

工程技术标准

深圳证券交易所 Binary 行情 数据接口规范

(Ver1.00~~β~~_α)



深圳证券交易所

二〇一四年四月六月

文档说明

修订历史		
日期	版本	修订说明
2013-10	0.10	创建
2014-1	0.90	根据市场参与者反馈意见修订
2014-4	1.00 α	根据0.9版征求意见反馈修订
<u>2014-6</u>	<u>1.00β</u>	<u>集中竞价交易的 Level I 和 Level II 快照行情使用相同的频道代码</u> <u>增加快照行情频道统计消息</u> <u>证券实时状态消息增加新的开关类别</u> <u>协议交易逐笔委托行情消息增加联系人 Contactor 字段</u> <u>逐笔成交行情消息中将 MDStreamID 移到 ApplSeqNum 字段之后</u> <u>补充消息校验和计算范围的说明</u> <u>订正部分文字错误</u>

名词释义

词汇缩写	含义
行情网关	Market Data GateWay 行情网关(简称“MDGW”),深圳证券交易所行情系统提供给信息商或券商等接入用户系统的接入点。 行情网关分为： 现场版，使用单向卫星作为通信线路，无数据重传功能 网络版，使用地面网络作为通信线路，具有数据重传功能
用户行情系统	Vendor Supplied System 接入用户服务器 (简称“VSS”) 经过许可接入深圳证券交易所行情系统的接入用户服务器。

目 录

一、 前言	1
二、 会话机制	1
2.1 连接	1
2.1.1 会话	1
2.1.2 IP 地址和 Port	1
2.1.3 安全	1
2.1.4 流量控制	1
2.2 会话管理	1
2.2.1 建立会话	1
2.2.2 心跳包和测试请求	2
2.2.3 终止会话	2
2.2.4 重建会话	3
三、 服务说明	3
3.1 交易行情数据类别	3
3.2 快照行情接收	43
3.3 逐笔行情接收	4
3.4 公告消息接收	4
四、 消息定义	4
4.1 消息结构	4
4.1.1 消息头	4
4.1.2 消息尾	4
4.2 管理消息	5
4.2.1 登录消息 (Logon)	5
4.2.2 注销消息 (Logout)	5
4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)	6
4.3 公共消息	6
4.3.1 频道心跳	6
4.3.1 重传消息	6
4.3.1 用户信息报告消息	8
4.3.1 快照行情频道统计	8
4.4 实时行情	9
4.4.1 证券实时状态	9
4.4.2 公告	11
4.4.3 快照行情	12
4.4.3.1 集中竞价业务行情快照扩展字段 (300111)	13
4.4.3.2 盘后定价大宗交易业务行情快照 (300611)	15
4.4.3.3 指数行情快照扩展字段 (309011)	15
4.4.3.4 成交量统计指标行情快照扩展字段 (309111)	15
4.4.4 逐笔委托行情	15
4.4.4.1 集中竞价业务逐笔委托行情扩展字段 (300192)	16
4.4.4.2 协议交易业务逐笔委托行情扩展字段 (300592)	17

4.4.4.3 转融通证券出借业务逐笔委托行情扩展字段 (300792)	17
4.4.5 逐笔成交行情	17
五、数据字典	18
5.1 数据类型	18
5.2 会话层域定义	19
5.3 业务层域定义	19
一、前言	1
二、会话机制	1
2.1 连接	错误!未定义书签。
2.1.1 会话	错误!未定义书签。
2.1.2 IP 地址和 Port	错误!未定义书签。
2.1.3 安全	错误!未定义书签。
2.1.4 流量控制	错误!未定义书签。
2.2 会话管理	1
2.2.1 建立会话	1
2.2.2 心跳包和测试请求	2
2.2.3 终止会话	2
2.2.4 重建会话	3
三、服务说明	3
3.1 交易行情数据类别	3
3.2 快照行情接收	4
3.3 逐笔行情接收	错误!未定义书签。
3.4 公告消息接收	错误!未定义书签。
四、消息定义	4
4.1 消息结构	4
4.1.1 消息头	4
4.1.2 消息尾	4
4.2 管理消息	5
4.2.1 登录消息 (Logon)	5
4.2.2 注销消息 (Logout)	5
4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)	6
4.3 公共消息	6
4.3.1 频道心跳	6
4.3.1 重传消息	6
4.3.1 用户信息报告消息	8
4.4 实时行情	8
4.4.1 证券实时状态	8
4.4.2 公告	10
4.4.3 快照行情	11
4.4.3.1 集中竞价业务行情快照扩展字段 (300111)	12
4.4.3.2 盘后定价大宗交易业务行情快照 (300611)	14
4.4.3.3 指数行情快照扩展字段 (309011)	14
4.4.3.4 成交量统计指标行情快照扩展字段 (309111)	14

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

带格式的

...

