。

2.4 各类文件具体交换方式说明

表 2-3 各类文件具体交换方式说明

文件		交换方式	FTS 传送业务规则名	备注
静态交易参考信息		交易所群发	szse_marketdata	
日终静态行情信息				
日终回报数据	网络投票回报	点对点	szse_trading_XXXXXX	XXXXXX 为 6 位市场参与主体 ID（会员 ID）
	成交汇总文件	点对点	szse_report_TGWID	TGWID 为成交汇总通信网关 ID
	港股通成交单据文件	点对点	szse_trading_XXXXXX	XXXXXX 为 6 位市场参与主体 ID（会员 ID）
风险控制信息	减持额度信息	点对点	szse_trading_XXXXXX	XXXXXX 为 6 位市场参与主体 ID（会员 ID）
	资金前端风险控制信息	点对点	szse_trading_XXXXXX	XXXXXX 为 6 位市场参与主体 ID（会员 ID）

三、 静态交易参考信息

所有静态交易参考信息（ETF 实时申购赎回 PCF 文件除外）在每个交易日（T 日）开市前发送两遍，第一遍在交易所完成 T 日的主要业务数据准备后（一般为 T-1 日的晚间）发送，第二遍在 T 日开市前（一般为 T 日早间）发送。

第一遍静态交易参考信息的文件名格式如下，其中 YYYYMMDD 为对应的 T 日日期：

pre_文件 ID_YYYYMMDD.扩展名

示例：pre_securities_YYYYMMDD.xml

第二遍静态交易参考信息的文件名格式如下，其中 YYYYMMDD 为对应的 T 日日期：

文件 ID_YYYYMMDD.扩展名

示例：securities_YYYYMMDD.xml

ETF 实时申购赎回 PCF 文件随第二遍交易参考信息时一起发送。

第一遍的数据相比第二遍的数据差异如下：

- 证券信息（securities）中的 T-1 日基金净值（NAV）可能是不准确的；
- 没有 ETF 实时申购赎回 PCF 文件；
- 没有国际市场互联状态信息；
- 没有国际市场互联标的信息；
- 没有国际市场互联汇率信息；
- 没有港股通交易参考信息。

第一遍发送的数据，应市场参与主体的需求提供给相关市场参与主体参考。因业务或技术等特殊原因，第一遍的数据相比第二遍的数据可能还有其他差异，也有可能不发送第一遍数据，只发送第二遍数据，会员及相关市场参与主体应该都以第二遍数据为准（即文件名没有 pre 前缀的）。

如下列表中的文件，市场参与主体还可通过卫星线路的行情网关 MDGW 接收：

序号	文件名	文件 ID
1	证券信息	securities
2	指数信息	indexinfo
3	统计量指标信息	stat
4	现货集中竞价交易类业务参考信息	cashauctionparams
5	衍生品集中竞价交易业务参考信息	derivativeauctionparams
6	网上发行认购业务参考信息	issueparams
7	债券分销业务参考信息	bonddistributionparams
8	配股业务参考信息	rightsissueparams
9	现货证券收盘行情	cashsecurityclosemd
10	衍生品证券收盘行情	derivativesecurityclosemd
11	国际市场互联状态信息	imcparams
12	国际市场互联标的信息	imcsecurityparams
13	国际市场互联汇率信息	imcexchangerate
14	港股产品信息	hkexreff04
15	最小价差文件	hkexzxjc
16	港股收盘价格文件	hkexclpr04

3.1 证券信息（securities）

文件 ID 为 securities，扩展名为 xml。

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

表 3-1 证券信息 securities.xml 内容定义

	字段名称	字段英文名	类型	说明
所有证券都包含的字段	证券代码	SecurityID	C8	
	证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
	证券简称	Symbol	U40	

	英文简称	EnglishName	C40	对于期权填写合约代码
	ISIN 代码	ISIN	C12	
	基础证券代码	UnderlyingSecurityID	C8	
	基础证券代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
	上市日期	ListDate	N8	
	证券类别	SecurityType	N4	
	货币种类	Currency	C4	币种，左对齐 CNY = 人民币 HKD = 港币
	数量单位	QtyUnit	N15(2)	对于某一证券申报的委托，其委托数量字段必须为该证券数量单位的整数倍
	是否支持当日回转交易	DayTrading	C1	Y=支持 N=不支持
	昨日收盘价	PrevClosePx	N13(4)	
	证券状态	SecurityStatus		一只证券可能具有 0 个或多个状态
	→ 状态	Status	N2	证券状态代码: 1-停牌 2-除权 3-除息 4-ST 5-*ST 6-上市首日 7-公司再融资 8-恢复上市首日 9-网络投票 10-退市整理期 12-增发股份上市 13-合约调整 14-暂停上市后协议转让
	总发行量	OutstandingShare	N18(2)	
	流通股数	PublicFloatShareQuantit	N18(2)	

		y		
	面值	ParValue	N13(4)	
	是否可作为融资 融券可充抵保证 金证券	GageFlag	C1	Y=是 N=否
	可充抵保证金折 算率	GageRatio	N5(2)	
	是否为融资标的	CrdBuyUnderlying	C1	Y=是 N=否
	是否为融券标的	CrdSellUnderlying	C1	Y=是 N=否
	提价检查方式	PriceCheckMode	N2	0=不检查 1=不低于最近成交价 2=不低于昨收价 3=不低于最高叫买 4=不低于最低叫卖
	是否可质押入库	PledgeFlag	C1	Y=是 N=否
	对回购标准券折 算率	ContractMultiplier	N5(4)	
	对应回购标准券	RegularShare	C8	
	投资者适当性管 理标志	QualificationFlag	C1	deprecated 是否需要对该证券作投资者适当 性管理 Y=是 N=否
	投资者适当性管 理分类	QualificationClass	N2	投资者适当性管理分类 0=包括公众投资者、合格投资者 在内的所有投资者 1=仅合格投资者 2=仅合格投资者中的机构投资者
股票特有字段 StockParams				
相关证券类别代码（1、2、3、4、36）				
股票特有	行业种类	IndustryClassification	C4	

