上海黄金交易所 黄金资产管理产品登记托管系统 数据文件接口规范

（V0.6）

上海黄金交易所

2021年5月

文档标识

|  |  |
| --- | --- |
| 文档名称 | 上海黄金交易所黄金资产管理产品登记托管系统数据上报文件接口规范 |
| 版本号 | V0.5 |
| 状况 |  |

文档修订历史

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **版本** | **日期** | **描述** | **文档所有者** |
| V0.10 | 2019.4 | 形成初稿 |  |
| V0.20 | 2019.5 | 技术开发中心内部评审通过 |  |
| V0.30 | 2019.5 | 形成alpha版本 |  |
| V0.40 | 2020.6 | 增加累计净值、产品存续规模（元）、当日申购份额（份）、当日赎回份额（份）、当月赎回份额（份）、初始净值、投资标的发行机构编码、当月申购金额（元）、当月赎回金额（元）、业绩比较基准字段，产品余额（元）修改为存续规模（元）且对黄金理财产品存续期数据中的累计净值（元）、产品净值（元）、实现收益率（%）、投资者数量（万）字段的备注进行修改，详见6.1章节。 |  |
| V0.50 | 2021.3 | 更新文件上报方式章节的内容描述 |  |
| V0.60 | 2021.5 | 更新文件上报方式章节的内容描述 |  |

目录

[1前言 2](#_Toc44194158)

[1.1 目标和范围 2](#_Toc44194159)

[1.2 读者对象 2](#_Toc44194160)

[2 术语和定义 2](#_Toc44194161)

[3 数据文件与字段定义规范 3](#_Toc44194162)

[3.1 文件分类 3](#_Toc44194163)

[3.2 文件命名规则 3](#_Toc44194164)

[3.3 文件格式 3](#_Toc44194165)

[3.4 字段类型 4](#_Toc44194166)

[4 文件存取方式 4](#_Toc44194167)

[4.1 文件上传路径 4](#_Toc44194168)

[4.2 文件上报方式 4](#_Toc44194169)

[5 文件校验机制 5](#_Toc44194170)

[5.1 校验机制 5](#_Toc44194171)

[5.2 校验文件格式 5](#_Toc44194172)

[6 文件清单和字段列表 5](#_Toc44194173)

[6.1 文件清单 5](#_Toc44194174)

[6.2.1 黄金ETF存续期数据 5](#_Toc44194175)

[6.2.2 黄金ETF联接基金存续期数据 6](#_Toc44194176)

[6.2.3 黄金理财产品存续期数据 7](#_Toc44194177)

[6.2.4 ETF存续期数据投资标的关联数据 8](#_Toc44194178)

[6.2.5 ETF联接基金存续期数据投资标的关联数据 8](#_Toc44194179)

[6.2.6 理财产品存续期数据投资标的关联数据 9](#_Toc44194180)

[7 附录 10](#_Toc44194181)

[7.1 投资标的说明 10](#_Toc44194182)

[7.2 币种 11](#_Toc44194183)

[7.3 单位 11](#_Toc44194184)

# 1前言

## 目标和范围

本文档定义了上海黄金交易所系统与发行管理机构、实物登记托管机构之间传输的数据文件内容及传输方式。

## 读者对象

本接口标准说明书的适用读者为：上海黄金交易所业务/技术部门人员、发行管理机构、实物登记托管机构的开发人员。

# 术语和定义

**发行管理机构**：指发行或者管理黄金资产管理产品的金融机构

**实物登记托管机构**：指为投资于场外实物黄金的黄金资管产品提供登记托管服务的金融机构

**资产管理产品**：是指经金融监管部门同意，各类金融机构发行的资产管理类产品。理财产品投资资产管理产品主要分为“自主管理”（即主动管理）和“委托管理”（即被动管理）两种形式。

**理财产品**：发行机构为向客户提供理财服务、实现资产增值保值目的而发起设立的金融产品，该产品按照合同事先约定的方式进行投资和资产管理，与客户按照约定方式承担投资收益与风险。

# 数据文件与字段定义规范

## 文件分类

|  |  |
| --- | --- |
| 编号 | 业务 |
| 001 | 黄金ETF存续期数据 |
| 002 | 黄金ETF联接基金存续期数据 |
| 003 | 黄金理财产品存续期数据 |
| 004 | ETF存续期数据投资标的关联数据 |
| 005 | ETF联接基金存续期数据投资标的关联数据 |
| 006 | 理财产品存续期数据投资标的关联数据 |