4.4.4	逐笔委托行情	15
4.4.4.1	集中竞价业务逐笔委托行情扩展字段 (300192)	16
4.4.4.2	协议交易业务逐笔委托行情扩展字段 (300592)	16
4.4.4.3	转融通证券出借业务逐笔委托行情扩展字段 (300792)	16
4.4.5	逐笔成交行情	16
五	数据字典	17
5.1	数据类型	17
5.2	会话层域定义	18
5.3	业务层域定义	19

- 带格式的：默认段落字体
- 带格式的：默认段落字体
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体
- 带格式的：默认段落字体
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法
- 带格式的：默认段落字体，检查拼写和语法

深圳证券交易所 Binary 行情数据接口规范

一、前言

本接口规范提供给证券公司等市场参与者和合作信息服务商和会员，用以指导开发以 Binary 协议接入深圳证券交易所第五版交易系统获取行情信息。本接口规范描述内容包括行情产品内容、必要的运行指导以及详细的数据交换格式。

文档所采用的术语、消息内容、以及消息流描述与 STEP 行情数据接口规范基本一致，可以互为参考。

~~本接口规范采用 UTF 8 编码。~~

带格式的：缩进：首行缩进：0.74 厘米

二、会话机制

2.1 连接

2.1.1 会话

接入用户通过会话将自身的系统连接到行情网关 MDGW。该连接为标准的 TCP/IP 点对点连接。

2.1.2 IP 地址和 Port

行情网关为用户行情系统提供两个服务端口，实时数据端口（默认为 9129），重传服务端口（默认为 9130）。每一个端口只能建立一个 TCP/IP 连接。只有网络版行情网关提供重传服务端口。

2.1.3 安全

行情网关和用户行情系统必须位于同一个安全网络之中，行情网关和用户行情系统之间传输的数据是非加密的，数据传输安全由接入用户网络保证。

2.1.4 流量控制

行情网关与用户行情系统之间设有流量控制机制，如果用户行情系统不能够及时处理行情网关发送的数据，从而导致行情网关累积的待发送消息超过设定的阈值后，行情网关将会立即断开和用户行情系统的连接。在连接断开之后，用户行情系统应该尝试重新连接行情网关。

2.2 会话管理

2.2.1 建立会话

用户行情系统与行情网关间最多可建立两个会话：

- 实时数据会话，用于传输实时数据；
- 重传服务会话（网络版行情网关提供），用于重传缺失的数据。

会话建立过程：

1. 用户行情系统首先建立一个到行情网关 [MDGW](#) 的 TCP/IP 连接，然后发送一个 Logon 消息给行情网关。
2. 如果行情网关验证用户行情系统有权登录，那么行情网关会返回 Logon 消息给用户行情系统，作为一个登录消息的确认，本次会话登录成功。
3. 如果用户行情系统登录验证失败，那么行情网关会返回 Logout 消息给用户行情系统，本次会话登录失败。
4. 用户行情系统发送 Logon 消息后，如果对方没有在适当的时间间隔里作回应，则可以关闭连接，并在等待一段时间后再尝试下一次连接。
5. 如果用户行情系统断线或收到行情网关的登出消息，也应该等待一段时间后再尝试下一次连接。

实时服务会话与重传服务会话采用相同的会话建立机制，只是使用不同的会话服务端口。

2.2.2 心跳包和测试请求

为了行情网关和用户行情系统通信的双方能够实时监测通信链路状态，要求通信双方在数据空闲时互相发送心跳包，当一方没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时，则可认为是数据链路发生故障，接收方可以断开此链接。

