

上海国际能源交易中心 结算数据文件格式说明

上海国际能源交易中心

2021年08月

1. 文档属性

文件属性	内容
文件名称	上海国际能源交易中心_结算数据文件格式说明
文件编号	
文件版本号	V1.2
文件状态	正式
作者	
文档编写日期	
文档发布日期	

2. 文档变更历史清单

文件版本号	修正日期	修正人	备注
V1.0	20180710	上海期货信息技术公司	
V1.1	20210625	上海期货信息技术公司	
V1.2	20210816	上海期货信息技术公司	变更说明 15

3. 本次修改变更说明

序号	变更内容简述
1.	3.2 成交单中增加成交类型字段
2.	修改 3.8 执行宣告的字段
3.	修改 3.9 放弃执行宣告的字段
4.	修改 3.10 非交易持仓变动明细的说明及部分字段的含义
5.	删除 3.12 交割保证金明细中买卖双方交割金额字段
6.	增加 3.15 汇率文件
7.	修改附录中的数据类型和枚举值 新增：数据来源 ApplySourceType 和成交类型 TradeTypeType 修改：持仓变动 PositionChangeType 的含义
8.	删除执行宣告及放弃执行宣告 删除交割货款收付流水
9.	3.8 非交易持仓变动明细增加 sequenceno 字段，修改方向为持仓方向 3.7 抵押品明细中 MortType 改为可空，增加对于外汇充抵的部分描述
10.	修改 3.8 非交易持仓变动文件
11.	修改 3.11 合约参数中执行手续费率的数据域名
12.	修改 3.3 标准合约计算表及 3.4 标准合约结算明细表中的数据说明 修改 3.8 非交易持仓变动明细中期权执行价格字段的说明
13.	3.8 非交易持仓变动明细增加开仓成交编号 3.5 会员资金情况表增加对于交易手续费的说明
14.	3.7 修改抵押品明细文件字段 Amount 的类型，由 VolumeType 改为 MoneyType

15.	3.8 非交易持仓变动明细文件，持仓变动类型增加‘8’非套保转套保 增加 3.13 成交调整文件、TABiz 字段及其枚举值定义描述
-----	---

目 录

1.	文档范围.....	6
2.	文件格式.....	6
2.1	文件命名规范.....	6
2.2	文件格式基本约定.....	7
2.2.1	TXT 文件格式.....	7
2.2.2	DBF 文件格式.....	7
2.2.3	HTML 文件格式.....	7
2.3	文件交换方式.....	7
2.4	文件编码.....	8
3.	文件内容及定义.....	8
3.1	申报单 (Order)	8
3.1.1	数据说明.....	8
3.1.2	数据格式.....	8
3.2	成交单 (Trade)	8
3.2.1	数据说明.....	8
3.2.2	数据格式.....	8
3.3	标准合约结算表 (Settlement)	9
3.3.1	数据说明.....	9
3.3.2	数据格式.....	9
3.4	标准合约结算明细表 (SettlementDetail)	10
3.4.1	数据说明.....	10
3.4.2	数据格式.....	10
3.5	会员资金情况表 (Capital)	11
3.5.1	数据说明.....	11
3.5.2	数据格式.....	11
3.6	出入金明细 (MoneyIO)	12
3.6.1	数据说明.....	12
3.6.2	数据格式.....	12
3.7	抵押品明细 (MortgageDetail)	12
3.7.1	数据说明.....	12
3.7.2	数据格式.....	12
3.8	非交易持仓变动明细 (PositionChange)	13
3.8.1	数据说明.....	13
3.8.2	数据格式.....	14
3.9	非标准组合申报单 (CombOrder)	16
3.9.1	数据说明.....	16
3.9.2	数据格式.....	16
3.10	交割保证金明细 (DeliveryMargin)	17
3.10.1	数据说明.....	17
3.10.2	数据格式.....	17
3.11	合约结算参数 (InstrumentParam)	17
3.11.1	数据说明.....	17

3.11.2	数据格式.....	17
3.12	汇率表 (ExchangeRate)	22
3.12.1	数据说明.....	22
3.12.2	数据格式.....	22
3.13	成交调整 (TradeAdjust)	23
3.13.1	数据说明.....	23
3.13.2	数据格式.....	23
4.	附录.....	23
4.1	数据类型.....	23
4.2	枚举类型.....	24

1. 文档范围

本档用于描述上海国际能源交易中心与会员间的结算数据文件格式说明及接口定义。

上海国际能源交易中心结算数据文件内容见表 1.1:

