

上海证券交易所 LDDS 系统主参考数据接口说明书 技术开发稿

文档状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	LDDS 系统接口说明书主参考数据分册
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	1.0.2 (技术开发稿)
	<input type="checkbox"/> 修改	作者	市场数据部
	<input checked="" type="checkbox"/> 发布	发布者	上证所信息网络有限公司
	<input type="checkbox"/> 作废	完成日期	2023/09/11

文档变动说明

日期	版本	说明
2020-11-13	1.0.0	首次发布
2023-03-27	1.0.1	文件接口名称修改
2023-09-11	1.0.2	1. 补充数据更新频率说明，文件按照更新频率进行下发 2. 调整文件字段为空时，补一个空格字符

1. 引言

1.1 目的

文档介绍了 LDDS 系统中主参考数据的接入方式，详细说明了主参考数据的数据格式，以方便信息商接收主参考数据。

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主参考数据技术支持人员。

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 中获得主参考数据。

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

主参考数据包括如下：交易日期数据、证券基础数据、市场数据、交易参考数据、盘后参考数据和发行参考数据六大类别。

3.2 内容

表 3-1 主参考数据内容表

产品类别号	数据类别	文件名称	更新频率	更新时间
62	交易日期数据	交易日历 YYYYMMDD_TRADEDAY.txt	D	T+1 8:45
	证券基础数据	证券基础信息 YYYYMMDD_STOCKINFO.txt	D	T+1 8:45
		证券股本信息 YYYYMMDD_SHARECAPITAL.txt	D	T+1 8:45
		指数成分股信息 YYYYMMDD_CONSTITUENTINFO.txt	D	T+1 8:45
	市场数据	上市公司财务报表 YYYYMMDD_FINREPORT.txt	D	T+1 8:45
		上市公司财务指标 YYYYMMDD_FININDEX.txt	D	T+1 8:45
		ETF 申购赎回信息 YYYYMMDD_ETFMASTER.txt	D	T+1 8:45
		ETF 成分券信息 YYYYMMDD_ETFCONSTITUENT.txt	D	T+1 8:45
		周 ETF 申购赎回统计数据 YYYYMMDD_ETFSUBSTAT.txt	W1	T+1 8:45
		基金净值 YYYYMMDD_FUNDVALUE.txt	D	T+1 8:45
		债券回购标准券折算率 YYYYMMDD_BONDREPORATIO.txt	D	T+1 8:45
		可转债转股信息 YYYYMMDD_CONVERTBONDS.txt	D	T+1 8:45
	交易参考数据	历史停牌信息 YYYYMMDD_SUSP_HIS.txt	D	T+1 8:45
		分红配送数据 YYYYMMDD_RIGHTSDATA.txt	D	T+1 8:45
	盘后参考数据	市场成交概况 YYYYMMDD_TRDSTATIS_D.txt	D	T+1 8:45
		月度成交概况 YYYYMMDD_TRDSTATIS_M.txt	M5	T+1 8:45
		证券收盘数据 YYYYMMDD_CLSQUOT.txt	D	T+1 8:45
		大宗交易数据 YYYYMMDD_POSTRADE.txt	D	T+1 8:45
	发行参考数据	每日 IPO 数据 YYYYMMDD_ISSUE_D.txt	D	T+1 8:45
		本年度 IPO 统计数据 YYYYMMDD_ISSUE_M.txt	M5	T+1 8:45

更新频率和更新时间中字符含义如下：

D：每交易日。

WX：每周第 X 个交易日。

MX：每月第 X 个交易日。

T+1：第二个交易日。

各文件数据将按照上表“更新频率”字段下发。

3.3 数据格式

数据文件的文件命名格式为：YYYYMMDD_XXXXX.txt，各字段具体含义见表 3-2 所示。

表 3-2 数据文件格式说明表

文件名称含义	样例中的展示	说明
日期	YYYYMMDD	文件产生的日期，年月日。例：20111103
文件名称	XXXXX	固定的文件主题名称

数据文件格式规范见表 3-3 所示。

表 3-3 数据文件格式规范表

格式	类型	说明
字符集	无	txt 文件中的编码为 gbk，flg 文件为 utf8
文件头	无	不带 UTF - 8 的 BOM 头
记录分隔方式	换行	每条记录以换行结束(0A)
分隔符		竖线分隔符，开头和结尾字段不添加
小数符	.	小数点符号
千分分隔符	无	在千位，百万位等位置无千分分隔符
字段是否定长	否	字段不定长，长度以实际内容为准
是否为空	无	字段为空时，填充单个空格字符处理

