

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所互联网交易平台  
市场参与者接口规格说明书  
(销售机构卷)  
V1.121



上海证券交易所

二〇二二年七八月

## 文档版本

日期	版本	状态	说明
2021-08	V0.1	开发稿	创建文档
2021-09	V0.2	开发稿	增加基金通业务相关接口
2021-11	V0.21	开发稿	<p>1、修订公共报文头响应参数：通讯返回错误描述为 <b>message</b>；</p> <p>2、订单结果查询（<b>get_order_results</b>）请求参数： 当前最大索引编号字段备注修改：上一次拉取到的最大索引编号，默认每日从 0 开始；响应参数索引编号：默认每日从 1 开始编号；</p> <p>3、订单结果查询接口补充说明：处理类型为 2 自动撤单时，申请单编号为撤单申报的原申请单编号；</p> <p>4、修改文件接口产品基础信息第一版第一批次为产品基础信息第二版第一批次</p> <p>5、开通交易所账户接口个人证件类型及机构证件类型字段 <b>certicateType</b> 修订为：<b>certificateType</b></p> <p>6、补充幂等校验判断逻辑及公共报文头字段约束</p>
2022-02	V0.22	开发稿	<p>1、调整开通交易所账户中投资人姓名字段定义长度为 C200</p> <p>2、完善订单结果查询接口处理类型字段说明：处理类型为 1 主动撤单，为用户发起的撤单申报，结果查询返回的申请单编号为用户发起撤单指令时的申请单编号；处理类型为 2 自动撤单，为系统触发撤单，结果查询返回的申请单编号为该笔申报的原始申请单编号。</p>

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

			3、完善订单结果查询接口订单数量字段说明：处理类型为 0 成交时，表示成交数量；处理类型为 1,2,3 时表示当前订单剩余未成交数量；若撤单失败，则订单数量为 0，表示当前订单无剩余可撤数量。
2022-02	1.00	正式稿	
2022-03	1.10	开发稿	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 增加询价申报、询价报价查询、报价回复接口；</li> <li>2. 订单撤销接口补充说明，可支持询价撤单；</li> <li>3. 份额过户文件补充说明，包含询价交易；</li> <li>4. 修订笔误，行情查询接口市场行情状态字段为 mdSesStatus</li> </ol>
2022-07	1.11	开发稿	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 点击成交报价回复响应参数中增加“网点代码”字段，修改买卖方向字段类型为 C1，成交编号字段类型为 C16；</li> <li>2. 匹配成交报价回复响应参数中增加“网点代码”字段，修改买卖方向类型为 C1，成交编号字段类型为 C16；</li> <li>3. 修改“订单申报”为“新订单申报”；</li> <li>4. 订单结果查询“处理类型”字段增加字典项“4 超时撤单”用于返回询价超时信息，增加“业务类型”字段，通过该接口查询询价撤销结果，包括主动撤销和因超时引起的撤销；</li> <li>5. 订单结果查询修改字段“订单类型”、“挂单类型”为非必填，同时补充说明报价交易时该字段必填，询价交易时字段无效；</li> </ol>
<u>2022-08</u>	<u>1.12</u>	<u>正式稿</u>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. <u>公共报文头产品集字段调整为非必填，其中订单结果查询、询价报价查询接口 setId 必填；</u></li> <li>2. <u>询价申报中订单价格上下限字段，增加字段说明“预留，暂不启用”；</u></li> <li>3. <u>匹配成交中交易数量增加备注，交易数量即为</u></li> </ol>

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

			<u>匹配成交最终确认数量，若未填写则默认按询价申报的订单数量；</u>
--	--	--	--------------------------------------

目录

1. 实时报文格式约定 .....	6
1.1. 报文通讯模式 .....	6
1.2. 数据类型约定 .....	6
1.3. 公共报文头定义 .....	6
1.4. 请求和返回示例 .....	7
2. 实时通讯类接口 .....	8
2.1. 开通交易所账户 (/account/new_account) .....	8
2.2. 新订单申报 (/trade/new_order) .....	10
2.3. 订单结果查询 (/trade/get_order_results) .....	11
2.4. 行情查询 (/mktdata/get_snapshot) .....	13
2.5. 订单撤销 (/trade/cancel_order) .....	16
2.6. 询价申报 (/trade/new_quote_request) .....	17
2.7. 询价报价查询 (/trade/get_quotes) .....	18
2.8. 点击成交报价回复 (/trade/click_quote) .....	19
2.9. 匹配成交报价回复 (/trade/match_quote) .....	21
3. 文件类接口规范 .....	22
3.1. 数据类型约定 .....	22
3.2. 标志文件 .....	23
4. 文件类接口 .....	24
4.1. 产品基础信息第二版第一批次文件 (cpxx0201MMDD.txt) .....	24
4.2. 账户申请对账文件 (khXXXXXX.txt) .....	27
4.3. 份额过户文件 (ofghXXXXXX.txt) .....	28
4.4. 产品与销售机构对应关系文件 (xsscpxxMMDD.txt) .....	29
4.5. 产品与做市商对应关系文件 (zsscpxxMMDD.txt) .....	30
5. 附录 .....	30
5.1. 返回码列表 .....	30

