



沪深 L2 高频行情文件说明

V1.8

版本号	说明	发布日期
V1.1	初始版本	2019-04
V1.2	对沪深交易所文件进行了区分说明;	2019-07
V1.3	优化字段细节说明; 2019-06-06 新增买卖十档位下委托笔数	2019-08
V1.4	优化字段细节说明; 2019-07-25 新增上交所盘后固定价格交易行情数据	2019-08
V1.4.1	修正深交所 MarketData、OrderQueue 文件部分字段类型 (浮点型调整为整型); 修正深交所 mdl_6_28_1、mdl_6_28_2 文件第一列字段名为 DataTimeStamp;	2019-10
V1.5.1	补充上交所 VirtualAuctionPrice 文件说明; 新增早期各字段历史情况说明	2019-11
V1.5.2	修改上交所 Index 文件 PreCloseIndex 字段历史情况说明	2019-12
V1.5.3	新增文件整体说明, 与字段校验点标注	2019-12
V1.5.4	新增交易所数量单位说明, 与上交所委托成交最大等待时间字段说明	2020-01
V1.5.5	调整上交所 InstruStatus 交易状态说明; 新增多字段释义; mdl_6_31_0 新增 MDStreamID=370 类别, 调整原 060、061 说明; mdl_6_33_0、mdl_6_36_0 剔除 MDStreamID=041 类别	2020-11
V1.6	上交所逐笔成交消息升级; 上交所新增逐笔委托行情	2021-04
V1.6.1	添加委托队列文件与行情快照文件关联的补充说明	2021-10

V1.7	上交所新债券系统上线，股债分离，新增债券三个消息号	2021-10
V1.8	上交所发布合并逐笔数据，旧版 Transaction 和 mdl_4_19_0 下线； 沪深债券单拆出去，结构参见《通联_沪深 L2 债券数据结构展示》 深交所发布 ETF 实时申赎数据(mdl_6_50_0)	2023-12

目录

文件总览.....	3
文件说明.....	4
上交所数据结构说明:	7
VIRTUALAUCTIONPRICE.....	7
MARKETDATA	8
ORDERQUEUE.....	15
INDEX	18
TRANSACTION	19
MDL_4_16_0.....	19
MDL_4_17_0.....	20
MDL_4_19_0.....	21
MDL_4_24_0.....	22
深交所数据结构说明:	25
【2010-05 ~ 2016-05-06】:	25
MARKETDATA	25
ORDERQUEUE.....	27
INDEX	30
ORDER.....	31
TRADE	32

【2016-05-07 ~ 至今】:	33
MDL_6_28_0.....	33
MDL_6_28_1.....	38
MDL_6_28_2.....	41
MDL_6_29_0.....	43
MDL_6_30_0.....	44
MDL_6_31_0.....	44
MDL_6_33_0.....	46
MDL_6_36_0.....	48
MDL_6_50_0.....	49

文件总览

说明：历史文件由于交易所数据消息架构升级等原因，在不同时期的文件名称、文件数据结构会存在差异。

SH> 上交所：

文件名	文件描述	备注
VirtualAuctionPrice.csv	上交所虚拟集合竞价快照行情	2018-12-21 之后数据合并入 MarketData 文件
MarketData.csv	上交所 L2 快照行情	mdl_4_4_0
Index.csv	上交所 L2 指数快照行情	mdl_4_6_0
OrderQueue.csv	上交所 L2 最优买卖盘前 50 笔委托	mdl_4_4_1
Transaction.csv	上交所 L2 竞价逐笔成交行情	mdl_4_18_0 2023-12-22 下线
mdl_4_16_0.csv	上交所 L2 盘后固定价格交易行情	2019-07-25 新增
mdl_4_17_0.csv	上交所 L2 盘后固定价格交易逐笔成交	2019-07-25 新增
mdl_4_19_0.csv	上交所 L2 竞价逐笔委托行情	2021-06-07 新增 2023-12-22 下线
mdl_4_24_0.csv	上交所 L2 竞价合并逐笔行情	2023-11-27 上线

SZ> 深交所：

文件名	文件描述	备注
2010-05 ~ 2016-05-06:		
MarketData.csv	深交所 L2 快照行情	
Index.csv	深交所 L2 指数快照行情	
Order.csv	深交所 L2 逐笔委托行情	从 2012-10 始
Trade.csv	深交所 L2 逐笔成交行情	
OrderQueue.csv	深交所 L2 最优买卖盘前 50 笔委托	

2016-05-07~至今:		
mdl_6_28_0.csv	深交所 L2 快照行情	
mdl_6_28_1.csv	深交所 L2 最优卖价前 50 笔委托	
mdl_6_28_2.csv	深交所 L2 最优买价前 50 笔委托	
mdl_6_29_0.csv	深交所 L2 指数快照行情	
mdl_6_30_0.csv	深交所 L2 成交量统计指标行情快照	
mdl_6_31_0.csv	深交所 L2 盘后定价交易业务行情快照	
mdl_6_33_0.csv	深交所 L2 逐笔委托行情	
mdl_6_33_0_rebuild.csv	深交所 L2 逐笔委托回补文件	非固定文件, 2020-12 后变更为 实时回补
mdl_6_36_0.csv	深交所 L2 逐笔成交行情	
mdl_6_36_0_rebuild.csv	深交所 L2 逐笔成交回补文件	非固定文件, 2020-12 后变更为 实时回补
mdl_6_50_0.csv	深交所 L2 ETF 实时申赎行情	2023-12-11 上线

文件说明

	文件名	数据内容	备注
SH	VirtualAuctionPrice	上交所开盘集合竞价行情(09:15~09:25), 包含虚拟成交价、虚拟匹配量与未匹配量	指数无集合竞价
	MarketData	上交所市场行情, 包含场内交易的股债基等各品种的成交信息 (如开高低新价、成交量成交额)、报价信息 (买卖前 10 档的委托价格、数量与笔数) 与撤单信息, 以及 ETF、债券、权证等专用信息, 如 IOPV	十档报价的价格顺序: (买) bid10 < ... < bid1 < ask1 < ... < ask10 (卖)
	Index	上交所指数行情, 包含上证与中证重要指数的开高低收价、成交量、成交额等	今收盘 CloseIndex 只在 15 点盘后有值;

			部分指数行情更新至 15 点 30
	OrderQueue	上交所前 50 笔委托队列，包含买卖一档（最优报价）下，总的委托笔数和前 50 笔委托的委托量明细	可与 MarketData 结合使用，时间可对齐
	Transaction	上交所逐笔成交行情，包含场内交易的股债基等各品种的每笔成交信息（成交价、成交量、买方卖方委托单号、成交方向）	内外盘标记可作为资金主动性流入流出的判定参考
	mdl_4_16_0	上交所盘后固定价格交易行情，目前仅涵盖科创板股票，包含以收盘价报价交易的成交情况、委托情况（买卖一档委托明细）与撤单情况	
	mdl_4_17_0	上交所盘后固定价格交易逐笔成交行情，目前仅涵盖科创板股票，与竞价交易逐笔成交字段一致	单独成交通道
	mdl_4_19_0	上交所竞价交易逐笔委托信息，同支证券的逐笔委托与逐笔成交数据在同一通道中发布，通过 BizIndex 序列号连续	集合竞价与停牌阶段不实时发布；盘后固价交易阶段不发布
	mdl_4_24_0.csv	上交所竞价交易合并逐笔成交与委托信息，同支证券的逐笔委托与逐笔成交数据在同一通道中发布，通过 BizIndex 序列号连续	集合竞价与停牌阶段不实时发布；盘后固价交易阶段不发布
SZ	2010-05~2016-05-06:		
	MarketData	深交所市场行情，包含场内交易的股债基等各品种的成交信息（如开高低新价、成交量成交额）与报价信息（买卖前 10 档的委托价格、数量与笔数），以及股票市盈率与价格涨跌等	十档报价的价格顺序： (买) bid10 < ... < bid1 < ask1 < ... < ask10 (卖)
	Index	深交所指数行情，包含深证与国证重要指数的开高低收价、成交量、成交额等	“395” 开头为成交量统计指标，无点位信息

