

内部资料，请勿外传

FPGA 行情分发系统输出行情结构说明

版本：v1.12

发布日期：2021-10-11

更新记录

版本号	变更人	变更日期	变更记录
1.0	朱恺	2020-05-22	初始版本
1.1	朱恺	2020-06-04	
1.2	朱恺	2020-06-15	
1.3	朱恺	2020-08-26	
1.4	朱恺	2020-11-03	
1.5	朱恺	2021-03-09	新增上交所 level2 期权及 level1 Binary 行情定义
1.6	陈建武	2021-04-07	新增上交所 level2 逐笔委托
1.7	陈建武	2021-04-09	修改 TradingDay 的含义为暂未使用，可忽略
1.8	陈建武	2021-04-21	修改逐笔委托中的字段错误定义
1.9	朱恺	2021-07-02	更新上交所指数行情 turnover 字段乘数系数
1.10	陈建武	2021-07-23	期权行情增加 step 消息中的 LastUpdateTime
1.11	陈建武	2021-08-04	增加新债券的逐笔行情和快照行情
1.12	陈建武	2021-10-11	修改上交所新债券行情快照中 updatetime 的定义

1 概述	4
2 自定义行情结构	4
2.1 GMD 消息协议	4
2.2 上交所输出行情消息域	7
2.2.1 指数行情域格式	7
2.2.2 逐笔成交行情域格式	8
2.2.3 逐笔委托行情域格式	9
2.2.4 快照行情域格式（股票、债券、基金）	10
2.2.5 期权快照行情域格式	13
2.2.6 Level1 股票快照行情域格式	14
2.2.7 Level1 指数快照行情域格式	16
2.2.8 Level1 期权快照行情域格式	17
2.2.9 新债券快照行情域格式	20
2.2.10 新债券逐笔行情域格式	23
2.3 深交所输出行情消息域	25
2.3.1 逐笔成交行情域格式	25
2.3.2 逐笔委托行情域格式	26
2.3.3 快照行情域格式（现货、质押式回购、债券分销）	27
2.3.4 期权快照行情域格式	29
2.3.5 指数行情域格式	32

1 概述

FPGA 证券行情分发系统在接收到沪/深交易所 Level2 行情后转换成自定义的行情格式, 并通过 UDP 多播形式推送给下游客户。转发行情格式可参考第二章内容。

2 自定义行情结构

FPGA 输出 UDP 多播行情分为上交所 Level2 行情和深交所 Level2 行情, 由于各家交易所定义的行情字段并不完全相同, 因此各自行情格式定义如下。

2.1 GMD 消息协议

FPGA 输出行情消息使用 GMD 消息协议, 每一条消息都由 GMD 消息头和 GMD 消息体组成。其中 GMD 消息体由可变数量的消息域组成, 每一个消息域由域头和域体组成。(注: FPGA 输出的行情消息中消息体只包含一个消息域)

GMD 消息头定义如下:

名称	类型	长度	说明
Verison	uint8_t	1	版本号
ExLen	uint8_t	1	扩展长度, FPGA 行情中暂未使用, 取值为 0
TopicID	uint16_t	2	主题号: 0x0201-上交所行情 0x0301-深交所行情
MsgID	uint16_t	2	消息号: 上交所 0x0D01-指数行情

			0x0D02-股票快照行情 0x0D03-债券快照行情 0x0D04-基金快照行情 0x0D05-期权快照行情 0x0D06-逐笔成交行情 0x0D0C-逐笔委托行情 0x0D20-Level1 股票快照行情 0x0D21-Level1 指数快照行情 0x0D22-Level1 期权快照行情 0x0D31-新债券快照行情 0x0D32-新债券逐笔行情 深交所 0x0D09-质押式回购快照行情 0x0D0A-债券分销快照行情 0x0D11-指数行情 0x0D12-现货快照行情 0x0D13-期权快照行情 0x0D14-逐笔成交行情 0x0D15-逐笔委托行情
BodyLen	uint16_t	2	消息体长度(不包含 GMD 消息头)
SeqNo	uint32_t	4	序列号

消息体中域头定义如下：

名称	类型	长度	说明
FieldID	uint16_t	2	域 ID: 上交所 0xBC11-指数行情域 0xBC12-股票快照行情域 0xBC13-债券快照行情域 0xBC14-基金快照行情域 0xBC15-期权快照行情域 0xBC16-逐笔成交行情域 0xBC0A-逐笔委托行情域 0xBD20-Level1 股票快照行情域 0xBD21-Level1 指数快照行情域 0xBD22-Level1 期权快照行情域 0XBC31-新债券快照行情域 0x BC32-新债券逐笔行情域 深交所 0xBD09-质押式回购快照行情域 0xBD0A-债券分销快照行情域 0xBD11-指数行情域 0xBD12-现货快照行情域 0xBD13-期权快照行情域 0xBD14-逐笔成交行情域

