

# 中证指数数据文件服务规范（资讯商专用）

## V1.3.2

中证指数有限公司

技术运行部

二〇一八年十一月

中证指数服务平台通过 FTP 服务器为资讯商提供中证公司系列指数的公告信息、指数成份股列表、指数的权重数据、历史行情数据、公司事件等信息。信息提供分为两类：文档信息和数据信息。

正常情况下，A 股数据服务文件的对外发布时间为 18:00 之前；亚太数据服务文件的对外发布时间为 20:00 之前；新三板数据服务文件的对外发布时间为 24:00 之前；全球数据服务文件的对外发布时间为次日 9:00 之前；基金指数数据服务文件的对外发布时间为次日 11:00 之前；SAC 基金估值指数数据服务文件的对外发布时间为 16:00 之前；期货指数数据服务文件的对外发布时间为 18:00 之前；债券指数数据服务文件的对外发布时间为 20:00 之前；如超过预订时间点，中证指数公司会及时向用户发送短信和邮件提示（短信提示支持除 186 网段之外的国内手机号）。请各位用户确保登记信息正确，如需变更请直接与市场部联系。

A 股、亚太、全球拟调入数据服务文件会在我司发布定期调样公告后尽快提供。根据指数编制规则，权重因子是以定期调样生效日前五个交易日的收盘数据计算，故在此之前，权重因子一列为空，在完成计算后提供。

如需我司数据服务请与市场部联系，联系电话：+86 21 50186571。

**文档版本历史表**

版本号	作者	操作	日期	说明
V1.0	指数公司运维部	创建	2011-3	
V1.1	指数公司运维部	修订	2011-7	(1) 修改 4.节文件内容说明中，数据文件开始部分字段说明仅保留英文； (2) 修改 4.2.2 节收盘权重文件、4.2.4 节次日权重文件、4.2.5 节成分券公司事件文件、4.3.1 中证行业分类文件中证券代码说明为“所在交易所交易代码(TICKER)” + “. “+ “交易所编码 ( EXCHANGE CODE ) ” 如:600000.SHH 1.HKG”； (3) 增加附录三，交易所及其编码对应表。
V1.2	指数公司运维部	修订	2011-7	(1) 3.2.2 节指数数据文件组织命名中增加债券期限结构说明； (2) 3.2.3 节其它指数文件组织命名中增加交易所编码和名称对应文件说明； (3) 增加 4.2.8 节债券指数期限结构数据文件说明； (4) 增加 4.3.6 节交易所编码及其名称对应文件说明。
V1.2.1	指数公司运维部	修订	2011-12	(1) 修改 3.2.2 节指数数据文件组织命名，增加成分券收盘权重文件（限债券指数）和债券估值文件（限债券指数）文件类型； (2) 修改 4.2.1 节历史行情文件中成交量字段说明，债券指数由“万股”变为“万元”； (3) 增加了 4.2.9 节债券指数收盘权重文件说明； (4) 增加了 4.2.10 节债券指数估值文件说明； (5) 修改附录 1 债券指数文件列表，增加收盘权重和估值数据文件； (6) 修改 4.3.3 节指数基本信息文件，增加所属指数系统，样本覆盖券市场； (6) 4.2.8 节债券期限结构数据文件的曲线名称字段类型调整为 C 80； (7) 4.2.9 节债券指数收盘权重文件

				的银行间代码移至深市代码后； (8)4.2.10 债券指数估值文件的银行间代码移至深市代码后。
V1.2.2	指数公司运维部	修订	2012-02	(1) 4.3.1 节中证二级代码调整为中证三级代码、中证二级名称调整为中证三级名称、中证二级英文名称调整为中证三级英文名称。 (2) 增加 4.3.7 节行业市盈率文件及文件说明。
V1.2.3	指数公司运维部	修订	2012-05	(1) 4.3.1 节中证三级代码调整为中证四级代码、中证三级名称调整为中证四级名称、中证三级英文名称调整为中证四级英文名称。
V1.2.4	指数公司运维部	修订	2012-05	(1) 4.3.1 节添加中证二级和三级行业分类信息包括代码、名称和英文名称
V1.2.5	指数公司运维部	修订	2012-07	(1) 4.3.3 节对指数基本信息的字段进行了详细注释 (2) 在第二页增加数据服务文件和拟调入文件发布时间说明 (3) 4.2.6 节增加拟调入文件发布时间说明
V1.2.6	指数公司运维部	修订	2012-08	(1) 4.2.9 节修改债券收盘权重文件格式
V1.2.7	指数公司运维部	修订	2012-08	(1) 4.2.2 节文件名 YYYYMMDD+ 指数系统+_closeweightfree.txt 改为 YYYYMMDD+ 指数系统+_closeweight.txt (2) 附录一中列出债券系统生成的文件 (3) 附录中文件名 YYYYMMDD+ 指数系统+_closeweightfree.txt 改为 YYYYMMDD+ 指数系统+_closeweight.txt (4) 4.3.7 节行业市盈率文件添加字段、说明 (5) 3.2.2 节数据文件目录结构调整 (6) 4.3.1 节更改中证行业分类文件名
V1.2.8	指数公司运维部	修订	2012-10	(1) 4.2.4 节次日权重文件的保留字段添加注解
V1.2.9	指数公司技术运行部	修订	2013-09	(1) 4.3.3 节指数归属增加“中华交易”和“客制指数”系列