表1.1: 文件名称与业务类型对应表

业务类型	文件名称 (中文)	文件名称 (英文)
交易报单	申报单	Order
	非标准组合申报单	CombOrder
交易成交	成交单	Trade
	成交调整	TradeAdjust
结算结果	非交易持仓变动明细	PositionChange
	标准合约结算表 (会员持仓)	Settlement
	标准合约结算明细表 (客户持仓)	SettlementDetail
会员资金	会员资金情况表	Capital
	出入金明细	MoneyIO
保证金充抵	抵押品明细	MortgageDetail
交割	交割保证金明细	DeliveryMargin
合约信息	合约结算参数	InstrumentParam
其他	汇率表	ExchangeRate

2. 文件格式

2.1 文件命名规范

上海国际能源交易中心对结算数据文件的文件名称进行统一规划,以达到从文件名称上区分不同业务文件的目的。

上海国际能源交易中心结算数据文件命名规范为: 会员代码+ “_” +资金账号+ “_” + 结算组代码+ “_” +结算日期+ “_” +文件名称 (英文)+ “_” +币种+ “.” +文件类型。各部分的具体含义说明见表 2.1:

表2.1: 文件命名规范说明

位置	说明	取值
1	会员号	会员号, 上期所目前为 4 位数字。
2	资金账号	会员资金账号
3	结算组代码	上期所目前为 00000001
4	结算日期	格式为 YYYYMMDD
5	文件名称	具体请参照表 1.1 中的文件名称 (英文)
6	币种	会员资金账号使用的币种, 引用 GB/T 12406-2008 代表

		货币和资金的代码，如：CNY—人民币元、USD—美元
7	文件类型	上期所目前暂时提供三种文件类型：TXT, DBF, HTML。其中 TXT, DBF 提供已压缩的 zip 文件下载。

2.2 文件格式基本约定

2.2.1 TXT 文件格式

TXT 格式的文件名以“.TXT”作为“后缀名”，其基本格式约定如下：

- (1) 域与域之间通过半角@符（0x40）分隔，如域内容中包含半角@符，一律替换为其转义字符 &at;
- (2) 在每一行的最后一个域之后跟一个回车换行符（0x0D, 0x0A）;
- (3) 第一行为域名，列举本文件所包含数据域的英文名称;
- (4) 第二行开始为数据内容，数据内容的顺序必需与第一行数据域的顺序保持一致;
- (5) 对于整数和浮点数类型的数据域内容，统一转换成字符串类型;
- (6) 连续两个回车换行符（0x0D, 0x0A）表示文件内容结束;

2.2.2 DBF 文件格式

DBF 格式的文件名以“.DBF”作为“后缀名”，其基本格式约定如下：

- (1) DBF 文件的记录项名称使用数据域的英文名称，字段名称上限为 10 个字符;
- (2) 对于整数和浮点数类型的数据域内容，统一转换成字符串类型;
- (3) 记录项的数据类型统一为字符型（character）;
- (4) 对于整数类型 number(n)的数据域，其对应记录项的数据长度为 n+1;
- (5) 对于浮点数类型 number(m,n)的数据域，其对应记录项的数据长度为 m+2;
- (6) 对于字符串类型 string(n)的数据域，其对应记录项的数据长度为 n;

2.2.3 HTML 文件格式

HTML 格式的文件名以“.HTM”作为“后缀名”，其基本格式约定如下：

- (1) HTML 文件以表格的形式（资金情况表列示显示）向用户清晰方便地显示业务数据。
- (2) 文件第一行为标题，包括“上海国际能源交易中心”及业务类型文件中文名称。
- (3) 第二行为空。
- (4) 第三行为基本信息，包括会员代码、会员名称、资金账号、资金账号币种、结算日期等。
- (5) 第四行开始显示具体业务信息。
- (6) 文件末尾可以增加必要的注释。

2.3 文件交换方式

上海国际能源交易中心结算数据文件可通过登录上海国际能源交易中心会员服务系统查

询并下载。

2.4 文件编码

汉字编码采用 GBK 编码，西文字符编码采用 ASCII 编码。所有英文字母使用半角模式。

3. 文件内容及定义

3.1 申报单 (Order)

3.1.1 数据说明

本文件提供当日交易报单数据。

3.1.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
OrderLocID	N	OrderIDType	本地报单编号
InstrID	N	InstrumentIDType	合约代码
Direction	N	DirectionType	买卖方向
OffsetFlag	N	OffsetFlagType	开平标志
HedgeFlag	N	HedgeFlagType	投机套保标志
OrdStatus	N	OrderStatusType	报单状态
OrderVol	N	VolumeType	报单数量
LimitPrice	N	PriceType	报单价格
Volume	N	VolumeType	成交数量
ClientID	N	ClientIDType	客户编码
OrderTime	N	TimeType	申报时间
OrderSysID	N	OrderIDType	系统编号
UserID	N	UserIDType	交易用户代码