4. 数据内容说明

4.1 交易日期数据

4.1.1 交易日历数据

交易日历数据的文件名称为 YYYYMMDD_TRADEDAY.txt，描述了沪市的交易日历，含交易日与非交易日。具体数据内容见表 4-1 所示。

表 4-1 交易日历数据文件格式

字段名称	字段中文名称	字段码值描述	格式及样例
DATE	日期		YYYYMMDD: 19000101
ISTRADE	是否交易	0 非交易日 1 交易日	字符格式: 1
DESCRIPTION	非交易日说明		字符格式: 一月一日
EXCHANGECODE	交易所代码		字符格式: SH

4.2 证券基础数据

4.2.1 证券基础信息

证券基础信息的文件名称为 YYYYMMDD_STOCKINFO.txt, 描述了沪市证券和中证指数的基础信息。具体数据内容见表 4-2 所示。

表 4-2 证券基础信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190410
SECODE	证券代码	字符格式: 600000
SYMBOL	ISIN 代码	字符格式: CNSH06000002
PROTYPE	产品类别	字符格式: EQUITY
SETYPE	证券类别	字符格式: ES 'ES'表示股票; 'EU'表示基金; 'D'表示债券; 'RWS'表示权证; 'FF'表示期货。(参考 ISO10962), 集合资产管理计划、债券预发行、定向可转债取'D'
SUBSETYPE	证券子类别	字符格式: ASH 自定义详细证券类别 参考: GBF 国债 GBZ 无息国债 DST 国债分销 (仅用于分销阶段) DVP 公司债 (地方债) 分销 CBF 企业债券 CCF 可转换企业债券 CPF 公司债券 (或地方债券) FBF 金融机构发行债券 CRP 质押式国债回购 BRP 质押式企债回购

		ORP 买断式债券回购 CBD 分离式可转债 OBD 其它债券 CEF 封闭式基金 OEF 开放式基金 EBS 交易所交易基金（买卖） OFN 其它基金 ASH 以人民币交易的股票 BSH 以美元交易的股票 CSH 国际版股票 OEQ 其它股票 CIW 企业发行权证 COV 备兑权证 FEQ 个股期货 FBD 债券期货 OFT 其它期货 AMP 集合资产管理计划 WIT 国债预发行 LOF LOF 基金 OPS 公开发行优先股 PPS 非公开发行优先股 QRP 报价回购 CMD 控制指令(中登身份认证密码服务产品复用 CMD 证券子类别)
EXCHANGECODE	市场代码	字符格式：SH
SENAME_FULL	中文全称	字符格式：浦发银行
SENAME	中文简称	字符格式：浦发银行
PINYIN	拼音简称	字符格式：PFYH
ENGNAME	英文简称	字符格式：SPD BANK
CUR	交易币种	字符格式：CNY 美元：USD；人民币：CNY；（参考ISO4217）
TOTALSHARE	总股本	字符格式：2935208.040000
CIRCSKAMT	流通股本	字符格式：2810376.390000
PARVALUE	面值	字符格式：1
PREPRICE	前收盘价	字符格式：11.2400
VALUECUR	面值币种	字符格式：CNY
ISSUEDATE	承销起始日	字符格式：19000101
LISTSTATUS	上市状态	字符格式：1 0：未上市（等待上市） 1：上市 2：退市 3：非上市

ISSUEPRICE	发行价	字符格式：10.0000
PAUSEDATE	暂停上市日期	字符格式：
LISTDATE	上市日期	字符格式：20080605
LISTOPRICE	上市首日开盘价	字符格式：29.5000
DELISTDATE	退市日期	字符格式：
DELISTCPRICE	退市前收盘价	字符格式：
LASTTRADDAE	最后交易日	字符格式：
FINANCFLAG	融资标的标志	字符格式：T ‘T’表示是融资标的证券 ‘F’表示不是融资标的证券
UNDERLYFLAG	融券标的标志	字符格式：T ‘T’表示是融券标的证券 ‘F’表示不是融券标的证券。
PRODUCTSTATUS	产品状态标志	字符格式： D F 该字段为 20 位字符串，每位表示含义如下，无定义则填充格。 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，‘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挂牌产品，无意义。 第 8 位对应：‘U’表示上市时尚未盈利的发行人的 股票或存托凭证，发行人首次实现盈利后，取消该 特别标识。该字段仅针对科创板产品有效。 第 9 位对应：‘W’表示具有表决权差异安排的发行 人的股票或存托凭证。该字段仅针对科创板产品有效。 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。
CSRCLEVEL1NAME	证监会行业	字符格式：金融业
GICSLEVEL1NAME	GICS 行业一级	字符格式：金融
SWLEVEL1NAME	申万行业一级	字符格式：银行
CSILEVEL1NAME	中证行业一级	字符格式：金融地产