# 1. 实时报文格式约定

## 1.1. 报文通讯模式

上交所与销售机构之间的所有数据报文均采用 HTTPS 协议进行加密通信, 通过 POST+JSON 方式提交报文, 报文采用 UTF-8 编码, 报文请求业务内容采用 base64 进行编码并通过交易所为每个机构下发的密钥进行签名。

开通交易所账户、订单申报类接口采用幂等方式处理。开通交易所账户基于机构代码、开放式基金账户及交易账户进行幂等校验, 触发幂等返回前一次开户结果; 订单申报类接口基于机构代码和订单编号进行幂等校验, 触发幂等后返回前一次申报结果。

## 1.2. 数据类型约定

本规范使用的数据类型定义如下:

标识符	类型
C	字符型
N	数值型, 并可参与数值计算
L	列表类型

数据处理规则: 字符区分大小写。

Nx、Nx(y): 代表该字段内容为数值, NX 代表该字符串为整数, X 为该整数的最大长度; NX(Y)代表该字符串为浮点数, X 代表该字符串的最大长度, Y 代表小数位数, X 包括一位小数点, 此时整数部分最多不超过 X-Y-1 位, 小数部分最多不超过 Y 位。

## 1.3. 公共报文头定义

请求参数:

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
API 版本	version	C	10	Y	"1.0"
消息内容	msg	C	1024	Y	base64 (原始业务报文 json 字符串, 具体见下面业务接

					口定义)
业务编码	bizId	C	3	Y	001:基金通
发送日期	sendDate	C	8	Y	yyyyMMdd, 当前交易日
发送时间	sendTime	C	9	Y	HHmmSSsss
请求流水号	seqNo	C	64	Y	请求流水号每个机构下需不重复
产品集	setId	N	4	<del>Y</del> N	数据集群 ID,具体见产品与销售机构对应关系参考数据 <a href="#">订单结果查询接口</a> 、 <a href="#">询价报价查询接口</a> <b>setId 必填</b>
机构代码	mctCode	C	9	Y	机构代码,由交易所分配
接口签名	sign	C	1024	Y	sign(MD5(msg),privateKey), 签名算法:SHA1withRSA,销售机构需要提前申请本机构的私钥文件进行数据签名

### 响应参数:

通讯返回码	code	C	4	Y	参考返回码列表
通讯返回错误描述	message	C	24	Y	系统未知异常,其他各种可能的错误
响应结果	data	C		N	当 code=200 时,data 有成功数据
响应时间	respTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss

## 1.4. 请求和返回示例

### 请求示例:

```
{"msg":"base64xxxxxx","mctCode":"000000001","seqNo":"1243443d5d33s44444....","sendDate":"20210502","bizId":"001","sign":"rasXXXXX","setId":"00","version":"1.0","sendTime":"102020"}
```

### 响应示例:

```
{"message":"成功","code":"200","data":{"orderId":"100202202222"}}
```

## 2. 实时通讯类接口

### 2.1. 开通交易所账户 (/account/new\_account)

功能描述：交易时间，销售机构发起开通交易所账号申请，实时反馈开户结果

接口路径：/account/new\_account

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	需保证每家机构日内唯一
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T 日申请中登开户，T+1 开通交易所账户可为空
投资人姓名	custName	C	120	Y	
个人/机构标志	individualOrInstitution	C	1	Y	0-机构，1-个人，2-产品
个人证件类型及机构证件类型	certificateType	C	3	Y	个人证件类型 0-身份证 1-中国护照 2-军官证 3-士兵证 4-港澳居民来往内地通行证，5-户口本 6-外国护照，7-其它 8-文职证，9-警官证 A-台胞证,B-外国人永久居留身份证,C-港澳台居民居住证 机构证件类型 0-组织机构代码证 1-营业执照，2-行政机关 3-社会团体，4-军队 5-武警，6-下属机构（具有主管单位批文号）7-基金



上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

					会， 8-其它， 9-登记证书， A-批文 产品证件类型 1-营业执照， 8-其它， 9-登记证书， A-批文
投资人证件号码	certNo	C	40	Y	
机构类型	institutionType	C	3	N	表示投资者类型，对机构和产品要求必填。 若为机构分类如下： 101:证券公司； 102:证券公司子公司； 103:银行； 104:信托公司； 105:基金管理公司； 106:基金管理公司子公司； 107:保险公司； 108:私募基金管理人； 109:期货公司； 110:期货公司子公司； 111:财务公司； 112:其他境内金融机构； 113:机关法人； 114:事业单位法人； 115:社会团体法人； 116:非金融机构企业法人； 117:非金融类非法人机构； 118:境外代理人； 119:境外金融机构； 120:外国战略投资者； 121:境外非金融机构； 122:其它； 123:银行子公司； 124:保险子公司 若为产品分类如下： 201:开放式公募基金产品； 202:封闭式公募基金产品； 203:银行理财产品； 204:信托计划； 205:基金公司专户； 206:基金子公司产品； 207:保险产品； 208:保险公司及其子公司的

