

股转系统办发〔2020〕115号附件1

全国中小企业股份转让系统
交易支持平台数据
接口规范
(V1.45)

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

二〇二〇年八月

文档信息

文档名称	全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范	
说明	规定主办券商与交易支持平台间数据交换的内容、格式及填写标准	
修订历史		
版本号	修改日期	修改说明
V1.0	2013.11	首次发布。
V1.0.1	2014.4	完善各章说明内容，对各字段的填写要求做出更具体的说明： 1.对于预留字段，注明默认值； 2.对于下发的行情文件，注明当揭示的值超过该字段定义的范围时，用最大值填充； 3.对于券商填写的接口库，明确约定了各字段是否必须填写； 4.完善了错误代码表中的错误原因说明； 5.补充说明了协议转让申报信息库将如何采取限流措施。
V1.1	2015.6	1.补充说明投资者适当性管理汇总信息库是与中国结算的有效账户比对后才下发； 2. 补充说明投资者适当性管理信息库和主办券商营业部信息库上报要求； 3. 增加了每月下发一次的投资者适当性全量库的说明； 4. 完善证券信息库、证券行情库、申报库、回报库中说明的内容。 5. 增加指数发布说明。
V1.2	2015.7	增加优先股业务的相关说明
V1.3	2016.1	增加挂牌公司市场分层信息发布的相关说明
V1.4	2017.3	完善集合竞价转让方式的相关说明
V1.41	2017.11	1. 证券行情库删除了挂牌公司协议转让股票的买卖盘说明； 2. 证券行情库增加挂牌公司集合竞价股票无法生成参考成交价时的通过买卖盘三揭示最优一档买卖盘的说明； 3. 申报库删除了从协议转让申报信息库获取成交约定号的说明； 4. 协议转让申报信息库说明不再发布申报信息。

V1.42	2019.2	增加要约收购业务相关说明
V1.43	2019.11	增加适当性差异化管理相关修订； 增加发行相关修订； 增加连续竞价相关修订。
V1.44	2020.6	连续竞价股票启用做市商数量相关修订； 增加差异化表决权相关修订； 增加分层信息库相关说明。
V1.45	2020.8	增加融资融券相关修订。

《数据接口规范》V1.45 前言

全国股转公司对《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.44）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.45）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 申报库增加融资融券标志和平仓标志字段，增加前端检查错误说明。
2. 回报库增加融资融券标志和平仓标志字段，增加合法性检查错误说明。
3. 增加融资融券余额数据库接口说明。
4. 增加信用违约资料库及汇总库接口说明。
5. 增加融资融券信息发布的公告文件结构说明。

《数据接口规范》V1.44 前言

全国股转公司对《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.43）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.44）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 证券信息库增加连续竞价股票启用做市商数量说明。
2. 证券信息库增加差异化表决权安排说明。
3. 新增分层信息库。

《数据接口规范》V1.43 前言

全国股转公司对《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.42）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.43）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 根据适当性数据差异化管理的要求，对投资者适当性管理信息库、投资者适当性管理汇总信息库、信息公告文件、受限投资者可交易证券信息库进行了修订，增加了投资者适当性管理信息确认库和投资者适当性管理信息检查库。

2. 根据发行规则，对证券信息库、证券行情库、申报库和回报库进行了修订，增加了确认库。

3. 根据新的交易细则，对证券信息库、证券行情库、申报库和回报库的申报价格范围、申报数量范围等进行了修订，增加了连续竞价相关说明。

《数据接口规范》V1.42 前言

全国股转公司对《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.41）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.42）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 证券信息库增加了要约收购的信息发布相关说明；
2. 证券行情库增加了要约收购的行情发布相关说明；
3. 申报库增加了要约收购申报数据填写的相关说明；
4. 回报库增加了要约收购确认数据填写的相关说明。

《数据接口规范》V1.41 前言

全国股转公司根据《全国中小企业股份转让系统股票转让细则》对《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.4）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.41）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 证券行情库删除了挂牌公司协议转让股票的买卖盘说明；
2. 证券行情库增加挂牌公司集合竞价股票无法生成参考成交价时的通过买卖盘三揭示最优一档买卖盘的说明；
3. 申报库删除了从协议转让申报信息库获取成交约定号的说明；
4. 协议转让申报信息库说明不再发布申报信息。

《数据接口规范》V1.4 前言

全国股转公司对《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.3）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.4）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 证券行情库修订了昨日收盘价和今日开盘价的定义；
2. 证券行情库增加了挂牌公司集合竞价股票买卖盘揭示的说明。

《数据接口规范》V1.3 前言

为通过行情系统向市场揭示挂牌公司分层后的差异信息。全国股转公司根据挂牌公司市场分层管理业务需求对原《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.2）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.3）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 增加一类新的信息公告文件 FCyymmdd.nnn；
2. 对该公告文件的格式进行相关定义；
3. 增加分层信息公告文件的示例。

《数据接口规范》V1.2 前言

为更好地满足挂牌公司业务发展需求，提高转让效率，全国股份转让公司根据优先股业务需求对原《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.1）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.2）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. NQXX.DBF 增加优先股证券信息揭示内容；
2. NQHQ.DBF 增加优先股行情揭示内容；
3. NQHGTZZ?????.DBF 增加优先股投资者报送说明；
4. NQHGTZZ.DBF 增加优先股投资者确认说明；
5. NQSDXQL.DBF 增加优先股投资者揭示说明；
6. 新增 NQFGKSBXX.DBF 揭示优先股申报信息；
7. 新增 NQFGKCJXX.DBF 揭示优先股成交信息。

《数据接口规范》V1.1 前言

为更好地满足业务发展需求，提高转让效率，全国股转公司根据前期业务运行情况及新增业务需求对原《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.0.1）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.1）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 补充说明投资者适当性管理信息库应于每个转让日15:30前，通过FDEP上报，且明确无新增报空库。
2. 补充说明主办券商营业部信息库应于每个转让日15:30前，通过FDEP上报，且明确无新增报空库。
3. 补充说明投资者适当性管理汇总信息库的生成机制。
4. 增加每月下发的投资者适当性管理全量库的说明。
5. 完善证券信息库中 XXZSSSL 的说明。
6. 证券行情库中 HQJSD2 的上限值修正为 9999.999。
7. 完善申报库中 WTHTXH 的说明。
8. 回报库中 HBDFZH 的说明修正字段编码为 9。
9. 根据竞价转让的检查规则，增加回报库中错误原因的分类解释。
10. 增加指数发布的相关内容说明。

《数据接口规范》V1.0.1 前言

为更好地满足挂牌公司业务发展需求，提高转让效率，全国股份转让公司根据仿真测试的情况特对原《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.0）》进行了修改，形成了《全国中小企业股份转让系统交易支持平台数据接口规范（V1.0.1）》。与原数据接口规范比较，本版本的数据接口规范作了如下修改：

1. 对于证券信息库、证券行情库等全国股份转让系统下发的文件中标注为预留的字段，增加了默认取值的说明：数值型默认为0、0.00或0.000，字符型默认用空格填充。

2. 对于证券行情库、做市转让申报信息库等全国股份转让系统下发的文件，注明当申报数量、成交数量、成交金额、涨跌幅等字段揭示的值超过该字段定义的范围时，用最大值填充。

3. 对于申报库，明确了各字段是否必填，规定了NQWT.WTHTXH中营业部编码的取值范围必须与NQQSYYB中上报的信息一致。对表3-2做了进一步完善，将错误代码F对应的错误说明中的“且不属于例外条款”具体化。

4. 对于回报库，对表4-2做了进一步完善，将错误原因“成交确认申报与定价申报之间不满足配对合法性要求”补充到错误19类。

5. 对于协议转让申报信息库，补充了在有效申报记录数超过 25000 笔时将如何采取限流措施。

6. 对于投资者适当性管理信息库，明确了各字段是否必填。

7. 对于主办券商营业部信息库，明确了各字段是否必填，增加说明了营业部编码与 NQWT.WTHTXH 的关系，补充说明了自营、资管、做市等无营业部编制的系统无需申报。

8. 对于投资者适当性管理汇总信息库，下发的信息中账户名称变为预留字段，补充说明该库仅下发合格投资者的信息，不下发两网公司及退市公司投资者的信息。

9. 对于受限投资者可交易证券信息库，补充说明下发数据的排序规则。

《数据接口规范》V1.0 前言

全国中小企业股份转让系统（以下简称“全国股份转让系统”）是经国务院批准设立的全国性证券交易场所。全国中小企业股份转让系统有限责任公司（以下简称“全国股份转让系统公司”）为其运营管理机构，组织安排非上市股份公司股票的公开转让，为非上市股份公司融资、并购等相关业务提供服务，为市场参与人提供信息、技术和培训服务。

本规范所称交易支持平台是指为全国股份转让系统挂牌证券提供转让服务的技术系统，包括交易系统、行情系统、监察系统及相关的接口程序。交易支持平台由全国股份转让系统公司建设和维护。

本规范对挂牌公司普通股票转让（协议转让、做市转让、竞价转让）、两网公司及退市公司股票转让的数据接口进行了定义，描述了主办券商信息系统与交易支持平台系统之间交互数据的内容和格式，包括证券信息库（NQXX.DBF）、证券行情库（NQHQ.DBF）、申报库（NQWT.DBF）、回报库（NQHB.DBF）、协议转让申报信息库（NQXYXX.DBF）、做市转让申报信息库（NQZSXX.DBF）、投资者适当性管理信息库（NQHGTZZ?????.DBF）、主办券商营业部信息库（NQQSYYB?????.DBF）、投资者适当性管理汇总信息库

(NQHGTZZ.DBF)、受限投资者可交易证券信息库(NQSXTZZ.DBF)和信息公告文件(xxyymmdd.nnn)等 11 个接口。

本规范只规定交易和行情的数据接口，结算数据接口规范由中国证券登记结算有限责任公司另文制定。

目 录

《数据接口规范》V1.45 前言.....	III
《数据接口规范》V1.44 前言.....	IV
《数据接口规范》V1.43 前言.....	V
《数据接口规范》V1.42 前言.....	VI
《数据接口规范》V1.41 前言.....	VII
《数据接口规范》V1.4 前言.....	VIII
《数据接口规范》V1.3 前言.....	IX
《数据接口规范》V1.2 前言.....	X
《数据接口规范》V1.1 前言.....	XI
《数据接口规范》V1.0.1 前言.....	XII
《数据接口规范》V1.0 前言.....	XIV
第一章 证券信息库 NQXX.DBF	1
第二章 证券行情库 NQHQ.DBF	8
第三章 申报库 NQWT.DBF	13
第四章 回报库 NQHB.DBF	19
第五章 协议转让申报信息库 NQXYXX.DBF.....	26
第六章 做市业务申报信息库 NQZSXX.DBF.....	27
第七章 投资者适当性管理信息库 NQHGTZZ?????.DBF.....	29
第八章 主办券商营业部信息库 NQSYYYB?????.DBF	31
第九章 投资者适当性管理汇总信息库 NQHGTZZ.DBF	33
第十章 受限投资者可交易证券信息库 NQSXTZZ.DBF.....	35
第十一章 信息公告文件 xxyymmdd.nnn	36
第十二章 投资者适当性管理全量库 NQSDXQL.DBF	45
第十三章 非公开转让申报信息库 NQFGKSBXX.DBF.....	46

第十四章 非公开转让成交信息库 NQFGKCJXX.DBF	48
第十五章 投资者适当性管理信息确认库 NQHGTZZQR?????.DBF	50
第十六章 投资者适当性管理信息检查库 NQHGTZZJC?????.DBF	53
第十七章 确认库 NQQR?????.DBF.....	56
第十八章 分层信息库 NQFC.DBF	58
第十九章 融资融券余额数据 RR?????.DBF	59
第二十章 信用违约资料 WY?????.DBF.....	62
第二十一章 信用违约资料汇总 XYWYZL.DBF.....	64