HSILEVEL1NAME	恒生行业一级	字符格式：
PROVINCENAME	省级地区	字符格式：上海市
CITYNAME	市级地区	字符格式：

4.2.2 证券股本结构

证券股本结构的文件名称为 YYYYMMDD_SHARECAPITAL.txt，描述了沪市证券的股本结构信息。具体数据内容见表 4-3 所示。

表 4-3 证券股本结构文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
TRADE_DATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190331
SEC_CODE	证券代码	字符格式: 600283
LASTCHANGEDATE	最近一次变动日期	YYYYMMDD: 20190302
CHANGEREASON	变动原因	字符格式: 其他上市
TOTALSHARE	总股本	数字格式: 352995758.000000
NONTRADABLESHARE	非流通股	数字格式: 0.000000
FLOWSHARE	流通股本	数字格式: 352995758.000000
AUTHORIZEDSHARE	法定股本 (H 股)	数字格式: 0.000000
HSHARE	H 股股本 (H 股)	数字格式: 0.000000
EXCHANGECODE	交易所代码	字符格式: SH

4.2.3 指数成分股信息

指数成分股信息的文件名称为 YYYYMMDD_CONSTITUENTINFO.txt，描述了指数的成分股信息。具体数据内容见表 4-4 所示。

表 4-4 指数成分股信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190410
INDEXCODE	指数代码	字符格式: 000001
INDEXNAME	指数名称	字符格式: 上证指数
INDEXMARKET	指数所属市场	字符格式: SH
SECURITYCODE	成分股代码	字符格式: 600000
EXCHANGECODE	成分股所属市场	字符格式: SH
INDEXMARK	指数来源	字符格式: 上证系列 SSE

4.3 市场数据

4.3.1 上市公司财务报表

上市公司财务报表的文件名称为 YYYYMMDD_FINREPORT.txt, 描述了沪市证券的财务报表信息。按上市公司具体披露时间提供, 当日无数据时为空文件。具体数据内容见表 4-5 所示。

表 4-5 上市公司财务报表文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190331
SECURITYCODE	证券代码	字符格式: 600004
REPORTTYPE	报表季度 YYYYQ	字符格式: 20191
PUBDATE	发布日期	YYYYMMDD: 20190331
EXCHANGECODE	交易所代码	字符格式: SH
TOTALASSET	总资产	数字格式: 25523239604.14
CURRENTASSET	流动资产	数字格式: 2476215870.47,
FIXEDASSET	固定资产	数字格式: 0.00
OTHERASSET	其他无形资产	数字格式: 539303783.41
TOTALLIABILITY	负债合计	数字格式: 9523122713.21
CURRENTLIABILITY	流动负债合计	数字格式: 7977669285.65
TOTALEQUITY	归属于上市公司股东权益合计	数字格式: 15851920655.50
CAPITALRESERVE	资本公积金	数字格式: 6676758244.35
TOTALOPERREVENUE	主营业务收入	数字格式: 0.00
OPENPROFIT	主营业务利润	数字格式: 372623205.65
TOTALPROFIT	利润总额	数字格式: 333281784.31
NETPROFIT	归属上市公司股东的净利润	数字格式: 223593783.47
UNDISTRIBUTEDPROFIT	未分配利润	数字格式: 223593783.47
NETCASHFLOWOPER	经营现金流量净额	数字格式: 393182222.78
NETCASHFLOWINV	投资现金流量净额	数字格式: -456238208.96
NETCASHFLOWFINA	筹资现金流量净额	数字格式: -1324393503.08
CASHEQUINETINCR	现金及现金等价净增额	数字格式: -1387449489.26

4.3.2 上市公司财务指标

上市公司财务指标的文件名称为 YYYYMMDD_FININDEX.txt, 描述了沪市证券的财务指标信息, 按上市公司最新财报及相关指标计算。具体数据内容见表 4-6 所示。