			0xBD15-逐笔委托行情域
FieldLen	uint16_t	2	域体长度（不包含域头）

消息体中域体的定义见后续章节。

2.2 上交所输出行情消息域

2.2.1 指数行情域格式

名称	类型	长度	说明
UpdateTime	int32_t	4	行情时间（秒） 143025 表示 14:30:25
UpdateMsec	int32_t	4	行情时间（毫秒），保留字段，暂未用
TradingDay	char[8]	8	交易日，暂未使用，可忽略
SecurityID	char[8]	8	证券代码
PreClose	int64_t	8	昨收盘指数，乘以 100000
Open	int64_t	8	今开盘指数，乘以 100000
TurnOver	int64_t	8	成交金额，乘以 10
High	int64_t	8	最高指数，乘以 100000
Low	int64_t	8	最低指数，乘以 100000
Last	int64_t	8	最新指数，乘以 100000
TradeVolume	int64_t	8	交易数量（手），乘以 100000
Close	int64_t	8	今收盘指数，乘以 100000

注：以上整型字段大于 0 时为有效值

2.2.2 逐笔成交行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	char[8]	8	交易日, 暂未使用, 可忽略
TradeIndex	int32_t	4	成交序号, 从 1 开始, 按 Channel 连续
TradeChannel	int32_t	4	成交通道
SecurityID	char[8]	8	证券代码
UpdateTime	int32_t	4	成交时间 14302506 表示 14:30:25.06
UpdateMsec	int32_t	4	成交时间 (毫秒), 保留字段, 暂未用
Price	int64_t	8	成交价格 (元), 乘以 1000
TradeVolume	int64_t	8	成交数量, 股票-股, 债券-手 乘以 1000
TurnOver	int64_t	8	成交金额 (元), 乘以 100000
TradeBuyNo	int64_t	8	买方订单号
TradeSellNo	int64_t	8	卖方订单号
TradeBSFlag	char[8]	8	内外盘标志: B-外盘, 主动买 S-内盘, 主动卖 N-未知
BizIndex	int64_t	8	业务序号

			与委托统一编号，从 1 开始，按 Channel 联系
--	--	--	-----------------------------

2.2.3 逐笔委托行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	char[8]	8	交易日，暂未使用，可忽略
OrderIndex	int32_t	4	委托序号，从 1 开始，按 Channel 连续
OrderChannel	int32_t	4	委托通道
SecurityID	char[8]	8	证券代码
UpdateTime	int32_t	4	委托时间 14302506 表示 14:30:25.06
UpdateMsec	int32_t	4	委托时间 (毫秒)，保留字段，暂未用
OrderType	char[8]	8	订单类型： A- 委托订单（增加） D- 委托订单（删除）
OrderNO	int64_t	8	原始订单号
OrderPrice	int64_t	8	委托价格（元），乘以 1000
Balance	int64_t	8	剩余委托量，乘以 1000
OrderBSFlag	char[8]	8	对于委托订单： B- 买单 S- 卖单

BizIndex	int64_t	8	业务序列号 与成交统一编号，从 1 开始，按 Channel 联系
----------	---------	---	--

2.2.4 快照行情域格式（股票、债券、基金）

名称	类型	长度	说明
TradingDay	char[8]	8	交易日，暂未使用，可忽略
UpdateTime	int32_t	4	行情时间（秒） 143025 表示 14:30:25
UpdateMsec	int32_t	4	行情时间(毫秒)，保留字段，暂未用
SecurityID	char[8]	8	证券代码
PreClose	int32_t	4	昨收盘价，乘以 1000
Open	int32_t	4	今开盘价，乘以 1000
High	int32_t	4	最高价，乘以 1000
Low	int32_t	4	最低价，乘以 1000
Last	int32_t	4	最新价，乘以 1000
Close	int32_t	4	今收盘价，乘以 1000
TradingPhaseCode	char[8]	8	产品所处的交易阶段代码

		<p>第 0 位：</p> <p>S=启动（开市前）</p> <p>C=开盘集合竞价</p> <p>T=连续交易</p> <p>E=闭市</p> <p>P=产品停牌</p> <p>M=可恢复交易的熔断时段</p> <p>N=不可恢复交易的熔断时段</p> <p>U=收盘集合竞价</p> <p>第 1 位：</p> <p>0=此产品不可正常交易</p> <p>1=此产品可正常交易</p> <p>第 2 位：</p> <p>0=未上市</p> <p>1=已上市</p> <p>第 3 位：</p> <p>0=此产品在当前时段不接受进行新订单申报</p>
--	--	--