V1.2.10	指数公司技术运行部	修订	2016-12	(1) 3.2.2 中新增指数系统: nec(新三板指数) (2) 4.2.5 中配股价精度调整 (3) 4.2.6 中拟调入文件启用备用字段, 改为: 是否存在需要调整价格的事件 (4) 附录一中增加新三板 nec 指数文件列表
V1.3.1	指数公司技术运行部	修订	2017-12	(1) 4.2.9 债券指数收盘权重文件和附录三 交易所及其编码对应表中, 银行间债券市场的交易所编码由“CPT”改为“BNK” (2) 4.2.2 收盘权重文件、4.2.4 次日权重文件、4.2.5 成分券公司事件文件、4.2.6 拟调入文件、4.2.9 债券指数收盘权重文件中, “成分券代码”字段长度由 C10 扩展为 C20
V1.3.2	指数公司技术运行部	修订	2018-11	增加 4.2.11 节债券特殊品种估值数据文件说明

## 目录

1. 引言.....	1
2. FTP 服务平台目录结构.....	1
2.1 目录说明.....	1
3. 文件说明.....	1
3.1 文件类型.....	1
3.2 文件命名组织方式.....	1
3.2.1 下一交易日文件列表文件组织命名.....	1
3.2.2 指数数据文件组织命名.....	1
3.2.3 其它指数文件组织命名.....	3
4. 文件内容说明.....	3
4.1 下一交易日文件列表文件内容说明.....	3
4.2 指数数据文件内容说明.....	3
4.2.1 指数行情文件.....	4
4.2.2 收盘权重文件.....	5
4.2.3 除数文件.....	6
4.2.4 次日权重文件.....	6
4.2.5 成分券公司事件文件.....	7
4.2.6 拟调入文件.....	8
4.2.7 全部股本数据文件.....	9
4.2.8 债券期限结构数据文件.....	10
4.2.9 债券指数收盘权重文件.....	10
4.2.10 债券估值文件.....	11
4.2.11 债券特殊品种估值文件.....	12
4.3 其他文件内容说明.....	12
4.3.1 中证行业分类文件.....	12
4.3.2 证监会行业分类文件.....	13
4.3.3 指数基本信息文件.....	14
4.3.4 指数追溯行情文件.....	16
4.3.5 公告等其它文件.....	18
4.3.6 交易所编码及其名称对应文件.....	18
4.3.7 行业市盈率文件.....	18
附录一.....	21
附录二.....	23
附录三.....	24

## 1. 引言

指数公司通过 FTP 数据服务平台向资讯商提供指数相关数据。目前提供的指数分类有：A 股指数、海外指数（全球和亚太指数）、基金指数、SAC 基金估值指数、期货指数、债券指数、新三板指数。主要的数据有：指数历史行情、收盘权重、次日权重、除数、公司事件、成分券、拟调入等信息。本文档对于相关指数数据文件进行了阐述和说明。

## 2. FTP 服务平台目录结构

数据服务平台 FTP 主目录名称为 vendor，下级目录含有数据和文档资料目录。

### 2.1 目录说明

[vendor]目录主要包含指数数据，其下级子目录为：

目录说明	目录名
历史行情、收盘权重、公告等文件	Vendor\basic
收盘权重文件	Vendor\plus
除数、次日权重、公司事件、拟调入、全部股本文件	Vendor\agent
服务规范文件	Vendor\docs\specification

## 3. 文件说明

### 3.1 文件类型

文件分为以下三类：下一交易日文件列表文件，指数历史行情、权重、除数等数据文件，公告、编制方案等其他文件。相关文件通过 ZIP 方式进行压缩，当天 23:00 将所有文件进行压缩，名称为：YYYYMMDD.zip，该压缩包在数据服务平台只保留 3 天。

### 3.2 文件命名组织方式

#### 3.2.1 下一交易日文件列表文件组织命名

该文件包含了下一交易日产生的数据文件名称集合。

文件名称为：YYYYMMDDnextdayfiles.txt，对应压缩文件为：YYYYMMDDnextdayfiles.zip

文件所在目录为：Vendor\basic.

#### 3.2.2 指数数据文件组织命名

指数数据文件格式为 TXT。按照不同的指数系统和数据类型进行命名，文件名称为：

YYYYMMDD+指数系统+\_数据类型.txt, 对应的压缩文件为: YYYYMMDD+指数系统+\_数据类型.zip。根据数据类型的不同, 一个指数系统会对应多个压缩文件。

根据目前指数系统和文件类型, 文本文件有:

文件名称	文件说明	所在目录
YYYYMMDD+指数系统+_perf.txt	指数行情文件	Vendor\basic
YYYYMMDD+指数系统+_closeweight.txt	收盘权重文件 (sac、bond、fund 每日更新, ashare、asia、global、nee 每月更新)	Vendor\basic
YYYYMMDD+ bond_div.txt	债券除数文件	Vendor\basic
YYYYMMDD+ bond_weightnextday.txt	债券次日权重文件	Vendor\basic
YYYYMMDD+bond_valuation.txt	债券估值文件	data/bonddata/general
YYYYMMDD+specified_bond_valuation.txt	债券特殊品种估值文件	data/bonddata/specified_bond_valuation
YYYYMMDD+bond_termstructure.txt	债券期限结构数据文件	data/bonddata/general
YYYYMMDD+指数系统+_closeweight.txt	收盘权重文件 (A股、亚太和全球)	Vendor\plus
YYYYMMDD+指数系统+_div.txt	指数除数文件	Vendor\agent
YYYYMMDD+指数系统+_weightnextday.txt	次日权重文件	Vendor\agent
YYYYMMDD+指数系统+_cafuture.txt	公司事	Vendor\agent