## 文件命名规则

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **文件类型** | **说明** | **命名格式** |
| 数据文件 | 用于保存上报的业务数据 | [业务编号]\_[机构代码]\_[上报日期].txt |
| 校验文件 | 用于校验对应的数据文件的完整性。每个数据文件必须要对应一个校验文件 | [业务编号]\_[机构代码]\_[上报日期].md5 |

## 文件格式

1. 文本文件
2. 按行分隔数据条目，行分隔符为'\n'(LF, 0x10)，最后一行也用行分隔符结尾
3. 每条数据条目的字段数固定，字段间用二进制字符0x01分隔。字段数量不正确的行被视为非法数据。
4. 文件头尾无空行
5. 支持的数据类型有字符串、数字
6. 字符串类型字段统一用utf-8编码
7. 如果文件无数据也应该生成空文件
8. 空字段留空（分隔符之间不填充任何字符）即可

## 字段类型

字段类型说明：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **类型** | **符号表示** | **示例** | **说明** |
| 字符串 | C(x) | 类型C6，表示最大长度为6的字符串 | x表示最大长度 |
| 数字 | N(x,y) | 类型N(6,4)，总长度最大为6（不包括小数点），小数部分最大长度为4的数字，比如12.3456是合法数字，123.4567不合法，12.34567不合法 | x表示最大字符长度（不包括小数点），y表示小数部分最大长度 |

# 文件存取方式

## 文件上传路径

文件上传路径为sftp://[username]@[host]:[port]/[filename]

示例: sftp://user1@1.2.3.4:8000/001\_00000000000001\_20190429.txt

（假设数据上报方的用户名为user1，文件服务器的IP地址为1.2.3.4，端口号为8000，文件名为001\_00000000000001\_20190429.txt）

## 文件上报方式

1、外部文件交互推荐升级到HTTPS协议。此模式下，外部系统需要支持HTTPS上传功能，并且支持报文加签；

2、继续使用机构编码作为统一文件系统访问账号；

3、过渡期SFTP协议支持会保留，SFTP密码上线前后保持不变；

4、HTTPS协议模式下，机构需要上传公钥，公钥由机构联系运维部上传给交易所；

5、SFTP协议模式下，不再支持修改密码，如果想更新认证信息，必须切换到公钥认证登录模式；

6、使用SM2Sign-with-SM3算法加签RSA；

7、四代统一文件系统会在过渡期内继续兼容原SFTP协议，过渡期之后原则上要求升级为通过HTTPS协议传输文件。访问四代统一文件系统的接口协议详见《上海黄金交易所四代统一文件系统接口协议》；