表 4-6 上市公司财务指标文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190331
SECURITYCODE	证券代码	字符格式: 00001
REPORTTYPE	报表季度 YYYYQ	字符格式: 20184
PUBDATE	发布日期	YYYYMMDD: 20181231
EXCHANGECODE	交易所代码	字符格式: HK
REPORTFORMAT	会计报表格式（港股专有）	字符格式: ”
FORMERBASICEPS	上年度净利润/总股本（%）	数字格式: 8.675360
ESTIMATEDEPS	全年预估净利润/总股本（%）	数字格式: 8.675360
BVPS	每股净资产	数字格式: 99.243857
NETCASHFLOWPS	每股净现金流	数字格式: -4.776745
RETAINEDEARNINGPS	每股未分配利润	数字格式: 128.220856
NETINTERESTRATEOPER	经营净利率	数字格式: 332.720000
GROSSPROFITMARGIN	销售毛利率（%）	数字格式: 60.460000
MAINOPERPROFITMARGIN	主营业务利润率（%）	数字格式: 17.750000
OPERATINGPROFITMARGIN	营业净利润率（%）	数字格式: 16.810000
ANNUALROE	年化净资产收益率（%）	数字格式: 8.900000
CURRENTRATIO	流动比率（%）	数字格式: 1.550000
QUICKRATIO	速动比率（%）	数字格式: 1.440000
LONGTERMDTEBTEQUITYRATIO	长期负债股东权益比率（%）	数字格式: 29.671302
EQUITYRATIO	股东权益比率（%）	数字格式: 47.950000
ACCOUNTRECTURNOVER	应收帐款周转率（%）	数字格式: 17.990000
INVENTORYTURNOVER	存货周转率（%）	数字格式: 4.860000
OPERREVENUEYOY	营业收入同比增长（%）	数字格式: 11.510000
NETPROFITYOY	净利润同比增长（%）	数字格式: 6.830000
BASICEPSYOY	基本每股收益同比增长（%）	数字格式: 11.100000
OPERATINGPROFITYOY	营业利润同比增长（%）	数字格式: 29.640000
TOTALASSETYOY	总资产同比增长（%）	数字格式: 12.000000
EPS	每股收益	数字格式: 8.672358
LASTPARENETP	静态市盈率因子	数字格式: 33454200000.000000
NOWPARENETP	动态市盈率因子	数字格式: 33454200000.000000

4.3.3 ETF 申购赎回信息

ETF 申购股赎回信息的文件名称为 YYYYMMDD_ETFMASTER.txt, 描述了沪市 ETF 基金申购赎回情况。由基金公司提供并负责相关内容的真实准确性,

如信息与本所 8 点以后通过卫星发布的公告文件信息不一致，则以卫星发布的公告信息为准。具体数据内容见表 4-7 所示。

表 4-7 ETF 申购赎回信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20181210
ISINCODE	ETF 产品国际代码	字符格式: 01
FUNDINSTRUMENTID1	基金一级市场申赎代码	字符格式: 510011
FUNDINSTRUMENTID2	基金二级市场申赎代码	字符格式: 510010
FUNDNAME	基金名字	字符格式: 治理 ETF
FUNDCOMPANYNAME	基金公司名字	字符格式: 施罗德基金
UNDERLYINGINDEX	标的指数代码	字符格式: 000021
UNDERLYINGINDEXISINCODE	标的指数国际代码	字符格式: ”
CREATIONREDEMPTIONUNIT	每个篮子对应的 ETF 份数	字符格式: 1000000
TRADINGDAY	当前交易日	YYYYMMDD: 20181210
PRETRADINGDAY	前一交易日	YYYYMMDD: 20181207
NAVPERCU	前一日最小申赎单位净值	数字格式: 1012357.92
NAV	前一日基金份额净值	数字格式: 1.012
PRECASHCOMPONENT	前一日现金差额	数字格式: 989.92
CASHDIVIDEND	最小基金单位现金分红	数字格式: 0
ESTIMATEDCASHCOMPONENT	T 日每个篮子的预估现金差额	数字格式: 986.92
MAXCASHRATIO	总的现金替代比例	数字格式: 0.3
CREATIONLIMIT	当日申购限额	数字格式: 0
REDEMPTIONLIMIT	当日赎回限额	数字格式: 250000000
PUBLISHIOPVFLAG	用以表示单位净参考值是否需要公布的标志位	字符格式: Y 用以表示单位净参考值是否需要公布的标志位 Y - 由交易主机计算 IOPV 且通过行情发布 B - 交易主机不计算 IOPV 但要通过行情发布 N - 交易系统不计算 IOPV, 也无需通过行情发布 跨境 ETF, 此字段取值应为 B, 但系统不进行校验
CREATEREDEMPTIONSWITCH	申购/赎回切换	字符格式: 1

		0 - 不允许申购/赎回 1 - 申购和赎回皆允许 2 - 仅允许申购 3 - 仅允许赎回
RECORDNUMBER	成分券的数目	字符格式：100

4.3.4 ETF 成分券信息

ETF 成分券信息的文件名称为 YYYYMMDD_ETFCONSTITUENT.txt, 描述了沪市 ETF 基金成分股信息内容。由基金公司提供并负责相关内容的真实准确性, 如信息与本所 8 点以后通过卫星发布的公告文件信息不一致, 则以卫星发布的公告信息为准。具体数据内容见表 4-8 所示。