字段	上年每股利润	PreviousYearProfitPerShare	N10(4)	对于存托凭证（证券类别 36）为每份利润
	本年每股利润	CurrentYearProfitPerShare	N10(4)	对于存托凭证（证券类别 36）为每份利润
	是否处于要约收购期	OfferingFlag	C1	Y=是 N=否
	股票属性	Attribute	N2	0=普通股票 1=创新企业股票 该字段仅适用于证券类别为 1、2、3 的证券
基金特有字段 FundParams 相关证券类别代码（14、15、16、17、18、19、20、23、24、25、26）				
基金特有 字段	T-1 日基金净值	NAV	N13(4)	对于大部分基金，存放 T-1 日净值；对于部分基金（如投资境外市场基金），可能存放 T-x 日净值（x>=1，例如对于投资美股的基金，x=2）
债券特有字段 BondParams 相关证券类别代码（5、6、7、8、9、10、11、34、35）				
债券特有 字段	票面年利率	CouponRate	N8(4)	
	贴现发行价	IssuePrice	N13(4)	
	每百元应计利息	Interest	N12(8)	
	发行起息日或本次付息起息日	InterestAccrualDate	N8	
	到期日	MaturityDate	N8	
	是否处于转股回售期	OfferingFlag	C1	Y=是 N=否
权证特有字段 WarrantParams 相关证券类别代码（28）				
权证特有 字段	行权价	ExercisePrice	N13(4)	
	行权比例	ExerciseRatio	N10(4)	
	行权起始日	ExerciseBeginDate	N8	
	行权截止日	ExerciseEndDate	N8	
	认购或认沽	CallOrPut	C1	C = Call

				P = Put
	交割方式	DeliveryType	C1	S = 证券结算 C = 现金结算
	结算价格	ClearingPrice	N13(4)	
	行权方式	ExerciseType	C1	A = 美式 E = 欧式 B = 百慕大式
	最后交易日	LastTradeDay	N8	
质押式回购交易代码特有字段 RepoParams 相关证券类别代码(12)				
质押式回购交易代码特有字段	购回期限	ExpirationDays	N4	
期权特有字段 OptionParams 相关证券类别代码 (29、30)				
期权特有字段	认购或认沽	CallOrPut	C1	C = Call P = Put
	挂牌类型	ListType	N2	1=品种新挂 2=到期加挂 3=调整加挂 4=波动加挂
	交割日期	DeliveryDay	N8	
	交割月份	DeliveryMonth	N6	格式为 YYYYMM
	交割方式	DeliveryType	C1	S = 证券结算 C = 现金结算
	行权起始日期	ExerciseBeginDate	N8	
	行权结束日期	ExerciseEndDate	N8	
	行权价	ExercisePrice	N13(4)	
	行权方式	ExerciseType	C1	A = 美式 E = 欧式 B = 百慕大式
	最后交易日	LastTradeDay	N8	
	调整次数	AdjustTimes	N2	

	合约单位	ContractUnit	N15(2)	
	昨日结算价	PrevClearingPrice	N13(4)	
	合约持仓量	ContractPosition	N18(2)	
优先股特有字段 PreferredStockParams 相关证券类别代码 (33)				
优先股特有字段	票面股息率	Interest	N8(4)	0.0000 表示浮动股息率
	是否处于转股、回售、赎回期	OfferingFlag	C1	Y=是 N=否
资产支持证券特有字段 ReitsParams 相关证券类别代码 (13)				
资产支持 证券特有 字段	到期日	MaturityDate	N8	

注：

1) 证券类别代码定义如下：

表 3-2 证券类别定义

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

ETF	
现金债券 ETF	18
黄金 ETF	19
货币 ETF	20
杠杆 ETF	21（预留）
商品期货 ETF	22
标准 LOF	23
分级子基金	24
封闭式基金	25
仅申赎基金	26
权证	28
个股期权	29
ETF 期权	30
优先股	33
证券公司短期债	34
可交换公司债	35
存托凭证	36

3.2 指数信息（indexinfo）

文件 ID 为 indexinfo，扩展名为 xml。

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

表 3-3 指数信息 indexinfo.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
指数代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
指数简称	Symbol	U40	
英文简称	EnglishName	C40	
计算币种	Currency	C4	币种，左对齐 CNY = 人民币 HKD = 港币
昨收指数点位	PrevCloseIdx	N18(5)	

3.3 统计量指标信息 (stat)

文件 ID 为 stat，扩展名为 xml。

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

表 3-4 统计量指标信息 stat.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
指标代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
指标简称	Symbol	U40	
英文简称	EnglishName	C40	

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

文件 ID 为 cashauctionparams，扩展名为 xml。

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

表 3-5 现货集中竞价交易业务参考信息 cashauctionparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
买数量上限	BuyQtyUpperLimit	N15(2)	买委托数量的上限
卖数量上限	SellQtyUpperLimit	N15(2)	卖委托数量的上限
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
价格档位	PriceTick	N13(4)	
竞价限价参数	PriceLimitSetting		
→ 参数类型	Type	C1	O=开盘集合竞价 T=连续竞价 C=收盘集合竞价
→ 是否有涨跌限制	HasPriceLimit	C1	Y=是 N=否
→ 基准价类型	ReferPriceType	C1	1=昨收价
→ 涨跌限制类	LimitType	C1	1=幅度（百分比）

	型			2=价格（绝对值）
→	上涨幅度	LimitUpRate	N10(3)	
→	下跌幅度	LimitDownRate	N10(3)	
→	上涨限价	LimitUpAbsolute	N10(4)	
→	下跌限价	LimitDownAbsolute	N10(4)	
→	是否有有效 竞价范围限制	HasAuctionLimit	C1	Y=是 N=否
→	有效范围限制类型	AuctionLimitType	C1	1=幅度（百分比） 2=价格（绝对值）
→	有效范围涨跌幅度	AuctionUpDownRate	N10(3)	
→	有效范围涨跌幅价格	AuctionUpDownAbsolute	N10(4)	
做市商标志		MarketMakerFlag	C1	标识是否有做市商 Y=是 N=否

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

文件 ID 为 derivativeauctionparams，扩展名为 xml。

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

表 3-6 衍生品集中竞价交易业务参考信息 derivativeauctionparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
限价买数量上限	BuyQtyUpperLimit	N15(2)	限价买委托数量的上限
限价卖数量上限	SellQtyUpperLimit	N15(2)	限价卖委托数量的上限
市价买数量上限	MarketOrderBuyQtyUpperLimit	N15(2)	市价买委托数量的上限
市价卖数量上限	MarketOrderSellQtyUpperLimit	N15(2)	市价卖委托数量的上限
报价买数量上限	QuoteOrderBuyQtyUpperLimit	N15(2)	报价买委托数量的上限
报价卖数量上限	QuoteOrderSellQtyUpperLimit	N15(2)	报价卖委托数量的上限
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
价格档位	PriceTick	N13(4)	