	件文件	
YYYYMMDD+指数系统 +_securites_to_be_included.txt	拟调入 文件	Vendor\agent
YYYYMMDD+指数系统 +_securities_share.txt	全部证 券股本 信息文 件	Vendor\agent

其中, YYYYMMDD 为交易日当天。指数系统按照现有的划分为: ashare (A 股指数)、global (全球指数)、fund (基金指数)、sac (基金估值行业指数)、asia (海外亚太指数)、futures (期货指数)、bond (债券指数)、nee(新三板指数)、others (包括沪深 300 二、三级行业、海外指数二、三级行业指数等其它)。所有指数系统的文件列表参照附录一。

### 3.2.3 其它指数文件组织命名

中证行业分类文件名称为: asharecics.txt(A 股)、asiacics.txt (亚太)、globalcics.txt (全球)

证监会行业分类文件名称为: csrcindustry.txt

指数基本信息文件名称为: indexbasicinfo.txt

指数追溯行情文件名称为: 指数代码+trackedbackperf.txt

交易所编码及其名称对应文件名称为: exchangecode.txt

行业市盈率文件名称为: YYYYMMDDcsiinduspe.txt

对于中证行业分类、证监会行业分类、指数基本信息表、指数追溯行情、交易所编码及其名称对应文件、指数公告等其它文件, 压缩为 YYYYMDDothers.zip 文件。

行业市盈率文件压缩为 YYYYMMDDcsiinduspe.zip。

所在目录为: Vendor\basic.

## 4. 文件内容说明

### 4.1 下一交易日文件列表文件内容说明

文件内容第一行为下一交易日, 从第二行开始为数据文件名称, 每个文件名称占用一行。

### 4.2 指数数据文件内容说明

一个指数数据文件中包含了多条指数的信息。数据 TXT 文本文件开始部分作为字段说明, 每个字段说明为一行。字段说明下一行为分割行, 由 10 个“=”字符组成, 之后每一行为一条数据记录, 记录的字段之间通过“|”进行分割。字段左对齐, 如果该字段没有数据, 则通过空格进行填充。

#### 4.2.1 指数行情文件

说明：包含指数当天行情。

文件名称：YYYYMMDD+指数系统+\_perf.txt.

数据内容包括：

字段名称	字段类型	说明
日期 Date	C 8	交易日期
指数代码 Index Code	C 8	
开盘 Open	N 11 (4)	指数开盘价
最高 High	N 11 (4)	指数最高价
最低 Low	N 11 (4)	指数最低价
收盘 Close	N 11 (4)	指数收盘价
涨跌 Change	N 11 (4)	指数涨跌值
涨跌幅(%) Change(%)	N 6 (2)	指数涨跌幅
成交量 Volume	N 18	指数当日成交量 注：在股票指数中为股， 期货指数中为手，债券指 数中为万元
成交金额 Turnover	N 18	指数当日成交金额
指数市值(百万) Index Market Cap.(mn)	N 20 (2)	指数所含样本的总市值
成份券数目 Number of Cons.	N 5	指数成份券数目
市盈率 1 P/E1	N 6 (2)	指数市盈率 1= $\frac{\sum(\text{总股本} \times \text{股价})}{\sum(\text{总股本} \times \text{每股收益})}$
市盈率 2 P/E2	N 6 (2)	指数市盈率 2= $\frac{\sum(\text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{股价})}{\sum(\text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{每股收益})}$
股息率 1 D/P1	N 6 (2)	指数股息率 1= $\frac{\sum(\text{总股本} \times \text{年度每股现金股息})}{\sum(\text{总股本} \times \text{股价})} \times 100\%$
股息率 2	N 6 (2)	指数股息率 2= $\sum(\text{调整股}$

D/P2		本数 × 权重因子 × 年度每股现金股息) / ∑ (调整股本数 × 权重因子 × 股价) × 100%
持仓量(手) Open Interests(lots)	N 10	持仓量(仅用于期货指数)
结算金额(万元) Settlement Turnover (10 thousand CNY)	N 10	指数所有样本的结算总金额(仅用于债券指数)
修正久期 Modified Duration	N 11 (4)	指数的修正久期(仅用于债券指数)
凸性 Convexity	N 11 (4)	指数的凸性(仅用于债券指数)
到期收益率(%) Yield To Maturity(%)	N 11 (4)	指数的到期收益率(仅用于债券指数)
久期 Duration	N 11 (4)	指数的久期(仅用于债券指数)
平均价格 Average Price	N 11 (4)	指数所有样本的平均价格(仅用于债券指数)
净价指数值 Net Price	N 11 (4)	以指数所有样本券的净价来计算的净价指数值(仅用于债券指数)
利息及再投资指数值 Interest and Reinvestment Price	N 11 (4)	以指数所有样本券净价为100来计算的全价指数值(仅用于债券指数)
保留 Reserve	C 10	保留字段

注1: 以 C X 格式表示字符串型, 其中 X 代表长度。以 N X (Y)格式表示数字型, 其中 X 代表数字型字符串总长度, 包括小数点和符号位, Y 代表小数位数。下表相同。

注2: 其中的日期字段类型为 C 8, 格式为 YYYYMMDD, 以下说明中相同。

#### 4.2.2 收盘权重文件

**说明:** 包含指数的收盘权重。其中, 成分券股本、价格信息为空。

**文件名称:** YYYYMMDD+指数系统+\_closeweight.txt。

**数据内容包括:**

字段名称	字段类型	说明
生效日期 Effective Date	C 8	样本/权重生效日期
指数代码 Index Code	C 8	
成分券代码	C 20	所在交易所交易代码