表 4-8 ETF 成分券信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190830
ISINCODE	ETF 产品国际代码	字符格式: ”
FUNDINSTRUMENTID1	基金一级市场申赎代码	字符格式: 510011
FUNDINSTRUMENTID2	基金二级市场申赎代码	字符格式: 510010
INSTRUMENTID	成分证券 ID	字符格式: 600000
INSTRUMENTNAME	成分证券简称	字符格式: 浦发银行
QUANTITY	证券数量	字符格式: 2600
SUBSTITUTIONFLAG	替代标志	字符格式: 1 表示该成份证券是否可被现金替代 0 - 沪市不可被替代 1 - 沪市可以被替代 2 - 沪市必须被替代 3 - 深市退补现金替代 4 - 深市必须现金替代 5 - 非沪深市场成份证券退补现金替代 6 - 非沪深市场成份证券必须现金替代
PREMIUMRATE	溢价比例	数字格式: 0.1
SUBSTITUTIONCASHAMOUNT	替代金额	数字格式: 0

4.3.5 周 ETF 申购赎回统计数据

周 ETF 申购股赎回数据的文件名称为 YYYYMMDD_ETFSUBSTAT.txt, 描述了沪市 ETF 的每周申购赎回数据统计。每周第 1 个交易日提供, 具体数据内容见表 4-9 所示。

表 4-9 周 ETF 申购赎回统计数据文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
STATDATE	统计日期	YYYYMMDD: 20110401
SECCODE	ETF 代码	字符格式: 510130
ECVOL	周申购份额 (亿份)	数字格式: 0.08
ERVOL	周赎回份额 (亿份)	数字格式: 7.23
CHGVOL	周净份额变动 (亿份)	数字格式: - 0.26

4.3.6 基金净值

基金净值的文件名称为 YYYYMMDD_FUNDVALUE.txt, 描述了基金净值及其他相关信息。基金代码与上交所代码系统有所不同, 数据来源于基金公司每日提供的 XBRL 文件。具体数据内容见表 4-10 所示。

表 4-10 基金净值文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
UPDATEDATE	更新日期	YYYYMMDD: 20110401
FUNDCODE	基金代码	字符格式: 510160
FUNDABBR	基金简称	字符格式: 小康 ETF
FUNDMNGR	基金管理人	字符格式: 南方基金管理有限公司
FUNDNAV	净值	数字格式: 0.8878

4.3.7 债券回购标准券折算率

债券回购标准券折算率的文件名称为 YYYYMMDD_BONDREPORATIO.txt, 描述了每日债券回购的标准券折算率。具体数据内容见表 4-11 所示。

表 4-11 债券回购标准券折算率文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
------	--------	-------

TRADEDATE	交易日期	YYYYMMDD: 20110401
SECCODE	证券代码	字符格式: 010107
SECABBR	证券简称	字符格式: 05 国债(12)
DISCRATE	标准券折算率	数字格式: 0.970

4.3.8 可转债转股信息

可转债转股信息的文件名称为 YYYYMMDD_CONVERTBONDS.txt，描述了沪市可转债转股信息。具体数据内容见表 4-12 所示。

表 4-12 可转债转股信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190410
BONDCODE	可转债代码	字符格式: 110030
SKCODE	转股代码	字符格式: 600185
CVTPRICE	转股价格	字符格式: 6.94
CBPRICE	转债价格	字符格式: 104.72
SKMARKET	转股市场	字符格式: 001002

4.3.9 北向证券标的列表

北向证券标的列表的文件名称为 YYYYMMDD_NTARGETLIST.txt，描述了 A 股通北向交易的证券标的列表。具体数据内容见表 4-13 所示。

表 4-13 科创板异常交易信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190410
REFDATATYPE	参考数据类型	字符格式: R0407
SECCODE	A 股证券代码	字符格式: 600000
TARGETTYPE	A 股通标的类型	字符格式: 1 1: A 股通标的(可买可卖)