3.2 成交单 (Trade)

3.2.1 数据说明

本文件提供当日交易成交数据。

3.2.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
ClientID	N	ClientIDType	客户编码
InstrD	N	InstrumentIDType	合约代码
TradeID	N	TradeIDType	成交编号

Volume	N	VolumeType	成交量
Price	N	PriceType	成交价
Amount	N	MoneyType	成交金额
TradeTime	N	TimeType	成交时间
Direction	N	DirectionType	买卖方向
OffsetFlag	N	OffsetFlagType	开平标志
HedgeFlag	N	HedgeFlagType	投机套保标志
TradeType	N	TradeTypeType	成交类型
OrderLocID	Y	OrderIDType	本地报单编号
UserID	Y	UserIDType	交易用户代码

3.3 标准合约结算表 (Settlement)

3.3.1 数据说明

本文件提供当日会员持仓明细数据。

期权/期货自对冲量计入当日平仓成交量（额）字段

期权执行量不计入当日期权平仓成交量（额）及期货开仓成交量（额）

持仓量不包含期权合约到期作废量，但包含期货合约到期交割量

3.3.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
InstrID	N	InstrumentIDType	合约代码
SettlPrice	N	PriceType	结算价
BOpenVol	N	VolumeType	买开成交量
BOffVol	N	VolumeType	买平成交量
BTotalVol	N	VolumeType	买成交量合计
SOpenVol	N	VolumeType	卖开成交量
SOffVol	N	VolumeType	卖平成交量
STotalVol	N	VolumeType	卖成交量合计
BOpenAmt	N	MoneyType	买开成交额
BOffAmt	N	MoneyType	买平成交额
BTotalAmt	N	MoneyType	买成交额合计
SOpenAmt	N	MoneyType	卖开成交额
SOffAmt	N	MoneyType	卖平成交额
STotalAmt	N	MoneyType	卖成交额合计
BSpecPosi	N	VolumeType	投机买持仓量
BHedgPosi	N	VolumeType	套保买持仓量
BTotalPosi	N	VolumeType	买持仓合计
SSpecPosi	N	VolumeType	投机卖持仓量
SHedgPosi	N	VolumeType	套保卖持仓量

STotalPosi	N	VolumeType	卖持仓合计
Margin	N	MoneyType	交易保证金
DueFee	N	MoneyType	应收手续费
DerateFee	N	MoneyType	减免手续费
ActualFee	N	MoneyType	实收手续费
Profit	N	MoneyType	当日盈亏

3.4 标准合约结算明细表 (SettlementDetail)

3.4.1 数据说明

本文件提供当日客户持仓明细数据。

期权/期货自对冲量计入当日平仓成交量（额）字段

期权执行量不计入当日期权平仓成交量（额）及期货开仓成交量（额）

持仓量不包含到期合约到期执行量，但包含期货合约到期交割量

3.4.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
ClientID	N	ClientIDType	客户编码
InstrID	N	InstrumentIDType	合约代码
SettlPrice	N	PriceType	结算价
BOpenVol	N	VolumeType	买开成交量
BOffVol	N	VolumeType	买平成交量
BTotalVol	N	VolumeType	买成交量合计
SOpenVol	N	VolumeType	卖开成交量
SOffVol	N	VolumeType	卖平成交量
STotalVol	N	VolumeType	卖成交量合计
BOpenAmt	N	MoneyType	买开成交额
BOffAmt	N	MoneyType	买平成交额
BTotalAmt	N	MoneyType	买成交额合计
SOpenAmt	N	MoneyType	卖开成交额
SOffAmt	N	MoneyType	卖平成交额
STotalAmt	N	MoneyType	卖成交额合计
BSpecPosi	N	VolumeType	投机买持仓量
BHedgPosi	N	VolumeType	套保买持仓量
BTotalPosi	N	VolumeType	买持仓合计
SSpecPosi	N	VolumeType	投机卖持仓量
SHedgPosi	N	VolumeType	套保卖持仓量
STotalPosi	N	VolumeType	卖持仓合计
Margin	N	MoneyType	交易保证金
Profit	N	MoneyType	当日盈亏

3.5 会员资金情况表 (Capital)

