

会员二级系统

清算数据文件接口规范

V1.01

上海黄金交易所

2024年5月

文档修订历史

| **版本号** | **日期** | **修订说明** |
| --- | --- | --- |
| V1.0 | 2023-11 | 形成基线版 |
| V1.01 | 2024-05 | 增订2024年端午版本接口变更内容 |

目录

[1 文件获取方式 7](#_Toc166485893)

[2 文件清单 7](#_Toc166485894)

[3 资金数据 13](#_Toc166485895)

[3.1 席位资金数据文件 13](#_Toc166485896)

[3.1.1 明细记录 13](#_Toc166485897)

[3.2 席位保证金业务流水文件 15](#_Toc166485898)

[3.2.1 汇总记录 15](#_Toc166485899)

[3.3 客户保证金业务流水文件 16](#_Toc166485900)

[3.3.1 明细记录 16](#_Toc166485901)

[4 库存数据 17](#_Toc166485902)

[4.1 客户库存数据文件 17](#_Toc166485903)

[4.1.1 明细记录 17](#_Toc166485904)

[4.2 客户库存明细数据文件 18](#_Toc166485905)

[4.2.1 明细记录 18](#_Toc166485906)

[4.3 客户库存变化流水数据文件 19](#_Toc166485907)

[4.3.1 明细记录 19](#_Toc166485908)

[5 持仓数据 23](#_Toc166485909)

[5.1 席位延期持仓数据文件 23](#_Toc166485910)

[5.1.1 汇总记录 23](#_Toc166485911)

[5.2 客户延期持仓数据文件 24](#_Toc166485912)

[5.2.1 明细记录 24](#_Toc166485913)

[5.3 席位保证金询价持仓数据文件 25](#_Toc166485914)

[5.3.1 明细记录 25](#_Toc166485915)

[5.4 客户保证金询价持仓数据文件 25](#_Toc166485916)

[5.4.1 明细记录 25](#_Toc166485917)

[6 成交单数据 26](#_Toc166485918)

[6.1 现货实盘成交单数据文件 26](#_Toc166485919)

[6.1.1 明细记录 26](#_Toc166485920)

[6.2 即期成交单数据文件 27](#_Toc166485921)

[6.2.1 明细记录 27](#_Toc166485922)

[6.3 递延成交单数据文件 28](#_Toc166485923)

[6.3.1 明细记录 28](#_Toc166485924)

[6.4 交收申报成交单数据文件 29](#_Toc166485925)

[6.4.1 明细记录 29](#_Toc166485926)

[6.5 定价成交单数据文件 30](#_Toc166485927)

[6.5.1 明细记录 30](#_Toc166485928)

[6.6 大宗交易成交单数据文件 31](#_Toc166485929)

[6.6.1 明细记录 31](#_Toc166485930)

[6.7 询价交易成交单数据文件 31](#_Toc166485931)

[6.7.1 明细记录 31](#_Toc166485932)

[6.8 历史询价成交单变更数据文件 37](#_Toc166485933)

[6.8.1 明细记录 37](#_Toc166485934)

[6.9 询价期权成交单数据文件 43](#_Toc166485935)

[6.9.1 明细记录 43](#_Toc166485936)

[6.10 历史询价期权成交单变更数据文件 49](#_Toc166485937)

[6.10.1 明细记录 49](#_Toc166485938)

[6.11 询价拆借成交单数据文件 55](#_Toc166485939)

[6.11.1 明细记录 55](#_Toc166485940)

[6.12 历史询价拆借成交单变更数据文件 60](#_Toc166485941)

[6.12.1 明细记录 60](#_Toc166485942)

[6.13 保证金询价交易成交单数据文件 65](#_Toc166485943)

[6.13.1 明细记录 65](#_Toc166485944)

[6.14 保证金询价交易调仓单数据文件 66](#_Toc166485945)

[6.14.1 明细记录 66](#_Toc166485946)

[7 黄金ETF交易数据 67](#_Toc166485947)

[7.1 账户备案信息数据文件 67](#_Toc166485948)

[7.1.1 明细记录 67](#_Toc166485949)

[7.2 认申赎清单数据文件 70](#_Toc166485950)

[7.2.1 明细记录 70](#_Toc166485951)

[8 交割数据 72](#_Toc166485952)

[8.1 预交割单数据文件 72](#_Toc166485953)

[8.1.1 明细记录 72](#_Toc166485954)

[8.2 交割单数据文件 73](#_Toc166485955)

[8.2.1 明细记录 73](#_Toc166485956)

[8.3 现金交割单数据文件 74](#_Toc166485957)

[8.3.1 明细记录 74](#_Toc166485958)

[9 清算费用数据 75](#_Toc166485959)

[9.1 席位费用数据文件 75](#_Toc166485960)

[9.1.1 汇总记录 75](#_Toc166485961)

[9.2 客户费用数据文件 78](#_Toc166485962)

[9.2.1 明细记录 78](#_Toc166485963)

[9.3 席位升贴水信息数据文件 80](#_Toc166485964)

[9.3.1 汇总记录 80](#_Toc166485965)

[9.4 客户升贴水信息数据文件 81](#_Toc166485966)

[9.4.1 明细记录 81](#_Toc166485967)

[9.5 询价即远掉手续费明细单数据文件 81](#_Toc166485968)

[9.5.1 明细记录 81](#_Toc166485969)

[9.6 询价期权手续费明细单数据文件 82](#_Toc166485970)

[9.6.1 明细记录 82](#_Toc166485971)

[9.7 询价拆借手续费明细单数据文件 83](#_Toc166485972)

[9.7.1 明细记录 83](#_Toc166485973)

[9.8 保证金询价手续费明细单数据文件 83](#_Toc166485974)

[9.8.1 明细文件 83](#_Toc166485975)

[10 行情数据 84](#_Toc166485976)

[10.1 竞价收市行情数据文件 84](#_Toc166485977)

[10.1.1 明细记录 84](#_Toc166485978)

[10.2 定价合约定盘价数据文件 85](#_Toc166485979)

[10.2.1 明细记录 85](#_Toc166485980)

[10.3 保证金询价结算价数据文件 86](#_Toc166485981)

[10.3.1 明细记录 86](#_Toc166485982)

[10.4 租借基准利率数据文件 86](#_Toc166485983)

[10.4.1 明细记录 86](#_Toc166485984)

[11 询价清算单明细 87](#_Toc166485985)

[11.1 即远掉到期清算单数据文件 87](#_Toc166485986)

[11.1.1 明细记录 87](#_Toc166485987)

[11.2 期权权利金清算单数据文件 89](#_Toc166485988)

[11.2.1 明细记录 89](#_Toc166485989)

[11.3 拆借过户清算单数据文件 90](#_Toc166485990)

[11.3.1 明细记录 90](#_Toc166485991)

[11.4 拆借利息清算单数据文件 91](#_Toc166485992)

[11.4.1 明细记录 91](#_Toc166485993)

[11.5 保证金询价到期清算单数据文件 92](#_Toc166485994)

[11.5.1 明细记录 92](#_Toc166485995)

[12 其他数据 93](#_Toc166485996)

[12.1 充抵申请明细数据文件 93](#_Toc166485997)

[12.1.1 明细记录 93](#_Toc166485998)

[12.2 违约单数据文件 95](#_Toc166485999)

[12.2.1 明细记录 95](#_Toc166486000)

[12.3 发票数据文件 95](#_Toc166486001)

[12.3.1 明细记录 95](#_Toc166486002)

[12.4 席位保证金率数据文件 96](#_Toc166486003)

[12.4.1 明细文件 96](#_Toc166486004)

[12.5 席位手续费率数据文件 97](#_Toc166486005)

[12.5.1 明细文件 97](#_Toc166486006)

[12.6 客户保证金率数据文件 98](#_Toc166486007)

[12.6.1 明细文件 98](#_Toc166486008)

[12.7 客户手续费率数据文件 99](#_Toc166486009)

[12.7.1 明细文件 99](#_Toc166486010)

[12.8 单向大边合约组合数据文件 100](#_Toc166486011)

[12.8.1 明细文件 100](#_Toc166486012)

[12.9 延期合约交割方式数据文件 100](#_Toc166486013)

[12.9.1 明细文件 100](#_Toc166486014)

[12.10 保证金询价席位保证金率数据文件 101](#_Toc166486015)

[12.10.1 明细文件 101](#_Toc166486016)

[12.11 保证金询价客户保证金率数据文件 101](#_Toc166486017)

[12.11.1 明细文件 101](#_Toc166486018)

[12.12 保证金询价交割保证金率数据文件 102](#_Toc166486019)

[12.12.1 明细文件 102](#_Toc166486020)

[12.13 保证金询价违约费率数据文件 102](#_Toc166486021)

[12.13.1 明细文件 102](#_Toc166486022)

[13 客户转移业务数据 103](#_Toc166486023)

[13.1 客户转移申请数据文件 103](#_Toc166486024)

[13.1.1 明细文件 103](#_Toc166486025)

[13.2 客户转移延期持仓数据文件 103](#_Toc166486026)

[13.2.1 明细文件 103](#_Toc166486027)

[13.3 转移客户费用数据文件 104](#_Toc166486028)

[13.3.1 明细文件 104](#_Toc166486029)

[14 标志文件 105](#_Toc166486030)

[15 版本业务影响说明 105](#_Toc166486031)

[15.1 2024年端午版本 105](#_Toc166486032)