Constituent Code		(TICKER)”+”.”+“ 交易所编码 ( EXCHANGE CODE ) 如:600000.SHH 1.HKG
交易货币 Trading Currency	C 3	交易所使用的币种: HKD: 港币 USD: 美元 CNY: 人民币 TWD: 台 币 ,CAD: 加元,SGD: 新加坡元
汇率 exchange rate	N 9 (4)	交易货币对指数币种汇 率
权重(% ) Weight(% )	N 6 (3)	该成分券在指数中所占 权重
保留 Reserve	C 10	保留字段

其中，对于基金指数、债券指数不提供权重信息，通过生效日期、指数代码、成分券代码标志指数样本信息。

#### 4.2.3 除数文件

**说明：**包含指数的除数。

**文件名称：**YYYYMMDD+指数系统+\_div.txt。

**数据内容包括：**

字段名称	字段类型	说明
除数生效日期 Effective Date	C 8	除数生效日期
指数代码 Index Code	C 8	
除数 Divisor	N 15	生效日除数
保留 Reserve	C 10	保留字段

#### 4.2.4 次日权重文件

**说明：**包含了生效日的成分券调整后的股本生效信息。

**文件名称：**YYYYMMDD+指数系统+\_weightnextday.txt。

**数据内容包括：**

字段名称	字段类型	说明
生效日期 Effective Date	C 8	样本/权重生效日期
指数代码	C 8	

Index Code		
成分券代码 Constituent Code	C 20	所在交易所交易代码 (TICKER)”+”.”+“交易所编 码 ( EXCHANGE CODE ) 如: 600000.SHH 1.HKG
交易货币 Trading Currency	C 3	交易所使用的币种: HKD: 港币 USD: 美元 CNY: 人民币 TWD: 台 币 ,CAD: 加元,SGD: 新 加坡元
汇率 exchange rate	N 9 (4)	交易货币对指数币种汇 率
总股本 (股) Total Shares(share)	N 15	
自由流通比例(%)(归档后) Categorized Inclusion Factor(%)	N 10 (6)	分级靠档后的自由流通 比例
计算用股本 (股) Shares in Index(share)	N 15	详见各指数编制方案
调整后开盘参考价 Reference Open Price for Next Trading Day	N 12 (3)	调整后明日开盘参考价
次日权重 (债券)/保留(其它) Weight Next Day ( bond ) /Reserve ( else)	N 10 (3) / C 10	债券系统为次日权重; 其 它系统为保留字段

#### 4.2.5 成分券公司事件文件

**说明:** 包含了指数成分券一段时间内分红、送股、配股、增发、债转股、权证行权、股 权分置限售期满等提示信息(详见附录二)。其中,分红币种、价格调整因子仅用于 global (全球)、asia (亚太) 指数系统。

**文件名称:** YYYYMMDD+指数系统+\_cafuture.txt。

**数据内容包括:**

字段名称	字段类型	说明
生效日期 Effective Date	C 8	股本、价格生效日期
指数代码 Index Code	C 8	
成分券代码 Constituent Code	C 20	所在交易所交易代码 (TICKER)”+”.”+“交易所编 码 ( EXCHANGE

		CODE) 如: 600000.SHH 1.HKG
事件 CA Type	C 50	成分券公司事件, 类型详见附录一
送股比例 Bonus Issues Ratio(per share)	N 7 (4)	
配股比例 Rights Offering Ratio(per share)	N 7 (4)	
配股价 Rights Offering Price	N 13 (4)	金额
每股分红 Dividend per share	N 10 (6)	金额
分红币种 Dividend Currency	C 3	
价格调整因子 Price Adjust Factor	N 9 (5)	
拟生效计算用股本(股) Future Shares in Index(share)	N 15	公司事件生效后, 计入指数股本
备注 Notes	C 50	
保留 Reserve	C 10	保留字段

#### 4.2.6 拟调入文件

**说明:** 包含了在指数临时和定期调样时, 成分券股本信息、拟调入成分券标识信息等。该文件会在中证指数公司对外公告最新调样名单后尽快发布。根据指数规则, 权重因子是以定期调样生效日前五个交易日收盘数据计算的, 故在此之前, 文件中权重因子一列为空, 待权重因子计算完成后尽快提供。

**文件名称:** YYYYMMDD+指数系统+\_securities\_to\_be\_included.txt。

**数据内容包括:**

字段名称	字段类型	说明
调入日期 Inclusion Date	C 8	该股票调入指数的日期, 即: 样本/股本生效日期
生效日期 Effective Date	C 8	调整后开盘参考价生效日期
指数代码 Index Code	C 8	
成分券代码 Constituent Code	C 20	
交易货币	C 3	交易所使用的币种:

Trading Currency		HKD: 港币 USD: 美元 CNY: 人民币 TWD: 台 币 ,CAD: 加元,SGD: 新 加坡元
总股本(股) Total A Shares(share)	N 15	
自由流通比例(%)(归档后) Categorized Inclusion Factor(%)	N 10 (6)	分级靠档后的自由流通 比例
权重因子 Cap Factor	N 9 (8)	
计算用股本(股) Shares in Index(share)	N 15	详见各指数编制方案
调整后开盘参考价 Reference Open Price for Next Trading Day	N 12 (3)	调整后明日开盘参考价
当前靠档比例 (%) Including Factor now (%)	N 10 (6)	成分券当前靠档比例
样本标志 Constituent Change	C 10	样本调入标志 注: 对于拟调入的成分券 该字段为 “New Add”
是否存在需要调整价格的公司 事件 Whether there is a company event which need to adjust the security's price	C1	该证券在新样本生效前 是否存在需要调整价格 的公司事件标志 注: 如有事件, 该字段为 “Y”