涨停价	PriceUpperLimit	N13(4)	
跌停价	PriceLowerLimit	N13(4)	
昨卖开每张保证金	LastSellMargin	N18(4)	
今卖开每张保证金	SellMargin	N18(4)	
保证金比例计算参数一	MarginRatioParam1	N4(2)	百分数，例如：12.00%在文件中用 12.00 表示
保证金比例计算参数二	MarginRatioParam2	N4(2)	百分数，例如：12.00%在文件中用 12.00 表示
做市商标志	MarketMakerFlag	C1	标识是否有做市商 Y=是 N=否

3.6 协议交易业务参考信息 (negotiationparams)

文件 ID 为 negotiationparams，扩展名为 xml。

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

表 3-7 协议交易业务参考信息 negotiationparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍
数量门槛	QtyLowerLimit	N15(2)	必须满足数量门槛或金额门槛
金额门槛	AmtLowerLimit	N18(4)	
涨停价格	PriceUpperLimit	N13(4)	
跌停价格	PriceLowerLimit	N13(4)	
价格档位	PriceTick	N13(4)	
做市商标志	MarketMakerFlag	C1	标识是否有做市商 Y=是 N=否

3.7 盘后定价交易业务参考信息 (afterhoursparams)

文件 ID 为 afterhoursparams，扩展名为 xml。

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

表 3-8 盘后定价交易业务参考信息 afterhoursparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID		
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
买数量单位	BuyQtyUnit	N15(2)	每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍
卖数量单位	SellQtyUnit	N15(2)	每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍

3.8 转融通证券出借业务参考信息 (securitylendingparams)

文件 ID 为 securitylendingparams，扩展名为 xml。

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

表 3-9 转融通证券出借业务参考信息 securitylendingparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
期限类型	ExpirationType	C1	期限类型 1 表示固定期限
期限	ExpirationDays	N4	
费率	Rate	N13(4)	

3.9 ETF 实时申购赎回业务参考信息 (pcf)

每只 ETF 对应一个 PCF 文件。

PCF 文件名为 pcf_NNNNNNNN_YYYYMMDD.xml，其中 NNNNNNNN 为 ETF 代码（如果 ETF 代码不足 8 位，则使用 6 位，如 159901 的 PCF 文件为 pcf_159901_YYYYMMDD.xml），YYYYMMDD 为对应的交易日。

表 3-10 ETF 实时申购赎回业务参考信息 pcf_*.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
版本号	Version	C8	固定值 1.0
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
基金名称	Symbol	U40	

字段名称	字段英文名	类型	说明
基金公司名称	FundManagementCompany	U30	
拟合指数代码	UnderlyingSecurityID	C8	
拟合指数代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	101 = 上海证券交易所 102 = 深圳证券交易所 103 = 香港交易所 9999=其他
最小申购赎回单位	CreationRedemptionUnit	N15(2)	每个篮子（最小申购赎回单位）对应的 ETF 份数，目前只能为正整数
预估现金差额	EstimateCashComponent	N11(2)	T 日每个篮子的预估现金差额
最大现金替代比例	MaxCashRatio	N6(5)	最大现金替代比例，例如：5.551% 在文件中用 0.05551 表示
是否发布 IOPV	Publish	C1	Y=是 N=否
是否允许申购	Creation	C1	Y=是 N=否
是否允许赎回	Redemption	C1	Y=是 N=否
深市成份证券数目	RecordNum	N4	表示一个篮子中的深市成份证券数目（包含 159900 证券）
所有成份证券数目	TotalRecordNum	N4	表示一个篮子中的所有成份证券数目（包含 159900 证券）
交易日	TradingDay	N8	格式 YYYYMMDD
前交易日	PreTradingDay	N8	T-X 日日期，格式 YYYYMMDD， X 由基金公司根据基金估值时间确定
现金余额	CashComponent	N11(2)	T-X 日申购赎回基准单位的现金余额
申购赎回基准单位净值	NAVperCU	N12(2)	T-X 日申购赎回基准单位净值
单位净值	NAV	N8(4)	T-X 日基金的单位净值
红利金额	DividendPerCU	N12(2)	T 日申购赎回基准单位的红利金额
累计申购总额限制	CreationLimit	N18(2)	当天累计可申购的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
累计赎回总额限制	Redemption Limit	N18(2)	当天累计可赎回的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
单个账户累计申购总额限制	CreationLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限，为 0 表示没有限

字段名称		字段英文名	类型	说明
				制，目前只能为整数
单个账户累计赎回总额限制		RedemptionLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
净申购总额限制		NetCreationLimit	N18(2)	当天净申购的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
净赎回总额限制		NetRedemptionLimit	N18(2)	当天净赎回的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
单个账户净申购总额限制		NetCreationLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天净申购的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
单个账户净赎回总额限制		NetRedemptionLimitPerUser	N18(2)	单个证券账户当天净赎回的基金份额上限，为 0 表示没有限制，目前只能为整数
成份股列表		Components		
→	成份股信息	Component		
→	→ 证券代码	UnderlyingSecurityID	C8	
→	→ 证券代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	101 = 上海证券交易所 102 = 深圳证券交易所 103 = 香港交易所
→	→ 证券简称	UnderlyingSymbol	U40	
→	→ 成份证券数	ComponentShare	N15(2)	每个申购篮子中该成份证券的数量
→	→ 现金替代标志	SubstituteFlag	C1	0=禁止现金替代（必须有证券） 1=可以进行现金替代（先用证券，证券不足时差额部分用现金替代） 2=必须用现金替代
→	→ 溢价比列	PremiumRatio	N7(5)	证券用现金进行替代的时候，计算价格时增加的比例。例如： 2.551%在文件中用 0.02551 表示； 2.1%在文件中用 0.02100 表示。 此字段只有现金替代标志为‘1’时才有效
→	→ 申购替代金额	CreationCashSubstitute	N18(4)	当某只证券必须用现金替代的时候，申购时该证券所需总金额 此字段只有当替代标志为‘2’时才有效
→	→ 赎回替代金额	RedemptionCashSubstitute	N18(4)	当某只证券必须用现金替代的时候，赎回时对应该证券返还的总金额。 例如：2000 在文件中用 2000.0000

字段名称			字段英文名	类型	说明
					表示。对于跨境 ETF、跨市场 ETF、黄金 ETF 和现金债券 ETF，该字段为 0.0000。 此字段只有当替代标志为‘2’时才有效

3.10 网上发行认购业务参考信息 (issueparams)