Order	深交所逐笔委托行情，包含从集合竞价开始每一笔委托的明细信息（委托时间、价格、数量、类别等）	
Trade	深交所逐笔成交行情，包含场内交易的股债基等各品种的每笔成交信息（成交价、成交量、买方卖方委托单号）与撤单信息	
OrderQueue	深交所最优买卖盘前 50 笔委托，包含买卖一档（最优报价）下，总的委托笔数和前 50 笔委托的委托量明细	可与 MarketData 结合使用，时间可对齐
2016-05-07~至今：		
mdl_6_28_0	深交所市场行情，包含场内交易的股债基等各品种的成交信息（如开高低新价、成交量成交额）与报价信息（买卖前 10 档的委托价格、数量与笔数），以及股票市盈率与价格涨跌等	与原 MarketData 字段基本一致，新增 ETF 基金 IOPV 数据
mdl_6_28_1	深交所最优卖价前 50 笔委托，包含卖一档下总的委托笔数和前 50 笔委托的委托量明细	与原 OrderQueue 字段基本一致，只含卖方
mdl_6_28_2	深交所最优买价前 50 笔委托，包含买一档下总的委托笔数和前 50 笔委托的委托量明细	与原 OrderQueue 字段基本一致，只含买方
mdl_6_29_0	深交所指数行情，包含深证与国证重要指数的开高低收价、成交量、成交额等	与原 Index 文件披露字段一致，市场状态字段细化
mdl_6_30_0	深交所成交量统计指标行情，“395”开头，反应市场统计信息（成交量、成交笔数、成交额）及统计指标样本数量	无点位信息
mdl_6_31_0	深交所盘后定价交易业务行情，分为以成交价和以成交量加权平均价交易的两类行情，包含成交总量、成交总额、成交笔数与买卖十档的委托量	

mdl_6_33_0	深交所逐笔委托行情，包含从集合竞价开始每一笔委托的明细信息（委托时间、价格、数量、类别等）	与原 Order 文件有较大格式变更，新增“市价/限价/本方最优”的订单标识字段
mdl_6_33_0_rebuild	深交所逐笔委托回补文件，收盘后检索序列号，有丢失进行回补，结构与 mdl_6_33_0 完全一致，可直接合并使用	非固定文件
mdl_6_36_0	深交所逐笔成交行情，包含场内交易的股债基等各品种的每笔成交信息（成交价、成交量、买方卖方委托单号）与撤单信息	与原 Trade 文件有较大格式变更，判定类别由两个字段变为一个字段：ExecType
mdl_6_36_0_rebuild	深交所逐笔成交回补文件，收盘后检索序列号，有丢失进行回补，结构与 mdl_6_36_0 完全一致，可直接合并使用	非固定文件
mdl_6_50_0	深交所 ETF 基金实时申购赎回数据，包含申购赎回的笔数和数量等信息	

上交所数据结构说明：

上交所数量单位说明：

股票为股，基金为份，债券与回购为手（1 手=10 张，每张面值 100 元），指数为手。

VirtualAuctionPrice

字段名	说明	字段类型	备注
UpdateTime	交易所时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
DataStatus	数据状态	正整数	1=重复数据 2=未获授权
SecurityID	证券代码	ASIIIC 字符串	
VirPri	虚拟开盘参考价格	单精度浮点数	3 位小数

VirAucQty	虚拟匹配量	双精度浮点数	3 位小数
LeaQty	虚拟未匹配量	双精度浮点数	3 位小数
Side	方向	ASCII 字符串	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
LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
SeqNo	消息序列号	64 位正整数	2015-08-24 前为空

MarketData

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	UpdateTime	交易所时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
2	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
3	ImageStatus	快照类型(全量/更新)	32 位整数	技术字段, 不需关注 2015-08-24 前为空
4	PreCloPrice	昨收盘价	单精度浮点数	3 位小数
5	OpenPrice	今开盘价	单精度浮点数	3 位小数
6	HighPrice	最高价	单精度浮点数	3 位小数
7	LowPrice	最低价	单精度浮点数	3 位小数
8	LastPrice	最新价	单精度浮点数	3 位小数
9	ClosePrice	今收盘价	单精度浮点数	3 位小数 2015-08-24 前为空
10	InstruStatus	当前品种交易状态	ASCII 字符串	详见下注 1
11	TradNumber	成交笔数	32 位正整数	
12	TradVolume	成交总量	双精度浮点数	3 位小数
13	Turnover	成交总金额	双精度浮点数	5 位小数
14	TotalBidVol	委托买入总量	双精度浮点数	3 位小数

				统计范围为当前全部有效委托单（不含撤单）
15	WAvgBidPri	加权平均委买价格	单精度浮点数	3 位小数
16	AltWAvgBidPri	债券加权平均委买价格	单精度浮点数	3 位小数
17	TotalAskVol	委托卖出总量	双精度浮点数	3 位小数 统计范围为当前全部有效委托单（不含撤单）
18	WAvgAskPri	加权平均委卖价格	单精度浮点数	3 位小数
19	AltWAvgAskPri	债券加权平均委卖价格	单精度浮点数	3 位小数
20	EtfBuyNumber	ETF 申购笔数	32 位正整数	2015-08-24 前为空
21	EtfBuyVolume	ETF 申购数量	双精度浮点数	3 位小数 2015-08-24 前为空
22	EtfBuyMoney	ETF 申购金额	双精度浮点数	5 位小数 2015-08-24 前为空
23	EtfSellNumber	ETF 赎回笔数	32 正整数	2015-08-24 前为空
24	EtfSellVolume	ETF 赎回数量	双精度浮点数	3 位小数 2015-08-24 前为空
25	ETFSellMoney	ETF 申购金额	双精度浮点数	5 位小数 2015-08-24 前为空
26	YieldToMatu	债券到期收益率	单精度浮点数	4 位小数
27	TotWarExNum	权证执行的总数量	双精度浮点数	3 位小数 2015-08-24 前为空
28	WarLowerPri	权证跌停价格	双精度浮点数	3 位小数 2015-08-24 前为空
29	WarUpperPri	权证涨停价格	双精度浮点数	3 位小数 2015-08-24 前为空
30	WiDBuyNum	买入撤单笔数	32 位正整数	累计值 2015-08-24 前为空
31	WiDBuyVol	买入撤单数量	双精度浮点数	3 位小数，累计值

				2015-08-24 前为空
32	WiDBuyMon	买入撤单金额	双精度浮点数	5 位小数, 累计值 2015-08-24 前为空
33	WiDSellNum	卖出撤单笔数	32 位正整数	累计值 2015-08-24 前为空
34	WiDSellVol	卖出撤单数量	双精度浮点数	3 位小数, 累计值 2015-08-24 前为空
35	WiDSellMon	卖出撤单金额	双精度浮点数	5 位小数, 累计值 2015-08-24 前为空
36	TotBidNum	买入总笔数	32 位正整数	统计当前买入委托 (未成交) 的总笔数 2015-08-24 前为空
37	TotSellNum	卖出总笔数	32 位正整数	统计当前卖出委托 (未成交) 的总笔数 2015-08-24 前为空
38	MaxBidDur	买入委托成交最大等待时间	32 位正整数	10ms 级别, HHMMSS.ss。如 6607 代表 66.07s, 即 66 秒 70 毫秒。 2015-08-24 前为空
39	MaxSellDur	卖出委托最大等待时间	32 位正整数	10ms 级别, HHMMSS.ss。如 6607 代表 66.07s, 即 66 秒 70 毫秒。 2015-08-24 前为空
40	BidNum	买方委托价位数	32 位正整数	当前买方有多少档报价 2015-08-24 前为空
41	SellNum	卖方委托价位数	32 位正整数	当前卖方有多少档报价 2015-08-24 前为空