#### 4.2.7 全部股本数据文件

**说明:** 包含了证券总股本、归档后自由流通股本、调整后开盘参考价数据。含 B 股证券，其中 B 股自由流通股本（归档后）字段为空。

**文件名称:** YYYYMMDD+指数系统+\_securities\_share.txt。

**数据内容包括:**

字段名称	字段类型	说明
生效日期 Effective Date	C 8	股本生效日期
证券代码 Security Code	C 10	
总股本(股) Total Shares(share)	N 15	
自由流通股本(归档后)(股) Categorized Free-Float Shares(share)	N 15	证券靠档后自由流通股 本。其中 B 股证券为空。

调整后开盘参考价 Reference Open Price for Next Trading Day	N 12 (3)	调整后明日开盘参考价
保留 Reserve	C 10	保留字段

#### 4.2.8 债券期限结构数据文件

说明：包含了国债（Treasury Bond Term Structure）、金融债（Financial Bond Term Structure）、企业债（Corporate Bond Term Structure）、固定收益平台国债（Treasury Bond(SSE) Term Structure）期限结构。

文件名称：YYYYMMDD+bond\_termstructure.txt。

数据内容包括：

字段名称	字段类型	说明
日期 Date	C 8	生效日期
曲线名称 Curve Name	C 80	曲线名称
年限（年） Term（year）	N 5	
即期利率（%） Spot Rate（%）	N 10	
到期收益率（%） Yield to Maturity（%）	N 10	
远期利率（%） Forward Rate（%）	N 10	
保留 Reserve	C 10	保留字段

#### 4.2.9 债券指数收盘权重文件

说明：包含了成分券的收盘权重。

文件名称：YYYYMMDD+bond\_closeweight.txt。

数据内容包括：

字段名称	字段类型	说明
日期 Date	C 8	样本/权重生效日期
指数代码 Index Code	C 8	
沪市代码 SHH Code	C10	沪市代码
深市代码 SHZ Code	C10	深市代码
银行间代码	C 10	银行间代码



Inter-Bank Code		
成分券代码 Constituent Code	C 20	所在交易所交易代码(TICKER)"+". "+交易所编码(沪市:SHH、深市SHZ、银行间BNK)如:010107.SHH
交易货币 Trading Currency	C 3	交易所使用的币种: HKD: 港币 USD: 美元 CNY: 人民币
汇率 Exchange Rate	N 9 (4)	交易货币对指数币种汇率
权重(%) Weight(%)	N 10 (3)	该成分券在指数中所占权重
保留 Reserve	C 10	保留字段

#### 4.2.10 债券估值文件

说明: 债券估值数据。

文件名称: YYYYMMDD+bond\_valuation.txt.

数据内容包括:

字段名称	字段类型	说明
日期 Date	C 8	日期
沪市代码 SHH Code	C10	沪市代码
深市代码 SHZ Code	C10	深市代码
银行间代码 Inter-Bank Code	C 10	银行间代码
计算价格 Calculation Price	N10 (4)	计算价格
计算收益率 Yield To Maturity(%)	N10(4)	计算收益率
修正久期 Modified Duration	N10(4)	修正久期
凸性 Convexity	N10(4)	凸性
净价 Clean Price	N10(4)	净价
应计利息 Accrued Interest	N10(4)	应计利息
保留	C 10	保留字段

Reserve		
---------	--	--

#### 4.2.11 债券特殊品种估值文件

**说明：**债券特殊品种估值数据，包含违约债券估值。

**文件名称：**YYYYMMDD+specified\_bond\_valuation.txt.

**数据内容与债券估值文件相同，包括：**

字段名称	字段类型	说明
日期 Date	C 8	日期
沪市代码 SHH Code	C10	沪市代码
深市代码 SHZ Code	C10	深市代码
银行间代码 Inter-Bank Code	C 10	银行间代码
计算价格 Calculation Price	N10 (4)	计算价格
计算收益率 Yield To Maturity(%)	N10(4)	计算收益率
修正久期 Modified Duration	N10(4)	修正久期
凸性 Convexity	N10(4)	凸性
净价 Clean Price	N10(4)	净价
应计利息 Accrued Interest	N10(4)	应计利息
保留 Reserve	C 10	保留字段

### 4.3 其他文件内容说明

#### 4.3.1 中证行业分类文件

**说明：**包含了证券的中证行业分类。

**文件名称：**asharecics.txt(A股)、asiacics.txt(亚太)、globalcics.txt(全球)

**数据内容包括：**

字段名称	说明
生效日期 Effective Date	该公司行业分类开始生效日期
证券代码	所在交易所交易代码(TICKER)"+". "+交易所编码

Securities Code	( EXCHANGE CODE ) 如:600000.SHH 1.HKG
中证一级代码 CICS 1 <sup>st</sup> Level Code	行业分类一级代码
中证一级名称 CICS 1 <sup>st</sup> Level Name	行业分类一级名称
中证一级英文名称 CICS 1 <sup>st</sup> Level Name(Eng.)	行业分类一级英文名称
中证二级代码 CICS 2 <sup>nd</sup> Level Code	行业分类二级代码
中证二级名称 CICS 2 <sup>nd</sup> Level Name	行业分类二级名称
中证二级英文名称 CICS 2 <sup>nd</sup> Level Name(Eng.)	行业分类二级英文名称
中证三级代码 CICS 3 <sup>rd</sup> Level Code	行业分类三级代码
中证三级名称 CICS 3 <sup>rd</sup> Level Name	行业分类三级名称
中证三级英文名称 CICS 3 <sup>rd</sup> Level Name(Eng.)	行业分类三级英文名称
中证四级代码 CICS 4 <sup>th</sup> Level Code	行业分类四级代码
中证四级名称 CICS 4 <sup>th</sup> Level Name	行业分类四级名称
中证四级英文名称 CICS 4 <sup>th</sup> Level Name(Eng.)	行业分类四级英文名称
沪深 300 行业指数 CSI300 Sector Index	该股票所属的行业指数名称
沪深 300 行业指数英文名称 CSI300 Sector Index Name ( Eng. )	该股票所属的行业指数英文名称
保留 Reserve	保留字段