当用户行情系统登录到行情网关时，用户行情系统应在登录消息中指定心跳间隔参数（秒为单位）。

在一个心跳间隔时间内如果行情网关没有需要向用户行情系统发送的数据，那么行情网关会向用户行情系统发送一个心跳消息，以保证两条消息之间的时间间隔不会超过设定的心跳间隔；同样，用户行情系统也应该通过必要时发送心跳消息的方式来保证行情网关收到的连续两条消息之间的时间间隔不超过心跳间隔时间。

用户行情系统也可以采用类似的检测机制对行情网关和用户行情系统之间的连接情况进行检测。

2.2.3 终止会话

用户行情系统和行情网关方都能通过发送 Logout 消息要求终止会话。对方接收到 Logout 消息请求后，会发送一条 Logout 消息回应。发起方收到登出回应后，终止连接。

如果连接对方没有在适当的时间间隔里作回应，则可终止连接。

2.2.4 重建会话

如果会话在交易日中被终止了，用户行情系统可以通过登录消息重建会话。

重建会话后，用户行情系统应通过应用层的消息恢复机制来获得缺失的数据。应用层消息恢复机制参见“重传消息”一节。

三、 服务说明

3.1 交易行情数据类别

交易行情数据（Market Data）按业务内容分为多个类别，每个类别根据其中数据量的大小可能会使用一个或多个频道来发送，每个行情网关可以配置只接收某些频道的交易行情数据。

每个类别使用的频道代码在单独的接口规范使用指南中发布。

类别		频道代码区间	频道内容
证券实时状态		0001	证券实时状态消息（390013）
公告		0002	公告消息（390012）
指数/成交量统计指标快照行情		0010-0020	行情快照（309011，309111）
集中竞价交易 Level I 快照行情		0100-0110	行情快照（300111）
集中竞价交易 Level II 快照 行情	股票	1001-1999	行情快照（300111）
	基金		
	债券		
	期权		
	权证		
集中竞价交易 逐笔行情	股票	2001-2999	逐笔委托消息(300192)
	基金		逐笔成交消息(300191)
	债券		
	期权		
	权证		
综合金融服务快照行情		3001-3999	行情快照（300611）
综合金融服务逐笔行情		4001-4999	逐笔委托消息(300592，300792) 逐笔成交消息(300591，300791)

3.2 快照行情接收

快照行情（包括证券实时状态）数据定时发布，不能重传。
每个快照行情频道可能会包含多个类别的行情，每类行情都有自己的发布频率。

3.3 逐笔行情接收

逐笔行情数据支持重传。在行情网关发送的每个逐笔行情消息中，都会包含该消息所属的频道代码和消息记录号。消息记录号在一个频道内从 1 开始顺序递增，如出现记录号跳变的情况，说明逐笔行情消息出现丢失，用户行情系统可通过发送重传消息请求补传缺失的逐笔行情消息。

每个频道的逐笔行情消息发送完毕后，行情网关会发送一笔频道结束消息。

每个频道在空闲时，会有独立的心跳消息，心跳消息没有记录号。用户行情系统没有接收到数据包的时间超过两倍的心跳间隔时，则可能是行情网关发生故障，用户行情系统应当断开与行情网关的连接，并尝试重连。

3.4 公告消息接收

行情网关通过公告消息向用户行情系统发送公告文件，每个公告文件都有一个唯一的 ID 号。

对于每个新到达行情网关的公告文件，行情网关都会通过公告消息发送给用户行情系统。对于与行情网关建立连接之前可能丢失的公告文件，用户行情系统可以通过重传消息先申请重传公告概要，公告概要中包含所有已发布公告文件的 ID，用户行情系统可以逐个申请重传缺失的公告文件。

建议用户行情系在完成和行情网关的登录动作之后，立即向行情网关申请重传公告文件。

四、 消息定义

4.1 消息结构

每一条消息都由消息头、消息体和消息尾组成。

4.1.1 消息头

消息头定义了应用消息的类型，长度数据域，均不加密传输。

域名	字段描述
MsgType	消息类型
BodyLength	消息体长度

4.1.2 消息尾

消息尾定义了消息的校验和，不加密传输。校验和的计算范围从消息头开始（包括

消息头) 一直到消息体结束。

域名	字段描述
Checksum	校验和

以下为计算校验和的代码段:

```
uint32 GenerateCheckSum( char *buf, uint32 bufLen )
{
    long idx;
    uint32 cks;
    for( idx = 0L, cks = 0; idx < bufLen; cks += (uint32)buf[ idx++ ] );
    return ( cks % 256 );
}
```