42	IOPV	ETF 净值估值	单精度浮点数	3 位小数
43	AskPrice1	申卖价 1	单精度浮点数	3 位小数
44	AskVolume1	申卖量 1	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
45	AskPrice2	申卖价 2	单精度浮点数	3 位小数
46	AskVolume2	申卖量 2	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
47	AskPrice3	申卖价 3	单精度浮点数	3 位小数
48	AskVolume3	申卖量 3	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
49	AskPrice4	申卖价 4	单精度浮点数	3 位小数
50	AskVolume4	申卖量 4	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
51	AskPrice5	申卖价 5	单精度浮点数	3 位小数
52	AskVolume5	申卖量 5	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
53	AskPrice6	申卖价 6	单精度浮点数	3 位小数
54	AskVolume6	申卖量 6	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
55	AskPrice7	申卖价 7	单精度浮点数	3 位小数
56	AskVolume7	申卖量 7	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
57	AskPrice8	申卖价 8	单精度浮点数	3 位小数
58	AskVolume8	申卖量 8	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
59	AskPrice9	申卖价 9	单精度浮点数	3 位小数
60	AskVolume9	申卖量 9	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
61	AskPrice10	申卖价 10	单精度浮点数	3 位小数
62	AskVolume10	申卖量 10	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用

63	BidPrice1	申买价 1	单精度浮点数	3 位小数
64	BidVolume1	申买量 1	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
65	BidPrice2	申买价 2	单精度浮点数	3 位小数
66	BidVolume2	申买量 2	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
67	BidPrice3	申买价 3	单精度浮点数	3 位小数
68	BidVolume3	申买量 3	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
69	BidPrice4	申买价 4	单精度浮点数	3 位小数
70	BidVolume4	申买量 4	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
71	BidPrice5	申买价 5	单精度浮点数	3 位小数
72	BidVolume5	申买量 5	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
73	BidPrice6	申买价 6	单精度浮点数	3 位小数
74	BidVolume6	申买量 6	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
75	BidPrice7	申买价 7	单精度浮点数	3 位小数
76	BidVolume7	申买量 7	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
77	BidPrice8	申买价 8	单精度浮点数	3 位小数
78	BidVolume8	申买量 8	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
79	BidPrice9	申买价 9	单精度浮点数	3 位小数
80	BidVolume9	申买量 9	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
81	BidPrice10	申买价 10	单精度浮点数	3 位小数
82	BidVolume10	申买量 10	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
83	NumOrdersB1	申买 1 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段

84	NumOrdersB2	申买 2 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
85	NumOrdersB3	申买 3 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
86	NumOrdersB4	申买 4 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
87	NumOrdersB5	申买 5 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
88	NumOrdersB6	申买 6 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
89	NumOrdersB7	申买 7 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
90	NumOrdersB8	申买 8 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
91	NumOrdersB9	申买 9 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
92	NumOrdersB10	申买 10 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
93	NumOrdersS1	申卖 1 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
94	NumOrdersS2	申卖 2 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
95	NumOrdersS3	申卖 3 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
96	NumOrdersS4	申卖 4 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
97	NumOrdersS5	申卖 5 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
98	NumOrdersS6	申卖 6 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
99	NumOrdersS7	申卖 7 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
100	NumOrdersS8	申卖 8 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
101	NumOrdersS9	申卖 9 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
102	NumOrdersS10	申卖 10 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-06 新增字段
103	LocalTime	本地接受时间戳		时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
104	SeqNo	64 位消息序列号		接收序列号 2015-08-24 前为空

注 1:

交易状态取值说明:

START 启动

OCALL 开市集合竞价

TRADE 连续自动撮合

SUSP 停牌 (SUSP 和 HALT 的区别在于在 SUSP 时可以撤单)

CCALL 闭市集合竞价

CLOSE 闭市, 自动计算闭市价格

ENDTR 交易结束

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

ADD 新产品

BETW 交易间, 禁止任何交易活动

BREAK 休市, 例如: 午餐休市。无撮合和市场内部信息披露

DEL 产品待删除

FCALL 固定价格集合竞价

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

OOBB 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

VOLA 连续交易和集合竞价交易的波动性中断 (VOLA)

交易所状态发布说明:

Level-2 没有全市场收盘标志, 只有每个股票的收盘标志。

历史发布: 在 9:00~9:15 间, 如果该证券当日第一天停牌, 则可以收到 SUSP 标志; 如果连续停牌, 则无法收到停牌标志; 9:15~9:25 是集合竞价阶段, 由于不发行情快照, 所以无法收到 OCALL 标志; 9:25 到 9:30, 如果正常交易的股票会有 BETW 标志; 9:30~11:30, 会有 TRADE 标志; 11:30~13:00, 是 BREAK 标志; 13:00~15:00, 又是 TRADE; 15:00 后, 首先发 CLOSE 标志, 随后发 ENDTR 标志。

2019 年后发布调整:

如果该证券当日第一天停牌, 则当天先后收到 SUSP、CLOSE 及 ENDTR 标志; 如果连续停牌, 则始终保持

SUSP 标志。

8: 45~9: 15, 发 START 标志; 9: 15~9: 25 是开盘集合竞价阶段, 发 OCALL 标志; 9: 25~14: 57 是连续竞价阶段, 发 TRADE 标志; 14: 57~15: 00 是收盘集合竞价阶段, 发 CCALL 标志; 15: 00 后, 首先发 CLOSE 标志, 随后发 ENDTR 标志。

对于债券回购产品, 9: 25~15: 30 是连续竞价阶段, 发 TRADE 标志; 15: 30 后, 首先发 CLOSE 标志, 随后发 ENDTR 标志; 其余与前一致。

OrderQueue

字段名	说明	字段类型	备注
UpdateTime	关联行情快照交易所时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
ImageStatus	快照状态	正整数	1: 全量行情 2: 增量行情, 客户端不会接收到该值 3: 增量和上一次全量合并后的行情 2015-08-24 前为空
Side	买卖方向	ASCII 字符串	S: 卖 B: 买
NoPriceLevel	价格档位	正整数	最优买卖档位, 总是 1
PrcLvlOperator	委托进入方式	正整数	当快照状态是增量行情时, 此字段表示委托进入方式, 因此客户端不会接收到该值
Price	委托价格	单精度浮点数	3 位小数
Volume	委托数量	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用 股票: 股 权证: 份 债券: 手 2015-08-24 前均为空, 可在 MarketData 获取
NumOrders	委托笔数	正整数	委买(卖)价 1 上总委托笔数 (可以超

			过 50) 2011-03-23 ~ 2015-07-30 均为空 校验点: 若 NoOrders<50, 则 NumOrders=NoOrders; 若 NoOrders=50, 则 NumOrders>NoOrders (允许小概率相等数据)
NoOrders	委托队列长度	正整数	委买(卖)价 1 上揭示的委托笔数。 当委托笔数 ≤ 50 时, 委托队列长度 = 委托笔数 当委托笔数 > 50 时, 委托队列长度 = 50
OrderQty1	委托量 1	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty2	委托量 2	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty3	委托量 3	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty4	委托量 4	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty5	委托量 5	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty6	委托量 6	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty7	委托量 7	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty8	委托量 8	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty9	委托量 9	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty10	委托量 10	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty11	委托量 11	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty12	委托量 12	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty13	委托量 13	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty14	委托量 14	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty15	委托量 15	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty16	委托量 16	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty17	委托量 17	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty18	委托量 18	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty19	委托量 19	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用

OrderQty20	委托量 20	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty21	委托量 21	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty22	委托量 22	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty23	委托量 23	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty24	委托量 24	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty25	委托量 25	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty26	委托量 26	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty27	委托量 27	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty28	委托量 28	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty29	委托量 29	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty30	委托量 30	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty31	委托量 31	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty32	委托量 32	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty33	委托量 33	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty34	委托量 34	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty35	委托量 35	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty36	委托量 36	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty37	委托量 37	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty38	委托量 38	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty39	委托量 39	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty40	委托量 40	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty41	委托量 41	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty42	委托量 42	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty43	委托量 43	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty44	委托量 44	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty45	委托量 45	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty46	委托量 46	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty47	委托量 47	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty48	委托量 48	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty49	委托量 49	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用
OrderQty50	委托量 50	双精度浮点数	3 位小数, 小数部分未使用

LocalTime	关联行情快照本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒, 与 SeqNo 结合使用保证关联唯一性 2015-08-24 前为空
SeqNo	关联行情快照消息序列号	正整数	64 位, 与 LocalTime 结合使用保证关联唯一性 2015-08-24 前为空