#### 4.3.2 证监会行业分类文件

**说明：**包含了证券的证监会行业分类。

**文件名称：**csrcindustry.txt

**数据内容包括：**

字段名称	说明
生效日期 Effective Date	该公司行业分类开始生效日期
证券代码	

Securities Code	
证监会行业分类代码 CSRC Industry Code	证监会行业分类代码
证监会行业分类名称 CSRC Industry Name	证监会行业分类名称
证监会行业分类英文名称 CSRC Industry Name(Eng.)	证监会行业分类英文名称
证监会行业分类代码(全) CSRC Industry Code(Full)	证监会行业分类代码(全)
证监会行业分类名称(全) CSRC Industry Name(Full)	证监会行业分类名称(全)
证监会行业分类英文名称(全) CSRC Industry Name(Full)(Eng.)	证监会行业分类英文名称(全)
保留 Reserve	保留字段

#### 4.3.3 指数基本信息文件

**说明：**包含了指数的基本信息。

**文件名称：**indexbasicinfo.txt。

**数据内容包括：**

字段名称	说明
指数代码 Index Code	
发布渠道 Distribution Channel	卫星：通过卫星/LEVEL 2 发布实时行情 指数通：通过指数公司 IndexPress 发布实时行情 数据服务平台：仅通过指数公司 FTP 数据服务平台/网站发布收盘行情 纽交所：通过纽交所发布实时行情
中文全称 Chinese Name(Full)	指数中文全称
中文简称 Chinese Name	指数中文简称
英文全称 English Name(Full)	指数英文全称
英文简称 English Name	指数英文简称
币种 Currency	指数的计价币种，包括人民币、港元、台币、美元等
互联网(数据服务)系统代码	互联网数据服务指数代码

Internet(Data service) System Code	
指数通代码 IndexPress Code	收盘指数无指数通代码
上交所行情代码 SSE Market Code	上交所行情代码(或有)
深交所行情代码 SZSE Market Code	深交所行情代码(或有)
港交所行情代码 HKSE Market Code	港交所行情代码(或有)
台交所行情代码 TWSE Market Code	台交所行情代码(或有)
其他交易所 Other Market Code	其他交易所代码(或有)
ISIN	指数 ISIN 码(或有)
SEDOL	指数 SEDOL 码(或有)
CUSIP	指数 CUSIP 码(或有)
RIC	指数 RIC 码(或有)
BLOOMBERGID	指数 BLOOMBERGID 码(或有)
基日 Base Date	指数基日
基期 Base Index	指数基日收盘点位
价格/全收益 Price/Total Return	价格、全收益指数类别
公告日期 Announcement Date	指数发布公告见报日期
发布日期 Launch Date	正式对外发布指数行情日期
指数类型 Index Type	股票、债券、基金、商品期货、组合资产等
指数归属 Index Mark	上证系列、深证系列、中证系列、中华交易系列、定制指数系列
对应主指数代码 Code Corresponding to Main Index	衍生指数有主指数代码, 本身为主指数则为空。
与主指数关系 Relationship with Mother Index	主指数、币种不同、分红规则不同、分红规则和币种都不同、税后分红、税后分红和币种不同
指数计算系统 Index Calculate System	上交所: 由上交所计算, 并通过上交所卫星/LEVEL 2 发布, 指数通转播的指数; 深交所: 由深交所计算, 并通过深交所卫星发布, 指数通转播的指数; 中证指数: 由指数公司计算, 并通过指数通发布的

	指数 纽交所：委托纽交所计算，并通过纽交所计算的指数 无实时：无实时计算的收盘指数
指数类别 Index Category	主指数、衍生指数
所属指数系统 Index Type	指数数据文件命名中的“系统归属”，用于判断在那个数据文件中可以获得该指数的数据，参见 3.2.2 指数数据文件组织命名及附录 1
样本券覆盖市场 Constituents Market	上交所、深交所、沪深、港交所、沪深港、台交所、大中华、大陆、亚太、全球、银行间、开放式基金、其他
保留 Reserve	保留字段

#### 4.3.4 指数追溯行情文件

**说明：**包含了指数发布行情前的历史行情。

**文件名称：**指数代码+ trackedbackperf.txt。

**数据内容包括：**

字段名称	字段类型	说明
日期 Date	C 8	交易日期
指数代码 Index Code	C 8	
开盘 Open	N 11 (4)	指数开盘价
最高 High	N 11 (4)	指数最高价
最低 Low	N 11 (4)	指数最低价
收盘 Close	N 11 (4)	指数收盘价
涨跌 Change	N 11 (4)	指数涨跌值
涨跌幅(%) Change(%)	N 6 (2)	指数涨跌幅
成交量 Volume	N 18	指数当日成交量 注：在股票指数中为股， 期货指数中为手，债券指 数中为万股
成交金额 Turnover	N 18	指数当日成交金额

