

上海证券交易所技术文档



上海证券交易所
特定参与者接口规格说明书
(托管银行卷)

1.38 版



上海证券交易所

二〇二六年九月

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.38 版发布说明：

2026 年 9 月：

1、下线 ghXXXXX.dbf，删除相关描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.37 版发布说明：

2026 年 6 月，根据固收迁移安排，调整原固收相关文件：

- 1、原固收成交明细行情文件接口和确定报价行情文件接口不再发送；
- 2、原固收成交数据文件接口规范（私有数据）调整为一债通成交汇总文件；
- 3、原固收收盘价文件（公有数据）调整为债券非匹配成交参考价文件。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.36 版发布说明：

2026 年 3 月：

托管银行私有数据接口 YYYY.sse 新增新竞价过户数据文件（gh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt）、新竞价发行过户数据文件（ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt）、指定过户数据文件（zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt）。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.35 版发布说明：

2025 年 11 月：

1. 基于《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》文档正式废止，相关内容迁移至《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》，更新相关引用描述。
2. 卫星发送盘后数据功能下线，调整相关描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.34 版发布说明：

2021 年 6 月 24 日：

- 1、固收平台成交数据、成交明细行情中增加竞买、合并申报相关描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.33 版发布说明：

2021 年 9 月 22 日：

- 1、固收平台成交明细行情说明中删除“不包含私募债券成交数据”。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.32 版发布说明：

2021 年 5 月，非交易改造相关内容修订。

- 1、盘后数据文件补充基金过户（JJGH）、债券过户（ZQGH）、综合业务过户（BGH）数据说明。
- 2、调整成交数据文件中关于非交易代码的描述。

《上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）》1.31 版发布说明：

2021 年 3 月，成交明细行情文件格式中成交方式中删除“5.”(仅为文档更正，不涉及程序变更)。

2021 年 3 月，确定报价行情文件格式说明中删除“不包含特定债券确定报价行情”。

2021 年 2 月，成交数据文件格式说明中删除“不包含私募债券成交数据”(仅为文档更正，不涉及程序变更)。

2021 年 1 月，增加公募 REITs 产品相关说明。文中所述“基金”包含公募 REITs。

2020 年 12 月，创新创业债更名为双非可转债。

2019 年 2 月，增加债券回售撤销业务。2018 年 9 月，增加特定债券转让业务。

2018 年 4 月，三方回购业务上线，该部分接口规范正式启用。

2018 年 1 月，增加双非可转债转股业务。

2017 年 11 月，增加三方回购业务,该业务尚未上线，相关接口规范为预发布版。

2016 年 8 月，增加非公开公司债券回售相关内容；固定收益平台关于非公开公司债券回售业务尚未上线，相关接口规范为预发布版。2016 年 11 月，回售业务上线，该部分接口规范正式启用。

2016 年 7 月，增加非公开可交换债券换股业务相关内容。固定收益平台非公开可交换债换股业务已于 2016 年 1 月上线，于 2016 年 7 月完成首单换股业务。该部分接口规范正式启用。

2016 年 6 月创建：

- 1、IS110 固定收益平台托管银行数据接口规范废止，相关内容整合至本文档。
- 2、IS104 托管银行（含基金公司）系统接口规范的托管银行部分章节整合至本文档。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释。

服务电话：4008888400-2

通信地址：上海市浦东南路 528 号上交所技术公司技术开发总部

网站地址：<http://www.sse.com.cn/> — 服务 — 交易技术支持专区

目录

1 概述	1
1.1 本文编写目的	1
2 托管银行私有数据接口	2
2.1 文件结构	2
2.2 数据流图	2
2.3 新固定收益系统	3
2.4 竞价撮合平台	3
2.5 综合业务平台	3
2.6 托管银行数据文件解密工具	4
2.6.1 数据文件解密工具功能	4
2.6.2 解密使用示例	4
2.6.3 重要提示 (FAQ)	5
3 托管银行公共数据接口	6
3.1 新固定收益系统	6
4 后记	7