Index

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	UpdateTime	交易所时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
2	DataStatus	数据状态	正整数	1=重复数据 2=未获授权 技术字段, 不需关注
3	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
4	PreCloseIndex	前收盘指数	双精度浮点数	5 位小数 2015-01-05 ~ 2015-08-24, 数据为空 全天有值且不变
5	OpenIndex	今开盘指数	双精度浮点数	5 位小数
6	Turnover	成交金额	双精度浮点数	1 位小数
7	HighIndex	最高指数	双精度浮点数	5 位小数
8	LowIndex	最低指数	双精度浮点数	5 位小数
9	LastIndex	最新指数	双精度浮点数	5 位小数
10	TradTime	成交时间	时间	时:分:秒.毫秒
11	TradVolume	交易数量(手)	双精度浮点数	5 位小数
12	CloseIndex	今日收盘指数(大于 0 为有效值)	双精度浮点数	5 位小数 15 点收盘后有值
13	LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
14	SeqNo	消息序列号	64 位正整数	2015-08-24 前为空

Transaction

字段名	说明	字段类型	备注
DataStatus	数据状态	正整数	1=重复数据 2=未获授权
TradeIndex	成交序号	整数	从 1 开始, 连续
TradeChan	成交通道	整数	同一通道 TradeChan 下成交序号连续
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
TradTime	成交时间	时间	时:分:秒.毫秒
TradPrice	成交价格	单精度浮点数	3 位小数
TradVolume	成交数量	双精度浮点数	3 位小数 股票: 股 权证: 份 债券: 手
TradeMoney	成交金额	双精度浮点数	5 位小数
TradeBuyNo	买方单号	64 位整数	2013-04-15 前为空
TradeSellNo	卖方单号	64 位整数	2013-04-15 前为空
TradeBSFlag	内外盘标志	ASCII 字符串	B=外盘主动买 S=内盘主动卖 N=未知 2013-04-15 前为空
BizIndex	业务序列号	64 位整数	与逐笔委托统一编号, 从 1 开始按 Channel 连续 2021-04-26 新增字段
LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
SeqNo	消息序列号	64 位正整数	2015-08-24 前为空

mdl_4_16_0

字段名	说明	字段类型	备注
-----	----	------	----

UpdateTime	交易所时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
ImageStatus	快照类型	32 位整数	1-全量
ClosePx	今收盘价	单精度浮点数	3 位小数
InstrumentStatus	当前品种交易状态	ASCII 字符串	
	PCALL - 集中撮合时段		
	POSMT - 连续交易时段		
	ENDPT - 闭市时段		
NumTrades	成交笔数	32 位正整数	
TotalVolumeTrade	成交总量	双精度浮点数	3 位小数
TotalValueTrade	成交总金额	双精度浮点数	5 位小数
TotalBidQty	委托买入总量	双精度浮点数	3 位小数
TotalOfferQty	委托卖出总量	双精度浮点数	3 位小数
WithdrawBuyNumber	买入撤单笔数	32 位正整数	
WithdrawBuyAmount	买入撤单数量	双精度浮点数	3 位小数
WithdrawSellNumber	卖出撤单笔数	32 位正整数	
WithdrawSellAmount	卖出撤单数量	双精度浮点数	3 位小数
Bid1_OrderQty	申买量 1	双精度浮点数	3 位小数
Bid1_NumOrders	申买 1 档的委托笔数	32 位正整数	
Bid1_Orders50	申买 1 档前 50 笔委托 明细	ASCII 字符串	每笔委托数量明细
Offer1_OrderQty	申卖量 1	双精度浮点数	3 位小数
Offer1_NumOrders	申卖 1 档的委托笔数	32 位正整数	
Offer1_Orders50	申卖 1 档前 50 笔委托 明细	ASCII 字符串	每笔委托数量明细
LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SeqNo	消息序列号	64 位正整数	

mdl_4_17_0

字段名	说明	字段类型	备注
-----	----	------	----

DataStatus	数据状态	正整数	1=重复数据 2=未获授权
TradeIndex	成交序号	整数	从 1 开始, 按 TradeChannel 连续
TradeChannel	成交通道	整数	
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
TradeTime	成交时间	时间	时:分:秒.毫秒
TradePrice	成交价格	单精度浮点数	3 位小数
TradeQty	成交数量	双精度浮点数	3 位小数 股票: 股; 债券: 手
TradeMoney	成交金额	双精度浮点数	5 位小数
TradeBuyNo	买方单号	64 位整数	
TradeSellNo	卖方单号	64 位整数	
TradeBSFlag	内外盘标志	ASCII 字符串	B=外盘主动买 S=内盘主动卖 N=未知
LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SeqNo	消息序列号	64 位正整数	

mdl_4_19_0

字段名	说明	字段类型	备注
DataStatus	数据状态	正整数	1=重复数据 2=未获授权
OrderIndex	委托序号	正整数	从 1 开始, 按 Channel 连续
OrderChannel	行情通道	正整数	
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
OrderTime	委托时间	时间	时:分:秒.毫秒
OrderType	订单类型	ASCII 字符串	A-新增委托订单【注 1】 D-删除委托订单
OrderNO	原始订单号	正整数	可与逐笔成交中买卖订单号对应

OrderPrice	委托价格	双精度浮点数	单位：元 三位小数（预留）
Balance	委托量【注 2】	双精度浮点数	三位小数（预留）
OrderBSFlag	委托标识	ASCII 字符串	B-买单； S-卖单；
BizIndex	业务序列号	64 位整数	与逐笔成交统一编号，从 1 开始按 Channel 连续【注 3】
LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SeqNo	消息序列号	64 位正整数	

【注 1】新增委托订单，仅在首次撮合后发布（对应委托量为首次撮合后的剩余委托量）；之后在被动成交过程中，不再发布该笔委托的变动信息；

【注 2】在集合竞价或停牌阶段，发布的委托量为原始委托数量；且集合竞价及停牌阶段收到的有效委托不实时发布，在集合竞价或停牌阶段结束后统一发布。若停牌至收盘，将不再发布停牌期间的逐笔委托消息。

在连续竞价阶段，发布的委托数量为订单首次撮合后的剩余委托量；若一笔订单被一次性全部撮合，将不会发布该笔订单的委托信息。

【注 3】竞价逐笔委托与竞价逐笔成交属于不同的消息，没有固定的到达先后次序关系。BizIndex 字段为竞价逐笔委托消息和竞价逐笔成交消息合并后的连续编号，可以通过 BizIndex 字段判断竞价逐笔委托消息与竞价逐笔成交消息产生的先后顺序。

mdl_4_24_0

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	BizIndex	逐笔序号	正整数	从 1 开始，按 Channel 连续
2	Channel	行情通道	正整数	
3	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
4	TickTime	订单或成交时间	时间	时:分:秒.毫秒
5	Type	类型	ASCII 字符串	A-新增委托订单【注 1】 D-删除委托订单（即撤单） S-产品状态 订单 T-成交

6	BuyOrderNO	买方订单	正整数	若为产品状态订单或卖方订单无意义
7	SellOrderNO	卖方订单	正整数	若为产品状态订单或买方订单无意义
8	Price	价格	双精度浮点数	单位：元（三位小数） 若为产品状态订单、删除订单无意义
9	Qty	数量【注 2】	整数	若为产品状态订单无意义
10	TradeMoney	成交金额	双精度浮点数	对于新增委托：已成交的委托数量 对于成交：成交金额（单位为元） 其他无意义（三位小数）
11	TickBSFlag	标识	ASCII 字符串	若为新增或删除委托订单： B - 买单 S - 卖单 若为产品状态订单： START 启动 OCALL 开市集合竞价 TRADE 连续自动撮合 SUSP 停牌 CCALL 收盘集合竞价 CLOSE 闭市 ENDTR 交易结束 若为成交： B 外盘 主动买 S 内盘 主动卖 N 未知
12	LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
13	SeqNo	消息序列号	64 位正整数	

【注 1】连续竞价阶段，同一笔委托产生的主动成交及剩余新增委托订单数据，先发送成交数据，再发送成交后的新增委托订单数据（对应委托量为首次撮合后的剩余委托量）；之后再产生的剩余委托订单数据不再发布；若一笔订单被一次性全部撮合，将不会发布该笔订单的委托