第一章 证券信息库 NQXX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	XXZQDM	证券代码	C	6	
2	XXZQJC	证券简称	C	8	
3	XXYWJC	英文简称	C	20	
4	XXJCZQ	基础证券	C	6	标的券
5	XXISIN	ISIN 编码	C	12	国际证券识别码
6	XXZRDW	交易单位	N	4,0	
7	XXHYZL	行业种类	C	5	
8	XXHBZL	货币种类	C	2	
9	XXMGMZ	每股面值	N	7,2	
10	XXZGB	总股本	N	12,0	
11	XXFXSGB	非限售股本	N	12,0	
12	XXSNSY	上年每股收益	N	9,4	
13	XXBNSY	本年每股收益	N	9,4	预留
14	XXJSFL	经手费率	N	7,6	按成交金额计算
15	XXYHSL	印花税率	N	7,6	按成交金额计算
16	XXGHFL	过户费率	N	7,6	预留
17	XXGPRQ	挂牌日期	D	8	CCYYMMDD
18	XXZQQXR	起息日	D	8	CCYYMMDD
19	XXDQR	到期日	D	8	CCYYMMDD
20	XXMBXL	每笔限量	N	9,0	
21	XXBLDW	买数量单位	N	6,0	
22	XXSLDW	卖数量单位	N	6,0	
23	XXZXSBSL	最小申报数量	N	9,0	
24	XXJGDW	价格档位	N	5,3	
25	XXSBCS	首笔交易限价参数	N	7,3	
26	XXHXCS	后续交易限价参数	N	7,3	
27	XXXJXZ	限价参数性质	N	1,0	
28	XXZTJG	涨停价格	N	9,3	
29	XXDTJG	跌停价格	N	9,3	
30	XXDZZTJG	大宗交易价格上限	N	9,3	预留
31	XXDZDTJG	大宗交易价格下限	N	9,3	预留
32	XXCFGBZ	成分股标志	C	1	预留
33	XXZHBL	折合比例	N	5,2	
34	XXZRZT	交易状态	C	1	
35	XXZQJB	证券级别	C	1	
36	XXZRLX	交易类型	C	1	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
37	XXZSSL	做市商数量	N	4,0	
38	XXTPBZ	停牌标志	C	1	
39	XXCQCX	除权除息标志	C	1	
40	XXWLTP	网络投票标志	C	1	预留
41	XXQTYW	其他业务状态	C	4	
42	XXGXSJ	记录更新时间	N	6,0	HHMMSS

说明：

(1) 本库的第一条记录为特殊记录：XXZQDM（字段 1：证券代码）为“000000”；XXZQJC（字段 2：证券简称）存放当前日期 CCYYMMDD；XXYWJC（字段 3：英文简称）存放本库更新时间 HHMMSSss，只取前 8 位；XXSLDW（字段 22：卖数量单位）存放当日挂牌证券数量。

(2) XXZQDM（字段 1：证券代码）为关键字，其中前三位为标识类别，后三位为顺序码，具体含义见表 1-1。

表 1-1：证券代码定义表

第一位	第二位	第三位	定义
4	0	0	两网公司及退市公司 A 股
4	2	0	两网公司及退市公司 B 股
4	3		挂牌公司股票
8	2	0	优先股
8	3		挂牌公司股票
8	4	0	要约收购
8	4	1	要约回购
8	5	0	股权激励期权
8	7		挂牌公司股票
8	8	9	发行业务
8	9	9	指数

(3) XXZRDW（字段 6：交易单位），指申报库（NQWT.DBF）中 WTWTSL（申报数量）的单位，最终申报量 = NQWT.WTWTSL *

NQXX.XXZRDW。例如某证券的 **NQWT.WTWTSL** = 1000 , **NQXX.XXZRDW** = 10 (股), 则: 该证券的申报量 = $1000 * 10 = 10000$ (股)。

(4) **XXHYZL** (字段 7: 行业种类), 对于股票: 左边第一位为字母, 表示门类; 左边第二、三位为数字, 表示大类; 其他位为空。具体定义请参见中国证监会颁布的《上市公司行业分类指引》。

(5) **XXHBZL** (字段 8: 货币种类), ‘00’人民币, ‘02’美元。

(6) **XXMGMZ** (字段 9: 每股面值): 对于股票, 每股面值为 1 元。

(7) **XXSNSY** (字段 12: 上年每股收益): 对于股票, 存放上年每股利润。

(8) **XXJSFL** (字段 14: 经手费率), 为全国股转公司本身收取或向投资者代收的交易费用费率, 该费率仅为参考, 实际费率以相关收费管理规定为准。

(9) **XXGPRQ**(字段 17: 挂牌日期)的日期格式为 **CCYYMMDD**。

(10) **XXZQQXR**(字段 18: 起息日)的日期格式为 **CCYYMMDD**。对于优先股, 该字段存放其起息日; 对于要约业务, 该字段存放其要约开始日期; 对于发行业务, 该字段存放其询价开始日期。

(11) **XXDQR** (字段 19: 到期日) 的日期格式为 **CCYYMMDD**。对于要约业务, 该字段存放其要约结束日期; 对于发行业务, 该字段存放其询价结束日期。

(12) **XXMBXL** (字段 20: 每笔限量) 指 **NQWT.WTWTSL** (申

报数量) 的上限。

(13) 每笔买入申报的 **NQWT.WTWTSL** (申报数量) 必须是 **XXBLDW** (字段 21: 买数量单位) 的整数倍。互报成交确认申报时买入申报数量例外。

(14) 每笔卖出申报的 **NQWT.WTWTSL** (申报数量) 或做市申报的 **NQWT.WTWTSL2** (申报数量 2) 必须是 **XXSLDW** (字段 22: 卖数量单位) 的整数倍。余股一次性卖出时卖出申报数量例外。

(15) **XXZXSBSL** (字段 23: 最小申报数量) 存放除做市商外其他投资者在正常交易时段的每笔最小申报数量。

(16) **XXJGDW** (字段 24: 价格档位) 为 **NQWT.WTWTJG** (申报价格) 的最小变动单位, 例如 0.01 元 RMB。

(17) **XXSBCS** (字段 25: 首笔交易限价参数)。若 **XXSBCS=0** 表示不限制; 若 **XXSBCS>0**, 则首笔交易 (最近成交价为 0) 的有效价格范围为: $[\text{MAX}(\text{XXJGDW}, \text{NQHQ.HQZRSP} - ((\text{NQHQ.HQZRSP} - 1) * \text{XXXJXZ} + 1) * \text{XXSBCS}), \text{NQHQ.HQZRSP} + ((\text{NQHQ.HQZRSP} - 1) * \text{XXXJXZ} + 1) * \text{XXSBCS}]$ 。

如有效价格区间上限值-前收盘价<价格最小变动单位, 有效价格区间上限值=前收盘价+价格最小变动单位; 如前收盘价-有效价格区间下限值<价格最小变动单位, 有效价格区间下限值=前收盘价-价格最小变动单位。

价格在此区间内的申报才有资格参加首笔交易撮合, 如该证券同时设有申报有效价格范围, 则取上述范围与申报有效价格范围的交集。

(18) **XXHXCS** (字段 26: 后续交易限价参数)。若 **XXHXCS**=0 表示不限制; 若 **XXHXCS**>0, 则后续交易 (最近成交价不为 0) 的有效价格范围为: $[\text{MAX}(\text{XXJGDW}, \text{NQH.Q.HQZJCJ}-((\text{NQH.Q.HQZJCJ}-1)*\text{XXXJXZ}+1)*\text{XXHXCS}), \text{NQH.Q.HQZJCJ}+((\text{NQH.Q.HQZJCJ}-1)*\text{XXXJXZ}+1)*\text{XXHXCS}]$ 。

如有效价格区间上限值-最近成交价<价格最小变动单位, 有效价格区间上限值=最近成交价+价格最小变动单位; 如最近成交价-有效价格区间下限值<价格最小变动单位, 有效价格区间下限值=最近成交价-价格最小变动单位。

价格在此区间内的申报才有资格参加后续交易撮合, 如该证券同时设有申报有效价格范围, 则取上述范围与申报有效价格范围的交集。

(19) **XXXJXZ** (字段 27: 限价参数性质)。0 表示 **XXSBCS** 和 **XXHXCS** 的值为价格; 1 表示 **XXSBCS** 和 **XXHXCS** 的值为比例数。

(20) **XXZTJG** (字段 28: 涨停价格) 为申报有效价格范围的价格上限, 如果 **XXZTJG**=99999.99 (币种为人民币) 或 99999.999 (币种为美元), 则相应的证券没有涨幅限制。对于要约业务, 存放其收购/回购价格。

(21) **XXDTJG** (字段 29: 跌停价格) 为申报有效价格范围的价格下限, 如果 **XXDTJG**=0.000, 则相应的证券没有跌幅限制。对于要约业务, 存放其收购/回购价格。

(22) **XXZHBL** (字段 33: 折合比例): 对于优先股, 该字段存放其票面股息率 (%)。

(23) **XXZRZT** (字段 34: 交易状态), ‘N’表示正常状态, ‘Y’表示首日挂牌, ‘D’表示新增股票挂牌交易, ‘I’表示询价, ‘F’表示申购。

(24) **XXZQJB** (字段 35: 证券级别), ‘T’表示对应证券是挂牌公司股票; ‘B’表示对应证券是两网公司及退市公司股票; ‘O’表示对应证券是仅提供行权功能的期权; ‘P’表示对应证券是持有人数存在 200 人限制的证券; ‘R’表示对应证券是其他类型的业务; ‘F’表示是发行业务。

(25) **XXZRLX** (字段 36: 交易类型), ‘T’表示协议交易方式; ‘M’表示做市交易方式; ‘B’表示集合竞价+连续竞价交易方式; ‘C’表示集合竞价交易方式; ‘P’表示发行方式, ‘O’表示其他类型。

(26) **XXZSSSL** (字段 37: 做市商数量), 对于有做市商提供做市服务的证券揭示其做市商数量, 对于没有做市商提供做市服务的证券该字段的值默认为 0。

(27) **XXTPBZ** (字段 38: 停牌标志), ‘F’表示正常交易; ‘T’表示停牌, 不接受申报; ‘H’表示停牌, 接受申报。

(28) **XXCQCX** (字段 39: 除权除息标志), ‘N’表示正常状态, ‘E’表示除权, ‘D’表示除息, ‘A’表示除权除息。

(29) **XXQTYW** (字段 41: 其他业务状态): 各字节的含义见表 1-2。

表 1-2: 其他业务状态含义表

XXQTYW	优先股	挂牌公司股票	要约收购/回购	其他
第一字节	预留, 默认为空格	为“T”表明处于要约期, 为“F”表明不处于要约期	为“T”表明处于要约收购/回购截止期间, 禁止做撤回预受要约申报, 为“F”表明处于要约收购/回购正常期间	预留, 默认为空格

XXQTYW	优先股	挂牌公司股票	要约收购/回购	其他
第二字节	预留，默认为空格	为“T”表明有差异化表决权安排，为“F”表明没有差异化表决权安排	预留，默认为空格	预留，默认为空格
第三字节	回售标志，该证券是否处于回售期：F-否，T-是	预留，默认为空格	预留，默认为空格	预留，默认为空格
第四字节	转股标志，该证券是否允许转股：F-禁止，T-允许	预留，默认为空格	预留，默认为空格	预留，默认为空格