4.2 管理消息

4.2.1 登录消息 (Logon)

Logon 消息应该是用户行情系统开始工作时向行情网关发出的第一条消息。用户行情系统使用登录消息来与行情网关建立连接, 行情网关使用 **Logon** 消息确认用户行情系统登录成功。

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 1
SenderCompID	发送方代码
TargetCompID	接收方代码
HeartBtInt	心跳间隔, 单位是秒。用户行情系统登陆时提供给行情网关。
Password	密码
DefaultApplVerID	二进制协议版本

4.2.2 注销消息 (Logout)

当用户行情系统发起的连接请求不被行情网关接受时, 行情网关会向用户行情系统发送 **Logout** 消息来拒绝登录请求。在必要时用户行情系统也可以主动发送 **Logout** 消息来中断当前和行情网关的连接。

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 2

SessionStatus	退出时的会话状态。 0 = 会话活跃 1 = 会话口令已更改 2 = 将过期的会话口令 3 = 新会话口令不符合规范 4 = 会话退登完成 5 = 不合法的用户名或口令 6 = 账户锁定 7 = 当前时间不允许登录 8 = 口令过期 9 = 收到的 MsgSeqNum(34)太小 10 = 收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789)太大。 101 = 其他 102 = 无效消息
Text	文本 注销原因的进一步补充说明。

4.2.3 心跳消息 (Heartbeat)

行情网关和用户行情系统之间用 *Heartbeat* 消息来检测之间 TCP 连接的状态，因此当一方处于数据发送空闲期时，需要定时发送 *Heartbeat* 消息以供检测链接的健康度。

域名	字段描述
Standard Header	MsgType = 3, BodyLength=0

4.3 公共消息

4.3.1 频道心跳

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=390095
ChannelNo	频道代码
ApplLastSeqNum	最后一条行情消息的记录号
EndOfChannel	频道结束标志

注：频道心跳发送间隔为 3 秒。

4.3.1 重传消息

用户行情系统发送重传消息给行情网关，行情网关返回需要重传的数据，并在重传完成后同样返回一个重传消息指示重传完成，如果重传失败也通过该消息返回失败原因。行情网关以“请求—应答”的方式实现数据重传，因此当收到多个重传请求时，行情网

关会按照重传请求达到的顺序依次处理收到的请求。

对于逐笔行情数据通过频道代码和消息记录号判断是否有消息丢失，当收到的消息记录号 \leq 本频道已经收到的最大消息记录号时，说明已经收到过该消息，此时应忽略该消息。当收到的消息序号 $>$ 已经收到的最大消息记录号+1（如已收的最大消息记录号=10，新的消息记录号=12）说明发生了消息丢失，此时应通过重传服务请求丢失的数据。

对于公告文件，收到公告概要后，应通过公告概要检查公告是否有丢失或者变化。如果有丢失或者变化，则应通过重传服务请求丢失或者变化的公告文件。

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=390094
ResendType	重发种类 1 = 逐笔行情数据 2 = 公告信息
ChannelNo	频道代码 当 ResendType=1 时生效
ApplBegSeqNum	起始序号 当 ResendType=1 时生效 指定记录序号的范围。
ApplEndSeqNum	结束序号 当 ResendType=1 时生效 指定记录序号的范围。 当 ApplEndSeqNum=0 时，行情网关会将 ApplEndSeqNum 设置为收到重传请求时，该频道数据在内存中的最大值。
NewsID	公告唯一标识 当 ResendType=2 时生效 为空时表示申请公告概要
ResendStatus	重传状态 仅在行情网关前置机返回给用户 行情系统服务器时有效 1 = 完成

	2 = 部分完成（有部分请求的数据没有返回） 3 = 拒绝（重传请求被服务器拒绝） 4 = 数据不可用
RejectText	文本 仅在行情网关前置机返回给用户行情系统服务器时有效 如果请求被行情网关前置机拒绝，错误代码在这个域返回