信息。

【注 2】在集合竞价及停牌阶段，发布的委托量为原始委托数量；且集合竞价及停牌阶段收到的有效委托不实时发布，在集合竞价或停牌阶段结束后统一发布；先发送委托订单数据，再发送成交数据和产品状态订单数据；若停牌至收盘，将不再发布停牌期间的逐笔委托消息。

【注 3】单个产品的所有逐笔类消息在同一通道发布。

深交所数据结构说明：

深交所数量单位说明：

股票为股，基金为份，债券与回购为张，指数为股

【2010-05 ~ 2016-05-06】：

MarketData

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	DataTimeStamp	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
2	SecurityID	证券代码	ASIIIC 字符串	
3	PreClosePx	昨日收盘价	双精度浮点数	3 位小数
4	OpenPx	开盘价	双精度浮点数	3 位小数
5	HighPx	最高价	双精度浮点数	3 位小数
6	LowPx	最低价	双精度浮点数	3 位小数
7	LastPx	最近价	双精度浮点数	3 位小数
8	NumTrades	成交笔数	64 位正整数	
9	TotalVolumeTrade	成交总量	64 位正整数	
10	TotalValueTrade	成交总金额	双精度浮点数	3 位小数
11	TotalLongPosition	合约持仓量	64 位正整数	均为 0
12	PERatio1	市盈率 1 股票：价格/上年每股利润 债券：每百元应计利息	双精度浮点数	2 位小数
13	PERatio2	市盈率 2 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	双精度浮点数	2 位小数 交易所预留字段，尚未披露，值为 0

		权证：溢价率		
14	EndOfDayMaker	闭市标志 Y = 闭市 N = 开市	ASIIIC 字符串	2015-08-24 前为空
15	TotalOfferQty	委托卖出总量 (有效竞价范围内)	64 位正整数	2011-08-10 前为空
16	WeightedAvgOfferPx	加权平均卖出价格 (有效竞价范围内)	双精度浮点数	3 位小数 2011-08-10 前为空
17	TotalBidQty	委托买入总量 (有效竞价范围内)	64 位正整数	2011-08-10 前为空
18	WeightedAvgBidPx	加权平均买入价格 (有效竞价范围内)	双精度浮点数	3 位小数 2011-08-10 前为空
19	AskPrice1	申卖价 1	单精度浮点数	3 位小数
20	AskVolume1	申卖量 1	64 位正整数	
21	AskPrice2	申卖价 2	单精度浮点数	3 位小数
22	AskVolume2	申卖量 2	64 位正整数	
23	AskPrice3	申卖价 3	单精度浮点数	3 位小数
24	AskVolume3	申卖量 3	64 位正整数	
25	AskPrice4	申卖价 4	单精度浮点数	3 位小数
26	AskVolume4	申卖量 4	64 位正整数	
27	AskPrice5	申卖价 5	单精度浮点数	3 位小数
28	AskVolume5	申卖量 5	64 位正整数	
29	AskPrice6	申卖价 6	单精度浮点数	3 位小数
30	AskVolume6	申卖量 6	64 位正整数	
31	AskPrice7	申卖价 7	单精度浮点数	3 位小数
32	AskVolume7	申卖量 7	64 位正整数	
33	AskPrice8	申卖价 8	单精度浮点数	3 位小数
34	AskVolume8	申卖量 8	64 位正整数	
35	AskPrice9	申卖价 9	单精度浮点数	3 位小数
36	AskVolume9	申卖量 9	64 位正整数	
37	AskPrice10	申卖价 10	单精度浮点数	3 位小数

38	AskVolume10	申卖量 10	64 位正整数	
39	BidPrice1	申买价 1	单精度浮点数	3 位小数
40	BidVolume1	申买量 1	64 位正整数	
41	BidPrice2	申买价 2	单精度浮点数	3 位小数
42	BidVolume2	申买量 2	64 位正整数	
43	BidPrice3	申买价 3	单精度浮点数	3 位小数
44	BidVolume3	申买量 3	64 位正整数	
45	BidPrice4	申买价 4	单精度浮点数	3 位小数
46	BidVolume4	申买量 4	64 位正整数	
47	BidPrice5	申买价 5	单精度浮点数	3 位小数
48	BidVolume5	申买量 5	64 位正整数	
49	BidPrice6	申买价 6	单精度浮点数	3 位小数
50	BidVolume6	申买量 6	64 位正整数	
51	BidPrice7	申买价 7	单精度浮点数	3 位小数
52	BidVolume7	申买量 7	64 位正整数	
53	BidPrice8	申买价 8	单精度浮点数	3 位小数
54	BidVolume8	申买量 8	64 位正整数	
55	BidPrice9	申买价 9	单精度浮点数	3 位小数
56	BidVolume9	申买量 9	64 位正整数	
57	BidPrice10	申买价 10	单精度浮点数	3 位小数
58	BidVolume10	申买量 10	64 位正整数	
59	LocalTime	本地接受时间戳		时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
60	SeqNo	64 位消息序列号		2015-08-24 前为空

OrderQueue

字段名	说明	字段类型	备注
DataTimeStamp	关联行情快照 交易所时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	

ImageStatus	快照状态	正整数	1: 全量行情 2: 增量行情, 客户端不会接收到该值 3: 增量和上一次全量合并后的行情 2015-08-24 前为空
Side	买卖方向	ASCII 字符串	S: 卖 B: 买
NoPriceLevel	价格档位	正整数	最优买卖档位, 总是 1
PrcLvlOperator	委托进入方式	正整数	当快照状态是增量行情时, 此字段表示委托进入方式, 因此客户端不会接收到该值
Price	委托价格	单精度浮点数	3 位小数
Volume	委托数量	正整数	校验点: 若 NumOrders = NoOrders, 则 $Volume = \text{Sum}(\text{OrderQty1} \sim 50)$ 若 NumOrders > NoOrders, 则 $Volume > \text{Sum}(\text{OrderQty1} \sim 50)$
NumOrders	委托笔数	正整数	委买(卖)价 1 上总委托笔数 (可以超过 50)
NoOrders	委托队列长度	正整数	委买(卖)价 1 上揭示的委托笔数。 当委托笔数 ≤ 50 时, 委托队列长度 = 委托笔数; 当委托笔数 > 50 时, 委托队列长度 = 50
OrderQty1	委托量 1	正整数	
OrderQty2	委托量 2	正整数	
OrderQty3	委托量 3	正整数	
OrderQty4	委托量 4	正整数	
OrderQty5	委托量 5	正整数	
OrderQty6	委托量 6	正整数	

OrderQty7	委托量 7	正整数	
OrderQty8	委托量 8	正整数	
OrderQty9	委托量 9	正整数	
OrderQty10	委托量 10	正整数	
OrderQty11	委托量 11	正整数	
OrderQty12	委托量 12	正整数	
OrderQty13	委托量 13	正整数	
OrderQty14	委托量 14	正整数	
OrderQty15	委托量 15	正整数	
OrderQty16	委托量 16	正整数	
OrderQty17	委托量 17	正整数	
OrderQty18	委托量 18	正整数	
OrderQty19	委托量 19	正整数	
OrderQty20	委托量 20	正整数	
OrderQty21	委托量 21	正整数	
OrderQty22	委托量 22	正整数	
OrderQty23	委托量 23	正整数	
OrderQty24	委托量 24	正整数	
OrderQty25	委托量 25	正整数	
OrderQty26	委托量 26	正整数	
OrderQty27	委托量 27	正整数	
OrderQty28	委托量 28	正整数	
OrderQty29	委托量 29	正整数	
OrderQty30	委托量 30	正整数	
OrderQty31	委托量 31	正整数	
OrderQty32	委托量 32	正整数	
OrderQty33	委托量 33	正整数	
OrderQty34	委托量 34	正整数	
OrderQty35	委托量 35	正整数	
OrderQty36	委托量 36	正整数	
OrderQty37	委托量 37	正整数	