					资产管理计划； 209:证券公司及其子公司集合理财产品（含证券公司大集合）； 210:证券公司及其子公司专项资管计划； 211:证券公司及其子公司单一资管计划； 212:期货公司及其子公司的资产管理计划； 213:私募投资基金； 214:政府引导基金； 215:全国社保基金； 216:地方社保基金； 217:基本养老保险； 218:养老金产品； 219:企业年金及职业年金； 220:境外资金（QFII）； 221:境外资金（RQFII）； 222:其它境外资金； 223:社会公益基金（慈善基金、捐赠基金等）； 224:其他产品
--	--	--	--	--	--

响应参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	N	开户成功后返回

## 2.2. 新订单申报 (/trade/new\_order)

功能描述：交易时间，销售机构转发投资者交易申报数据

接口路径：/trade/new\_order

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	销售机构申请单号
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T 日申请中登开户，T+1 订单申报时可为空
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
买卖方向	orderSide	C	1	Y	1-买入 2-卖出
订单价格	price	N	(14,5)	Y	单位元
订单数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份
订单类型	orderType	C	1	Y	2: 投资者保护价格
挂单类型	bookType	N	1	Y	1: 剩余转撤销 2: 剩余转挂单

响应参数					
申请单确认编号	exchangeOrderNo	C	16	Y	交易所订单编号

### 2.3. 订单结果查询 (/trade/get\_order\_results)

功能描述：开市后至闭市后半小时内，销售机构拉取申报对应的结果数据，包含新订单申报成交结果数据和订单撤销结果数据（新订单撤销、询价撤单）。

接口路径：/trade/get\_order\_results

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

流速大小	pageSize	N	5	Y	INT 值,根据报单速率换算,上限 1000
当前最大索引编号	lastSucSeq	N	16	Y	上一次拉取到的最大索引编号,默认每日从 0 开始

响应参数					
订单结果	orderResults	L		N	list 开始, list 开始与 list 结束标志中间部分为 list 内容体
索引编号	seqNo	N	16	Y	默认每日从 1 开始编号
申请单编号	orderNo	C	24	Y	销售机构原始申请单号
成交编号	resultNo	C	16	N	每日全局唯一编号,仅成交时存在
处理时间	dealTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
成交价格	price	N	(14,5)	N	单位元,仅成交时有值。
订单数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份,成交时表示成交数量,撤单及已拒绝表示当前订单剩余未成交数量
成交金额	gmy	N	(19,5)	N	单位元,仅成交时有值。小数点 5 位,实际有效位数 2 位
处理类型	dealType	N	1	Y	0: 成交 1: 主动撤单 2: 自动撤单 3: 已拒绝 4: 超时撤单
业务类型	businessType	C	6	Y	600020-基金通报价交易订单申报 600022-基金通询价交易申报
订单类型	orderType	C	1	N	2: 投资者保护价格
挂单类型	bookType	C	1	N	1: 剩余转撤单 2: 剩余转挂单
订单结果	orderResults	L		N	list 结束

备注:

(1) 处理类型为 1 主动撤单，为用户发起的撤单申报，结果查询返回的申请单编号为用户发起撤单指令时的申请单编号；处理类型为 2 自动撤单，为挂单类型为剩余转撤单触发撤单，结果查询返回的申请单编号为该笔申报的原始申请单编号；处理类型为 3 已拒绝，为交易所原因触发撤单，结果查询返回的申请单编号为该笔申报的原始申请单编号；处理类型为 4 超时撤单，为询价交易超时时触发，结果查询返回的申请单编号为该笔申报的原始申请单编号。

(2) 订单数量，处理类型为 0 成交时，表示成交数量；处理类型为 1,2,3,4 时表示当前订单剩余未成交数量；若撤单失败，订单数量为 0，表示当前订单无剩余可撤数量。

(3) 业务类型为 600020 基金通报价交易时，订单类型及挂单类型必填；业务类型为 600022 基金通询价交易时，订单类型及挂单类型无效。

## 2.4. 行情查询 (/mktdata/get\_snapshot)

功能描述: 开市后至闭市后市场行情标志被设置为结束期间，销售机构可通过此接口拉取行情相关数据

接口路径: /mktdata/get\_snapshot

数据格式:

请求方: 销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					

响应参数					
交易日期	tradeDate	N	8	Y	YYYYMMDD
行情数据	fundList	L		N	list 开始
最新更新时间	lastUpdateTime	N	9	Y	HHMMSSsss
证券代码	fundCode	C	6	Y	
产品简称	fundName	C	8	Y	
报单数据	itemFunds	L		N	list 开始, list 开始与 list 结束标志中间部分为 itemFunds list 内容体, 包含做市商买卖最优 5 档报价
报价价格	price	N	(14,5)	Y	单位元
报价数量	number	N	(15,2)	Y	单位份

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

报价类型	type	C	1	Y	1-买入 2-卖出
报单数据	itemFunds	L		N	list 结束
投资者卖出均价	sellingPrice	N	(14,5)	Y	单位元
投资者卖出总量	sellVolume	N	(15,2)	Y	单位份
投资者卖出最优价	bestSellPrice	N	(14,5)	Y	单位元
投资者卖出最优价数量	sellVolumeAtBest Price	N	(15,2)	Y	单位份
投资者买入均价	buyingPrice	N	(14,5)	Y	单位元
投资者买入总量	buyVolume	N	(15,2)	Y	单位份
投资者买入最优价	bestBuyPrice	N	(14,5)	Y	单位元
投资者买入最优价数量	buyVolumeAtBest Price	N	(15,2)	Y	单位份
现价	currentPrice	N	(14,5)	Y	单位元
均价	perPrice	N	(14,5)	Y	单位元
最高价	highestPrice	N	(14,5)	Y	单位元
最低价	lowestPrice	N	(14,5)	Y	单位元
昨日收盘价	preClosePrice	N	(14,5)	Y	小数点 5 位，实际有效位三位
今日开盘价	openPrice	N	(14,5)	Y	小数点 5 位，实际有效位三位
今日收盘价	closePrice	N	(14,5)	Y	小数点 5 位，实际有效位三位
总成交量	tradeCount	N	(15,2)	Y	
总成交金额	tradeAmount	N	(19,5)	Y	小数点 5 位，实际有效位三位

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

总成交笔数	count	N	(16,0)	Y	
IOPV	turnoverRate	N	(14,5)	N	
产品实时阶段及标志	tradingPhaseCode	C	8	Y	<p>该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。</p> <p>第 1 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示开盘集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示产品停牌，‘M’表示可恢复交易的熔断时段（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断时段（暂停交易至闭市），‘U’表示收盘集合竞价时段。</p> <p>第 2 位：‘0’表示此产品不可正常交易，‘1’表示此产品可正常交易，无意义填充格。</p> <p>第 3 位：‘0’表示未上市，‘1’表示已上市。</p> <p>第 4 位：‘0’表示此产品在当前时段不接受订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受订单申报。无意义填充格。</p>
行情数据	fundList	L		N	<p>list 结束，list 开始与 list 结束标志中间部分为 fundListlist 内容体</p>
市场行情状态	mdSesStatus	C	8	Y	<p>全市场行情状态：</p> <p>全市场行情状态：</p> <p>该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充格。</p> <p>第 1 位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’</p>

					<p>表示全市场处于交易期间（含中间休市），‘E’表示全市场处于闭市期间。</p> <p>第 2 位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。</p> <p>第 3 位：‘1’表示全市场行情结束标志，未结束取‘0’。</p> <p>第 4 位-第 8 位预留。</p>
--	--	--	--	--	--

## 2.5. 订单撤销 (/trade/cancel\_order)

功能描述：交易时间，销售机构转发投资者交易撤销数据，包括报价交易和询价交易（询价交易，在有效时间内且投资者未进行报价回复前均可发起撤单）。

接口路径：/trade/cancel\_order

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	销售机构申请单号
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T 日申请中登开户，T+1 订单撤销时可为空
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
原申请单编码	origOrderNo	C	24	Y	销售机构原始申请单号
买卖方向	orderSide	C	1	Y	原始申请单买卖方向 1-买入



					2-卖出
业务类型	businessType	C	6	Y	600020-基金通报价交易订单申报 600022-基金通询价交易申报

响应参数

注：撤单申报时，开放式基金账户、交易账户、销售人代码、网点代码、证券代码和买卖方向需与原始申报相同

## 2.6. 询价申报 (/trade/new\_quote\_request)

功能描述：交易时间，销售商可通过此接口转发投资者的询价申报信息

接口路径：/trade/new\_quote\_request

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T 日申请中登开户，T+1 订单申报时可为空
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
做市商会员代码群	memberIDs	C	500	N	为空，则表示对该产品所有做市商进行询价。若指定多个做市商，做市商会员代码以,分割，最多不超过 50 个

买卖方向	orderSide	C	1	Y	1-询价买入 2-询价卖出
订单价格上限	highPrice	N	(14,5)	N	单位元 <u>预留，暂不启用</u>
订单价格下限	lowPrice	N	(14,5)	N	单位元 <u>预留，暂不启用</u>
订单数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份