文件 ID 为 issueparams，扩展名为 xml。

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

表 3-11 网上发行认购业务参考信息 issueparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
证券简称	Symbol	U40	
英文简称	EnglishName	C40	
正股代码	UnderlyingSecurityID	C8	仅适用于增发发行
总发行量	OutStandingShare	N18(2)	
证券类别	SecurityType	N4	
认购价格上限	PriceUpperLimit	N13(4)	
认购价格下限	PriceLowerLimit	N13(4)	
申购基数	Unit	N15(2)	申购数量必须为基数的整数倍
单笔申购上限	QtyUpperLimit	N15(2)	
单笔申购下限	QtyLowerLimit	N15(2)	
发行起始日	StartDate	N8	
发行结束日	EndDate	N8	
是否允许撤单	CancelPermit	C1	Y=是 N=否
是否允许重复申购	ReApplyPermit	C1	Y=是 N=否
证券属性	Attribute	N2	0=其他 1=创新企业股票 该字段仅适用于证券类别为 1、

			2、3 的证券
--	--	--	---------

如果当天没有发行业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

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

文件 ID 为 bonddistributionparams, 扩展名为 xml。

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

表 3-12 债券分销业务参考信息 bonddistributionparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
分销代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
证券简称	Symbol	U40	承销商名称
英文简称	EnglishName	C40	
基础证券代码	UnderlyingSecurityID	C8	债券上市挂牌代码
基础证券代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
证券类别	SecurityType	N4	
认购委托限量	QtyUpperLimit	N15(2)	
代为挂牌总量	ProxyListQty	N18(2)	
自行挂牌总量	SelfListQty	N18(2)	
分销起始日	StartDate	N8	
分销截止日	EndDate	N8	
承销商交易单元	BrokerPBU	C6	
投资者适当性管理分类	QualificationClass	N2	投资者适当性管理分类 0=包括公众投资者、合格投资者在内的所有投资者 1=仅合格投资者 2=仅合格投资者中的机构投资者

如果当天没有债券分销业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

3.12 配股业务参考信息 (rightsissueparams)

文件 ID 为 rightsissueparams, 扩展名为 xml。

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

表 3-14 配股业务参考信息 rightsissueparams.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
证券简称	Symbol	U40	
英文简称	EnglishName	C40	
基础证券代码	UnderlyingSecurityID	C8	配股代码对应的正股代码
基础证券代码源	UnderlyingSecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
配股价	Price	N13(4)	
认购基数	Unit	N15(2)	认购数量必须为基数的整数倍

如果当天没有配股业务也会发送一个不包含任何记录的 xml 文件。

3.13 国际市场互联状态信息 (imcparams)

文件 ID 为 imcparams，扩展名为 xml。

本信息包含国际市场互联状态的相关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，每个市场对应 xml 中的一条 market 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
市场代码	MarketID	C8	XHKG=港股通
是否开放	OpenFlag	C1	Y=是 N=否
初始额度	ThresholdAmount	N18(4)	

3.14 国际市场互联标的的信息 (imcsecurityparams)

文件 ID 为 imcsecurityparams，扩展名为 xml。

本信息包含国际市场互联标的的相关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，每个市场对应 xml 中的一条 security 记录。

字段名称	字段英文名	类型	说明
市场代码	MarketID	C8	XHKG=港股通
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	103 = 香港交易所

3.15 国际市场互联汇率信息 (imcexchangerate)

文件 ID 为 imcexchangerate，扩展名为 xml。

本信息包含国际市场互联汇率相关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，

每对货币的汇率对应一条 exchangerate 记录。

字段名	字段代号	类型	说明
源货币种类	FromCurrency	C4	HKD=港币 CNY=人民币
目标货币种类	ToCurrency	C4	HKD=港币 CNY=人民币
参考汇率买入价	BidRate	N15(5)	
参考汇率卖出价	OfferRate	N15(5)	
参考汇率中间价	MidPointRate	N15(5)	

注：

- 1) 本文件为国际市场互联交易日额度控制的预估汇率。
- 2) 本文件所有汇率均为一元源货币兑换目标货币价格，比如对于港股通业务，使用源货币种类为港币 HKD，目标货币种类为人民币 CNY 的记录来计算额度。

3.16 港股通交易参考信息

3.16.1 港股产品信息（hkexreff04）

文件 ID 为 hkexreff04，扩展名为 txt。

本信息包含港股产品的基础信息数据，该信息以 txt 文件的形式在交易日（T 日）开市前发布，每只证券对应一条记录，文件数据格式为：记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

文件由港交所生成，深交所转发。

序号	字段名	长度	字段描述
1.	参考数据类型	C5	R0401
2.	证券代码	C5	证券代码，不足五位左补零 例：00012
3.	ISIN 代码	C12	ISIN 代码（例：HK0000000012） 若该证券没有 ISIN 代码则填空
4.	中文证券简称	C40	证券名称 （简体中文，最多 8 个汉字，GBK 编码）
5.	英文证券简称	C15	英文证券简称
6.	英文全称	C40	英文证券全称
7.	辅助证券代码	C5	权证的正股代码
8.	市场种类	C4	MAIN- 主板 GEM-创业板 ETS-扩充交易证券 NASD-Nasdaq AMX 市场
9.	证券类别	C4	BOND Bond 债券

			BWRT Basket Warrant 一篮子权证 EQTY Equity 股本 TRST Trust 信托 WRNT Warrant 权证
10.	货币种类	C3	港币：HKD；美元：USD；人民币：CNY；澳币：AUD；加币：CAD；日圆：JPY；新加坡币：SGD；英镑：GBP；欧元：EUR
11.	货币单位	C1	货币单位表示前收盘价格字段的单位，当货币单位取值为0时，前收盘价格=前收盘价格字段取值×10的0次幂，当货币单位取值为1时，前收盘价格=前收盘价格字段取值×10的1次幂，依次类推
12.	面值	N15(8)	股票的面值，单位是元。若无面值，则为0 整数位不超过6位
13.	面值货币种类	C3	港币：HKD；美元：USD；人民币：CNY 若该产品无面值，则该字段为空。
14.	利息	N15(8)	对于债券填写交收日利息 仅针对利息通过CCASS系统来结算的债券，其他情况该字段为0
15.	上市日期	C8	在港交所首日交易日期，YYYYMMDD
16.	买卖单位	N6	整手股数（或张数或份数） 买卖申报数量必须是该字段的整数倍
17.	前收盘价格	N10(3)	当日除权（息）后收盘价格 （如有除权除息，为除权除息后收盘价）
18.	备注	C50	第一位有效Y表示停牌 N表示非停牌 第二位有效 Y表示参与市场波动调节机制 N表示不参与 第三位有效 Y表示参与收市竞价交易时段 N表示不参与 保留字段，无效