OrderQty38	委托量 38	正整数	
OrderQty39	委托量 39	正整数	
OrderQty40	委托量 40	正整数	
OrderQty41	委托量 41	正整数	
OrderQty42	委托量 42	正整数	
OrderQty43	委托量 43	正整数	
OrderQty44	委托量 44	正整数	
OrderQty45	委托量 45	正整数	
OrderQty46	委托量 46	正整数	
OrderQty47	委托量 47	正整数	
OrderQty48	委托量 48	正整数	
OrderQty49	委托量 49	正整数	
OrderQty50	委托量 50	正整数	
LocalTime	关联行情快照 本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒, 与 SeqNo 结合使用保证关联唯一性 2015-08-24 前为空
SeqNo	关联行情快照 消息序列号	正整数	64 位, 与 LocalTime 结合使用保证关联唯一性 2015-08-24 前为空

Index

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	SecurityID	证券代码	ASIIIC 字符串	
2	OpenIndex	今开盘指数	双精度浮点数	4 位小数
3	Turnover	成交金额	双精度浮点数	3 位小数
4	HighIndex	最高指数	双精度浮点数	4 位小数
5	LowIndex	最低指数	双精度浮点数	4 位小数
6	LastIndex	最新指数	双精度浮点数	4 位小数
7	DataTimeStamp	数据时间	时间	时:分:秒.毫秒
8	NumTrades	成交笔数	64 位整数	成分股成交笔数汇总

9	TotalVolumeTraded	交易数量	64 位整数	
10	CloseIndex	前收盘指数	双精度浮点数	4 位小数 注意为前收盘, 全天有 值且不变
11	EndOfDayMaker	闭市标志	ASCII 字符串	Y-闭市 N-开市 2015-08-24 前为空
12	LocalTime	本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
13	SeqNo	消息序列号	64 位正整数	2015-08-24 前为空

Order

字段名	说明	字段类型	备注
RecNo	委托索引	32 位整数	指定证券集上唯一记录标识, 从 1 开始计数
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
OrderEntryTime	委托时间	时间	时:分:秒.毫秒
Price	委托价格	双精度浮点数	3 位小数
OrderQty	委托数量	32 位正整数	
OrderKind	委托类别	ASCII 字符串	与 FunctionCode 结合使用
FunctionCode	委托代码	ASCII 字符串	
SetNo	证券集代号	32 位正整数	类似上交所通道编码, 与 RecNo 结合使用
LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
SeqNo	接收序列号	64 位整数	2015-08-24 前为空

用法说明:

OrderKind	FunctionCode	业务含义
-----------	--------------	------

0	B	正常交易业务的买委托记录
0	S	正常交易业务的卖委托记录
0	C	正常交易业务的撤单记录
2	B	即时成交剩余撤销买委托记录
2	S	即时成交剩余撤销卖委托记录
K	B	ETF 基金申购申报记录
K	S	ETF 基金赎回申报记录
V	B	最优五档即时成交剩余撤销买委托记录
V	S	最优五档即时成交剩余撤销卖委托记录
W	B	全额成交或撤销买委托记录
W	S	全额成交或撤销卖委托记录
X	B	本方最优价格买委托记录
X	S	本方最优价格卖委托记录
X	C	本方最优价格撤单委托记录
Y	B	对手方最优价格买委托记录
Y	S	对手方最优价格卖委托记录
Y	C	对手方最优价格撤单委托记录

Trade

字段名	说明	字段类型	备注
RecNo	成交索引	32 位正整数	指定证券集上唯一记录标识, 从 1 开始计数 2012-10-08 前为空
BuyOrderRecNo	买方委托索引	32 位正整数	从 1 开始计数, 0 表示无对应委托。 2012-10-08 前为空
SellOrderRecNo	卖方委托索引	32 位正整数	从 1 开始计数, 0 表示无对应委托。 2012-10-08 前为空
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	

TradeTime	成交时间	时间	时:分:秒.毫秒
Price	成交价格	双精度浮点数	3 位小数
TradeQty	成交数量	32 位正整数	
OrderKind	成交类别	ASCII 字符串	与 FunctionCode 结合使用。
FunctionCode	成交代码	ASCII 字符串	0-成交, C-撤单 2012-10-08 前该字段始终为 0
SetNo	证券集代号	32 位正整数	2012-10-08 前为空
LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒 2015-08-24 前为空
SeqNo	接收序列号	64 位整数	2015-08-24 前为空

用法说明:

OrderKind	FunctionCode	业务含义
0	0	交易业务的成交记录
0	C	交易业务的撤单记录
2	C	“即时成交剩余撤销委托”未能成交部分或其他原因的自动撤单回报记录
K	0	ETF 基金申购/赎回成功回报记录或证券给付明细回报记录
K	C	ETF 基金申购/赎回撤单回报记录
V	C	“最优五档即时成交剩余撤销委托”未能成功部分的自动撤单记录
W	C	“全额成交或撤销委托记录”未能成交部分的自动撤单记录
X	C	本方最优价格委托的撤单回报记录
Y	C	对手方最优价格委托的撤单回报记录
Z	0	ETF 基金申购/赎回成功允许/必须现金替代明细回报记录

【2016-05-07 ~ 至今】:

mdl_6_28_0

列	字段名	说明	字段类型	备注
---	-----	----	------	----

1	UpdateTime	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
2	MDStreamID	行情类别: 010 现货 (股票, 基金, 债券等) 集中竞价交易快照行情 020 质押式回购交易快照行情 030 债券分销快照行情	ASCII 字符串	
3	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
4	SecurityIDSource	证券代码源	ASCII 字符串	102 深交所
5	TradingPhaseCode	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=连续竞价 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	ASCII 字符串	
6	PreCloPrice	昨收价	双精度浮点数	4 位小数
7	TurnNum	成交笔数	64 位整数	
8	Volume	成交总量	64 位整数	
9	Turnover	成交总金额	双精度浮点数	4 位小数
10	LastPrice	最新价	双精度浮点数	6 位小数
11	OpenPrice	开盘价	双精度浮点数	6 位小数

12	HighPrice	最高价	双精度浮点数	6 位小数
13	LowPrice	最低价	双精度浮点数	6 位小数
14	DifPrice1	涨跌 1 (最新价-昨收价)	双精度浮点数	6 位小数
15	DifPrice2	涨跌 2 (最新价-上一最新价)	双精度浮点数	6 位小数
16	PE1	股票市盈率 1	双精度浮点数	6 位小数
17	PE2	股票市盈率 2	双精度浮点数	预留条目 6 位小数
18	PreCloseIOPV	基金 T-1 日净值	双精度浮点数	6 位小数
19	IOPV	基金实时参考净值(包括 ETF 的 IOPV)	双精度浮点数	6 位小数
20	TotalBidQty	委托买入总量(有效竞价范围内)	64 位整数	
21	WeightedAvgBidPx	加权平均买入价格(有效竞价范围内)	双精度浮点数	6 位小数
22	TotalOfferQty	委托卖出总量(有效竞价范围内)	64 位整数	
23	WeightedAvgOfferPx	加权平均卖出价格(有效竞价范围内)	双精度浮点数	6 位小数
24	HighLimitPrice	涨停价, 999999999.9999 表示无涨停价格限制。	双精度浮点数	6 位小数
25	LowLimitPrice	跌停价, 对于价格可以为负数的业务, -999999999.9999 表示无跌停价格限制; 对于价格不可以为负数的业务, 则填写价格档位, 表示无跌停价格限制, 比如对于股票现货集中竞价业务填写 0.01	双精度浮点数	6 位小数
26	OpenInt	持仓量	64 位整数	
27	OptPremiumRatio	权证溢价率	双精度浮点数	6 位小数