3.5.1 数据说明

本文件提供会员资金情况数据。

3.5.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
LDeposit	N	MoneyType	上一交易日实有货币资金余额
MoneyIn	N	MoneyType	当日收入资金
ActProfit	N	MoneyType	当日盈亏
Premium	N	MoneyType	当日总期权权利金
MoneyOut	N	MoneyType	当日付出资金
Fee	N	MoneyType	交易手续费 包含：期货交易手续费、期权交易手续费、期权自对冲手续费、执行手续费、期货自对冲手续费
Deposit	N	MoneyType	当日实有货币资金余额
Margin	N	MoneyType	交易保证金占用
RemainMrgn	N	MoneyType	结算准备金占用
Mortgage	N	MoneyType	权利凭证实际可用金额
UsedMortg	N	MoneyType	权利凭证实际占用
TotaMargin	N	MoneyType	总保证金（交易保证金）
SpecMargin	N	MoneyType	投机头寸保证金
HedgMargin	N	MoneyType	保值头寸保证金
DelvMargin	N	MoneyType	交割头寸保证金
Balance	N	MoneyType	当日结算准备金余额
TradeResrv	N	MoneyType	下一交易日开仓准备金
DueFee	N	MoneyType	应付交易手续费
DerateFee	N	MoneyType	减免交易手续费
DepositChg	N	MoneyType	实有货币资金变动
MarginChg	N	MoneyType	交易保证金变动
BalanceChg	N	MoneyType	结算准备金变动
MaxMortgag	N	MoneyType	最大配比金额
Deduction	N	MoneyType	权利凭证折后金额

3.6 出入金明细 (MoneyIO)

3.6.1 数据说明

本文件提供会员出入金明细数据，并且包括内转交割盈亏和内转交割手续费。

3.6.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
BillNo	N	BillNoType	单据号
FundType	N	FundTypeNameType	资金类型名称
CurrencyID	N	CurrencyIDType	币种代码
Amount	N	MoneyType	金额
FundTrnsfr	N	FundTransferType	资金划账方式
CreateDate	Y	DateType	录入日期
CfmDate	Y	DateType	到账日期

3.7 抵押品明细 (MortgageDetail)

3.7.1 数据说明

本文件提供当日所有抵押品明细信息。

3.7.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
MortgageID	N	MortgageIDType	抵押品代码 抵押品为仓单时填写商品代码，抵押品为外汇时填写币种。
MortName	N	MortgageNameType	抵押品名称
MortUnit	N	MortgageUnitType	抵押品单位 抵押品数量的计量单位 外汇质押取“1”
Collateral	N	CollateralType	抵押品类型
DutyStatus	Y	DutyStatusType	保税/完税状态 质押品为外汇时本字段为空
DueDate	Y	DateType	到期日期 质押品为外汇时本字段为空
ClientID	Y	ClientIDType	客户编码

			质押品为外汇时本字段为空
MortType	Y	MortgageType	抵押类型 质押品为外汇时本字段为空
Amount	N	MoneyType	数量
Mortgage	N	MoneyType	充抵金额
Deduction	N	MoneyType	折后金额
InstrID	Y	InstrumentIDType	合约代码 交割月仓单质押时用于指定充抵哪个合约的持仓保证金，普通质押时本字段为空，质押品为外汇时本字段为空
PosiDirect	Y	PosiDirectionType	持仓方向 交割月仓单质押时用于指定充抵合约哪个方向持仓的保证金，普通质押时本字段为空，质押品为外汇时本字段为空

3.8 非交易持仓变动明细 (PositionChange)

3.8.1 数据说明

本文件包含了除交易成交之外的所有持仓变动明细，包括以下几类：

(1) 期权执行：含期权合约执行后其持仓的减少，以及期权合约执行后相应标的期货合约持仓的增加。

(2) 期权持仓自对冲：期权执行前，根据买方发起的期权自对冲指令对期权持仓按期权结算价进行自对冲。

(3) 期货持仓自对冲：期权执行后，根据买卖双方发起的期货持仓自对冲指令对期货持仓按当日期货结算价进行自对冲。

(4) 期权持仓过期作废：所有未被执行的期权到期后自动了解持仓。

(5) 到期交割：期货合约在最后交易日因进入交割环节而减少的持仓，到期交割又分为“实物交割”和“现金交割”两种方式。需要注意的是，最后交易日的期货合约持仓仍

包含在交易所发送的持仓相关数据文件中。

- (6) 移仓：移出方持仓减少量，移入方持仓增加量。
- (7) 强减：交易所进行规则平仓后造成的持仓减少。
- (8) 非套保转套保：从非套保持仓转为套保持仓，非套保持仓减少、套保持仓增加。