注：

1) 关于前收盘价格字段约定如下：

- 前收盘价格字段为 T-1 日（交易日）除权（息）后收盘价。
- 若 T-1 日停牌产品，T 日收到的本文件该产品的“前收盘价格”为 T-1 日（交

易日)本文件中该产品的“前收盘价格”的除权(息)价(若 T-1 日当天发生除权(息)事项),若 T 日又停盘,则依次递推。

- 2) 若 T 日摘牌产品, T 日收到的本文件不含该证券数据。
- 3) 证券代码唯一,不能为空。
- 4) 证券面值于香港结算系统中长度及格式:整数位为 8(包括小数点)及小数位为 5 (Round up)。在一般情况下,如该证券之实际面值少于小数点后 5 位数例如 0.000003,该证券面值会输入为最低数值 0.00001 或 0。
- 5) 因应公司行动(例如股份合并、分拆等),证券面值及证券面值货币种类会于行动生效日(交易日)早上更改并反映在当天此文件数据中,临时代码产品信息数据会在前一交易日包含于本文件中。

3.16.2 最小价差文件(hkexzxjc)

文件 ID 为 hkexzxjc,扩展名为 txt。

本信息包含港股各类产品的最小价差(也即申报价格的最小变动单位)信息数据,该信息以 txt 文件的形式在开市前发布,每类证券对应一条记录,文件数据格式为:记录采用行格式,字段以分隔符‘|’来区分,固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式,即通过 0x0A 表示换行。

文件由港交所生成,深交所转发。

序号	字段名	长度	字段描述
1.	参考数据类型	C5	R0403
2.	价差表代码	C2	价差代码,不足两位左补零 例: 01 - 股本证券 02 - 债务证券 03 - 股票期权
3.	最低下限价格	N10(3)	本价差表代码容许的最低成交价格
4.	最高上限价格	N10(3)	本价差表代码容许的最高成交价格
5.	起点价格	N10(3)	本价差表代码的最小价格
6.	价差组别数量	N2	以下为本价差表有的实际价差组别数量 (数量值由 1 到 52)
7.	价差组别:(重复共 52 组)		
7a	组别终点价格	N10(3)	本价差组别的最高价格

			当组别数大过价差组别数量时, 取值为 000000.000
7b	价差值	N6(3)	价差值是上一个组别终点价格(若第一个组别则为起点价格)与今个组别终点价格之间的价差 (例: 12.456) 当组别数大过价差组别数量时, 取值为 00.000
7c	价差数量	N6	本价差组别的价差数量 当组别数大过价差组别数量时, 取值为 000000

3.17 证券业务开关信息 (securityswitch)

文件 ID 为 securityswitch, 扩展名为 xml。

本信息包含所有业务涉及证券代码的相关业务开关信息。该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 每只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

表 3-15 证券业务开关信息 securityswitch.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所 103 = 香港交易所
证券业务开关	SecuritySwitch		一只证券可能具有 0 个或多个业务开关
→ 开关类别	Switch	N2	证券业务开关:
→ 开关是否打开	Status	C1	Y=是 N=否

注:

表 3-15-1 证券业务开关类型说明

开关类别	类别代码	说明
融资买入	1	适用于融资标的证券
融券卖出	2	适用于融券标的证券
申购	3	适用于 ETF, LOF 等开放式基金 对于黄金 ETF 是指现金申购
赎回	4	适用于 ETF, LOF 等开放式基金 对于黄金 ETF 是指现金赎回开关
认购	5	适用于网上发行认购代码

转股	6	适用于处于转股期的可转债、优先股；处于换股期的可交换私募债、可交换公司债
回售	7	适用于处于回售期的企业债、公司债、可转债、私募债、可交换私募债、证券公司次级债、资产支持证券、优先股、证券公司短期债、可交换公司债
行权	8	适用于处于行权期的权证或期权
买开仓	10	适用于期权等衍生品
卖开仓	11	适用于期权等衍生品
黄金ETF实物申购	12	适用于黄金ETF
黄金ETF实物赎回	13	适用于黄金ETF
预受要约	14	适用于处于要约收购期的股票
解除要约	15	适用于处于要约收购期的股票
转股撤单	18	适用于处于转股期的可转债、优先股；处于换股期的可交换私募债、可交换公司债
回售撤单	19	适用于处于回售期的企业债、公司债、可转债、私募债、可交换私募债、证券公司次级债、资产支持证券、优先股、证券公司短期债、可交换公司债
质押	20	适用于质押式回购可质押入库证券
解押	21	适用于质押式回购可质押入库证券
表决权	22	适用于优先股
股票质押式回购	23	适用于可开展股票质押式回购业务的证券
实时分拆	24	适用于分级基金
实时合并	25	适用于分级基金
备兑开仓	26	适用于期权等衍生品
做市商报价	27	适用于期权等支持做市商报价的证券
港股通整手买	28	适用于港股通标的证券
港股通整手卖	29	适用于港股通标的证券
港股通零股买	30	适用于港股通标的证券
港股通零股卖	31	适用于港股通标的证券

3.18 网络投票业务参考信息 (evoteparams)

网络投票业务参考信息文件的具体格式内容定义请参见《上市公司股东大会数据接口》。该文件只在晚间发布一次。

3.19 三方回购质押券篮子信息 (tripartyrepobasket)

文件 ID 为 tripartyrepobasket, 扩展名为 xml。

本信息包含债券质押式三方回购业务质押券篮子清单信息, 该信息以 XML 文件的形式在开市前发布, 一个篮子对应 xml 中的一条 basket 记录, 一个篮子中含多只证券代码。

字段名称	字段英文名	类型	说明
篮子编号	BasketID	N2	
篮子名称	Name	C20	
折扣率	Ratio	N5(4)	0.2500 表示 25%, 若债券估值为 X, 则折算后价值为: $X*(1-25\%)$
债券清单列表	SecurityList		
→ 证券代码	SecurityID	C8	

四、 风险控制信息

4.1 减持额度信息 (reducequota)

文件名为 reducequota_memberID_YYYYMMDD.csv, 其中 memberID 为交易参与人在深交所的会员 ID, YYYYMMDD 为对应的交易日。该文件在每个交易日开市前下发。

减持额度信息文件中的记录按照 (托管单元, 证券账户, 证券代码) 单调递增顺序排序。若交易参与人所有托管单元下的股份都不涉及减持控制, 则会下发一个记录数为 0 的空文件。

表 4-1 减持额度信息 reducequota_*.csv 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
托管单元	ClearPBU	C6	
证券账户	AccountID	C12	
证券代码	SecurityID	C8	
无限售流通股总数量	TotalQty	N18(2)	托管的无限售流通股总数量
无限售流通股冻结数量	FrozenQty	N18(2)	托管的无限售流通股中因各类非交易业务被结算冻结的股份数量
股份数量 1	ShareQty1	N18(2)	交易前端认定的期满前不可转让的股份数量, 已剔除被结算