# 文件获取方式

会员通过交易所四代统一文件系统下载清算数据文件。通过HTTPS协议传输文件：

（1）会员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》。

（2）会员在访问四代统一文件系统下载清算数据文件时，在HTTPS协议下仅支持通过公私钥签名验签验证。其中：

·公钥由会员生成后通过交易所会员服务平台上传给交易所。

（3）会员单位在通过HTTPS协议下载清算数据文件时，URL中的topic值约定为“settle\_data”。

# 文件清单

遵循《数据接口标准（GDS）》协议标准，所有数据文件均为文本文件，若当日文件无记录，则生成空数据文件。

对于同一会员下，多个席位的清算文件，采用压缩包形式下发。

压缩包目录：“会员号文件目录/席位号文件目录/交易日期 .zip。

如：0001会员000112席位，交易日期为20160720，在0001/000112/目录下生成的清算数据文件为：

20160720.zip

定义的数据文件名单如下：

| **编号** | **数据分类** | **文件中文名** | **文件命名** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 资金数据 | 席位资金数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+MEMBERSEATCAPITAL.TXT |
|  | 席位保证金业务流水文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SEATCAPITALFLOW.TXT |
|  | 客户保证金业务流水文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTCAPITALFLOW.TXT |
|  | 库存数据 | 客户库存数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTSTORAGE.TXT |
|  | 客户库存明细数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTSTORAGEDETAIL.TXT |
|  | 客户库存变化流水数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTSTORAGEFLOW.TXT |
|  | 持仓数据 | 席位延期持仓数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SEATDEFERPOSITION.TXT |
|  | 客户延期持仓数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTDEFERPOSITION.TXT |
|  | 席位保证金询价持仓数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+SEATRFQPOSITION.TXT |
|  | 客户保证金询价持仓数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+CLIENTRFQPOSITION.TXT |
|  | 成交单数据 | 现货成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SPOTMATCH.TXT |
|  | 即期成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+FORWARDMATCH.TXT |
|  | 递延成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+DEFERMATCH.TXT |
|  | 交收申报成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+DEFERDELIVERYAPPMATCH.TXT |
|  | 定价成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+ PRICINGMATCH.TXT |
|  | 大宗交易成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+LARGEAMOUNTMATCH.TXT |
|  | 询价交易成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+INQUIRYSPOTMATCH.TXT |
|  | 历史询价成交单变更数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+HIS+INQUIRYSPOTMATCH+VARIATION.TXT |
|  | 询价期权成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+INQUIRYOPTIONMATCH.TXT |
|  | 历史询价期权成交单变更数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+HIS+INQUIRYOPTIONMATCH+VARIATION.TXT |
|  | 询价拆借成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+INQUIRYLENDMATCH.TXT |
|  | 历史询价拆借成交单变更数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+HIS+INQUIRYLENDMATCH+VARIATION.TXT |
|  | 保证金询价交易成交单数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQMATCH.TXT |
|  | 保证金询价交易调仓单数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQADJUSTPOSITIONDETAIL.TXT |
|  | ETF交易数据 | 账户备案信息数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+ ETFCLIENT.TXT |
|  | 认申赎清单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+ ETFAPPLY.TXT |
|  | 交割数据 | 预交割单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+PREDELIVERY.TXT |
|  | 交割单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+DELIVERY.TXT |
|  | 现金交割单数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+CASHDELIVERY.TXT |
|  | 清算费用数据 | 席位费用数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SEATMISFEEDETAIL.TXT |
|  | 客户费用数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTMISFEEDETAIL.TXT |
|  | 席位升贴水信息数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SEATAGIODETAIL.TXT |
|  | 客户升贴水信息数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTAGIODETAIL.TXT |
|  | 询价即远掉手续费明细单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+INQUIRYTRADEFEEDETAIL.TXT |
|  | 询价期权手续费明细单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+ INQUIRYOPTIONFEEDETAIL.TXT |
|  | 询价拆借手续费明细单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+INQUIRYLEGENDFEEDETAIL.TXT |
|  | 保证金询价手续费明细单数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQTRADEFEEDETAIL.TXT |
|  | 行情数据 | 竞价收市行情数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+QUOTATION.TXT |
|  | 定价合约定盘价数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+BENCHMARKPRICE.TXT |
|  | 租借基准利率数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+BASELENDRATE.TXT |
|  | 保证金询价结算价数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQSETTLEPRICE.TXT |
|  | 询价清算数据 | 即远掉到期清算单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+DUESETTLEDETAIL.TXT |
|  | 期权权利金清算单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+OPTIONSETTLEDETAIL.TXT |
|  | 拆借过户清算单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+LENDSETTLEDETAIL.TXT |
|  | 拆借利息清算单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+INTERESTSETTLEDETAIL.TXT |
|  | 保证金询价到期清算单数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQDUESETTLELIST.TXT |
|  | 其他数据 | 充抵申请明细数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+OFFSETAPPLYDETAIL.TXT |
|  | 违约单数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+BREACH.TXT |
|  | 发票数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+ INVOICEDATA.TXT |
|  | 席位保证金率数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SEATMARGINRATE.TXT |
|  | 席位手续费率数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+SEATTRADEFEERATE.TXT |
|  | 客户保证金率数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTMARGINRATE.TXT |
|  | 客户手续费率数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+CLIENTTRADEFEERATE.TXT |
|  | 单向大边合约组合数据文件 | I+6位席位代码+S+ YYMMDD+00+LARGESIDEINSTGROUP.TXT |
|  | 延期合约交割方式数据文件 | I+6位席位代码+ S+YYMMDD+00+DEFERDELIVMANAGE.TXT |
|  | 保证金询价席位保证金率数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQSEATMARGINRATE.TXT |
|  | 保证金询价客户保证金率数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQCLIENTMARGINRATE.TXT |
|  | 保证金询价交割保证金率数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQDELIVERYMARGINRATE.TXT |
|  | 保证金询价违约费率数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+RFQBREACHFEERATE.TXT |
|  | 客户转移业务数据 | 客户转移申请数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+CLIENTTRANSFERAPPLY.TXT |
|  | 客户转移延期持仓数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+CLIENTTRANSFERDEFERPOSI.TXT |
|  | 转移客户费用数据文件 | I+6位席位代码+S+YYMMDD+00+CLIENTTRANSFERMFEE.TXT |

（在本文档中，询价交易通常泛指信用型询价交易，保证金询价交易泛指履约担保询价交易。）

# 资金数据

## 席位资金数据文件

### 明细记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字 |
|  | 上日总权益 | N18 | 单位：分 |
|  | 总权益 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日实有货币资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 实有货币资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日可提资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日可提资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 充抵出金限制金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日实际充抵额度 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日实际充抵额度 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日已用充抵额度 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日已用充抵额度 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日剩余充抵额度 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日货币交易保证金占用 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日货币交易保证金占用 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日额度交易保证金占用 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日额度交易保证金占用 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日货币交易可报价余额 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日货币交易可报价余额 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日额度交易可报价余额 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日额度交易可报价余额 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日基础保证金 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日铂金冻结金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日手工冻结资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日远期盈亏冻结资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日基础保证金 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日铂金冻结金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日手工冻结资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日远期盈亏冻结资金 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日盈亏 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日入金 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日出金 | N18 | 单位：分 |
|  | 收到的货款 | N18 | 单位：分  包含询价期权权利金 |
|  | 支付的货款 | N18 | 单位：分  包含询价期权权利金 |
|  | 费用 | N18 | 单位：分  全部费用合计 |
|  | 利息 | N18 | 单位：分 |
|  | 追加保证金 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日白银货款冻结 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日交割保证金占用 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日白银货款冻结 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日交割保证金占用 | N18 | 单位：分 |
|  | 上日司法冻结金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 当日司法冻结金额 | N18 | 单位：分 |

## 席位保证金业务流水文件

### 汇总记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 记账日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 业务类型 | C1 | 1-往帐  2-来帐  3-调整保证金 |
|  | 业务子类型 | C4 | 11- 自动往账  13- 清算部往账  21- 自动来账  23- 清算部来账  31- 调整保证金 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 金额汇总 | N18 | 单位：分 |
|  | 笔数汇总 | N12 |  |

## 客户保证金业务流水文件

### 明细记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 记账日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 记账时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 流水号 | C32 |  |
|  | 业务类型 | C1 | 1-往帐  2-来帐  3-调整保证金 |
|  | 业务子类型 | C4 | 11- 自动往账  13- 清算部往账  21- 自动来账  23- 清算部来账  31- 调整保证金 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 发生金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 发电记帐日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 发电流水序号 | N10 |  |
|  | 业务记账日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 业务记账时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 清算行代码 | C3 |  |
|  | 往来账标志 | C1 | 1-往帐/付/交易所划款入会员帐户  2-来帐/收/会员划款入交易所帐户  3-扣/交易所主动扣会员帐 |
|  | 业务流水号 | C32 |  |
|  | 已发电标志 | C2 | 标识往账申请是否已经发电，1位数字字符：  1- 未发电  2- 发电已回执  3- 在途  4- 来帐不需发电  5- 发电失败  6- 手工发电  7- 往帐流水号重帐  8- 余额不足  9- 划款服务已停止  10- 其它错误 |
|  | 回执标志 | C4 | 记录清算行回执中对往账申请记录的处理结果 |
|  | 摘要 | C254 |  |

# 库存数据

## 客户库存数据文件

### 明细记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 品种代码 | C3 | 3位编码，包括交割品种和保管品种 |
|  | 库存总量 | N(16,6) | 库存总量=可用库存+待提库存+质押库存+手工冻结库存+过户业务冻结库存+充抵冻结库存 |
|  | 可用库存 | N(16,6) |  |
|  | 待提库存 | N(16,6) |  |
|  | 质押库存 | N(16,6) |  |
|  | 手工冻结库存 | N(16,6) |  |
|  | 过户业务冻结库存 | N(16,6) |  |
|  | 充抵冻结库存 | N(16,6) |  |
|  | 入库溢短总量 | N(16,6) |  |
|  | 未清算入库溢短 | N(16,6) |  |
|  | 出库溢短总量 | N(16,6) |  |

## 客户库存明细数据文件

### 明细记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 品种代码 | C3 | 3位编码，包括交割品种和保管品种 |
|  | 仓库代码 | C4 | 4位字符 |
|  | 库存总量 | N(16,6) | 库存总量=可用库存+待提库存+质押库存+手工冻结库存+过户业务冻结库存+充抵冻结库存 |
|  | 可用库存 | N(16,6) |  |
|  | 待提库存 | N(16,6) |  |
|  | 质押库存 | N(16,6) |  |
|  | 手工冻结库存 | N(16,6) |  |
|  | 过户业务冻结库存 | N(16,6) |  |
|  | 充抵冻结库存 | N(16,6) |  |
|  | 仓储费积数 | N(16,6) |  |