4.3.1 用户信息报告消息

用户行情系统服务器有义务定时向行情网关前置机发送用户信息报告消息上报当前时刻与用户行情系统服务器连接的客户端数目。只有信息商用户行情系统需要发送该消息。

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=390093
OrigTime	数据生成时间
VersionCode	版本代码 01 = 现场版 02 = 网络版
UserNum	用户数目 当前连接在本用户行情系统服务器的终端用户数目

4.3.1 快照行情频道统计

每个快照行情频道都会定期发送快照行情频道统计消息。

域名	字段描述
<u>Standard Header</u>	<u>消息头</u> <u>MsgType=390090</u>
<u>OrigTime</u>	<u>数据生成时间</u>

	ChannelNo	频道代码
	NoMDStreamID	行情类别个数
→	StockNum	证券只数
→	TradingPhaseCode	闭市状态 第 0 位： T=连续竞价（全部证券尚未闭市） E=已闭市（全部证券已闭市）

带格式表格

注：快照行情频道统计消息发送间隔为 15 秒。

4.4 实时行情

4.4.1 证券实时状态

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=390013
OrigTime	数据生成时间
ChannelNo	频道代码
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
SecurityPreName	证券简称前缀
NoSwitch	开关个数
→ SecuritySwitchType	开关类别
→ SecuritySwitchStatus	开关状态

注：

1) 开关类别说明：

开关类别	类别代码	说明
融资买入	1	适用于融资标的证券
融券卖出	2	适用于融券标的证券
申购	3	适用于 ETF，LOF 等开放式基金 对于黄金 ETF 是指现金申购
赎回	4	适用于 ETF，LOF 等开放式基金 对于黄金 ETF 是指现金赎回开关
认购	5	适用于网上发行认购代码
转股	6	适用于处于转股回售期的可转债

回售	7	适用于处于转股回售期的可转债
行权	8	适用于处于行权期的权证
要约收购	9	适用于处于要约收购期的股票
买开仓	10	适用于期权等衍生品
卖开仓	11	适用于期权等衍生品
黄金ETF实物 申购	12	适用于黄金ETF
黄金ETF实物 赎回	13	适用于黄金ETF
预受要约	14	适用于处于要约收购期的股票
解除要约	15	适用于处于要约收购期的股票

2) 证券简称前缀说明:

	取值	定义
第一位	Y	全天停牌
	H	暂停交易
	.	正常交易（注意是英文小数点字符）
第二位	C	仅可融资
	S	仅可融券
	A	既可融资也可融券
	.	其他（注意是英文小数点字符）
第三位	N	股票：新股上市首日 可转债、权证、基金、国债、企业债等单独的证券新上市首日
	M	恢复上市首日
	I	当前证券处于发行期间
	J	公司再融资（包括增发、配股、可转债发行等）通过交易系统公开发售申购期间（仅 A、B 股标记，以基础证券为准）
	X	股票、债券、基金：除权除息 权证：行权价格、行权比例调整起始生效日 可转债：可转债派息除息日
	W	权证：当日可行权 可转债、分离交易型可转债、企业债、公司债：当日可回售 股票：当日可申报预受要约
	V	当日可网络投票（A、B 股分别标识）
	.	通常状态（注意是英文小数点字符）
第四位	A	上市公司于交易日下午收市前通过指定网站发布公告提示
	C	封闭式基金
	O	开放式基金（仅揭示净值）
	F	非交易型基金（仅揭示基金净值及开放申购赎回业务）

	取值	定义
	L	上市开放式基金（可交易）
	E	ETF 基金
	.	其他（注意是英文小数点字符）

同一位中不同业务同时发生的，按优先次序（表中列出次序）揭示。交易所可视业务需要改变优先次序。

3) 证券实时状态消息的发布间隔为 15 秒

4.4.2 公告

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=390012
NewsID	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。
Headline	公告标题
OrigTime	公告时间
RawDataLength	二进制数据长度
RawData	二进制数据

公告概要

公告概要是一个当前公告文件的文本格式汇总列。

公告数量	BulletNum	数据类型为整数
公告标识	ID1	数据类型参见 NewsID
公告标题	NAME1	数据类型参见 Headline
公告大小	SIZE1	数据类型参见 RawDataLength
公告时间	TIME1	数据类型参见 OrigTime
...