8、https中URL的topic值统一使用/getr\_data/；

9、SFTP切换HTPPS过渡期为2021年国庆-2021年12月31日，过渡期后不再支持SFTP协议。

# 文件校验机制

## 校验机制

文件校验时，引入校验文件来做校验：

对于文件生成方，在数据文件生成后，应生成对应的标志文件。

对于文件接收方，只有在检测到标志文件后，才能下载该数据文件和标志文件。通过核对标志文件中的校验码，文件接收方来校验文件的完整性。

## 校验文件格式

1. 单行文本文件
2. 内容仅为对应的数据文件的md5值的二进制字符串表示（小写）
3. 以’\n’(LF, 0x10)结尾

# 文件清单和字段列表

## 文件清单

### 6.2.1 黄金ETF存续期数据

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **字段类型** | **备注** |
| 1 | 产品编码 | C6 | 必填 |
| 2 | 数据截止日期 | C8 | 必填，示例：20190322 |
| 3 | 现金申购量（千克） | N(16,2) | 必填 |
| 4 | 现金赎回量（千克） | N(16,2) | 必填 |
| 5 | 日终基金总份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 6 | 证券交易所场内交易总量（份） | N(14,2) | 必填 |
| 7 | 证券交易所场内交易金额（元） | N(16,2) | 必填 |
| 8 | ETF开盘价（元） | N(10,4) | 必填 |
| 9 | ETF收盘价（元） | N(10,4) | 必填 |
| 10 | 基金单位净值 | N(10,4) | 必填 |
| 11 | 租借余额（千克） | N(16,2) | 选填 |
| 12 | 投资者数量 | N(12,0) | 必填 |
| 13 | 机构代码 | C14 | 必填 |
| 14 | 累计净值 | N(10,4) | 必填 |
| 15 | 产品存续规模（元） | N(16,2) | 必填 |
| 16 | 当日申购份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 17 | 当日赎回份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 18 | 当月申购份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 19 | 当月赎回份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 20 | 初始净值 | N(10,4) | 必填 |

### 6.2.2 黄金ETF联接基金存续期数据

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **类型** | **备注** |
| 1 | 产品编码 | C6 | 必填 |
| 2 | 数据截止日期 | C8 | 必填，示例：20190322 |
| 3 | 现金申购量（份） | N(16,2) | 必填 |
| 4 | 现金赎回量（份） | N(16,2) | 必填 |
| 5 | 日终基金总份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 6 | 日终基金单位净值 | N(10,4) | 必填 |
| 7 | 投资者数量 | N(12,0) | 必填 |
| 8 | 机构代码 | C14 | 必填 |
| 9 | 累计净值 | N(10,4) | 必填 |
| 10 | 产品存续规模（元） | N(16,2) | 必填 |
| 11 | 当月申购份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 12 | 当月赎回份额（份） | N(18,2) | 必填 |
| 13 | 初始净值 | N(10,4) | 必填 |

### 6.2.3 黄金理财产品存续期数据

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **类型** | **备注** |
| 1 | 产品编码 | C15 | 必填 |
| 2 | 数据截止日期 | C8 | 必填，示例：20190322 |
| 3 | 存续规模（元） | N(15,2) | 必填 |
| 4 | 累计净值（元） | N(10,5) | 净值类产品必填，非净值类产品选填。 |
| 5 | 产品净值（元） | N(10,5) | 净值类产品必填，非净值类产品选填。 |
| 6 | 实现收益率（%） | N(8,5) | 非净值型产品必填，净值型产品选填。 |
| 7 | 投资者数量（万） | N(14,4) | 必填 |
| 8 | 产品总份额（份） | N(18,5) | 必填 |
| 9 | 累计申购份额（份） | N(18,5) | 选填 |
| 10 | 累计赎回份额（份） | N(18,5) | 选填 |
| 11 | 机构代码 | C14 | 必填 |
| 12 | 当月申购金额（元） | N(15,2) | 开放式产品必填，封闭式产品为空。 |
| 13 | 当月赎回金额（元） | N(15,2) | 开放式产品必填，封闭式产品为空。 |
| 14 | 当月申购份额（份） | N(18,5) | 开放式净值类产品必填，其它产品为空. |
| 15 | 当月赎回份额（份） | N(18,5) | 开放式净值类产品必填，其它产品为空. |
| 16 | 初始净值 | N(10,5) | 净值型产品必填，其它类型产品为空。 |
| 17 | 业绩比较基准 | N(8,5) | 必填，如3.24% |

### 6.2.4 ETF存续期数据投资标的关联数据

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **类型** | **备注** |
| 1 | 产品编码 | C6 | 必填 |
| 2 | 数据截止日期 | C8 | 必填，示例：20190322 |
| 3 | 投资标的编码 | C9 | 必填 |
| 4 | 投资标的数量 | N(18,5) | 必填 |
| 5 | 投资标的类型 | C2 | 必填 |
| 6 | 币种 | C2 | 必填 |
| 7 | 单位 | C2 | 必填 |
| 8 | 余额 | N(15,2) | 必填 |
| 9 | 折算人民币余额（元/人民币） | N(15,2) | 必填 |
| 10 | 投资标的发行机构编码 | C14 | 必填 |