## 客户库存变化流水数据文件

### 明细记录

提供二级系统清算时计算库存的数据来源。每个交易日清算数据文件中本节点包含以下记录：

1) 该席位全部客户上一交易日清算点之后的客户库存变化流水记录。

2) 该席位全部客户当前交易日清算点之前（包括该清算点）的客户库存变化流水记录。

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 流水序号 | N10 | 最长10位数字 |
|  | 单据编号 | C20 | 对应仓储业务的单据号，最长20位。 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 品种代码 | C3 | 3位编号，包括交割品种和保管品种 |
|  | 仓库代码 | C4 | 4位编码 |
|  | 发生实际重量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 库存余量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 库存变化类型 | C4 | 2位字符，取值：  1-入库  2-提货申请  3-提货申请修改  4-当日撤销提货申请  5-自提出库  6-交提出库  7-质押（质权方）  8-质押（出质方）  9-质押注销（质权方）  A-质押注销（出质方）  B-租借（借出）  C-租借（借入）  D-法律冻结  E-法律冻结解冻  F-现货买入  G-现货卖出  K-出库  M-大宗交易买入  N-大宗交易卖出  Q-充抵做市商透支  R-减做市商入库库存  S-非即期卖出  T-非即期买入  U-次日撤销提货申请  V-系统撤销提货申请  X-调拨出库  W-调拨入库  Y-还金  Z-收金  0-询价卖出（是阿拉伯数字0）  L-询价买入  11-认购转出  12-认购转入  13-认购失败转出  14-认购失败转入  15-申购转出  16-申购转入  17-赎回转出  18-赎回转入  19-应急黄金ETF非交易过户转出  20-应急黄金ETF非交易过户转入  21-拆借拆出  22-拆借拆入  23-拆借还出  24-拆借还入  25-非交易过户转出  26-非交易过户转入  27-充抵冻结  28-充抵解冻  29-充抵冻结转交割  30-充抵违约处置（转入）  31-充抵违约处置（转出）  32-定价买入  33-定价卖出  34-库存互换换入  35-库存互换换出  36-质物处置（减少质押）  37-质物处置（增加可用）  40-库存划转转出  41-库存划转转入  42-交易库移库转出  43-自提移库转出  44-交提移库转出  45-交易库移库转入  46-保管库移库转出  47-保管库移库转入  48-过户业务冻结  49-过户业务解冻  50-充抵透支库存  51-减少已充抵库存  52-白银交割品种转换转出  53-白银交割品种转换转入 |
|  | 实际发生日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际发生时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 发生标准重量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 账户类型 | C1 | 0-自营  1-代理 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 提货申请单编号 | C16 | 出库单对应的提货申请单编号 |

# 持仓数据

## 席位延期持仓数据文件

### 汇总记录

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位字符 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 多头持仓量 | N18 |  |
|  | 空头持仓量 | N18 |  |
|  | 今日多头开仓 | N18 |  |
|  | 今日空头开仓 | N18 |  |
|  | 今日多头平仓 | N18 |  |
|  | 今日空头平仓 | N18 |  |
|  | 交易盈亏 | N18 | 单位：分，作为保留字段暂默认置0 |
|  | 手续费 | N18 | 单位：分，作为保留字段暂默认置0 |
|  | 保证金 | N18 | 单位：分 |
|  | 结算价 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 延期补偿费 | N18 | 单位：分 |

## 客户延期持仓数据文件

### 明细记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 多头持仓量 | N18 |  |
|  | 空头持仓量 | N18 |  |
|  | 今日多头开仓 | N18 |  |
|  | 今日空头开仓 | N18 |  |
|  | 今日多头平仓 | N18 |  |
|  | 今日空头平仓 | N18 |  |
|  | 交易盈亏 | N18 | 单位：分，作为保留字段暂默认置0 |
|  | 手续费 | N18 | 单位：分，作为保留字段暂默认置0 |
|  | 保证金 | N18 | 单位：分 |
|  | 结算价 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 延期补偿费 | N18 | 单位：分 |

## 席位保证金询价持仓数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 多头持仓量 | N12 |  |
|  | 空头持仓量 | N12 |  |
|  | 净持仓 | N12 |  |

## 客户保证金询价持仓数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 到期日 | C8 |  |
|  | 持仓量 | N12 | 正数表示多头持仓，负数表示空头持仓 |

# 成交单数据

## 现货实盘成交单数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 | 成交记录的唯一编号 |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前黄金相关合约单位是元/克。 |
|  | 数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 系统报单号 | C20 | 20位数字编号 |
|  | 报单本地编号 | C14 | 不定长数字编号，最长14位，报单在交易客户端的编号。 |
|  | 类型 | C1 | 1-现货 |

## 即期成交单数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 | 成交记录的唯一编号 |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前黄金相关合约单位是元/克，白银相关合约单位是元/千克。 |
|  | 数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 系统报单号 | C20 | 20位数字编号 |
|  | 报单本地编号 | C14 | 不定长数字编号，最长14位，报单在交易客户端的编号。 |
|  | 开平标志 | C1 | 0- 开  1- 平  （该字段值可以为空） |
|  | 保证金率 | N(16,6) | 该字段值可以为空。 |
|  | 保证金类型 | C1 | 0- 固定值  1- 比率  （该字段值可以为空） |

## 递延成交单数据文件

### 明细记录

提供二级系统核对延期市场成交单。如果交易所进行了强制减仓业务，递延成交单包括强制减仓产生的成交数据。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 | 成交记录的唯一编号 |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前黄金相关合约单位是元/克，白银相关合约单位是元/千克。 |
|  | 数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 系统报单号 | C20 | 20位数字编号 |
|  | 报单本地编号 | C14 | 不定长数字编号，最长14位，报单在交易客户端的编号。  强制减仓产生的成交单，该字段值为0。 |
|  | 开平标志 | C1 | 0- 开  1- 平  2- 强行平仓 |

## 交收申报成交单数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交序号 | C20 | 成交记录的唯一编号 |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 报单号 | C20 |  |
|  | 报单本地编号 | C14 | 不定长数字编号，最长14位，报单在交易客户端的编号。 |
|  | 是否为中立仓 | C1 | 1- 是  0- 否 |

## 定价成交单数据文件

### 明细记录

当前交易日上海金和上海银集中定价业务产生的定价成交单数据。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 | 成交记录的唯一编号 |
|  | 买卖方向 | C2 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 成交轮次 | N10 | 数值型 |
|  | 成交场次 | C10 | 最长2位字符 |
|  | 申报类型/成交模式 | C2 | 1-市场申报  2-补充申报  3-分摊 |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前上海金单位是元/克，上海银单位是元/千克 |
|  | 数量 | N18 | 单位：手 |

## 大宗交易成交单数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 | 成交记录的唯一编号 |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前黄金相关合约单位是元/克。 |
|  | 数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 录入员 | C16 |  |
|  | 复核员 | C16 |  |
|  | 复核标志 | C1 | 2-已复核，1位字符。 |

## 询价交易成交单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日登记成功的询价即远掉成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交单编号 | C20 | 成交单登记成功，或清算生成行权交易时生成成交单编号 |
|  | 报价单编号 | C20 |  |
|  | 外汇成交单编号 | C30 | 最长支持30位字符，来自外汇的成交单此字段有值 |
|  | 交易时间 | C8 | 在线上平台的原始交易时间,格式为：HH:MM:SS |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 自然日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单历史状态记录时间 | C8 | 成交单字段变化的时间（即系统记录询价成交单历史状态的时间）,格式为：HH:MM:SS |
|  | 本方方向 | C4 | 买方  卖方 |
|  | 本方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 本方会员代码 | C4 |  |
|  | 本方会员简称 | C40 |  |
|  | 本方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 本方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 本方交易员代码 | C15 |  |
|  | 本方交易员名称 | C40 |  |
|  | 本方客户代码 | C10 |  |
|  | 本方客户简称 | C40 |  |
|  | 本方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 本方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 本方渠道代码 | C4 | 1-询价综合业务终端  2-询价业务监控终端  3-会员二级系统  4-会员服务平台  5-会员服务平台经纪终端  6-中国外汇交易中心  7-业务服务平台 |
|  | 本方渠道简称 | C40 |  |
|  | 本方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 对手方会员代码 | C4 |  |
|  | 对手方会员简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 对手方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方交易员代码 | C15 |  |
|  | 对手方交易员名称 | C40 |  |
|  | 对手方客户代码 | C10 |  |
|  | 对手方客户简称 | C40 |  |
|  | 对手方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 对手方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 对手方渠道代码 | C4 | 取值说明同【本方渠道代码】 |
|  | 对手方渠道简称 | C40 |  |
|  | 对手方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交易/登记 | C4 | 1-交易  2-登记 |
|  | 交易类型 | C4 | 25-即期  26-远期  27-掉期 |
|  | 交易类别 | C4 | 1-普通  2-行权 |
|  | 相关成交单号 | C20 | 用来记录行权的期权成交单号，或为未来其他业务备用 |
|  | 交易单位 | N10 |  |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 期限 | C10 | 期限由业务配置，包括但不限于：  SPOT、TODAY、TOM、1D、1M、1W、1Y、2M、2W、3M  、3W、4M、5M、6M、9M、BROKEN |
|  | 远端期限 | C10 | 取值说明同【期限】 |
|  | 报价单位 | C4 | 1-元/克  2-分/克  3-元/千克 |
|  | 价格 | N(12,6) |  |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际到期日 | C8 | 即期、远期和掉期近端清算成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |
|  | 远端价格 | N(12,6) |  |
|  | 远端到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际远端到期日 | C8 | 掉期远端清算成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |
|  | 结算方式 | C4 | 1-实物交割  2-现金结算 |
|  | 是否交易所清算资金 | C4 | 2-是（交易所清算资金/利息）  1-否（非交易所清算资金/利息） |
|  | 参考价格类型 | C4 | 1-开盘价  2-收盘价  3-加权平均价  4-黄金现货(上午)基准价  5-黄金现货(下午)基准价  6-黄金现货(夜市)基准价  b-上海金基准价早盘价  c-上海金基准价午盘价  a-上海金基准价夜市价  X-手工输入  Y-其他价格  d-Ag（T+D）开盘价  e-Ag（T+D）收盘价  f-Ag（T+D）结算价  g-上海银基准价早盘价  h-上海银基准价午盘价  i-上海银基准价夜市价 |
|  | 参考价格日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 参考价格调整项 | N(12,6) |  |
|  | 其他参考价格说明 | C50 |  |
|  | 参考价格 | N(12,6) | 即期、远期和掉期近端清算后填写参考价格的值 |
|  | 远端参考价格类型 | C4 | 参见【参考价格类型】 |
|  | 远端参考价格日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 远端参考价格调整项 | N(12,6) |  |
|  | 远端参考价格 | N(12,6) | 掉期远端清算后填写参考价格的值 |
|  | 远端其他参考价格说明 | C50 |  |
|  | 附加条款 | C150 |  |
|  | 状态 | C4 | **即期、远期**：  1-已成交  2-清算成功  3-清算失败  4-再次清算  5-已撤销 **掉期**：  1-已成交  6-近端清算成功  7-近端清算失败  8-远端清算成功  9-远端清算失败  10-近端再次清算  11-远端再次清算  5-已撤销 |
|  | 清算信息 | C4 | 1-成功  2-实际买方主动违约  3-实际卖方主动违约  4-双方主动违约  5-实际买方被动违约  6-实际卖方被动违约  7-双方被动违约  8-现金结算主动违约  9-现金结算被动违约  10-参考价格不存在 |
|  | 收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |
|  | 指定仓库代码 | C4 | 白银合约时字段有值 |
|  | 远端指定仓库代码 | C4 | 白银合约时字段有值 |