28	AskPrice1	申卖价 1	双精度浮点数	6 位小数
29	AskVolume1	申卖量 1	64 位整数	
30	AskPrice2	申卖价 2	双精度浮点数	6 位小数
31	AskVolume2	申卖量 2	64 位整数	
32	AskPrice3	申卖价 3	双精度浮点数	6 位小数
33	AskVolume3	申卖量 3	64 位整数	
34	AskPrice4	申卖价 4	双精度浮点数	6 位小数
35	AskVolume4	申卖量 4	64 位整数	
36	AskPrice5	申卖价 5	双精度浮点数	6 位小数
37	AskVolume5	申卖量 5	64 位整数	
38	AskPrice6	申卖价 6	双精度浮点数	6 位小数
39	AskVolume6	申卖量 6	64 位整数	
40	AskPrice7	申卖价 7	双精度浮点数	6 位小数
41	AskVolume7	申卖量 7	64 位整数	
42	AskPrice8	申卖价 8	双精度浮点数	6 位小数
43	AskVolume8	申卖量 8	64 位整数	
44	AskPrice9	申卖价 9	双精度浮点数	6 位小数
45	AskVolume9	申卖量 9	64 位整数	
46	AskPrice10	申卖价 10	双精度浮点数	6 位小数
47	AskVolume10	申卖量 10	64 位整数	
48	BidPrice1	申买价 1	双精度浮点数	6 位小数
49	BidVolume1	申买量 1	64 位整数	
50	BidPrice2	申买价 2	双精度浮点数	6 位小数
51	BidVolume2	申买量 2	64 位整数	
52	BidPrice3	申买价 3	双精度浮点数	6 位小数
53	BidVolume3	申买量 3	64 位整数	
54	BidPrice4	申买价 4	双精度浮点数	6 位小数
55	BidVolume4	申买量 4	64 位整数	
56	BidPrice5	申买价 5	双精度浮点数	6 位小数

57	BidVolume5	申买量 5	64 位整数	
58	BidPrice6	申买价 6	双精度浮点数	6 位小数
59	BidVolume6	申买量 6	64 位整数	
60	BidPrice7	申买价 7	双精度浮点数	6 位小数
61	BidVolume7	申买量 7	64 位整数	
62	BidPrice8	申买价 8	双精度浮点数	6 位小数
63	BidVolume8	申买量 8	64 位整数	
64	BidPrice9	申买价 9	双精度浮点数	6 位小数
65	BidVolume9	申买量 9	64 位整数	
66	BidPrice10	申买价 10	双精度浮点数	6 位小数
67	BidVolume10	申买量 10	64 位整数	
68	NumOrdersB1	申买 1 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
69	NumOrdersB2	申买 2 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
70	NumOrdersB3	申买 3 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
71	NumOrdersB4	申买 4 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
72	NumOrdersB5	申买 5 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
73	NumOrdersB6	申买 6 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
74	NumOrdersB7	申买 7 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
75	NumOrdersB8	申买 8 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
76	NumOrdersB9	申买 9 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
77	NumOrdersB10	申买 10 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段

78	NumOrdersS1	申卖 1 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
79	NumOrdersS2	申卖 2 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
80	NumOrdersS3	申卖 3 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
81	NumOrdersS4	申卖 4 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
82	NumOrdersS5	申卖 5 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
83	NumOrdersS6	申卖 6 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
84	NumOrdersS7	申卖 7 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
85	NumOrdersS8	申卖 8 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
86	NumOrdersS9	申卖 9 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
87	NumOrdersS10	申卖 10 档委托笔数	32 位正整数	2019-06-05 新增字段
88	LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
89	SeqNo	接收序列号	64 位整数	

mdl_6_28_1

字段名	说明	字段类型	备注
DataTimeStamp	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
ImageStatus	快照状态	正整数	1: 全量行情
Side	买卖方向	ASCII 字符串	S: 卖 B: 买

NoPriceLevel	价格档位	正整数	最优买卖档位, 总是 1
PrcLvlOperator	委托进入方式	正整数	保留未用
Price	委托价格	双精度浮点数	6 位小数
Volume	委托数量	64 位整数	
NumOrders	委托笔数	正整数	
NoOrders	委托队列长度	正整数	当委托笔数 ≤ 50 时, 委托队列长度 = 委托笔数 当委托笔数 > 50 时, 委托队列长度 = 50
OrderQty1	委托量 1	正整数	
OrderQty2	委托量 2	正整数	
OrderQty3	委托量 3	正整数	
OrderQty4	委托量 4	正整数	
OrderQty5	委托量 5	正整数	
OrderQty6	委托量 6	正整数	
OrderQty7	委托量 7	正整数	
OrderQty8	委托量 8	正整数	
OrderQty9	委托量 9	正整数	
OrderQty10	委托量 10	正整数	
OrderQty11	委托量 11	正整数	
OrderQty12	委托量 12	正整数	
OrderQty13	委托量 13	正整数	
OrderQty14	委托量 14	正整数	
OrderQty15	委托量 15	正整数	
OrderQty16	委托量 16	正整数	
OrderQty17	委托量 17	正整数	
OrderQty18	委托量 18	正整数	
OrderQty19	委托量 19	正整数	
OrderQty20	委托量 20	正整数	
OrderQty21	委托量 21	正整数	

OrderQty22	委托量 22	正整数	
OrderQty23	委托量 23	正整数	
OrderQty24	委托量 24	正整数	
OrderQty25	委托量 25	正整数	
OrderQty26	委托量 26	正整数	
OrderQty27	委托量 27	正整数	
OrderQty28	委托量 28	正整数	
OrderQty29	委托量 29	正整数	
OrderQty30	委托量 30	正整数	
OrderQty31	委托量 31	正整数	
OrderQty32	委托量 32	正整数	
OrderQty33	委托量 33	正整数	
OrderQty34	委托量 34	正整数	
OrderQty35	委托量 35	正整数	
OrderQty36	委托量 36	正整数	
OrderQty37	委托量 37	正整数	
OrderQty38	委托量 38	正整数	
OrderQty39	委托量 39	正整数	
OrderQty40	委托量 40	正整数	
OrderQty41	委托量 41	正整数	
OrderQty42	委托量 42	正整数	
OrderQty43	委托量 43	正整数	
OrderQty44	委托量 44	正整数	
OrderQty45	委托量 45	正整数	
OrderQty46	委托量 46	正整数	
OrderQty47	委托量 47	正整数	
OrderQty48	委托量 48	正整数	
OrderQty49	委托量 49	正整数	
OrderQty50	委托量 50	正整数	
LocalTime	关联集中竞价交易快照 行情本地接受时间戳	时间	时:分:秒.毫秒, 与 SeqNo 结合使用保证关联唯一性

SeqNo	关联集中竞价交易快照 行情消息序列号	64 位整数	与 LocalTime 结合使用保证 关联唯一性
-------	-----------------------	--------	-----------------------------

mdl_6_28_2

字段名	说明	字段类型	备注
DataTimeStamp	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
ImageStatus	快照状态	正整数	1: 全量行情
Side	买卖方向	ASCII 字符串	S: 卖 B: 买
NoPriceLevel	价格档位	正整数	最优买卖档位, 总是 1
PrcLvlOperator	委托进入方式	正整数	保留未用
Price	委托价格	双精度浮点数	6 位小数
Volume	委托数量	64 位整数	
NumOrders	委托笔数	正整数	
NoOrders	委托队列长度	正整数	当委托笔数 ≤ 50 时, 委托队列长度 = 委托笔数 当委托笔数 > 50 时, 委托队列长度 = 50
OrderQty1	委托量 1	正整数	
OrderQty2	委托量 2	正整数	
OrderQty3	委托量 3	正整数	
OrderQty4	委托量 4	正整数	
OrderQty5	委托量 5	正整数	
OrderQty6	委托量 6	正整数	
OrderQty7	委托量 7	正整数	
OrderQty8	委托量 8	正整数	
OrderQty9	委托量 9	正整数	
OrderQty10	委托量 10	正整数	
OrderQty11	委托量 11	正整数	

OrderQty12	委托量 12	正整数	
OrderQty13	委托量 13	正整数	
OrderQty14	委托量 14	正整数	
OrderQty15	委托量 15	正整数	
OrderQty16	委托量 16	正整数	
OrderQty17	委托量 17	正整数	
OrderQty18	委托量 18	正整数	
OrderQty19	委托量 19	正整数	
OrderQty20	委托量 20	正整数	
OrderQty21	委托量 21	正整数	
OrderQty22	委托量 22	正整数	
OrderQty23	委托量 23	正整数	
OrderQty24	委托量 24	正整数	
OrderQty25	委托量 25	正整数	
OrderQty26	委托量 26	正整数	
OrderQty27	委托量 27	正整数	
OrderQty28	委托量 28	正整数	
OrderQty29	委托量 29	正整数	
OrderQty30	委托量 30	正整数	
OrderQty31	委托量 31	正整数	
OrderQty32	委托量 32	正整数	
OrderQty33	委托量 33	正整数	
OrderQty34	委托量 34	正整数	
OrderQty35	委托量 35	正整数	
OrderQty36	委托量 36	正整数	
OrderQty37	委托量 37	正整数	
OrderQty38	委托量 38	正整数	
OrderQty39	委托量 39	正整数	
OrderQty40	委托量 40	正整数	
OrderQty41	委托量 41	正整数	
OrderQty42	委托量 42	正整数	