响应参数					
申请单确认编号	exchangeOrderNo	C	16	Y	交易所订单编号

注：询价申报时，需申报订单数量，无需订单价格上限及下限。

## 2.7. 询价报价查询 (/trade/get\_quotes)

功能描述：交易时间，销售商可通过此接口获取做市商针对投资者询价的相关报价信息，包括新增报价及报价撤销。

接口路径：/trade/get\_quotes

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
流速大小	pageSize	N	5	Y	INT 值,根据报单速率换算,上限 1000
当前最大索引编号	lastSucSeq	N	16	Y	上一次拉取到的最大索引编号，默认每日从 0 开始

响应参数					
报价数据	quoteList	L		N	list 开始，list 开始与 list 结束标志中间部分为 quoteList 内容体
索引编号	seqNo	N	16	Y	默认每日从 1 开始编号
申请单编号	orderNo	C	24	Y	询价申请单编号
做市商询价报价编号	inquiryConfirmNo	C	24	Y	做市商询价报价编号

做市商会员代码	memberID	C	8	N	做市商非匿名报价时,显示对应报价的做市商会员代码
报价时间	orderTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
报价类型	orderType	C	1	Y	0:报价申报 1:报价撤销
交易价格	price	N	(14,5)	Y	单位元
交易数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份
报价数据	quotesList		L	N	list 结束

## 2.8. 点击成交报价回复 (/trade/click\_quote)

功能描述: 交易时间, 投资者采用点击成交方式对询价进行二次确认, 返回参数中包括实际成交价格及数量

接口路径: /trade/click\_quote

数据格式:

请求方: 销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	询价申请单编号
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T日申请中登开户, T+1 订单撤销时可为空
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
买卖方向	orderSide	C	1	Y	1-询价买入 2-询价卖出
报价回复	resultsList	L		Y	list 开始, list 开始与 list 结束标志中间部分为 resultsList 内容体
做市商询价报价编号	inquiryConfirmNo	C	24	Y	做市商询价报价编号

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

做市商会员代码	memberID	C	8	N	做市商非匿名报价时, 显示对应报价的做市商会员代码
交易价格	price	N	(14,5)	Y	单位元
交易数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份
报价回复	resultsList	L		Y	list 结束

响应参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	
处理时间	dealTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T日申请中登开户, T+1 订单撤销时可为空
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
买卖方向	orderSide	C	1	Y	1-询价买入 2-询价卖出
报价回复结果	confirmList	L		N	list 开始, list 开始与 list 结束标志中间部分为 confirmList 内容体
做市商询价报价编号	inquiryConfirmNo	C	24	Y	做市商询价报价编号
做市商会员代码	memberID	C	8	N	做市商非匿名报价时, 显示对应报价的做市商会员代码
成交编号	resultNo	C	16	N	每日全局唯一编号, 仅成交时有值
成交价格	price	N	(14,5)	N	单位元, 仅成交时有值。小数点 5 位, 实际有效位数 2 位
成交数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份, 成交时表示成交数量; 确认失败时, 数量为 0
成交金额	gmy	N	(19,5)	N	单位元, 交易成功后返回, 小数点 5 位, 实际有效位数 2 位; 确认失败时, 金额为 0
报价回复结果	confirmList	L		N	list 结束

## 2.9. 匹配成交报价回复 (/trade/match\_quote)

功能描述：交易时间，投资者采用匹配成交方式对询价进行二次确认，返回参数中包括实际成交价格及数量

接口路径：/trade/match\_quote

数据格式：

请求方：销售机构

字段名称	变量名	类型	长度	必填	备注
请求参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	询价申请单编号
业务时间	businessTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T日申请中登开户，T+1 订单撤销时可为空
交易所账号	exchangeAccountNo	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
买卖方向	orderSide	C	1	Y	1-询价买入 2-询价卖出
交易价格	price	N	(14,5)	Y	单位元
交易数量	quantity	N	(15,2)	N	单位份 <b>匹配成交最终确认数量，若未填写则默认按询价申报的订单数量</b>

响应参数					
申请单编号	orderNo	C	24	Y	
处理时间	dealTime	C	17	Y	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
销售人代码	distributorCode	C	9	Y	
网点代码	branchCode	C	9	Y	
交易账号	tradeAccountNo	C	17	Y	
开放式基金账号	taAccountNo	C	12	N	T日申请中登开户，T+1 订单撤销时可为空