指数市值(百万) Index Market Cap.(mn)	N 20 (2)	指数所含样本的总市值
成份券数目 Number of Cons.	N 5	指数成份券数目
市盈率 1 P/E1	N 6 (2)	指数市盈率 1= $\sum(\text{总股本} \times \text{股价}) / \sum(\text{总股本} \times \text{每股收益})$
市盈率 2 P/E2	N 6 (2)	指数市盈率 2= $\sum(\text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{股价}) / \sum(\text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{每股收益})$
股息率 1 D/P1	N 6 (2)	指数股息率 1= $\sum(\text{总股本} \times \text{年度每股现金股息}) / \sum(\text{总股本} \times \text{股价}) \times 100\%$
股息率 2 D/P2	N 6 (2)	指数股息率 2= $\sum(\text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{年度每股现金股息}) / \sum(\text{调整股本数} \times \text{权重因子} \times \text{股价}) \times 100\%$
持仓量(手) Open Interests(lots)	N 10	持仓量(仅用于期货指数)
结算金额(万元) Settlement Turnover (10 thousand RMB)	N 10	指数所有样本的结算总金额(仅用于债券指数)
修正久期 Modified Duration	N 11 (4)	指数的修正久期(仅用于债券指数)
凸性 Convexity	N 11 (4)	指数的凸性(仅用于债券指数)
到期收益率(%) Yield To Maturity(%)	N 11 (4)	指数的到期收益率(仅用于债券指数)
久期 Duration	N 11 (4)	指数的久期(仅用于债券指数)
平均价格 Average Price	N 11 (4)	指数所有样本的平均价格(仅用于债券指数)
净价指数值 Net Price	N 11 (4)	以指数所有样本券的净价来计算的净价指数值(仅用于债券指数)
利息及再投资指数值 Interest and Reinvestment Price	N 11 (4)	以指数所有样本券净价为 100 来计算的全价指数值(仅用于债券指数)
保留 Reserve	C 10	保留字段

#### 4.3.5 公告等其它文件

指数公告、指数编制方案等文件为 word、pdf 等格式。

#### 4.3.6 交易所编码及其名称对应文件

说明：包含了交易所文件编码及其对应名称。

文件名称：exchangecode.txt

数据内容包括：

字段名称	字段类型	说明
交易所编码 Exchange Code	C 3	交易所编码
交易所名称 Exchange Name	C 200	交易所名称

#### 4.3.7 行业市盈率文件

说明：包含了证券所属证监会大类、中类代码、中证四级代码及最新市盈率、市净率和股息率和各板块的市盈率、市净率和股息率。

文件名称：YYYYMMDDcsiinduspe.txt

数据内容包括：

字段名称	字段类型	说明
S1	字符型	生效日期
S2	字符型	记录类型
S3	字符型	证券代码/证监会行业代码/中证行业代码/板块代码
S4	字符型	证监会行业代码
S5	字符型	中证行业代码
S6	数字型	最新市盈率
S7	数字型	股票家数
S8	数字型	其中亏损家数
S9	数字型	最近一个月平均市盈率
S10	数字型	最近三个月平均市盈率
S11	数字型	最近六个月平均市盈率
S12	数字型	最近一年平均市盈率
S13	数字型	最新滚动市盈率
S14	数字型	股票家数
S15	数字型	其中亏损家数
S16	数字型	最近一个月平均滚动市盈率
S17	数字型	最近三个月平均滚动市盈率



S18	数字型	最近六个月平均滚动市盈率
S19	数字型	最近一年平均滚动市盈率
S20	数字型	最新市净率
S21	数字型	股票家数
S22	数字型	其中亏损家数
S23	数字型	最近一个月平均市净率
S24	数字型	最近三个月平均市净率
S25	数字型	最近六个月平均市净率
S26	数字型	最近一年平均市净率
S27	数字型	最新股息率
S28	数字型	股票家数
S29	数字型	其中未分红家数
S30	数字型	最近一个月平均股息率
S31	数字型	最近三个月平均股息率
S32	数字型	最近六个月平均股息率
S33	数字型	最近一年平均股息率

备注：

1、 字段 S2（记录类型）数据详细说明：

- a) 1： 证券市盈率记录。S3 为证券代码，S4 为证监会行业大类代码，S5 为中证行业三级代码；
- b) 2： 证监会行业市盈率记录。S3 为证监会行业代码，S4 为空，S5 为空；
- c) 3： 中证行业市盈率记录。S3 为中证行业代码，S4 为空，S5 为空。
- d) 4： 板块市盈率。S3 为板块代码，S4，S5 为空

板块代码和名称对应关系如下：

板块代码	板块名称
BK0001	上海 A 股
BK0002	深圳 A 股
BK0003	沪深 A 股
BK0004	中小板
BK0005	创业板
BK0006	深市主板

2、字段 S6、S13、S20 为空值时有如下三种情况：

- a) 当 S2=1 时，代表该证券亏损；
- b) 当 S2=2 时，代表该证监会行业内股票家数不足 5 家（剔除暂停上市和年度报告亏损后剩余的股票数量，不含 5 家）；
- c) 当 S2=3 时，代表该中证行业内股票家数不足 5 家（剔除暂停上市和年度报告亏损后剩余的股票数量，不含 5 家）。

3、字段 S27 为空时有如下情况：

- a) 当 S2=1 时，代表该证券在最近一年没有分红
- b) 当 S2=2 或者 3 时，代表该行业分类中的股票最近一年都没有分红。

## 附录一

### A 股指数 (ashare) 文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDashare\_perf.txt
- 除数文件: YYYYMMDDashare\_div.txt
- 收盘权重文件: YYYYMMDDashare\_closeweight.txt
- 次日权重文件: YYYYMMDDashare\_weightnextday.txt
- 公司事件文件: YYYYMMDDashare\_cafuture.txt
- 拟调入文件: YYYYMMDDashare\_securities\_to\_be\_included.txt
- 全部证券股本文件: YYYYMMDDashare\_securities\_share.txt