1 概述

本文为上海证券交易所特定参与者接口规格说明书（托管银行卷）。

1.1 本文编写目的

本文包括以下部分：

第 1 部分：概述

即本节，这部分说明本文编写目的。

第 2 部分：托管银行私有数据接口

概述了托管银行私有数据文件结构及数据流图。

同时介绍了托管银行数据文件解密工具的功能及使用方法。

第 3 部分：托管银行公共数据接口

包括新固定收益平台数据接口（含债券非匹配成交参考价文件和证券产品基础信息文件）等。

2 托管银行私有数据接口

2.1 文件结构

文件名：YYYY.sse。其中 YYYY 为托管银行英文简称，长度为 4 位；

功能描述：新交易将需要发给托管银行的 ~~PBU 过户数据~~、一债通成交汇总文件、大宗交易过户数据、综合业务过户数据、ZQY 数据、IPOGH 数据、ZQGH 数据、JJGH 数据、新竞价过户数据文件、新竞价发行过户数据文件、指定过户数据文件，按照要发往的银行分别压缩打包并加密，再需要根据托管银行配置文件向市场发送。

时间和频率：每个交易日 15:00 之后。

数据格式：

1) 新一代交易系统根据配置文件，将托管银行对应的 ~~席位成交(ghXXXXX.dbf)文件~~、大宗交易过户数据文件(dghXXXXXYYYYMMDD.dbf)、综合业务过户数据(bghXXXXX.dbf)、一债通成交汇总文件(zghXXXXX.txt)、ZQY 数据(zqyXXXXX.dbf)、IPOGH 数据(IPOGHXXXXX.txt)、ZQGH 数据(ZQGHXXXXX.txt)、JJGH 数据(JJGHXXXXX.txt)、新竞价过户数据文件(gh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)、新竞价发行过户数据文件(ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)、指定过户数据文件(zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)一起使用 zip 压缩，形成 YYYY.gz 文件。这里 XXXXX 为 PBU 号，YYYY 为托管银行简称。托管银行简称统一为 4 位；

2) 新一代交易系统调用 encryptfile 工具，对前面生成的 YYYY.gz 文件加密为 YYYY.sse。此文件发送托管银行；

3) ~~席位成交(ghXXXXX.dbf)文件~~、大宗交易过户数据文件(dghXXXXXYYYYMMDD.dbf)、综合业务过户数据(bghXXXXX.dbf)、一债通成交汇总文件(zghXXXXX.txt)、ZQY 数据(zqyXXXXX.dbf)、IPOGH 数据(IPOGHXXXXX.txt)、ZQGH 数据(ZQGHXXXXX.txt)、JJGH 数据(JJGHXXXXX.txt)、新竞价过户数据文件(gh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)、新竞价发行过户数据文件(ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)、指定过户数据文件(zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)相关格式参见各相关系统接口文件。

处理：

托管银行收到盘后数据文件 YYYY.sse 后，首先运行 encryptfile 工具解密成.zip 文件：

```
encryptfile -d -p 12345678 -i YYYY.sse -o YYYY.zip
```

然后运行 unzip 解压缩软件解压缩。

2.2 数据流图

如图 1 所示，上海证券交易所通过证通云盘在盘后发送托管银行打包加密后的盘后数据。托管银行收到此文件后，运行上海证券交易所提供的解密程序，输入预设密码解密并解包出所需数据文件，进行

