# 账户交易数据

## 资金数据

1. 昨日资金（请求ReqSubPreRiskAccount，回报：OnRtnSeqPreRiskAccount）

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcSeqPreRiskAccountField |
| 经纪公司代码 | BrokerID |
| 投资者代码 | InvestorID |
| 投资者帐号 | AccountID |
| 上次质押金额 | PreMortgage |
| 上次信用额度 | PreCredit |
| 上次存款额 | PreDeposit |
| 上次总权益 | PreBalance |
| 上次占用的保证金 | PreMargin |
| 基本准备金 | Reserve |
| 上次交易所保证金 | PreExchMargin |
| 历史强平次数 | ForceCloseStat |
| 投资者交割保证金 | DeliveryMargin |
| 交易所交割保证金 | ExchangeDeliveryMargin |

1. 当日资金（回报：OnRtnRiskSyncAccount）

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcRiskSyncAccountField |
| 经纪公司代码 | BrokerID |
| 投资者代码 | InvestorID |
| 出入金金额 | Withdraw |
| 当前保证金总额 | CurrMargin |
| 手续费 | Commission |
| 平仓盈亏 | CloseProfit |
| 持仓盈亏 | PositionProfit |
| 总权益 | Balance |
| 可用资金 | Available |
| 质押金额 | Mortgage |
| 交易所保证金 | ExchangeMargin |
| 可取资金 | WithdrawQuota |
| 信用额度 | Credit |
| 保证金冻结 | FrozenMargin |
| 手续费冻结 | FrozenCommission |

## 持仓

订阅ReqSubscribePosition，回报OnRtnSequencialPosition

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcSequencialPositionField |
| 流中唯一的序列号 | UniqSequenceNo |
| 合约代码 | InstrumentID |
| 经纪公司代码 | BrokerID |
| 投资者代码 | InvestorID |
| 持仓多空方向 | PosiDirection |
| 投机套保标志 | HedgeFlag |
| 持仓日期 | PositionDate |
| 上日持仓 | YdPosition |
| 今日持仓 | Position |
| 多头冻结 | LongFrozen |
| 空头冻结 | ShortFrozen |
| 开仓冻结金额 | LongFrozenAmount |
| 开仓冻结金额 | ShortFrozenAmount |
| 开仓量 | OpenVolume |
| 平仓量 | CloseVolume |
| 开仓金额 | OpenAmount |
| 平仓金额 | CloseAmount |
| 持仓成本 | PositionCost |
| 上次占用的保证金 | PreMargin |
| 占用的保证金 | UseMargin |
| 冻结的保证金 | FrozenMargin |
| 冻结的资金 | FrozenCash |
| 冻结的手续费 | FrozenCommission |
| 资金差额 | CashIn |
| 手续费 | Commission |
| 平仓盈亏 | CloseProfit |
| 持仓盈亏 | PositionProfit |
| 上次结算价 | PreSettlementPrice |
| 本次结算价 | SettlementPrice |
| 交易日 | TradingDay |
| 结算编号 | SettlementID |
| 开仓成本 | OpenCost |
| 交易所保证金 | ExchangeMargin |
| 组合成交形成的持仓 | CombPosition |
| 组合多头冻结 | CombLongFrozen |
| 组合空头冻结 | CombShortFrozen |
| 逐日盯市平仓盈亏 | CloseProfitByDate |
| 逐笔对冲平仓盈亏 | CloseProfitByTrade |
| 今日持仓 | TodayPosition |
| 保证金率 | MarginRateByMoney |
| 保证金率(按手数) | MarginRateByVolume |

## 交易

订阅ReqSubscribeTrade，回报OnRtnSequencialTrade

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcSequencialTradeField |
| 流中唯一的序列号 | UniqSequenceNo |
| 经纪公司代码 | BrokerID |
| 投资者代码 | InvestorID |
| 合约代码 | InstrumentID |
| 报单引用 | OrderRef |
| 用户代码 | UserID |
| 交易所代码 | ExchangeID |
| 成交编号 | TradeID |
| 买卖方向 | Direction |
| 报单编号 | OrderSysID |
| 会员代码 | ParticipantID |
| 客户代码 | ClientID |
| 交易角色 | TradingRole |
| 合约在交易所的代码 | ExchangeInstID |
| 开平标志 | OffsetFlag |
| 投机套保标志 | HedgeFlag |
| 价格 | Price |
| 数量 | Volume |
| 成交时期 | TradeDate |
| 成交时间 | TradeTime |
| 成交类型 | TradeType |
| 成交价来源 | PriceSource |
| 交易所交易员代码 | TraderID |
| 本地报单编号 | OrderLocalID |
| 结算会员编号 | ClearingPartID |
| 业务单元 | BusinessUnit |
| 序号 | SequenceNo |
| 交易日 | TradingDay |
| 结算编号 | SettlementID |
| 经纪公司报单编号 | BrokerOrderSeq |
| 成交来源 | TradeSource |