下面是 RawData 中存放内容的一个简单示例：

BulletNum = 2

ID1 = SZGG0001

NAME1 = 中小企业板交易公开信息

SIZE1 = 100245

TIME1 = 20071022-09:15:01

ID2 = SZGG0002

NAME2 = 深圳证券市场权证交易公开信息

SIZE2 = 25076

4.4.3 快照行情

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=3xxx11
OrigTime	数据生成时间
ChannelNo	频道代码
MDStreamID	行情类别
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
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 第 1 位： 0=正常状态 1=全天停牌
PrevClosePx	昨收价
NumTrades	成交笔数
TotalVolumeTrade	成交总量
TotalValueTrade	成交总金额
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

- 1) 该消息用于以下行情类别

行情类别 MDStreamID	说明	消息类型	有无扩展 字段
010	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易快 照行情	300111	Y
020	质押式回购交易快照行情		
030	债券分销快照行情		
040	期权集中竞价交易快照行情		
060	以收盘价交易的盘后定价大宗交易申报	300611	Y
061	以成交量加权平均价交易的盘后定价大宗交 易申报		
900	指数	309011	Y
910	成交量统计指标	309111	Y

4.4.3.1 集中竞价业务行情快照扩展字段（300111）

域名		字段描述
NoMDEntries		行情条目个数
→	MDEntryType	行情条目类别 0=买入 1=卖出 2=最近价 4=开盘价 6=结算价 7=最高价 8=最低价 x1=涨跌一 x2=涨跌二 x3=买入汇总（总量及加权平均 价） x4=卖出汇总（总量及加权平均 价） x5=股票市盈率一 x6=股票市盈率二 x7=基金 T-1 日净值

			x8=基金实时参考净值（包括 ETF 的 IOPV） x9=权证溢价率 xe=涨停价，999999999.9999 表示无涨停价格限制 xf=跌停价，-999999999.9999 表示无跌停价格限制 xg=合约持仓量
→	MDEntryPx		价格
→	MDEntrySize		数量
→	MDPriceLevel		买卖盘档位
→	NumberOfOrders		价位总委托笔数 为 0 表示不揭示
→	NoOrders		价位揭示委托笔数 为 0 表示不揭示
→	→	OrderQty	委托数量

注：

- 1) 行情条目类别说明：
- ✓ 行情条目类别为 0（买入）或 1（卖出）时，表示该行情条目为买卖盘档位，其中 MDEntryPx 表示档位价格，MDEntrySize 表示档位上的买卖数量，MDPriceLevel 表示档位的优先级，从 1 开始，值越小表示档位的优先级越高，NumberOfOrders 表示档位上的总委托笔数，NoOrders 表示档位上揭示的委托笔数，在后面的 OrderQty 重复组中会揭示该价位上最优相应数量的每一笔委托的数量；

✓ 行情条目类别为 x3/x4 时，表示该行情条目为证券的买入/卖出汇总统计，其中 MDEntryPx 表示加权平均价，MDEntrySize 表示总数量，其他字段无意义；

✓ 行情条目类别为 xg 时，表示该行情条目为期权合约的持仓量，其中 MDEntrySize 表示合约持仓量，其他字段无意义；

✓ 其他行情条目类别都在 MDEntryPx 表示相应的值，其他字段无意义；
- 2) 集合竞价期间的虚拟成交价通过买卖盘档位揭示，其中买一和卖一都揭示虚拟成交价和成交数量，买二或卖二揭示虚拟成交价位上的买剩余量或卖剩余量，假设虚拟成交价格为 15.4000，成交数量为 3200，买剩余量为 1200，则行情快照中会存在以下行情条目

MDEntryType	MDEntryPx	MDEntrySize	MDPriceLevel
0	15.4000	3200.00	1
1	15.4000	3200.00	1

0	0.0000	1200.00	2
---	--------	---------	---

4.4.3.2 盘后定价大宗交易业务行情快照扩展字段 (300611)

域名		字段描述
NoMDEntries		行情条目个数
→	MDEntryType	行情条目类别 0=买入 1=卖出
→	MDEntryPx	价格
→	MDEntrySize	数量