### 6.2.5 ETF联接基金存续期数据投资标的关联数据

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **类型** | **备注** |
| 1 | 产品编码 | C6 | 必填 |
| 2 | 数据截止日期 | C8 | 必填,示例：20190322 |
| 3 | 投资标的编码 | C9 | 必填 |
| 4 | 投资标的数量 | N(18,5） | 必填 |
| 5 | 投资标的类型 | C2 | 必填 |
| 6 | 币种 | C2 | 必填 |
| 7 | 单位 | C2 | 必填 |
| 8 | 余额 | N(15,2) | 必填 |
| 9 | 折算人民币余额（元/人民币） | N(15,2) | 必填 |
| 10 | 投资标的发行机构编码 | C14 | 必填 |

### 6.2.6 理财产品存续期数据投资标的关联数据

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **字段名** | **类型** | **备注** |
| 1 | 产品编码 | C15 | 必填 |
| 2 | 数据截止日期 | C8 | 必填，示例：20190322 |
| 3 | 投资标的编码 | C9 | 必填 |
| 4 | 投资标的数量 | N(18, 5) | 必填 |
| 5 | 投资标的类型 | C2 | 必填 |
| 6 | 币种 | C2 | 必填 |
| 7 | 单位 | C2 | 必填 |
| 8 | 余额 | N(15,2) | 必填 |
| 9 | 折算人民币余额（元/人民币） | N(15,2) | 必填 |
| 10 | 投资标的发行机构编码 | C14 | 必填 |

# 附录

## 投资标的说明

|  |  |
| --- | --- |
| **投资标的编码** | **投资标的全称** |
| 010100001 | Au99.99 |
| 010200001 | Au99.95 |
| 010300001 | Au99.5 |
| 010400001 | Au50g |
| 010500001 | Au100g |
| 010600001 | PGC30g |
| 010700001 | iAu100g |
| 010800001 | iAu99.99 |
| 010900001 | iAu99.5 |
| 011000001 | 上海金 |
| 011100001 | 其他场内实物黄金 |
| 020100001 | 金条 |
| 020200001 | 金锭 |
| 020300001 | 金币 |
| 020400001 | 金钞 |
| 020500001 | 金块 |
| 020600001 | 艺术品 |
| 020700001 | 其他场外实物黄金 |
| 030100001 | 期权 |
| 030200001 | 期货 |
| 030300001 | 远期 |
| 030400001 | 掉期 |
| 030500001 | Au（T+D） |
| 030600001 | mAu（T+D） |
| 030700001 | Au（T+N1） |
| 030800001 | Au（T+N2） |
| 030900001 | 其他黄金衍生品 |
| 040100001 | 黄金ETF |
| 040200001 | 黄金ETF联接基金 |
| 040300001 | 黄金理财产品 |
| 040400001 | 券商资产管理计划 |
| 040500001 | 期货资产管理计划 |
| 040600001 | 保险资产管理计划 |
| 040700001 | 私募基金 |
| 040800001 | 其他黄金资管产品 |
| 050100001 | 黄金积存产品 |
| 050200001 | 账户黄金产品 |
| 050300001 | 黄金租借合约 |
| 050400001 | 黄金质押产品 |
| 050500001 | 其他产品 |

## 币种

|  |  |
| --- | --- |
| **序号** | **中文名称** |
| 01 | 人民币 |
| 02 | 美元 |
| 03 | 港元 |
| 04 | 欧元 |
| 05 | 日元 |
| 06 | 英镑 |
| 99 | 其他 |

## 单位

说明：01 克/02 千克/03 盎司/04 手/05 份额/06 币种/99 其他，如选择“06 币种”，则该要素与“币种”保持一致即可，为计量投资标的标准量的名称。