## 历史询价成交单变更数据文件

### 明细记录

提供二级系统存续期间发生信息变动的询价即远掉成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交单编号 | C20 | 成交单登记成功，或清算生成行权交易时生成成交单编号 |
|  | 报价单编号 | C20 |  |
|  | 外汇成交单编号 | C30 | 最长支持30位字符，来自外汇的成交单此字段有值 |
|  | 交易时间 | C8 | 在线上平台的原始交易时间，格式为：HH:MM:SS |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 自然日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单历史状态记录时间 | C8 | 成交单字段变化的时间（即系统记录询价成交单历史状态的时间）,格式为：HH:MM:SS |
|  | 本方方向 | C4 | 买方  卖方 |
|  | 本方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 本方会员代码 | C4 |  |
|  | 本方会员简称 | C40 |  |
|  | 本方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 本方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 本方交易员代码 | C15 |  |
|  | 本方交易员名称 | C40 |  |
|  | 本方客户代码 | C10 |  |
|  | 本方客户简称 | C40 |  |
|  | 本方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 本方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 本方渠道代码 | C4 | 1-询价综合业务终端  2-询价业务监控终端  3-会员二级系统  4-会员服务平台  5-会员服务平台经纪终端  6-中国外汇交易中心  7-业务服务平台 |
|  | 本方渠道简称 | C40 |  |
|  | 本方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 对手方会员代码 | C4 |  |
|  | 对手方会员简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 对手方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方交易员代码 | C15 |  |
|  | 对手方交易员名称 | C40 |  |
|  | 对手方客户代码 | C10 |  |
|  | 对手方客户简称 | C40 |  |
|  | 对手方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 对手方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 对手方渠道代码 | C4 | 取值说明同【本方渠道代码】 |
|  | 对手方渠道简称 | C40 |  |
|  | 对手方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交易/登记 | C4 | 1-交易  2-登记 |
|  | 交易类型 | C4 | 25-即期  26-远期  27-掉期 |
|  | 交易类别 | C4 | 1-普通  2-行权 |
|  | 相关成交单号 | C20 | 用来记录行权的期权成交单号，或为未来其他业务备用 |
|  | 交易单位 | N10 |  |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 期限 | C10 | 期限由业务配置，包括但不限于：  SPOT、TODAY、TOM、1D、1M、1W、1Y、2M、2W、3M  、3W、4M、5M、6M、9M、BROKEN |
|  | 远端期限 | C10 | 取值说明同【期限】 |
|  | 报价单位 | C4 | 1-元/克  2-分/克  3-元/千克 |
|  | 价格 | N(12,6) |  |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际到期日 | C8 | 即期、远期和掉期近端清算成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |
|  | 远端价格 | N(12,6) |  |
|  | 远端到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际远端到期日 | C8 | 掉期远端清算成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |
|  | 结算方式 | C4 | 1-实物交割  2-现金结算 |
|  | 是否交易所清算资金 | C4 | 2-是（交易所资金清算）  1-否（非交易所资金清算） |
|  | 参考价格类型 | C4 | 1-开盘价  2-收盘价  3-加权平均价  4-黄金现货(上午)基准价  5-黄金现货(下午)基准价  6-黄金现货(夜市)基准价  b-上海金基准价早盘价  c-上海金基准价午盘价  a-上海金基准价夜市价  X-手工输入  Y-其他价格  d-Ag（T+D）开盘价  e-Ag（T+D）收盘价  f-Ag（T+D）结算价  g-上海银基准价早盘价  h-上海银基准价午盘价  i-上海银基准价夜市价 |
|  | 参考价格日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 参考价格调整项 | N(12,6) |  |
|  | 其他参考价格说明 | C50 |  |
|  | 参考价格 | N(12,6) | 即期、远期和掉期近端清算后填写参考价格的值 |
|  | 远端参考价格类型 | C4 | 参见【参考价格类型】 |
|  | 远端参考价格日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 远端参考价格调整项 | N(12,6) |  |
|  | 远端参考价格 | N(12,6) | 掉期远端清算后填写参考价格的值 |
|  | 远端其他参考价格说明 | C50 |  |
|  | 附加条款 | C150 |  |
|  | 状态 | C4 | 即期、远期：1-已成交、2-清算成功、3-清算失败、4-再次清算、5-已撤销 掉期：1-已成交、6-近端清算成功、7-近端清算失败、8-远端清算成功、9-远端清算失败、10-近端再次清算、11-远端再次清算、5-已撤销 |
|  | 清算信息 | C4 | 1-成功  2-实际买方主动违约  3-实际卖方主动违约  4-双方主动违约  5-实际买方被动违约  6-实际卖方被动违约  7-双方被动违约  8-现金结算主动违约  9-现金结算被动违约  10-参考价格不存在 |
|  | 收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |
|  | 指定仓库代码 | C4 | 白银合约时字段有值 |
|  | 远端指定仓库代码 | C4 | 白银合约时字段有值 |

## 询价期权成交单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日登记成功的询价期权成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交单编号 | C20 | 成交单登记成功生成成交单编号 |
|  | 报价单编号 | C20 |  |
|  | 交易时间 | C8 | 在线上平台的原始交易时间 |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 自然日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单历史状态记录时间 | C8 | 成交单字段变化的时间（即系统记录询价成交单历史状态的时间） |
|  | 本方方向 | C4 | 买方  卖方 |
|  | 本方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 本方会员代码 | C4 |  |
|  | 本方会员简称 | C40 |  |
|  | 本方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 本方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 本方交易员代码 | C15 |  |
|  | 本方交易员名称 | C40 |  |
|  | 本方客户代码 | C10 |  |
|  | 本方客户简称 | C40 |  |
|  | 本方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 本方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 本方渠道代码 | C4 | 1-询价综合业务终端  2-询价业务监控终端  3-会员二级系统  4-会员服务平台  5-会员服务平台经纪终端  6-中国外汇交易中心  7-业务服务平台 |
|  | 本方渠道简称 | C40 |  |
|  | 本方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 对手方会员代码 | C4 |  |
|  | 对手方会员简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 对手方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方交易员代码 | C15 |  |
|  | 对手方交易员名称 | C40 |  |
|  | 对手方客户代码 | C10 |  |
|  | 对手方客户简称 | C40 |  |
|  | 对手方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 对手方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 对手方渠道代码 | C4 | 取值说明同【本方渠道代码】 |
|  | 对手方渠道简称 | C40 |  |
|  | 对手方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交易/登记 | C4 | 1-交易  2-登记 |
|  | 行权方式 | C4 | 0-欧式期权  1-美式期权 |
|  | 期权交易类型 | C4 | 1-看涨期权  2-看跌期权 |
|  | 交易单位 | N10 |  |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 期限 | C10 | 期限由业务配置，包括但不限于：  1D、1M、1W、1Y、2M、2W、3M、3W、4M、5M、6M、9M、BROKEN、SPOT、TODAY、TOM |
|  | 权利金和行权价报价单位 | C4 | 1-元/克  2-分/克  3-元/千克 |
|  | 行权价 | N(12,6) |  |
|  | 行权日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 行权截止时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 实际行权日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实物交割合约期限 | N10 | 行权日与到期日之间的日期间隔天数（工作日） |
|  | 结算日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际结算日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 权利金 | N(12,6) |  |
|  | 权利金支付状态 | C4 | 1-未支付  2-支付成功  3-支付失败  4-再次支付 |
|  | 权利金清算信息 | C4 | 1-成功  11-权利金主动违约  12-权利金被动违约 |
|  | 权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 平仓权利金 | N(12,6) |  |
|  | 平仓权利金支付状态 | C4 | 1-未支付  2-支付成功  3-支付失败  4-再次支付 |
|  | 平仓权利金清算信息 | C4 | 1-成功  11-权利金主动违约  12-权利金被动违约 |
|  | 平仓权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际平仓权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 行权交易成交单号 | C20 |  |
|  | 结算方式 | C4 | 1-实物交割  2-现金结算 |
|  | 现金结算期权参考价格类型 | C4 | 1-前一交易日收盘价  2-前一交易日加权平均价  3-开盘价  4-黄金现货(夜市)基准价  5-黄金现货(上午)基准价  6-前一交易日黄金现货(下午)基准价  b-上海金基准价早盘价  a-上海金基准价夜市价  c-前一交易日上海金基准价午盘价  d-Ag（T+D）开盘价  e-前一交易日Ag（T+D）收盘价  f-前一交易日Ag（T+D）结算价  g-上海银基准价早盘价  h-前一交易日上海银基准价午盘价  i-上海银基准价夜市价 |
|  | 现金结算期权参考价格调整项 | N(12,6) | 默认为0，可为正可为负 |
|  | 附加条款 | C150 |  |
|  | 状态 | C4 | 1-已成交  13-已平仓  12-已到期  5-已撤销 |
|  | 行权状态 | C4 | 1-未行权  2-已行权 |
|  | 收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期，格式为：YYYYMMDD |
|  | 平仓收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 平仓收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期，格式为：YYYYMMDD |
|  | 指定仓库代码 | C4 |  |