			公司冻结的股份。 例如：大宗交易减持受让方获得的受限股份。
股份数量 2	ShareQty2	N18(2)	交易前端认定的受限股份数量，且仅可通过大宗交易减持的股份数量（减持时还必须满足减持额度要求），已剔除被结算公司冻结的股份。 例如：解除限售一年内的非公开发行股份 50% 部分。
股份数量 3	ShareQty3	N18(2)	交易前端认定的受限股份数量，且可通过竞价交易或大宗交易减持的股份数量（减持时还必须满足减持额度要求），已剔除被结算公司冻结的股份。
股份数量 4	ShareQty4	N18(2)	交易前端认定的非受限股份数量，可通过竞价交易或大宗交易减持，已剔除被结算公司冻结的股份。 例如：之前通过竞价交易买入的股份。
股份数量 5	ShareQty5	N18(2)	受限股份竞价交易可减持额度 = (1%-最近 89 个自然日竞价交易受限股份减持比例之和) * 公司总股本。
股份数量 6	ShareQty6	N18(2)	受限股份大宗交易可减持额度 = (2%-最近 89 个自然日大宗交易受限股份减持比例之和) * 公司总股本。
股份数量 1（含冻结）	OrigShareQty1	N18(2)	股份数量 1 剔除冻结前的数量
股份数量 2（含冻结）	OrigShareQty2	N18(2)	股份数量 2 剔除冻结前的数量
股份数量 3（含冻结）	OrigShareQty3	N18(2)	股份数量 3 剔除冻结前的数量
股份数量 4（含冻结）	OrigShareQty4	N18(2)	股份数量 4 剔除冻结前的数量

4.2 资金前端风险控制信息（fundquota）

文件名为 fundquota_memberID_YYYYMMDD.xml，其中 memberID 为交易参与人在深交所的会员 ID，YYYYMMDD 为对应的交易日。该文件在每个交易日开市前下发。

资金前端风险控制信息文件包含需要做资金前端风险控制的交易参与人的自设额度和纳入控制的交易单元列表，该信息以 XML 文件的形式在开市前发布，一个受控类别对应 xml 中的一条 monitor 记录。一个受控类别中包含多个交易单元，表明这些交易

单元需要做资金前端风险控制。此文件只用于交易参与者进行自设额度的核对。

表 4-2 资金规模控制信息 fundquota.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
受控类别	MonitorType	N2	1=会员自营类 2=会员资管类 3=机构业务类
自设额度	FundQuota	N18(4)	
交易单元代码列表	PBUList		
→ 交易单元	PBUID	C6	

五、 日终静态行情信息

该类信息主要包括在每个交易日收市后发布的静态行情信息文件。

5.1 现货证券收盘行情 (cashsecurityclosemd)

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

证券收盘行情文件中包含证券信息文件(securities)中的所有现货证券的收盘行情。该信息以 XML 文件的形式在交易日闭市后发布，一只证券对应 xml 中的一条 security 记录。

表 5-1 现货证券收盘行情 cashsecurityclosemd_*.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
证券简称	Symbol	U40	
英文简称	EnglishName	C40	对于期权填写合约代码
证券类别	SecurityType	N4	取值为除 29(个股期权)、30(ETF 期权) 外的证券类别
昨收价	PrevClosePx	N13(4)	
开盘价	OpenPrice	N13(4)	
收盘价	ClosePx	N13(4)	
成交笔数	NumTrades	N18	
成交总量	TotalVolumeTrade	N15(2)	
成交总金额	TotalValueTrade	N18(4)	

5.2 衍生品证券收盘行情 (derivativesecurityclosemd)

文件名为 derivativesecurityclosemd_YYYYMMDD.xml，其中 YYYYMMDD 为对应

的交易日。

证券收盘行情文件中包含证券信息文件（securities）中的所有衍生品证券的收盘行情。该信息以XML文件的形式在交易日闭市后发布，一只证券对应xml中的一条security记录。

表 5-2 衍生品证券收盘行情 derivativesecurityclosemd_*.xml 内容定义

字段名称	字段英文名	类型	说明
证券代码	SecurityID	C8	
证券代码源	SecurityIDSource	C4	102 = 深圳证券交易所
证券简称	Symbol	U40	
英文简称	EnglishName	C40	对于期权填写合约代码
证券类别	SecurityType	N4	取值为 29（个股期权）、30（ETF 期权）
昨收价	PrevClosePx	N13(4)	
开盘价	OpenPrice	N13(4)	
收盘价	ClosePx	N13(4)	
成交笔数	NumTrades	N18	
成交总量	TotalVolumeTrade	N15(2)	
成交总金额	TotalValueTrade	N18(4)	
结算价	ClearingPrice	N13(4)	
合约持仓量	ContractPosition	N18(2)	

5.3 港股收盘价格文件（hkexclpr04）

文件 ID 为 hkexclpr04，扩展名为 txt。

本信息包含港股产品的收盘价格数据，该信息以 txt 文件的形式在收市后发布，每只证券对应一条记录，文件数据格式为：记录采用行格式，字段以分隔符‘|’来区分，固定长度。该文件换行方式为 Unix 方式，即通过 0x0A 表示换行。

文件由港交所生成，深交所转发。

表 5-3 港股收盘价格文件内容定义

序号	字段名	长度	字段描述
1.	参考数据类型	C5	R0402
2.	证券代码	C5	证券代码
3.	收盘价格	N10(3)	
4.	货币种类	C3	港币：HKD；美元：USD；人民币：CNY；港币：

			AUD; 加币: CAD; 日圆: JPY; 新加坡币: SGD ; 英镑 : GBP ; 欧元: EUR
--	--	--	--

六、 日终回报数据

该类信息主要包括在每个交易日收市后批量发送的回报数据。

6.1 网络投票回报 (evotereport)

文件名为 evotereport_YYYYMMDD.csv, 其中 YYYYMMDD 为对应的交易日。

网络投票回报文件包含通过交易系统下达的网络投票委托的累计预处理结果, 例如某挂牌网络投票的时间为 $[V_1, V_n]$, 则在 V_m 日 ($1 \leq m \leq n$) 发送 V_1 至 V_m 日的所有通过交易系统下达的网络投票委托的处理结果。

