

# 新高频数据说明书

版权所有 侵权必究

发布日期：2019 年 3 月

## 目录

库表结构 .....	1
一、上海证券交易所 .....	3
L1 .....	3
分笔 （SEL1_TAQ_YYYYMM） .....	3
分时 （SEL1_TRDMIN_YYYYMM） .....	5
L2 .....	7
集合竞价 （SEL2_VIRTUALAUCTION_YYYYMM） .....	7
十档行情 （SEL2_TAQ_YYYYMM） .....	8
委托队列 （SEL2_ORDERQUEUE_YYYYMM） .....	11
指数行情 （SEL2_INDEX_YYYYMM） .....	14
逐笔成交 （SEL2_TRANSACTION_YYYYMM） .....	15
静态数据 （SEL2_BASICINFO_YYYYMM） .....	16
个股期权 L2.....	18
分笔 （SHSOL1_TAQ_YYYYMM） .....	18
分时 （SHSOL1_TRDMIN_YYYYMM） .....	22
静态数据 （SHSOL1_BASICINFO_YYYYMM） .....	24
二、深圳证券交易所 .....	27
L1 .....	27
分笔 （SEL1_TAQ_YYYYMM） .....	27
分时 （SEL1_TRDMIN_YYYYMM） .....	30
公告及增值信息 （SZL1_BULLETIN_ YYYYMM） .....	32

L2 .....	32
十档行情（SZL2_TAQ_YYYYMM） .....	32
委托队列（SZL2_ORDERQUEUE_YYYYMM） .....	35
指数行情（SZL2_INDEX_YYYYMM） .....	38
逐笔委托（SZL2_ORDER_YYYYMM） .....	39
逐笔成交（SZL2_TRADE_YYYYMM） .....	40
静态数据（SZL2_STOCKINFO_YYYYMM） .....	41
证券状态（SZL2_STOCKSTATUS_YYYYMM） .....	44
三、中金所 .....	46
股指期货 L2.....	46
分笔（FFL2_TAQ_YYYYMM） .....	46
分时（FFL2_TRDMIN_YYYYMM） .....	48
国债期货 L2.....	50
分笔（TFL2_TAQ_YYYYMM） .....	50
分时（TFL2_TRDMIN_YYYYMM） .....	53
四、大商所 .....	54
大商所商品期货 L1 .....	54
分笔（MFL1_TAQ_YYYYMM） .....	54
分时（MFL1_TRDMIN_YYYYMM） .....	58
套利行情（MFL1_ARBI_YYYYMM） .....	59
大商所商品期货 L2.....	61
分笔（MFL2_TAQ_YYYYMM） .....	61

---

委托统计行情 (MFL2_ORERSTATISTIC_YYYYMM) .....	64
实时结算行情 (MFL2_REALTIMEPRICE_YYYYMM) .....	65
分价成交量行情 (MFL2_MARCHPRICEQTY_YYYYMM) .....	66
套利深度行情 (MFL2_ARBI_YYYYMM) .....	68
大商所商品期权 L1.....	71
分笔 (COL1_TAQ_YYYYMM) .....	71
分时 (COL1_TRDMIN_YYYYMM) .....	75
大商所商品期权 L2.....	77
分笔 (COL2_TAQ_YYYYMM) .....	77
委托统计行情 (COL2_ORERSTATISTIC_YYYYMM) .....	81
实时结算行情 (COL2_REALTIMEPRICE_YYYYMM) .....	82
分价成交量行情 (COL2_MARCHPRICEQTY_YYYYMM) .....	82
五、郑商所.....	85
郑商所商品期货 L1.....	85
分笔 (MFL1_TAQ_YYYYMM) .....	85
分时 (MFL1_TRDMIN_YYYYMM) .....	88
郑商所商品期权 L1.....	90
分笔 (COL1_TAQ_YYYYMM) .....	90
分时 (COL1_TRDMIN_YYYYMM) .....	93
六、上期所&上期能源.....	95
上期所&上期能源的商品期货 L1 .....	95
分笔 (MFL1_TAQ_YYYYMM) .....	95

分时（MFL1_TRDMIN_YYYYMM） .....	98
上期所商品期权 L1 .....	99
分笔（COL1_TAQ_YYYYMM） .....	99
分时（COL1_TRDMIN_YYYYMM） .....	103

## 库表结构

交易所	市场及深度	数据类型	数据库名	数据库里的表名	最高推送频率	历史数据时间区间
上海证券交易所	上海 L1	分笔	SEL1_TAQ_YYYYMM	SHL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2003.01~
		分时	SEL1_TRDMIN_YYYYMM	SHL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2003.01~
	上海 L2	集合竞价	SEL2_VIRTUALAUCTION_YYYYMM	SHL2_VIRTUALAUCTION_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2006.12~2018.12.21
		十档行情	SEL2_TAQ_YYYYMM	SHL2_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2006.12~
		委托队列	SEL2_ORDERQUEUE_YYYYMM	SHL2_ORDERQUEUE_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2006.12~
		指数行情	SEL2_INDEX_YYYYMM	SHL2_INDEX_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2006.12~
		逐笔成交	SEL2_TRANSACTION_YYYYMM	SHL2_TRANSACTION_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2006.12~
		静态数据	SEL2_BASICINFO_YYYYMM	SHL2_BASICINFO_ALL_YYYYMM	日频	2017.07~
	个股期权 L2	分笔	SHSOL1_TAQ_YYYYMM	SHSOL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2014.12~
		分时	SHSOL1_TRDMIN_YYYYMM	SHSOL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2014.12~
		静态数据	SHSOL1_BASICINFO_YYYYMM	SHSOL1_BASICINFO_ALL_YYYYMM	日频	2014.09~
深圳证券交易所	深圳 L1	分笔	SEL1_TAQ_YYYYMM	SZL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2003.01~
		分时	SEL1_TRDMIN_YYYYMM	SZL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2003.01~
		公告及增值信息	SZL1_BULLETIN_YYYYMM	SZL1_BULLETIN_ALL_YYYYMM	日频	2012.10~
	深圳 L2	十档行情	SZL2_TAQ_YYYYMM	SZL2_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2010.05~
		委托队列	SZL2_ORDERQUEUE_YYYYMM	SZL2_ORDERQUEUE_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2010.05~
		指数行情	SZL2_INDEX_YYYYMM	SZL2_INDEX_SYMBOL_YYYYMM	3 秒/次	2010.01~
		逐笔委托	SZL2_ORDER_YYYYMM	SZL2_ORDER_SYMBOL_YYYYMM	实时	2012.10~
		逐笔成交	SZL2_TRADE_YYYYMM	SZL2_TRADE_SYMBOL_YYYYMM	实时	2010.01~
		静态数据	SZL2_STOCKINFO_YYYYMM	SZL2_STOCKINFO_ALL_YYYYMM	日频	2012.10~
		证券状态	SZL2_STOCKSTATUS_YYYYMM	SZL2_STOCKSTATUS_ALL_YYYYMM	日频	2012.10~
中金所	股指期货 L2	分笔	FFL2_TAQ_YYYYMM	FFL2_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2010.04~
		分时	FFL2_TRDMIN_YYYYMM	FFL2_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2010.04~
	国债期货 L2	分笔	TFL2_TAQ_YYYYMM	TFL2_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2013.09~
		分时	TFL2_TRDMIN_YYYYMM	TFL2_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2013.09~
大	商品期货	分笔	MFL1_TAQ_YYYYMM	MFL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2003.08~

# 新高频数据说明书

商 所	L1	分时	MFL1_TRDMIN_YYYYMM	MFL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2003.08~
		套利行情	MFL1_ARBI_YYYYMM	MFL1_ARBI_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2014.03~
	商品期货 L2	分笔	MFL2_TAQ_YYYYMM	MFL2_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2007.01~
		委托统计行情	MFL2_ORERSTATISTIC_YYYYMM	MFL2_ORERSTATISTIC_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2007.01~
		实时结算行情	MFL2_REALTIMEPRICE_YYYYMM	MFL2_REALTIMEPRICE_SYMBOL_YYYYMM	6 秒/次	2007.01~
		分价成交量行情	MFL2_MARCHPRICEQTY_YYYYMM	MFL2_MARCHPRICEQTY_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2007.01~
		套利深度行情	MFL2_ARBI_YYYYMM	MFL2_ARBI_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2007.06~
	商品期权 L1	分笔	COL1_TAQ_YYYYMM	COL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2017.03~
		分时	COL1_TRDMIN_YYYYMM	COL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2017.03~
	商品期权 L2	分笔	COL2_TAQ_YYYYMM	COL2_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2017.03~
		委托统计行情	COL2_ORERSTATISTIC_YYYYMM	COL2_ORERSTATISTIC_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2017.03~
		实时结算行情	COL2_REALTIMEPRICE_YYYYMM	COL2_REALTIMEPRICE_SYMBOL_YYYYMM	6 秒/次	2017.03~
分价成交量行情		COL2_MARCHPRICEQTY_YYYYMM	COL2_MARCHPRICEQTY_SYMBOL_YYYYMM	0.25 秒/次	2017.03~	

郑 商 所	商品期货 L1	分笔	MFL1_TAQ_YYYYMM	MFL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2003.08~
		分时	MFL1_TRDMIN_YYYYMM	MFL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2003.08~
	商品期权 L1	分笔	COL1_TAQ_YYYYMM	COL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2017.04~
		分时	COL1_TRDMIN_YYYYMM	COL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2017.04~

上 期 所	商品期货 L1	分笔	MFL1_TAQ_YYYYMM	MFL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2003.08~
		分时	MFL1_TRDMIN_YYYYMM	MFL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2003.08~
	商品期权 L1	分笔	COL1_TAQ_YYYYMM	COL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2018.10~
		分时	COL1_TRDMIN_YYYYMM	COL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2018.10~

上 期 能 源	商品期货 L1	分笔	MFL1_TAQ_YYYYMM	MFL1_TAQ_SYMBOL_YYYYMM	0.5 秒/次	2018.04~
		分时	MFL1_TRDMIN_YYYYMM	MFL1_TRDMINFreq_YYYYMM	1 分钟	2018.04~

# 一、上海证券交易所

L1

## 分笔（SEL1\_TAQ\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码，包含股票、基金、债券、权证、指数。	Y
2	ShortName	证券简称	nvarchar(20)	交易所公布的各类证券品种的简称，包含股票、基金、债券、权证、指数等	Y
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	H
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-ddhh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成	H
5	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	上一交易日的收盘价（如有除权除息，前复权之后的收盘价）	Y
6	OpenPrice	今开盘价	decimal(9,3)	该证券在当日的开盘价	Y
7	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)	当前最新成交价格	Y
8	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
9	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交金额	Y
10	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交量	N
11	TradeAmount	分笔期间成交金额	decimal(19,3)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交金额	N
12	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
13	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
14	PriceChange01	价格升降 1	decimal(9,3)	最新成交价相对于昨收盘价的升降	N
15	PriceChange02	价格升降 2	decimal(9,3)	本分笔的最新成交价相对于上一分笔记录的最新成交价的升降	N
16	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交,S:卖方主动成交;N:无法判断	N



# 新高频数据说明书

17	SellPrice05	卖价五	decimal(9,3)	第 5 档委托卖出价, 高于第 4 档委托卖出价	Y
18	SellPrice04	卖价四	decimal(9,3)	第 4 档委托卖出价, 高于第 3 档委托卖出价	Y
19	SellPrice03	卖价三	decimal(9,3)	第 3 档委托卖出价, 高于第 2 档委托卖出价	Y
20	SellPrice02	卖价二	decimal(9,3)	第 2 档委托卖出价, 高于第 1 档委托卖出价	Y
21	SellPrice01	卖价一	decimal(9,3)	第 1 档委托卖出价	Y
22	BuyPrice01	买价一	decimal(9,3)	第 1 档委托买入价	Y
23	BuyPrice02	买价二	decimal(9,3)	第 2 档委托买入价, 低于第 1 档委托买入价	Y
24	BuyPrice03	买价三	decimal(9,3)	第 3 档委托买入价, 低于第 2 档委托买入价	Y
25	BuyPrice04	买价四	decimal(9,3)	第 4 档委托买入价, 低于第 3 档委托买入价	Y
26	BuyPrice05	买价五	decimal(9,3)	第 5 档委托买入价, 低于第 4 档委托买入价	Y
27	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	以第 5 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
28	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	以第 4 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
29	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	以第 3 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
30	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	以第 2 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
31	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以第 1 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
32	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以第 1 档委托买入价委托买入的数量	Y
33	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	以第 2 档委托买入价委托买入的数量	Y
34	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	以第 3 档委托买入价委托买入的数量	Y
35	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	以第 4 档委托买入价委托买入的数量	Y
36	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	以第 5 档委托买入价委托买入的数量	Y
37	BuyRatio	买比	decimal(9,4)	外盘/成交总量, 主动性买盘占成交总量的比例	N
38	Spread	买卖价差	decimal(9,3)	当前时刻上,最低委托卖价与最高的委托买价之差; 即卖一价-买一价	N
39	RelativeSpread	相对价差	decimal(9,4)	当前时刻上, 最低委托卖价与最高的委托买价之差相对值(卖一价-买一价)/(卖一价+买一价)	N
40	Depth01	报价深度 1	decimal(19,3)	买卖一档价量乘积之和/2, 具体计算公式: $(\text{SellPrice01} * \text{SellVolume01} + \text{BuyPrice01} * \text{BuyVolume01})/2$	N
41	Depth02	报价深度 2	decimal(19,3)	买卖五档价量乘积之和/2, 具体计算公式: $\frac{\sum_{i=1}^5 (\text{SellPrice}_i * \text{SellVolume}_i + \text{BuyPrice}_i * \text{BuyVolume}_i)}{2}$	N
42	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
43	Market	市场	varchar(5)	SSE 表示上海市场	N
44	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
45	ClosePrice	今收盘价	decimal(9,3)	该证券在此交易日的收盘价	Y
46	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	最新成交价 LastPrice 相对于昨收盘价 PreClosePrice 的升跌幅度, 计算公式: $\frac{\text{LastPrice} - \text{PreClosePrice}}{\text{PreClosePrice}}$	N
47	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨收盘价(PreClosePrice)	N

48	AveragePrice	均价	decimal(9,3)	成交总额/成交总量，没有成交则显示昨收盘价	N
49	TurnoverRate	换手率	decimal(9,4)	在一定时间内市场中股票转手买卖的频率，是反映股票流通性强弱的指标之一	N
50	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标，计算公式： 当日分钟均量（当前成交总量/当前交易分钟数）/前5天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数，例如出现 09:31:01 就按两分钟算；09:30:00 按一分钟算。	N
51	OrderRate	委比	decimal(9,4)	公式：(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
52	Circulation MarketValue	流通市值	decimal(19,3)	某特定时间内当时可交易的流通股股数乘以当时股价得出的流通股总价值	N
53	TotalMarketVAL	总市值	decimal(19,3)	某特定时间内总股本数乘以当时股价得出的股票总价值	N
54	PE1	市盈率	decimal(9,4)	某种股票每股市价与每股盈利的比率	N
55	PB	市净率	decimal(9,4)	price/ book value, 每股股价与每股净资产的比率	N
56	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	委买总量-委卖总量；委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
57	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交	N
58	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
59	Premium	溢价	decimal(9,4)	基金现价与基金净值之差	N
60	PremiumRate	溢价率	decimal(9,4)	基金溢价与基金净值之比	N

## 分时（SEL1\_TRDMIN\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码，包含股票、基金、债券、权证、指数。
2	ShortName	证券简称	Nvarchar(20)	例如：浦发银行
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd，例如：20141120

## 新高频数据说明书

4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
5	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
6	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
9	Volume	分时段内成交量	decimal(19,2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
10	Amount	分时段内成交金额	decimal(19,3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
11	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
12	Market	市场	varchar(5)	SSE, 表示上海
13	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识
14	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	股票、基金、债券、指数取昨收盘价, 上市首日为发行价 (昨收盘价等于发行价)
15	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
16	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
17	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时段区间内的末条成交记录的成交总量
18	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数; 股票、基金合约乘数取 1; 债券、指数不算该字段, 填充 0
19	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
20	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
21	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数; 股票、基金合约乘数取 1; 债券、指数不算该字段, 填充 0。
22	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价一, 档位不够的填充 0
23	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价二, 档位不够的填充 0
24	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价三, 档位不够的填充 0
25	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价四, 档位不够的填充 0
26	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价五, 档位不够的填充 0
27	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价一, 档位不够的填充 0
28	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价二, 档位不够的填充 0
29	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价三, 档位不够的填充 0
30	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价四, 档位不够的填充 0
31	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价五, 档位不够的填充 0
32	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量一, 档位不够的填充 0
33	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量二, 档位不够的填充 0
34	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量三, 档位不够的填充 0
35	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量四, 档位不够的填充 0
36	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量五, 档位不够的填充 0
37	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量一, 档位不够的填充 0
38	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量二, 档位不够的填充 0
39	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量三, 档位不够的填充 0

40	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量四, 档位不够的填充 0
41	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量五, 档位不够的填充 0

## L2

## 集合竞价 (SEL2\_VIRTUALAUCTION\_YYYYMM)

说明: 自 2018.12.22 开始, 上交所 L2 的集合竞价消息类型停止下发数据, 集合竞价数据转到十档行情中下发。

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
4	AuctionOpenPrice	虚拟开盘参考价格	decimal(9,3)	特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格	Y
5	AuctionVolume	虚拟匹配量	decimal(19,2)	特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Y
6	LeaveVolume	虚拟未匹配量	decimal(19,2)	特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方或卖方剩余申报数量	Y
7	Side	买卖方向	varchar(1)	0=无未匹配量, 买卖两边的未匹配量都为 0; 1=买方有未匹配量, 卖方未匹配量=0; 2=卖方有未匹配量, 买方未匹配量=0	Y
8	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
9	Market	市场	varchar(5)	SSE, 表示上海	N
10	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## 十档行情 (SEL2\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
4	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	上一交易日的收盘价(如有除权除息, 为前复权后的收盘价)	Y
5	OpenPrice	开盘价	decimal(9,3)	当日的开盘价	Y
6	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
7	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
8	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
9	TradeStatus	当前品种状态	varchar(8)	详见表后说明	Y
10	SellLevelNo	申卖价格档位数	int	委卖的报价档位数, 10 档	Y
11	SellPrice10	委卖价 10	decimal(9,3)	第 10 档委托卖出价	Y
12	SellPrice09	委卖价 9	decimal(9,3)	第 9 档委托卖出价	Y
13	SellPrice08	委卖价 8	decimal(9,3)	第 8 档委托卖出价	Y
14	SellPrice07	委卖价 7	decimal(9,3)	第 7 档委托卖出价	Y
15	SellPrice06	委卖价 6	decimal(9,3)	第 6 档委托卖出价	Y
16	SellPrice05	委卖价 5	decimal(9,3)	第 5 档委托卖出价	Y
17	SellPrice04	委卖价 4	decimal(9,3)	第 4 档委托卖出价	Y
18	SellPrice03	委卖价 3	decimal(9,3)	第 3 档委托卖出价	Y
19	SellPrice02	委卖价 2	decimal(9,3)	第 2 档委托卖出价	Y
20	SellPrice01	委卖价 1	decimal(9,3)	第 1 档委托卖出价	Y
21	BuyPrice01	委买价 1	decimal(9,3)	第 1 档委托买入价	Y
22	BuyPrice02	委买价 2	decimal(9,3)	第 2 档委托买入价	Y
23	BuyPrice03	委买价 3	decimal(9,3)	第 3 档委托买入价	Y
24	BuyPrice04	委买价 4	decimal(9,3)	第 4 档委托买入价	Y
25	BuyPrice05	委买价 5	decimal(9,3)	第 5 档委托买入价	Y
26	BuyPrice06	委买价 6	decimal(9,3)	第 6 档委托买入价	Y
27	BuyPrice07	委买价 7	decimal(9,3)	第 7 档委托买入价	Y
28	BuyPrice08	委买价 8	decimal(9,3)	第 8 档委托买入价	Y
29	BuyPrice09	委买价 9	decimal(9,3)	第 9 档委托买入价	Y