## 历史询价期权成交单变更数据文件

### 明细记录

提供二级系统存续期间发生信息变动的询价期权成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交单编号 | C20 | 成交单登记成功生成成交单编号 |
|  | 报价单编号 | C20 |  |
|  | 交易时间 | C8 | 在线上平台的原始交易时间,格式为：HH:MM:SS |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 自然日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单历史状态记录时间 | C8 | 成交单字段变化的时间（即系统记录询价成交单历史状态的时间） |
|  | 本方方向 | C4 | 买方  卖方 |
|  | 本方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 本方会员代码 | C4 |  |
|  | 本方会员简称 | C40 |  |
|  | 本方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 本方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 本方交易员代码 | C15 |  |
|  | 本方交易员名称 | C40 |  |
|  | 本方客户代码 | C10 |  |
|  | 本方客户简称 | C40 |  |
|  | 本方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 本方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 本方渠道代码 | C4 | 1-询价综合业务终端  2-询价业务监控终端  3-会员二级系统  4-会员服务平台  5-会员服务平台经纪终端  6-中国外汇交易中心  7-业务服务平台 |
|  | 本方渠道简称 | C40 |  |
|  | 本方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 对手方会员代码 | C4 |  |
|  | 对手方会员简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 对手方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方交易员代码 | C15 |  |
|  | 对手方交易员名称 | C40 |  |
|  | 对手方客户代码 | C10 |  |
|  | 对手方客户简称 | C40 |  |
|  | 对手方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 对手方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 对手方渠道代码 | C4 | 取值说明同【本方取代代码】 |
|  | 对手方渠道简称 | C40 |  |
|  | 对手方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交易/登记 | C4 | 1-交易  2-登记 |
|  | 行权方式 | C4 | 0-欧式期权  1-美式期权 |
|  | 期权交易类型 | C4 | 1-看涨期权  2-看跌期权 |
|  | 交易单位 | N10 |  |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 期限 | C10 | 期限由业务配置，包括但不限于：  1D、1M、1W、1Y、2M、2W、3M、3W、4M、5M、6M、9M、BROKEN、SPOT、TODAY、TOM |
|  | 权利金和行权价报价单位 | C4 | 1-元/克  2-分/克  3-元/千克 |
|  | 行权价 | N(12,6) |  |
|  | 行权日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 行权截止时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 实际行权日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 标的合约期限 | N10 | 行权日与到期日之间的日期间隔天数（工作日） |
|  | 结算日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际结算日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 权利金 | N(12,6) |  |
|  | 权利金支付状态 | C4 | 1-未支付  2-支付成功  3-支付失败  4-再次支付 |
|  | 权利金清算信息 | C4 | 1-成功  11-权利金主动违约  12-权利金被动违约 |
|  | 权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 平仓权利金 | N(12,6) |  |
|  | 平仓权利金支付状态 | C4 | 1-未支付  2-支付成功  3-支付失败  4-再次支付 |
|  | 平仓权利金清算信息 | C4 | 1-成功  11-权利金主动违约  12-权利金被动违约 |
|  | 平仓权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际平仓权利金支付日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 行权交易成交单号 | C20 |  |
|  | 结算方式 | C4 | 1-实物交割  2-现金结算 |
|  | 现金结算期权参考价格类型 | C4 | 1-前一交易日收盘价  2-前一交易日加权平均价  3-开盘价  4-黄金现货(夜市)基准价  5-黄金现货(上午)基准价  6-前一交易日黄金现货(下午)基准价  b-上海金基准价早盘价  a-上海金基准价夜市价  c-前一交易日上海金基准价午盘价  d-Ag（T+D）开盘价  e-前一交易日Ag（T+D）收盘价  f-前一交易日Ag（T+D）结算价  g-上海银基准价早盘价  h-前一交易日上海银基准价午盘价  i-上海银基准价夜市价 |
|  | 现金结算期权参考价格调整项 | N(12,6) | 默认为0，可为正可为负 |
|  | 附加条款 | C150 |  |
|  | 状态 | C4 | 1-已成交  13-已平仓  12-已到期  5-已撤销 |
|  | 行权状态 | C4 | 1-未行权  2-已行权 |
|  | 收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期, 格式为：YYYYMMDD |
|  | 平仓收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 平仓收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期，格式为：YYYYMMDD |
|  | 指定仓库代码 | C4 |  |

## 询价拆借成交单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日登记成功的询价拆借成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交单编号 | C20 | 成交单登记成功生成成交单编号 |
|  | 报价单编号 | C20 |  |
|  | 交易时间 | C8 | 在线上平台的原始交易时间，格式为：HH:MM:SS |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 自然日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单历史状态记录时间 | C8 | 成交单字段变化的时间（即系统记录询价成交单历史状态的时间） |
|  | 本方方向 | C4 | 拆入  拆出 |
|  | 本方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 本方会员代码 | C4 |  |
|  | 本方会员简称 | C40 |  |
|  | 本方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 本方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 本方交易员代码 | C15 |  |
|  | 本方交易员名称 | C40 |  |
|  | 本方客户代码 | C10 |  |
|  | 本方客户简称 | C40 |  |
|  | 本方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 本方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 本方渠道代码 | C4 | 1-询价综合业务终端  2-询价业务监控终端  3-会员二级系统  4-会员服务平台  5-会员服务平台经纪终端  6-中国外汇交易中心  7-业务服务平台 |
|  | 本方渠道简称 | C40 |  |
|  | 本方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 对手方会员代码 | C4 |  |
|  | 对手方会员简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 对手方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方交易员代码 | C15 |  |
|  | 对手方交易员名称 | C40 |  |
|  | 对手方客户代码 | C10 |  |
|  | 对手方客户简称 | C40 |  |
|  | 对手方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 对手方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 对手方渠道代码 | C4 | 取值说明同【本方渠道代码】 |
|  | 对手方渠道简称 | C40 |  |
|  | 对手方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交易/登记 | C4 | 1-交易  2-登记 |
|  | 交易单位 | N10 |  |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 标准重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 计息基准价单位 | C4 | 1-元/克  3-元/千克 |
|  | 计息基准价 | N(12,6) |  |
|  | 名义本金 | N18 | 单位：分 |
|  | 计息基准 | C10 | 1-实际天数/实际天数  2-实际天数/365  3-实际天数/365（固定）  4-实际天数/360  5-30/360 |
|  | 期限 | C10 | 期限由业务配置，包括但不限于：  O/N、1W、2W、3W、1M、2M、3M、4M、5M、6M、9M、1Y、BROKEN |
|  | 拆借类型 | C4 | 1-正常  2-续借 |
|  | 借金状态 | C4 | 1-未借金  2-借金成功  3-借金失败  4-续借借金 |
|  | 起息日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 还金类型 | C4 | 1-续借还金  2-提前还金  3-主动还金  4-系统自动还金  5-再次还金 |
|  | 还金状态 | C4 | 1-未还金  2-还金成功  3-还金失败  4-再次还金 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 付息状态 | C4 | 1-不适用  2-未支付  3-支付成功  4-支付失败  5-再次支付 |
|  | 付息日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际付息日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 是否交易所清算利息 | C4 | 2-是（交易所资金清算）  1-否（非交易所资金清算） |
|  | 拆借年利率 | N(12,6) |  |
|  | 利息 | N18 | 单位：分 |
|  | 借金仓库 | C4 |  |
|  | 还金仓库 | C4 |  |
|  | 还金交割品种 | C15 |  |
|  | 前接成交单编号 | C20 |  |
|  | 后续成交单编号 | C20 |  |
|  | 附加条款 | C150 |  |
|  | 状态 | C4 | 1-已成交  5-已撤销 |
|  | 过户失败原因 | C20 | 1-库存不足  20126-库存不足  其他值，其他错误 |
|  | 收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期,格式为：YYYYMMDD |

## 历史询价拆借成交单变更数据文件

### 明细记录

提供二级系统存续期间发生信息变动的询价拆借成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交单编号 | C20 | 成交单登记成功生成成交单编号 |
|  | 报价单编号 | C20 |  |
|  | 交易时间 | C8 | 在线上平台的原始交易时间，格式为：HH:MM:SS |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 自然日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单历史状态记录时间 | C8 | 成交单字段变化的时间（即系统记录询价成交单历史状态的时间） |
|  | 本方方向 | C4 | 拆入  拆出 |
|  | 本方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 本方会员代码 | C4 |  |
|  | 本方会员简称 | C40 |  |
|  | 本方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 本方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 本方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 本方交易员代码 | C15 |  |
|  | 本方交易员名称 | C40 |  |
|  | 本方客户代码 | C10 |  |
|  | 本方客户简称 | C40 |  |
|  | 本方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 本方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 本方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 本方渠道代码 | C4 | 1-询价综合业务终端  2-询价业务监控终端  3-会员二级系统  4-会员服务平台  5-会员服务平台经纪终端  6-中国外汇交易中心  7-业务服务平台 |
|  | 本方渠道简称 | C40 |  |
|  | 本方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方角色 | C4 | 1-Maker  2-Taker |
|  | 对手方会员代码 | C4 |  |
|  | 对手方会员简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位代码 | C6 |  |
|  | 对手方会员席位简称 | C40 |  |
|  | 对手方会员席位英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方交易员代码 | C15 |  |
|  | 对手方交易员名称 | C40 |  |
|  | 对手方客户代码 | C10 |  |
|  | 对手方客户简称 | C40 |  |
|  | 对手方客户英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 对手方经纪机构简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构英文简称 | C40 |  |
|  | 对手方经纪机构用户 | C15 |  |
|  | 对手方渠道代码 | C4 | 取值说明同【本方渠道代码】 |
|  | 对手方渠道简称 | C40 |  |
|  | 对手方渠道英文简称 | C40 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交易/登记 | C4 | 1-交易  2-登记 |
|  | 交易单位 | N10 |  |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 标准重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 计息基准价单位 | C4 | 元/克、元/千克 |
|  | 计息基准价 | N(12,6) | 单位：元 |
|  | 名义本金 | N18 | 单位：分 |
|  | 计息基准 | C10 | 1-实际天数/实际天数  2-实际天数/365  3-实际天数/365（固定）  4-实际天数/360  5-30/360 |
|  | 期限 | C10 | 期限由业务配置，包括但不限于：  O/N、1W、2W、3W、1M、2M、3M、4M、5M、6M、9M、1Y、BROKEN |
|  | 拆借类型 | C4 | 1-正常  2-续借 |
|  | 借金状态 | C4 | 1-未借金  2-借金成功  3-借金失败  4-续借借金 |
|  | 起息日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 还金类型 | C4 | 1-续借还金  2-提前还金  3-主动还金  4-系统自动还金  5-再次还金 |
|  | 还金状态 | C4 | 1-未还金  2-还金成功  3-还金失败  4-再次还金 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 付息状态 | C4 | 1-不适用  2-未付息  3-付息成功  4-付息失败  5-再次付息 |
|  | 付息日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际付息日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 是否交易所清算利息 | C4 | 2-是（交易所资金清算）  1-否（非交易所资金清算） |
|  | 拆借年利率 | N(12,6) |  |
|  | 利息 | N18 | 单位：分 |
|  | 借金仓库 | C4 |  |
|  | 还金仓库 | C4 |  |
|  | 还金交割品种 | C15 |  |
|  | 前接成交单编号 | C20 |  |
|  | 后续成交单编号 | C20 |  |
|  | 附加条款 | C150 |  |
|  | 状态 | C4 | 1-已成交  5-已撤销 |
|  | 过户失败原因 | C20 | 1-库存不足  20126-库存不足  其他值，其他错误 |
|  | 收费状态 | C4 | 0-未收费  1-已收费 |
|  | 收费日期 | C8 | 清算收费成功后填写当日日期，格式为：YYYYMMDD |