4.4 交易参考数据

4.4.1 历史停牌信息

历史停牌信息的文件名称为 YYYYMMDD_SUSP_HIS.txt，描述了沪市上市证券截止 T 日的所有停牌信息。具体数据内容见表 4-13 所示。

表 4-14 历史停牌信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190410
SECCODE	证券代码	字符格式: 600360
SECABBR	中文缩写	字符格式: 华微电子
SUSPREASON	停(复)牌原因	字符格式: 配股
SUSPDATE	停牌起始日	YYYYMMDD: 20190404
RETRADDATE	复牌日	YYYYMMDD: 20190415
SUSPSTAT	停(复)牌状态	字符格式: 4 连续停牌类型处理说明: 如果证券代码在公司管理部《停复牌数据文件》的证券代码中,且使用日期在停牌起始日和停牌终止日间,则为‘4’,在有连续停牌情况下,未公布复牌日期的。数据使用日期大于等于停牌日期时,状态也为‘4’,在有复牌情况下,未公布停牌日期的,数据使用日期的小于复牌日期时,状态也为‘4’ 如果是(停牌终止日+1)交易日,则为‘3’; 临时停牌类型处理说明: 如果证券代码在公司管理部《临时停牌》的证券代码中,并且使用日期等于停牌日期,同时停牌期限=‘全天’则为‘1’, 如果停牌期限=‘9:30-10:30’则为‘2’,否则为‘0’(在有连续停牌情况下,公布停牌日期的,停牌日期小于数据使用日期,状态也为‘0’。) 状态说明: 0-其他; 1-全天停牌; 2-停牌 1 小时; 3-结束停牌; 4-连续停牌;
EXCHANGECODE	交易所代码	字符格式: SH

4.4.2 分红配送数据

分红配送数据的文件名称为 YYYYMMDD_RIGHTSDATA.txt，描述了沪市上市证券的历史分红配送信息。具体数据内容见表 4-14 所示。

表 4-15 分红配送数据文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
TRD_DATE	数据日期	YYYYMMDD: 20070625
SEC_CODE	证券代码	字符格式: 000629
SEC_NAME	证券名称	字符格式: 攀钢钒钛
EXCHANGECODE	交易所代码	字符格式: SZ
CORP_ANN_ALERT	公司行为提醒	字符格式: ”
BON_REG_DATE	股权登记日（送股）	YYYYMMDD: 20070622
BON_EX_DATE	红股除权日	YYYYMMDD: 20070625
BON_LIST_DATE	红股上市日	YYYYMMDD: 20070625
BON_RATIO	送股比例	数字格式: 0.100000000
CAPITAL_REG_DATE	股权登记日（转增）	YYYYMMDD: 20070622
CAPITAL_EX_DATE	转增除权日	YYYYMMDD: 20070625
CAPITAL_LIST_DATE	转增上市日	YYYYMMDD: 20070625
CAPITAL_RATIO	转增比例	数字格式: 0.100000000
DIV_REG_DATE	股权登记日（分红）	YYYYMMDD: 20070622
DIV_EX_DATE	分红除息日	YYYYMMDD: 20070625
DIV_PRICE	每股分红金额	数字格式: 0.100000000
RIGHT_OFFER_REG_DATE	股权登记日（配股）	YYYYMMDD: 20070625
RIGHT_OFFER_EX_DATE	配股除权日	YYYYMMDD: 20070625
RIGHT_OFFER_LIST_DATE	配股上市日	YYYYMMDD: 20070625
RIGHT_OFFER_PRICE	配股价格	数字格式: 0.100000000
RIGHT_OFFER_EXEC_RATIO	实际配股占比	数字格式: 0.100000000

4.4.3 科创板异常交易信息

科创板异常交易信息的文件名称为 YYYYMMDD_KSHABNINFO.txt，描述了科创板证券异常交易时的公开信息。具体数据内容见表 4-13 所示。

表 4-16 科创板异常交易信息文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
DATADATE	数据日期	YYYYMMDD: 20190410
TRADEDATE	交易日期	YYYYMMDD: 20190410
INDITYPE	指标类别	字符格式: Y6

		<p>Y3 科创板证券连续 10 个交易日内 3 次出现连续 3 个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计达到 30%</p> <p>Y4 科创板证券连续 10 个交易日内 3 次出现连续 3 个交易日内日收盘价格跌幅偏离值累计达到 30%</p> <p>Y5 科创板证券连续 10 个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计达到 100%</p> <p>Y6 科创板证券连续 10 个交易日内日收盘价格跌幅偏离值累计达到 50%</p> <p>Y7 科创板证券连续 30 个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计达到 200%</p> <p>Y8 科创板证券连续 30 个交易日内日收盘价格跌幅偏离值累计达到 70%</p> <p>G7 实施特别停牌的证券(本文件只给出 G7 的投资者分类成交信息)</p>
EXCEPTIONSTART	异常开始日期	<p>YYYYMMDD: 20190410</p> <p>对于 Y3、Y4, 为第一次 Y1/2 出现的开始日期; 例: 第一次 Y1/2 发生日为 20190514, 统计区间为 20190512-20190514, 则此处填写 20190512</p>
EXCEPTIONEND	异常结束日期	<p>YYYYMMDD: 20190410</p> <p>对于 Y3、Y4, 为第三次 Y1/2 出现的日期</p>
SECCODE	证券代码	字符格式: 600000
INSTRTYPE	证券类型	<p>字符格式: A</p> <p>A-科创板 A 股</p> <p>C-科创板 CDR</p> <p>证券类型不参与证券排名排序</p>
ABBREVIATIONS	证券简称	字符格式: 浦发银行
RANKING	证券排名	数字格式: 1
INDICATORS	证券指标值	<p>数字格式: 0.28</p> <p>对于 Y3, Y4, 此指标不展示</p>
VOLUME	证券区间成交数量	<p>数字格式: 18</p> <p>单位为股, 区间指异常开始到异常结束之间; 对 Y3、Y4 需计算其第一次异动区间开始日至第三次异动发生日的成交数量</p>