## 新高频数据说明书

30	BuyPrice10	委买价 10	decimal(9,3)	第 10 档委托买入价	Y
31	BuyLevelNo	申买价格档位数	int	委卖的报价档位数, 10 档	Y
32	SellVolume10	委卖量 10	decimal(19,2)	第 10 档申卖量	Y
33	SellVolume09	委卖量 9	decimal(19,2)	第 9 档申卖量	Y
34	SellVolume08	委卖量 8	decimal(19,2)	第 8 档申卖量	Y
35	SellVolume07	委卖量 7	decimal(19,2)	第 7 档申卖量	Y
36	SellVolume06	委卖量 6	decimal(19,2)	第 6 档申卖量	Y
37	SellVolume05	委卖量 5	decimal(19,2)	第 5 档申卖量	Y
38	SellVolume04	委卖量 4	decimal(19,2)	第 4 档申卖量	Y
39	SellVolume03	委卖量 3	decimal(19,2)	第 3 档申卖量	Y
40	SellVolume02	委卖量 2	decimal(19,2)	第 2 档申卖量	Y
41	SellVolume01	委卖量 1	decimal(19,2)	第 1 档申卖量	Y
42	BuyVolume01	委买量 1	decimal(19,2)	第 1 档申买量	Y
43	BuyVolume02	委买量 2	decimal(19,2)	第 2 档申买量	Y
44	BuyVolume03	委买量 3	decimal(19,2)	第 3 档申买量	Y
45	BuyVolume04	委买量 4	decimal(19,2)	第 4 档申买量	Y
46	BuyVolume05	委买量 5	decimal(19,2)	第 5 档申买量	Y
47	BuyVolume06	委买量 6	decimal(19,2)	第 6 档申买量	Y
48	BuyVolume07	委买量 7	decimal(19,2)	第 7 档申买量	Y
49	BuyVolume08	委买量 8	decimal(19,2)	第 8 档申买量	Y
50	BuyVolume09	委买量 9	decimal(19,2)	第 9 档申买量	Y
51	BuyVolume10	委买量 10	decimal(19,2)	第 10 档申买量	Y
52	TotalNo	成交总笔数	decimal(9,0)	开盘至当前时刻的累计成交笔数	Y
53	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
54	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交额	Y
55	TotalBuyOrderVolume	委托买入总量	decimal(19,2)		Y
56	WtAvgBuyPrice	加权平均委买价格	decimal(9,3)	单位: 元, 非债券代码适用	Y
57	BondWtAvgBuyPrice	债券加权平均委买价格	decimal(9,3)	单位: 元, 债券代码适用	Y
58	TotalSellOrderVolume	委托卖出总量	decimal(19,2)		Y
59	WtAvgSellPrice	加权平均委卖价格	decimal(9,3)	单位: 元, 非债券代码适用	Y
60	BondWtAvgSellPrice	债券加权平均委卖价格	decimal(9,3)	单位: 元, 债券代码适用	Y
61	IOPV	ETF 净值估计	decimal(9,4)	基金实时参考净值	Y
62	YTM	到期收益率	decimal(9,4)	债券独有字段, 其他品种以 0 填充	Y
63	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
64	Market	交易所代码	varchar(5)	SSE 表示上海	N
65	ClosePrice	今日收盘价	decimal(9,3)		Y
66	TotalBuyOrderNo01	委买笔数 1	decimal(9,0)	委买价 1 的委托总笔数	Y
67	TotalBuyOrderNo02	委买笔数 2	decimal(9,0)	委买价 2 的委托总笔数	Y
68	TotalBuyOrderNo03	委买笔数 3	decimal(9,0)	委买价 3 的委托总笔数	Y
69	TotalBuyOrderNo04	委买笔数 4	decimal(9,0)	委买价 4 的委托总笔数	Y
70	TotalBuyOrderNo05	委买笔数 5	decimal(9,0)	委买价 5 的委托总笔数	Y

71	TotalBuyOrderNo06	委买笔数 6	decimal(9,0)	委买价 6 的委托总笔数	Y
72	TotalBuyOrderNo07	委买笔数 7	decimal(9,0)	委买价 7 的委托总笔数	Y
73	TotalBuyOrderNo08	委买笔数 8	decimal(9,0)	委买价 8 的委托总笔数	Y
74	TotalBuyOrderNo09	委买笔数 9	decimal(9,0)	委买价 9 的委托总笔数	Y
75	TotalBuyOrderNo10	委买笔数 10	decimal(9,0)	委买价 10 的委托总笔数	Y
76	TotalSellOrderNo01	委卖笔数 1	decimal(9,0)	委卖价 1 的委托总笔数	Y
77	TotalSellOrderNo02	委卖笔数 2	decimal(9,0)	委卖价 2 的委托总笔数	Y
78	TotalSellOrderNo03	委卖笔数 3	decimal(9,0)	委卖价 3 的委托总笔数	Y
79	TotalSellOrderNo04	委卖笔数 4	decimal(9,0)	委卖价 4 的委托总笔数	Y
80	TotalSellOrderNo05	委卖笔数 5	decimal(9,0)	委卖价 5 的委托总笔数	Y
81	TotalSellOrderNo06	委卖笔数 6	decimal(9,0)	委卖价 6 的委托总笔数	Y
82	TotalSellOrderNo07	委卖笔数 7	decimal(9,0)	委卖价 7 的委托总笔数	Y
83	TotalSellOrderNo08	委卖笔数 8	decimal(9,0)	委卖价 8 的委托总笔数	Y
84	TotalSellOrderNo09	委卖笔数 9	decimal(9,0)	委卖价 9 的委托总笔数	Y
85	TotalSellOrderNo10	委卖笔数 10	decimal(9,0)	委卖价 10 的委托总笔数	Y
86	ETFBuyNo	ETF 申购笔数	decimal(9,0)		Y
87	ETFBuyVolume	ETF 申购数量	decimal(19,2)		Y
88	ETFBuyAmount	ETF 申购金额	decimal(19,3)		Y
89	ETFSellNo	ETF 赎回笔数	decimal(9,0)		Y
90	ETFSellVolume	ETF 赎回数量	decimal(19,2)		Y
91	ETFSellAmount	ETF 赎回金额	decimal(19,3)		Y
92	WithdrawBuyNo	买入撤单笔数	decimal(9,0)		Y
93	WithdrawBuyVolume	买入撤单数量	decimal(19,2)		Y
94	WithdrawBuyAmount	买入撤单金额	decimal(19,3)		Y
95	WithdrawSellNo	卖出撤单笔数	decimal(9,0)		Y
96	WithdrawSellVolume	卖出撤单数量	decimal(19,2)		Y
97	WithdrawSellAmount	卖出撤单金额	decimal(19,3)		Y
98	TotalBuyNo	买入总笔数	decimal(9,0)		Y
99	TotalSellNo	卖出总笔数	decimal(9,0)		Y
100	MaxBuyDuration	买入委托成交最大等待时间	decimal(9,0)		Y
101	MaxSellDuration	卖出委托成交最大等待时间	decimal(9,0)		Y
102	BuyOrderNo	买方委托价位数	decimal(9,0)		Y
103	SellOrderNo	卖方委托价位数	decimal(9,0)		Y
104	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N

说明: TradeStatus (当前品种状态)字段描述:

TradeStatus (当前品种状态)	TradeStatus 描述
----------------------	----------------

• ADD	新产品
• BETW	交易间，禁止任何交易活动
• BREAK	休市，如：午餐休市。无撮合和市场内部信息披露
• CLOSE	闭市，自动计算闭市价格
• DEL	产品待删除
• ENDTR	交易结束
• FCALL	固定价格集合竞价
• HALT	暂停，除了自有订单和交易的查询之外，任何交易活动都被禁止
• SUSP	停牌（SUSP 和 HALT 的区别在于在 SUSP 时可以撤单）
• ICALL	盘中集合竞价
• IOBB	盘中集合竞价订单簿平衡（OBB）
• IPOBB	盘中集合竞价 PREOBB
• OCALL	开市集合竞价
• OOB	开市集合竞价 OBB
• OPOBB	开市集合竞价订单簿平衡（OBB）前期时段
• NOTRD	非交易支持非交易服务
• POSTR	盘后处理
• PRETR	盘前处理
• START	启动
• TRADE	连续自动撮合
• VOLA	连续交易和集合竞价交易的波动性中断

## 委托队列（SEL2\_ORDERQUEUE\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码，包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	Y



## 新高频数据说明书

3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
4	Side	买卖方向	varchar(1)	1=BIDQUEUE (买) 2=OFFERQUEUE (卖)	Y
5	NoPriceLevel	买卖盘价位数量	int	值为 10，代表 10 档行情	Y
6	Price	委托价格	decimal(9,3)	委买(卖)价 1，3 位小数	Y
7	Numorders	最优价位上的委托笔数	decimal(9,0)	委买(卖)价 1 上总委托笔数（可以超过 50）	Y
8	OrderVolume01	委托量 01	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，最早一笔还未成交或完全成交的委托中的未成交的委托量	Y
9	OrderVolume02	委托量 02	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 2 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
10	OrderVolume03	委托量 03	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 3 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
11	OrderVolume04	委托量 04	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 4 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
12	OrderVolume05	委托量 05	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 5 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
13	OrderVolume06	委托量 06	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 6 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
14	OrderVolume07	委托量 07	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 7 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
15	OrderVolume08	委托量 08	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 8 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
16	OrderVolume09	委托量 09	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 9 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
17	OrderVolume10	委托量 10	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 10 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
18	OrderVolume11	委托量 11	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 11 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
19	OrderVolume12	委托量 12	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 12 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
20	OrderVolume13	委托量 13	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 13 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
21	OrderVolume14	委托量 14	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 14 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
22	OrderVolume15	委托量 15	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 15 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
23	OrderVolume16	委托量 16	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 16 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
24	OrderVolume17	委托量 17	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 17 笔委托的委托量，	Y

				无则以 0 填充	
25	OrderVolume18	委托量 18	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 18 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
26	OrderVolume19	委托量 19	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 19 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
27	OrderVolume20	委托量 20	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 20 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
28	OrderVolume21	委托量 21	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 21 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
29	OrderVolume22	委托量 22	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 22 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
30	OrderVolume23	委托量 23	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 23 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
31	OrderVolume24	委托量 24	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 24 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
32	OrderVolume25	委托量 25	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 25 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
33	OrderVolume26	委托量 26	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 26 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
34	OrderVolume27	委托量 27	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 27 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
35	OrderVolume28	委托量 28	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 28 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
36	OrderVolume29	委托量 29	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 29 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
37	OrderVolume30	委托量 30	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 30 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
38	OrderVolume31	委托量 31	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 31 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
39	OrderVolume32	委托量 32	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 32 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
40	OrderVolume33	委托量 33	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 33 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
41	OrderVolume34	委托量 34	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 34 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
42	OrderVolume35	委托量 35	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 35 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
43	OrderVolume36	委托量 36	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 36 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
44	OrderVolume37	委托量 37	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 37 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
45	OrderVolume38	委托量 38	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 38 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y

46	OrderVolume39	委托量 39	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 39 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
47	OrderVolume40	委托量 40	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 40 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
48	OrderVolume41	委托量 41	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 41 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
49	OrderVolume42	委托量 42	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 42 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
50	OrderVolume43	委托量 43	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 43 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
51	OrderVolume44	委托量 44	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 44 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
52	OrderVolume45	委托量 45	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 45 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
53	OrderVolume46	委托量 46	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 46 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
54	OrderVolume47	委托量 47	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 47 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
55	OrderVolume48	委托量 48	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 48 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
56	OrderVolume49	委托量 49	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 49 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
57	OrderVolume50	委托量 50	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 50 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
58	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
59	Market	交易所代码	varchar(5)	SSE 表示上海	N
60	Noorders	发布的委托笔数	decimal(9,0)	委托价格上揭示的委托量队列数, 即委买(卖)价 1 上揭示的委托笔数, 其小于等于 50, 为 0 表示不揭示	Y
61	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
62	Volume	委托量	decimal(19,2)	委买(卖)价 1 上的委托总量	Y

## 指数行情 (SEL2\_INDEX\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的指数代码	Y

2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
4	ClosePrice	今收盘价	decimal(11,5)	该证券在当日的收盘价	Y
5	OpenPrice	开盘价	decimal(11,5)	该证券在当日的开盘价	Y
6	HighPrice	最高价	decimal(11,5)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
7	LowPrice	最低价	decimal(11,5)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
8	LastPrice	最新成交价	decimal(11,5)		Y
9	TotalVolume	成交总量	decimal(30,2)	单位: 股	Y
10	TotalAmount	成交总额	decimal(32,5)	截至当前时刻,该指数所包含的所有成分股的累计成交金额	Y
11	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
12	Market	市场	varchar(5)	SSE,表示上海	N
13	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(11,5)	上一交易日的收盘价	Y
14	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## 逐笔成交 (SEL2\_TRANSACTION\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和成交时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
4	RecID	成交序号	int	从 1 开始,按成交通道(TradeChannel)连续	Y
5	TradeChannel	成交通道	int	有多个成交通道	Y
6	TradePrice	成交价格	decimal(9,3)	3 位小数	Y
7	TradeVolume	成交数量	decimal(19,2)		Y
8	TradeAmount	成交金额	decimal(19,3)	3 位小数	Y
9	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的	N

				毫秒差值再减去 8*3600	
10	Market	市场	varchar(5)	SSE,表示上海	N
11	BuyRecID	买方订单号	int	该笔成交对应的买方委托单号	Y
12	SellRecID	卖方订单号	int	该笔成交对应的卖方委托单号	Y
13	BuySellFlag	内外盘标志	varchar(1)	B-外盘,主动买;S-内盘,主动卖;N-未知	Y
14	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## 静态数据 (SEL2\_BASICINFO\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	上交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证、指数。	Y
2	SecurityName	证券名称	nvarchar(20)		Y
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
5	SecurityEN	证券英文简称	varchar(20)		Y
6	ISINCode	ISIN 代码	varchar(12)		Y
7	SymbolUnderlying	基础证券代码	varchar(20)		Y
8	MarketType	市场种类	varchar(6)	'ASHR' 表示 A 股市场; 'BSHR' 表示 B 股市场; 'CSHR' 表示国际版市场。	Y
9	CFICode	证券类别	varchar(6)	'ES' 表示股票; 'EU' 表示基金; 'D' 表示债券; 'RWS' 表示权证; 'FF' 表示期货。	Y
10	SecuritySubType	证券子类别	varchar(6)	自定义详细证券类别, 参考: (1) GBF 国债; (2) GBZ 无息国债; (3) DST 国债分销 (仅用于分销阶段); (4) DVP 公司债 (地方债) 分销; (5) CBF 企业债券; (6) CCF 可转换企业债券; (7) CPF 公司债券 (或地方债券); (8) FBF 金融机构发行债券; (9) CRP 质押式国债回购; (10) BRP 质押式企业债回购; (11) ORP 买断式债券回购; (12) CBD 分离式可转债; (13) OBD 其它债券; (14) CEF 封闭式基金; (15) OEF 开放式基金; (16) EBS 交易所交易基金 (买卖); (17) FBL 跨市场/跨境资金; (18) OFN 其它基金; (19) ASH 以人民币交易的股票; (20) BSH 以美元交易的股票; (21) CSH 国际版	Y

				股票；(22) OEQ 其它股票；(23) CIW 企业发行权证；(24) COV 备兑权证；(25) FEQ 个股期货；(26) FBD 债券期货；(27) OFT 其它期货；(28) AMP 集合资产管理计划；(29) WIT 国债预发行；(30) LOF LOF 基金；(31) OPS 公开发行优先股；(32) PPS 非公开发行优先股；(33) QRP 报价回购。	
11	Currency	币种	varchar(5)	美元：USD；人民币：CNY	Y
12	ParValue	面值	decimal(9,3)	3 位有效小数位数；债券当前面值，单位元；其他产品取 0.000	Y
13	TradableNo	可流通未上市数量	decimal(19,2)	交易所预留字段	Y
14	EndDate	最后交易日期	int	对于国债预发行产品，为最后交易日期，格式为 yymmdd	Y
15	ListingDate	上市日期	int		Y
16	SetNo	产品集编号	int	取值范围从 1 到 999。用来表明产品的一种分组方式，用于在多主机间进行负载均衡分配。该值在一个交易日内不会变化。	Y
17	BuyVolumeUnit	买数量单位	int	买订单的申报数量必须是该字段的整数倍。	Y
18	SellVolumeUnit	卖数量单位	int	3 位有效小数位数，申报价格的最小变动单位	Y
19	DeclareVolumeFloor	申报量下限	int	申报数量下限	Y
20	DeclareVolumeCeiling	申报量上限	int	申报数量上限	Y
21	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	3 位有效小数位数，上一交易日的收盘价（如有除权除息，为前复权的收盘价）；对于货币市场基金实时申赎，取值为 0.010	Y
22	TickSize	最小报价单位	decimal(9,3)	3 位有效小数位数，申报价格的最小变动单位	Y
23	UpDownLimitType	涨跌幅限制类型	varchar(1)	‘N’ 表示交易规则规定的有涨跌幅限制类型或者权证管理办法第 22 条规定； ‘R’ 表示交易规则规定的无涨跌幅限制类型； ‘S’ 表示回购涨跌幅控制类型。	Y
24	PriceUpLimit	涨幅价格	decimal(15,3)	债券有部分涨停价是 10 亿	Y
25	PriceDownLimit	跌幅价格	decimal(9,3)		Y
26	XRRatio	除权比例	decimal(9,6)	6 位有效小数位数，每股送股比例； 对于国债预发行产品，为保证金比例。	Y
27	XDAmount	除息金额	decimal(9,6)	6 位有效小数位数，每股分红金额	Y
28	CrdBuyUnderlying	融资标的标志	varchar(1)	‘T’ 表示是融资标的证券；‘F’ 表示不是融资标的证券	Y
29	SecurityStatus	产品状态标识	varchar(20)	该字段为 20 位字符串，每位表示允许对应的业务，无定义则填空格。 第 0 位对应：‘N’ 表示首日上市。 第 1 位对应：‘D’ 表示除权。 第 2 位对应：‘R’ 表示除息。	Y

				<p>第 3 位对应：' D' 表示国内主板正常交易产品，' S' 表示股票风险警示产品，' P' 表示退市整理产品，' T' 表示退市转让产品，' U' 表示优先股产品。</p> <p>第 4 位对应：' S' 表示债券风险警示类。第 4 位未来改为不启用，此改动暂未实施，具体以交易所通知为准。</p> <p>第 5 位对应：' L' 表示债券投资者适当性要求类</p>	
30	SampleNo	样本数量	int	重点指数当前的样本数量	Y
31	SampleAvgPrice	样本均价	decimal(9,3)	重点指数当前样本的均价。 市价总值/发行股本。若该指标不统计则输出 N/A	Y
32	TradeAmount	成交金额	decimal(9,4)	重点指数当前样本的当日成交金额（单位：亿元）	Y
33	AvgCapital	平均股本	decimal(9,4)	重点指数当前样本的平均股本（算术平均，单位：亿股）。若该指标不统计则输出 N/A	Y
34	TotalMarketValue	总市值	decimal(9,4)	重点指数当前样本的总市值汇总（算术和，单位：万亿元）。若该指标不统计则输出 N/A	Y
35	MarketValueRatio	占比%	decimal(9,4)	重点指数当前样本的总市值占上证综指全样本的总市值百分比。若该指标不统计则输出 N/A	Y
36	StaticPERatio	静态市盈率	decimal(9,4)	重点指数当前样本的静态市盈率。公式：合计（人民币收盘价*发行量）/合计（每股收益*发行量）。若该指标未统计则输出 N/A	Y
37	IndexLevelStatus	指数级别标识	varchar(20)	前 5 位为指数排序数值， 最后 1 位即指数级别信息：1 为重点指数；2 为全貌指数；其他可根据需要扩展。	Y
38	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
39	Market	市场	varchar(5)	SSE 表示上海	N

## 个股期权 L2

### 分笔（SHSOL1\_TAQ\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2014-09-01	H

## 新高频数据说明书

				08:57:55.000	
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	Symbol	合约代码	varchar(8)	合约期权产品代码, 8 位字符;唯一标示	Y
4	ShortName	证券简称/合约简称	nvarchar(20)		Y
5	LastPrice	最新成交价	decimal(11,4)		Y
6	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
7	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交量	N
8	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交金额	Y
9	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19,3)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交金额	N
10	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交,S:卖方主动成交;如果为空则表示当前处于集合竞价阶段, 不计算此值	N
11	OpenClose	开平仓性质	Nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态: 双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
12	Change	涨跌	decimal(11,4)	最新成交价-昨结算价	N
13	ChangeRatio	涨跌比例	decimal(11,4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
14	OpenPrice	开盘价	decimal(11,4)	该合约当天开盘价	Y
15	HighPrice	最高价	decimal(11,4)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
16	LowPrice	最低价	decimal(11,4)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
17	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(11,4)	该合约在上一交易日的结算价	Y
18	SettlePrice	结算价	decimal(11,4)	该合约当天结算价	Y
19	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(11,4)	上一交易日的收盘价(如有除权除息, 为前复权的收盘价), 来自静态数据	N
20	ClosePrice	收盘价	decimal(11,4)	该合约当天收盘价	Y
21	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19,2)	昨天收盘后持仓量	Y
22	TotalPosition	持仓量	decimal(19,2)	当前观测时点的持仓量	Y
23	PrePositionChange	日增仓	decimal(19,2)	持仓量-昨持仓量 (TotalPosition-PreTotalPosition)	N