## 保证金询价交易成交单数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 |  |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 线下成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 成交价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前黄金品种合约单位是元/克 |
|  | 成交数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 成交重量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 期限名 | C8 | 期限由业务定义，包括但不限于：  TODAY、TOM、SPOT、Broken、3个月度、4个季度  其中，3个月度、4个季度格式为：YYYYMM |
|  | 交易登记 | C1 | t-交易  r-登记 |
|  | 交易类型 | C1 | s-即期  f-远期  w-掉期 |
|  | 成交类型 | C1 | 1-普通  2-应急 |
|  | 近远端 | C1 | n-近端  f-远端 |
|  | 关联掉期编号 | C20 |  |
|  | 到期日类型 | C1 | s-标准到期日  u-非标准到期日 |
|  | 强平标志 | C1 | 1-是  0-否 |
|  | 报单编号 | C20 | ，用法如下：  对于线下登记交易，该字段为对应的待确认成交单编号；  对于线上交易，该字段为对应的报单编号 |
|  | 交易员代码 | C10 |  |
|  | 经纪机构代码 | C10 |  |
|  | 交易来源渠道 | C8 | 保留字段，暂不使用 |
|  | 本地报单编号 | N18 | 最长18位数字编号 |

## 保证金询价交易调仓单数据文件

### 明细记录

当发生节假日调整时，交易所会对原到期日为节假日的持仓按业务规则进行调整，生成相应的调仓成交单。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 调仓成交单编号 | C20 |  |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 成交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 成交价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  目前黄金相关合约单位是元/克 |
|  | 成交数量 | N12 | 单位：手 |
|  | 成交重量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |

# 黄金ETF交易数据

## 账户备案信息数据文件

### 明细记录

下载清算数据文件的席位不同，交易所提供数据文件的内容不同。对于基金专用席位（基金专用席位的席位代码就是黄金ETF基金属性中的席位代码），每个交易日的数据是从上一交易日清算完成之后到当前交易日清算完成时这段时间内，所有客户向该黄金ETF基金提交的账户备案申请、账户解除备案申请记录；对于非基金专用席位（除基金专用席位之外的席位都是非基金专用席位），每个交易日的数据是从上一交易日清算完成之后到当前交易日清算完成时这段时间内，该席位下客户提交的黄金ETF基金账户备案申请、账户解除备案申请记录。

利用清算数据文件中账户备案信息节点的“投资人证件号码”字段为基金公司提供法人客户的营业执照号，即：当客户为法人时，无论该会员是基金公司还是金交所会员，“投资人证件号码”字段填写金交所系统中该法人客户的营业执照号，如果该法人客户没有营业执照号，该字段值为空。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 申请日期 | C8 | YYYYMMDD，该字段填写的是交易日期。不可为空 |
|  | 申请时间 | C8 | HH:MM:SS。不可为空 |
|  | 本地编号 | C14 | 14位字符，二级系统自己定义的业务请求唯一标识。可以为空 |
|  | ETF账户备案流水号 | C16 | 16位字符，不可为空 |
|  | 投资人名称 | C80 | 最长80位字符，可以为空 |
|  | 投资人类型 | C1 | 1位字符  1-法人  2-自然人，  3-特殊客户  （可以为空） |
|  | 投资人证件类型 | C4 | 最长4位字符，自然人证件类型。  1-身份证  2-护照  3-军官证  4-警官证  5-回乡证  6-台胞证  7-港澳台居住证  （可以为空） |
|  | 投资人证件号码 | C20 | 最长20位字符，自然人客户在黄金交易所开户时登记的证件号码。  当客户为法人时，该字段填写金交所系统中该法人客户的营业执照号，如果系统中没有该法人客户营业执照号，该字段值为空。可以为空 |
|  | 法人组织机构代码 | C40 | 最长40位字符，法人客户在黄金交易所开户时登记的组织机构代码。可以为空 |
|  | 投资人黄金账号 | C10 | 10位数字编号，不可为空 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号，不可为空 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 黄金账号指定会员名称 | C40 | 最长40位字符，不可为空 |
|  | 投资人证券账号 | C10 | 10位字符，不可为空 |
|  | 黄金ETF基金代码 | C6 | 6位字符，不可为空 |
|  | 业务类型 | C4 | 4位字符，不可为空  031-绑定  032-解绑定 |
|  | 确认标志 | C4 | 4位字符，取值为：  701-绑定待确认  702-绑定已完成  703-绑定已失败  802-解绑定已完成  803-解绑定已失败。  其中：“702-绑定已完成”、“703-绑定已失败”为基金公司提供，不可为空 |

## 认申赎清单数据文件

### 明细记录

下载清算数据文件的席位不同，交易所提供数据文件的内容不同。对于基金专用席位，每个交易日的数据是从上一交易日清算完成之后到当前交易日清算完成时这段时间内，所有客户针对该黄金ETF基金的认申赎交易记录；对于非基金专用席位，每个交易日的数据是从上一交易日清算完成之后到当前交易日清算完成时这段时间内，该席位下客户的认申赎交易记录。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD，不可为空 |
|  | 交易时间 | C8 | HH:MM:SS，不可为空 |
|  | 金交所ETF交易编号 | C16 | 16位字符，不可为空 |
|  | 投资人黄金账号 | C10 | 10位数字编号，不可为空 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号，不可为空 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 黄金ETF基金代码 | C6 | 6位字符，不可为空 |
|  | 投资人证券账号 | C10 | 10位字符，不可为空 |
|  | 交易单元 | C6 | 6位字符，可以为空 |
|  | 合约代码1 | C8 | 最长8位字符，可以为空 |
|  | 重量1 | N(16,6) | 单位：千克，可以为空 |
|  | 合约代码2 | C8 | 最长8位字符，可以为空 |
|  | 重量2 | N(16,6) | 单位：千克，可以为空 |
|  | 合约代码3 | C8 | 最长8位字符，可以为空 |
|  | 重量3 | N(16,6) | 单位：千克，可以为空 |
|  | 合约代码4 | C8 | 最长8位字符，可以为空 |
|  | 重量4 | N(16,6) | 单位：千克，可以为空 |
|  | 合约代码5 | C8 | 最长8位字符，可以为空 |
|  | 重量5 | N(16,6) | 单位：千克，可以为空 |
|  | 总重量 | N(16,6) | 单位：千克，可以为空 |
|  | 份额 | N16 | 可以为空 |
|  | 本地编号 | C14 | 14位字符，二级系统自己定义的业务请求唯一标识。可以为空 |
|  | 确认标志 | C4 | 4位字符，取值为：  101-申购请求  402-冻结成功  403-冻结失败  501-份额增加请求  502-份额增加成功  503-份额增加失败  104-申购确认成功  405-过户失败  407-解冻失败  301-赎回请求  601-份额减少请求  602-份额减少成功  603-份额减少失败  304-赎回确认成功  305-赎回过户失败  201-认购请求  204-认购成功  205-认购失败  206-认购确认成功  207-认购确认失败  105-申购确认失败  406-解冻成功  其中：101-申购请求，402-冻结成功，501-份额增加请求，502-份额增加成功，301-赎回请求，601-份额减少请求，602-份额减少成功，201-认购请求为中间状态，在异常情况下才会出现。其中 206-认购确认成功，207-认购确认失败为基金公司提供。不可为空 |
|  | 交易类型 | C4 | 最长4位字符：  020-认购  022-申购  024-赎回  （不可为空） |

# 交割数据

## 预交割单数据文件

### 明细记录

提供二级系统清算后核对客户预交割单（全市场），目前仅即期白银合约、延期白银合约、定价合约会产生预交割单）。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 预交割单序号 | C20 |  |
|  | 交割日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 申报日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交割价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 交割手数 | N12 |  |
|  | 交割重量 | N(16,6) | 单位：千克  该值是标准交割重量，等于交割手数×交易单位数量。 |
|  | 交割金额 | N18 | 单位：分 |

## 交割单数据文件

### 明细记录

提供二级系统清算后核对客户实物交割单（全市场）。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
|  | 交割序号 | C20 |  |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交割价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 交割日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 交割品种 | C3 | 3位编码 |
|  | 标准数量 | N12 | 竞价即期、延期白银为标重（单位：千克）；其它都是手数，询价白银为手数。 |
|  | 标准金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 实际交割重量 | N(16,6) | 单位：千克实际的交割重量，对于黄金、铂金品种，该字段为标准重量；对于白银品种，该字段为实际重量。 |
|  | 实际交割金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 意向仓库代码 | C4 | 4位编码  进行了交割仓库意向申报的白银交割才有意向仓库代码。 |

## 现金交割单数据文件

### 明细记录

提供二级系统清算后核对竞价延期现金交割合约的客户现金交割单。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
|  | 交割日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 交割序号 | C20 |  |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 多空方向 | C1 | 1- 多  0- 空 |
|  | 交割价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位  黄金品种合约单位为元/克 |
|  | 交割数量 | N12 |  |
|  | 交割金额 | N18 | 单位：分 |

# 清算费用数据

## 席位费用数据文件

### 汇总记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 费用类型 | C4 | 费用类型包括：  1-仓储费  2-超期补偿费  3-TD延期补偿费  4-运保费  5-询价手续费（应收）  6-竞价手续费（应收）  8- 交割手续费  9- 交易所收取交割违约金  10- 会员收到/支付的交割违约金  13- 质押登记费  14- 租借登记费  15- 会员收到/支付的平仓违约金  17- 交易所收取的税票违约金  18- 会员收到/支付的税票违约金  19- 滞纳金  20- 黄金ETF过户费  21- 黄金ETF实际现金差额  22- 租借拆借利息  24- 充抵手续费  25- 过户费  31- 出入库费  32- 实物搬运费  33- 保管库保管费  34- 手续费减免  35- TN延期补偿费  36- 出金手续费  37- 库存互换费  38- 询价豁免库存利息  39- 盈亏  46-保证金询价手续费(应收)  其中：  1. 6-竞价手续费（应收）包括：竞价交易产生的手续费，定价交易产生的手续费目前也汇总到该费用类型。  2. 34-手续费减免包括：5-询价手续费（应收）、6-竞价手续费（应收）、46-保证金询价手续费（应收）减免的手续费总额  3. 5-询价手续费（应收）：包括信用型询价即远掉、拆借、期权产生的手续费  4. 22-租借拆借利息：含租借利息和拆借利息  5.25-过户费包括：交易库非交易过户费、库存互换过户费、保管库场外实物清算过户费、库存划转过户费。  6.33-保管库保管费包括：保管库包仓费、保管库称重费、保管库查库费、保管库包装费、保管库其他费用。  7.手续费实收=竞价手续费（应收）+询价手续费（应收）-手续费减免  8. 39-盈亏包括：延期每日无负债盈亏、上海金和上海银集中定价交割盈亏、白银即期交割盈亏、询价现金交割的交割盈亏、保证金询价每日无负债盈亏  9. 31-出入库费包括：交易库入库费、交易库出库费、保管库入库费、保管库出库费  10. 36-出金手续费包括：当日跨行出金手续费、当日同行出金手续费、跨日出金手续费 |
|  | 费用合计 | N18 | 单位：分  按费用类型合计该会员各席位下的费用 |

