

上海证券交易所 LDDS 系统固定收益行情 接口说明书

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	LDDS 系统接口说明书固定收益行情分册
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	1.0.6
	<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	2022/05/09

文档变动说明

日期	版本	说明
2018-05-14	1.0.0	首次发布
2019-11-11	1.0.1	延长交易时间从 15:00 到 15:30
2020-10-16	1.0.2	1. 调整各个行情文件说明内容 2. 因非交易业务类型替换辅助代码，将证券信息文件中“质押券代码”字段废除
2021-03-24	1.0.3	1. 增加公募 REITs 产品及相关说明 2. 完善字段说明，文中所述“基金”包含公募 REITs
2021-07-05	1.0.4	针对成交明细文件中成交方式字段进行修改 1. 修改“指定对手方”为“指定对手方（含合并申报）” 2. 增加“竞买”
2021-09-23	1.0.5	1. 成交行情中对涉及的成交方式进行补充（仅文档修订，不涉及程序修改） 2. 证券信息中增加公募可转债相关内容 3. 成交行情和证券信息文件中对公募可转债昨日加权平均价进行说明
2022-05-09	1.0.6	成交行情和成交明细文件中增加竞买、合并申报业务相关描述

1. 引言

1.1 目的

固定收益证券综合电子平台（以下简称“固定收益平台”）是上海证券交易所为适应中国固定收益市场快速发展的环境，提高固定收益市场流动性，而建设的一套交易与信息紧密结合的电子平台系统。它定位于机构间市场，引入了一级交易商做市机制，为国债等固定收益产品提供高效、低成本的批发交易平台。

文档介绍了 LDDS 系统中固定收益行情的接入方式，详细说明了固定收益实时数据的数据格式，以方便信息商接收固定收益行情。

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固定收益行情技术支持人员。

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

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，要求通过上交所 LDDS 系统接收固定收益行情数据，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 中获得固定收益行情数据。

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

在上海证券交易所固定收益平台交易的所有证券。债券质押式回购业务只包含证券信息及成交行情。

3.2 内容

固定收益行情提供四类行情文件落地：确定报价、成交行情、成交明细、证券信息。具体文件名如下：

文件内容	文件名
确定报价	se015qdbjyyyyymmdd001.txt
成交行情	se015cjhqyyyyymmdd001.txt
成交明细	se015cjmxyyyyyymmdd001.txt
证券信息	se015zqxxyyyyyymmdd001.txt

由于上述文件的刷新频率较高且没有标志文件，为避免读写冲突，规定如下：

1、每个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；实际记录内容从文件的第二行开始。每行的换行符为“0x0D0A”。

2、固定收益平台在刷新行情内容前，首先清空第一行内容，说明该文件正处于刷新状态；完成刷新后，根据本次实际情况，回填第一行内容，作为刷新完成的标志。

3、接收行情方，必须以只读方式打开上述文件，并且在内容读取完成后，及时关闭。若一直保持在打开状态，会影响系统的行情刷新。

4、确定报价、成交明细行情文件在开盘时首次生成。首次生成时如当日还无相关数据，则文件中第一行“记录数”字段填“0”。

3.3 时间表

每个交易日 8:45—15:30 发送。

4. 文件说明

4.1 确定报价

系统开盘后开始刷新，若刷新时间段内报价数据没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	证券代码	TEXT	6	
2	证券简称	TEXT	30	
3	买入订单编号	TEXT	10	
4	买入报价时间	TIME	8	HHMMSS, 前补空
5	买入报价方	TEXT	10	交易商简称
6	买入价（净价）	NUMBER	10	单位：厘 对于基金，代表买入价
7	买入数量	NUMBER	10	单位：手 对于基金，单位为“份”
8	买入全价	NUMBER	10	单位：厘
9	买入到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 如：2.1234 对于基金无效
10	卖出订单编号	TEXT	10	
11	卖出报价时间	TIME	8	HHMMSS, 前补空
12	卖出报价方	TEXT	10	交易商简称
13	卖出价（净价）	NUMBER	10	单位：厘 对于基金，代表卖出价
14	卖出数量	NUMBER	10	单位：手 对于基金，单位为“份”
15	卖出全价	NUMBER	10	单位：厘
16	卖出到期收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 对于基金无效
17	应计利息	NUMBER	10	单位：0.1 厘 对于基金无效

说明：

- a. 在确定报价行情文件中，按照每个证券的代码从小到大依次排列各证券的所有当前报价。
- b. 在每个证券的报价记录中，分别按最优买、卖报价的方式排序。
- c. 在报价记录中，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，在数量一栏显示冰山订单值，而不是实际数量。
- d. 在报价记录中，如果是匿名报价，则在报价方一栏显示“匿名”。

4.2 成交行情

系统开市后开始刷新，不论在刷新时间段内成交数据有无变化，该文件都会被刷新。

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	证券简称	TEXT	30	对债券质押式协议回购、三方回购，为回购简称
3	时间	TIME	8	HHMMSS，前补空
4	昨日收盘价	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。债券质押式协议回购、三方回购中利率的填写规则下同。
5	昨日加权平均价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购、三方回购，为上一交易日该品种所有成交的加权平均利率 对公募可转债，为上一交易日竞价收盘价
6	当日开盘价	NUMBER	10	单位：厘 当日开盘后的第一笔成交价格；若当日无成交，则为零 对债券质押式协议回购、三方回购，