24	AuctionPrice	波动性中断参考价	decimal(11,4)		Y
25	AuctionVolume	波动性中断集合竞价 虚拟匹配量	decimal(19,2)		Y
26	BuyLevelNO	委托买入档位数	int		Y
27	BuyPrice01	申买价 1	decimal(11,4)		Y
28	BuyPrice02	申买价 2	decimal(11,4)		Y
29	BuyPrice03	申买价 3	decimal(11,4)		Y
30	BuyPrice04	申买价 4	decimal(11,4)		Y
31	BuyPrice05	申买价 5	decimal(11,4)		Y
32	BuyVolume01	申买量 1	decimal(19,2)		Y
33	BuyVolume02	申买量 2	decimal(19,2)		Y
34	BuyVolume03	申买量 3	decimal(19,2)		Y
35	BuyVolume04	申买量 4	decimal(19,2)		Y
36	BuyVolume05	申买量 5	decimal(19,2)		Y
37	SellLevelNO	委托卖出档位数	int		Y
38	SellPrice01	申卖价 1	decimal(11,4)		Y
39	SellPrice02	申卖价 2	decimal(11,4)		Y
40	SellPrice03	申卖价 3	decimal(11,4)		Y
41	SellPrice04	申卖价 4	decimal(11,4)		Y
42	SellPrice05	申卖价 5	decimal(11,4)		Y
43	SellVolume01	申卖量 1	decimal(19,2)		Y
44	SellVolume02	申卖量 2	decimal(19,2)		Y
45	SellVolume03	申卖量 3	decimal(19,2)		Y
46	SellVolume04	申卖量 4	decimal(19,2)		Y
47	SellVolume05	申卖量 5	decimal(19,2)		Y
48	SecurityPhaseTag	交易状态	varchar(8)	该字段为 4 位字符串, 左起每位表示特定的含义, 无定义则填空格。 第 1 位: 'S' 表示启动(开市前)时段, 'C' 表示集合竞价时段, 'T' 表示连续交易时段, 'B' 表示休市时段, 'E' 表示闭市时段, 'V' 表示波动性中断, 'P' 表示临时停牌、	Y

				<p>‘U’表示收盘集合竞价。‘M’表示可恢复交易的熔断（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断（暂停交易至闭市）</p> <p>第2位：‘0’表示未连续停牌，‘1’表示连续停牌。（预留，暂填空格）。</p> <p>第3位：‘0’表示不限制开仓，‘1’表示限制备兑开仓，‘2’表示卖出开仓，‘3’表示限制卖出开仓、备兑开仓，‘4’表示限制买入开仓，‘5’表示限制买入开仓、备兑开仓，‘6’表示限制买入开仓、卖出开仓，‘7’表示限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓。</p> <p>第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。</p>	
49	Market	市场	varchar(5)	SSE 表示上海	N
50	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
51	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
52	AveragePrice	均价	decimal(11,4)	成交总额/(成交总量*合约单位)，没有成交则显示昨收盘价；合约单位来自静态数据	N
53	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
54	VolRate	量比	decimal(9,4)	<p>量比是衡量相对成交量的指标，计算公式： 当日分钟均量（当前成交总量/当前交易分钟数）/前5天平均每分钟成交量。</p> <p>当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数，例如出现 09:31:01 就按两分钟算；09:30:00 按一分钟算。</p>	N
55	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	<p>委买总量-委卖总量；</p> <p>委买总量=BuyVolume01+BuyVolume02+BuyVolume03+BuyVolume04+BuyVolume05；</p> <p>委卖总量=SellVolume01+SellVolume02+SellVolume03+SellVolume04+SellVolume05</p>	N
56	OrderRate	委比	decimal(9,4)	<p>(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。</p> <p>委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。</p> <p>委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。</p>	N
57	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	符合以下两个条件中的一个或者两个时，将分	N

				笔期间成交量累加到 SellVOL: (1) LastPrice(t)<>0 且 SellPrice01(t-1)-LastPrice(t)>LastPrice(t)- Buyprice01(t-1) (2)LastPrice(t)<>0 且 SellPrice01(t-1)-LastPrice(t)=LastPrice(t)- BuyPrcie01(t-1) 且 LastPrice(t)<LastPrice(t-1)	
58	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	符合以下两个条件中的一个或者两个时, 将分 笔期间成交量累加到 BuyVOL; (1) LastPrice(t)<>0 且 SellPrice01(t-1)-LastPrice(t)<LastPrice(t)- Buyprice01(t-1)时 (2)LastPrice(t)<>0 且 SellPrice01(t-1)-LastPrice(t)=LastPrice(t)- BuyPrcie01(t-1) 且 LastPrice(t)>LastPrice(t-1)	N
59	PositionChange	仓差	decimal(19,2)	当前持仓量[TotalPosition(t)]-上一分笔的持 仓量[TotalPosition(t-1)]; 当日首条分笔仓差 为 0	N

## 分时 (SHSOL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	Symbol	合约代码	varchar(8)	合约期权产品代码, 8 位字符;唯一标示
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120
4	ShortName	证券简称/合约简称	nvarchar(20)	
5	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(11, 4)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
6	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(11, 4)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
7	HighPrice	分时段内最高价	decimal(11, 4)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
8	LowPrice	分时段内最低价	decimal(11, 4)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
9	Change	涨跌	decimal(11, 4)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价

10	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(11, 4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
11	Position	持仓量	decimal(19, 2)	分时区间内最后一笔分笔的持仓量
12	Volume	分时段成交量	decimal(19, 2)	分时区间内成交记录的成交量之和
13	Amount	分时段成交金额	decimal(19, 3)	分时区间内成交记录的成交金额之和
14	Market	市场	varchar(5)	SSE 表示上海
15	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
16	SecurityId	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识
17	BenchMarkOpen Price	开盘基准价	decimal(11, 4)	取昨结算价(PreSettlePrice)，上市首日为挂牌基准价
18	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	取分时区间内的末条成交记录的成交总量
19	VWAP	成交量加权平均价	decimal(11,4)	Amount / Volume / 合约乘数； 合约乘数取静态数据中 ContractMultiplierUnit( 合约单位 ) 字段，该字段可用于全天填充。
20	CumulativeLow Price	开盘至今最低价	decimal(11,4)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
21	CumulativeHigh Price	开盘至今最高价	decimal(11,4)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
22	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(11,4)	本分时段最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
23	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的买价一，档位不够的填充 0
24	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的买价二，档位不够的填充 0
25	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的买价三，位不够的填充 0
26	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的买价四，位不够的填充 0
27	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的买价五，档位不够的填充 0
28	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的买量一，档位不够的填充 0
29	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的买量二，档位不够的填充 0
30	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的买量三，档位不够的填充 0
31	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的买量四，档位不够的填充 0
32	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的买量五，档位不够的填充 0
33	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的卖价一，档位不够的填充 0
34	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的卖价二，档位不够的填充 0

35	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的卖价三，位不够的填充 0
36	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的卖价四，位不够的填充 0
37	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(11,4)	分时区间最后一条分笔的卖价五，档位不够的填充 0
38	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的卖量一，档位不够的填充 0
39	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的卖量二，档位不够的填充 0
40	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的卖量三，档位不够的填充 0
41	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的卖量四，档位不够的填充 0
42	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19, 2)	分时区间最后一条分笔的卖量五，档位不够的填充 0
43	MarginUnit	期权初始保证金	decimal(11,4)	当日单张初始保证金
44	MaintainingMargin	期权维持保证金	decimal(11,4)	当日单张维持保证金
45	Return	简单收益率	decimal(9,4)	(分时收盘价-昨结算价)/昨结算价

## 静态数据 (SHSOL1\_BASICINFO\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和包头时间(交易所发包时间)合成	H
3	Symbol	合约代码	varchar(8)	合约期权产品代码, 8 位字符;唯一标示	Y

4	ContractCode	合约编码	varchar(19)	<p>合约交易代码 17 位，按以下顺序编写：</p> <p>第 1 至第 6 位为数字，取标的证券代码，如工商银行 601398，取“601398”；</p> <p>第 7 位为 C(Call)或者 P(Put)，分别表示认购期权或者认沽期权；</p> <p>第 8、9 位表示到期年份；</p> <p>第 10、11 位表示到期月份；</p> <p>第 12 位期初设为“M”，表示月份合约。当合约首次调整后，“M”修改为“A”，以表示该合约被调整过一次，如发生第二次调整，则“A”修改为“B”、“M”修改为“A”，以此类推；</p> <p>第 13 至 17 位表示期权行权价格.留两位备用</p>	Y
5	ShortName	证券简称/合约简称	nvarchar(20)		Y
6	UnderlyingSecuritySymbol	标的证券代码	varchar(6)	期权标的证券代码	Y
7	UnderlyingShortName	标的证券简称	nvarchar(20)		Y
8	UnderlyingType	标的证券类型	varchar(5)	EBS - ETF, ASH - A 股	Y
9	OptionType	期权类型	varchar(1)	欧式期权，则为“E”；美式期权，则为“A”	Y
10	CallOrPut	认购认沽	varchar(1)	认购，则为“C”；认沽，则为“P”	Y
11	ContractMultiplierUnit	合约单位	decimal(11, 0)	经过除权除息调整后的合约单位，一定是整数	Y
12	ExercisePrice	期权行权价	decimal(11, 4)	4 位有效小数位。经过除权除息调整后的期权行权价，精确到 0.0001 元	Y
13	StartDate	首个交易日	int	期权首个交易日，yyyymmdd	Y
14	EndDate	最后交易日	int	期权最后交易日，yyyymmdd	Y
15	ExerciseDate	期权行权日	int	期权行权日，yyyymmdd	Y
16	DeliveryDate	行权交割日	int	行权交割日，默认为行权日的下一个交易日，yyyymmdd	Y
17	ExpireDate	期权到期日	int	期权到期日，yyyymmdd	Y
18	Version	合约版本号	varchar(1)	期权合约的版本号，新挂合约是'1'	Y
19	PrePosition	昨持仓量	decimal(19, 2)	单位是（张），此值为前一交易日日终持仓轧差对冲之后持仓数据	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(11, 4)	上一交易日的收盘价（如有除权除息，为前复权后的收盘价）	Y
21	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(11, 4)		Y

22	Underlying PreClosePrice	标的证券昨收盘价	decimal(11, 4)		Y
23	UpDownLimitType	涨跌幅限制类型	varchar(1)	‘N’ 有涨跌幅限制类型	Y
24	PriceUpLimit	涨幅限制	decimal(11, 4)	4 位有效小数位，当日期权涨停价格	Y
25	PriceDownLimit	跌幅限制	decimal(11, 4)	4 位有效小数位，当日期权跌停价格	Y
26	MarginUnit	单位保证金	decimal(16, 2)	2 位有效小数位，当日持有一张合约所需要的保证金数量	Y
27	MarginRatioParam1	保证金计算比例参数一	decimal(6, 2)	2 位有效小数位。保证金计算参数，单位：%	Y
28	MarginRatioParam2	保证金计算比例参数二	decimal(6, 2)	2 位有效小数位。保证金计算参数，单位：%	Y
29	RoundLotT	整手数	decimal(9, 0)	一手等于几张合约	Y
30	LmtOrdFloor	单笔限价申报下限	decimal(19, 2)	单笔限价申报的申报张数下限	Y
31	LmtOrdCeiling	单笔限价申报上限	decimal(19, 2)	单笔限价申报的申报张数上限	Y
32	MktOrdFloor	单笔市价申报下限	decimal(19, 2)	单笔市价申报的申报张数下限	Y
33	MktOrdCeiling	单笔市价申报上限	decimal(19, 2)	单笔市价申报的申报张数上限	Y
34	TickSize	最小报价单位	decimal(11, 4)		Y
35	SecurityStatusFlag	期权合约状态	varchar(8)	<p>该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充空格。</p> <p>第 1 位：‘0’ 表示可开仓，‘1’ 表示限制卖出开仓（包括备兑开仓）和买入开仓。</p> <p>第 2 位：‘0’ 表示未连续停牌，‘1’ 表示连续停牌。</p> <p>第 3 位：‘0’ 表示未临近到期日，‘1’ 表示距离到期日不足 5 个交易日。</p> <p>第 4 位：‘0’ 表示近期未做调整，‘1’ 表示最近 5 个交易日内合约发生过调整。</p> <p>第 5 位：‘A’ 表示当日新挂牌的合约，‘E’ 表示存续的合约，‘D’ 表示当日摘牌的合约。</p> <p>第 6 位：‘1’ 表示合约不能进行垂直价差组合策略，‘0’ 表示可以进行所有的组合策略</p>	Y
36	SecurityID	证券统一编码	decimal(19, 0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N

## 二、深圳证券交易所

### L1

#### 分笔 (SEL1\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证、指数。	Y
2	ShortName	证券简称	nvarchar(20)	交易所公布的各类证券品种的简称, 包含股票、基金、债券、权证、指数等	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	N
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
5	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	上一交易日的收盘价 (如有除权除息, 为前复权后的收盘价)	Y
6	OpenPrice	今开盘价	decimal(9,3)	该证券在当日的开盘价	Y
7	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)	最后一笔以非零收盘价刷新	Y
8	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
9	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交金额	Y
10	TotalNo	成交总笔数	decimal(9,0)	开盘至当前时刻的累计成交笔数	Y
11	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交量	N
12	TradeAmount	分笔期间成交金额	decimal(19,3)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交金额	N
13	TradeNo	分笔期间成交笔数	decimal(9,0)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交笔数	N
14	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
15	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
16	PERatio1	市盈率 1	decimal(9,4)	对于国债,存放到期年收益率,供市场参考用;对于 LOF 和 ETF,存放交易当日定时更新的每百份基金单位净值估值;对于认购或认沽权证,存放权证实时溢价率的百分比值,例如该值为 20,则表示权证实时溢价率为 20%.	Y



17	PERatio2	市盈率 2	decimal(9,4)	对于国债，存放到期年收益率，供市场参考使用。国债的到期年收益率采取单利计算，计算公式为： $y=((FV-PV)/PV)*(365/D)$ ，其中 y 为到期收益率，PV 为债券全价（等于成交价格加应计利息），D 为交易当日至债券兑付日的实际天数，FV 为到期本息和；对于公司债券、企业债券和分离交易的可转换公司债券，该字段取值为 0；对于 LOF 和 ETF，若面值为 100 元，存放每 10 份基金当日实时参考净值；若面值不为 100 元，存放每百份基金当日实时参考净值。对于认购或者认沽权证，存放权证实时溢价率的百分比值，例如该值为 20，则表示权证实时溢价率为 20^%	Y
18	PriceChange01	价格升降 1	decimal(9,3)	最新成交价 LastPrice 相对于昨收盘价 PreClosePrice 的升降	N
19	PriceChange02	价格升降 2	decimal(9,3)	本分笔的最新成交价相对于上一分笔记录的最新成交价的升降	N
20	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:主动性买盘,S:主动性卖盘;N: 无法判断	N
21	SellPrice05	卖价五	decimal(9,3)	第 5 档委托卖出价，高于第 4 档委托卖出价	Y
22	SellPrice04	卖价四	decimal(9,3)	第 4 档委托卖出价，高于第 3 档委托卖出价	Y
23	SellPrice03	卖价三	decimal(9,3)	第 3 档委托卖出价，高于第 2 档委托卖出价	Y
24	SellPrice02	卖价二	decimal(9,3)	第 2 档委托卖出价，高于第 1 档委托卖出价	Y
25	SellPrice01	卖价一	decimal(9,3)	第 1 档委托卖出价	Y
26	BuyPrice01	买价一	decimal(9,3)	第 1 档委托买入价	Y
27	BuyPrice02	买价二	decimal(9,3)	第 2 档委托买入价，低于第 1 档委托买入价	Y
28	BuyPrice03	买价三	decimal(9,3)	第 3 档委托买入价，低于第 2 档委托买入价	Y
29	BuyPrice04	买价四	decimal(9,3)	第 4 档委托买入价，低于第 3 档委托买入价	Y
30	BuyPrice05	买价五	decimal(9,3)	第 5 档委托买入价，低于第 4 档委托买入价	Y
31	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	以第 5 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
32	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	以第 4 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
33	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	以第 3 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
34	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	以第 2 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
35	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以第 1 档委托卖出价委托卖出的数量	Y
36	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以第 1 档委托买入价委托买入的数量	Y
37	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	以第 2 档委托买入价委托买入的数量	Y
38	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	以第 3 档委托买入价委托买入的数量	Y
39	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	以第 4 档委托买入价委托买入的数量	Y
40	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	以第 5 档委托买入价委托买入的数量	Y
41	BuyRatio	买比	decimal(9,4)	外盘/成交总量，主动性买盘占成交总量的比例	N
42	Spread	买卖价差	decimal(9,3)	最低委托卖价与最高的委托买价之差；即卖一价-买一价	N
43	RelativeSpread	相对价差	decimal(9,4)	最低委托卖价与最高的委托买价之差相对值，（卖一价-买一价）/（买一价+卖一价）	N
44	Depth01	报价深度 1	decimal(19,3)	买卖一档价量乘积之和/2，具体计算公式：	N

				$(\text{SellPrice01} * \text{SellVolume01} + \text{BuyPrice01} * \text{BuyVolume01}) / 2$	
45	Depth02	报价深度 2	decimal(19,3)	买卖五档价量乘积之和/2, 具体计算公式: $\frac{\sum_{i=1}^5 (\text{SellPrice}_i * \text{SellVolume}_i + \text{BuyPrice}_i * \text{BuyVolume}_i)}{2}$	N
46	UNIX	格林威治时刻	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
47	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳市场	N
48	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
49	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102=深圳证券交易所 103=香港交易所	Y
50	PriceUpLimit	涨停价	decimal(15,3)		Y
51	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9,3)		Y
52	ClosePrice	今收盘价	decimal(9,3)		Y
53	SecurityPhaseTag	当前品种交易状态	varchar(8)	产品所处的交易阶段代码: 第 0 位: S=启动 (开市前) O=开盘集合竞价 T=连续 B=休市 C=收盘集合竞价 E=已闭市 H=临时停牌 A=盘后交易 V=波动性中断 第 1 位: 0=正常状态 1=全天停牌	Y
54	NAV	基金 T-1 日净值	decimal(9,4)	基金净值	Y
55	IOPV	基金实时参考净值	decimal(9,4)	基金实时参考净值 (包括 ETF 的 IOPV)	Y
56	SampleNo	样本个数	int	统计量指标样本个数	Y
57	Amplitude	振幅	decimal(9, 4)	$[\text{最高价}(\text{HighPrice}) - \text{最低价}(\text{LowPrice})] / \text{昨收盘价}(\text{PreClosePrice})$	N
58	AveragePrice	均价	decimal(9,3)	成交总额/成交总量, 没有成交则显示昨收盘价	N
59	TurnoverRate	换手率	decimal(9, 4)	在一定时刻内市场中股票转手买卖的频率, 是反映股票流通性强弱的指标之一	N
60	VolRate	量比	decimal(9, 4)	量比是衡量相对成交量的指标, 计算公式: 当日分钟均量 (当前成交总量/当前交易分钟数) / 前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数, 例如出现 09:31:01 就按两分钟算; 09:30:00 按一分钟算。	N
61	OrderRate	委比	decimal(9, 4)	$(\text{委买总量} - \text{委卖总量}) / (\text{委买总量} + \text{委卖总量})$ ; 委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是	N

				当前委卖五档的委托量之和。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	
62	CirculationMarketValue	流通市值	decimal(19,3)	某特定时刻内当时可交易的流通股股数乘以当时股价得出的流通股票总价值	N
63	TotalMarketVAL	总市值	decimal(19,3)	某特定时刻内总股本数乘以当时股价得出的股票总价值	N
64	PE1	市盈率	decimal(9,4)	某种股票每股市价与每股盈利的比率	N
65	PB	市净率	decimal(9,4)	price/ book value,每股股价与每股净资产的比率	N
66	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	委买总量-委卖总量；委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
67	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交	N
68	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
69	Premium	溢价	decimal(9,4)	现价与每股净资产之差	N
70	PremiumRate	溢价率	decimal(9,4)	权证预留字段，基金衍生（（现价-净值）/净值）	Y
71	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	涨跌/昨收盘价	N

## 分时（SEL1\_TRDMIN\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码，包含股票、基金、债券、权证、指数。
2	ShortName	证券简称	nvarchar(20)	例如：浦发银行
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd，例如：20141120
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
5	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间的首条成交记录的最新成交价 LastPrice
6	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9,3)	分时段区间的末条成交记录的最新成交价 LastPrice
9	Volume	分时段内成交量	decimal(19,2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
10	Amount	分时段内成交金额	decimal(19,3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
11	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
12	Market	市场	varchar(5)	SZSE，表示深圳市场
13	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识

## 新高频数据说明书

14	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	股票、基金、债券、指数取昨收盘价，上市首日为发行价（昨收盘价等于发行价）
15	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
16	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
17	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时区间内的末条成交记录的成交总量
18	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数； 股票、基金合约乘数取 1；债券、指数不算该字段，填充 0
19	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
20	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
21	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数；股票、基金合约乘数取 1；债券、指数不算该字段，填充 0。
22	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价一，档位不够的填充 0
23	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价二，档位不够的填充 0
24	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价三，档位不够的填充 0
25	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价四，档位不够的填充 0
26	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价五，档位不够的填充 0
27	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价一，档位不够的填充 0
28	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价二，档位不够的填充 0
29	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价三，档位不够的填充 0
30	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价四，档位不够的填充 0
31	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价五，档位不够的填充 0
32	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量一，档位不够的填充 0
33	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量二，档位不够的填充 0
34	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量三，档位不够的填充 0
35	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量四，档位不够的填充 0
36	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量五，档位不够的填充 0
37	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量一，档位不够的填充 0
38	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量二，档位不够的填充 0
39	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量三，档位不够的填充 0
40	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量四，档位不够的填充 0
41	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量五，档位不够的填充 0