TURNOVERS	证券区间成交金额	数字格式：2000 单位为元，区间指异常开始到异常结束之间；对 Y3、Y4 需计算其第一次异动区间开始日至第三次异动发生日的成交金额
DIRECTIONS	买卖方向	字符格式：B B：买 S：卖
CLASSIFICATION	投资者分类类型	字符格式：A00 自然人:A00 中小投资者:A10 其他自然人:A20 机构:D00 沪股通:H00
INVESTORS	投资者分类描述	字符格式：自然人 自然人；中小投资者；其他自然人；机构；沪股通
TRADING	投资者分类区间交易数量	字符格式：20
AMOUNT	投资者分类区间交易金额	数字格式：2888.88
ACCOUNTED	投资者分类区间交易金额 市场占比	数字格式：0.26

4.5 盘后参考数据

4.5.1 市场成交概况

市场成交概况的文件名称为 YYYYMMDD_TRDSTATIS_D.txt，描述了沪市各类型证券盘后日统计数据，统计范围包括竞价交易平台，固定收益平台和大宗交易平台的数据。具体数据内容见表 4-15 所示。

表 4-16 市场成交概况文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
TRADEDATE	交易日期	YYYYMMDD: 20110401
SECTYPEDESC	证券类型描述	字符格式：国债买断式回购
TOTMKTVAL	市价总值（亿元）	数字格式：189149.13
TRADEVOL	成交量（万股）	数字格式：555692.09
TRADEAMT	成交金额（亿元）	数字格式：1342.23
TOTFLTVAL	流通市值（亿元）	数字格式：152477.96
AVGPERATIO	平均市盈率	数字格式：22.77

4.5.2 月度成交概况

月度成交概况的文件名称为 YYYYMMDD_TRDSTATIS_M.txt，描述了沪市各类型证券月度成交概况，统计范围包括竞价交易平台，固定收益平台和大宗交易平台的数据，统计截止时间为月末最后一个交易日，B 股以美元计算。每月第 5 个交易日提供。具体数据内容见表 4-16 所示。

表 4-16 月度成交概况文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
STATDATE	统计日期	YYYYMMDD: 20110401
SECTYPEDESC	证券类型描述	字符格式: A 股
TRADEVOL	成交量	数字格式: 127977.89
TRADECNT	成交笔数	数字格式: 18733.28
TRADEAMT	成交金额	数字格式: 36920.00
HIGHCNT	最高成交笔数	数字格式: 1035.98
HIGHCNTDATE	最高成交笔数发生日期	YYYYMMDD: 20110401
LOWCNT	最低成交笔数	数字格式: 630.12
LOWCNTDATE	最低成交笔数发生日期	YYYYMMDD: 20110401
HIGHTRADEVOL	最高成交量	数字格式: 1679316.44
HIGHTRADEVOLDATE	最高交易量发生日期	YYYYMMDD: 20110401
LOWTRADEVOL	最低交易量	数字格式: 946168.88
LOWTRADEVOLDATE	最低交易量发生日期	YYYYMMDD: 20110401
HIGHTRADEAMT	最高成交金额	数字格式: 2074.72
HIGHTRADEAMTDATE	最高成交金额发生日期	YYYYMMDD: 20110401
LOWTRADEAMT	最低成交金额	数字格式: 1199.09
LOWTRADEAMTDATE	最低成交金额发生日期	YYYYMMDD: 20110401

4.5.3 证券收盘数据

证券收盘数据的文件名称为 YYYYMMDD_CLSQUOTE.txt，描述了沪市单只证券的盘后统计数据，统计范围仅包括竞价交易平台，不含固定收益平台和大宗交易平台的数据。具体数据内容见表 4-17 所示。

表 4-17 证券收盘数据文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
TRADEDATE	交易日期	YYYYMMDD: 20110401

SECCODE	证券代码	字符格式：600002
PRECLOSEPRICE	昨收盘价	数字格式：22.7700
OPENPRICE	开盘价	数字格式：22.4700
HIGHPRICE	最高价	数字格式：22.9000
LOWPRICE	最低价	数字格式：22.3700
CLOSEPRICE	今日收盘价格	数字格式：22.6500
TRADECNT	成交笔数（笔）	数字格式：200231
TRADEVOL	成交总量（万）	数字格式：12500.02
TRADEAMT	成交总金额（万元）	数字格式：2250.23