交易所账号	exchangeAccount No	C	20	Y	
证券代码	fundCode	C	6	Y	
买卖方向	orderSide	C	1	Y	1-询价买入 2-询价卖出
报价回复结果	confirmList	L		N	list 开始, list 开始与 list 结束标志中间部分为 confirmList 内容体
做市商询价报价编号	inquiryConfirmNo	C	24	Y	做市商询价报价编号
做市商会员代码	memberID	C	8	N	做市商非匿名报价时, 显示对应报价的做市商会员代码
成交编号	resultNo	C	16	N	每日全局唯一编号, 仅成交时有值
成交价格	price	N	(14,5)	N	单位元, 仅成交时有值。小数点 5 位, 实际有效位数 2 位
成交数量	quantity	N	(15,2)	Y	单位份, 成交时表示成交数量; 确认失败时, 数量为 0
成交金额	gmy	N	(19,5)	N	单位元, 交易成功后返回, 小数点 5 位, 实际有效位数 2 位; 确认失败时, 金额为 0
报价回复结果	confirmList	L		N	list 结束

## 3. 文件类接口规范

### 3.1. 数据类型约定

本接口支持 txt 格式文件。除特别说明, 本接口中所有数据文件均采用 GB18030 编码规范。

txt 格式数据文件均遵循以下约定:

- 1) CX 类型表示字符型字段, 其中 X 代表总长度, 左对齐, 不足部分右补空格;
- 2) NX、NX(Y): 代表该字段内容为数值, NX 代表该字符串为整数, X 为该整数的最大长度, 右对齐, 不足部分左补空格; NX(Y) 代表该字符串为浮点数, X 代表该字符串

的最大长度，Y 代表小数位数，X 包括一位小数点，此时整数部分最多不超过 X-Y-1 位，小数部分最多不超过 Y 位；

- 3) 除非特殊说明，对于数字字段数值溢出的情况，将填写全 9 数值，如 N6 (2) 型字段值溢出时将填写 999.99；
- 4) 字段间分隔符为竖线 ('|')；
- 5) 竖线 ('|') 不应出现在每条记录的开头和结尾；
- 6) 各字段遵循类型定义，均为定长字段；
- 7) 每行记录以二进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。
- 8) 其他补充约束参见字段具体描述。

### 3.2. 标志文件

在文件发送和接收时，需要一个标志文件表明该文件已传送结束，可以进一步操作。

该标志文件命名规则：主文件名.flg（主文件名为其所标志的文件的名字）。

文件内容如下：

编号	字段名	字段类型	描述	必选项
1	File Name	C60	被标志的文件名	是
2	File Size	C16	文件大小，以字节为单位	是
3	Creation Date	C8	该文件的生成日期，YYYYMMDD 格式	是
4	Creation Time	C6	文件生成时间，HHMMSS 格式	是
5	Record Number	C12	文件记录数	是
6	Check Sum	C64	MD5 校验码	是
7	Reserved Field	C64	预留字段	

文件发送方应在数据文件发送完毕后发送该标志文件，文件接收方要在发现和成功读取该标志文件后，读取该数据文件。

## 4. 文件类接口

### 4.1. 产品基础信息第二版第一批文件(cpxx0201MMDD.txt)

数据文件名：cpxx0201MMDD.txt。

数据内容：产品基础信息

功能描述：使用该文件向销售机构发送竞价产品基础信息，为交易所可交易产品全量数据。

处理类型：不适用

产品类型：产品基本信息

文件发送方：上海证券交易所[批处理中心]

文件接收方：销售机构

发送时间：每个交易日发送，开市前发布

数据格式：TXT 格式；

发布渠道：证通云盘

序号	字段名称	类型	描述
1	证券代码	C6	证券代码 在show2003.dbf中为非交易业务（比如发行业务）而挂牌的“证券代码”（比如 780***），没有对应的产品基础信息数据记录，有关属性通过非交易信息文件获取。
2	ISIN代码	C12	ISIN代码（预留）。
3	记录更新时间	C8	标识接口中本记录更新时间HH:MM:SS
4	中文证券名称	C8	中文证券名称
5	英文证券名称	C10	英文证券名称（预留）
6	基础证券代码	C6	当产品为权证、可转债等衍生品时，该字段为其标的产品的证券代码。
7	市场种类	C4	‘ASHR’表示A股市场；‘BSHR’表示B股市场。 科创板股票、综业平台集合资产管理计划、债券预发行、定向可转债取‘ASHR’。
8	证券类别	C6	‘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；‘CB’表示公募REITs。（参考ISO10962），集合资产管理计划、债券预发行、定向可转债取‘D’
9	证券子类别	C3	自定义详细证券类别 参考： RET 公募REITs