## 公告及增值信息 (SZL1\_BULLETIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和包头时间(交易所发包时间)合成。例如, 2018-01-02 08:57:21.820	H
3	ChannelNo	频道代码	int	频道代码	Y
4	NewsID	公告标识	nvarchar(8)	唯一标识, 空串表示公告概要, 公告概要会重复发送。可通过公告概要确定公告是否有遗漏或是修改。	Y
5	Headline	公告标题	nvarchar(400)	可能包含中文字符	Y
6	RawDataFormat	二进制数据格式	nvarchar(8)	二进制数据格式, 取值为 TXT、PDF、DOC 等	Y
7	RawDataLength	二进制数据长度	decimal(19,0)		Y
8	RawData	二进制数据	ntext	非 FAST 消息	Y
9	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应TradingTime与1970-01-01 00:00:00.000的毫秒差值再减去 8*3600	N
10	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳	N
11	SecurityID	证券 ID	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## L2

## 十档行情 (SZL2\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	nvarchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发)	H

## 新高频数据说明书

				的)合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	
4	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	上一交易日的收盘价（如有除权除息，为前复权后的收盘价）	Y
5	OpenPrice	开盘价	decimal(9,3)	该证券在当日的开盘价	Y
6	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
7	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
8	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
9	TotalNo	成交总笔数	decimal(9, 0)	开盘至当前时刻的累计成交笔数	Y
10	TradeNo	分笔期间成交笔数	decimal(9, 0)	当前成交总笔数(TotalNo <sub>t</sub> )-上一记录的成交总笔数(TradeNo <sub>t-1</sub> );首条记录取当前成交总笔数	N
11	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
12	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19, 2)	当前成交总量(TotalVolume <sub>t</sub> )-上一分笔的成交总量(TotalVolume <sub>t-1</sub> );首条记录取当前成交总量	N
13	TotalAmount	成交总额	decimal(19, 3)	开盘至当前时刻的累计成交金额	Y
14	TradeAmount	分笔期间成交金额	decimal(19, 3)	当前成交总额(TotalAmount <sub>t</sub> )-上一分笔的成交总额(TotalAmount <sub>t-1</sub> );首条记录取当前成交总额	N
15	PERatio1	市盈率 1	decimal(9, 4)	2 位小数 股票：价格/本年每股利润 债券：到期收益率 基金：每百份的 IOPV 或净值 权证：溢价率	Y
16	PERatio2	市盈率 2	decimal(9, 4)	2 位小数 股票：价格/上年每股利润 债券：每百元应计利息	Y
17	TotalSellOrderVolume	委托卖出总量	decimal(19, 2)	2011 年 9 月份前该字段为 0	Y
18	WtAvgSellPrice	加权平均委卖价	decimal(9, 3)	2011 年 9 月份前该字段为 0	Y
19	SellLevelNo	卖盘价位数	int		Y
20	SellPrice10	申卖价十	decimal(9, 3)	第 10 档委托卖出价	Y
21	SellPrice09	申卖价九	decimal(9, 3)	第 9 档委托卖出价	Y
22	SellPrice08	申卖价八	decimal(9, 3)	第 8 档委托卖出价	Y
23	SellPrice07	申卖价七	decimal(9, 3)	第 7 档委托卖出价	Y
24	SellPrice06	申卖价六	decimal(9, 3)	第 6 档委托卖出价	Y
25	SellPrice05	申卖价五	decimal(9, 3)	第 5 档委托卖出价	Y
26	SellPrice04	申卖价四	decimal(9, 3)	第 4 档委托卖出价	Y
27	SellPrice03	申卖价三	decimal(9, 3)	第 3 档委托卖出价	Y
28	SellPrice02	申卖价二	decimal(9, 3)	第 2 档委托卖出价	Y
29	SellPrice01	申卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
30	SellVolume10	申卖量十	decimal(19, 2)	第 10 档申卖量	Y
31	SellVolume09	申卖量九	decimal(19, 2)	第 9 档申卖量	Y
32	SellVolume08	申卖量八	decimal(19, 2)	第 8 档申卖量	Y
33	SellVolume07	申卖量七	decimal(19, 2)	第 7 档申卖量	Y
34	SellVolume06	申卖量六	decimal(19, 2)	第 6 档申卖量	Y

# 新高频数据说明书

35	SellVolume05	申卖量五	decimal(19, 2)	第 5 档申卖量	Y
36	SellVolume04	申卖量四	decimal(19, 2)	第 4 档申卖量	Y
37	SellVolume03	申卖量三	decimal(19, 2)	第 3 档申卖量	Y
38	SellVolume02	申卖量二	decimal(19, 2)	第 2 档申卖量	Y
39	SellVolume01	申卖量一	decimal(19, 2)	第 1 档申卖量	Y
40	TotalBuyOrderVolume	委托买入总量	decimal(19, 2)		Y
41	WtAvgBuyPrice	加权平均买入价	decimal(9, 3)	(元) 非债券代码适用	Y
42	BuyLevelNo	买盘价位数	int		Y
43	BuyPrice01	申买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
44	BuyPrice02	申买价二	decimal(9, 3)	第 2 档委托买入价	Y
45	BuyPrice03	申买价三	decimal(9, 3)	第 3 档委托买入价	Y
46	BuyPrice04	申买价四	decimal(9, 3)	第 4 档委托买入价	Y
47	BuyPrice05	申买价五	decimal(9, 3)	第 5 档委托买入价	Y
48	BuyPrice06	申买价六	decimal(9, 3)	第 6 档委托买入价	Y
49	BuyPrice07	申买价七	decimal(9, 3)	第 7 档委托买入价	Y
50	BuyPrice08	申买价八	decimal(9, 3)	第 8 档委托买入价	Y
51	BuyPrice09	申买价九	decimal(9, 3)	第 9 档委托买入价	Y
52	BuyPrice10	申买价十	decimal(9, 3)	第 10 档委托买入价	Y
53	BuyVolume01	申买量一	decimal(19, 2)	第 1 档申买量	Y
54	BuyVolume02	申买量二	decimal(19, 2)	第 2 档申买量	Y
55	BuyVolume03	申买量三	decimal(19, 2)	第 3 档申买量	Y
56	BuyVolume04	申买量四	decimal(19, 2)	第 4 档申买量	Y
57	BuyVolume05	申买量五	decimal(19, 2)	第 5 档申买量	Y
58	BuyVolume06	申买量六	decimal(19, 2)	第 6 档申买量	Y
59	BuyVolume07	申买量七	decimal(19, 2)	第 7 档申买量	Y
60	BuyVolume08	申买量八	decimal(19, 2)	第 8 档申买量	Y
61	BuyVolume09	申买量九	decimal(19, 2)	第 9 档申买量	Y
62	BuyVolume10	申买量十	decimal(19, 2)	第 10 档申买量	Y
63	UNIX	格林威治时刻	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
64	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳市场	N
65	PriceUpLimit	涨停价	decimal(15, 3)		Y
66	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)		Y
67	PriceUpdown1	涨跌一	decimal(9, 3)		Y
68	PriceUpdown2	涨跌二	decimal(9, 3)		Y
69	ClosePrice	今收盘价	decimal(9, 3)		Y
70	SecurityPhaseTag	当前品种交易状态	varchar(8)	产品所处的交易阶段代码： 第 0 位：S=启动（开市前）；O=开盘集合竞价； T=连续；B=休市； C=收盘集合竞价；E=已闭市；H=临时停牌；A=盘后交易；V=波动性中断 第 1 位：0=正常状态；1=全天停牌	Y

71	NAV	基金 T-1 日净值	decimal(9, 4)		Y
72	IOPV	基金实时参考净值	decimal(9, 4)		Y
73	PremiumRate	权证溢价率	decimal(9, 4)		Y
74	TotalBuyOrderNo01	委买笔数 1	decimal(9,0)	委买价 1 的委托总笔数	Y
75	TotalBuyOrderNo02	委买笔数 2	decimal(9,0)	委买价 2 的委托总笔数	Y
76	TotalBuyOrderNo03	委买笔数 3	decimal(9,0)	委买价 3 的委托总笔数	Y
77	TotalBuyOrderNo04	委买笔数 4	decimal(9,0)	委买价 4 的委托总笔数	Y
78	TotalBuyOrderNo05	委买笔数 5	decimal(9,0)	委买价 5 的委托总笔数	Y
79	TotalBuyOrderNo06	委买笔数 6	decimal(9,0)	委买价 6 的委托总笔数	Y
80	TotalBuyOrderNo07	委买笔数 7	decimal(9,0)	委买价 7 的委托总笔数	Y
81	TotalBuyOrderNo08	委买笔数 8	decimal(9,0)	委买价 8 的委托总笔数	Y
82	TotalBuyOrderNo09	委买笔数 9	decimal(9,0)	委买价 9 的委托总笔数	Y
83	TotalBuyOrderNo10	委买笔数 10	decimal(9,0)	委买价 10 的委托总笔数	Y
84	TotalSellOrderNo01	委卖笔数 1	decimal(9,0)	委卖价 1 的委托总笔数	Y
85	TotalSellOrderNo02	委卖笔数 2	decimal(9,0)	委卖价 2 的委托总笔数	Y
86	TotalSellOrderNo03	委卖笔数 3	decimal(9,0)	委卖价 3 的委托总笔数	Y
87	TotalSellOrderNo04	委卖笔数 4	decimal(9,0)	委卖价 4 的委托总笔数	Y
88	TotalSellOrderNo05	委卖笔数 5	decimal(9,0)	委卖价 5 的委托总笔数	Y
89	TotalSellOrderNo06	委卖笔数 6	decimal(9,0)	委卖价 6 的委托总笔数	Y
90	TotalSellOrderNo07	委卖笔数 7	decimal(9,0)	委卖价 7 的委托总笔数	Y
91	TotalSellOrderNo08	委卖笔数 8	decimal(9,0)	委卖价 8 的委托总笔数	Y
92	TotalSellOrderNo09	委卖笔数 9	decimal(9,0)	委卖价 9 的委托总笔数	Y
93	TotalSellOrderNo10	委卖笔数 10	decimal(9,0)	委卖价 10 的委托总笔数	Y
94	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102=深圳证券交易所 103=香港交易所	Y
95	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## 委托队列 (SZL2\_ORDERQUEUE\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm	H



## 新高频数据说明书

				由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	
4	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
5	Side	买卖方向	varchar(1)	1=Bidqueue; 2=Offerqueue	N
6	Price	委托价格	decimal(9, 3)	3 位小数	Y
7	Volume	委托量	decimal(19,2)	委买(卖)价 1 上的委托总量	Y
8	Numorders	最优价位上的总委托笔数	decimal(9,0)	委买(卖)价 1 上总委托笔数（可以超过 50）	Y
9	Noorders	揭示的委托笔数	decimal(9,0)	委托价格上揭示的委托量队列数，即委买(卖)价 1 上揭示的委托笔数。其小于等于 50，为 0 表示不揭示	Y
10	OrderVolume01	委托量 01	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，最早一笔还未成交或完全成交的委托中的未成交的委托量	Y
11	OrderVolume02	委托量 02	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 2 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
12	OrderVolume03	委托量 03	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 3 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
13	OrderVolume04	委托量 04	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 4 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
14	OrderVolume05	委托量 05	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 5 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
15	OrderVolume06	委托量 06	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 6 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
16	OrderVolume07	委托量 07	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 7 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
17	OrderVolume08	委托量 08	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 8 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
18	OrderVolume09	委托量 09	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 9 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
19	OrderVolume10	委托量 10	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 10 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
20	OrderVolume11	委托量 11	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 11 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
21	OrderVolume12	委托量 12	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 12 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
22	OrderVolume13	委托量 13	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 13 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
23	OrderVolume14	委托量 14	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 14 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
24	OrderVolume15	委托量 15	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 15 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
25	OrderVolume16	委托量 16	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 16 笔委托的委托量，无则以 0 填充	Y
26	OrderVolume17	委托量 17	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上，还未成交的第 17 笔委托的委托量，	Y

				无则以 0 填充	
27	OrderVolume18	委托量 18	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 18 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
28	OrderVolume19	委托量 19	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 19 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
29	OrderVolume20	委托量 20	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 20 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
30	OrderVolume21	委托量 21	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 21 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
31	OrderVolume22	委托量 22	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 22 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
32	OrderVolume23	委托量 23	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 23 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
33	OrderVolume24	委托量 24	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 24 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
34	OrderVolume25	委托量 25	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 25 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
35	OrderVolume26	委托量 26	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 26 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
36	OrderVolume27	委托量 27	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 27 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
37	OrderVolume28	委托量 28	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 28 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
38	OrderVolume29	委托量 29	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 29 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
39	OrderVolume30	委托量 30	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 30 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
40	OrderVolume31	委托量 31	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 31 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
41	OrderVolume32	委托量 32	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 32 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
42	OrderVolume33	委托量 33	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 33 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
43	OrderVolume34	委托量 34	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 34 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
44	OrderVolume35	委托量 35	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 35 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
45	OrderVolume36	委托量 36	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 36 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
46	OrderVolume37	委托量 37	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 37 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
47	OrderVolume38	委托量 38	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 38 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y

48	OrderVolume39	委托量 39	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 39 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
49	OrderVolume40	委托量 40	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 40 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
50	OrderVolume41	委托量 41	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 41 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
51	OrderVolume42	委托量 42	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 42 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
52	OrderVolume43	委托量 43	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 43 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
53	OrderVolume44	委托量 44	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 44 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
54	OrderVolume45	委托量 45	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 45 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
55	OrderVolume46	委托量 46	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 46 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
56	OrderVolume47	委托量 47	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 47 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
57	OrderVolume48	委托量 48	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 48 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
58	OrderVolume49	委托量 49	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 49 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
59	OrderVolume50	委托量 50	decimal(19,2)	在委买(卖)价 1 上, 还未成交的第 50 笔委托的委托量, 无则以 0 填充	Y
60	NoPriceLevel	买卖盘价位数量	int	开盘虚拟集合竞价、收盘集合竞价期间为 1 或 2; 连续竞价期间为 10; 其他时间为 0	Y
61	UNIX	格林威治时刻	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的 毫秒差值再减去 8*3600	N
62	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳	N
63	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## 指数行情 (SZL2\_INDEX\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的指数代码。	Y

2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
4	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(19,6)	上一交易日的收盘价	Y
5	OpenPrice	开盘价	decimal(19,6)	该证券在当日的开盘价	Y
6	HighPrice	最高价	decimal(19,6)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
7	LowPrice	最低价	decimal(19,6)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
8	LastPrice	最新成交价	decimal(19,6)		Y
9	TotalAmount	成交总额	decimal(19, 3)	参与计算相应指数的成交金额	Y
10	TotalNo	成交总笔数	decimal(9,0)	参与计算相应指数的成交笔数	Y
11	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	参与计算相应指数的交易数量	Y
12	UNIX	格林威治时刻	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
13	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳	N
14	SecurityPhaseTag	当前品种交易状态	varchar(8)	产品所处的交易阶段代码 第 0 位: S=启动(开市前); O=开盘集合竞价; T=连续; B=休市; C=收盘集合竞价; E=已闭市; H=临时停牌; A=盘后交易; V=波动性中断 第 1 位: 0=正常状态; 1=全天停牌	Y
15	SampleNo	样本个数	int	统计量指标样本个数	Y
16	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
17	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102=深圳证券交易所; 103=香港交易所	Y

## 逐笔委托 (SZL2\_ORDER\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	N
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和委托时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
4	SetID	频道代码	int	频道代码	Y
5	RecID	消息记录号	decimal(19,0)	从 1 开始计数, 同一频道代码下的所有 RecID 连续	Y
6	OrderPrice	委托价格	decimal(9,3)	3 位小数	Y

7	OrderVolume	委托数量	decimal(19,2)		Y
8	OrderType	订单类别	varchar(1)	1=市价 2=限价 U=本方最优	Y
9	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
10	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳	N
11	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102=深圳证券交易所 103=香港交易所	Y
12	OrderCode	委托买卖方向	varchar(1)	1=买 2=卖 G=借入 F=出借	Y
13	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N

## 逐笔成交 (SZL2\_TRADE\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码，包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和成交时间（交易所直接下发的）合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
4	BuyOrderID	买方委托索引	decimal(19,0)	从 1 开始计数，0 表示无对应委托	Y
5	SellOrderID	卖方委托索引	decimal(19,0)	从 1 开始计数，0 表示无对应委托	Y
6	TradePrice	成交价格	decimal(9,3)		Y
7	TradeVolume	成交数量	decimal(19,2)		Y
8	TradeType	成交类型	varchar(1)	4=撤销，主动或自动撤单执行报告； F=成交，成交执行报告	Y
9	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
10	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳	N
11	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
12	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102=深圳证券交易所；103=香港交易所	Y
13	SetID	频道代码	int	频道代码	Y
14	RecID	消息记录号	decimal(19,0)	从 1 开始计数，同一频道代码下的所有 RecID 连续	Y

## 静态数据 (SZL2\_STOCKINFO\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码, 包含股票、基金、债券、权证、指数。	Y
2	SecurityName	证券名称	nvarchar(40)		Y
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0) 由交易当天日期和采集时间(数据到达时我们系统记录的时间)合成	H
5	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102 = 深圳证券交易所	Y
6	SecurityEN	证券英文简称	varchar(40)		Y
7	ISINCode	ISIN 代码	varchar(12)		Y
8	SymbolUnderlying	基础证券代码	varchar(20)		Y
9	UnderlyingSecurityIDSource	基础证券代码源	varchar(5)	102 = 深圳证券交易所	Y
10	SecurityType	证券类别代码	int	1 主板 A 股; 2 中小板股票; 3 创业板股票; 4 主板 B 股; 5 国债 (含地方债); 6 企业债; 7 公司债; 8 可转债; 9 私募债; 10 可交换私募债; 11 证券公司次级债; 12 质押式回购; 13 资产支持证券; 14 本市场股票 ETF; 15 跨市场 ETF; 16 跨境 ETF; 17 本市场实物债券 ETF; 18 现金债券 ETF; 19 黄金 ETF; 20 货币 ETF; 21 (预留) 杠杆 ETF; 22 (预留) 商品期货 ETF; 23 标准 LOF; 24 分级子基金; 25 封闭式基金; 26 仅申赎基金; 28 权证; 29 个股期权; 30 ETF 期权; 33 优先股; 34 证券公司短期债; 35 可交换公司债	Y
11	SecurityStatusTag	证券状态标识	varchar(20)	该字段为 20 位字符串 (后六位备用), 每位表示特定的含义, “1” 表示位数有业务意义, “0” 表示该位数无业务意义。第 1 位对应: “1” 表示停牌; 第 2 位对应: “1” 表示除权; 第 3 位对应: “1” 表示除息; 第 4 位对应: “1” 表示 ST; 第 5 位对应: “1” 表示 *ST; 第 6	Y

## 新高频数据说明书

				位对应：“1”表示上市首日；第 7 位对应：“1”表示公司再融资；第 8 位对应：“1”表示恢复上市首日；第 9 位对应：“1”表示网络投票；第 10 位对应：“1”表示退市整理期；第 12 位对应：“1”表示增发股份上市；第 13 位对应：“1”表示合约调整；第 14 位对应：“1”表示暂停上市后协议转让。	
12	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(11,5)	上一交易日的收盘价格（如有除权除息，为除权除息后的收盘价）；对于货币市场基金实时申赎，取值为 0.010	Y
13	ListingDate	上市日期	int		Y
14	Currency	币种	varchar(5)	币种 CNY = 人民币 HKD = 港币	Y
15	ParValue	每股面值	decimal(9,3)		Y
16	IssuedVolume	总发行量	decimal(19,2)		Y
17	OutstandingShare	流通股数	decimal(19,2)		Y
18	IndustryType	行业种类	varchar(5)		Y
19	PreYearEPS	上年每股利润	decimal(9,4)		Y
20	YearEPS	本年每股利润	decimal(9,4)		Y
21	OfferingFlag	收购(转股、行权)标志	varchar(1)	股票：要约收购； 债券、优先股：转股回售； Y=是，=否	Y
22	NAV	基金 T-1 日累计净值	decimal(9,4)		Y
23	CouponRate	票面利率	decimal(9,4)		Y
24	IssuePrice	贴现发行价	decimal(9,4)		Y
25	Interest	每百元应计利息	decimal(12,8)	对于优先股：8 位小数，0.0000 表示浮动股息率	Y
26	InterestAccrualDate	起息日	int		Y
27	MaturityDate	到期交割日	int		Y
28	ConversionPrice	行权价格	decimal(11,4)		Y
29	ConversionRatio	行权比例	decimal(10,4)		Y
30	ConversionBeginDate	行权开始日	int		Y
31	ConversionEndDate	行权结束日	int		Y
32	CallOrPut	认购认沽	varchar(1)	C = Call; P = Put	Y
33	WarrantClearingType	权证结算方式	varchar(1)	S = 证券结算 C = 现金结算	Y
34	ClearingPrice	结算价格	decimal(11,4)	适用于权证	Y
35	OptionType	行权类型	varchar(1)	A = 美式 E = 欧式 B = 百慕大式	Y
36	EndDate	最后交易日	int		Y
37	ExpirationDays	购回期限	int		Y