该信息以 csv 文件的形式在交易日闭市后发布, 每条记录对应一条回报。

表 6-1 网络投票回报数据 evotereport_*.csv 内容定义

域名	类型	字段描述
SubmittingPBUID	C6	申报交易单元
SecurityID	C8	投票代码
SecurityIDSource	C4	证券代码源
OwnerType	N4	订单所有者类型
TransactTime	N17	原投票委托时间 格式为 YYYYMMDDHHMMSSsss
OrderID	C16	交易所订单编号
ClOrdID	C10	客户订单编号
ExecID	C16	执行编号
ExecType	C1	执行类型 0=New 有效投票记录 8=Rejected 无效投票记录
OrdRejReason	N5	拒绝原因代码, 执行类型为 8 时填写
AccountID	C12	证券账户
BranchID	C4	营业部识别码
VotingProposal	N4	投票议案号, 正数 1-99 表示具体议案号 100 表示总议案
VotingSubProposal	N4	投票子议案号或选举候选人, 正数 0 表示所有子议案

		>0 其他表示具体子议案
VotingPreference	C1	投票意向 1 代表同意, 2 代表反对, 3 代表弃权
OrderQty	N15(2)	投票数量

注:

- 1) 如对逐项表决议案下的部分子议案的有效申报早于对逐项表决议案的申报, 则对逐项表决议案的申报为部分有效, 返回多笔回报, 对之前已存在有效申报的每个子议案都产生一笔撤单回报, 对之前不存在有效申报的每个子议案都产生一笔申报有效回报。
- 2) 如投资者直接对所有议案提交“总议案投票”, 则视投票成功, 仅返回一笔成功回报; 如果投资者先对部分议案作了有效投票, 再提交“总议案投票”委托, 则该笔委托视为部分有效, 返回多笔回报, 对之前已存在有效申报的每个议案都产生一笔撤单回报, 对之前不存在有效申报的每个议案都产生一笔申报有效回报; 如果投资者先对所有议案作了有效投票, 再提交“总议案投票”委托, 则该笔委托视为重单, 返回一笔撤单回报。
- 3) 如股东大会互联网投票结束日晚于交易系统投票结束日, 且二者期间为非交易日 (例如, 交易系统投票结束日为周五, 互联网投票结束日为周日), 则于交易系统投票结束日的下一交易日回报交易系统投票的累计处理结果。
- 4) 如市场参与主体没有网络投票处理回报数据, 则给相应市场参与主体传送一记录数为 0 的文件。
- 5) 投票委托无效原因含义表

表 6-2 网络投票委托无效原因定义表

OrdRejReason	原因简称	具体含义
20201	议案代码错	1. 议案号需和公告中的普通议题代码完全相同; 2. 议案号和子议案号可以是公告中的逐项表决的总议题代码和子议题代码 3. 议案号需是公告中累积投票中表示候选人的议题代码 4. 除了上述范围, 其他议案号和子议案号输入都视为议案代码错, 特别是累积投票总议题代码作为议案号输入, 也视为议案代码错。
20202	表决意见错	对于普通议题和逐项表决, 投票意向只能是 1 或 2 或 3, 否则视为表决意见错。 对于累积投票, 投票数量应小于等于股东账户持股数乘以选出人数, 否则视为表决意见错。
20203	非参会股东	投票记录中的证券账户号不是股权登记日持有该上市公司股份的证券账户号, 视为非参会股东。
20204	重复投票	对同一议案的投票只能申报一次, 多次申报的, 以第一次有效申报为准, 第一次有效申报以后的申报都视为重复投票。

OrdRejReason	原因简称	具体含义
		如果对逐项表决议案的有效申报早于对逐项表决议案下某子议案申报，则对某子议案的申报视为重复投票。 如果对逐项表决议案下的所有子议案的有效申报都早于对逐项表决议案的申报，则对逐项表决议案的申报视为重复投票。 如某投资者通过交易系统和互联网投票系统重复投票的，统计投票结果时，按照时间优先顺序计算。 如果投资者先对部分议案作了有效投票，再提交“总议案投票”委托，则该笔委托视为部分有效，返回多笔回报，对之前已存在有效申报的每个议案都产生一笔撤单回报，视为重复投票。 如果投资者先对所有议案作了有效投票，再提交“总议案投票”委托，则该笔委托视为重复投票，返回一笔撤单回报。
20205	累积人数错	在对单条记录进行有效性判断后，进行累积判断。 有效的累积投票条数不应超过应选人数，否则视为累积人数错。
20206	累积股数错	在对单条记录进行有效性判断后，进行累积判断。 股东在股权登记日持有股份乘以应选人数，为其有的选举票数，如该股东所投票数大于其持有的选票数，则视为累积股数错。
20070	无效账户	不合格账户禁止通过交易系统进行网络投票
29999	其他错误	上述范围外的未知情况产生的无效票。

6.2 成交汇总文件（execution_aggr）

成交汇总文件提供文件形式的成交汇总服务。文件接口和流接口相比除了通道、格式方面有差异外，在记录内容和顺序上完全一致。

成交汇总文件名为 execution_aggr_TGWID_N_YYYYMMDD.tsv，其中 TGWID 为对应的成交汇总网关 ID，N 为业务平台代码（代码定义参见《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》），YYYYMMDD 为对应的交易日。深交所交易系统定义的每个业务平台对应一个成交汇总文件，如果该平台当天没有回报记录，则也会下发一个空文件。

成交汇总文件为文本文件，文件中的每条记录（一行）为一笔成交，记录内容定义参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》中的二进制成交消息定义，与二进制消息相比，除了消息头部分仅保留消息类型（MsgType）字段，且没有消息尾部分外，其他字段都是按照顺序一一对应。

tsv 文件格式规范见后面的“tsv 文件格式规范说明”一节。

以下面的现货集中竞价业务订单成交执行报告二进制消息为例：

表 6-3 现货集中竞价业务订单成交执行报告 BINARY 消息示例

域名	取值
MsgType	200115
BodyLength	149
ReportIndex	2
ApplID	010
ReportingPBUID	00100
SubmittingPBUID	000100
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	1
ClearingFirm	01
TransactTime	20130228144215555
UserInfo	test
OrderID	6B4569CDNB009C03
ClOrdID	A0000001
ExecID	1100000000004124
ExecType	F
OrdStatus	1
LastPx	171000
LastQty	30000
LeavesQty	90000
CumQty	30000
Side	1
AccountID	0100004698
BranchID	AA
CashMargin	1

对应到成交汇总文件中记录内容为(<T>代表 TAB 分隔符，<N>代表行分隔符)：

200115<T>2<T>010<T>00100<T>000100<T>000001<T>102<T>1<T>01<T>2013022
8144215555<T>test<T>6B4569CDNB009C03<T>A0000001<T>1100000000004124<T>F<
T>1<T>17.1000<T>300.00<T>900.00<T>300.00<T>1<T>0100004698<T>AA<T>1<N>