OrderQty43	委托量 43	正整数	
OrderQty44	委托量 44	正整数	
OrderQty45	委托量 45	正整数	
OrderQty46	委托量 46	正整数	
OrderQty47	委托量 47	正整数	
OrderQty48	委托量 48	正整数	
OrderQty49	委托量 49	正整数	
OrderQty50	委托量 50	正整数	
LocalTime	关联集中竞价交易 快照行情本地接受 时间戳	时间	时:分:秒.毫秒, 与 SeqNo 结合使用保证关联唯一性
SeqNo	关联集中竞价交易 快照行情消息序列 号	64 位整数	与 LocalTime 结合使用保证关联唯一性

mdl_6_29_0

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	UpdateTime	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
2	MDStreamID	行情类别: 900 指数快照行情	ASCII 字符串	
3	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
4	SecurityIDSource	证券代码源	ASCII 字符串	
5	TradingPhaseCode	产品所处的交易阶段代码	ASCII 字符串	
6	TurnNum	成交笔数	64 位整数	
7	Volume	成交总量	64 位整数	
8	Turnover	成交总金额	双精度浮点数	4 位小数
9	LastIndex	当前指数	双精度浮点数	6 位小数
10	PreCloIndex	昨收指数	双精度浮点数	6 位小数
11	OpenIndex	开盘指数	双精度浮点数	6 位小数

12	HighIndex	最高指数	双精度浮点数	6 位小数
13	LowIndex	最低指数	双精度浮点数	6 位小数
14	LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
15	SeqNo	接收序列号	64 位整数	

mdl_6_30_0

字段名	说明	字段类型	备注
UpdateTime	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
MDStreamID	行情类别: 910 成交量统计指标快 照行情	ASCII 字符串	
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
SecurityIDSource	证券代码源	ASCII 字符串	
TradingPhaseCode	产品所处的交易阶段代 码	ASCII 字符串	
PreCloPrice	昨收价	双精度浮点数	4 位小数
TurnNum	成交笔数	64 位整数	
Volume	成交总量	64 位整数	
Turnover	成交总金额	双精度浮点数	4 位小数
StockNum	统计量指标样本个数	32 位整数	
LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SeqNo	接收序列号	64 位整数	

mdl_6_31_0

字段名	说明	字段类型	备注
UpdateTime	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
MDStreamID	行情类别:	ASCII 字符串	

	060 以收盘价交易的盘后定价大宗交易快照行情		
	061 以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交易快照行情		
	370 盘后定价交易快照行情		
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
SecurityIDSource	证券代码源	ASCII 字符串	
TradingPhaseCode	产品所处的交易阶段代码	ASCII 字符串	
PreCloPrice	昨收价	双精度浮点数	4 位小数
TurnNum	成交笔数	64 位整数	
Volume	成交总量	64 位整数	
Turnover	成交总金额	双精度浮点数	4 位小数
AskPrice1	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume1	申卖价	64 位整数	
AskPrice2	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume2	申卖价	64 位整数	
AskPrice3	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume3	申卖价	64 位整数	
AskPrice4	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume4	申卖价	64 位整数	
AskPrice5	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume5	申卖价	64 位整数	
AskPrice6	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume6	申卖价	64 位整数	
AskPrice7	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume7	申卖价	64 位整数	
AskPrice8	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume8	申卖价	64 位整数	
AskPrice9	申卖量	双精度浮点数	6 位小数

AskVolume9	申卖价	64 位整数	
AskPrice10	申卖量	双精度浮点数	6 位小数
AskVolume10	申卖价	64 位整数	
BidPrice1	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume1	申买价	64 位整数	
BidPrice2	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume2	申买价	64 位整数	
BidPrice3	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume3	申买价	64 位整数	
BidPrice4	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume4	申买价	64 位整数	
BidPrice5	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume5	申买价	64 位整数	
BidPrice6	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume6	申买价	64 位整数	
BidPrice7	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume7	申买价	64 位整数	
BidPrice8	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume8	申买价	64 位整数	
BidPrice9	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume9	申买价	64 位整数	
BidPrice10	申买量	双精度浮点数	6 位小数
BidVolume10	申买价	64 位整数	
LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
SeqNo	接收序列号	64 位整数	

mdl_6_33_0

字段名	说明	字段类型	备注
ChannelNo	频道代码	32 位整数	同一 ChannelNo 下 ApplSeqNum

			唯一连续
ApplSeqNum	消息记录号, 从 1 开始计数	64 位整数	
MDStreamID	行情类别:	ASCII 字符串	
	011 现货 (股票, 基金, 债券等) 集中竞价交易逐笔行情		
	021 质押式回购交易逐笔行情		
SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
SecurityIDSource	证券代码源	ASCII 字符串	
Price	委托价格	双精度浮点数	4 位小数 只有限价单的价格是有意义的
OrderQty	委托数量	64 位整数	
Side	买卖方向	32 位整数	
	'1'=买 (本地 ASCII 码自动转码为 49)		
	'2'=卖 (本地 ASCII 码自动转码为 50)		
	'G'=借入 (本地 ASCII 码自动转码为 71)		
	'F'=出借 (本地 ASCII 码自动转码为 70)		
TransactTime	委托时间	时间	时:分:秒.毫秒
OrdType	订单类别	32 位整数	
	'1'=市价 (本地 ASCII 码自动转码为 49)		
	'2'=限价 (本地 ASCII 码自动转码为 50)		
	'U'=本方最优 (本地 ASCII 码自动转码为 85)		
LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒

SeqNo	接收序列号	64 位整数	
-------	-------	--------	--

mdl_6_36_0

序号	字段名	说明	字段类型	备注
1	ChannelNo	频道代码	32 位整数	同一 ChannelNo 下 ApplSeqNum 唯一连续
2	ApplSeqNum	消息记录号, 从 1 开始计数	64 位整数	
3	MDStreamID	行情类别:	ASCII 字符串	
		011 现货 (股票, 基金, 债券等) 集中竞价交易逐笔行情		
		021 质押式回购交易逐笔行情		
4	BidApplSeqNum	买方委托索引 从 1 开始计数, 0 表示无对应委托	64 位整数	
5	OfferApplSeqNum	卖方委托索引 从 1 开始计数, 0 表示无对应委托	64 位整数	
6	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
7	SecurityIDSource	证券代码源	ASCII 字符串	
8	LastPx	委托价格	双精度浮点数	4 位小数
9	LastQty	委托数量	64 位整数	
10	ExecType	成交类别	32 位整数	
		'4' = 撤销 (本地 ASCII 码自动		

		转码为 52)		
		'F'=成交 (本地 ASCII 码自动转码为 70)		
11	TransactTime	成交时间	时间	时:分:秒.毫秒
12	LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
13	SeqNo	接收序列号	64 位整数	

mdl_6_50_0

列	字段名	说明	字段类型	备注
1	DateTime	数据生成时间	时间	时:分:秒.毫秒
2	SecurityID	证券代码	ASCII 字符串	
3	ETFBuyNumber	申购笔数	32 位整数	
4	ETFBuyAmount	申购数量	双精度浮点数	
5	ETFSellNumber	赎回笔数	正整数	
6	ETFSellAmount	赎回数量	双精度浮点数	
7	LocalTime	接收时间戳	时间	时:分:秒.毫秒
8	SeqNo	接收序列号	32 位整数	

地址: 上海市虹口区塘沽路 463 号华虹国际大厦 16 层 16th Floor, No. 463 Tanggu Road, Hongkou, Shanghai 200085 PRC

电话: 86-21-6021 6200

传真: 86-21-6021 6222

网址: www.datayes.com