## 报单

订阅ReqSubscribeOrder，回报CShfeFtdcSequencialOrderField

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcSequencialOrderField |
| 流中唯一的序列号 | UniqSequenceNo |
| 经纪公司代码 | BrokerID |
| 投资者代码 | InvestorID |
| 合约代码 | InstrumentID |
| 报单引用 | OrderRef |
| 用户代码 | UserID |
| 报单价格条件 | OrderPriceType |
| 买卖方向 | Direction |
| 组合开平标志 | CombOffsetFlag |
| 组合投机套保标志 | CombHedgeFlag |
| 价格 | LimitPrice |
| 数量 | VolumeTotalOriginal |
| 有效期类型 | TimeCondition |
| GTD日期 | GTDDate |
| 成交量类型 | VolumeCondition |
| 最小成交量 | MinVolume |
| 触发条件 | ContingentCondition |
| 止损价 | StopPrice |
| 强平原因 | ForceCloseReason |
| 自动挂起标志 | IsAutoSuspend |
| 业务单元 | BusinessUnit |
| 请求编号 | RequestID |
| 本地报单编号 | OrderLocalID |
| 交易所代码 | ExchangeID |
| 会员代码 | ParticipantID |
| 客户代码 | ClientID |
| 合约在交易所的代码 | ExchangeInstID |
| 交易所交易员代码 | TraderID |
| 安装编号 | InstallID |
| 报单提交状态 | OrderSubmitStatus |
| 报单提示序号 | NotifySequence |
| 交易日 | TradingDay |
| 结算编号 | SettlementID |
| 报单编号 | OrderSysID |
| 报单来源 | OrderSource |
| 报单状态 | OrderStatus |
| 报单类型 | OrderType |
| 今成交数量 | VolumeTraded |
| 剩余数量 | VolumeTotal |
| 报单日期 | InsertDate |
| 委托时间 | InsertTime |
| 激活时间 | ActiveTime |
| 挂起时间 | SuspendTime |
| 最后修改时间 | UpdateTime |
| 撤销时间 | CancelTime |
| 最后修改交易所交易员代码 | ActiveTraderID |
| 结算会员编号 | ClearingPartID |
| 序号 | SequenceNo |
| 前置编号 | FrontID |
| 会话编号 | SessionID |
| 用户端产品信息 | UserProductInfo |
| 状态信息 | StatusMsg |
| 用户强评标志 | UserForceClose |
| 操作用户代码 | ActiveUserID |
| 经纪公司报单编号 | BrokerOrderSeq |
| 相关报单 | RelativeOrderSysID |
| 郑商所成交数量 | ZCETotalTradedVolume |

## 出入金

订阅ReqSubSeqDeposit，回报OnRtnSeqDeposit

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcSeqDepositField |
| 流中唯一的序列号 | UniqSequenceNo |
| 出入金类型 | Type |
| 有效标志-有效或冲正 | Flag |
| 出入金方向 | Direction |
| 交易日 | TradingDay |
| 流水号 | SequenceNo |
| 时间 | Time |
| 经纪公司代码 | BrokerID |
| 投资者代码 | InvestorID |
| 出入金金额 | Amount |

# 行情数据

## 品种

合约信息回报：OnRtnInstrument

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcInstrumentField |
| 合约 | InstrumentID |
| 交易所 | ExchangeID |
| 商品类型 | ProductClass |
| 交割年份 | DeliveryYear |
| 交割月份 | DeliveryMonth |
| 市价单最大下单量 | MaxMarketOrderVolume |
| 市价单最小下单量 | MinMarketOrderVolume |
| 限价单最大下单量 | MaxLimitOrderVolume |
| 限价单最小下单量 | MinLimitOrderVolume |
| 合约乘数 | VolumeMultiple |
| 最小变动价位 | PriceTick |
| 上市日 | OpenDate |
| 到期日 | ExpireDate |
| 开始交割日 | StartDelivDate |
| 结束交割日 | EndDelivDate |
| 合约生命周期状态 | InstLifePhase |
| 当前是否交易 | IsTrading |
| 持仓类型 | PositionType |
| 持仓日期类型 | PositionDateType |
| 多头保证金率 | LongMarginRatio |
| 空头保证金率 | ShortMarginRatio |

## 实时报价

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | 实时行情 | 订阅最新价 |
| 订阅： | ReqSubRiskMarketData | ReqSubVaryMarketData |
| 退订 | ReqUnSubRiskMarketData | ReqUnSubVaryMarketData |
| 返回 | OnRtnRiskDepthMarketData | OnRtnVaryMarketData |

数据类型：

|  |  |
| --- | --- |
|  | CShfeFtdcDepthMarketDataField |
| 时间 | UpdateTime |
| 合约 | InstrumentID |
| 最新价 | LastPrice |
| 上次结算价 | PreSettlementPrice |
| 昨日收盘价 | PreClosePrice |
| 昨日持仓量 | PreOpenInterest |
| 今日开盘价 | OpenPrice |
| 最高价 | HighestPrice |
| 最低价 | LowestPrice |
| 成交量 | Volume |
| 成交额 | Turnover |
| 持仓量 | OpenInterest |
| 今日收盘价 | ClosePrice |
| 本次结算价 | SettlementPrice |
| 涨停板价 | UpperLimitPrice |
| 跌停板价 | LowerLimitPrice |
| 昨日虚实度 | PreDelta |
| 今日虚实度 | CurrDelta |
| 买一价 | BidPrice1 |
| 买一量 | BidVolume1 |
| 卖一价 | AskPrice1 |
| 卖一量 | AskVolume1 |
| 买二价 | BidPrice2 |
| 买二量 | BidVolume2 |
| 卖二价 | AskPrice2 |
| 卖二量 | AskVolume2 |
| 买三价 | BidPrice3 |
| 买三量 | BidVolume3 |
| 卖三价 | AskPrice3 |
| 卖三量 | AskVolume3 |
| 买四价 | BidPrice4 |
| 买四量 | BidVolume4 |
| 卖四价 | AskPrice4 |
| 卖四量 | AskVolume4 |
| 买五价 | BidPrice5 |
| 买五量 | BidVolume5 |
| 卖五价 | AskPrice5 |
| 卖五量 | AskVolume5 |
| 当日均价 | AveragePrice |