38	DayTrading	回转交易标志	varchar(1)	是否支持当日回转交易： Y=支持 N=不支持	Y
39	GageFlag	保证金证券标志	varchar(1)	是否可作为融资融券可充抵保证金证券： Y=是 N=否	Y
40	GageRate	担保品折算率	decimal(9,4)		Y
41	CrdBuyUnderlying	融资标的标志	varchar(1)	Y=是；N=否	Y
42	CrdSellUnderlying	融券标的标志	varchar(1)	Y=是；N=否	Y
43	CrdPriceCheckType	提价检查方式	varchar(2)	0=不检查；1=不低于最近成交价；2=不低于昨收盘价；3=不低于最高叫买；4=不低于最低叫卖	Y
44	PledgeFlag	质押入库标志	varchar(1)	是否可质押入库:Y=是 N=否	Y
45	ContractMultiplier	债券折合回购标准券比例	decimal(9,4)		Y
46	RegularShare	对应回购标准券	varchar(8)		Y
47	QualificationFlag	投资者适当性管理标志	varchar(1)	是否需要对该证券作投资者适当性管理 Y=是 N=否	Y
48	MarketMakerFlag	做市商标志	varchar(1)	标识是否有做市商 Y=是 N=否	Y
49	RoundLot	整手数	decimal(19,2)	2 位有效小数位。对于某一证券申报的委托, 其委托数量字段必须为该证券数量单位的整数倍	Y
50	TickSize	最小报价单位	decimal(9,3)		Y
51	BuyQtyUpperLimit	买数量上限	decimal(19,2)	2 位有效小数位。买委托数量的上限	Y
52	SellQtyUpperLimit	卖数量上限	decimal(19,2)	2 位有效小数位。卖委托数量的上限	Y
53	BuyVolumeUnit	买数量单位	decimal(19,2)	2 位有效小数位。每笔买委托的委托数量必须是买数量单位的整数倍	Y
54	SellVolumeUnit	卖数量单位	decimal(19,2)	2 位有效小数位。每笔卖委托的委托数量必须是卖数量单位的整数倍	Y
55	LimitUpRateO	开盘集合竞价上涨幅度	decimal(9,3)		Y
56	LimitDownRateO	开盘集合竞价下跌幅度	decimal(9,3)		Y
57	LimitUpAbsoluteO	开盘集合竞价上涨限价	decimal(9,3)	预留字段, 深交所未有实际应用	Y
58	LimitDownAbsoluteO	开盘集合竞价下跌限价	decimal(9,3)	预留字段, 深交所未有实际应用	Y
59	AuctionUpDownRateO	开盘集合竞价有效范围涨跌幅度	decimal(9,3)		Y
60	AuctionUpDownAbsoluteO	开盘集合竞价有效范围涨跌幅价格	decimal(9,3)		Y
61	LimitUpRateT	连续竞价上涨幅度	decimal(9,3)		Y
62	LimitDownRateT	连续竞价下跌幅度	decimal(9,3)		Y
63	LimitUpAbsoluteT	连续竞价上涨限价	decimal(9,3)	预留字段, 深交所未有实际应用	Y
64	LimitDownAbsoluteT	连续竞价下跌限价	decimal(9,3)	预留字段, 深交所未有实际应用	Y
65	AuctionUpDownRateT	连续竞价有效范围涨跌幅度	decimal(9,3)		Y
66	AuctionUpDownAbsolute	连续竞价有效范围涨跌幅价	decimal(9,3)		Y



	oluteT	格			
67	LimitUpRateC	收盘集合竞价上涨幅度	decimal(9,3)		Y
68	LimitDownRateC	收盘集合竞价下跌幅度	decimal(9,3)		Y
69	LimitUpAbsoluteC	收盘集合竞价上涨限价	decimal(9,3)	预留字段，深交所未有实际应用	Y
70	LimitDownAbsoluteC	收盘集合竞价下跌限价	decimal(9,3)	预留字段，深交所未有实际应用	Y
71	AuctionUpDownRateC	收盘集合竞价有效范围涨跌幅度	decimal(9,3)		Y
72	AuctionUpDownAbsoluteC	收盘集合竞价有效范围涨跌幅价格	decimal(9,3)		Y
73	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
74	Market	市场	varchar(5)	SZSE 表示深圳市场	N

## 证券状态 (SZL2\_STOCKSTATUS\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	深交所公布的各类证券品种代码，包含股票、基金、债券、权证。	Y
2	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	Y
3	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
4	CrdBuyStatus	当前融资开放状态	varchar(1)	适用于融资标的证券。1=是,0=否,空格无意义	Y
5	CrdSellStatus	当前融券开放状态	varchar(1)	适用于融券标的证券。1=是,0=否,空格无意义	Y
6	SubScribeStatus	申购标志	varchar(1)	适用于 ETF,LOF 等开放式基金,对于黄金 ETF 是指现金申购。1=是,0=否,空格无意义	Y
7	RedemptionStatus	赎回标志	varchar(1)	适用于 ETF,LOF 等开放式基金,对于黄金 ETF 是指现金赎回开关。1=是,0=否,空格无意义	Y
8	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应TradingTime与1970-01-01 00:00:00.000的毫秒差值再减去 8*3600	N
9	Market	市场	varchar(4)	SZSE 表示深圳	N
10	SymbolSource	证券代码源	varchar(5)	102=深圳证券交易所 103=香港交易所	Y
11	FinancialStatus	证券状态信息	varchar(8)	A=上市公司早间披露提示	Y

				B=上市公司午间披露提示 每个字节揭示一种状态,最多可同时揭示八种状态	
12	PurchasingStatus	认购标志	varchar(1)	适用于网上发行认购。1=是,0=否,空格无意义	Y
13	StockDiviStatus	转股标志	varchar(1)	适用于处于转股回售期的可转债。 1=是,0=否,空格无意义	Y
14	PutableStatus	回售标志	varchar(1)	适用于处于转股回售期的可转债。 1=是,0=否,空格无意义	Y
15	ExerciseStatus	行权标志	varchar(1)	适用于处于行权期的权证。1=是,0=否,空格无意义	Y
16	GoldPurchase	黄金 ETF 实物 申购标志	varchar(1)	适用于黄金 ETF 实物申购。1=是,0=否,空格无意义	Y
17	GoldRedemption	黄金 ETF 实物 赎回标志	varchar(1)	适用于黄金 ETF 实物赎回。1=是,0=否,空格无意义	Y
18	AcceptedStatus	预受要约标志	varchar(1)	适用于处于要约收购期的股票。1=是,0=否,空格无意义	Y
19	ReleaseStatus	解除要约标志	varchar(1)	适用于处于要约收购期的股票。1=是,0=否,空格无意义	Y
20	CancStockDiviStatus	转股撤单标志	varchar(1)	适用于处于转股回售期的可转债。1=是,0=否,空格无意义	Y
21	CancPutableStatus	回售撤单标志	varchar(1)	适用于处于转股回售期的可转债。1=是,0=否,空格无意义	Y
22	PledgeStatus	质押标志	varchar(1)	适用于质押式回购可质押入库证券。1=是,0=否,空格无意义	Y
23	RemovePledge	解押标志	varchar(1)	适用于质押式回购可质押入库证券。1=是,0=否,空格无意义	Y
24	VoteStatus	表决权标志	varchar(1)	适用于优先股。1=是,0=否,空格无意义	Y
25	StockPledgeRepo	股票质押式回 购标志	varchar(1)	适用于可开展股票质押式回购业务的证券。1=是,0=否,空格无意义	Y
26	DivideStatus	实时分拆标志	varchar(1)	适用于分级基金。1=是,0=否,空格无意义	Y
27	MergerStatus	实时合并标志	varchar(1)	适用于分级基金。1=是,0=否,空格无意义	Y
28	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

### 三、中金所

#### 股指期货 L2

#### 分笔 (FFL2\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
3	Symbol	合约代码	varchar(6)	以中金所公布股指期货合约代码为准	Y
4	OpenPrice	今开盘价	decimal(9, 3)	该合约在本交易日的开盘价	Y
5	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
6	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
7	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
8	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约在本交易日的结算价,采用本交易日最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价	Y
9	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的结算价,采用上一交易日最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价	Y
10	ClosePrice	今收盘价	decimal(9, 3)	今日收盘价	Y
11	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)		Y
12	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,0)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交量。	N
13	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻该合约的累计成交量	Y
14	TradeAmount	分笔期间成交金额	decimal(19, 3)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交额	N
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19, 3)	开盘至当前时刻该合约的累计成交金额	Y
16	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19, 2)	上一交易日收盘时刻该合约的未平仓量	Y
17	TotalPosition	持仓量	decimal(19, 2)	当前观测时点的持仓量	Y
18	PrePositionChange	日增仓	decimal(19, 2)	持仓量-昨持仓量	N
19	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)	该合约在本交易日的最高报价; 正常交易日为前一交易日结算价*(1+10%);	Y

				季月合约上市首日为挂盘基准价*(1+20%); 最后交易日为前一交易日结算价*(1+20%)。	
20	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)	该合约在本交易日的最低报价; 正常交易日为前一交易日结算价*(1-10%); 季月合约上市首日为挂盘基准价*(1-20%); 最后交易日为前一交易日结算价*(1-20%)。	Y
21	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; NULL: 无法判断	N
22	OpenClose	开平仓性质	Nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态: 双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
23	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
24	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	第 2 档委托买入价, 低于第 1 档委托买入价	Y
25	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	第 3 档委托买入价, 低于第 2 档委托买入价	Y
26	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	第 4 档委托买入价, 低于第 3 档委托买入价	Y
27	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	第 5 档委托买入价, 低于第 4 档委托买入价	Y
28	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
29	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	第 2 档委托卖出价, 高于第 1 档委托卖出价	Y
30	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	第 3 档委托卖出价, 高于第 2 档委托卖出价	Y
31	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	第 4 档委托卖出价, 高于第 3 档委托卖出价	Y
32	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	第 5 档委托卖出价, 高于第 4 档委托卖出价	Y
33	BuyVolume01	买量一	decimal(19, 2)	以买价一委托买入的数量	Y
34	BuyVolume02	买量二	decimal(19, 2)	以买价二委托买入的数量	Y
35	BuyVolume03	买量三	decimal(19, 2)	以买价三委托买入的数量	Y
36	BuyVolume04	买量四	decimal(19, 2)	以买价四委托买入的数量	Y
37	BuyVolume05	买量五	decimal(19, 2)	以买价五委托买入的数量	Y
38	SellVolume01	卖量一	decimal(19, 2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
39	SellVolume02	卖量二	decimal(19, 2)	以卖价二委托卖出的数量	Y
40	SellVolume03	卖量三	decimal(19, 2)	以卖价三委托卖出的数量	Y
41	SellVolume04	卖量四	decimal(19, 2)	以卖价四委托卖出的数量	Y
42	SellVolume05	卖量五	decimal(19, 2)	以卖价五委托卖出的数量	Y
43	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	预留字段。该合约在本交易日的 Delta, Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
44	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	预留字段。该合约在上一交易日的 Delta Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
45	SettleGroupID	结算组代码	varchar(9)	股指期货结算组	Y
46	SettleID	结算编号	decimal(9, 0)		Y
47	Change	涨跌	decimal(9,3)	最新成交价-昨结算价	N
48	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
49	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	沪深 300 交易代码 IF, 上证 50 交易代码 IH, 中证 500 交易代码 IC, 连续合约包括四种, L1, L2, L3,	N

				L4, 连续合约代码为“交易代码+连续合约”, 如 IFL1,IFL2,IFL3,IFL4	
50	Market	市场	varchar(5)	默认为 CFFEX, 即中国金融期货交易所	N
51	UNIX	格林威治时刻	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
52	PositionChange	仓差	decimal(19, 2)	当前持仓量 [TotalPosition(t)]- 上一分笔的持仓量 [TotalPosition(t-1)]; 当日首条分笔仓差为 0	N
53	ContinueSignName	连续合约名称	nvarchar(6)	代码 L1,L2,L3,L4 分别对应:当月连续,下月连续,下季连续, 隔季连续	N
54	SecurityID	证券统一编码	decimal(19, 0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
55	ShortName	证券简称	nvarchar(20)		N
56	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	成交总额/成交总量/合约乘数, 没有成交则显示昨收盘价	N
57	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量); 委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。 委比的取值自-100%到+100%, 如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
58	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	委买总量-委卖总量; 委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
59	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
60	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标, 计算公式: 当日分钟均量(当前成交总量/当前交易分钟数)/前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数, 例如出现 09:31:01 就按两分钟算; 09:30:00 按一分钟算。	N
61	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交	N
62	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N

## 分时 (FFL2\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
3	Symbol	合约代码	varchar(6)	以中金所公布股指期货合约代码为准

4	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9, 3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价 LastPrice
5	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9, 3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价 LastPrice
6	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9, 3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9, 3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	Change	涨跌	decimal(9, 3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
9	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
10	Position	持仓量	decimal(19, 2)	分时段区间内最后一笔分笔的持仓量
11	Volume	分时段内成交量	decimal(19, 2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
12	Amount	分时段内成交金额	decimal(19, 3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
13	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	沪深 300 交易代码 IF, 上证 50 交易代码 IH, 中证 500 交易代码 IC, 连续合约包括四种, L1, L2, L3, L4, 连续合约代码为“交易代码+连续合约”, 如 IFL1,IFL2,IFL3,IFL4
14	Market	市场	varchar(5)	默认为 CFFEX, 即中国金融期货交易所
15	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
16	ContinueSignName	连续合约名称	Nvarchar(6)	代码 L1,L2,L3,L4 分别对应:当月连续,下月连续,下季连续, 隔季连续
17	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	取分时段区间内的末条成交记录的成交总量
18	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount/Volume/合约乘数
19	SecurityID	证券统一编码	decimal(19, 0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识
20	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	为昨结算价, 上市首日为挂牌基准价
21	ShortName	证券简称	nvarchar(20)	
22	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的最低价 LowPrice
23	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的最高价 HighPrice
24	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
25	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价一
26	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价二
27	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价三
28	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价四
29	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价五
30	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价一
31	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价二

32	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价三
33	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价四
34	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价五
35	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量一
36	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量二
37	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量三
38	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量四
39	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量五
40	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量一
41	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量二
42	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量三
43	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量四
44	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量五
45	Return	简单收益率	decimal(9,4)	( 分时段内收盘价-昨结算价 ) / 昨结算价

## 国债期货 L2

### 分笔 (TFL2\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
3	Symbol	合约代码	varchar(6)	以中金所公布国债期货合约代码为准	Y

4	OpenPrice	今开盘价	decimal(9, 3)	该合约在本交易日的开盘价	Y
5	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
6	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
7	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
8	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约在本交易日的结算价,采用本交易日最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价	Y
9	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的结算价,采用上一交易日最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价	Y
10	ClosePrice	今收盘价	decimal(9, 3)	今日收盘价	Y
11	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的收盘价	Y
12	TradeVolume	分 笔 期 间 成 交 量	decimal(19,0)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交量.	N
13	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻该合约的累计成交量	Y
14	TradeAmount	分 笔 期 间 成 交 金 额	decimal(19, 3)	上一条记录至本条记录(即相邻两个观测时点)期间所发生的成交额	N
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19, 3)	开盘至当前时刻该合约的累计成交金额	Y
16	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19, 2)	上一交易日收盘时刻该合约的未平仓量	Y
17	TotalPosition	持仓量	decimal(19, 2)	当前观测时点的持仓量	Y
18	PrePositionChange	日增仓	decimal(19, 2)	持仓量-昨持仓量	N
19	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)		Y
20	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)		Y
21	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; NULL: 无法判断	N
22	OpenClose	开平仓性质	Nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态: 双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
23	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
24	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	第 2 档委托买入价, 低于第 1 档委托买入价	Y
25	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	第 3 档委托买入价, 低于第 2 档委托买入价	Y
26	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	第 4 档委托买入价, 低于第 3 档委托买入价	Y
27	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	第 5 档委托买入价, 低于第 4 档委托买入价	Y
28	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
29	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	第 2 档委托卖出价, 高于第 1 档委托卖出价	Y
30	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	第 3 档委托卖出价, 高于第 2 档委托卖出价	Y
31	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	第 4 档委托卖出价, 高于第 3 档委托卖出价	Y
32	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	第 5 档委托卖出价, 高于第 4 档委托卖出价	Y
33	BuyVolume01	买量一	decimal(19, 2)	以买价一委托买入的数量	Y
34	BuyVolume02	买量二	decimal(19, 2)	以买价二委托买入的数量	Y
35	BuyVolume03	买量三	decimal(19, 2)	以买价三委托买入的数量	Y
36	BuyVolume04	买量四	decimal(19, 2)	以买价四委托买入的数量	Y
37	BuyVolume05	买量五	decimal(19, 2)	以买价五委托买入的数量	Y



## 新高频数据说明书

38	SellVolume01	卖量一	decimal(19, 2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
39	SellVolume02	卖量二	decimal(19, 2)	以卖价二委托卖出的数量	Y
40	SellVolume03	卖量三	decimal(19, 2)	以卖价三委托卖出的数量	Y
41	SellVolume04	卖量四	decimal(19, 2)	以卖价四委托卖出的数量	Y
42	SellVolume05	卖量五	decimal(19, 2)	以卖价五委托卖出的数量	Y
43	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	预留字段。该合约在本交易日的 Delta Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
44	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	预留字段。该合约在上一交易日的 Delta Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
45	SettleGroupID	结算组代码	varchar(9)	国债期货结算组	Y
46	SettleID	结算编号	decimal(9, 0)		Y
47	Change	涨跌	decimal(9,3)	最新成交价-昨结算价	N
48	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
49	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	五年期国债交易代码 TF, 十年期国债交易代码 T, 连续合约包括 L1, L2, L3, 连续合约代码为“交易代码+连续合约”, 如 TFL1,TFL2,TFL3	N
50	Market	市场	varchar(5)	默认为 CFFEX, 即中国金融期货交易所	N
51	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
52	PositionChange	仓差	decimal(19, 2)	当前持仓量 [TotalPosition(t)]- 上一分笔的持仓量 [TotalPosition(t-1)]; 当日首条分笔仓差为 0	N
53	ContinueSignName	连续合约名称	nvarchar(6)	代码 L1,L2,L3 分别对应当季连续, 下季连续, 隔季连续	N
54	SecurityID	证券统一编码	decimal(19, 0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
55	ShortName	证券简称	nvarchar(20)		N
56	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	成交总额/成交总量/合约乘数, 没有成交则显示昨收盘价	N
57	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。 委比的取值自-100%到+100%, 如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
58	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	委买总量-委卖总量; 委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
59	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
60	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标, 计算公式: 当日分钟均量(当前成交总量/当前交易分钟数)/前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时刻分钟数, 例如出现 09:31:01 就按两分钟算; 09:30:00 按一分钟算。	N
61	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家	N

				的买入价卖出成交。	
62	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N

## 分时 (TFL2\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
3	Symbol	合约代码	varchar(6)	以中金所公布国债期货合约代码为准
4	OpenPrice	分时段开盘价	decimal(9, 3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价 LastPrice
5	ClosePrice	分时段收盘价	decimal(9, 3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价 LastPrice
6	HighPrice	分时段最高价	decimal(9, 3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段最低价	decimal(9, 3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	Change	涨跌	decimal(9, 3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
9	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
10	Position	持仓量	decimal(19, 2)	分时段区间内最后一笔分笔的持仓量
11	Volume	分时段成交量	decimal(19, 2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
12	Amount	分时段成交金额	decimal(19, 3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
13	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	五年期国债交易代码 TF, 十年期国债交易代码 T, 连续合约包括 L1, L2, L3, 连续合约代码为“交易代码+连续合约”, 如 TFL1, TFL2, TFL3
14	Market	市场	varchar(5)	CFFEX, 即中国金融期货交易所
15	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
16	ContinueSignName	连续合约名称	Nvarchar(6)	代码 L1, L2, L3 分别对应当季连续, 下季连续, 隔季连续
17	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	取分时段区间内的末条成交记录的成交总量
18	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount/Volume/合约乘数
19	SecurityId	证券统一编码	decimal(19, 0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识
20	BenchmarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	为昨结算价, 上市首日为挂牌基准价
21	ShortName	证券简称	nvarchar(20)	
22	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的最低价 LowPrice
23	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的最高价 HighPrice

	ce			
24	CumulativeVWAP	开盘至今交易量 加权平均价	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
25	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价一
26	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价二
27	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价三
28	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价四
29	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的买价五
30	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价一
31	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价二
32	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价三
33	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价四
34	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的卖价五
35	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的买量一
36	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的买量二
37	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的买量三
38	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的买量四
39	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的买量五
40	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的卖量一
41	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的卖量二
42	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的卖量三
43	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的卖量四
44	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19, 2)	本分时区间最后一条分笔的卖量五
45	Return	简单收益率	decimal(9,4)	( 分时段内收盘价-昨结算价 ) / 昨结算价

## 四、大商所

### 大商所商品期货 L1

#### 分笔 (MFL1\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
----	-----	----	------	----	--------

1	Symbol	合约代码	varchar(6)		Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)		Y
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成，例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19, 2)	当前成交总量(TotalVolumet)-上一分笔的成交总量(TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	某一合约在当日交易期间所有成交合约的双边数量，包含作为套利合约的单腿成交的成交量。	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19, 2)	某交易日某一期货合约交易期间的即时成交双边数量，包含作为套利合约的单腿成交的成交量。	Y
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19, 2)	上一交易日结算后，期货交易者所持有的未平仓合约的双边数量	Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19, 2)	某交易日某一期货合约交易期间期货交易者所持有的未平仓合约的双边数量。	Y
14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19, 2)	持仓量-昨持仓量	Y
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19, 3)	某一合约在当日交易期间所有成交合约的双边金额，包含作为套利合约的单腿成交的成交额。	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19, 3)	当前成交总额(TotalAmountt)-上一分笔的成交总额(TotalAmountt-1);首条记录取当前成交总额	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)	当前交易日价格涨幅的上限。	Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)	当前交易日价格跌幅的下限。	Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)		Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9, 3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9, 3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约当天结算价	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y