4.4.3.3 指数行情快照扩展字段 (309011)

域名		字段描述
NoMDEntries		行情条目个数
→	MDEntryType	行情条目类别 3=当前指数 xa=昨日收盘指数 xb=开盘指数 xc=最高指数 xd=最低指数
→	MDEntryPx	指数点位

4.4.3.4 成交量统计指标行情快照扩展字段 (309111)

域名	字段描述
StockNum	统计量指标样本个数

4.4.4 逐笔委托行情

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=3xxx92
ChannelNo	频道代码
ApplSeqNum	消息记录号

	从 1 开始计数
MDSStreamID	行情类别
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源
Price	委托价格
OrderQty	委托数量
Side	买卖方向 1=买 2=卖 G=借入 F=出借
TransacTime	委托时间
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下行情类别

行情类别 MDSStreamID	说明	消息类型	有无扩展 字段
011	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易逐笔行情	300192	Y
021	质押式回购交易逐笔行情		
041	期权集中竞价交易逐笔行情		
051	协议交易逐笔意向行情	300592	Y
052	协议交易逐笔定价行情		
071	转融通证券出借逐笔行情	300792	Y

4.4.4.1 集中竞价业务逐笔委托行情扩展字段（300192）

域名	字段描述
OrdType	订单类别 1=市价 2=限价 U=本方最优
TimeInForce	0=当日有效 3=即时成交或撤销

MaxPriceLevels	最多成交价位数 0 表示不限制成交价位数
MinQty	最低成交数量

4.4.4.2 协议交易业务逐笔委托行情扩展字段（300592）

域名	字段描述
ConfirmID	定价行情约定号 ConfirmID 为空表示是意向行情 否则为定价行情
Contactor	联系人
ContactInfo	联系方式

4.4.4.3 转融通证券出借业务逐笔委托行情扩展字段（300792）

域名	字段描述
ExpirationDays	期限，单位为天数
ExpirationType	期限类型 1=固定期限

4.4.5 逐笔成交行情

域名	字段描述
Standard Header	消息头 MsgType=3xxx91
ChannelNo	频道代码
ApplSeqNum	消息记录号 从 1 开始计数
MDStreamID	行情类别
BidApplSeqNum	买方委托索引 从 1 开始计数，0 表示无对应委托
OfferApplSeqNum	卖方委托索引 从 1 开始计数，0 表示无对应委托
MDStreamID	行情类别
SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源

LastPx	委托价格
LastQty	委托数量
ExecType	成交类别 4=撤销 F=成交
TransacTime	委托时间
Extend Fields	各业务扩展字段

注：

1) 该消息用于以下行情类别

行情类别 MDSStreamID	说明	消息类型	有无扩展 字段
011	现货（股票，基金，债券等）集中竞价交易逐笔行情	300191	N
021	质押式回购交易逐笔行情		
041	期权集中竞价交易逐笔行情		
051	协议交易逐笔意向行情	300591	N
052	协议交易逐笔定价行情		
071	转融通证券出借逐笔行情	300791	N

2) 同一个频道内的逐笔委托和逐笔成交消息的记录号（ApplSeqNum）连续编号。

五、 数据字典


本接口规范中的所有整数类型字段都采用高字节序（BIG-ENDIAN）编码方式。

5.1 数据类型

数据类型	二进制类型	说明
CompID	char[20]	接收方或发送方代码
Price	Int64	价格，N13(4)
Qty	Int64	数量，N15(2)
Amt	Int64	金额，N18(4)
SeqNum	Int64	消息序号
Boolean	uInt16	1=True/Yes,0=False/No
Length	uInt32	长度 表示字节为单位的数据长度，正数

LocalTimeStamp	Int64	本地时间戳 YYYYMMDDHHMMSSsss（毫秒）， YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31, HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-60（秒），sss=000-999 （毫秒）。
NumInGroup	uInt32	重复数 表示重复组的个数，正数
LocalMktDate	uInt32	本地市场日期 格式 YYYYMMDD, YYYY = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31
SecurityID	char[8]	证券代码