## 客户费用数据文件

### 明细记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 费用类型 | C4 | 费用类型包括：  1-仓储费  2-超期补偿费  3-TD延期补偿费  4-运保费  5-询价手续费（应收）  6-竞价手续费（应收）  8- 交割手续费  9- 交易所收取交割违约金  10- 会员收到/支付的交割违约金  13- 质押登记费  14- 租借登记费  15- 会员收到/支付的平仓违约金  17- 交易所收取的税票违约金  18- 会员收到/支付的税票违约金  19- 滞纳金  20- 黄金ETF过户费  21- 黄金ETF实际现金差额  22- 租借拆借利息  24- 充抵手续费  25- 过户费  31- 出入库费  32- 实物搬运费  33- 保管库保管费  34- 手续费减免  35- TN延期补偿费  36- 出金手续费  37- 库存互换费  38- 询价豁免库存利息  39- 盈亏  46-保证金询价手续费(应收)  其中：  1. 6-竞价手续费（应收）包括：竞价交易产生的手续费，定价交易产生的手续费目前也汇总到该费用类型。  2. 34-手续费减免包括：5-询价手续费（应收）、6-竞价手续费（应收）、46-保证金询价手续费（应收）减免的手续费总额  3. 5-询价手续费（应收）：包括信用型询价即远掉、拆借、期权产生的手续费  4. 22-租借拆借利息：含租借利息和拆借利息  5.25-过户费包括：交易库非交易过户费、库存互换过户费、保管库场外实物清算过户费、库存划转过户费。  6.33-保管库保管费包括：保管库包仓费、保管库称重费、保管库查库费、保管库包装费、保管库其他费用。  7.手续费实收=竞价手续费（应收）+询价手续费（应收）-手续费减免  8. 39-盈亏包括：延期每日无负债盈亏、上海金和上海银集中定价交割盈亏、白银即期交割盈亏、询价现金交割的交割盈亏、保证金询价每日无负债盈亏  9. 31-出入库费包括：交易库入库费、交易库出库费、保管库入库费、保管库出库费  10. 36-出金手续费包括：当日跨行出金手续费、当日同行出金手续费、跨日出金手续费 |
|  | 费用 | N18 | 单位：分 |

## 席位升贴水信息数据文件

### 汇总记录

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 升贴水类型 | C4 | 7- 条块升贴水  11- 溢短金额  12- 品种升贴水  16- 品牌升贴水 |
|  | 升贴水合计 | N18 | 单位：分 |

## 客户升贴水信息数据文件

### 明细记录

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
|  | 交易日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 升贴水类型 | C4 | 7- 条块升贴水  11- 溢短金额  12- 品种升贴水  16- 品牌升贴水 |
|  | 金额 | N18 | 单位：分 |

## 询价即远掉手续费明细单数据文件

### 明细记录

提供二级系统从上一交易日询价市场收市之后、到当前交易日截止询价市场收市登记成功的询价即远掉手续费。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 收费日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 手续费类型 | C2 | 0-固定值  1-比率 |
|  | 手续费率 | N(16,6) |  |
|  | 手续费 | N18 | 单位：分 |

## 询价期权手续费明细单数据文件

### 明细记录

提供二级系统从上一交易日询价市场收市之后、到当前交易日截止询价市场收市登记成功的询价期权手续费。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 收费日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 开平标志 | C1 | 0- 开  1- 平  （该字段值可以为空） |
|  | 手续费类型 | C2 | 0-固定值  1-比率 |
|  | 手续费率 | N(16,6) |  |
|  | 手续费 | N18 | 单位：分 |

## 询价拆借手续费明细单数据文件

### 明细记录

提供二级系统从上一交易日询价市场收市之后、到当前交易日截止询价市场收市登记成功的询价拆借手续费。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 收费日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 手续费类型 | C2 | 0-固定值  1-比率 |
|  | 手续费率 | N(16,6) |  |
|  | 手续费 | N18 | 单位：分 |

## 保证金询价手续费明细单数据文件

### 明细文件

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 成交编号 | C20 |  |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 手续费 | N18 | 单位：分 |
|  | 手续费率 | N(18,6) | 单位：元/手 |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |

注：询价保证金手续费收取标准一般按每手固定金额收取，所以手续费率单位此处为“元/手”。

# 行情数据

## 竞价收市行情数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符，不可为空 |
|  | 合约名称 | C12 | 最长12位字符，不可为空 |
|  | 昨收盘 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 昨结算 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 开盘价 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 最高价 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 最低价 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 收盘价 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 结算价 | N(12,6) | 单位：元，可以为空 |
|  | 成交量 | N12 | 可以为空 |
|  | 持仓量 | N12 | 可以为空 |
|  | 成交额 | N18 | 单位：分，可以为空 |
|  | 行情日期 | C8 | YYYYMMDD，不可为空 |

## 定价合约定盘价数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 合约名称 | C12 |  |
|  | 场次编号 | C10 |  |
|  | 场次名称 | C31 |  |
|  | 参考价 | N(12,6) |  |
|  | 参考价报入时间 | C8 |  |
|  | 成交手数 | N10 |  |
|  | 成交重量 | N(16,6) |  |
|  | 买手数 | N10 |  |
|  | 买重量 | N (16,6) |  |
|  | 卖手数 | N10 |  |
|  | 卖重量 | N(16,6) |  |
|  | 基准价 | N(12,6) |  |
|  | 是否为结算价 | C2 | 1-是  0-否 |
|  | 月平均价 | N(12,6) |  |
|  | 月成交量 | N(16,6) |  |
|  | 年平均价 | N(12,6) |  |
|  | 行情日期 | C8 | YYYYMMDD |

说明：对于成交重量、买重量、卖重量、月平均价、月成交量、年平均价等统计类字段，为保留字段并填空。

## 保证金询价结算价数据文件

### 明细记录

提供二级系统关于保证金询价市场各标的的结算价。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 结算价 | N(12,6) | 黄金品种合约单位是元/克 |

## 租借基准利率数据文件

### 明细记录

提供交易所系统收市后的租借基准利率数据。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 行情日期 | C8 | 指以交易系统日期切换为标准的交易所工作日期，格式YYYYMMDD。示例：20150219。 |
|  | 行情时间 | C8 | 指程序所在服务器的系统时间，格式HH:MM:SS，数据值符合国际标准时间。示例：14:08:16。 |
|  | 品种 | C2 | 目前是黄金，后续业务发展了需要支持白银、铂金、钯金等其他品种。取值包括但不限于：  1-黄金  2-铂金  3-白银 |
|  | 期限 | C10 | 利率期限包括但不限于：隔夜（O/N）、1周（1W）、2周（2W）、1个月（1M）、3个月（3M）、6个月（6M）、9个月（9M）及1年（1Y），后续会根据实际情况增加。 |
|  | 利率 | N(16,6) | 以百分点表示，保留4位小数。  例如：1.9052,表示利率为1.9052%。 |

# 询价清算单明细

## 即远掉到期清算单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日信用型询价即远掉到期清算单信息。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 询价即远掉到期清算单编号 | C20 |  |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 本方方向（原交易方向） | C4 | 买方  卖方 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 近/远端 | C4 | 1-近端  2-远端 |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 结算方式 | C4 | 1-实物交割  2-现金结算 |
|  | 参考价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 本方收到资金金额 | N18 | 单位：分  若本方收到，数值为正；若本方支出，数值为负。 |
|  | 本方收到实物重量 | N(12,6) | 单位：千克  若本方收货，数值为正；若本方交货，数值为负。 |
|  | 是否违约申报 | C4 | P1-未申报  P2-实物交割买方违约申报  P3-现金结算违约申报 |
|  | 清算信息 | C4 | 1-成功  2-实际买方主动违约  3-实际卖方主动违约  4-双方主动违约  5-实际买方被动违约  6-实际卖方被动违约  7-双方被动违约  8-现金结算主动违约  9-现金结算被动违约  10-参考价格不存在 |
|  | 指定仓库代码 | C4 | 白银合约时字段有值 |

## 期权权利金清算单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日询价期权权利金清算单信息

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | 生成清算单的时间,格式：YYYYMMDD |
|  | 询价期权权利金清算单编号 | C20 |  |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 本方方向（原交易方向） | C4 | 买方  卖方 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 开平仓标志 | C4 | 0-开仓  1-平仓 |
|  | 权利金 | N(12,6) | 单位：元/克、元/千克 |
|  | 数量 | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 本方收到资金金额 | N18 | 单位：分  本方收到，数值为正；本方支出，数值为负。 |
|  | 是否违约申报 | C4 | O1-未申报  O2-权利金违约申报 |
|  | 清算信息 | C4 | 1-成功  11-权利金主动违约  12-权利金被动违约 |

## 拆借过户清算单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日询价拆借过户清算单信息

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | 生成清算单的时间,格式为：YYYYMMDD |
|  | 询价拆借过户单编号 | C20 |  |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 本方方向（原交易方向） | C4 | 拆入  拆出 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 过户品种 | C20 |  |
|  | 借金/还金 | C4 | 1-借金  2-还金  3-利息清算 |
|  | 数量(手） | N10 | 单位：手 |
|  | 重量 | N(12,6) | 单位：千克 |
|  | 本方收到实物重量 | N(12,6) | 单位：千克  本方收货，数值为正；本方交货，数值为负。 |
|  | 仓库代码 | C4 |  |
|  | 清算信息 | C4 | 1-成功  13-失败 |

## 拆借利息清算单数据文件

### 明细记录

提供二级系统当前交易日询价拆借利息清算单信息

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | 生成清算单的时间,格式为：YYYYMMDD |
|  | 询价拆借利息清算单编号 | C20 |  |
|  | 成交单编号 | C20 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 本方方向（原交易方向） | C4 | 拆入  拆出 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 本方收到资金金额 | N18 | 单位：分  本方收到，为正值，本方支付，为负值 |
|  | 清算信息 | C4 | 1-成功  13-失败 |