(30) 凡标注为预留的字段，如果字段类型为数值型，其值为 0，如果字段类型为字符型，用空格填充。

第二章 证券行情库 NQHQ.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HQZQDM	证券代码	C	6	
2	HQZQJC	证券简称	C	8	
3	HQZRSP	昨日收盘价	N	9,3	
4	HQJRKP	今日开盘价	N	9,3	
5	HQZJCJ	最近成交价	N	9,3	
6	HQCJSL	成交数量	N	12,0	
7	HQCJJE	成交金额	N	17,3	
8	HQCJBS	成交笔数	N	9,0	预留
9	HQZGCJ	最高成交价	N	9,3	
10	HQZDCJ	最低成交价	N	9,3	
11	HQSYL1	市盈率 1	N	9,4	静态市盈率
12	HQSYL2	市盈率 2	N	9,4	动态市盈率
13	HQJSD1	价格升跌 1	N	9,3	较昨日收盘价涨跌
14	HQJSD2	价格升跌 2	N	9,3	较上一笔成交价涨跌
15	HQHYCC	合约持仓量	N	12,0	
16	HQSJW5	卖价位五	N	9,3	
17	HQSSL5	卖数量五	N	12,0	
18	HQSJW4	卖价位四	N	9,3	
19	HQSSL4	卖数量四	N	12,0	
20	HQSJW3	卖价位三	N	9,3	
21	HQSSL3	卖数量三	N	12,0	
22	HQSJW2	卖价位二	N	9,3	
23	HQSSL2	卖数量二	N	12,0	
24	HQSJW1	卖价位一/叫卖揭示价	N	9,3	
25	HQSSL1	卖数量一	N	12,0	
26	HQBJW1	买价位一/叫买揭示价	N	9,3	
27	HQBSL1	买数量一	N	12,0	
28	HQBJW2	买价位二	N	9,3	
29	HQBSL2	买数量二	N	12,0	
30	HQBJW3	买价位三	N	9,3	
31	HQBSL3	买数量三	N	12,0	
32	HQBJW4	买价位四	N	9,3	
33	HQBSL4	买数量四	N	12,0	
34	HQBJW5	买价位五	N	9,3	
35	HQBSL5	买数量五	N	12,0	

说明：

(1) 每个交易日本库的第一条记录为特殊记录，**HQZQDM** 为“000000”，**HQZQJC** 存放当前日期 CCYYMMDD，**HQCJBS** 存放当前时间 HHMMSS，**HQZRSP** 存放“指数因子”，**HQCJSL** 存放行情状态信息。**HQCJSL** 个位数存放收市行情标志（0：非收市行情；1：收市行情；2：盘后行情），**HQCJSL** 十位数存放正式行情与测试行情标志（0：正式行情；1：测试行情），即 **HQCJSL** 值为 0 时表示正式非收市行情，为 1 时表示正式收市行情，为 2 时表示正式盘后行情，为 10 时表示测试的非收市行情，为 11 时表示测试的收市行情，为 12 时表示测试的盘后行情。**HQBSL4** 存放当日最近一次发布信息公告的时间，格式为 HHMMSSss，**HQBSL5** 存放 NQXX.DBF 最近一次更新的时间，格式为 HHMMSSss。

(2) 当本库的记录为指数记录时（**HQZQDM** 最左三位为 899），在证券代码、证券简称、昨日收盘价、今日开盘价、最近成交价、成交数量、成交金额、最高成交价、最低成交价字段揭示相应的指数信息，其中 **HQZRSP**、**HQJRKP**、**HQZJCJ**、**HQCJSL**、**HQCJJE**、**HQZGCJ**、**HQZDCJ** 等都必须乘上“指数因子”，计算出的结果才为实际的指数值。动态指数当天实时发布，静态指数在下一交易日发布，**HQHYCC** 揭示静态指数的交易日期。

(3) **HQZQDM**（字段 1：证券代码）为关键字，证券代码区间划分见表 2-1。

表 2-1：证券代码区间定义表

第一位	第二位	第三位	定义
4	0	0	两网公司及退市公司 A 股

第一位	第二位	第三位	定义
4	2	0	两网公司及退市公司 B 股
4	3		挂牌公司股票
8	2	0	优先股
8	3		挂牌公司股票
8	4	0	要约收购
8	4	1	要约回购
8	5	0	股权激励期权
8	8	9	发行业务
8	9	9	指数

(4) **HQZRSP** (字段 3: 昨日收盘价): 挂牌公司股票昨日收盘价为上一交易日收盘价或经除权除息后的上一交易日收盘价, 上一交易日无收盘价的, 则为上一交易日的昨日收盘价。挂牌股票发生首笔交易前昨日收盘价为空。对于要约业务, 存放其收购/回购价格。

(5) **HQJRKP** (字段 4: 今日开盘价): 开盘价为当日该股票的第一笔成交价, 盘后申报达成的成交不纳入开盘价计算。

(6) **HQJSD1** (字段 13: 价格升跌一) = **HQZJCJ** (最近成交价) - **HQZRSP** (昨日收盘价)。若昨日收盘价为空, 则价格升跌一也为空。若价格升跌一超过行情库能揭示的最大范围, 则以 99999.999 或 -9999.999 表示。

(7) **HQJSD2** (字段 14: 价格升跌二) = **HQZJCJ** (最近成交价) - 前一笔最近成交价。

对于当天的第一笔成交:

HQJSD2 (价格升跌二) = **HQZJCJ** (最近成交价) - **HQZRSP** (昨日收盘价)。若昨日收盘价为空, 则价格升跌二也为空。若价格升

跌二超过行情库能揭示的最大范围，则以 99999.999 或 -9999.999 表示。

(8) 卖盘五至卖盘一(HQSJW5, HQSSL5, HQSJW4, HQSSL4, HQSJW3, HQSSL3, HQSJW2, HQSSL2, HQSJW1, HQSSL1) 为实时最低五笔或者五个价位卖出申报的价格和数量，买盘一至买盘五(HQBJW1, HQBSL1, HQBJW2, HQBSL2, HQBJW3, HQBSL3, HQBJW4, HQBSL4, HQBJW5, HQBSL5) 为实时最高五笔或者五个价位买入申报的价格和数量。

a) 若是挂牌公司做市股票，则只揭示三档行情，卖盘四至卖盘五，买盘四至买盘五均为空。买卖盘价格字段都不为空（都大于零）时，字段值有如下关系：

$$\text{HQSJW3} > \text{HQSJW2} > \text{HQSJW1};$$

$$\text{HQBJW3} < \text{HQBJW2} < \text{HQBJW1}。$$

买卖盘信息仅显示做市商做市申报信息，不显示投资者限价申报信息及做市商间互报成交确认申报信息，买价可能会等于或者高于卖价。

b) 若是挂牌公司连续竞价股票，且买卖盘价格字段都不为空（都大于零）时，字段值有如下关系：

$$\text{HQSJW5} > \text{HQSJW4} > \text{HQSJW3} > \text{HQSJW2} > \text{HQSJW1};$$

$$\text{HQBJW5} < \text{HQBJW4} < \text{HQBJW3} < \text{HQBJW2} < \text{HQBJW1}。$$

在集合竞价期间，买卖盘一（HQBJW1/HQBSL1 和 HQSJW1/HQSSL1）显示集合竞价参考成交价、匹配量，买卖数量二（HQBSL2 和 HQSSL2）显示对应未匹配量，买卖盘一

(HQB JW1/HQBSL1 和 HQS JW1/HQSSL1) 显示无法生成参考成交价时的最优一档买卖盘, 每次撮合结束后揭示最优五档买卖盘。

c) 若是挂牌公司集合竞价股票, 买卖盘一 (HQB JW1/HQBSL1 和 HQS JW1/HQSSL1) 显示集合竞价参考成交价、匹配量, 买卖数量二 (HQBSL2 和 HQSSL2) 显示对应未匹配量, 买卖盘一 (HQB JW1/HQBSL1 和 HQS JW1/HQSSL1) 显示无法生成参考成交价时的最优一档买卖盘。

d) 若是两网公司及退市公司集合竞价股票, 集合竞价期间仅在最近成交价 (HQZJCJ) 显示集合竞价参考成交价, 卖盘一至卖盘五, 买盘一至买盘五均为空; 集合竞价撮合完成后显示三档行情。当买卖盘价格字段都不为空 (都大于零) 时, 字段值有如下关系:

$$\text{HQS JW3} > \text{HQS JW2} > \text{HQS JW1};$$
$$\text{HQB JW3} < \text{HQB JW2} < \text{HQB JW1}。$$

e) 若是挂牌公司协议转让优先股, 在开盘期间不揭示买卖盘和成交情况, 收盘后才揭示成交情况, 买卖盘始终不揭示。

若卖盘五至卖盘一 (HQSSL5、HQSSL4、HQSSL3、HQSSL2、HQSSL1), 买盘一至买盘五的数量 (HQBSL1、HQBSL2、HQBSL3、HQBSL4、HQBSL5)、成交数量值超过行情库能揭示的最大范围, 则以 999999999999 表示, 若成交金额的值超过行情库能揭示的最大范围, 则以 999999999999.999 表示。

(9) 凡标注为预留的字段, 如果字段类型为数值型, 其值为 0, 如果字段类型为字符型, 用空格填充。

第三章 申报库 NQWT.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WTHTXH	合同序号	C	22	必填
2	WTZQDM	证券代码	C	6	必填
3	WTZQZH	证券账户	C	10	为十位数字字符, 不足十位的左端补足'0', 不可含空格, 必填
4	WTWTSL	申报数量	N	9,0	必填
5	WTWTJG	申报价格	N	9,3	必填
6	WTYWLB	业务类别	C	2	必填
7	WTDFDY	拟成交对手方交易单元	C	6	数字字符串, 互报成交确认申报必须填写
8	WTDFZH	拟成交对手方证券账户	C	10	数字字符串, 互报成交确认申报必须填写
9	WTWTSL2	申报数量 2	N	9,0	做市报价申报中双向申报的卖出数量
10	WTWTJG2	申报价格 2	N	9,3	做市报价申报中双向申报的卖出价格
11	WTLXR	联系人	C	12	预留
12	WTLXFS	联系方式	C	30	预留
13	WTYDH	成交约定号	N	8,0	成交确认申报必须填写
14	WTRZRQ	融资融券标志	C	1	必填
15	WTPCBZ	平仓标志	C	1	必填
16	WTWTSJ	申报时间	C	6	HHMMSS, 必填
17	WTCLBZ	处理标志	C	1	必填
18	WTBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用
19	WTBYZD1	备用字段 1	N	19,3	预留
20	WTBYZD2	备用字段 2	N	19,3	预留
21	WTBYZD3	备用字段 3	C	40	预留

说明:

(1) **WTHTXH** (字段 1: 合同序号) 的左六位为表示交易单元的数字串, 中间 8 位为申报日期 (CCYYMMDD), 右 8 位为申报流水号。申报流水号中最左两位 (即合同序号 **WTHTXH** 的第 15、16 位) 可为

英文字母或阿拉伯数字，表示主办券商下属的证券营业部识别码（该识别码必须与 NQQSYB 上报的信息一致），其余六位为数字，合同序号必须全市场唯一。

(2) WTWTSL（字段 4：申报数量）和 WTWTJG（字段 5：申报价格）、及 WTWTSL2（字段 9：申报数量 2）和 WTWTJG2（字段 10：申报价格 2）四个字段的值域要求，同 WTYWLB（业务类别）有关，详见表 3-1。