4.5.4 大宗交易数据

大宗交易数据的文件名称为 YYYYMMDD_POSTRADE.txt，描述了沪市单只证券的当日大宗交易统计数据。具体数据内容见表 4-18 所示。

表 4-18 大宗交易数据文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
TRADEDATE	交易日期	YYYYMMDD: 20110401
SECCODE	证券代码	字符格式：600002
TRADEPRICE	大宗交易价格	数字格式：22.770
TRADEVOL	大宗交易成交量	数字格式：56000
SELLBRANCHNAME	卖出方营业部全称	字符格式： 中信证券有限公司上海市吴淞路营业部
BUYBRANCHNAME	买入方营业部全称	字符格式： 中信证券有限公司上海市吴淞路营业部
IF_DS	是否专场	字符格式：0 0：不是 1：是

4.6 发行参考数据

4.6.1 每日 IPO 数据

每日 IPO 数据的文件名称为 YYYYMMDD_ISSUE_D.txt，描述了沪市 A 股每日新股发行数据。具体数据内容见表 4-19 所示。

表 4-19 每日 IPO 数据文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
------	--------	-------

TRADEDATE	数据日期	YYYYMMDD: 20110401
SECCODE	证券代码	字符格式: 600255
SECABBR	证券简称	字符格式: 紫金矿业
ISSUECODE	网上定价发行申购代码	字符格式: 700255
ISSUEDATE	网上定价发行日期	YYYYMMDD: 20110801
ISSUEPRICE	网上定价发行价格	数字格式: 38.200
ISSUEVOL	网上发行数量	数字格式: 7500.00
PRICINGVOLLIMIT	网上定价发行申购上限 (万股)	数字格式: 2.4000
ISSUEPERATIO	发行摊薄市盈率	数字格式: 67.20
ISSUEPERATIO2	发行加权市盈率	数字格式: 67.20
ALLOTRATIO	发行中签率 (%)	数字格式: 1.23
LEADUNDERWRITER1	主承销商 1	字符格式: 兴业证券有限公司
LEADUNDERWRITER2	主承销商 2	字符格式: 兴业证券有限公司
LEADUNDERWRITER3	主承销商 3	字符格式: 兴业证券有限公司
LEADUNDERWRITER4	主承销商 4	字符格式: 兴业证券有限公司
LEADUNDERWRITER5	主承销商 5	字符格式: 兴业证券有限公司
LEADUNDERWRITERRE P	主承销商保荐人代表 1	字符格式: 兴业证券有限公司保 荐人 XXX
LEADUNDERWRITERRE P2	主承销商保荐人代表 2	字符格式: 兴业证券有限公司保 荐人 XXX

4.6.2 本年度 IPO 统计数据

本年度 IPO 统计数据的文件名称为 YYYYMMDD_ISSUE_M.txt，描述了年初至今的市场 IPO 及市场增发的统计数据，统计截止日为月末最后一个交易日。每月第 5 个交易日提供。具体数据内容见表 4-20 所示。

表 4-20 本年度 IPO 统计数据文件格式

字段名称	字段中文名称	格式及样例
SYMBOL	证券代码	字符格式: 600087
SESNAME	证券简称	字符格式: 长航油运
ONLSUBCODE	申购代码	字符格式
ONLSUBSNAME	申购名称	字符格式
EXCHANGE	交易市场	字符格式
UWBEGDATE	承销起始日	YYYYMMDD: 20110303
UWENDDATE	承销截止日	YYYYMMDD: 20110303
ONLSUBBEGDATE	网上申购起始日	YYYYMMDD: 20110303
ONLSUBENDDATE	网上申购截止日	YYYYMMDD: 20110303
SECMKPLADATE	二级市场配售日	YYYYMMDD: 20110303

LISTPUBDATE	上市公告日	YYYYMMDD: 20110303
LISTDATE	上市日期	YYYYMMDD: 20110303
ACTISSQTY	发行数量	数字格式: 2750000
ISSPRICE	发行价格	数字格式: 5.630
ACTTOTRAISEAMT	募集金额	数字格式: 154825.00
PEAFT	发行市盈率（摊薄法）	数字格式: 36.47
ISSUEMODE	发行方式	字符格式: 定向募集
LEADUWER	主承销商	字符格式: 民生证券有限责任公司
ONLLOTWINRT	网上发行中签率	数字格式: 0.4785

5. 枚举值说明

字段	枚举值	说明
EXCHANGE EXCHANGECODE	SH	沪市
	SZ	深市
	HK	港股
	BJ	新三板
	DCE	大商所
	CZCE	郑商所
	SHFE	上期所
	CFE	中金所