上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

序号	字段名称	类型	描述
10	货币种类	C3	货币代码取值： 美元：USD；人民币：CNY；（参考ISO4217）
11	面值	N15(3)	债券当前面值，单位元，其他产品取 0.000
12	可流通证券未上市数量	N15	预留
13	最后交易日期	C15	对于国债预发行产品，为最后交易日期，格式为YYYYMMDD
14	上市日期	C8	在上交所首日交易日期，YYYYMMDD
15	产品集SET编号	N3	取值范围从 1 到 999。 用来表明产品的一种分组方式，用于在多主机间进行负载均衡分配。该值在一个交易日内不会变化。
16	买数量单位	N12	买订单的申报数量必须是该字段的整数倍。
17	卖数量单位	N12	卖订单的申报数量必须是该字段的整数倍。
18	限价申报数量下限	N12	限价申报数量下限
19	限价申报数量上限	N12	限价申报数量上限
20	前收盘价格	N11(3)	前收盘价格（如有除权除息，为除权除息后前收盘价） 对于货币市场基金实时申赎，取值为 0.010 集合资产管理计划固定填写挂牌首日开盘参考价格 定向可转债如果处于转让期，则为除权除息前的前收盘价，否则为 0
21	价格档位	N11(3)	申报价格的最小变动单位
22	涨跌幅限制类型	C1	‘N’表示交易规则（2013 修订版）3.4.13 规定的有涨跌幅限制类型或者权证管理办法第 22 条规定 ‘R’表示交易规则(2013 修订版)3.4.15 和 3.4.16 规定的无涨跌幅限制类型 ‘S’表示回购涨跌幅控制类型 ‘F’表示基于参考价格的涨跌幅控制 ‘P’表示IPO上市首日的涨跌幅控制类型 ‘U’表示无任何价格涨跌幅控制类型
23	涨幅上限价格	N11(3)	对于N类型涨跌幅限制的产品，该字段当日不会更改，基于前收盘价（已首日上市交易产品为发行价）计算。 对于 R 类型无涨跌幅限制的产品，该字段取开盘时基于参考价格计算的上限价格，无实际控制意义。 对于 P 类型 IPO 上市首日产品，取连续竞价期间基于参考价格计算最大范围的上限价格，因不是实时的实际控制价格，故仅供参考。
24	跌幅下限价格	N11(3)	计算方式参考涨幅上限价格
25	除权比例	N11(6)	每股送股比例 对于国债预发行产品，为保证金比例，单位为%。
26	除息金额	N11(6)	每股分红金额
27	融资标的标志	C1	‘T’表示是融资标的证券 ‘F’表示不是融资标的证券。

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

序号	字段名称	类型	描述
28	融券标的标志	C1	‘T’表示是融资标的证券 ‘F’表示不是融资标的证券。
29	产品状态标志	C20	该字段为 20 位字符串，每位表示含义如下，无定义则填空格。 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’表示国内主板正常交易产品，‘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，对应 mkt dt00.txt 行情文件中市场行情状态第 4 位闭市标志，‘S’表示 15:30 闭市的产品，对应 mkt dt00.txt 行情文件中市场行情状态第 5 位闭市标志，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。
30	市价申报数量下限	N12	市价申报数量下限
31	市价申报数据上限	N12	市价申报数量上限
32	中文证券名称（长）	C32	中文证券名称（长）
33	备注	C50	保留字段，用于扩展。备注中补充以下字段，每个字段根据格式定义，参照本文档txt文件对齐方式约定，字段定长，字段间以&分隔。 一、产品属性区间（第 1-40 位）1、对于债券类产品（证券类别为“D”），定义如下：对于国债预发行产品（证券子类别为“WIT”）：1) 招标方式C1，‘1’表示国债预发行利率招标，‘2’表示国债预发行价格招标。2) 基准价格N11(3)，当价格招标时为基准价格，当利率招标时为基准收益率。3) 参考久期N6(2)，单位为年。4) 当期发行量N9，单位为手。其他位预留，暂不启用。  对于非国债预发行产品： 1) 产品细分类别C4，“B010”表示科创板可转债，其他债券产品暂不标识。其他位预留，暂不启用。

序号	字段名称	类型	描述
			<p>2、对于股票类产品（证券类别为“ES”），定义如下： 1）市场流通总量N15，单位为股。上述字段仅对A股股票（包括主板及其它板）有效。其他位预留，暂不启用。</p> <p>3、对于基金类产品（证券类别为“EU”），定义如下：</p> <p>1）产品细分类别C4，</p> <p>“F111”表示单市场股票（沪）ETF；</p> <p>“F112”表示跨市场股票（沪深）ETF；</p> <p>“F113”表示跨市场股票（沪港深）ETF；</p> <p>“F114”表示单市场股票（科创板）科创板相关ETF；（含单市场科创板ETF和跨市场科创板ETF），</p> <p>“F115”表示跨市场股票（含科创板）ETF；</p> <p>“F121”表示单市场债券（沪）ETF；</p> <p>“F122”表示跨市场债券（沪深）ETF；</p> <p>“F123”表示现金申赎类债券ETF；</p> <p>“F130”表示跨境ETF；</p> <p>“F141”表示黄金ETF；</p> <p>“F142”表示商品期货ETF；</p> <p>“F150”表示交易型货币基金；</p> <p>“F220”表示科创板相关LOF。</p> <p>其他位预留，暂不启用。</p> <p>二、交易属性区间（第 41-60 位）</p> <p>对所有产品，定义如下：</p> <p>1、盘后固定价格交易标志C1，“Y”表示支持盘后固定价格交易，“N”表示不支持盘后固定价格交易</p> <p>2、其他位预留，暂不启用。</p>