表 3-1：申报业务类别含义表

WTYW LB	申报业务含义	WTWT SL	WTW TJG	WTWTS L2	WTWTJ G2
0B	限价申报买入申报记录	>0	>0	=0	=0
0S	限价申报卖出申报记录	>0	>0	=0	=0
0C	限价申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
1B	成交确认申报买入申报记录	>0	>0	=0	=0
1S	成交确认申报卖出申报记录	>0	>0	=0	=0
1C	成交确认申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
2A	双向做市申报记录	>0	>0	>0	>0
	单向做市申报买入申报记录	>0	>0	=0	=0
	单向做市申报卖出申报记录	=0	=0	>0	>0
2C	做市做市申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
3B	互报成交确认申报买入申报记录	>0	>0	=0	=0
3S	互报成交确认申报卖出申报记录	>0	>0	=0	=0
3C	互报成交确认申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
4B	做市互报成交确认申报买入申报记录	>0	>0	=0	=0
4S	做市互报成交确认申报卖出申报记录	>0	>0	=0	=0
4C	做市互报成交确认申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
6B	定价申报买入申报记录	>0	>0	=0	=0
6S	定价申报卖出申报记录	>0	>0	=0	=0
6C	定价申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
7B	询价申报记录	>0	>0	=0	=0
8B	申购申报记录	>0	>0	=0	=0
EB	撤回预受要约申报记录	>0	≥0	≥0	=0
ES	预受要约申报记录	>0	≥0	≥0	=0
EC	要约撤单记录	=0	=0	≥0	=0
VB	最优五档即时成交剩余撤销买入申报记录	>0	=0	=0	>0

WTYW LB	申报业务含义	WTWT SL	WTW TJG	WTWTS L2	WTWTJ G2
VS	最优五档即时成交剩余撤销卖出申报记录	>0	=0	=0	>0
WB	最优五档即时成交剩余转限价买入申报记录	>0	=0	=0	>0
WS	最优五档即时成交剩余转限价卖出申报记录	>0	=0	=0	>0
WC	最优五档即时成交剩余转限价撤单记录	=0	=0	=0	=0
XB	本方最优申报买入申报记录	>0	=0	=0	>0
XS	本方最优申报卖出申报记录	>0	=0	=0	>0
XC	本方最优申报撤单记录	=0	=0	=0	=0
YB	对手方最优申报买入申报记录	>0	=0	=0	>0
YS	对手方最优申报卖出申报记录	>0	=0	=0	>0
YC	对手方最优申报撤单记录	=0	=0	=0	=0

注：对于做市商双向做市申报，WTYWLB（字段 6：业务类别）应填写为“2A”，WTWTSL（字段 4：申报数量）存放买入数量，WTWTJG（字段 5：申报价格）存放买入价格，WTWTSL2（字段 9：申报数量 2）存放卖出数量，WTWTJG2（字段 10：申报价格 2）存放卖出价格且必须大于 WTWTJG（字段 5：申报价格）。如果是买入单向做市申报，WTWTSL2 和 WTWTJG2 同时为 0，如果是卖出单向做市申报，WTWTSL 和 WTWTJG 同时为 0；若对应数量字段大于 0，要求对应价格字段也大于 0，反之亦然；对于要约业务，WTWTSL2 存放其股份性质，股份性质定义以中国结算公布的为准。对于连续竞价交易业务的市价申报，WTWTJG2（字段 10：申报价格 2）填保护限价。其他业务的 WTWTSL2（字段 9：申报数量 2）和 WTWTJG2（字段 10：申报价格 2）均填 0。

(3) WTYWLB（字段 6：业务类别）为“1B”或“1S”时，WTYDH（字段 13：成交约定号）字段必须大于等于 1,000,000 且小于等于

99,999,999，即填写的值必须是非公开转让申报信息库中揭示的定价申报的约定号。WTYWLB（字段 6：业务类别）为“3B”、“3S”、“4B”或“4S”时，WTYDH（字段 13：成交约定号）字段必须小于 1,000,000。

(4) WTDFDY(字段 7: 拟成交对手方交易单元): 对于 WTYWLB（字段 6：业务类别）为“3B”、“3S”、“4B”或“4S”的成交确认申报需要填写正确的拟成交对手方交易单元；其余业务填为“000000”。

(5) WTDFZH(字段 8: 拟成交对手方证券账户): 对于 WTYWLB（字段 6：业务类别）为“3B”、“3S”、“4B”或“4S”的成交确认申报需要填写正确的拟成交对手方证券账户；其余业务填为“0000000000”。

(6) WTLXR（字段 11：联系人），为预留字段，用空格填满。

(7) WTLXFS（字段 12：联系方式），为预留字段，用空格填满。

(8) WTCLBZ（字段 15：处理标志）将表明本申报记录的处理状态。其初始值由主办券商系统置为‘z’；通信程序将对该笔申报的合法性进行检查，若合法则将 WTCLBZ 置为‘1’，转入申报内容检查，非法则被置为对应的错误代码，见表 3-2。若申报格式正确但申报内容不符合业务要求，则通过回报库（NQHB.DBF）自动撤单并在 NQHB.HBCDYY 和 NQHB.HBDFZH 里填写错误代码和简要撤单原因。

表 3-2：申报记录错误代码含义表

错误代码	含义
A	交易单元非法： 不是 6 位数字编码； 交易单元禁止在该报盘小站上使用； 交易单元未开通； 交易单元状态为冻结或注销。
B	申报日期非法： 不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码； 申报日期不是当天。

错误代码	含义
C	申报流水号非法： 不是 2 位证券营业部编码+6 位数字编码。
D	证券代码非法： 不是 6 位数字编码； 不是已挂牌证券。
E	证券停牌： 证券代码状态为“停牌且当天不接受申报”。
F	申报数量（或申报数量 2）非法： 违反“表 3-1：申报业务类别含义表”相关描述； 撤单申报但数量不为零，非撤单申报但数量不大于零； 申报数量（或申报数量 2）不是整数； 要约申报时申报数量 2 取值范围不在 0-99 之间； 买申报数量不是 NQXX.XXBLDW 的整数倍且不属于互报成交确认申报的买入申报类型； 卖申报数量不是大于零的整数； 申报数量超过 NQXX.XXMBXL 。
G	申报价格（或申报价格 2）非法： 违反“表 3-1：申报业务类别含义表”相关描述； 撤单申报但价格不为零，非撤单申报但价格不大于零； 市价申报但申报价格不等于零或申报价格 2 不大于零； 挂牌公司股票和两网公司及退市公司 A 类股票价格没有精确到小数点后 2 位； 两网公司及退市公司 B 类股票价格没有精确到小数点后 3 位； 申报价格不是 NQXX.XXJGDW 的整数倍。
H	证券账户非法： 不是 10 位数字编码。
I	业务类别非法： 业务类别不属于“0B”、“0S”、“0C”、“1B”、“1S”、“1C”、“2A”、“2C”、“3B”、“3S”、“3C”、“4B”、“4S”、“4C”、“6B”、“6S”、“6C”、“7B”、“8B”、“EB”、“ES”、“EC”、“VB”、“VS”、“WB”、“WS”、“WC”、“XB”、“XS”、“XC”、“YB”、“YS”、“YC”其中之一； 证券代码不允许申报该业务类别； 证券账户不允许申报该业务类别。
J	测试环境正式用户不允许报单。
K	处理标记非法： WTCLBZ 没有填‘z’。
L	交易期间测试用户不允许报单。
M	该交易单元无权经营该种证券。
N	该证券账户无权交易该种证券。
P	申报时间非法： 申报时间不是 HHMMSS 格式的 6 位数字编码；

错误代码	含义
	该证券在当前时间不可交易； 当前申报时间禁止接收该业务类别的申报。
Q	交易单元被禁买或禁卖。 该小站为数据汇总小站，无申报权限。
R	证券账户被禁买或禁卖。
U	对手方信息非法： 互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户非法； 互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户为空； 非互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空。
V	股份性质非法： 要约申报（业务类别属于“EB”、“ES”）中委托数量 2 不为大于等于 0 的 2 位以内整数（0-99）；
W	约定号非法： 成交确认申报中约定号不是 1-8 位数字编码； 非成交确认申报中约定号不为 0。
X	该申报记录标有 DELETE 标记。
Y	融资融券标志错误。
Z	平仓标志错误。

（9）WTRZRQ（字段 14：融资融券标志）：“ ”（空格）-普通交易；“1”-融资；“2”-融券。

（10）WTPCBZ（字段 15：平仓标志）：“ ”（空格）-普通交易；“3”-强制平仓。

第四章 回报库 NQHB.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HBCJHM	成交号码	C	8	数字字符串
2	HBZQDM	证券代码	C	6	数字字符串
3	HBHTXH	合同序号	C	22	
4	HBZQZH	证券账户	C	10	数字字符串
5	HBCJSL	成交数量	N	10,0	为正数时表示买卖成交数量，为负数时表示撤单确认数量，做市商报价撤单时，填写买入撤单确认数量
6	HBCJJG	成交价格	N	9,3	
7	HBCJSL2	成交数量 2	N	10,0	做市商报价撤单时，填写卖出撤单确认数量
8	HBDFDY	对手方交易单元	C	6	数字字符串
9	HBDFZH	对手方证券账户	C	10	数字字符串 撤单回报时填写简要撤单说明
10	HBCJSJ	成交时间	C	8	HHMMSSss
11	HBCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
12	HBYWLB	业务类别	C	2	
13	HBCDYY	撤单原因	C	2	
14	HBRZRQ	融资融券标志	C	1	
15	HBPCBZ	平仓标志	C	1	
16	HBBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用
17	HBBYZD1	备用字段 1	N	19,3	预留
18	HBBYZD2	备用字段 2	N	19,3	预留
19	HBBYZD3	备用字段 3	C	40	预留

说明：

(1) HBCJHM（字段 1：成交号码）是交易支持平台产生的流水号，当日不重复。

(2) HBCJSL（字段 5：成交数量）、HBCJJG（字段 6：成交价格）和 HBCJSL2（字段 7：成交数量 2）三字段的值域要求与 HBYWLB（字段 12：业务类别）相关，对应关系详见表 4-1。

表 4-1：成交回报业务类别含义表

HBYWLB	交易回报业务含义	HBCJSL	HBCJJG	HBCJSL2	对应申报业务类别
0B	限价申报买成交回报	>0	买入成交价	=0	0B VB WB XB YB
0S	限价申报卖成交回报	>0	卖出成交价	=0	0S VS WS XS YS
0C	限价申报撤单回报	≤0	=0	=0	0B 0S 0C
1B	成交确认买成交回报	>0	确认买入成交价	=0	1B
1S	成交确认卖成交回报	>0	确认卖出成交价	=0	1S
1C	成交确认撤单回报	≤0	=0	=0	1B 1S 1C
2B	做市申报买成交回报	>0	做市买入成交价	=0	2A
2S	做市申报卖成交回报	>0	做市卖出成交价	=0	2A
2C	做市申报撤单回报	≤0	=0	≤0	2A 2C
3B	互报成交确认申报买成交回报	>0	确认买入成交价	=0	3B
3S	互报成交确认申报卖成交回报	>0	确认卖出成交价	=0	3S
3C	互报成交确认申报撤单回报	≤0	=0	=0	3B 3S 3C
4B	做市互报成交确认申报买成交回报	>0	确认买入成交价	=0	4B
4S	做市互报成交确认申报卖成交回报	>0	确认卖出成交价	=0	4S
4C	做市互报成交确认申报撤单回报	≤0	=0	=0	4B 4S 4C
6B	定价申报买成交回报	>0	确认买入成交价	=0	6B
6S	定价申报卖成交回报	>0	确认卖出成交价	=0	6S

