

数据类型	市场	说明
逐笔成交	沪市+深市	9:15前成交价格为0
		逐笔成交. 叫卖序号 = 逐笔委托. 交易所委托号
		逐笔成交. 叫买序号 = 逐笔委托. 交易所委托号
	深市	在深市中，逐笔委托的撤单，记录在逐笔成交的《成交代码》列中，代码是C
逐笔委托	沪市	在沪市中，逐笔委托的《委托类型》列，A是成交，D是撤单，其他代码无意义
		在沪市中，逐笔委托的《委托代码》列，B是买入，S是卖出，其他代码无意义
	深市	在深市中，逐笔委托的《委托类型》列，一般有0,1,U三个指标。《委托代码》列，一般有B和S两个指标。一起有以下几个组合意义。
		1B 市价买入
		1S 市价卖出
		0B 限价买入(其它软件逐笔委托为2B)
		0S 限价卖出(其它软件逐笔委托为2S)
		UB 本方最优价格委托买入
		US 本方最优价格委托卖出

注意事项
1、里面价格后四位都是小数，例如成交价格18400，代表1.84 2、时间精确到毫秒，例如94356000，代表 9:43:56:000

十档行情

序号	段名	注释	数据类型	备注
1	万得代码	证券代码. SZ	char (9)	
2	交易所代码	证券代码	char (6)	上交所公布的各类证券品种代码（沪深股票2017开始、基金、债券等2023.10开始）。
3	自然日	交易归属日期	int	交易当天日期。格式yyyymmdd，例如：20141120
4	时间	交易发生时间	int	交易所直接下发的交易时间 。格式：hhmmssmm，例如93015000, 即09:30:15.000
5	成交价	最新成交价	int	凡涉及价格、金额，精度10000倍（下同）
6	成交量	分笔期间成交量	int	当前成交总量-上一分笔的成交总量，首条记录取当前成交总成交量。凡涉及成交量，单位：股（下同）
7	成交额	分笔期间成交额	int	当前成交总额-上一分笔的成交总额，首条记录取当前成交总成交额。
8	成交笔数	成交总笔数	int	开盘至当前时刻的累计成交笔数
9	IOPV	基金实时参考净值	int	
10	成交标志	保留		
11	BS标志	保留		
12	当日累计成交量	成交总量	int	开盘至当前时刻的累计成交量
13	当日成交额	成交总额	int	开盘至当前时刻的累计成交金额
14	最高价	最高价	int	开盘至当前时刻所出现的最高成交价
15	最低价	最低价	int	开盘至当前时刻所出现的最低成交价
16	开盘价	开盘价	int	该证券在当日的开盘价
17	前收盘	昨收盘价	int	上一交易日的收盘价 （如有除权除息，为前复权后的收盘价）
18	申卖价1	申卖价一	int	第1档委托卖出价
19	申卖价2	申卖价二	int	第2档委托卖出价
20	申卖价3	申卖价三	int	第3档委托卖出价
21	申卖价4	申卖价四	int	第4档委托卖出价
22	申卖价5	申卖价五	int	第5档委托卖出价
23	申卖价6	申卖价六	int	第6档委托卖出价
24	申卖价7	申卖价七	int	第7档委托卖出价
25	申卖价8	申卖价八	int	第8档委托卖出价
26	申卖价9	申卖价九	int	第9档委托卖出价
27	申卖价10	申卖价十	int	第10档委托卖出价
28	申卖量1	申卖量一	int	第1档申卖量
29	申卖量2	申卖量二	int	第2档申卖量
30	申卖量3	申卖量三	int	第3档申卖量
31	申卖量4	申卖量四	int	第4档申卖量
32	申卖量5	申卖量五	int	第5档申卖量

33	申卖量6	申卖量六	int	第6档申卖量
34	申卖量7	申卖量七	int	第7档申卖量
35	申卖量8	申卖量八	int	第8档申卖量
36	申卖量9	申卖量九	int	第9档申卖量
37	申卖量10	申卖量十	int	第10档申卖量
38	申买价1	申买价一	int	第1档委托买入价
39	申买价2	申买价二	int	第2档委托买入价
40	申买价3	申买价三	int	第3档委托买入价
41	申买价4	申买价四	int	第4档委托买入价
42	申买价5	申买价五	int	第5档委托买入价
43	申买价6	申买价六	int	第6档委托买入价
44	申买价7	申买价七	int	第7档委托买入价
45	申买价8	申买价八	int	第8档委托买入价
46	申买价9	申买价九	int	第9档委托买入价
47	申买价10	申买价十	int	第10档委托买入价
48	申买量1	申买量一	int	第1档申买量
49	申买量2	申买量二	int	第2档申买量
50	申买量3	申买量三	int	第3档申买量
51	申买量4	申买量四	int	第4档申买量

