文件头、文件描述、文件索引格式

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Field Name** | | | **Type** | **Comments** |
| Head | Category | | Char[16] | 文件类型 |
| DateTime | | Uint64\_t | 文件创建与修改日期时间 |
| HeadSize | | Uint32\_t | 文件头长度 |
| DescriptionSize | | Uint32\_t | 文件描述长度 |
| IndexSize | | Uint32\_t | 索引长度 |
| RecordSum | | Uint32\_t | 记录总数 |
| RecordLen | | Uitn32\_t | 每条记录的长度 |
| FieldCount | | Uint32\_t | 每条记录的字段个数（1） |
| CodeCount | | Uint32\_t | 代码个数（2） |
| Description | → | FieldPosition | Uint32\_t | 字段位置 |
| → | FieldLen | Uint32\_t | 记录中每个字段的长度 |
| → | FieldType | Char[4] | 字段类型 |
| → | Precision | Uint32\_t | 小数位 |
| Index | → | Code | Char[16] | 证券代码 |
| → | CodeBeginPosition | Uint64\_t | 代码开始位置 |
| → | CodeEndPosition | Uint64\_t | 代码结束位置 |

其中category为day, minute, snap, tick, auction。分别为日K线，分钟K线，快照，逐笔，集合竞价。

* 日K线文件以证券代码为文件名存储，即一个证券的日K线存储为一个文件。CodeCount为证券类型编号。
* 分钟K线文件以证券代码及年份为文件名存储，即一个证券一年的分钟K线存储为一个文件。CodeCount为证券类型编号。
* 快照、逐笔、集合竞价以日期为文件名存储，即一天中所有证券的快照（逐笔、集合竞价）存储为一个文件。

|  |  |
| --- | --- |
| **Category** | **Value** |
| Security | 0 |
| Option | 1 |
| ETF | 2 |

Day/Minute

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Field Name** | **Type** | **Comments** |
| DateTime | Uint64\_t | 日期时间 |
| PreClosePx | Uint32\_t | 昨收价 |
| OpenPx | Uint32\_t | 开始价 |
| HighPx | Uint32\_t | 最高价 |
| LowPx | Uint32\_t | 最低价 |
| LastPx | Uint32\_t | 收盘价 |
| Volume | Uint64\_t | 成交量 |
| Amount | Uint64\_t | 成交金额 |
| *IOPV* | *Uint32\_t* | *ETF净值估值（ETF）* |
| *ETFBuyNumber* | *Uint32\_t* | *ETF申购笔数（ETF）* |
| *ETFBuyAmount* | *Uint64\_t* | *ETF申购数量（ETF）* |
| *ETFBuyMoney* | *Uint64\_t* | *ETF申购金额（ETF）* |
| *ETFSellNumber* | *Uint32\_t* | *ETF赎回笔数（ETF）* |
| *ETFSellAmount* | *Uint64\_t* | *ETF赎回数量（ETF）* |
| *ETFSellMoney* | *Uint64\_t* | *ETF赎回金额（ETF）* |
| *OpenInterest* | *Uint64\_t* | *持仓量（期权）* |

Snap1

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Field Name** | **Type** | **Comments** |
| DateTime | Uint64\_t | 日期时间 |
| PreClosePx | Uint32\_t | 昨收价 |
| OpenPx | Uint32\_t | 开始价 |
| HighPx | Uint32\_t | 最高价 |
| LowPx | Uint32\_t | 最低价 |
| LastPx | Uint32\_t | 收盘价 |
| Volume | Uint64\_t | 成交量 |
| Amount | Uint64\_t | 成交金额 |
| NowVolume | Uint64\_t | 成交现量 |
| NowAmount | Uint64\_t | 成交现金额 |
| BidPx[5] | Uint32\_t | 申买价 |
| OfferPx[5] | Uint32\_t | 申卖价 |
| BidSize[5] | Uint64\_t | 申买量 |
| OfferSize[5] | Uint64\_t | 申卖量 |
| *NumTrades* | *Uint64\_t* | *成交笔数（L1FAST）* |
| *IOPV* | *Uint32\_t* | *净值估值（L1FAST）* |
| *NAV* | *Uint32\_t* | *净资产价值（L1FAST）* |
| *PhaseCode* | *Char[8]* | *交易时段（L1FAST）* |

Tick

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Field Name** | **Type** | **Comments** |
| DateTime | Uint64\_t | 日期时间 |
| Price | Uint32\_t | 成交价 |
| Volume | Uint32\_t | 成交数据量 |
| Amount | Uint64\_t | 成交金额 |
| BuyNo | Uint64\_t | 买方订单号 |
| SellNo | Uint64\_t | 卖方订单号 |