HBWLB	交易回报业务含义	HBCJSL	HBCJJG	HBCJSL2	对应申报业务类别
6C	定价申报撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	6B 6S 6C
7B	询价申报确认回报	> 0	同申报价格	$= 0$	7B
7C	询价申报撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	7B
8B	申购申报确认回报	> 0	同申报价格	$= 0$	8B
8C	申购申报撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	8B
EB	撤回预受要约确认回报	> 0	同申报价格	≥ 0	EB
ES	预受要约确认回报	> 0	同申报价格	≥ 0	ES
EC	要约撤单回报	≤ 0	$= 0$	≥ 0	EB ES EC
VC	最优五档即时成交剩余撤销撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	VB VS
WC	最优五档即时成交剩余转限价撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	WB WS WC
XC	本方最优申报撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	XB XS XC
YC	对手方最优申报撤单回报	≤ 0	$= 0$	$= 0$	YB YS YC

(3) HBCJSL<0 表示成功撤单的回报 (|HBCJSL|是被撤单的股数); HBCJSL=0 则表示撤单不成功的回报。

(4) 对于要约业务, HBCJSL2 (字段 7: 成交数量 2) 为股份性质。

(5) HBZQDM (字段 2: 证券代码)、HBHTXH (字段 3: 合同序号)和 HBZQZH (字段 4: 证券账户)的定义同申报库(NQWT.DBF), 其值与相应申报记录对应相等。

(6) HBDFDY (字段 8: 对手方交易单元)和 HBDFZH (字段 9: 对手方证券账户) 为互报成交确认申报的成交回报业务中对手方的信

息，其他申报的回报中该字段用 0 填充。

(7) 若 HBYWLB 为“2C”表示为做市商做市申报的撤单回报。此时，若 HBCJSL<0 表示买入申报成功撤单数量；若 HBCJSL2<0 表示卖出申报成功撤单数量。

(8) 闭市标志：HBCJJG = -2.000。盘后交易结束标志：HBCJJG = -3.000。

(9) HBCDYY（字段 13：撤单原因）为交易支持平台对申报自动撤单的原因代号，其含义见表 4-2，相应撤单原因简要说明填于 HBDFZH（字段 9：对手方证券账户）。

表 4-2：交易主机自动撤单含义表

HBCDY Y	HBDFZH	具体含义
01	无效账户	证券账户编码不存在； 证券账户不是 10 位数字编码。
03	单元卖空	托管单元拥有的该证券可用股数小于卖出申报数量。
04	股东卖空	股东拥有的该证券可用股数小于卖出申报数量， 证券公司融券专户上可用股数小于融券卖出数量。
06	价格过高	两网公司及退市公司股票交易申报价格超出涨幅的上限； 做市商间互报成交确认申报价格超过当日允许申报价格区间的上限。
07	价格过低	两网公司及退市公司股票交易申报价格超出跌幅的下限； 做市商间互报成交确认申报价格超过当日允许申报价格区间的下限。
08	价格错误	申报价格非价格档位的整数倍； 撤单申报但价格不为零，非撤单申报但价格不大于零； 挂牌公司股票和两网公司及退市公司 A 类股票价格没有精确到小数点后 2 位； 两网公司及退市公司 B 类股票价格没有精确到小数点后 3 位； 非做市申报但申报价格 2 的值不为 0； 融券卖出价格低于规定价格。
09	数量非法	申报买数量小于下限； 撤单申报单数量不为零；

HBCDY Y	HBDFZH	具体含义
		非撤单申报但数量不大于零； 申报数量不是整数； 买申报数量不是 NQXX.XXBLDW 的整数倍且不属于例外条款； 卖申报数量不是 NQXX.XXSLDW 的整数倍且不属于例外条款； 申报数量超出 NQXX.XXMBXL 的限值； 非做市申报但申报数量 2 的值不为 0。
12	账户非法	证券账户/对方证券账户格式非法； 证券账户/对方证券账户状态不可用。
13	账户限制	证券账户禁止申报该业务类别； 证券账户有买入、卖出或者双向限制； 证券账户限制交易申报买卖的证券（买入、卖出或双向限制）； 证券账户在申报交易单元上限制交易（买入、卖出或双向限制）； 证券账户在申报交易单元上限制交易申报买卖的证券（买入、卖出或双向限制）； 该证券账户无权交易该种证券； 信用账户融资买入或融券卖出禁止交易非标的券； 信用账户不允许买入非担保品； 信用账户融券卖出必须是限价单； 信用账户不能在非融资融券专用交易单元上进行交易； 非信用账户不能在融资融券专用交易单元上进行交易； 融券专用账户禁止交易。
19	配对失败	互报成交确认申报之间不满足配对合法性要求； 成交确认申报与定价申报之间不满足配对合法性要求； 互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户非法； 互报成交确认申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户为空； 定价申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 限价申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 做市商做市申报中拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空； 成交确认申报中（约定号≥1000000）拟成交对手方交易单元或拟成交对手方证券账户不为空；

HBCDY Y	HBDFZH	具体含义
		对方证券账户不存在; 对方证券账户不是 10 位数字编码; 对方交易单元不存在; 对方交易单元不是 6 位数字编码。
22	错误约定号	成交确认申报约定号格式错误(不为长度小于 8 位的数字字符串); 成交确认申报中约定号为空; 定价申报、限价申报或做市商做市申报中约定号不为空; 约定号重复; 非成交确认申报/互报成交确认申报但约定号不为 0。
23	无效单元	交易单元不存在; 交易单元不是 6 位数字编码; 交易单元禁止在该报盘小站上使用; 交易单元未开通; 交易单元处于冻结或注销状态; 该交易单元融资/融券业务权限被暂停; 非融资融券专用交易单元禁止强制平仓; 非融资融券专用交易单元禁止融资融券交易。
26	单元限制	交易单元/对方交易单元禁买、禁卖; 交易单元/对方交易单元无权经营该业务; 交易单元/对方交易单元无权经营该类证券品种; 证券账户禁止通过该交易单元申报/对方证券账户禁止通过对方交易单元申报。
27	市价撤单	本方最优申报时,当前本方无有效委托或者有委托但不满足保护限价; 对手方最优申报时,当前对手方无有效委托或者有委托但不满足保护限价; 最优五档即时成交剩余转限价申报时,未成交部分无对手方申报也无本方申报或者有委托但都不满足保护限价; 最优五档成交剩余撤销申报时,未成交部分当前对手方无有效委托或者有委托但不满足保护限价。
42	融资禁止	当前禁止该证券的融资交易业务。
43	融券禁止	当前禁止该证券的融券交易业务。
44	无效业务	无效业务类别; 不是有效的融资融券标志; 不是有效的平仓标志。
45	禁止零卖	申报数量小于规定值的股份应一次性卖出(余股没有一次性卖

HBCDYY	HBDFZH	具体含义
		出)。
50	做市价格错	做市商双向做市申报价差不符合规定。
51	业务类别错	不属于目前已开通的交易业务； 证券代码不允许申报该业务类别。
52	禁止该业务	当前申报时间不允许接收该业务类别的申报； 该证券当前处于停牌且当天不接受申报状态； 该证券挂牌后未发生成交，禁止做市商间互报成交确认申报。
53	无申报可撤	没有匹配的可撤申报。
54	报价类型错	做市申报非法。
55	无对手方	无可匹配成交的对手方申报。
56	替换撤单	做市申报替换撤单。
57	联系信息错	联系人或联系方式不为空。
58	股份性质错	股份性质不存在； 股份性质不是 2 位以内数字编码。
95	无效代码	证券代码非法或不存在； 证券代码不是 6 位数字编码； 该证券不是已挂牌证券。
96	时间非法	申报时间格式非法。
97	日期非法	申报日期不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码； 非当前交易日期。
98	流水号非法	申报流水号格式非法，不是 2 位营业部编码+6 位数字编码。
99	其他错误	因其他原因导致的交易主机自动撤单。

注：该撤单原因列表会根据实际业务需要扩充。

(10)HBRZRQ（字段 14：融资融券标志）和 HBPCBZ（字段 15：平仓标志）的定义同申报库（NQWT.DBF），其值与相应申报记录对应相等。

第五章 协议转让申报信息库 NQXYXX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	XYZQDM	证券代码	C	6	
2	XYJYDY	交易单元	C	6	预留
3	XYYWLB	业务类别	C	2	
4	XYWTSL	申报数量	N	12,0	
5	XYWTJG	申报价格	N	9,3	
6	XYYDH	成交约定号	N	8,0	系统自动分配，当天全市场唯一
7	XYWTSJ	申报时间	C	6	HHMMSS
8	XYJLZT	记录状态	C	1	0-无效，1-有效
9	XYBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明：

(1) 每个交易日本库的第一条记录为特殊记录，XYZQDM 为“000000”，XYYDH 存放当前日期 CCYYMMDD，XYWTSJ 存放最近一次更新的时间，格式为 HHMMSS。

(2) 协议转让申报信息库不再发布申报信息。

第六章 做市业务申报信息库 NQZSXX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZSZQDM	证券代码	C	6	
2	ZSYWLB	业务类别	C	2	
3	ZSWTSL	申报数量	N	12,0	
4	ZSWTJG	申报价格	N	9,3	
5	ZSSJLX	数据类型	C	1	0-档位；1-笔数
6	ZSWTSJ	申报时间	C	6	HHMMSS，如果为档位时，该字段填写行情生成的时间而不是申报时间
7	ZSBYZD	备用字段	N	8,0	预留

说明：

(1) 每个交易日本库的第一条记录为特殊记录，**ZSZQDM** 为“000000”，**ZSBYZD** 存放当前日期 CCYYMMDD，**ZSWTSJ** 存放最近一次更新的时间，格式为 HHMMSS。

(2) 对于单个做市商，只对其发送该做市商做市股票投资者买卖各最优 10 档申报信息及做市商买卖各最优 10 笔申报信息。若有效申报信息不足 10 笔或 10 档，则无相应数据的记录除证券代码字段外，其余字段用空格（字符型）或 0（数值型）填充。对于同一个做市商同时做市的多只股票，申报信息按“证券代码+业务类别”的顺序发布，且遵循“价格优先、时间优先”的原则。对于不同的做市商，因其做市股票不同，收到的申报信息也就不同。做市商双向做市申报会拆分成单向做市申报信息揭示。业务类别详见表 6-1。

表 6-1：申报业务类别含义表

ZSYWLB	申报业务类别含义	ZSWTSL	ZSWTJG
0B	投资者限价申报买入申报记录	>0	>0
0S	投资者限价申报卖出申报记录	>0	>0
2B	做市商做市申报买入申报记录	>0	>0
2S	做市商做市申报卖出申报记录	>0	>0

(3) 若申报数量超过信息库能揭示的最大范围，则以 999999999999 表示。

第七章 投资者适当性管理信息库

NQHGTZZ?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HGSQXH	流水号	N	8	为主办券商内部当日唯一的流水序号，必填
2	HGZQZH	证券账户	C	10	必填
3	HGZHMC	账户名称	C	108	必填
4	HGQSRQ	签署日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为适当性协议签署的日期，必填
5	HGSQRQ	申请日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为上报开通交易权限的日期，必填
6	HGLBBS	类别标识	C	1	申请变更的适当性类型或交易权限类别，必填
7	HGYBBM	营业部编码	C	2	证券营业部识别码（预留）
8	HGBYZ	备用标识	C	1	券商自用

说明：

(1) 接口库名中??????为转让参与人编码。

(2) **HGZHMC**（字段 3：账户名称）对于个人投资者，填写姓名；对于机构投资者，填写机构全称。

(3) **HGQSRQ**（字段 4：签署日期）和 **HGSQRQ**（字段 5：申请日期）分别填写投资者签署适当性协议的日期和主办券商上报投资者为合格投资者的日期。