26	AveragePrice01	成交均价 01	decimal(9, 3)	AveragePrice01=成交总额/成交总量/合约乘数, 其小数位不同合约处理方法不同(需要具体合约具体分析), 例如在 2018.5.15 日 b1809 是直接取整, 而 jm1809 是当小数位 $\geq 0.5$ 时小数位取 0.500, 当小数位 $< 0.5$ 时小数位取 0.000。 因成交总量和成交总额包括套利定单的成交, 但套利定单直接成交不更新最新成交价、最高价、最低价, 故可能出现均价在最高价和最低价之外。	Y
27	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	以 AveragePrice01 填充, 即 AveragePrice=AveragePrice01	N
28	BidImpleQty	申买推导量	decimal(19, 2)	大商所独有字段, 和套利合约有关	Y
29	AskImpleQty	申卖推导量	decimal(19, 2)	大商所独有字段, 和套利合约有关	Y
30	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; N: 无法判断	N
31	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
32	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
33	SellVolume01	卖量一	decimal(19, 2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
34	BuyVolume01	买量一	decimal(19, 2)	以买价一委托买入的数量	Y
35	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
36	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
37	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
38	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
39	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
40	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
41	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
42	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
43	SellVolume05	卖量五	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
44	SellVolume04	卖量四	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
45	SellVolume03	卖量三	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
46	SellVolume02	卖量二	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
47	BuyVolume02	买量二	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
48	BuyVolume03	买量三	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
49	BuyVolume04	买量四	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
50	BuyVolume05	买量五	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
51	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	预留字段。该合约在上一交易日的 Delta Delta=期权价格变化/期货价格变化	N

52	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	预留字段。该合约在本交易日的 Delta, Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
53	Change	涨跌	decimal(9, 3)	最新成交价-昨结算价	N
54	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
55	Varieties	品种	nvarchar(8)		N
56	ContinueSign	连续合约代码	nvarchar(8)	当月交割为 L0,下月交割为 L1,以此类推	N
57	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
58	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
59	OpenClose	开平仓性质	nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态：双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
60	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
61	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标，计算公式： 当日分钟均量(当前成交总量/当前交易分钟数)/前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数，例如出现 09:31:01 就按两分钟算；09:30:00 按一分钟算。	N
62	OrderDiff	委差	decimal(19, 2)	委买总量-委卖总量；委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
63	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买 1 档的委托量，委卖总量是当前委卖 1 档的委托量。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
64	SellVOL	内盘	decimal(19, 2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交。	N
65	BuyVOL	外盘	decimal(19, 2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
66	PositionChange	仓差	decimal(19, 2)	当前持仓量[TotalPosition(t)]-上一分笔的持仓量[TotalPosition(t-1)]；当日首条分笔仓差为 0	N
67	DeliverySettlePrice	当日交割结算价	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N

## 分时 (MFL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识
2	Symbol	合约代码	varchar(6)	根据交易所公布的商品期货合约代码为准
3	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	例如: 豆一 1903
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120
5	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
6	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	取昨结算价, 上市首日填挂牌基准价
7	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
8	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
9	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
10	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
11	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价一
12	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价二(大商所不提供), 填充 0
13	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价三(大商所不提供), 填充 0
14	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价四(大商所不提供), 填充 0
15	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价五(大商所不提供), 填充 0
16	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的卖价一
17	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的卖价二(大商所不提供), 填充 0
18	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的卖价三(大商所不提供), 填充 0
19	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的卖价四(大商所不提供), 填充 0
20	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的卖价五(大商所不提供), 填充 0
21	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的买量一
22	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的买量二(大商所不提供), 填充 0
23	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的买量三(大商所不提供), 填充 0
24	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的买量四(大商所不提供), 填充 0
25	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的买量五(大商所不提供), 填充 0
26	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的卖量一
27	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的卖量二(大商所不提供), 填充 0
28	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的卖量三(大商所不提供), 填充 0
29	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	分时段区间最后一条分笔的卖量四(大商所不提供), 填充 0

30	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量五(大商所不提供), 填充 0
31	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
32	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
33	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时区间内的末条成交记录的成交总量
34	Volume	分时段成交量	decimal(19,2)	分时区间内成交记录的成交量之和
35	Amount	分时段成交金额	decimal(19,3)	分时区间内成交记录的成交金额之和
36	Position	分时持仓量	decimal(19,2)	分时区间内最后一笔分笔的持仓量
37	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
38	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE
39	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数
40	Varieties	品种	nvarchar(8)	
41	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	把每个合约都分配了一个连续合约。 L0 表示当月交割合约 (离交割日最近合约), L1 表示下一个交割的合约, L2 表示下下个交割的合约, 以此类推
42	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
43	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
44	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时段最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
45	Return	简单收益率	decimal(9,4)	简单收益率= (分时段收盘价-昨结算价) / 昨结算价

## 套利行情 (MFL1\_ARBI\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y



2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成, 例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
3	Symbol	套利合约号	varchar(20)		Y
4	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
5	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
6	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
7	LifeLow	历史最低价	decimal(9,3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
8	LifeHigh	历史最高价	decimal(9,3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y
9	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9,3)	第一个合约涨停板价 - 第二个合约跌停板价	Y
10	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9,3)	第一个合约跌停板价 - 第二个合约涨停板价	Y
11	BuyPrice01	申买价	decimal(9,3)	当日买方申请套利定单买入的即时最高价格	Y
12	BuyVolume01	申买量	decimal(19,2)	当日交易所交易系统中未成交的最高价位申请买入的套利定单的下单数量。	Y
13	SellPrice01	申卖价	decimal(9,3)	当日卖方申请套利定单卖出的即时最低价格	Y
14	SellVolume01	申卖量	decimal(19,2)	当日交易所交易系统中未成交的最低价位申请卖出的套利定单的下单数量。	Y
15	Market	交易所	varchar(5)	大商所 DCE	N
16	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
17	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N

## 大商所商品期货 L2

## 分笔 (MFL2\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	以商品交易所公布商品期货合约代码为准	Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	商品期货合约的中文简称	Y
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
5	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	当前成交总量(TotalVolumet)-上一分笔的成交总量(TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	某一合约在当日交易期间所有成交合约的双边数量, 包含作为套利合约的单腿成交的成交量。	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19,2)	某交易日某一期货合约交易期间的即时成交双边数量, 包含作为套利合约的单腿成交的成交量。	Y
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19,2)	上一交易日结算后, 期货交易者所持有的未平仓合约的双边数量	Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19,2)	某交易日某一期货合约交易期间期货交易者所持有的未平仓合约的双边数量。	Y
14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19,2)	持仓量-昨持仓量	Y
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	某一合约在当日交易期间所有成交合约的双边金额, 包含作为套利合约的单腿成交的成交额。	Y

16	TradeAmount	分笔期间成交金额	decimal(19,3)	当前成交总额(TotalAmount <sub>t</sub> )-上一分笔的成交总额(TotalAmount <sub>t-1</sub> )；首条记录取当前成交总额	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9,3)	当前交易日价格涨幅的上限。	Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9,3)	当前交易日价格跌幅的下限。	Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9,3)	上一交易日的结算价	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9,3)	当前交易日的首笔成交价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9,3)	当前交易日的末笔成交价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9,3)	采用当日最后一小时交易价格的算术平均值,未收盘时一直为 0	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9,3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
25	LifeHigh	历史最高价	decimal(9,3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y
26	AveragePrice	当日均价	decimal(9,3)	AveragePrice =成交总额/成交总量/合约乘数, 其小数位不同合约处理方法不同(需要具体合约具体分析), 例如在 2018.5.15 日 b1809 是直接取整, 而 jm1809 是当小数位 $\geq 0.5$ 时小数位取 0.500, 当小数位 $< 0.5$ 时小数位取 0.000。 因成交总量和成交总额包括套利定单的成交,但套利定单直接成交不更新最新成交价、最高价、最低价, 故可能出现均价在最高价和最低价之外。	Y
27	Nolevel	深度行情数量	int	深度行情数量=深度买行情数量+深度卖行情数量	Y
28	BuyOrSell	买卖方向	varchar (1)	N=无法判断; B=主动买入; S=主动卖出	N
29	SellPrice01	卖价一	decimal(9,3)	第 1 档委托卖出价	Y
30	BuyPrice01	买价一	decimal(9,3)	第 1 档委托买入价	Y
31	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
32	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以买价一委托买入的数量	Y
33	SellPrice05	卖价五	decimal(9,3)	第 5 档委托卖出价	Y
34	SellPrice04	卖价四	decimal(9,3)	第 4 档委托卖出价	Y
35	SellPrice03	卖价三	decimal(9,3)	第 3 档委托卖出价	Y

36	SellPrice02	卖价二	decimal(9,3)	第 2 档委托卖出价	Y
37	BuyPrice02	买价二	decimal(9,3)	第 2 档委托买入价	Y
38	BuyPrice03	买价三	decimal(9,3)	第 3 档委托买入价	Y
39	BuyPrice04	买价四	decimal(9,3)	第 4 档委托买入价	Y
40	BuyPrice05	买价五	decimal(9,3)	第 5 档委托买入价	Y
41	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	以卖价五委托卖出的数量	Y
42	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	以卖价四委托卖出的数量	Y
43	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	以卖价三委托卖出的数量	Y
44	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	以卖价二委托卖出的数量	Y
45	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	以买价二委托买入的数量	Y
46	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	以买价三委托买入的数量	Y
47	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	以买价四委托买入的数量	Y
48	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	以买价五委托买入的数量	Y
49	BidImPLYQty01	申买推导量 1	decimal(19,2)	买价一上套利所占的委托量	Y
50	BidImPLYQty02	申买推导量 2	decimal(19,2)	买价二上套利所占的委托量	Y
51	BidImPLYQty03	申买推导量 3	decimal(19,2)	买价三上套利所占的委托量	Y
52	BidImPLYQty04	申买推导量 4	decimal(19,2)	买价四上套利所占的委托量	Y
53	BidImPLYQty05	申买推导量 5	decimal(19,2)	买价五上套利所占的委托量	Y
54	AskImPLYQty01	申卖推导量 1	decimal(19,2)	卖价一上套利所占的委托量	Y
55	AskImPLYQty02	申卖推导量 2	decimal(19,2)	卖价二上套利所占的委托量	Y
56	AskImPLYQty03	申卖推导量 3	decimal(19,2)	卖价三上套利所占的委托量	Y
57	AskImPLYQty04	申卖推导量 4	decimal(19,2)	卖价四上套利所占的委托量	Y
58	AskImPLYQty05	申卖推导量 5	decimal(19,2)	卖价五上套利所占的委托量	Y
59	Market	市场	varchar(5)	DCE	N
60	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
61	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	0,1,2, ..., 11	N
62	BestBuyQty01	最优价委买量 1	decimal(19,2)	买价一的前 10 笔的委托买入量。	Y

63	BestBuyQty02	最优价委买量 2	decimal(19,2)	2018.4.17 日前不提供该字段，以 0 填充； 从 2018.4.17 日开始提供该字段。	Y
64	BestBuyQty03	最优价委买量 3	decimal(19,2)		Y
65	BestBuyQty04	最优价委买量 4	decimal(19,2)		Y
66	BestBuyQty05	最优价委买量 5	decimal(19,2)		Y
67	BestBuyQty06	最优价委买量 6	decimal(19,2)		Y
68	BestBuyQty07	最优价委买量 7	decimal(19,2)		Y
69	BestBuyQty08	最优价委买量 8	decimal(19,2)		Y
70	BestBuyQty09	最优价委买量 9	decimal(19,2)		Y
71	BestBuyQty10	最优价委买量 10	decimal(19,2)		Y
72	BestSellQty01	最优价委卖量 1	decimal(19,2)	卖价一的前 10 笔的委托卖出量。 2018.4.17 日前不提供该字段，以 0 填充； 从 2018.4.17 日开始提供该字段。	Y
73	BestSellQty02	最优价委卖量 2	decimal(19,2)		Y
74	BestSellQty03	最优价委卖量 3	decimal(19,2)		Y
75	BestSellQty04	最优价委卖量 4	decimal(19,2)		Y
76	BestSellQty05	最优价委卖量 5	decimal(19,2)		Y
77	BestSellQty06	最优价委卖量 6	decimal(19,2)		Y
78	BestSellQty07	最优价委卖量 7	decimal(19,2)		Y
79	BestSellQty08	最优价委卖量 8	decimal(19,2)		Y
80	BestSellQty09	最优价委卖量 9	decimal(19,2)		Y
81	BestSellQty10	最优价委卖量 10	decimal(19,2)		Y

## 委托统计行情 (MFL2\_ORERSTATISTIC\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
----	-----	----	------	----	--------

1	Symbol	证券代码	varchar(20)	以商品交易所公布商品期货合约代码为准	Y
2	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	Y
4	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
5	TotalBuyOrderVolume	委托买入总量	decimal(19,2)	买方向的所有委托的总委托量，不包括推导量。	Y
6	WtAvgBuyPrice	加权平均委买价格	decimal(9,3)	买方向所有委托的加权平均价，计算公式= $\Sigma$ （委托价*委托量）/委托买入总量	Y
7	TotalSellOrderVolume	委托卖出总量	decimal(19,2)	卖方向的所有委托的总委托量，不包括推导量。	Y
8	WtAvgSellPrice	加权平均委卖价格	decimal(9,3)	卖方向所有委托的加权平均价，计算公式= $\Sigma$ （委托价*委托量）/委托卖出总量	Y
9	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
10	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N

## 实时结算行情（MFL2\_REALTIMEPRICE\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(6)	以商品交易所公布商品期货合约代码为准	Y
2	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	Y
4	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
5	RealTimePrice	实时结算价	decimal(9,3)	某合约当天的成交价格按照成交量的加权平均。计算	Y

				公式：实时结算价=成交总额/成交总量。	
6	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
7	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N

## 分价成交量行情（MFL2\_MARCHPRICEQTY\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(6)	以商品交易所公布商品期货合约代码为准	Y
2	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20141120	N
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成，例如：2014-09-01 08:57:55.000	H
5	PriceOne	价格 1	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，最大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
6	PriceOneBOQTY	买开数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
7	PriceOneBEQTY	买平数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
8	PriceOneSOQTY	卖开数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
9	PriceOneSEQTY	卖平数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
10	PriceTwo	价格 2	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
11	PriceTwoBOQTY	买开数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
12	PriceTwoBEQTY	买平数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y

## 新高频数据说明书

13	PriceTwoSOQTY	卖开数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
14	PriceTwoSEQTY	卖平数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
15	PriceThree	价格 3	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
16	PriceThreeBOQTY	买开数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
17	PriceThreeBEQTY	买平数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
18	PriceThreeSOQTY	卖开数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
19	PriceThreeSEQTY	卖平数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
20	PriceFour	价格 4	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
21	PriceFourBOQTY	买开数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
22	PriceFourBEQTY	买平数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
23	PriceFourSOQTY	卖开数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
24	PriceFourSEQTY	卖平数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
25	PriceFive	价格 5	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
26	PriceFiveBOQTY	买开数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
27	PriceFiveBEQTY	买平数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
28	PriceFiveSOQTY	卖开数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
29	PriceFiveSEQTY	卖平数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
30	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
31	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N

说明:



- 1) 大连商品交易所 Level-2 行情提供分价位的成交量统计。Level-2 提供 5 个累计成交量最大的价位区间，分别显示每个价位区间上的买开、卖开、买平、卖平的累计成交量；
- 2) 累计成交量=买入开仓的累计成交量+卖出开仓的累计成交量+买入平仓的累计成交量+卖出平仓的累计成交量
- 3) 请注意，这里的成交量只统计基本定单的成交；
- 4) 将涨跌停板范围按照 3\*tick 划分成多个子区间，根据区间内基本定单产生的成交量降序排列，价格为区间的下限。假设跌停板价格是 1，涨停板价格是 9，tick 是 1，那么可以划分成[1,2,3]、[4,5,6]、[7,8,9]三个区间，第一笔成交的成交价为 5，买开与卖平成交 2 手（买卖各 1 手），则将划分到第 2 个区间里，这个区间的价格为 4，则此时计算分价成交行情的话，价格 1 为 4，买开数量为 1，买平数量为 0，卖开数量为 0，卖平数量为 1，其他价格及量均为 0。

## 套利深度行情 (MFL2\_ARBI\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
3	Symbol	套利合约号	varchar(20)	以商品交易所公布商品期货合约代码为准。 格式: 套利策略 腿 1 合约代码&腿 2 合约代码。套利策略分为 SP 跨期套利、SPC 跨品种套利两种。	Y
4	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)	套利定单直接成交，不刷新该价，以 0 填充	Y
5	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	套利定单直接成交，不刷新该价，以 0 填充	Y
6	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	套利定单直接成交，不刷新该价，以 0 填充	Y
7	LifeLow	历史最低价	decimal(9,3)	套利定单直接成交，不刷新该价，以 0 填充	Y
8	LifeHigh	历史最高价	decimal(9,3)	套利定单直接成交，不刷新该价，以 0 填充	Y

# 新高频数据说明书

9	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9,3)	第一个合约涨停板价 - 第二个合约跌停板价。	Y
10	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9,3)	第一个合约跌停板价 - 第二个合约涨停板价。	Y
11	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
12	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
13	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
14	Nolevel	深度行情数量	int	深度行情数量=深度买行情数+深度卖行情数； 深度买(卖)行情数=接收到的”买(卖) 深度行情域” 数量，买(卖)5 个，不足时补 0。	Y
15	SellPrice01	卖价一	decimal(9,3)	第 1 档委托卖出价	Y
16	BuyPrice01	买价一	decimal(9,3)	第 1 档委托买入价	Y
17	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	在卖价一上委托卖出套利定单的数量	Y
18	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	在买价一上委托买入套利定单的数量	Y
19	SellPrice05	卖价五	decimal(9,3)	第 5 档委托卖出价	Y
20	SellPrice04	卖价四	decimal(9,3)	第 4 档委托卖出价	Y
21	SellPrice03	卖价三	decimal(9,3)	第 3 档委托卖出价	Y
22	SellPrice02	卖价二	decimal(9,3)	第 2 档委托卖出价	Y
23	BuyPrice02	买价二	decimal(9,3)	第 2 档委托买入价	Y
24	BuyPrice03	买价三	decimal(9,3)	第 3 档委托买入价	Y
25	BuyPrice04	买价四	decimal(9,3)	第 4 档委托买入价	Y
26	BuyPrice05	买价五	decimal(9,3)	第 5 档委托买入价	Y
27	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	在卖价五上委托卖出套利定单的数量	Y
28	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	在卖价四上委托卖出套利定单的数量	Y
29	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	在卖价三上委托卖出套利定单的数量	Y
30	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	在卖价二上委托卖出套利定单的数量	Y
31	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	在买价二上委托买入套利定单的数量	Y
32	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	在买价三上委托买入套利定单的数量	Y
33	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	在买价四上委托买入套利定单的数量	Y
34	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	在买价五上委托买入套利定单的数量	Y
35	BidImPLYQty01	申买推导量 1	decimal(19,2)	目前交易所暂不提供，各档推导量都显示为 0	Y
36	BidImPLYQty02	申买推导量 2	decimal(19,2)		Y

37	BidImPLYQty03	申买推导量 3	decimal(19,2)		Y
38	BidImPLYQty04	申买推导量 4	decimal(19,2)		Y
39	BidImPLYQty05	申买推导量 5	decimal(19,2)		Y
40	AskImPLYQty01	申卖推导量 1	decimal(19,2)	目前交易所暂不提供，各档推导量都显示为 0	Y
41	AskImPLYQty02	申卖推导量 2	decimal(19,2)		Y
42	AskImPLYQty03	申卖推导量 3	decimal(19,2)		Y
43	AskImPLYQty04	申卖推导量 4	decimal(19,2)		Y
44	AskImPLYQty05	申卖推导量 5	decimal(19,2)		Y
45	BestBuyQty01	最优价委买量 1	decimal(19,2)	买价一的前 10 笔的委托买入量。 交易所不提供该字段，以 0 填充。	Y
46	BestBuyQty02	最优价委买量 2	decimal(19,2)		Y
47	BestBuyQty03	最优价委买量 3	decimal(19,2)		Y
48	BestBuyQty04	最优价委买量 4	decimal(19,2)		Y
49	BestBuyQty05	最优价委买量 5	decimal(19,2)		Y
50	BestBuyQty06	最优价委买量 6	decimal(19,2)		Y
51	BestBuyQty07	最优价委买量 7	decimal(19,2)		Y
52	BestBuyQty08	最优价委买量 8	decimal(19,2)		Y
53	BestBuyQty09	最优价委买量 9	decimal(19,2)		Y
54	BestBuyQty10	最优价委买量 10	decimal(19,2)		Y
55	BestSellQty01	最优价委卖量 1	decimal(19,2)	卖价一的前 10 笔的委托卖出量。 交易所不提供该字段，以 0 填充。	Y
56	BestSellQty02	最优价委卖量 2	decimal(19,2)		Y
57	BestSellQty03	最优价委卖量 3	decimal(19,2)		Y
58	BestSellQty04	最优价委卖量 4	decimal(19,2)		Y
59	BestSellQty05	最优价委卖量 5	decimal(19,2)		Y
60	BestSellQty06	最优价委卖量 6	decimal(19,2)		Y
61	BestSellQty07	最优价委卖量 7	decimal(19,2)		Y