6.3 港股通成交单据文件（hkexecution_tax_memberID）

根据相关法规和业务要求，中国登记结算公司在每个交易日结算完成后，向深交所提供港股通的成交单据数据。深交所将以会员（含非会员，下同）为单位，在每个交易日收市后，向市场转发上述成交单据文件。

港股通成交单据文件格式为文本文件，文件名为：hkexecution_tax_memberID_yyyymmdd.tsv，其中，MemberID为各会员单位在深交所的会员ID，yyymmdd：表示对应交易日。无论当日有无深港通成交单据记录，都会下发成交单据文件（如果无深港通成交单据记录，则下发空文件内容）。

tsv文件格式规范见后面的“tsv文件格式规范说明”一节。

表 6-4 港股通成交单据文件内容定义

字段名	长度类型	字段说明
证券代码	C8	
制单日期	C8	YYYYMMDD 格式
成交日期	C8	YYYYMMDD 格式
执行编号	C16	
交易单元	C6	
成交数量	N15 (2)	
成交价格	N13 (4)	单位：港元
成交金额	N18 (4)	单位：港元
成交时间	C6	HHMMSS 格式
印花税	N18 (4)	单位：港元
交收日期	C8	YYYYMMDD 格式
说明 1	C80	此单据上的印花税款额，已经或将会通过香港联合交易所有限公司缴付
说明 2	C80	成交单据由深交所子公司根据联交所发送有关香港证券的成交结果予以制备及签立
说明 3	C80	深交所会员等机构委托深交所子公司将有关香港证券买卖订单路由至联交所进行及完成交易

七、数据类型说明

文件中字段的数据类型说明如下：

- ✓ Cx 表示 ASCII 字符串，x 表示最多字符数；
- ✓ Ux 表示 UTF-8 字符串，x 表示最多字符数；
- ✓ Nx 表示十进制整数，x 表示整数最大位数（不包括正负号），除非特别声明，整数类型均有正负；
- ✓ Nx(y)表示浮点数，x 表示整数与小数总计位数，不包括小数点，y 表示小数位数，小数位数不足时在后面补 0；除非特别声明，浮点数类型均有正负。

八、tsv 文件格式规范说明

tsv 文件格式规范说明如下：

- ✓ 记录的每个字段之间以 TAB（0x09）分隔，每条记录以行分隔符 0x0A 结束，首字段前和尾字段后不附加字段分隔符 TAB，最后一条记录后也附加行分隔符。
- ✓ 对于 Nx(y)定点数类型的字段内容带小数点，小数位补齐，整数位不足部分不左补空格，比如价格字段类型 N13(4)的示例为“15.2300”或“-14.0210”；整数型字段内容仅包含实际整数值，左右都不补空格，比如“1500”；char[x]字符串型字段内容包含字符串实际值去掉右边的空格部分。
- ✓ 市场参与者系统应能支持记录尾部扩展新的字段，不使用新扩展的字段时应能自动忽略新字段而不需做技术改造。

九、附件

9.1 减持额度信息示例

假设上市公司 A 的总股本为 250 万股，股东 B 持有上市公司 A 的 IPO 前股份 40000 股，解除限售 1 年以上的非公开发行股份 30000 股，解除限售 1 年以内的非公开发行股份 20000 股，6 个月内通过大宗交易受让的受限股份 8000 股，竞价交易买入的股份 3000 股，上述股份都没有被冻结也未减持过，则减持额度信息中各数量字段的值示例如下：

字段	数 量 (股)	备注
无限售流通股总数量	101000	持有的无限售流通股总量
无限售流通股冻结数量	0	当日无冻结
股份数量 1	8000	6 个月内通过大宗交易受让的受限股份 8000 股

股份数量 2	10000	解除限售 1 年以内的非公开发行股份 20000 股的 50% 部分
股份数量 3	80000	IPO 前股份 40000 股+解除限售 1 年以上的非公开发行股份 30000 股+解除限售 1 年以内的非公开发行股份 20000 股的 50% 部分
股份数量 4	3000	竞价交易买入的股份 3000 股
股份数量 5	25000	总股本为 250 万股*1%
股份数量 6	50000	总股本为 250 万股*2%
股份数量 1 (含冻结)	8000	6 个月内通过大宗交易受让的受限股份 8000 股
股份数量 2 (含冻结)	10000	解除限售 1 年以内的非公开发行股份 20000 股的 50% 部分
股份数量 3 (含冻结)	80000	IPO 前股份 40000 股+解除限售 1 年以上的非公开发行股份 30000 股+解除限售 1 年以内的非公开发行股份 20000 股的 50% 部分
股份数量 4 (含冻结)	3000	竞价交易买入的股份 3000 股

如股东 B 的持股有被冻结，则冻结的顺序为股份数量 1、股份数量 2、股份数量 3 大于股份数量 5 的部分、股份数量 4、股份数量 3 小于等于股份数量 5 的部分。下表列举了股东 B 在不同的无限售流通股冻结数量示例下的股份数量 1-4 的取值：

字段	冻结数量 5000 股	冻结数量 10000 股	冻结数量 30000 股	冻结数量 75000 股	冻结数量 80000 股
股份数量 1	3000	0	0	0	0
股份数量 2	10000	8000	0	0	0
股份数量 3	80000	80000	68000	25000	21000
股份数量 4	3000	3000	3000	1000	0
股份数量 1 (含冻结)	8000	8000	8000	8000	8000
股份数量 2 (含冻结)	10000	10000	10000	10000	10000
股份数量 3 (含冻结)	80000	80000	80000	80000	80000
股份数量 4 (含冻结)	3000	3000	3000	3000	3000

附件二：会员柜台系统前端监控及股份扣减规则

委托类型	前端监控通过条件	股份 1-4 扣减顺序	额度维护
现货集中竞价交易 卖委托 股票 ETF 申购 转融通证券出借	MIN (股份数量 3, 股份数量 5)+ 股份数量 4 >= 委托数量	(1) 股份数量 3 (2) 股份数量 4 注：对股份数量 3 的扣减量不能超过股份数量 5 (集中竞价减持额度范围内)。	扣减股份数量 5 (竞价交易可减持额度), 扣减数量同股份数量 3 扣减的数量
大宗交易卖委托 (受限股份转让)	MIN (股份数量 3+股份数量 2, 股份数量 6) >= 委托数量	(1) 股份数量 2 (2) 股份数量 3 注：股份数量 2、股份数量 3 的合计扣减量不能超过股份数量 6 (大宗交易减持额度范围内)。受让股份 6 个月之内不得转让。	扣减股份数量 6 (大宗交易可减持额度), 扣减数量同委托数量
大宗交易卖委托 (非受限股份转让)	股份数量 4 >= 委托数量	注：只能使用股份数量 4。	不占用减持额度，无需扣减