

中证指数估值文件接口规范

(Ver 1.0)

中证指数有限公司

二〇一二年二月

一. 概要

为了更好地服务于市场，指数公司通过上海证券交易所单向卫星平台向市场发布债券估值，发布方式以文件形式。同时通过其他途径发布债券期限结构数据文件。

二. 指数行情信息文件说明

• 文件名

每个文件都被上传到或下载于指定给外部系统的文件夹。文件名称遵循规格说明中指定的文件名称。文件名称参照下面命名格式：

债券估值文件：bvYYMMDD.txt

MD5 码校验文件：bvYYMMDD.flg

债券期限结构数据文件：bcYYMMDD.txt

MD5 码校验文件：bcYYMMDD.flg

• 统一的文件结构

所有文件都为 UTF-8 编码的文本，并必须遵循本章定义的统一的文件结构。

• 行

文件开头部分用来存放文件每一列的列名称。属于特殊的部分，在任何情况下都须存在。该部分内容与正式数据之间有一行由 10 个 “=” 隔开的分隔符，以上为列名称，以下为正式文件内容。

每一行与下一行之间的换行符为 “0xD 0xA”（或者称

为“\r\n”)。

- 字段分隔符

一条数据记录中不同的列使用“|”分割（各行开始不包括分隔符“|”，每一行数据最后一列结尾包括分隔符“|”）。

- 字段

每一个字段有固定长度，如该字段数据长度不满约定长度则用空格补满，补充空格一律在数据的右侧，数字型的长度包含小数点和符号位。

以下为示例数据：

S1=Date

S2=Index Code

S3=Open

S4=High

=====

20120131|000001 |2285.9540 |2296.3840 |

- 文件内容

文件内容为空时文件不生成。生成的文件内容必须符合文件本身的定义。文件开头为每一个字段名称，在10个“=”分隔符之后为具体内容。

三. 债券指数估值文件格式

债券指数估值文件名称: bvYYMMDD.txt (其中 YYMMDD 为下一个交易日期). 各文件中字段的顺序按照以下字段定义顺序为准. 各文件开头为字段名称, 从 10 个 “=” 分隔符以下开始为信息记录。

字符型字段长度描述为 X, 其中 X 代表字段实际长度。

数值型字段长度描述为 X(Y), 其中 X 代表字段实际长度, Y 代表小数点后的长度 (如数据本身小数点长度不足则补 0)。

1. 文件头信息具体定义如下:

字段名	类型	长度	数据含义
列名称	字符型	无固定	每一行代表一个列的名称, 例如: “SX=Date” 其中 “X” 代表列位置, “=” 之后为列名称。

表 3-1: 文件头信息数据结构表

信息记录定义如下:

2. 债券指数估值信息定义:

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
日期	字符型	8	日期	
Date				
沪市代码	字符型	10	沪市代码	
SHH Code				
深市代码	字符型	10	深市代码	
SHZ Code				
银行间代码	字符型	10	银行间代码	
Inter-Bank Code				

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
计算价格 Calculation Price	数值型	10(4)	计算价格	
计算收益率 Yield To Maturity(%)	数值型	10(4)	计算收益率	
修正久期 Modified Duration	数值型	10(4)	修正久期	
凸性 Convexity	数值型	10(4)	凸性	
净价 Clean Price	数值型	10(4)	净价	
应计利息 Accrued Interest	数值型	10(4)	应计利息	
保留 Reserve	字符型	10	保留字段	

表 3-2: 文件信息数据结构定义表

四. 债券期限结构数据文件格式

债券期限结构数据文件名称: bcYYMMDD.txt (其中 YYMMDD 为下一个交易日期). 各文件中字段的顺序按照以下字段定义顺序为准. 各文件开头为字段名称, 从 10 个 “=” 分隔符以下开始为信息记录。

字符型字段长度描述为 X, 其中 X 代表字段实际长度。

数值型字段长度描述为 X(Y), 其中 X 代表字段实际长度, Y 代表小数点后的长度 (如数据本身小数点长度不足则补 0)。

1. 文件头信息具体定义如下:

字段名	类型	长度	数据含义
列名称	字符型	无	每一行代表一个列的名称，例如：“SX=Date”其中“X”代表列位置，“=”之后为列名称。

表 3-2: 文件头信息数据结构表

信息记录定义如下:

2. 债券期限结构数据信息定义:

字段名	类型	长度	字段含义	数据说明
日期 Date	字符型	8	生效日期	
曲线名称 Curve Name	字符型	80	曲线名称	
年限(年) Term (year)	数值型	5		
即期利率(%) Spot Rate (%)	数值型	10		
到期收益率(%) Yield to Maturity (%)	数值型	10		
远期利率(%) Forward Rate (%)	数值型	10		
保留 Reserve	字符型	10	保留字段	

表 3-2: 文件信息数据结构定义表

五. 校验文件格式

在主文件传送结束后，需要发送一个校验文件表明该文件已传送

结束。该校验文件命名规则为：主文件名.flg

其中主文件名为其所校验的文件的名字。

文件内容如下：

编号	字段名	字段类型	描述	必选项
1	File Name	C 60	被标志的文件名	是
2	File Size	C 16	文件大小，以字节为单位	是
3	Creation Date	C 8	该文件的生成日期， YYYYMMDD格式	是
4	Creation Time	C 6	文件生成时间， HHMMSS格式	是
5	Record Number	C 12	文件记录数，对二进制文件无效	是
6	Check Sum	C 64	MD5校验码，为大写	是
7	Reserved Field	C 64	预留字段，填充格	

* 字段间以” |” 为分隔符。

由于文件通过公共存储网关进行交换，所以在接口系统之间没有专门的连接通知数据接收和处理的状态。文件发送方应在数据文件发送完毕后，发送如上所定义的校验文件，用作文件传输成功的标志。文件接收方要在发现和成功读取该校验文件后，才能读取文件，且应根据校验码，对文件完整性进行校验。