62	BestSellQty08	最优价委卖量 8	decimal(19,2)		Y
63	BestSellQty09	最优价委卖量 9	decimal(19,2)		Y
64	BestSellQty10	最优价委卖量 10	decimal(19,2)		Y

## 大商所商品期权 L1

### 分笔 (COL1\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(20)		Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)		N
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20181120	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2018-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19, 2)	当前成交总量 (TotalVolumet)- 上一分笔的成交总量 (TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19, 2)	最近一笔成交的成交量	Y
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19, 2)	前一交易日收盘后持仓量	Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19, 2)	当前观测时刻的持仓量	Y

14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19, 2)	持仓量-昨持仓量	Y
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交额	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19,3)	当前成交总额 (TotalAmount <sub>t</sub> )-上一分笔的成交总额 (TotalAmount <sub>t-1</sub> ); 首条记录取当前成交总额	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)		Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)		Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	上一交易日的结算价	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9, 3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9, 3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约当天结算价	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y
26	AveragePrice01	成交均价 01	decimal(9, 3)	AveragePrice01=成交总额/成交总量/合约乘数, 其小数位不同合约处理方法不同(需要具体合约具体分析)	Y
27	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	以 AveragePrice01 填充, 即 AveragePrice=AveragePrice01	N
28	BidImpleyQty	申买推导量	decimal(19, 2)	和套利合约有关	Y
29	AskImpleyQty	申卖推导量	decimal(19, 2)	和套利合约有关	Y
30	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; N: 无法判断	N
31	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
32	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y

33	SellVolume01	卖量一	decimal(19, 2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
34	BuyVolume01	买量一	decimal(19, 2)	以买价一委托买入的数量	Y
35	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
36	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
37	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
38	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
39	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
40	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
41	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
42	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
43	SellVolume05	卖量五	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
44	SellVolume04	卖量四	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
45	SellVolume03	卖量三	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
46	SellVolume02	卖量二	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
47	BuyVolume02	买量二	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
48	BuyVolume03	买量三	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
49	BuyVolume04	买量四	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
50	BuyVolume05	买量五	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
51	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	该合约在上一交易日的 Delta Delta=期权价格变化/期货价格变化	N
52	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	该合约在本交易日的 Delta, Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
53	Change	涨跌	decimal(9, 3)	最新成交价-昨结算价	N
54	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
55	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
56	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应TradingTime与1970-01-01 00:00:00.000的毫秒 差值再减去 8*3600	N

57	OpenClose	开平仓性质	nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态：双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
58	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价 (HighPrice)- 最低价 (LowPrice)]/ 昨结算价 (PreSettlePrice)	N
59	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标，计算公式： 当日分钟均量（当前成交总量/当前交易分钟数）/前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数，例如出现 09:31:01 就按两分钟算；09:30:00 按一分钟算。	N
60	OrderDiff	委差	decimal(19, 2)	委买总量-委卖总量；委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
61	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买 1 档的委托量，委卖总量是当前委卖 1 档的委托量。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
62	SellVOL	内盘	decimal(19, 2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交。	N
63	BuyVOL	外盘	decimal(19, 2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
64	PositionChange	仓差	decimal(19, 2)	当前持仓量 [TotalPosition(t)]- 上一分笔的持仓量 [TotalPosition(t-1)]；当日首条分笔仓差为 0	N
65	DeliverySettlePrice	当日交割结算价	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
66	Gamma	Gamma	decimal(9, 4)	证券组合价值 Delta 变化与标的资产价格变化的比率	Y

67	Rho	Rho	decimal(9, 4)	交易组合价值变化与利率变化的比率	Y
68	Theta	Theta	decimal(9, 4)	证券组合价值变化与时间变化的比率	Y
69	Vega	Vega	decimal(9, 4)	交易组合价值变化与标的资产波动率变化的比率	Y

## 分时 (COL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20181120
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
3	Symbol	合约代码	varchar(20)	根据交易所公布的商品期权合约代码为准
4	OpenPrice	分时段开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
5	ClosePrice	分时段收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
6	HighPrice	分时段最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
9	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
10	Position	分时持仓量	decimal(19,2)	分时段区间内最后一笔分笔的持仓量
11	Volume	分时段成交量	decimal(19,2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
12	Amount	分时段成交金额	decimal(19,3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
13	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE
14	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
15	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时段区间内的末条成交记录的成交总量
16	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数
17	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识
18	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	取昨结算价, 上市首日填挂牌基准价



## 新高频数据说明书

19	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	例如：玉米 1905-看涨-1680
20	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
21	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
22	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
23	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价一
24	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价二(大商所不提供)，填充 0
25	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价三(大商所不提供)，填充 0
26	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价四(大商所不提供)，填充 0
27	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价五(大商所不提供)，填充 0
28	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价一
29	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价二(大商所不提供)，填充 0
30	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价三(大商所不提供)，填充 0
31	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价四(大商所不提供)，填充 0
32	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价五(大商所不提供)，填充 0
33	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量一
34	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量二(大商所不提供)，填充 0
35	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量三(大商所不提供)，填充 0
36	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量四(大商所不提供)，填充 0
37	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量五(大商所不提供)，填充 0
38	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量一
39	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量二(大商所不提供)，填充 0
40	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量三(大商所不提供)，填充 0
41	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量四(大商所不提供)，填充 0
42	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量五(大商所不提供)，填充 0
43	Return	简单收益率	decimal(9,4)	简单收益率=（分日内收盘价-昨结算价）/昨结算价

## 大商所商品期权 L2

## 分笔 (COL2\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(20)	以交易所公布的商品期权合约代码为准	Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	商品期权合约的中文简称	N
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20181120	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2018-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9,3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9,3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	当前成交总量(TotalVolumet)-上一分笔的成交总量(TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19,2)	最近一笔成交的成交量	Y
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19,2)	上一交易日收盘时刻的未平仓合约量	Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19,2)	当前观测时点的持仓量	Y
14	PrePositionChange	增仓	decimal(19,2)	持仓量- 昨持仓量	Y
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交额	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交金额	decimal(19,3)	当前成交总额(TotalAmount <sub>t</sub> )-上一分笔的成交总额(TotalAmount <sub>t-1</sub> ); 首条记录取当前成交总额	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9,3)		Y

18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9,3)		Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9,3)	上一交易日的结算价	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9,3)	上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9,3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9,3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9,3)	该合约当天结算价	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9,3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9,3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y
26	AveragePrice	当日均价	decimal(9,3)	AveragePrice = 成交总额/成交总量/合约乘数, 其小数位不同合约处理方法不同(需要具体合约具体分析)	Y
27	Nolevel	深度行情数量	int	深度行情数量=深度买行情数量+深度卖行情数量	Y
28	BuyOrSell	买卖方向	varchar (1)	“N” =无法判断 “B” =主动买入 “S” =主动卖出	N
29	SellPrice01	卖价一	decimal(9,3)	第 1 档委托卖出价	Y
30	BuyPrice01	买价一	decimal(9,3)	第 1 档委托买入价	Y
31	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
32	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以买价一委托买入的数量	Y
33	SellPrice05	卖价五	decimal(9,3)	第 5 档委托卖出价	Y
34	SellPrice04	卖价四	decimal(9,3)	第 4 档委托卖出价	Y
35	SellPrice03	卖价三	decimal(9,3)	第 3 档委托卖出价	Y
36	SellPrice02	卖价二	decimal(9,3)	第 2 档委托卖出价	Y
37	BuyPrice02	买价二	decimal(9,3)	第 2 档委托买入价	Y
38	BuyPrice03	买价三	decimal(9,3)	第 3 档委托买入价	Y
39	BuyPrice04	买价四	decimal(9,3)	第 4 档委托买入价	Y
40	BuyPrice05	买价五	decimal(9,3)	第 5 档委托买入价	Y

41	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	以卖价五委托卖出的数量	Y
42	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	以卖价四委托卖出的数量	Y
43	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	以卖价三委托卖出的数量	Y
44	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	以卖价二委托卖出的数量	Y
45	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	以买价二委托买入的数量	Y
46	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	以买价三委托买入的数量	Y
47	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	以买价四委托买入的数量	Y
48	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	以买价五委托买入的数量	Y
49	BidImPLYQty01	申买推导量 1	decimal(19,2)	买价一上套利所占的委托量	Y
50	BidImPLYQty02	申买推导量 2	decimal(19,2)	买价二上套利所占的委托量	Y
51	BidImPLYQty03	申买推导量 3	decimal(19,2)	买价三上套利所占的委托量	Y
52	BidImPLYQty04	申买推导量 4	decimal(19,2)	买价四上套利所占的委托量	Y
53	BidImPLYQty05	申买推导量 5	decimal(19,2)	买价五上套利所占的委托量	Y
54	AskImPLYQty01	申卖推导量 1	decimal(19,2)	卖价一上套利所占的委托量	Y
55	AskImPLYQty02	申卖推导量 2	decimal(19,2)	卖价二上套利所占的委托量	Y
56	AskImPLYQty03	申卖推导量 3	decimal(19,2)	卖价三上套利所占的委托量	Y
57	AskImPLYQty04	申卖推导量 4	decimal(19,2)	卖价四上套利所占的委托量	Y
58	AskImPLYQty05	申卖推导量 5	decimal(19,2)	卖价五上套利所占的委托量	Y
59	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
60	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
61	BestBuyQty01	最优价委买量 1	decimal(19,2)	买价一的前 10 笔的委托买入量。 2018.4.25 日前不提供该字段，以 0 填充； 从 2018.4.25 日开始提供该字段。	Y
62	BestBuyQty02	最优价委买量 2	decimal(19,2)		Y
63	BestBuyQty03	最优价委买量 3	decimal(19,2)		Y
64	BestBuyQty04	最优价委买量 4	decimal(19,2)		Y
65	BestBuyQty05	最优价委买量 5	decimal(19,2)		Y

66	BestBuyQty06	最优价委买量 6	decimal(19,2)		Y
67	BestBuyQty07	最优价委买量 7	decimal(19,2)		Y
68	BestBuyQty08	最优价委买量 8	decimal(19,2)		Y
69	BestBuyQty09	最优价委买量 9	decimal(19,2)		Y
70	BestBuyQty10	最优价委买量 10	decimal(19,2)		Y
71	BestSellQty01	最优价委卖量 1	decimal(19,2)	卖价一的前 10 笔的委托买入量。 2018.4.25 日前不提供该字段，以 0 填充； 从 2018.4.25 日开始提供该字段。	Y
72	BestSellQty02	最优价委卖量 2	decimal(19,2)		Y
73	BestSellQty03	最优价委卖量 3	decimal(19,2)		Y
74	BestSellQty04	最优价委卖量 4	decimal(19,2)		Y
75	BestSellQty05	最优价委卖量 5	decimal(19,2)		Y
76	BestSellQty06	最优价委卖量 6	decimal(19,2)		Y
77	BestSellQty07	最优价委卖量 7	decimal(19,2)		Y
78	BestSellQty08	最优价委卖量 8	decimal(19,2)		Y
79	BestSellQty09	最优价委卖量 9	decimal(19,2)		Y
80	BestSellQty10	最优价委卖量 10	decimal(19,2)		Y
81	Delta	Delta	decimal(9, 4)	期权或资产价格变动对其标的资产价格变动的比率	Y
82	Gamma	Gamma	decimal(9, 4)	证券组合价值 Delta 变化与标的资产价格变化的比率	Y
83	Rho	Rho	decimal(9, 4)	交易组合价值变化与利率变化的比率	Y
84	Theta	Theta	decimal(9, 4)	证券组合价值变化与时间变化的比率	Y

85	Vega	Vega	decimal(9, 4)	交易组合价值变化与标的资产波动率变化的比率	Y
----	------	------	---------------	-----------------------	---

## 委托统计行情 (COL2\_ORERSTATISTIC\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(20)	以交易所公布商品期权合约代码为准	Y
2	SecurityID	证券统一编码	Decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20181120	N
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2018-09-01 08:57:55.000	H
5	TotalBuyOrderVolume	委托买入总量	decimal(19,2)	买方向的所有委托的总委托量, 不包括推导量。	Y
6	WtAvgBuyPrice	加权平均委买价格	Decimal(9,3)	买方向所有委托的加权平均价, 计算公式= $\Sigma(\text{委托价} \times \text{委托量}) / \text{委托买入总量}$	Y
7	TotalSellOrderVolume	委托卖出总量	decimal(19,2)	卖方向的所有委托的总委托量, 不包括推导量。	Y
8	WtAvgSellPrice	加权平均委卖价格	Decimal(9,3)	卖方向所有委托的加权平均价, 计算公式= $\Sigma(\text{委托价} \times \text{委托量}) / \text{委托卖出总量}$	Y
9	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
10	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N

## 实时结算行情 (COL2\_REALTIMEPRICE\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	证券代码	varchar(20)	以商品交易所公布商品期货合约代码为准	Y
2	SecurityID	证券统一编码	decimal (19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20181120	N
4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2018-09-01 08:57:55.000	H
5	RealTimePrice	实时结算价	decimal(9,3)	某合约当天的成交价格按照成交量的加权平均。计算公式：实时结算价=成交总额/成交总量。	Y
6	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
7	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N

## 分价成交量行情 (COL2\_MARCHPRICEQTY\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(20)	以商品交易所公布商品期权合约代码为准	Y
2	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
3	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20181120	N

4	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2018-09-01 08:57:55.000	H
5	PriceOne	价格 1	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，最大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
6	PriceOneBOQTY	买开数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
7	PriceOneBEQTY	买平数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
8	PriceOneSOQTY	卖开数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
9	PriceOneSEQTY	卖平数量 1	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，最大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
10	PriceTwo	价格 2	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
11	PriceTwoBOQTY	买开数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
12	PriceTwoBEQTY	买平数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
13	PriceTwoSOQTY	卖开数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
14	PriceTwoSEQTY	卖平数量 2	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第二大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
15	PriceThree	价格 3	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
16	PriceThreeBOQTY	买开数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
17	PriceThreeBEQTY	买平数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
18	PriceThreeSOQTY	卖开数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
19	PriceThreeSEQTY	卖平数量 3	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第三大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
20	PriceFour	价格 4	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
21	PriceFourBOQTY	买开数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
22	PriceFourBEQTY	买平数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y



23	PriceFourSOQTY	卖开数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
24	PriceFourSEQTY	卖平数量 4	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第四大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
25	PriceFive	价格 5	decimal(9,3)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量所在的价位区间的下限。价位区间解释请见表后说明。	Y
26	PriceFiveBOQTY	买开数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的买入开仓（做多）的累计成交量	Y
27	PriceFiveBEQTY	买平数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的买入平仓（平掉持有的空单）的累计成交量	Y
28	PriceFiveSOQTY	卖开数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的卖出开仓（做空）的累计成交量	Y
29	PriceFiveSEQTY	卖平数量 5	decimal(19,2)	开盘至当前时刻，第五大累计成交量中的卖出平仓（平多单）的累计成交量	Y
30	Market	市场	varchar(5)	大商所 DCE	N
31	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N

**说明:**

- 1) 大连商品交易所 Level-2 行情提供分价位的成交量统计。Level-2 提供 5 个累计成交量最大的价位区间，分别显示每个价位区间上的买开、卖开、买平、卖平的累计成交量；
- 2) 累计成交量=买入开仓的累计成交量+卖出开仓的累计成交量+买入平仓的累计成交量+卖出平仓的累计成交量
- 3) 请注意，这里的成交量只统计基本定单的成交；

将涨跌停板范围按照 3\*tick 划分成多个子区间,根据区间内基本定单产生的成交量降序排列,价格为区间的下限。

假设跌停板价格是 1，涨停板价格是 9，tick 是 1，那么可以划分成[1,2,3]、[4,5,6]、[7,8,9]三个区间，第一笔成交的成交价为 5，买开与卖平成交 2 手（买卖各 1 手），则将划分到第 2 个区间里，这个区间的价格为 4，则此时计算分价成交行情的话，价格 1 为 4，买开数量为 1，买平数量为 0，卖开数量为 0，卖平数量为 1，其他价格及量均为 0。

## 五、郑商所

### 郑商所商品期货 L1

#### 分笔 (MFL1\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(6)	在郑商所原始合约代码上增加交割年份的十位上的数字, 例如: RO109, 表示 2011 年 9 月份交割, 改为: RO1109, 避免十年后出现重复。	Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)		N
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20141120	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2014-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	当前成交总量(TotalVolumet)-上一分笔的成交总量(TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19,2)	上一个交易日的持仓量	Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19,2)	当前观测时点的持仓量	Y
14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19,2)	持仓量-昨持仓量	N

## 新高频数据说明书

15	TotalAmount	成交金额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交额，郑商所不实时更新，偶尔会更新	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19,3)	不提供该字段，以 0 填充	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)	当前交易日价格涨幅的上限。	Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)	当前交易日价格跌幅的下限。	Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的结算价	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9, 3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9, 3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约当天结算价	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y
26	AveragePrice01	成交均价 01	decimal(9, 3)		Y
27	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	以 AveragePrice01 填充，即 AveragePrice=AveragePrice01	N
28	BidImPLYQty	申买推导量	decimal(19,2)	不提供该字段，以 0 填充	N
29	AskImPLYQty	申卖推导量	decimal(19,2)	不提供该字段，以 0 填充	N
30	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交；S:卖方主动成交；NULL：无法判断	N
31	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
32	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
33	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
34	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以买价一委托买入的数量	Y
35	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
36	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
37	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
38	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
39	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
40	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
41	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
42	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
43	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	不提供该字段，以 0 填充	N

44	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
45	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
46	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
47	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
48	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
49	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
50	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
51	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
52	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
53	Change	涨跌	decimal(9, 3)	最新成交价-昨结算价	N
54	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
55	Varieties	品种	nvarchar(8)		N
56	ContinueSign	连续合约代码	nvarchar(8)	把每个合约都分配了一个连续合约。 L0 表示当月交割合约 (离交割日最近合约), L1 表示下一个交割的合约, L2 表示下下个交割的合约, 以此类推	N
57	Market	市场	varchar(5)	郑商所 CZCE	N
58	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
59	OpenClose	开平仓性质	nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态: 双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
60	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
61	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标, 计算公式: 当日分钟均量 (当前成交总量/当前交易分钟数) /前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数, 例如出现 09:31:01 就按两分钟算; 09:30:00 按一分钟算。	N
62	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	委买总量-委卖总量; 委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N

63	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买 1 档的委托量，委卖总量是当前委卖 1 档的委托量。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
64	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交	N
65	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
66	PositionChange	仓差	decimal(19,2)	当前持仓量 [TotalPosition(t)]-上一分笔的持仓量 [TotalPosition(t-1)]; 当日首条分笔仓差为 0	N
67	DeliverySettlePrice	当日交割结算价	decimal(9, 3)	交割日结算价，与结算价的数值相同。	Y

## 分时 (MFL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识
2	Symbol	合约代码	varchar(6)	在郑商所原始合约代码上增加交割年份的十位上的数字，例如：RO109，表示 2011 年 9 月份交割，改为：RO1109，避免十年后出现重复。
3	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd，例如：20141120
5	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-ddhh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
6	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	取昨结算价，上市首日填挂牌基准价
7	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
8	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
9	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
10	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
11	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价一
12	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	分时段区间最后一条分笔的买价二(郑商所不提供)，填充 0

13	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价三(郑商所不提供), 填充 0
14	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价四(郑商所不提供), 填充 0
15	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价五(郑商所不提供), 填充 0
16	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价一
17	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价二(郑商所不提供), 填充 0
18	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价三(郑商所不提供), 填充 0
19	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价四(郑商所不提供), 填充 0
20	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价五(郑商所不提供), 填充 0
21	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量一
22	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量二(郑商所不提供), 填充 0
23	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量三(郑商所不提供), 填充 0
24	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量四(郑商所不提供), 填充 0
25	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量五(郑商所不提供), 填充 0
26	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量一
27	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量二(郑商所不提供), 填充 0
28	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量三(郑商所不提供), 填充 0
29	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量四(郑商所不提供), 填充 0
30	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量五(郑商所不提供), 填充 0
31	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
32	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
33	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时区间内的末条成交记录的成交总量
34	Volume	分时段成交量	decimal(19,2)	分时区间内成交记录的成交量之和
35	Amount	分时段成交金额	decimal(19,3)	分时区间内成交记录的成交金额之和
36	Position	分时持仓量	decimal(19,2)	分时区间内最后一笔分笔的持仓量
37	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
38	Market	市场	varchar(5)	郑商所 CZCE

39	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数
40	Varieties	品种	nvarchar(8)	
41	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	把每个合约都分配了一个连续合约。 L0 表示当月交割合约（离交割日最近合约），L1 表示下一个交割的合约，L2 表示下下个交割的合约，以此类推
42	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
43	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
44	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
45	Return	简单收益率	decimal(9,4)	简单收益率=（分时段内收盘价-昨结算价）/昨结算价

## 郑商所商品期权 L1

### 分笔（COL1\_TAQ\_YYYYMM）

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(20)	在郑商所原始合约代码上增加交割年份的十位上的数字，例如：郑商所原始代码 SR809C6500，表示 2018 年 9 月份交割，改为：SR1809-C-6500，避免十年后出现重复。	Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)		N
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd，例如：20181120	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2018-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y