3.8.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
SequenceNo	N	PosiChangeNoType	持仓变动明细序号 持仓变动类型为：期权执行、期权自对冲、期货自对冲、期权到期作废时序号为期权执行序号； 持仓变动类型为：到期交割时序号为到期交割序号； 持仓变动类型为：移仓时序号为移仓调整序号； 持仓变动类型为：强减时序号为强减序号 持仓变动类型为：非套保转套保时，序号为非套保转套保调整序号；
PositionChg	N	PositionChangeType	持仓变动类型
ClientID	N	ClientIDType	客户编码
InstrID	N	InstrumentIDType	合约代码
PosiDirect	N	PosiDirectionType	持仓方向
HedgeFlag	N	HedgeFlagType	投机套保标志
Volume	N	VolumeType	持仓变动数量 正数表示持仓增加，负数表示持仓减少
Price	Y	PriceType	价格 期权执行时，期权合约持仓减少明细中价格为当日期权合约结算价； 期权执行时标的期货合约持仓增加明细中价格为执行价； 期权自对冲价格为期权当日结算价； 期货持仓自对冲、移仓、

			非套保转套保时价格为当日结算价； 转入交割时价格为交割结算价；
DelvMode	Y	DeliveryModeType	交割方式 持仓变动类型为“5 到期交割”时填写，其余情况下值为空
TradeID	Y	TradeIDType	成交编号 持仓变动类型为：期权执行、期权自对冲、期货自对冲、强减时字段不为空，且与成交文件中成交编号不重复 其他持仓变动类型时该字段为空
OffsetFlag	Y	OffsetFlagType	开平标志：不区分平今、平昨 0—开仓 1—平仓 持仓变动类型为：期权执行、期权自对冲、期货自对冲、强减时字段不为空；持仓变动明细为其他类型时该字段为空
Amount	Y	MoneyType	期货成交金额
StrikePrice	Y	MoneyType	行权价
TradeTime	N	TimeType	成交时间 统一填写 15:00:00
OpenTradeID	Y	TradeIDType	原开仓成交编号 持仓变动类型为：期货自对冲，且为正向平仓记录时显示其原开仓成交编号； 持仓变动类型为：期货自对冲，且为反向平仓记录时该字段为空； 其他持仓变动类型时该字段为空；

3.9 非标准组合申报单 (CombOrder)

3.9.1 数据说明

本文件提供当日非标准组合交易报单数据。

3.9.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
OrderLocID	N	OrderIDType	本地报单编号
InstrID1	N	InstrumentIDType	合约代码 1
Direction1	N	DirectionType	买卖方向 1
OffsetFlg1	N	OffsetFlagType	开平标志 1
HedgeFlg1	N	HedgeFlagType	投机套保标志 1
OrdStatus1	N	OrderStatusType	报单状态 1
InstrID2	N	InstrumentIDType	合约代码 2
Direction2	N	DirectionType	买卖方向 2
OffsetFlg2	N	OffsetFlagType	开平标志 2
HedgeFlg2	N	HedgeFlagType	投机套保标志 2
OrdStatus2	N	OrderStatusType	报单状态 2
InstrID3	N	InstrumentIDType	合约代码 3
Direction3	N	DirectionType	买卖方向 3
OffsetFlg3	N	OffsetFlagType	开平标志 3
HedgeFlg3	N	HedgeFlagType	投机套保标志 3
OrdStatus3	N	OrderStatusType	报单状态 3
InstrID4	N	InstrumentIDType	合约代码 4
Direction4	N	DirectionType	买卖方向 4
OffsetFlg4	N	OffsetFlagType	开平标志 4
HedgeFlg4	N	HedgeFlagType	投机套保标志 4
OrdStatus4	N	OrderStatusType	报单状态 4
OrderVol	N	VolumeType	报单数量
LimitPrice	N	PriceType	报单价格
Volume	N	VolumeType	成交数量
ClientID	N	ClientIDType	客户编码
OrderTime	N	TimeType	申报时间
OrdSysID	N	OrderIDType	系统编号
UserID	N	UserIDType	交易用户代码

3.10 交割保证金明细 (DeliveryMargin)

3.10.1 数据说明

本文件对当日的交割保证金收取情况进行说明。

3.10.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
InstrID	N	InstrumentIDType	合约代码
DelvType	N	DeliveryType	交割类型
DelvDate	N	DateType	交割日期 交割类型为期转现时填写期转现日，交割类型为到期交割时填写合约最后交易日
BDelvVolume	N	VolumeType	买方交割量
ILDelvMrgn	N	MoneyType	初始买方交割保证金
PDelvPayNm	N	VolumeType	已支付交割货款数量
LDelvMrgn	N	MoneyType	买方交割保证金
SDelvVolume	N	VolumeType	卖方交割量
ISDelvMrgn	N	MoneyType	初始卖方交割保证金
WarrantNum	N	VolumeType	已提交仓单数量
SDelvMrgn	N	MoneyType	当日卖方交割保证金
IVATMrgn	N	MoneyType	初始增值税发票保证金
VATInvNum	N	VolumeType	已提交增值税发票数量
SVATMrgn	N	MoneyType	当日卖方增值税发票保证金

3.11 合约结算参数 (InstrumentParam)