(4) 若重报或补报，**HGSQRQ**（字段 5：申请日期）应填写上报日期而不是初次申请日期。

(5) **HGLBBS**（字段 6：类别标识）具体含义如下：

表 7-1：类别标识含义表

HGLBBS	类别标识含义
1	一类合格投资者新增
2	一类合格投资者取消
3	两网退市投资者交易权限开通
4	两网退市投资者交易权限取消
5	四类合格投资者新增
6	四类合格投资者取消
B	二类合格投资者新增
C	二类合格投资者取消
D	三类合格投资者新增
E	三类合格投资者取消

(6) HGYBBM（字段 7：营业部编码）为预留字段，用空格填充。

(7) 本库每天都需通过 FDEP 上报，如当天没有变动则报空库。

(8) 本库上报截止时间为每交易日的 16:15。

第八章 主办券商营业部信息库

NQQSYBYB?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	QSQSMC	券商名称	C	64	必填
2	QSZRCYR	转让参与人编码	C	6	必填
3	QSJYDY	交易单元	C	6	(预留)
4	QSYBYBMC	营业部名称	C	128	必填
5	QSYBYBBM	营业部编码	C	2	营业部识别码, 必填
6	QSSBLX	上报类型	C	1	'1'-"启用"; '3'-"停用"; '4'-"变更", 必填

说明:

- (1) 接口库名中??????为转让参与人编码。
- (2) **QSQSMC** (字段 1: 券商名称) 填写券商全称, 例如: "XX 证券有限责任公司"、"XX 证券股份有限公司"等。
- (3) **QSYBYBMC** (字段 4: 营业部名称) 填写券商全称+营业部全称。该字段必须以 **QSQSMC** 中的内容作为前缀, 例如: "XX 证券有限责任公司 XX 营业部"、"XX 证券股份有限公司 XX 分公司"。
- (4) **QSYBYBBM** (字段 5: 营业部编码) 填写营业部的 2 位编码, 该编码在主办券商内部必须唯一。该编码必须与申报库中的合同序号 **WTHTXH** 的第 15、16 位一致。
- (5) **QSSBLX** (字段 6: 上报类型) 填写主办券商下属营业部与其交易单元的变更关系: 1 表示在指定交易单元新增一家营业部交易;

3 表示在指定交易单元取消指定营业部交易；4 表示指定营业部的名称发生变化。

(6) 自营、资产管理或做市等无营业部配置的系统无需上报。

(7) **QSJYDY**（字段 3：交易单元）为预留字段，用空格填充。

(8) 本库每天都需通过 **FDEP** 上报，只报送当日新增或变动的营业部信息，如当天没有变动则报空库。

(9) 本库上报截止时间为每个交易日的 16:15。

第九章 投资者适当性管理汇总信息库

NQHGTZZ.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HGSQXH	流水号	N	8	为主办券商内部当日唯一的流水序号，不为空
2	HGZQZH	证券账户	C	10	为合格投资者的证券账户，不为空
3	HGZHMC	账户名称	C	108	(预留)
4	HGQSRQ	签署日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为适当性协议签署的日期，不为空
5	HGSQRQ	申请日期	C	8	格式为 CCYYMMDD。为申请开通交易权限的日期，不为空
6	HGLBBS	类别标识	C	1	申请开通成功的适当性权限或交易权限类别，不为空
7	HGYBBM	营业部编码	C	2	为空
8	HGBYBZ	备用标识	C	1	券商自用

说明：

(1) 每个交易日，我司根据接收到的投资者适当性管理信息库文件，生成当日新增投资者证券账户信息，进而与中国结算的有效证券账户信息比对，形成当日的投资者适当性管理汇总信息库，下发给全体主办券商。

(2) 本库不包括两网公司及退市公司权限变动情况。

(3) HGLBBS（字段 6：类别标识）具体含义如下：

表 9-1：类别标识含义表

HGLBBS	类别标识含义
1	一类合格投资者新增
5	四类合格投资者新增
B	二类合格投资者新增



HGLBB S	类别标识含义
D	三类合格投资者新增

第十章 受限投资者可交易证券信息库

NQSXTZZ.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SXZQDM	证券代码	C	6	
2	SXZQZH	证券账户	C	10	

说明：

(1) 本库存放的是受限投资者允许交易的证券代码信息，在本库中的投资者只允许交易在本库中与其证券账户对应的证券，其他的证券禁止交易。如果投资者既不在本库中，又不在投资者适当性管理信息库中，表明该投资者禁止交易。

(2) 本库排序规则为证券代码+证券账户。

(3) 两网退市股票和优先股无受限信息。

第十一章 信息公告文件 xxyymmdd.nnn

信息公告文件为文本格式，一个信息公告就是单独的一个文本。为方便及时获取最新公告信息，NQHQ.DBF 首条特殊记录的 HQBSL4 字段记录了最新公告信息的接收时间（即当日最近一次收到信息公告的时间）。

（1）信息公告文件的命名规则

不同的文件名前缀用来区分不同类型的信息公告。信息公告文件的命名规则为：文件名（xxyymmdd.nnn）=2 位类型前缀+6 位公告日期+“.”+3 位流水号后缀。

其中，类型前缀“XX”表示“信息公告”；类型前缀“GS”表示“挂牌公司信息”；类型前缀“GG”表示“紧急公告”；类型前缀“QS”表示“主办券商信息”；类型前缀“QT”表示“其他公告”，类型前缀“FC”表示“分层信息”，类型前缀“LT”表示“临时停牌公告”，类型前缀“RR”表示“融资融券标的券信息”，类型前缀“DB”表示“融资融券担保券信息”。

日期为不含世纪的 6 位数字，格式为 yymmdd，其中 yy 表示年，mm 表示月，dd 表示日。

流水号后缀为 3 位数字，每天顺序编写。

文件名相同的信息公告下发时，应当重新读取新文件内容，取代旧文件内容。

表 11-1：信息公告文件命名示例

序号	文件名	信息类型	备注
1	XXyymmdd.nnn	全国股转公司信息公告	yymmdd为公告日期，nnn为文件编号 内容包括：全国股转公司业务通知、公告、交易公开信息等信息
2	GSyymmdd.nnn	挂牌公司、两网公司及退市公司信息	yymmdd为公告日期，nnn为文件编号 内容包括：全国股转系统挂牌公司、两网公司及退市公司信息公告摘要等信息
3	GGyymmdd.nnn	全国股转公司紧急公告	yymmdd为公告日期，nnn为文件编号 内容包括：全国股转公司紧急公告、挂牌证券临时停牌公告等信息
4	QSyymmdd.nnn	主办券商信息	yymmdd为公告日期，nnn为文件编号 内容包括：全国股转系统主办券商和做市商信息摘要等信息
5	QTyymmdd.nnn	其他公告	yymmdd为公告日期，nnn为文件编号 内容包括：所有不在已指定信息类型中的信息
6	FCyymmdd.nnn	分层信息	yymmdd 为公告日期，nnn 为文件编号 内容包括：所有已分层的挂牌证券的所属层级
7	LTyymmdd.nnn	临时停牌	yymmdd 为公告日期，nnn 为文件编号 内容包括：挂牌证券临时停牌公告等信息
8	RRyymmdd.nnn	融资融券标的券信息	yymmdd 为公告日期，nnn 为文件编号 内容包括：融资融券标的券及其可融资融券状态等信息
9	DByymmdd.nnn	融资融券担保券信息	yymmdd 为公告日期，nnn 为文件编号 内容包括：融资融券担保券等信息

(2) 信息公告文件的结构头

信息公告文本包含有一个带格式的结构头，结构头存放了信息公告的发送日期、发送时间、信息类型、主标题、主题词等要素。具体约定见表 11-2。

表 11-2：信息公告文件头结构定义

序号	要素	格式	备注
1	发送日期	8 位数字，格式：yyyymmdd	yyyy表示年，mm表示月，dd表示日
2	发送时间	8 位字符，格式：hh:mm:ss	hh 表示小时，mm 表示分，ss 表示秒

序号	要素	格式	备注
3	信息类型	12 位字符，仅 5 种类型	信息公告，挂牌公司信息，紧急公告，主办券商信息，其他公告，分层信息
4	消息来源	字符串	如果是来自全国股转公司的公告，消息来源为“全国股转公司”
5	主标题	字符串	公告标题
6	副标题	字符串	(1) 副标题一般为空，当副标题出现“走马灯”字样时，在首页走马灯位置显示公告正文内容。 (2) 当多个文件出现“走马灯”要求时，由新到旧开始显示。 (3) 走马灯文件只在当天有效。
7	主题词	字符串	有多个主题词时，主题词之间用“,”分隔

(3) 信息公告文件的主题词

主题词是信息公告关键内容的索引。对于一些固定内容的特殊公告，我们使用固定的主题词进行特别的标注。这些特别的公告和主题词的对应关系，如下表所示。

表 11-3：信息公告文件的主题词定义

序号	信息类型	信息内容	主题词
1	信息公告	全国股转系统交易公开信息	公开信息
2	挂牌公司、两网公司及退市公司信息	全国股转系统挂牌公司、两网公司及退市公司信息摘要	挂牌公司信息，两网公司及退市公司信息
3	紧急公告	XXXX证券临时停牌的公告	临时停牌,nnnnnnn (nnnnnnn 为停牌证券代码,当同一公司有多证券时,证券代码之间用“,”分隔。)
4	主办券商信息	全国股转系统主办券商、做市商信息摘要	主办券商信息，做市商信息，主办券商定期报告，做市商定期报告
5	分层信息	当日所有已分层的挂牌证券的所属层级	分层信息
6	临时停牌	XXXX 证券临时停牌的公告	临时停牌, nnnnnnn (nnnnnnn 为停牌证券代码)
7	融资融券标的券信息	当日所有融资融券标的券的信息及其可融资融券状态	融资融券信息
8	融资融券担保	当日所有融资融券担保券的信息	担保券信息

序号	信息类型	信息内容	主题词
	券信息		

(4) 信息公告文件示例

信息公告文件样例如下（注：省略了公告的具体内容）。

示例1：XX130727.801

发送日期：20130727

发送时间：08:38:16

信息类型：信息公告

消息来源：全国股转公司

主标题：全国股转系统交易公开信息

副标题：

主题词：公开信息

全国股转系统交易公开信息

（2013年07月26日）

示例2：GS130727.701

发送日期：20130727

发送时间：08:42:04

信息类型：挂牌公司信息

消息来源：巨潮资讯网

主标题：全国股转系统挂牌公司信息摘要

副标题：

主题词：挂牌公司信息

全国股转系统挂牌公司信息公告摘要

2013年07月27日

（来源:巨潮资讯网）

示例3: GG130509.901

发送日期: 20130509

发送时间: 15:50:15

信息类型: 紧急公告

消息来源: 全国股转公司

主标题: 全国股转公司关于水仙股票临时停牌的公告（模拟演练）

副标题: 走马灯

主题词: 临时停牌, 400008, 420008

示例4: GG130509.902

发送日期: 20130509

发送时间: 15:50:15

信息类型: 紧急公告

消息来源: 全国股转公司

主标题: 全国股转公司关于维珍创意临时停牌的公告

副标题:

主题词: 临时停牌, 430305

示例5: FC190101.001

发送日期: 20190101

发送时间: 08:30:00

信息类型: 分层信息

消息来源: 全国股转公司

主标题: 挂牌公司市场分层信息

副标题:

主题词: 公开信息, 分层信息

TAG

3

839000|测试9000|创新层

839001|测试9001|基础层

839002|测试9002|精选层

END

(注:

分层信息公告文件的正文分为四段:

首行为数据区开始标签TAG;

次行为本次发布挂牌证券的总数;

第三行开始按行揭示所有已分层的挂牌证券的所属层级, 每只证券用一行揭示, 按证券代码从小到大的顺序排列, 各字段之间用“|”分隔。

最末一行为数据区结束标签END。)

示例6: LT190911.001

发送日期: 20190911

发送时间: 14:24:01

信息类型: 紧急公告

消息来源：全国股转公司

主标题：关于测试代码（831007）盘中临时停牌的公告

副标题：

主题词：临时停牌，831007

今日测试证券（831007）竞价交易出现《全国中小企业股份转让系统股票交易规则》规定的临时停牌情形，我司自2019年09月11日14时24分01秒起对测试证券（831007）实施临时停牌，于2019年09月11日14时34分01秒复牌。

我司郑重提示投资者注意交易风险，理性投资。

全国中小企业股份转让系统有限责任公司

2019年09月11日

示例7：RR200817.001

发送日期：20200817

发送时间：08:30:00

信息类型：融资融券标的券信息

消息来源：全国股转公司

主标题：全国股转公司融资融券标的券信息

副标题：

主题词：融资融券信息

TAG

3

839000|测试9000|Y|N|Y|N

839001|测试9001|Y|Y|Y|Y

839002|测试9002|Y|Y|N|Y

END

(注:

融资融券标的券信息的发布内容包括证券代码、证券简称、融资标的状态、融券标的状态、当日可融资状态和当日可融券状态。

融资融券标的券信息的信息公告文件的正文分为四段:

首行为数据区开始标签 TAG;

次行为本次发布标的券的总数;

第三行开始按行揭示标的券的可融资融券状态, 每只证券用一行揭示, 按证券代码从小到大的顺序排列, 各字段之间用“|”分隔。

最末一行为数据区结束标签 END。)

示例8: DB200817.001

发送日期: 20200817

发送时间: 08:30:00

信息类型: 融资融券担保券信息

消息来源: 全国股转公司

主标题: 全国股转公司融资融券担保券信息

副标题:

主题词: 担保券信息

TAG

3

839000|测试9000

839001|测试9001

839002|测试9002

END

(注:

融资融券担保券信息的发布内容包括证券代码、证券简称。

融资融券担保券信息的信息公告文件的正文分为四段:

首行为数据区开始标签 TAG;

次行为本次发布担保券的总数;

第三行开始按行揭示担保券, 每只证券用一行揭示, 按证券代码从小到大的顺序排列, 各字段之间用“|”分隔。

最末一行为数据区结束标签 END。)

第十二章 投资者适当性管理全量库

NQSDXQL.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HGZQZH	证券账户	C	10	
2	HGQSRQ	签署日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为适当性协议签署的日期
3	HGFSRQ	发送日期	C	8	格式为 CCYYMMDD。为该数据的发送日期。
4	HGLBBS	类别标识	C	1	已申请开通的适当性类型或交易权限类别。
5	HGBYBZ	备用标识	C	1	

说明：

(1) 本库为所有有效的合格投资者的全量库，每个交易日都通过 FDEP 下发。

(2) 本库不包括两网公司及退市公司权限变动情况。

(3) HGLBBS（字段 4：类别标识）具体含义如下：

表 9-1：类别标识含义表

HGLBBS	类别标识含义
1	一类合格投资者
5	四类合格投资者
B	二类合格投资者
D	三类合格投资者

第十三章 非公开转让申报信息库

NQFGKSBXX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	FGKZQDM	证券代码	C	6	
2	FGKJYDY	交易单元	C	6	预留
3	FGKZQLB	证券类别	C	2	‘04’-优先股
4	FGKSBLB	申报类别	C	2	
5	FGKWTSL	申报数量	N	12,0	首条记录存放当前日期
6	FGKWTJG	申报价格	N	9,3	
7	FGKYDH	成交约定号	N	8,0	系统自动分配，当天全市场唯一
8	FGKWTSJ	申报时间	C	6	HHMMSS
9	FGKJLZT	记录状态	C	1	0-无效，1-有效
10	FGKBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明：

(1) 每个交易日本库的第一条记录为特殊记录，**FGKZQDM** 为“000000”，**FGKWTSL** 存放当前日期 CCYYMMDD，**FGKWTSJ** 存放最近一次更新的时间，格式为 HHMMSS。

(2) **FGKZQLB**（字段 3：证券类别）：采用非公开交易方式的证券类别。非公开转让证券类别详见表 13-1。

表 13-1：证券类别含义表

FGKZQLB	证券类别含义
04	优先股

(3) 非公开转让申报信息库仅显示协议转让的全部定价申报信息，**FGKJLZT**（字段 8：记录状态）的值为“0”时，表示该申报行情无效（对应的委托已被撤单或已成交）；“记录状态”的值为“1”时，表示该

申报行情有效。同一条申报行情的“记录状态”只可能从“1”变更为“0”或者保持不变。定价申报业务类别详见表 13-2。

表 13-2：申报业务类别含义表

FGKSBL B	申报业务类别含义	FGKWT SL	FGKWT JG
6B	定价申报的买入申报记录	>0	>0
6S	定价申报的卖出申报记录	>0	>0

第十四章 非公开转让成交信息库

NQFGKJCJXX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	FGKJCJXH	序号	N	8	数字字符串，从首条记录开始，从 0 递增
2	FGKZQDM	证券代码	C	6	
3	FGKZQJC	证券简称	C	8	
4	FGKZQLB	证券类别	C	2	‘04’-优先股
5	FGKBJDY Y	买入交易单元	C	6	预留
6	FGKBDYM C	买入营业部名称/交易单元名称	C	128	
7	FGKSJYD Y	卖出交易单元	C	6	预留
8	FGKSDYM C	卖出营业部名称/交易单元名称	C	128	
9	FGKJSL	成交数量	N	12,0	
10	FGKJJG	成交价格	N	9,3	
11	FGKJSJ	成交时间	C	6	HHMMSS
12	FGKBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明：

(1) 每个交易日本库的第一条记录为特殊记录，**FGKZQDM**（字段 1：证券代码）为“000000”，**FGKZQJC**（字段 2：证券简称）存放当前日期 **CCYYMMDD**，**FGKJSJ**（字段 10：成交时间）存放最近一次更新的时间，格式为 **HHMMSS**。

(2) **FGKZQLB**（字段 3：证券类别）：采用非公开交易方式的证券类别。非公开转让成交信息库仅显示采用非公开交易方式的证券的全部成交信息，不揭示其具体的成交方式。非公开转让证券类别详见

表 14-1。

表 14-1：证券类别含义表

FGKZQLB	证券类别含义
04	优先股

(3) 若成交能找到对应的主办券商证券营业部，**FGKBDYMC**（字段 5：买入营业部名称/交易单元名称）/**FGKSDYMC**（字段 7：卖出营业部名称/交易单元名称）成交信息显示主办券商证券营业部名称，否则显示交易单元名称，涉及机构专用交易单元的，公布名称为“机构专用”。

第十五章 投资者适当性管理信息确认库

NQHGTZZQR?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HGSQXH	流水号	N	8	为主办券商内部当日唯一的流水序号，必填
2	HGZQZH	证券账户	C	10	必填
3	HGZHMC	账户名称	C	108	必填
4	HGQSRQ	签署日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为适当性协议签署的日期，必填
5	HGSQRQ	申请日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为上报开通交易权限的日期，必填
6	HGLBBS	类别标识	C	1	申请变更成功的适当性类型或交易权限类别，必填
7	HGYBBM	营业部编码	C	2	证券营业部识别码（预留）
8	HGCLJG	处理结果	C	2	
9	HGBYBZ	备用标识	C	1	券商自用

说明：

(1) 本库为投资者适当性管理信息库 NQHGTZZ?????.DBF 的确认文件，返回券商当日报送合格投资者数据的处理结果。若券商当日不存在已报送文件、报送文件格式错误或报送文件无法正确识别，只返回一条错误代码为 99，其他字段为空的记录。若券商当日无报送数据（NQHGTZZ?????.DBF 记录数为 0）则只下发空文件(记录数为 0)。

(2) 接口库名中?????为转让参与人编码。仅返回对应券商当日报送数据的处理结果，不包括其他券商报送数据的处理结果。

(3) HGLBBS（字段 6：类别标识）具体含义如下：

表 15-1：类别标识含义表

HGLBB S	类别标识含义
1	一类合格投资者新增
2	一类合格投资者取消
3	两网退市投资者交易权限开通
4	两网退市投资者交易权限取消
5	四类合格投资者新增
6	四类合格投资者取消
B	二类合格投资者新增
C	二类合格投资者取消
D	三类合格投资者新增
E	三类合格投资者取消

(4) HGCLJG (字段 8: 处理结果) 存放报送数据的处理结果, 其含义见表 15-2:

表 15-2: 处理结果含义表

HGCLJ G	具体含义
00	处理成功
01	流水号重复; 流水号不是数字编码。
02	证券账户编码不存在; 证券账户不是 10 位数字编码。
03	账户名称为空。
04	签署日期不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码; 签署日期大于当前交易日期。
05	申请日期不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码; 申请日期不是当前交易日期。
06	类别标识不是‘1’、‘2’、‘3’、‘4’、‘5’、‘6’、‘B’、‘C’、‘D’、‘E’ 当中之一。
07	该账户已被报送为合格投资者。
08	该账户不存在相应权限, 无法取消。
09	同一投资者当日权限反向报送。
10	同一投资者当日权限重复报送。
90	流水号数据类型错。
91	证券账号数据类型错。
92	账户名称数据类型错。

HGCLJ G	具体含义
93	签署日期数据类型错。
94	申请日期数据类型错。
95	类别标识数据类型错。
96	营业部编码数据类型错。
98	备用标识数据类型错。
99	报送文件格式无法识别； 报送文件不存在。

(5) 本库每天都通过 FDEP 下发给对应券商，如当天没有变动则下发空库。

(6) 除 HGCLJG（字段 8：处理结果）外，其他字段填写券商原始报送信息。

第十六章 投资者适当性管理信息检查库

NQHGTZZJC?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HGSQXH	流水号	N	8	为主办券商内部当日唯一的流水序号，必填
2	HGZQZH	证券账户	C	10	必填
3	HGZHMC	账户名称	C	108	必填
4	HGQSRQ	签署日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为适当性协议签署的日期，必填
5	HGSQRQ	申请日期	C	8	格式为 CCYYMMDD，为上报开通交易权限的日期，必填
6	HGLBBS	类别标识	C	1	申请变更的适当性类型或交易权限类别，必填
7	HGYBBM	营业部编码	C	2	证券营业部识别码（预留）
8	HGJCJG	检查结果	C	2	
9	HGBYBZ	备用标识	C	1	券商自用

说明：

(1) 本库为投资者适当性管理信息库 NQHGTZZ?????.DBF 的检查结果，每天从 9:00 起至 16:15 止，每隔 5 分钟对券商报送数据进行一次格式检查，返回对券商当日报送合格投资者数据的基本格式的检查结果。

(2) 本库的第一条记录为特殊记录，HGSQXH 填写每次检查的时间，格式为 HHMMSS，若券商在该次检查时段不存在已报送文件、报送文件格式错误或报送文件无法正确识别，除首记录外，只返回一条错误代码为 99，其他字段为空的记录。若券商在该次检查时段无报送数据（NQHGTZZ?????.DBF 记录数为 0）则只下发首条特殊记录。