## 新高频数据说明书

9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	当前成交总量 (TotalVolumet)-上一分笔的成交总量 (TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19,2)		Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19,2)	当前观测时点的持仓量	Y
14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19,2)	持仓量-昨持仓量	N
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交额, 郑商所不实时更新。偶尔会更新, 更新无规律	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19,3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)		Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)		Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的结算价	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9, 3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9, 3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约当天结算价	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	Y
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	Y
26	AveragePrice01	成交均价 01	decimal(9, 3)		Y
27	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	以 AveragePrice01 填充, 即 AveragePrice=AveragePrice01	N
28	BidImPLYQty	申买推导量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
29	AskImPLYQty	申卖推导量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
30	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; NULL: 无法判断	N
31	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
32	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
33	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
34	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以买价一委托买入的数量	Y
35	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
36	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
37	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
38	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
39	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N



40	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
41	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
42	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
43	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
44	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
45	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
46	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
47	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
48	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
49	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
50	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
51	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
52	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
53	Change	涨跌	decimal(9, 3)	最新成交价-昨结算价	N
54	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
55	Market	市场	varchar(5)	郑商所 CZCE	N
56	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
57	OpenClose	开平仓性质	nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态: 双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
58	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
59	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标, 计算公式: 当日分钟均量(当前成交总量/当前交易分钟数)/前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时刻分钟数, 例如出现 09:31:01 就按两分钟算; 09:30:00 按一分钟算。	N
60	OrderDiff	委差	decimal(19,2)	委买总量-委卖总量; 委买总量是当前委买五档委托量的和, 委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
61	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买 1 档的委托量, 委卖总量是当前委卖 1 档的委托量。 委比的取值自-100%到+100%, 如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N

62	SellVOL	内盘	decimal(19,2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交。	N
63	BuyVOL	外盘	decimal(19,2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
64	PositionChange	仓差	decimal(19,2)	当前持仓量 [TotalPosition(t)]- 上一分笔的持仓量 [TotalPosition(t-1)]; 当日首条分笔仓差为 0	N
65	DeliverySettlePrice	当日交割结算价	decimal(9, 3)	交割日结算价, 与结算价的数值相同	Y
66	Gamma	Gamma	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
67	Rho	Rho	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
68	Theta	Theta	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N
69	Vega	Vega	decimal(9, 4)	不提供该字段, 以 0 填充	N

## 分时 (COL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20181120
2	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-ddhh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
3	Symbol	合约代码	varchar(20)	在郑商所原始合约代码上增加交割年份的十位上的数字, 例如: 郑商所原始代码 SR809C6500, 表示 2018 年 9 月份交割, 改为: SR1809-C-6500, 避免十年后出现重复。
4	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
5	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
6	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
9	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
10	Position	分时持仓量	decimal(19,2)	分时段区间内最后一笔分笔的持仓量
11	Volume	分时段内成交量	decimal(19,2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
12	Amount	分时段内成交金额	decimal(19,3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
13	Market	市场	varchar(5)	郑商所 CZCE
14	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600

15	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时区间内的末条成交记录的成交总量
16	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount/Volume/合约乘数
17	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识
18	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	为昨结算价，上市首日为挂牌基准价
19	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	
20	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
21	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
22	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
23	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价一
24	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价二(郑商所不提供)，填充 0
25	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价三(郑商所不提供)，填充 0
26	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价四(郑商所不提供)，填充 0
27	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的买价五(郑商所不提供)，填充 0
28	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价一
29	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价二(郑商所不提供)，填充 0
30	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价三(郑商所不提供)，填充 0
31	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价四(郑商所不提供)，填充 0
32	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	分时区间最后一条分笔的卖价五(郑商所不提供)，填充 0
33	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量一
34	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量二(郑商所不提供)，填充 0
35	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量三(郑商所不提供)，填充 0
36	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量四(郑商所不提供)，填充 0
37	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的买量五(郑商所不提供)，填充 0
38	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量一
39	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量二(郑商所不提供)，填充 0
40	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量三(郑商所不提供)，填充 0
41	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量四(郑商所不提供)，填充 0
42	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	分时区间最后一条分笔的卖量五(郑商所不提供)，填充 0
43	Return	简单收益率	decimal(9,4)	简单收益率=（分时内收盘价-昨结算价）/昨结算价

## 六、上期所&上期能源

### 上期所&上期能源的商品期货 L1

#### 分笔 (MFL1\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(6)		Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)		N
3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码, 证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20191120	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如: 2019-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19,2)	当前成交总量(TotalVolumet)-上一分笔的成交总量(TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19,2)		Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19,2)	当前观测时点的持仓量	Y
14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19,2)	持仓量-昨持仓量	N
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻该合约的累计成交额	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19,3)	当前成交总额(TotalAmountt)-上一分笔的成交总额(TotalAmountt-1);首条记录取当前成交总额	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)		Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)		Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的结算价	Y

20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	该合约在上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9, 3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9, 3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约当天结算价	Y
24	LifeLow	历史最低价	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9, 3)	不提供该字段, 以 0 填充	N
26	AveragePrice01	成交均价 01	decimal(9, 3)	成交总额/成交总量/合约乘数, 如果成交总量为 0, 则以昨收盘价填充	N
27	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	以 AveragePrice01 填充, 即 AveragePrice=AveragePrice01	N
28	BidImPLYQty	申买推导量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
29	AskImPLYQty	申卖推导量	decimal(19,2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
30	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; NULL: 无法判断	N
31	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
32	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
33	SellVolume01	卖量一	decimal(19,2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
34	BuyVolume01	买量一	decimal(19,2)	以买价一委托买入的数量	Y
35	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
36	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
37	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
38	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
39	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
40	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
41	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
42	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
43	SellVolume05	卖量五	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
44	SellVolume04	卖量四	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
45	SellVolume03	卖量三	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
46	SellVolume02	卖量二	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
47	BuyVolume02	买量二	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
48	BuyVolume03	买量三	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
49	BuyVolume04	买量四	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
50	BuyVolume05	买量五	decimal(19,2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
51	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	提供该字段, 但是数值为 0	Y

52	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	提供该字段，但是数值为 0	Y
53	Change	涨跌	decimal(9, 3)	最新成交价-昨结算价	N
54	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
55	Varieties	品种	nvarchar(8)		N
56	ContinueSign	连续合约代码	nvarchar(8)	把每个合约都分配了一个连续合约。 L0 表示当月交割合约（离交割日最近合约），L1 表示下一个交割的合约，L2 表示下下个交割的合约，以此类推	N
57	Market	市场	varchar(5)	上期所：SHFE；上期能源：INE	N
58	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600	N
59	OpenClose	开平仓性质	nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态：双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
60	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价(PreSettlePrice)	N
61	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标，计算公式： 当日分钟均量（当前成交总量/当前交易分钟数）/前 5 天平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时刻分钟数，例如出现 09:31:01 就按两分钟算；09:30:00 按一分钟算。	N
62	OrderDiff	委差	decimal(19, 2)	委买总量-委卖总量；委买总量是当前委买五档委托量的和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N
63	OrderRate	委比	decimal(9,4)	公式：(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。 委买总量是当前委买 5 档的委托量，委卖总量是当前委卖 5 档的委托量。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
64	SellVOL	内盘	decimal(19, 2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交	N
65	BuyVOL	外盘	decimal(19, 2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
66	PositionChange	仓差	decimal(19, 2)	当前持仓量[TotalPosition(t)]-上一分笔的持仓量[TotalPosition(t-1)]；当日首条分笔仓差为 0	N
67	DeliverySettlePrice	当日交割结算价	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N

## 分时 (MFL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识
2	Symbol	合约代码	varchar(6)	根据交易所公布的商品期货合约代码为准
3	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	例如：沪铜 1812
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20181120
5	TradingTime	交易时间	datetime	yyyy-mm-ddhh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
6	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	取昨结算价，上市首日为挂牌基准价
7	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价
8	HighPrice	分时段内最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
9	LowPrice	分时段内最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
10	ClosePrice	分时段内收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
11	BuyPrice01	分时委买价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价一，档位不够的填充 0
12	BuyPrice02	分时委买价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价二，档位不够的填充 0
13	BuyPrice03	分时委买价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价三，档位不够的填充 0
14	BuyPrice04	分时委买价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价四，档位不够的填充 0
15	BuyPrice05	分时委买价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价五，档位不够的填充 0
16	SellPrice01	分时委卖价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价一，档位不够的填充 0
17	SellPrice02	分时委卖价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价二，档位不够的填充 0
18	SellPrice03	分时委卖价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价三，档位不够的填充 0
19	SellPrice04	分时委卖价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价四，档位不够的填充 0
20	SellPrice05	分时委卖价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价五，档位不够的填充 0
21	BuyVolume01	分时委买量一	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量一，档位不够的填充 0
22	BuyVolume02	分时委买量二	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量二，档位不够的填充 0
23	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量三，档位不够的填充 0
24	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量四，档位不够的填充 0
25	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量五，档位不够的填充 0
26	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量一，档位不够的填充 0
27	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量二，档位不够的填充 0
28	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量三，档位不够的填充 0
29	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的卖量四，档位不够的填充 0

30	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量五，档位不够的填充 0
31	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
32	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
33	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时区间内的末条成交记录的成交总量
34	Volume	分时段成交量	decimal(19,2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
35	Amount	分时段成交金额	decimal(19,3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
36	Position	分时持仓量	decimal(19,2)	分时段区间内最后一条分笔的持仓量
37	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
38	Market	市场	varchar(5)	上期所: SHFE; 上期能源: INE
39	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数
40	Varieties	品种	nvarchar(8)	
41	ContinueSign	连续合约代码	varchar(6)	把每个合约都分配了一个连续合约。 L0 表示当月交割合约（离交割日最近合约），L1 表示下一个交割的合约，L2 表示下下个交割的合约，以此类推
42	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
43	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
44	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时区间最后一条分笔的成交总额 (TotalAmount)/成交总量 (TotalVolume)/合约乘数
45	Return	简单收益率	decimal(9,4)	简单收益率=（分时段内收盘价-昨结算价）/昨结算价

## 上期所商品期权 L1

### 分笔 (COL1\_TAQ\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注	是否原始字段
1	Symbol	合约代码	varchar(20)		Y
2	ShortName	合约简称	nvarchar(20)		N



## 新高频数据说明书

3	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识	N
4	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如：20190301	Y
5	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm 由交易当天日期和数据生成时间(交易所直接下发的)合成。例如：2019-09-01 08:57:55.000	H
6	LastPrice	最新成交价	decimal(9, 3)		Y
7	HighPrice	最高价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最高成交价	Y
8	LowPrice	最低价	decimal(9, 3)	开盘至当前时刻所出现的最低成交价	Y
9	TradeVolume	分笔期间成交量	decimal(19, 2)	当前成交总量 (TotalVolumet)- 上一分笔的成交总量 (TotalVolumet-1);首条记录取当前成交总量	N
10	TotalVolume	成交总量	decimal(19, 2)	开盘至当前时刻的累计成交量	Y
11	LastVolume	最新成交量	decimal(19, 2)	不提供该字段，以 0 填充	N
12	PreTotalPosition	昨持仓量	decimal(19, 2)	前一交易日收盘后持仓量	Y
13	TotalPosition	持仓量	decimal(19, 2)	当前观测时刻的持仓量	Y
14	PrePositionChange	日增仓	decimal(19, 2)	持仓量-昨持仓量	N
15	TotalAmount	成交总额	decimal(19,3)	开盘至当前时刻的累计成交额	Y
16	TradeAmount	分笔期间成交额	decimal(19,3)	当前成交总额 (TotalAmountt)- 上一分笔的成交总额 (TotalAmountt-1); 首条记录取当前成交总额	N
17	PriceUpLimit	涨停价	decimal(9, 3)		Y
18	PriceDownLimit	跌停价	decimal(9, 3)		Y
19	PreSettlePrice	昨结算价	decimal(9, 3)	上一交易日的结算价	Y
20	PreClosePrice	昨收盘价	decimal(9, 3)	上一交易日的收盘价	Y
21	OpenPrice	开盘价	decimal(9, 3)	该合约当天开盘价	Y
22	ClosePrice	收盘价	decimal(9, 3)	该合约当天收盘价	Y
23	SettlePrice	结算价	decimal(9, 3)	该合约当天结算价	Y

24	LifeLow	历史最低价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最低成交价	N
25	Lifehigh	历史最高价	decimal(9, 3)	合约上市至当前时刻的最高成交价	N
26	AveragePrice01	成交均价 01	decimal(9, 3)	AveragePrice01=成交总额/成交总量/合约乘数, 其小数位不同合约处理方法不同(需要具体合约具体分析)	N
27	AveragePrice	成交均价	decimal(9, 3)	以 AveragePrice01 填充, 即 AveragePrice=AveragePrice01	N
28	BidImpleQty	申买推导量	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
29	AskImpleQty	申卖推导量	decimal(19, 2)	不提供该字段, 以 0 填充	N
30	BuyOrSell	买卖标识	varchar(1)	B:买方主动成交; S:卖方主动成交; N: 无法判断	N
31	SellPrice01	卖价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托卖出价	Y
32	BuyPrice01	买价一	decimal(9, 3)	第 1 档委托买入价	Y
33	SellVolume01	卖量一	decimal(19, 2)	以卖价一委托卖出的数量	Y
34	BuyVolume01	买量一	decimal(19, 2)	以买价一委托买入的数量	Y
35	SellPrice05	卖价五	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
36	SellPrice04	卖价四	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
37	SellPrice03	卖价三	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
38	SellPrice02	卖价二	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
39	BuyPrice02	买价二	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
40	BuyPrice03	买价三	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
41	BuyPrice04	买价四	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
42	BuyPrice05	买价五	decimal(9, 3)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
43	SellVolume05	卖量五	decimal(19, 2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
44	SellVolume04	卖量四	decimal(19, 2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
45	SellVolume03	卖量三	decimal(19, 2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
46	SellVolume02	卖量二	decimal(19, 2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
47	BuyVolume02	买量二	decimal(19, 2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y
48	BuyVolume03	买量三	decimal(19, 2)	提供该字段, 但是数值为 0	Y

49	BuyVolume04	买量四	decimal(19, 2)	提供该字段，但是数值为 0	Y
50	BuyVolume05	买量五	decimal(19, 2)	提供该字段，但是数值为 0	Y
51	PreDelta	昨虚实度	decimal(9, 4)	该合约在上一交易日的 Delta Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
52	Delta	今虚实度	decimal(9, 4)	该合约在本交易日的 Delta, Delta=期权价格变化/期货价格变化	Y
53	Change	涨跌	decimal(9, 3)	最新成交价-昨结算价	N
54	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9, 4)	(最新成交价-昨结算价)/昨结算价	N
55	Market	市场	varchar(5)	上期所 SHFE	N
56	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒 差值再减去 8*3600	N
57	OpenClose	开平仓性质	nvarchar(9)	通过持仓量的增减变化与现手的关系以及成交价与最优 买卖价的关系推导出来开或平的性质。 包括 9 种状态：双开仓、双平仓、多头换手、空头换手、 多头开仓、空头开仓、多头平仓、空头平仓、多空相持	N
58	Amplitude	振幅	decimal(9,4)	[最高价(HighPrice)-最低价(LowPrice)]/昨结算价 (PreSettlePrice)	N
59	VolRate	量比	decimal(9,4)	量比是衡量相对成交量的指标，计算公式： 当日分钟均量（当前成交总量/当前交易分钟数）/前 5 天 平均每分钟成交量。 当前交易分钟数是开盘到当前时间分钟数，例如出现 09:31:01 就按两分钟算；09:30:00 按一分钟算。	N
60	OrderDiff	委差	decimal(19, 2)	委买总量-委卖总量；委买总量是当前委买五档委托量的 和，委卖总量是当前委卖五档的委托量之和。	N

61	OrderRate	委比	decimal(9,4)	(委买总量-委卖总量)/(委买总量+委卖总量)。委买总量是当前委买 1 档的委托量，委卖总量是当前委卖 1 档的委托量。 委比的取值自-100%到+100%，如+100%表示全部的委托均是买盘。衡量某一时段买卖盘相对强度的指标。	N
62	SellVOL	内盘	decimal(19, 2)	主动性卖盘的累计成交量。主动性卖是指卖家以买家的买入价卖出成交。	N
63	BuyVOL	外盘	decimal(19, 2)	主动性买盘的累计成交量。主动性买是指买家以卖家的卖出价而买入成交	N
64	PositionChange	仓差	decimal(19, 2)	当前持仓量 [TotalPosition(t)]- 上一分笔的持仓量 [TotalPosition(t-1)]; 当日首条分笔仓差为 0	N
65	DeliverySettlePrice	当日交割结算价	decimal(9, 3)	不提供该字段，以 0 填充	N
66	Gamma	Gamma	decimal(9, 4)	证券组合价值 Delta 变化与标的资产价格变化的比率	N
67	Rho	Rho	decimal(9, 4)	交易组合价值变化与利率变化的比率	N
68	Theta	Theta	decimal(9, 4)	证券组合价值变化与时间变化的比率	N
69	Vega	Vega	decimal(9, 4)	交易组合价值变化与标的资产波动率变化的比率	N

## 分时 (COL1\_TRDMIN\_YYYYMM)

序号	字段名	注释	数据类型	备注
1	TradingDate	交易归属日期	int	yyyymmdd, 例如: 20190301
2	TradingTime	交易发生时间	datetime	yyyy-mm-dd hh:mm:ss.mmm (ss.mmm 填 0)
3	Symbol	合约代码	varchar(20)	根据交易所公布的商品期权合约代码为准
4	OpenPrice	分时段内开盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的首条成交记录的最新成交价

5	ClosePrice	分时段收盘价	decimal(9,3)	分时段区间内的末条成交记录的最新成交价
6	HighPrice	分时段最高价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最大值
7	LowPrice	分时段最低价	decimal(9,3)	分时段区间内所有成交记录的最新成交价的最小值
8	Change	涨跌	decimal(9,3)	本分时的收盘价-上一分时的收盘价
9	ChangeRatio	涨跌幅	decimal(9,4)	(本分时的收盘价-上一分时的收盘价)/上一分时的收盘价
10	Position	分时段持仓量	decimal(19,2)	分时段区间内最后一笔分笔的持仓量
11	Volume	分时段成交量	decimal(19,2)	分时段区间内成交记录的成交量之和
12	Amount	分时段成交金额	decimal(19,3)	分时段区间内成交记录的成交金额之和
13	Market	市场	varchar(5)	上期所 SHFE
14	UNIX	格林威治时间	decimal(19,0)	对应 TradingTime 与 1970-01-01 00:00:00.000 的毫秒差值再减去 8*3600
15	TotalVolume	成交总量	decimal(19,2)	取分时段区间内的末条成交记录的成交总量
16	VWAP	成交量加权平均价	decimal(9,3)	Amount / Volume / 合约乘数
17	SecurityID	证券统一编码	decimal(19,0)	统一标准内部编码，证券唯一标识
18	BenchMarkOpenPrice	开盘基准价	decimal(9,3)	取昨结算价，上市首日填挂牌基准价
19	ShortName	合约简称	nvarchar(20)	例如：铜 1903-看涨-54000
20	CumulativeLowPrice	开盘至今最低价	decimal(9,3)	交易日内开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最低价
21	CumulativeHighPrice	开盘至今最高价	decimal(9,3)	交易日内从开盘到目前这根 Bar 这段区间内的最高价
22	CumulativeVWAP	开盘至今交易量加权平均价	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的成交总额(TotalAmount)/成交总量(TotalVolume)/合约乘数
23	BuyPrice01	分时段委买价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价一，档位不够的填充 0
24	BuyPrice02	分时段委买价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价二，档位不够的填充 0
25	BuyPrice03	分时段委买价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价三，档位不够的填充 0
26	BuyPrice04	分时段委买价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价四，档位不够的填充 0
27	BuyPrice05	分时段委买价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的买价五，档位不够的填充 0
28	SellPrice01	分时段委卖价一	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价一，档位不够的填充 0
29	SellPrice02	分时段委卖价二	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价二，档位不够的填充 0
30	SellPrice03	分时段委卖价三	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价三，档位不够的填充 0
31	SellPrice04	分时段委卖价四	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价四，档位不够的填充 0
32	SellPrice05	分时段委卖价五	decimal(9,3)	本分时段区间最后一条分笔的卖价五，档位不够的填充 0
33	BuyVolume01	分时段委买量一	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量一，档位不够的填充 0
34	BuyVolume02	分时段委买量二	decimal(19,2)	本分时段区间最后一条分笔的买量二，档位不够的填充 0

35	BuyVolume03	分时委买量三	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量三，档位不够的填充 0
36	BuyVolume04	分时委买量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量四，档位不够的填充 0
37	BuyVolume05	分时委买量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的买量五，档位不够的填充 0
38	SellVolume01	分时委卖量一	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量一，档位不够的填充 0
39	SellVolume02	分时委卖量二	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量二，档位不够的填充 0
40	SellVolume03	分时委卖量三	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量三，档位不够的填充 0
41	SellVolume04	分时委卖量四	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量四，档位不够的填充 0
42	SellVolume05	分时委卖量五	decimal(19,2)	本分时区间最后一条分笔的卖量五，档位不够的填充 0
43	Return	简单收益率	decimal(9,4)	简单收益率=（分时段内收盘价-昨结算价）/昨结算价