3.11.1 数据说明

本文件提供当日合约结算参数信息。

3.11.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
InstrID	N	InstrumentIDType	合约代码
ProductID	N	ProductIDType	产品代码
UdlyInstID	N	InstrumentIDType	合约标的物

VolMultipl	N	VolumeMultipleType	合约数量乘数
OptType	N	OptionType	期权类型
SettlPrice	N	PriceType	结算价
BrSpLMrgnR	N	RateType	代理投机多头保证金率
BrSpSMrgnR	N	RateType	代理投机空头保证金率
BrHdLMrgnR	N	RateType	代理套保多头保证金率
BrHdSMrgnR	N	RateType	代理套保空头保证金率
HoSpLMrgnR	N	RateType	自营投机多头保证金率
HoSpSMrgnR	N	RateType	自营投机空头保证金率
HoHdLMrgnR	N	RateType	自营套保多头保证金率
HoHdSMrgnR	N	RateType	自营套保空头保证金率
MmSpLMrgnR	N	RateType	做市商投机多头保证金率
MmSpSMrgnR	N	RateType	做市商投机空头保证金率
MmHdLMrgnR	N	RateType	做市商套保多头保证金率
MmHdSMrgnR	N	RateType	做市商套保空头保证金率
BrSLDMrgnR	N	RateType	代理投机多头交割保证金率
BrSSDMrgnR	N	RateType	代理投机空头交割保证金率
BrHLDMrgnR	N	RateType	代理套保多头交割保证金率
BrHSDMrgnR	N	RateType	代理套保空头交割保证金率
HoSLDMrgnR	N	RateType	自营投机多头交割保证金率
HoSSDMrgnR	N	RateType	自营投机空头交割保证金率
HoHLDMrgnR	N	RateType	自营套保多头交割保证金率
HoHSDMrgnR	N	RateType	自营套保空头交割保证金率

MmSLDMrgnR	N	RateType	做市商投机多头交割保证金率
MmSSDMrgnR	N	RateType	做市商投机空头交割保证金率
MmHLDMrgnR	N	RateType	做市商套保多头交割保证金率
MmHSDMrgnR	N	RateType	做市商套保空头交割保证金率
VATInMrgnR	N	RateType	增值税发票保证金率
BrSpLFeeR	N	RateType	代理投机多头交易手续费率
BrSpLFeeU	N	PriceType	代理投机多头交易手续费单价
BrSpSFeeR	N	RateType	代理投机空头交易手续费率
BrSpSFeeU	N	PriceType	代理投机空头交易手续费单价
BrHdLFeeR	N	RateType	代理套保多头交易手续费率
BrHdLFeeU	N	PriceType	代理套保多头交易手续费单价
BrHdSFeeR	N	RateType	代理套保空头交易手续费率
BrHdSFeeU	N	PriceType	代理套保空头交易手续费单价
HoSpLFeeR	N	RateType	自营投机多头交易手续费率
HoSpLFeeU	N	PriceType	自营投机多头交易手续费单价
HoSpSFeeR	N	RateType	自营投机空头交易手续费率
HoSpSFeeU	N	PriceType	自营投机空头交易手续费单价
HoHdLFeeR	N	RateType	自营套保多头交易手续费率
HoHdLFeeU	N	PriceType	自营套保多头交易手续费单价
HoHdSFeeR	N	RateType	自营套保空头交易手续费率
HoHdSFeeU	N	PriceType	自营套保空头交易手续费单价
MmSpLFeeR	N	RateType	做市商投机多头交易手续费率

MmSpLFeeU	N	PriceType	做市商投机多头交易手续费单价
MmSpSFeeR	N	RateType	做市商投机空头交易手续费率
MmSpSFeeU	N	PriceType	做市商投机空头交易手续费单价
MmHdLFeeR	N	RateType	做市商套保多头交易手续费率
MmHdLFeeU	N	PriceType	做市商套保多头交易手续费单价
MmHdSFeeR	N	RateType	做市商套保空头交易手续费率
MmHdSFeeU	N	PriceType	做市商套保空头交易手续费单价
BrSpLCFeeR	N	RateType	代理投机多头平今手续费率
BrSpLCFeeU	N	PriceType	代理投机多头平今手续费单价
BrSpSCFeeR	N	RateType	代理投机空头平今手续费率
BrSpSCFeeU	N	PriceType	代理投机空头平今手续费单价
BrHdLCFeeR	N	RateType	代理套保多头平今手续费率
BrHdLCFeeU	N	PriceType	代理套保多头平今手续费单价
BrHdSCFeeR	N	RateType	代理套保空头平今手续费率
BrHdSCFeeU	N	PriceType	代理套保空头平今手续费单价
HoSpLCFeeR	N	RateType	自营投机多头平今手续费率
HoSpLCFeeU	N	PriceType	自营投机多头平今手续费单价
HoSpSCFeeR	N	RateType	自营投机空头平今手续费率
HoSpSCFeeU	N	PriceType	自营投机空头平今手续费单价
HoHdLCFeeR	N	RateType	自营套保多头平今手续费率
HoHdLCFeeU	N	PriceType	自营套保多头平今手续费单价
HoHdSCFeeR	N	RateType	自营套保空头平今手续费率