### 全球 (global) 和亚太 (asia) 指数文件列表如下 (文件名称以全球指数为例):

- 指数行情文件: YYYYMMDDglobal\_perf.txt
- 除数文件: YYYYMMDDglobal\_div.txt
- 收盘权重文件: YYYYMMDDglobal\_closeweight.txt
- 次日权重文件: YYYYMMDDglobal\_weightnextday.txt
- 公司事件文件: YYYYMMDDglobal\_cafuture.txt
- 拟调入文件: YYYYMMDDglobal\_securities\_to\_be\_included.txt

### 基金 (fund) 指数文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDfund\_perf.txt
- 收盘权重文件: YYYYMMDDfund\_closeweight.txt

### 行业估值 (sac) 指数文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDsac\_perf.txt
- 收盘权重文件: YYYYMMDDsac\_closeweight.txt

### 债券 (bond) 指数文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDbond\_perf.txt
- 收盘权重文件: YYYYMMDDbond\_closeweight.txt
- 期限结构数据文件: YYYYMMDDbond\_termstructure.txt
- 估值数据文件: YYYYMMDDbond\_valuation.txt
- 特殊品种估值数据文件: YYYYMMDDspecified\_bond\_valuation.txt
- 除数文件: YYYYMMDDbond\_div.txt
- 次日权重文件: YYYYMMDDbond\_weightnextday.txt

### 期货 (futures) 指数文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDfutures\_perf.txt

其它(others)指数文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDothers\_perf.txt

新三板(nee)指数文件列表如下:

- 指数行情文件: YYYYMMDDnee\_perf.txt
- 除数文件: YYYYMMDDnee\_div.txt
- 收盘权重文件: YYYYMMDDnee\_closeweight.txt
- 次日权重文件: YYYYMMDDnee\_weightnextday.txt
- 公司事件文件: YYYYMMDDnee\_cafuture.txt

## 附录二

成分券公司事件包括以下内容:

- 分红/Dividend
- 送股/Bonus Issues
- 配股/Rights Offering
- 分红+送股/Dividend/Bonus Issues
- 回购/Buy-Back
- 债转股/Debt to Equity Swap
- 股改/implementation of Share Merger Reform
- 超额配售/Overallotment
- 增发/Placement
- 股份限售期满/ shares to be unrestricted
- 承诺锁定（非限售转限售）/Unrestricted shares to be restricted
- 权证行权/Warrants Exercise
- 分拆/Stock split
- 并购/Mergers and Acquisitions
- 股本/价格变动/shares/prices changing

### 附录三

交易所及其编码对应表:

交易所名称	交易所编码
American Stock Exchange	ASE
Australian Stock Exchange Ltd (澳大利亚证券交易所)	ASX
Bulgarian Stock Exchange – Sofia (保加利亚索菲亚证券交易所)	BLG
TSX Venture Exchange (former Canadian Ventures Exchange)	CVE
Frankfurt Stock Exchange (法兰克福证券交易所)	FRA
Xetra	GER
HongKong Stock Exchange (香港证券交易所)	HKG
Indonesia Stock Exchange (formerly Jakarta SE) (印度尼西亚证券交易所)	JKT
Johannesburg Stock Exchange (约翰内斯堡证券交易所)	JNB
Bursa Malaysia	KLS
Korea Exchange – KOSDAQ	KOE
Korea Exchange – KSE	KSC
Kuwait Stock Exchange (科威特证券交易所)	KUW
London Stock Exchange (伦敦证券交易所)	LSE
Bolsa Mexicana de Valores S.A. de C.V.	MEX
Consolidated Issue listed on NASDAQ Capital Market	NAQ
NASDAQ Stock Exchange Capital Market	NAS
Consolidated Issue listed on NASDAQ Global Market	NMQ
NASDAQ Stock Exchange Global Market	NMS
NASDAQ Stock Exchange Global Select Market	NSM
Consolidated Issue listed on NASDAQ Global Market	NSQ
New York Consolidated	NYQ
New York Stock Exchange (纽约证券交易所)	NYS
New Zealand Stock Exchange (新西兰证券交易所)	NZC
OTC Bulletin Board Market	OBB
Osaka Securities Exchange	OSA
Euronext Paris	PAR
CONSOLIDATED ISSUE LISTED BY NYSE Arca	PCQ
Philippine Stock Exchange, Inc (菲律宾证券交易所)	PHS
OTC Markets Group Inc - Limited Information	PKL
Pink OTC Markets Inc	PNK
OTC Markets Group Inc - OTCQB	QBB
Bolsa de Valores do Estado de Sao Paulo	SAO
Singapore Exchange Securities Trading Ltd (新加坡证券交易所)	SES
The Stock Exchange of Thailand (泰国证券交易所)	SET
ShangHai Stock Exchange (上海交易所)	SHH
ShenZhen Stock Exchange (深圳交易所)	SHZ
Stuttgart Stock Exchange (斯图加特证券交易所)	STU
Taiwan Stock Exchange (台湾证券交易所)	TAI

---

The Toronto Stock Exchange (多伦多证券交易所)	TOR
Tokyo Stock Exchange (东京证券交易所)	TYO
Warsaw Stock Exchange (华沙证券交易所)	WSE
China Open-ended Funds (中国开放式基金)	LIP
Interbank Bond Market (银行间债券市场)	BNK