## 4.2. 账户申请对账文件（khXXXXXX.txt）

数据文件名：khXXXXXX.txt, XXXXXX 为上交所分配的销售机构编码。

数据内容：基金通平台账户申请对账文件数据

功能描述：互联网交易平台使用该文件向销售机构发送盘中申请的开通交易所账户数据文件，为每日全量数据。

处理类型：不适用

产品类型：基金通产品

文件发送方：上海证券交易所[互联网交易平台]

文件接收方：销售机构

发送时间：每个交易日发送一次，闭市后二小时内发布（17 点前）

数据格式： TXT 格式；

发布渠道：证通云盘

序号	含义	字段类型	描述
1	序号	C16	顺序，唯一
2	申请单编号	C24	
3	业务时间	C17	yyyyMMddHHmmSSsss 据此计算交易日
4	销售机构编码	C8	销售机构在交易所的唯一标识
5	销售人代码	C9	
6	交易账号	C17	
7	开放式基金账号	C12	
8	交易所账号	C20	

### 4.3. 份额过户文件（ofghXXXXXX.txt）

数据文件名： ofghXXXXXX.txt, XXXXXX 为上交所分配的销售机构编码。

数据内容：基金通平台份额过户文件

功能描述：互联网交易平台使用该文件向销售机构发送逐笔成交明细汇总的过户报表，包含询价交易，为每日全量数据。

处理类型：不适用

产品类型：基金通产品

文件发送方：上海证券交易所[互联网交易平台]

文件接收方：销售机构

发送时间：每个交易日发送一次，闭市后二小时内发布（17 点前）

数据格式： TXT 格式；

发布渠道：证通云盘

序号	字段名称	字段类型	字段描述
1	证券代码	C6	证券代码
2	销售机构编码	C8	销售机构在交易所的唯一标识
3	销售人代码	C9	
4	交易所账号	C20	

5	交易账号	C17	
6	开放式基金账号	C12	
7	申请单编号	C24	需与订单申报申请单编号一致，同一申请单编号可能存在多条成交记录
8	成交编号	C16	
9	成交日期	C8	成交日期，格式为 YYYYMMDD
10	成交时间	C6	成交时间，格式为 HHMMSS
11	成交数量	N15(2)	成交数量，单位份
12	成交价格	N14(5)	成交价格，单位元
13	成交金额	N19(5)	成交金额，溢出处理参见实时成交回报接口成交金额字段
14	申报时间	C6	申报时间，格式为 HHMMSS
15	买卖方向	C1	1-买入 2-卖出
16	业务类型	C6	600020-基金通报价交易订单申报 600022-基金通询价交易申报

#### 4.4. 产品与销售机构对应关系文件（xsscpxxMMDD.txt）

数据文件名：xsscpxxMMDD.txt

数据内容：基金通平台产品对应关系文件

功能描述：互联网交易平台使用该文件向销售机构发送销售机构与基金通挂牌产品对应关系文件，为全量文件（包含停牌数据）。销售机构需基于此产品对应产品集获取订单结果。

处理类型：不适用

产品类型：基金通产品

文件发送方：上海证券交易所[互联网交易平台]

文件接收方：销售机构

发送时间：每个交易日发送一次，开市前发布（6:00 前）

数据格式：TXT 格式；

发布渠道：证通云盘

序号	字段名	字段类型	备注
1	序号	C20	唯一确定一条记录，不能重复
2	交易日期	C8	格式为：YYYYMMDD
3	证券代码	C6	

4	产品集	N4	
5	销售机构编码	C8	销售机构在交易所的唯一标识

#### 4.5. 产品与做市商对应关系文件（zsscpxxMMDD.txt）

数据文件名：zsscpxxMMDD.txt。

数据内容：基金通平台产品对应关系文件

功能描述：互联网交易平台使用该文件向销售机构发送做市商与基金通挂牌产品对应关系文件，为全量文件（包含停牌数据）

处理类型：不适用

产品类型：基金通产品

文件发送方：上海证券交易所[互联网交易平台]

文件接收方：销售机构

发送时间：每个交易日发送一次，开市前发布（6:00 前）

数据格式：TXT 格式；

发布渠道：证通云盘

序号	字段名	字段类型	备注
1	序号	C20	唯一确定一条记录，不能重复
2	交易日期	C8	格式为：YYYYMMDD
3	证券代码	C6	
4	做市商会员代码	C8	
5	做市商会员名称	C200	

## 5. 附录

### 5.1. 返回码列表

代码	说明
200	成功
201	报价结果未返回

上证基金通 2.0 市场参与者接口规格说明书

10000	内部错误，请联系上交所
19042	参数值非法
300	暂未登录或 token 已经过期
400	禁止调用，未授权