HoHdSCFeeU	N	PriceType	自营套保空头平今 手续费单价
MmSpLCFeeR	N	RateType	做市商投机多头平 今手续费率
MmSpLCFeeU	N	PriceType	做市商投机多头平 今手续费单价
MmSpSCFeeR	N	RateType	做市商投机空头平 今手续费率
MmSpSCFeeU	N	PriceType	做市商投机空头平 今手续费单价
MmHdLCFeeR	N	RateType	做市商套保多头平 今手续费率
MmHdLCFeeU	N	PriceType	做市商套保多头平 今手续费单价
MmHdSCFeeR	N	RateType	做市商套保空头平 今手续费率
MmHdSCFeeU	N	PriceType	做市商套保空头平 今手续费单价
BrSpDFeeR	N	RateType	代理投机交割手 续费率
BrSpDFeeU	N	PriceType	代理投机交割手 续费单价
BrHdDFeeR	N	RateType	代理套保交割手 续费率
BrHdDFeeU	N	PriceType	代理套保交割手 续费单价
HoSpDFeeR	N	RateType	自营投机交割手 续费率
HoSpDFeeU	N	PriceType	自营投机交割手 续费单价
HoHdDFeeR	N	RateType	自营套保交割手 续费率
HoHdDFeeU	N	PriceType	自营套保交割手 续费单价
MmSpDFeeR	N	RateType	做市商投机交割手 续费率
MmSpDFeeU	N	PriceType	做市商投机交割手 续费单价
MmHdDFeeR	N	RateType	做市商套保交割手 续费率
MmHdDFeeU	N	PriceType	做市商套保交割手 续费单价
BrSpSSFeeR	N	RateType	代理投机执行手 续费率

BrSpSSFeeU	N	PriceType	代理投机执行手续费单价
BrHdSSFeeR	N	RateType	代理套保执行手续费率
BrHdSSFeeU	N	PriceType	代理套保执行手续费单价
HoSpSSFeeR	N	RateType	自营投机执行手续费率
HoSpSSFeeU	N	PriceType	自营投机执行手续费单价
HoHdSSFeeR	N	RateType	自营套保执行手续费率
HoHdSSFeeU	N	PriceType	自营套保执行手续费单价
MmSpSSFeeR	N	RateType	做市商投机执行手续费率
MmSpSSFeeU	N	PriceType	做市商投机执行手续费单价
MmHdSSFeeR	N	RateType	做市商套保执行手续费率
MmHdSSFeeU	N	PriceType	做市商套保执行手续费单价
Delta	Y	RateType	虚实度
Volatitiy	Y	RateType	隐含波动率
AtTheMoney	Y	AtTheMoneyType	平值期权标志
MinMargin	Y	MoneyType	最小保证金

3.12 汇率表 (ExchangeRate)

3.12.1 数据说明

本文件提供当日结算使用汇率

3.12.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
ReleaseDate	N	DateType	单据号
CurrencyId	N	CurrencyIdType	币种
Unit	N	VolumeType	单位
ExchangeRat	N	RateType	汇率

3.13 成交调整 (TradeAdjust)

3.13.1 数据说明

本文件提供当日结算时调整的交易成交数据，包括以下几类：

(1) TAS 价格确定：按照 TAS 业务规则，确定 TAS 指令交易成交的价格，TAS 成交中的其它字段数据不变。

3.13.2 数据格式

数据域名	是否允许为空	数据类型	内容说明
TABiz	N	TABizType	成交调整业务类型
ClientID	N	ClientIDType	客户编码
InstrD	N	InstrumentIDType	合约代码
TradeID	N	TradeIDType	成交编号，左边空格转为 0
Volume	N	VolumeType	成交量
Price	N	PriceType	成交价
Direction	N	DirectionType	买卖方向
OffsetFlag	N	OffsetFlagType	开平标志
HedgeFlag	N	HedgeFlagType	投机套保标志