52	申买量5	申买量五	int	第5档申买量
53	申买量6	申买量六	int	第6档申买量
54	申买量7	申买量七	int	第7档申买量
55	申买量8	申买量八	int	第8档申买量
56	申买量9	申买量九	int	第9档申买量
57	申买量10	申买量十	int	第10档申买量
58	加权平均叫卖价	加权平均委卖价	int	2011年9月份前该字段为0
59	加权平均叫买价	加权平均买入价	int	2011年9月份前该字段为0
60	叫卖总量	委托卖出总量	int	2011年9月份前该字段为0
61	叫买总量	委托买入总量	int	2011年9月份前该字段为0
62	不加权指数			
63	品种总数			
64	上涨品种数			
65	下跌品种数			
66	持平品种数			

上海L2-逐笔委托

序号	段名	注释	数据类型,	备注
1	万得代码	证券代码. SZ	char (9)	
2	交易所代码	证券代码	char (6)	上交所公布的各类证券品种代码（股票2021. 7开始、基金、债券等2023. 10开始）。
3	自然日	交易归属日期	int	交易当天日期。格式yyyymmdd, 例如：20141120
4	时间	交易发生时间	int	交易所直接下发的交易时间 。格式：hhmmssmmm, 例如93059990, 即09:30:59. 990
5	委托编号	频道代码	char (1)	频道代码
6	交易所委托号	原始订单号	int	
7	委托类型	订单类别	char (1)	订单类型。A - 正常委托、D - 撤单
8	委托代码	委托买卖方向	char (1)	委托订单：B - 买单、S - 卖单
9	委托价格	委托价格	int	精度10000倍
10	委托数量	剩余委托量	int	股票：股

深圳L2-逐笔委托

序号	段名	注释	数据类型,	备注
1	万得代码	证券代码. SZ	char (9)	
2	交易所代码	证券代码	char (6)	上交所公布的各类证券品种代码（股票2017开始、基金、债券等2023. 10开始）。
3	自然日	交易归属日期	int	交易当天日期。格式yyyymmdd, 例如：20141120
4	时间	交易发生时间	int	交易所直接下发的交易时间 。格式：hhmmssmmm, 例如93059990, 即09:30:59. 990
5	委托编号	频道代码	char (1)	频道代码
6	交易所委托号	消息记录号	int	从1开始计数，同一频道代码下的所有编号连续
7	委托类型	订单类别	char (1)	0=限价 1=市价 U=本方最优
8	委托代码	委托买卖方向	char (1)	委托订单：B - 买单、S - 卖单
9	委托价格	委托价格	int	精度10000倍
10	委托数量	剩余委托量	int	

上海L2-逐笔成交

序号	段 名	注释	数据类型	备注
1	万得代码	证券代码. SH	char (9)	
2	交易所代码	证券代码	char (6)	上交所公布的各类证券品种代码（股票2017开始、基金、债券等2023. 10开始）。
3	自然日	交易归属日期	int	交易当天日期。格式yyyymmdd，例如：20141120
4	时间	交易发生时间	int	交易所直接下发的交易时间 。格式：hhmmssmmm，例如93059990, 即09:30:59. 990
5	成交编号	成交序号	int	从1开始，按成交通道连续
6	成交代码	成交代码	char (1)	保留
7	委托代码	委托代码	char (1)	保留
8	BS标志	成交方向	char (1)	成交订单：B - 买单、S - 卖单
9	成交价格	成交价格	int	精度10000倍
10	成交数量	成交数量	int	股
11	叫卖序号	买方订单号	int	该笔成交对应卖方委托单号
12	叫买序号	卖方订单号	int	该笔成交对应买方委托单号

深圳L2-逐笔成交

序号	段 名	注释	数据类型	备注
1	万得代码	证券代码. SH	char (9)	
2	交易所代码	证券代码	char (6)	上交所公布的各类证券品种代码（股票2017开始、基金、债券等2023. 10开始）。
3	自然日	交易归属日期	int	交易当天日期。格式yyyymmdd，例如：20141120
4	时间	交易发生时间	int	交易所直接下发的交易时间 。格式： hhmmssmmm，例如93059990，即09:30:59. 990
5	成交编号	消息记录号	int	从1开始计数，同一频道代码下的所有成交编号连续
6	成交代码	成交类型	char (1)	C=撤销，主动或被动撤单执行报告；空=成交执行报告
7	委托代码	委托代码	char (1)	保留
8	BS标志	成交方向	char (1)	成交订单：B - 买单、S - 卖单
9	成交价格	成交价格	int	精度10000倍，0表示无对应委托
10	成交数量	成交数量	int	股
11	叫卖序号	卖方委托索引	int	该笔成交对应卖方委托单号，0表示无对应委托
12	叫买序号	买方委托索引	int	该笔成交对应买方委托单号，0表示无对应委托