(3) 接口库名中?????为转让参与人编码。仅返回对应券商当日报送数据的检查结果，不包括其他券商报送数据的检查结果。

(4) HGLBBS（字段 6：类别标识）具体含义如下：

表 16-1：类别标识含义表

HGLBBS	类别标识含义
1	一类合格投资者新增
2	一类合格投资者取消
3	两网退市投资者交易权限开通
4	两网退市投资者交易权限取消
5	四类合格投资者新增
6	四类合格投资者取消
B	二类合格投资者新增
C	二类合格投资者取消
D	三类合格投资者新增
E	三类合格投资者取消

(5) HGJCJG（字段 8：检查结果）存放报送数据的处理结果，其含义见表 16-2：

表 16-2：处理结果含义表

HGJCJG	具体含义
00	处理成功
01	流水号重复； 流水号不是数字编码。
02	证券账户不是 10 位数字编码。
03	账户名称为空。
04	签署日期不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码； 签署日期大于当前交易日期。
05	申请日期不是 8 位 CCYYMMDD 格式的数字编码； 申请日期不是当前交易日期。
06	类别标识不是‘1’、‘2’、‘3’、‘4’、‘5’、‘6’、‘B’、‘C’、‘D’、‘E’ 当中之一。
90	流水号数据类型错。
91	证券账号数据类型错。

HGJCJ G	具体含义
92	账户名称数据类型错。
93	签署日期数据类型错。
94	申请日期数据类型错。
95	类别标识数据类型错。
96	营业部编码数据类型错。
98	备用标识数据类型错。
99	报送文件无法识别； 报送文件格式错误； 报送文件不存在。

(6) 除 HGJCJG（字段 8：检查结果）外，其他字段填写券商原始报送信息。

第十七章 确认库 NQQR?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	QRCJHM	成交号码	C	8	数字字符串
2	QRZQDM	证券代码	C	6	数字字符串
3	QRHTXH	合同序号	C	22	
4	QRZQZH	证券账户	C	10	数字字符串
5	QRCJSL	成交数量	N	10,0	为正数时表示买卖成交数量，为负数时表示撤单确认数量
6	QRCJJG	成交价格	N	9,3	
7	QRCJSL2	成交数量 2	N	10,0	
8	QRDFDY	对手方交易单元	C	6	数字字符串
9	QRDFZH	对手方证券账户	C	10	数字字符串 撤单回报时填写简要撤单说明
10	QRCJSJ	成交时间	C	8	HHMMSSss
11	QRCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
12	QRYWLB	业务类别	C	2	
13	QRCDYY	撤单原因	C	2	
14	QRBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明：

- (1) 接口库名中??????为转让参与人编码。
- (2) 本库存放的是发行业务的询价结果。
- (3) **QRCJHM**（字段 1：成交号码）是交易支持平台产生的流水号，当日不重复。
- (4) **QRCJSL**（字段 5：成交数量）、**QRCJJG**（字段 6：成交价格）和 **QRCJSL2**（字段 7：成交数量 2）三字段的值域要求与 **QRYWLB**（字段 12：业务类别）相关，对应关系详见表 17-1。

表 17-1：成交回报业务类别含义表

QRYWL B	交易回报业务含义	QRCJSL	QRCJJG	QRCJSL 2	对应申报业务类别
7B	询价申报确认回报	>0	同申报价格	>0	7B
7C	询价申报撤单回报	≤0	=0	=0	7B

(5) **QRCJSL**<0 表示询价失败的撤单回报 (**|QRCJSL|**是被撤单的股数)。

(6) **QRZQDM** (字段 2: 证券代码)、**QRHTXH** (字段 3: 合同序号)和 **QRZQZH**(字段 4: 证券账户)的定义同申报库(**NQWT.DBF**), 其值与相应申报记录对应相等。

(7) **QRCDYY** (字段 13: 撤单原因) 为询价失败的原因代号, 其含义见表 17-2, 相应撤单原因简要说明填于 **QRDFZH** (字段 9: 对手方证券账户)。

表 17-2: 交易主机自动撤单含义表

QRCDY Y	QRDFZH	具体含义
07	禁止参与	禁止参与本次发行的后续申购业务

注: 该撤单原因列表会根据实际业务需要扩充。

第十八章 分层信息库 NQFC.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	FCZQDM	证券代码	C	6	
2	FCZQJC	证券简称	C	32	
3	FCBZ	分层标志	C	1	
4	FCSXRQ	分层生效日期	D	8	CCYYMMDD
5	FCBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明：

(1) 本库的第一条记录为特殊记录：**FCZQDM**（字段 1：证券代码）为“000000”；**FCZQJC**（字段 2：证券简称）存放当日具有分层标识的挂牌证券数量；**FCSXRQ**（字段 4：分层生效日期）存放分层信息库生成的交易日期 **CCYYMMDD**。

(2) **FCBZ**（字段 3：分层标志）：‘0’基础层，‘1’创新层，‘2’精选层。

(3) 本库只包含挂牌公司代码，不包含其他代码。

第十九章 融资融券余额数据 RR?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	RRZQDM	证券代码	C	6	
2	RRZRRZYE	前日融资余额	N	19,2	金额，以元为单位
3	RRJRRZMR	当日融资买入额	N	19,2	金额，以元为单位
4	RRJRRZCH	当日融资偿还额	N	19,2	金额，以元为单位
5	RRZRRQYE	前日融券余量	N	19,2	数量，以股为单位
6	RRJRRQMC	当日融券卖出数量	N	19,2	数量，以股为单位
7	RRJRRQMR	当日融券买入数量	N	19,2	数量，以股为单位
8	RRJRXQCH	当日现券偿还数量	N	19,2	数量，以股为单位
9	RRJRRZPC	当日融资强制平仓额	N	19,2	金额，以元为单位
10	RRJRRQPC	当日融券强制平仓量	N	19,2	数量，以股为单位
11	RRJRRZYE	当日融资余额	N	19,2	金额，以元为单位
12	RRJRRQYE	当日融券余量金额	N	19,2	金额，以元为单位，融券余量*当日收盘价
13	RRJYRQ	信用交易发生日期	D	8	CCYYMMDD

说明：

- (1) 接口库名中??????为转让参与人编码。
- (2) 本库每天都需通过 FDEP 上报。
- (3) 当日融资余额=前日融资余额+当日融资买入-当日融资偿还额；
当日融券余量数量=前日融券余量+当日融券卖出数量-当日融券买入数量-当日现券偿还数量；
当日融券余量金额=当日融券余量数量*当日收盘价。
- (4) 当日融资买入金额、当日融券卖出数量、当日融券买入数量、当日融资强制平仓金额、当日融券强制平仓量等当日交易发生额数

据，以当天交易的清算数据为准。

其中，“当日融券买入数量”的申报数量应当为“融券买入”交易指令（包括投资者主动下达的买券还券交易指令、强制平仓交易指令）达成成交而实际了结掉的融券合约数量，即证券公司申报的“当日融券买入数量” $\leq$ 买券还券指令成交数量+强制融券平仓交易指令成交数量。也就是说，当融券买入（包含强制融券平仓）交易指令成交数量超过融券合约数量时，应申报实际了结的融券合约数量，投资者多还部分（即超出融券合约数量部分）的退券视为修正处理，不纳入申报数据。

- （5）通常，当日申报数据中的“前日融券余量”应与前一交易日申报的“当日融券余量”相等，但在当日发生因送红股而除权的情形下，当日申报数据中的“前日融券余额”不等于前一交易日申报的“当日融券余额”，其计算方法如下：

结算公司于股权登记日（R 日）下午收市后进行权益分派到账处理，证券于 R+1 日除权：证券公司在 R 日完成融资融券余额数据申报后，应对融券余额大于 0 的客户进行记借红股处理（例如，某投资者融券了 100 股，送股比例为 0.1，则将该投资者记借 100 股调整为记借 110 股，计算结果精确至股或份），于 R+1 日申报的“前日融券余量”=所有融券客户记借红股处理后的融券数量总计=R 日申报的“当日融券余量”+记借红股总量。

- （6）报送的数据不应包含包括佣金或交易经手费等费用部分。如，“当日融资买入额”=融资买入成交数量*成交价格，不包括交易印花税和佣金等费用部分；“当日融资偿还额”，应为扣除交纳交易印花税和佣金及融资费用后实际了结的融资合约额。
- （7）上表中，“当日融资偿还额”包含“本日融资强制平仓额”，“当日融券买入数量”包含“当日融券强制平仓量”。
- （8）上表中金额类字段，计算过程中精确至 0.01 元，最终结果精确至 1 元。
- （9）当证券代码为‘999999’时，代表该笔记录为所有标的证券的总计金额。

(10) 如某标的的证券前日融资余额、前日融券余额都为零，且当日无融资融券业务发生，则可不申报该证券的记录。申报数据中必须包含汇总记录（证券代码为‘999999’），即使所有标的的证券的余额数据都为0。

(10) 申报记录应按证券代码由小到大排序。

(11) 证券公司应确保每交易日正确申报该数据，申报的截止时间点为当日晚上 10:00。如证券公司因故未能于通常申报时间（如晚 9:00）成功申报，应启动应急流程，向全国股转公司有关人员报告。

(12) 如证券公司在约定时间（晚 10:00）前有多次申报，则以最后一次申报的数据为准。

第二十章 信用违约资料 WY?????.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WYZRCYZ	转让参与人代码	C	6	
2	WYJYDY	交易单元代码	C	6	主融资融券专用交易单元
3	WYQSMC	券商名称	C	40	
4	WYGDDM	违约者证券账户	C	10	
5	WYGDXM	违约者姓名	C	60	
6	WYSFZH	身份证号	C	30	
7	WYWYJE	违约金额	N	19,2	
8	WYWYLB	违约类别	C	1	“1”：未按规定补足担保物 “2”：合约期满未清偿 “3”：提供虚假信息 “4”：发生司法纠纷
9	WYSBLB	申报类别	C	1	“1”：新增 “2”：撤销 “3”：结案
10	WYSBRQ	申报日期	D	8	
11	WYBYBZ	备用字段	C	2	备用

说明：

- (1) 接口库名中??????为转让参与人编码。
- (2) 本库每天都需通过 FDEP 上报，如当天没有变动则报空库。
- (3) 全国股转公司于约定的截止时间点（每交易日晚上 10：00）前接收信用违约资料的申报。如券商多次申报，则以最后收到的数据为准。全国股转公司汇总各券商的数据，并以 XYWYZL.DBF（库结构同 WY?????.DBF）通过 FDEP 自动发送给开展融资融券业务的券商。

- (4) 由于违约汇总资料为每日的变更情况而并非当前完整的违约信息，券商需根据变更情况（新增、撤销、结案）维护违约信息。

第二十一章 信用违约资料汇总

XYWYZL.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WYZRCYZ	转让参与人代码	C	6	
2	WYJYDY	交易单元代码	C	6	主融资融券专用交易单元
3	WYQSMC	券商名称	C	40	
4	WYGDDM	违约者证券账户	C	10	
5	WYGDXM	违约者姓名	C	60	
6	WYSFZH	身份证号	C	30	
7	WYWYJE	违约金额	N	19,2	
8	WYWYLB	违约类别	C	1	“1”：未按规定补足担保物 “2”：合约期满未清偿 “3”：提供虚假信息 “4”：发生司法纠纷
9	WYSBLB	申报类别	C	1	“1”：新增 “2”：撤销 “3”：结案
10	WYSBRQ	申报日期	D	8	
11	WYBYBZ	备用字段	C	2	备用

说明：

- (1) 本库每天都通过 FDEP 下发，如当天没有变动则下发空库。
- (2) 本库为汇总各券商报送的当日违约数据变动情况。