4. 附录

4.1 数据类型

结算数据文件中用到的数据类型见表 4.1。

表 4.1：数据类型

数据类型名	基本数据类型	数据类型说明
EnumType	string(1)	枚举值类型
OrderIDType	string(12)	本地报单编号/系统报单编号
TradeIDType	string(12)	成交编号
ProductIDType	string(8)	品种代码
InstrumentIDType	string(30)	合约代码类型
DateType	string(8)	日期类型
TimeType	string(8)	时间类型
VolumeType	number(10)	数量类型
PriceType	number(12,2)	价格类型
RateType	number(17,8)	比率类型
DirectionType	string(1)	买卖方向类型
PosiDirectionType	string(1)	持仓方向类型

OffsetFlagType	string(1)	开平标示类型
HedgeFlagType	string(1)	投机套保标志类型
OrderStatusType	string(1)	报单状态类型
RsvPosiFlgType	string(1)	期权行权后是否保留期货头寸的标记
CloseFlagType	string(1)	期权行权后生成的头寸是否自动平仓类型
UserIDType	string(15)	交易用户代码
MoneyType	number(19,2)	资金类型
AccountIDType	string(12)	资金账号类型
ClientIDType	string(10)	客户编码类型
DutyStatusType	string(1)	保税/完税状态
BillNoType	string(14)	单据号
FundTypeNameType	string(50)	资金类型名称
FundTransferType	string(1)	资金转账类型
MortgageIDType	string(8)	抵押品代码
MortgageNameType	string(50)	抵押品名称
MortgageUnitType	string(10)	抵押品单位
CollateralType	string(1)	抵押品类型
MortgageType	string(1)	抵押类型
ExecResultType	string(1)	期权执行结果
PositionChangeType	string(1)	持仓变动类型
DeliverySheetNoType	string(10)	交割结算单编号
DeliveryType	string(1)	交割类型
DeliverySheetStatusType	string(1)	交割结算单状态
DeliveryModeType	string(1)	交割方式类型
VolumeMultipleType	number(5)	合约数量乘数类型
OptionType	string(1)	期权类型
AtTheMoneyType	string(1)	是否平值期权
CurrencyIDType	string(3)	币种代码类型，参照 GB/T 12406-2008
ApplySourceType	String(1)	申请来源
TradeTypeType	String(1)	成交类型
PosiChangeNoType	number(20)	非交易持仓变动明细序号类型

4.2 枚举类型

结算数据文件中用到的枚举类型见表 4.2:

表 4.2: 枚举类型

枚举描述	枚举名称	数据类型名	编码数值与描述
买卖方向	direction	DirectionType	0—买

			1-卖
持仓方向	posidirection	PosiDirectionType	1-多头和空头 2-多头 3-空头
开平标示	offsetflag	OffsetFlagType	0-开仓 1-平仓 2-强平 3-平今 4-平昨
投机套保标志	hedgeflag	HedgeFlagType	1-非套保 3-套保
报单状态	orderstatus	OrderStatusType	o-有效报单 c-全部成交 p-部分成交 t-删除
期权行权后是否保留期货头寸的标记	rsvposiflg	RsvPosiFlgType	1-是 0-否
期权行权后生成的头寸是否自动平仓类型	closeflag	CloseFlagType	1-是 0-否
保税/完税状态	dutystatus	DutyStatusType	0-完税 1-保税
资金转账类型	fundtransfertype	FundTransferType	1-内转 2-银行划转
抵押品类型	collateraltype	CollateralType	1-标准仓单 2-外汇
抵押类型	mortgagetype	MortgageType	0-普通质押 2-交割月仓单质押
交割类型	deliverytype	DeliveryType	2-期转现 3-到期交割
交割结算单状态	deliverysheetstatus	DeliverySheetStatusType	1-正常 2-撤销
期权执行结果	execresult	ExecResultType	n-没有执行 c-已经取消
持仓变动类型	positionchange	PositionChangeType	1-期权持仓自对冲 2-期权执行 3-期货持仓自对冲 4-期权持仓过期作废 5-到期交割 6-移仓

			7-强减
交割方式	dlvmode	DeliveryModeType	1-现金交割 2-实物交割
期权类型	optiontype	OptionType	0-非期权 1-看涨期权 2-看跌期权
平值期权标志	atthemoney	AtTheMoneyType	1-平值期权 0-非平值期权
合约状态	inststatus	InstrumentStatusType	0-未上市 1-上市 2-停牌
交易角色	tradrole	TradingRoleType	1-代理 2-自营 3-做市商
申请来源	applysource	ApplySourceType	1-交易系统 2-会员服务系统
成交类型	tradetype	TradeTypeType	0-普通成交 2-OTC 成交 3-期转现衍生成交
币种代码	currency	CurrencyIDType	引用 GB/T 12406-2008 代表货币和资金的代码, 如: CNY-人民币元 USD-美元 EUR-欧元
成交调整业务类型	TABiz	TABizType	1-TAS 价格确定