序号	字段	数据类型	长度	格式
				为回购利率
7	当日最高价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购、三方回购，为回购利率
8	当日最低价	NUMBER	10	单位：厘 对债券质押式协议回购、三方回购，为回购利率
9	当日最新价	NUMBER	10	单位：厘 当日最新的一条成交的价格，收盘后为收盘价；若当日无成交，则为零 对债券质押式协议回购、三方回购，为回购利率
10	当日加权平均价	NUMBER	10	单位：厘 累加该证券（每笔成交的价格乘以该笔成交数量）之和 除以（总成交数量） 对债券质押式协议回购、三方回购，为当日该品种所有成交的回购利率，用成交金额作为权重的加权平均利率，即 $(\sum(\text{成交金额} * \text{回购利率})) / \sum \text{成交金额}$ ，其中成交金额包含成交申报和到期续做合约新开。精确到%小数点后 3 位
11	当日总成交量	NUMBER	10	单位：手 对于基金，单位为“份” 对债券质押式协议回购、三方回购无效
12	当日总成交金额	NUMBER	10	单位：万元（四舍五入到万） 累加该证券（每笔成交的价格乘以该笔成交数量）之和 对债券质押式协议回购、三方回购为 $\sum(\text{成交金额})$ ，其中成交金额包含成交申报和到期续做合约新开。单位：万元（四舍五入到万元）
13	当日总成交笔数	NUMBER	10	

序号	字段	数据类型	长度	格式
14	昨日收盘收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数） 14~20 对债券质押式协议回购、三方回购无效 14-20 对基金无效
15	昨日加权平均收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数）
16	当日开盘收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数）
17	当日最高收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数）
18	当日最低收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数）
19	当日最新收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数）
20	当日加权平均收益率	NUMBER	10	百分数（4位小数）

说明：

a. 在成交行情文件中，按照每个证券的代码从小到大依次排列各证券的当前成交行情，每个证券一条记录。

b. 每个证券的统计行情包含了由确定报价、待定报价、询价、指定对手方、协议回购、三方回购、**竞买**、**合并申报**等方式达成的成交，但不包括协议交易、应急交易达成的成交。

c. 在行情记录中，所有价格均为净价。

d. 不包含特定债券成交数据。

4.3 成交明细

系统开盘后开始刷新，若刷新时间段内成交数据没有发生变化，则该文件不会被刷新，否则该文件被全量覆盖。

序号	字段	数据类型	长度	格式
1	证券代码	TEXT	6	
2	证券简称	TEXT	30	
3	成交日期	DATE	8	YYYYMMDD
4	成交时间	TIME	6	HHMMSS

5	成交净价	NUMBER	10	单位：厘 对于基金，代表成交价格
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 对于基金，单位为份
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：确定报价成交 2：待定报价成交 3：询价成交 5：场务应急 6：指定对手方（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、协议交易、指定对手方、**竞买**、**合并申报**等方式达成的成交。
- c. 不包含特定债券成交数据。

4.4 证券信息

每个交易日 8:30 前生成。系统开盘后该文件开始刷新，该文件总是被全量覆盖。

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	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
4	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
5	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
6	质押券代码	TEXT	6	无效
7	开盘时间	TIME	6	HHMMSS 对债券质押式协议回购、三方回购适用
8	收盘时间	TIME	6	HHMMSS 对债券质押式协议回购、三方回购适用
9	证券发行方式	TEXT	1	A: 付息 Z: 零息/贴现 P: 一次还本付息

10	证券面额	NUMBER	10	单位：厘 对基金无效
11	发行价格	NUMBER	10	单位：厘
12	利息类型	TEXT	1	X: 固定利率 F: 浮动利率 12-20 对基金无效
13	付息频率	TEXT	1	Y: 年付 H: 半年付 Q: 季付
14	票面利率/保底利率	NUMBER	10	单位：厘
15	基本利率	NUMBER	10	单位：厘 当前付息周期的基本利率
16	基本利差	NUMBER	10	单位：厘
17	期限	NUMBER	3	单位：年
18	实际发行总量	NUMBER	6	单位：亿元
19	发行开始日期	DATE	8	YYYYMMDD
20	发行结束日期	DATE	8	YYYYMMDD
21	上市日期	DATE	8	YYYYMMDD
22	到期日期	DATE	8	YYYYMMDD 22-28 对基金无效
23	国债类型	TEXT	1	A: 记帐式 R: 实物式 V: 凭证式
24	发行方法	TEXT	1	S: 包销 R: 代销 B: 招标 O: 其他
25	是否跨市场	TEXT	1	Y: 跨市场 N: 不跨市场
26	能否做空	TEXT	1	Y: 可以做空 N: 不能做空

27	总做空额度	NUMBER	10	单位：手
28	交易商做空额度	NUMBER	10	单位：手
29	上日收盘价	NUMBER	10	单位：厘
30	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：

a. 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。

b. 因“非交易业务类型替换辅助代码”而将证券信息中“质押券代码”字段废除。“质押券代码”不再有效，字段值为空。