## 保证金询价到期清算单数据文件

### 明细记录

提供二级系统保证金询价市场到期清算单数据。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 到期清算单编号 | C20 |  |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 交割价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 交割数量 | N12 |  |
|  | 交割重量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 交割金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 实际交割数量 | N12 |  |
|  | 实际交割重量 | N(16,6) | 单位：千克 |
|  | 实际交割金额 | N18 | 单位：分 |
|  | 是否违约申报 | C1 | 1-是  0-否 |
|  | 违约申报数量 | N12 |  |

# 其他数据

## 充抵申请明细数据文件

### 明细记录

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 充抵申请单编号 | C16 | 最长16位字符 |
|  | 充抵申请日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 充抵申请时间 | C8 | HH:MM:SS |
|  | 申请会员代码 | C4 |  |
|  | 申请席位代码 | C6 |  |
|  | 申请客户代码 | C10 |  |
|  | 充抵申请物代码 | C10 | 最长10位字符 |
|  | 充抵申请物简称 | C20 | 最长20位字符 |
|  | 充抵申请物类型代码 | C1 | 最长1位字符  0-库存类  1-外币类  2-有价证券类  3-其他资产类 |
|  | 充抵申请物数量 | N(16,2) |  |
|  | 充抵申请物有效数量 | N(16,2) |  |
|  | 充抵申请物转交割数量 | N(16,2) |  |
|  | 违约处置数量 | N(16,2) |  |
|  | 充抵到期数量 | N(16,2) |  |
|  | 充抵到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 实际充抵到期日 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 提交日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 状态 | C4 | 100-已录入  101-已提交  102-已注销  103-审核通过、  104-审核不通过  105-充抵成功、  106-充抵失败、  107-已失效  108-到期撤销中、  109-手工撤销中  110-充抵违约宽限处理中、  111-到期充抵违约处置中  112-到期充抵完结、  113-手工充抵完结、  114-交割充抵完结、  115-到期充抵违约处置完结 |
|  | 计费日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 充抵手续费率 | N(16,6) |  |
|  | 充抵手续费 | N18 |  |
|  | 充抵申请物估价金额 | N18 |  |
|  | 充抵申请物折后金额 | N18 |  |

## 违约单数据文件

### 明细记录

提供二级系统清算时处理违约的数据来源（包含竞价、定价、保证金询价市场的违约单）。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 交割序号 | C20 |  |
|  | 买卖方向 | C1 | s-卖  b-买 |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 会员代码 | C4 | 4位数字编号 |
|  | 席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 手数 | N12 |  |
|  | 价格 | N(12,6) | 单位同合约报价单位 |
|  | 违约方向 | C1 | 1- 违约方（支付给会员）  2-被违约方（收到会员违约金）  3-违约方（支付给交易所） |
|  | 违约日期 | C8 | YYYYMMDD |

## 发票数据文件

### 明细记录

提供二级系统清算后核对白银发票相关数据，若类型为滞纳金，代表对应交割单当日收取滞纳金；若类型为税票违约金，代表对应交割单当日收取税票违约金；若类型为发票，代表当日交易所收到对应交割单的增值税发票。

如果出现税票违约金，该笔白银交割单涉及买卖双方客户的发票数据文件中都要有该条记录，以便该笔白银交割单的买方客户能够处理税票违约金。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
|  | 交割单号 | C20 |  |
|  | 类型合计 | C1 | 1-滞纳金  2-税票违约金  3-发票 |

## 席位保证金率数据文件

### 明细文件

当前交易日发送给二级系统的保证金率，包括：现货实盘合约保证金率、即期合约保证金率、延期合约保证金率、定价合约保证金率。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 席位类型 | C1 | 1- 自营  2- 代理法人  3- 代理个人 |
|  | 席位性质 | C1 | 1- 主板  2- 国际板 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 保证金类型 | C1 | 0-固定值  1-比率 |
|  | 多空方向 | C1 | 定价合约此字段为空  1- 多  0- 空 |
|  | 交易保证金名称 | C3 | 定价合约保证金率使用此字段，其他合约此字段为空。  1-买入交易保证金  2-卖出交易保证金 |
|  | 保证金率 | N(16,6) |  |

## 席位手续费率数据文件

### 明细文件

当前交易日发送给二级系统的手续费率，包括：现货合约手续费率、即期合约手续费率、延期合约手续费率、定价合约手续费率。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 席位类型 | C1 | 1- 自营  2- 代理法人  3- 代理个人 |
|  | 席位性质 | C1 | 1- 主板  2- 国际板 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 开平标志 | C1 | 0- 开仓  1- 平仓  2- 强行平仓  3- 短线开仓  4- 短线平仓 |
|  | 申报类型 | C2 | 定价合约手续费率使用此字段，其它合约此字段为空。  1- 市场申报  2- 补充申报 |
|  | 手续费类型 | C1 | 0-固定值  1-比率 |
|  | 手续费率 | N(16,6) |  |

## 客户保证金率数据文件

### 明细文件

当前交易日发送给二级系统的配置到客户级别的保证金率，包括：现货实盘合约保证金率、即期合约保证金率、延期合约保证金率、定价合约保证金率。

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 |  |
|  | 保证金类型 | C1 | 0-固定值  1- 比率 |
|  | 多空方向 | C1 | 定价合约此字段为空  1- 多  0- 空 |
|  | 交易保证金名称 | C3 | 定价合约保证金率使用此字段，其他合约此字段为空。  1- 买入交易保证金  2- 卖出交易保证金 |
|  | 保证金率 | N(16,6) | 当日推送给二级系统的保证金率应为主系统当日清算时该合约生效的保证金率。 |

## 客户手续费率数据文件

### 明细文件

当前交易日发送给二级系统的配置到客户级别的客户手续费率，包括：现货实盘合约手续费率、即期合约手续费率、延期合约手续费率、定价合约手续费率。

| **序号** | **业务字段** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 合约代码 | C8 |  |
|  | 开平标志 | C1 | 0- 开仓  1- 平仓  2- 强行平仓  3- 短线开仓  4- 短线平仓 |
|  | 申报类型 | C2 | 定价合约手续费率使用此字段，其它合约此字段为空。  1- 市场申报  2- 补充申报 |
|  | 手续费类型 | C1 | 1. 固定值 2. 比率 |
|  | 手续费率 | N(16,6) |  |

## 单向大边合约组合数据文件

### 明细文件

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 组合代码 | N10 |  |
|  | 组合名称 | C20 |  |
|  | 合约代码 | C8 |  |

## 延期合约交割方式数据文件

### 明细文件

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 是否采用现金交割 | C1 | 2-是 |

**注**：延期合约如果出现在该文件，并且【是否采用现金交割】取值为“是”，则在最后交易日采用现金交割方式进行清算。

## 保证金询价席位保证金率数据文件

### 明细文件

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 席位性质 | C1 | 1- 主板  2- 国际板 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 单边保证金率 | N(16,6) | 单位：元/手 |
|  | 掉期保证金率 | N(16,6) | 单位：元/手 |

## 保证金询价客户保证金率数据文件

### 明细文件

如存在配置客户级别的保证金询价合约保证金率，当前交易日发送给二级系统。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 客户代码 | C10 |  |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 单边保证金率 | N(16,6) | 单位：元/手 |
|  | 掉期保证金率 | N(16,6) | 单位：元/手 |

## 保证金询价交割保证金率数据文件

### 明细文件

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 会员代码 | C4 |  |
|  | 席位代码 | C6 |  |
|  | 席位性质 | C1 | 1-主板  2-国际板 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 交割保证金率 | N(16,6) | 单位：元/手 |

## 保证金询价违约费率数据文件

### 明细文件

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 违约费率 | N(16,6) | 单位：元/手 |

# 客户转移业务数据

## 客户转移申请数据文件

### 明细文件

向转出席位和转入席位提供当前交易日交易所已完成处理的客户转移申请数据。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 申请序号 | C20 | 20位字符，不可为空 |
|  | 转移日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 转出席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 转入席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 客户上日保证金金额 | N18 | 单位：分 |

## 客户转移延期持仓数据文件

### 明细文件

向转出席位和转入席位提供当前交易日客户延期持仓转移数据。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 转移日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 转出席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 转入席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 合约代码 | C8 | 最长8位字符 |
|  | 多头持仓量 | N12 |  |
|  | 空头持仓量 | N12 |  |

## 转移客户费用数据文件

### 明细文件

向转出席位、转入席位提供当前交易日转移客户发生在转出席位下的费用数据。主要用于转出席位、转入席位获得转移客户实际转移金额。实际转移金额等于转移客户上日保证金余额减去转移客户发生在转出席位下的费用。

| **序号** | **属性描述** | **数据类型** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 转移日期 | C8 | YYYYMMDD |
|  | 客户代码 | C10 | 10位数字编号 |
|  | 转出席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 转入席位代码 | C6 | 6位数字编号 |
|  | 费用类型 | C4 | 同客户费用数据文件中费用类型说明 |
|  | 金额 | N18 | 单位：分 |

# 标志文件

标志文件中只有一条记录，包含如下字段，各字段之间采用分隔符”|”。

文件名后缀为“.sm”，供会员二级系统下载摘要数据，以供会员对文件完整性验证。

| **序号** | **位置** | **长度** | **名称** | **字段类型** | **必填** | **说明** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 1 | 61 | 文件名称 | C60 | 否 | 被标志的数据文件名。 |
|  | 62 | 78 | 文件字节数 | C16 | 否 | 以字节为单位。 |
|  | 79 | 87 | 文件生成日期 | C8 | 否 | 格式：YYYYMMDD |
|  | 88 | 94 | 文件生成时间 | C6 | 否 | 格式：HHMMSS |
|  | 95 | 107 | 文件记录数 | C12 | 否 |  |
|  | 108 | 172 | 校验码 | C64 | 是 | 64位字符串 |
|  | 173 | 237 | 保留字段 | C64 | 否 |  |

# 版本业务影响说明

## 2024年端午版本

为支持客户分离与转移业务，针对客户从转出席位转移到转入席位发生的资金、库存和持仓转移数据，可通过当天清算数据文件获取。

清算数据文件接口的具体变化及下发数据规则如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **数据** | **说明** | **转出席位** | **转入席位** |
| 客户转移申请数据 | 新增文件 | √ | √ |
| 客户库存转移数据 | 存量文件  通过原客户库存变化流水数据文件下发。其中，在客户库存转移产生的库存划转转出和转入流水（交易库）中，“单据编号”采用“KHZY+YYYYMMDD+顺序号”编码规则 | √  （转出流水） | √  （转入流水） |
| 客户转移延期持仓数据 | 新增文件  按合约记录发生转移的多头持仓和空头持仓数据 | √ | √ |
| 转移客户费用数据 | 新增文件  主要包括待转移客户发生在转出席位的费用及金额 | √ | √ |