

# 中证指数公司报价式回购折算率 数据文件接口规范 ( Ver 1.3 )

中证指数有限公司

二〇一五年九月

## 一. 概要

中证指数公司每日计算并发布报价式回购折算率，发布方式为文件形式。

## 二. 折算率数据文件说明

### • 文件名

中证指数公司每个交易日（T 日）22:00 通过网站 (<http://www.csindex.com.cn/>) 及 FTP（路径为：</idxdata/customize/ssebzs1>）发布适用于下一交易日（T+1 日）的报价式回购折算率数据，文件名称参照以下命名格式（MMDD 和 YYYYMMDD 均为 T+1 日日期）：

- 上交所债券折算率数据文件：bzs101MMDD.txt
- 全市场债券折算率数据文件：bzs102YYYYMMDD.txt
- 全市场类别折算率数据文件：bzs103YYYYMMDD.txt

同时，中证指数公司每个交易日（T 日）23:00 通过 FTP（路径为：</idxdata/customize/ssebzs1>）发布适用于下两个交易日（T+2 日）的报价式回购折算率数据供市场参与者参考。文件名称如下：

- 上交所 T+2 日债券折算率数据文件：bzslref.txt
- 与 bzs101MMDD.txt 不同的是，bzslref.txt 所含的是折算率预发布数据，仅供市场参与者参考使用，并非直接用于相关的交易、结算等环节。该文件中不包含将在 T+2 日上市的债券；且如遇折算率调整因子紧急变更或估值紧急调

整等事件，bzslref.txt 中所涉及个券的折算率值将可能发生调整，调整最终结果以 T+1 日发布的 bzs101MMDD.txt 为准。

- 行

每一行与下一行之间的换行符为“0x0A”。

- 字段分隔符

一条数据记录中不同的列使用“|”分割（各行第一列之前和最后一列之后不包括分隔符“|”。

### 三. 报价式回购折算率数据文件格式

上交所债券报价式回购折算率数据文件名称：

bzs101MMDD.txt

其中 MMDD 为折算率适用日月份的月、日部分。

文件中各字段的顺序和定义如下：

编号	字段名	字段类型	说明
1	证券代码	C 6	不足 6 位左边补 0
2	标准券比率/标准券折算值	N 15	右对齐，不足补空格； 保留三位小数，最大值为 999.999 当证券代码为债券时本字段为标准券折算率； 当证券代码为债券 ETF 或货币 ETF 时本字段为标准券折算值，折算值单位为元

全市场债券报价式回购折算率数据文件名称：

bzs102YYYYMMDD.txt

其中 YYYYMMDD 为折算率适用日日期。

文件中各字段的顺序和定义如下：

编号	字段名	字段类型	描述
1	证券代码	C 10	左对齐，右边补空格
2	市场	C 3	上海：SHH 深圳：SHZ 银行间：BNK
3	估值全价	N 10(4)	右对齐，不足补空格； 总长度 10 位（含小数点），其中小数部分 4 位
4	折扣率	N 10(4)	右对齐，不足补空格； 总长度 10 位（含小数点），其中小数部分 4 位
5	折算率	N 10(4)	右对齐，不足补空格； 总长度 10 位（含小数点），其中小数部分 4 位

全市场类别报价式回购折算率数据文件名称：

bzs103YYYYMMDD.txt

其中 YYYYMMDD 为折算率适用日日期。

文件中各字段的顺序和定义如下：

编号	字段名	字段类型	描述
1	类别名称	C 20	信用类别
2	债项评级	C 8	债项评级
3	折扣率中位数值	N 10(4)	右对齐，不足补空格； 总长度 10 位（含小数点），其中小数部分 4 位
4	折算率中位数值	N 10(4)	右对齐，不足补空格； 总长度 10 位（含小数点），其中小数部分 4 位

上交所报价式回购折算率预发布数据文件名称：

bzslref.txt

文件中各字段的顺序和定义如下：

编号	字段名	字段类型	说明
1	适用日期	C 8	格式为 YYYYMMDD
2	证券代码	C 6	不足 6 位左边补 0
3	标准券比率/标准券折算值	N 15	右对齐，不足补空格； 保留三位小数，最大值为 999.999； 当证券代码为债券时本字段为标准券折算率； 当证券代码为债券 ETF 或货币 ETF 时本字段为标准券折算值，折算值单位为元