后续处理。

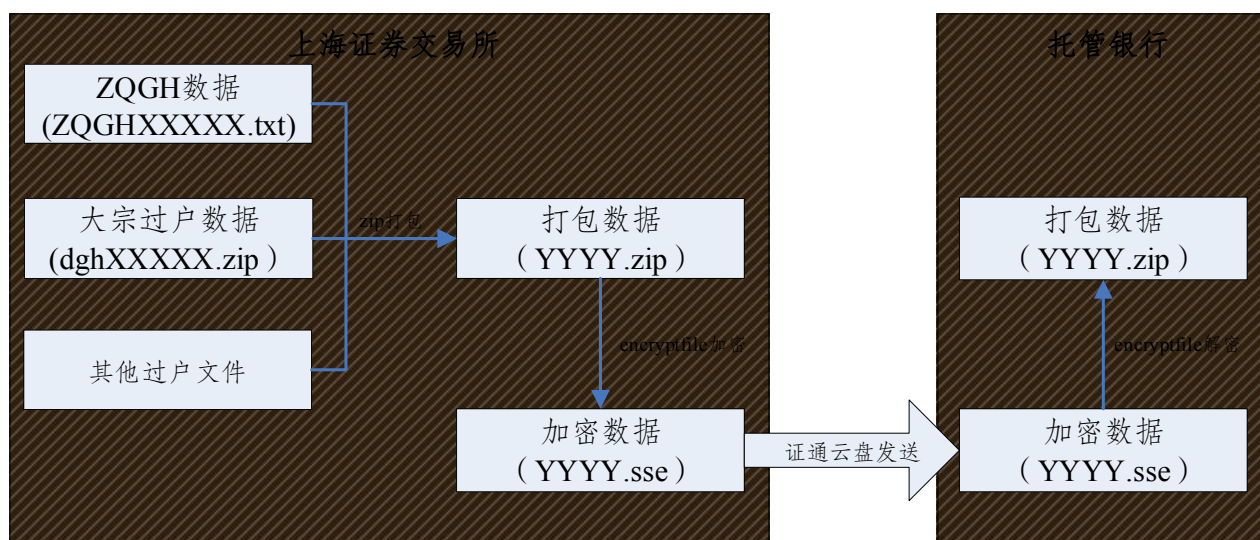


图 1 托管银行私有数据流图

2.3 新固定收益系统

上证所新固定收益系统与托管银行之间私有数据接口规范包括以下几部分：

1. 债券非匹配成交汇总文件(zghXXXXX.txt)

文件格式及获取方式参见《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》

2.4 竞价撮合平台

上证所竞价撮合平台与托管银行之间私有数据接口规范包括以下几部分：

竞价过户数据接口(ghXXXXX.dbf)

1. 新股发行过户数据接口(ipoghXXXXX.txt)
2. 证券权益接口 (zqyXXXXX.dbf)
3. 新竞价过户数据文件 (gh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)
4. 新竞价发行过户数据文件 (ipogh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)
5. 指定过户数据文件 (zdgh00PXXXXX_YYYYMMDD.txt)

以上接口详细规范可详见如下文档：

IS124 上海证券交易所市场数据文件交换 接口规格说明书

2.5 综合业务平台

上证所综合业务平台与托管银行之间私有数据接口规范包括以下几部分：

1. 过户数据接口 dghXXXXXYYYYMMDD.dbf
2. 过户数据接口 bghXXXXX.dbf
3. ZQGH 数据 ZQGHXXXXX.txt
4. JJGH 数据 JJGHXXXXX.txt

5. 以上接口详细规范可详见如下文档：

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

2.6 托管银行数据文件解密工具

2.6.1 数据文件解密工具功能

操作系统	客户端解密工具：兼容 Windows95/98/2000/xp 操作系统	
界面形式	命令行界面	
参数输入形式	所有参数作为开关与主命令共同一次输入	
信息输出形式	屏幕输出，错误能够反馈给批处理调用。	
功能开关设置	命令格式： encryptfile [SW] [INFO] [SW] [INFO] ... -i srcFileName -o destFileName SW:开关 INFO:信息 srcFileName:源文件 destFileName:目的文件	
	开关	描述
	-p	指定加/解密的密码
	-e	指定为加密
	-d	指定为解密
	-i	指定源文件
	-o	指定目标文件
	-t	加密文本文件
	-r	加密/解密后删除源文件
安装要求	工具为绿色软件，复制成功就能使用。包含文件： encryptfile.exe, libeay32.dll	
下载	可通过上海证券交易所市场技术服务平台下载： https://idc.ztcloud.ssetech.com.cn/	
其他要求	文件加密保证文件本身没有任何改变。应该能保证对于批处理生成的文件(dbf, zip, Steam LF 格式的 txt 文本)，加密后在 Windows 环境下解密后仍保持不变。	

2.6.2 解密使用示例

```
encryptfile -d -p password -i 123.sse -o 123.zip
```

输入需要解密的文件：123.sse

输出解密完成的文件：123.zip

密钥：password (此密码各基金公司与托管银行自行设定)

```
encryptfile -d -r -p password -i 123.sse -o 123.zip
```

输入需要解密的文件：123.sse

输出解密完成的文件：123.zip

密钥：password (此密码各基金公司与托管银行自行设定)

解密完成后并删除 123.sse

2.6.3 重要提示 (FAQ)

1. 为何解密生成的.zip 文件无法解压缩?

请检查所输入的密码是否正确。当解密密码错误时，命令行窗口会提示“cannot decrypt file XXXX.sse”，但会生成目标.zip 文件，只是此文件无法解压缩。

请用正确的密码解密，即可获得正确的.zip 文件。

3 托管银行公共数据接口

3.1 新固定收益系统

上证所新固定收益系统与托管银行之间公共数据接口包括以下几部分：

1. 债券非匹配成交参考价文件（bondnegorefp_x_yyyymmdd.xml）
2. 证券产品基础信息文件（products_yyyymmdd.xml）

文件格式及获取方式参见《IS124_上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》。

4 后记

上海证券交易所对本文档享有知识产权，未经上海证券交易所书面许可，任何单位和个人不得将本文档用于其他商业目的。

对本文档有任何批评指正意见，请发电子邮件到 tech_support@sse.com.cn。