Auction

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Field Name** | **Type** | **Comments** |
| DateTime | Uint64\_t | 日期时间 |
| Price | Uint32\_t | 成交价 |
| VirtualAuctionQty | Uint64\_t | 虚拟匹配量 |
| LeaveQty | Uint64\_t | 虚拟未匹配量 |
| Side | Char[8] | 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 |

Snap2

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Field Name** | **Type** | **Comments** |
| DateTime | Uint64\_t | 日期时间 |
| PreClosePx | Uint32\_t | 昨收价 |
| OpenPx | Uint32\_t | 开盘价 |
| HighPx | Uint32\_t | 最高价 |
| LowPx | Uint32\_t | 最低价 |
| LastPx | Uint32\_t | 最新价 |
| NumTrades | Uint32\_t | 成交笔数 |
| InstrumentStatus | char[8] | 交易状态 |
| TotalVolumeTrade | Uint64\_t | 成交总量 |
| TotalAmountTrade | Uint64\_t | 成交总金额 |
| NowVolumeTrade | Uint64\_t | 成交现量 |
| NowAmountTrade | Uint64\_t | 成交现金额 |
| TotalBidQty | Uint64\_t | 委托买入总量 |
| TotalOfferQty | Uint64\_t | 委托卖出总量 |
| WeightedAvgBidPx | Uint32\_t | 加权平均委买价格（债券共用） |
| WeightedAvgOfferPx | Uint32\_t | 加权平均委卖价格（债券共用） |
| WithdrawBuyNumber | Uint32\_t | 买入撤单笔数 |
| WithdrawSellNumber | Uint32\_t | 卖出撤单笔数 |
| WithdrawBuyAmount | Uint64\_t | 买入撤单数量 |
| WithdrawBuyMoney | Uint64\_t | 买入撤单金额 |
| WithdrawSellAmount | Uint64\_t | 卖出撤单数量 |
| WithdrawSellMoney | Uint64\_t | 卖出撤单金额 |
| TotalBidNumber | Uint32\_t | 买入总笔数 |
| TotalOfferNumber | Uint32\_t | 卖出总笔数 |
| BidTradeMaxDuration | Uint32\_t | 买入委托成交最大等待时间 |
| OfferTradeMaxDuration | Uint32\_t | 卖出委托成交最大等待时间 |
| NumBidOrders | Uint32\_t | 买方委托价位数 |
| NumOfferOrders | Uint32\_t | 卖方委托价位数 |
| BidPrice[10] | Uint32\_t | 申买十价 |
| BidOrderQty[10] | Uint64\_t | 申买十量 |
| BidNumOrders[10] | Uint32\_t | 申买十实际总委托笔数 |
| BidOrders[50] | Uint64\_t | 申买一前50笔订单 |
| OfferPrice[10] | Uint32\_t | 申卖十价 |
| OfferOrderQty[10] | Uint64\_t | 申卖十量 |
| OfferNumOrders[10] | Uint32\_t | 申卖十实际总委托笔数 |
| OfferOrders[50] | Uint64\_t | 申卖一前50笔订单 |
| *IOPV* | Uint32\_t | *ETF净值估值（ETF）* |
| *ETFBuyNumber* | Uint32\_t | *ETF申购笔数（ETF）* |
| *ETFBuyAmount* | Uint64\_t | *ETF申购数量（ETF）* |
| *ETFBuyMoney* | Uint64\_t | *ETF申购金额（ETF）* |
| *ETFSellNumber* | Uint32\_t | *ETF赎回笔数（ETF）* |
| *ETFSellAmount* | Uint64\_t | *ETF赎回数量（ETF）* |
| *ETFSellMoney* | Uint64\_t | *ETF赎回金额（ETF）* |

Snap Option

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Field Name** | **Type** | **Comments** |
| DateTime | Uint64\_t | 日期时间 |
| PreSettlePx | Uint32\_t | 昨天结算价 |
| OpenPx | Uint64\_t | 开盘价 |
| HighPx | Uint64\_t | 最高价 |
| LowPx | Uint64\_t | 最低价 |
| LastPx | Uint64\_t | 现价 |
| AuctionPx | Uint64\_t | 波动性中断参考价 |
| AuctionQty | Uint64\_t | 波动新中断集合竞价虚拟匹配量 |
| TotalLongPosition | Uint64\_t | 当前合约未平仓数量 |
| BidSize[5] | Uint64\_t | 申买五量 |
| BidPx[5] | Uint64\_t | 申买五价 |
| OfferSize[5] | Uint64\_t | 申卖五量 |
| OfferPx[5] | Uint64\_t | 申卖五价 |
| TotalVolumeTrade | Uint64\_t | 成交量 |
| TotalValueTrade | Uint64\_t | 成交金额 |
| NowVolumeTrade | Uint64\_t | 成交现量 |
| NowValueTrade | Uint64\_t | 成交现金额 |
| TradingPhaseCode | Char[8] | 交易时段 |