注：

- 1)  表中的 Nx(y)表示相应的类型实际为浮点数类型，其中 x 表示整数与小数总计位数，不
包括小数点,y 表示小数位数,比如对于 Price 类型,Int64 值 186400 表示的价格为 18.6400。
- 2) 字符串类型 char[x] 统一使用 UTF-8 编码。

带格式的：字体：五号

带格式的：列出段落，编号 + 级
别：1 + 编号样式：1, 2, 3, ... +
起始编号：1 + 对齐方式：左侧 +
对齐位置：0.74 厘米 + 缩进位
置：1.38 厘米

带格式的：字体：五号

5.2 会话层域定义

域名	类型	说明
BodyLength	uInt32	消息体长度
MsgType	uInt32	消息类型
Checksum	uInt32	校验和
SenderCompID	CompID	接收发送 方代码
TargetCompID	CompID	发送接收 方代码
Password	char[16]	密码
Text	char[200]	文本信息
HeartBtInt	Int32	心跳监测的时间间隔 为系统设定值,以秒为单位
DefaultApplVerID	char[32]	二进制协议版本，即数据接口规范版 本。
SessionStatus	Int32	会话状态

5.3 业务层域定义

域名	类型	说明
ApplBegSeqNum	SeqNum	起始序号
ApplEndSeqNum	SeqNum	结束序号

AppLastSeqNum	SeqNum	最后一条行情消息的记录号
AppSeqNum	SeqNum	消息记录号
BidAppSeqNum	SeqNum	买方委托索引
ChannelNo	uInt16	频道代码
ConfirmID	char[8]	定价行情约定号
ContactInfo	char[5030]	联系方式
Contactor	char[12]	联系人
EndOfChannel	Boolean	频道结束标志
ExecType	char	执行类型 4=Cancelled, 表示已撤销 F=Trade, 表示已成交
ExpiresType	uInt8	期限类型
FixedPriceType	uInt8	固定价格类型, 盘后定价大宗交易业务填写
Headline	char[128]	公告标题
LastPx	Price	成交价格
LastQty	Qty	成交数量
MaxPriceLevels	uInt16	最多成交价位数
MDEntryPx	Int64	行情条目价格, N18 (6)
MDEntrySize	Qty	行情条目数量
MDEntryType	char[2]	行情条目类别
MDPriceLevel	uInt8	买卖盘档位
MDStreamID	char[3]	行情类别
MinQty	Qty	最低成交数量
NewsID	char[8]	公告索引/增值信息索引
NoMDEntries	NumInGroup	行情条目个数
NoMDStreamID	NumInGroup	行情类别个数
NoOrders	NumInGroup	价位揭示委托笔数
NoSwitch	NumInGroup	开关个数
NumberOfOrders	uInt32	价位总委托笔数
NumTrades	Int64	成交笔数
OfferAppSeqNum	SeqNum	卖方委托索引

OrderQty	Qty	订单数量
OrdType	char	订单类型 1 <u>表示市价=市价</u> 2 <u>表示限价=限价</u> U <u>本方最优</u>
OrigTime	LocalTimestamp	<u>公告时间数据生成时间</u>
<u>PrevClosePx</u>	<u>Price</u>	<u>昨收价</u>
Price	Price	委托价格
RawData	char[n]	变长二进制数据
RawDataLength	Length	二进制数据长度
RejectText	char[16]	拒绝原因说明
ResendStatus	uInt8	重传状态
ResendType	uInt8	重发种类
SecurityID	SecurityID	证券代码
SecurityIDSource	char[4]	证券代码源 102=深圳证券交易所
SecurityPreName	char[4]	证券简称前缀
SecuritySwitchStatus	Boolean	开关状态
SecuritySwitchType	uInt16	开关类别
Side	char	买卖方向 1 <u>表示买=买</u> 2 <u>表示卖=卖</u> <u>G=借入</u> <u>F=出借</u>
TemplateID	uInt16	模板号
TimeInForce	char	0 表示当日有效
TotalValueTrade	Amt	成交总金额
TotalVolumeTrade	Qty	成交总量

TradingPhaseCode	char [8]	产品所处的交易阶段代码
TransacTime	LocalTimestamp	委托时间
UserNum	uInt16	用户数目
VersionCode	char [16]	版本代码