			1=此产品在当前时段 可接受进行新订单申 报
TradeNumber	int64_t	8	成交笔数
TradeVolume	int64_t	8	成交总量, 乘以 1000 股票-股 债券-手
TurnOver	int64_t	8	成交总金额(元), 乘以 100000
TotalBidQty	int64_t	8	委托买入总量, 乘以 1000
TotalOfferQty	int64_t	8	委托卖出总量, 乘以 1000
WeightedAvgBidPx	int32_t	4	加权平均委买价格 (元), 乘以 1000
WeightedAvgOfferPx	int32_t	4	加权平均委卖价格 (元), 乘以 1000
DepthMDField	CSSEDepthMDField[20]	320	买、卖十档价格盘口 0-9 为买盘十档价位 10-19 为卖盘十档价 位

注: 价格档位字段 DepthMDField 涉及的结构 CSSEDepthMDField 定义如下:

名称	类型	长度	说明
Level	int32_t	4	委托档位
Price	int32_t	4	价格, 乘以 1000
Volume	int64_t	8	申买量, 乘以 1000 股票: 股 债券: 手

2.2.5 期权快照行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	char[8]	8	交易日, 暂未使用, 可忽略
SecurityID	char[16]	16	产品代码
TradeNumber	int64_t	8	成交笔数
TradeVolume	int64_t	8	成交量, 单位: 张
TurnOver	double	8	成交金额, 单位: 元
PreClose	double	8	昨收盘价, 单位: 元
PreSettlement	double	8	昨结算价, 单位: 元
DepthMDField	OptionDepthMDField[10]	160	买、卖五档价格盘口
Last	double	8	最新价, 单位: 元
UpdateTime	int32_t	4	行情时间 (秒) 143025 表示 14:30:25
UpdateMsec	int32_t	4	行情时间 (毫秒)
Open	double	8	今开盘价, 单位: 元

Close	double	8	今收盘价，单位：元
Settlement	double	8	今结算价，单位：元
High	double	8	当日最高成交价，单位： 元
Low	double	8	当日最低成交价，单位： 元
LastUpdateTime	int32_t	4	最新更新时间（秒） 143025 表示 14:30:25
LastUpdateMsec	int32_t	4	最新更新时间（毫秒）

注：价格档位字段 DepthMDField 涉及的结构 OptionDepthMDField 定义如下：

名称	类型	长度	说明
Price	double	8	价格，单位：元
Volume	int64_t	8	申买量，单位：张

2.2.6Level1 股票快照行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	int32_t	4	交易日期 YYYYMMDD
LastUpdateTime	int32_t	4	最新更新时间 HHMMSSsss
SecurityID	char[8]	8	产品代码
PreClose	int64_t	8	昨收盘价，乘以 100000

TradeVolume	int64_t	8	成交数量
TradeNumber	int64_t	8	成交笔数
TurnOver	int64_t	8	成交金额，乘以 100
TradingPhaseCode	char[8]	8	<p>实时阶段及标志</p> <p>第 0 位：</p> <p>S=启动 (开市前) 时段</p> <p>C=开盘结合竞价</p> <p>T=连续交易</p> <p>E=闭市时段</p> <p>P=产品停牌</p> <p>M=可恢复交易的熔断时段</p> <p>N=不可恢复交易的熔断时段</p> <p>U=收盘集合竞价</p> <p>第 1 位：</p> <p>0=产品不可正常交易</p> <p>1=产品可正常交易</p> <p>第 3 位：</p> <p>0=未上市</p> <p>1=已上市</p> <p>第 4 位：</p>

			0=产品当前时段不接受新订单申报 1=产品当前时段可接受新订单申报
Last	int64_t	8	最新成交价，乘以100000
Open	int64_t	8	今开盘价，乘以100000
High	int64_t	8	当日最高成交价，乘以100000
Low	int64_t	8	当日最低成交价，乘以100000
DepthMDField	BinaryDepthMDField[10]	160	买、卖五档价格盘口

注：价格档位字段 DepthMDField 涉及的结构 BinaryDepthMDField 定义如下：

名称	类型	长度	说明
Price	int64_t	8	价格，乘以 100000
Volume	int64_t	8	申买量

2.2.7Level1 指数快照行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	int32_t	4	交易日期 YYYYMMDD
LastUpdateTime	int32_t	4	最新更新时间

			HHMMSSsss
SecurityID	char[8]	8	产品代码
PreClose	int64_t	8	昨收盘指数，乘以 100000
TradeVolume	int64_t	8	成交数量
TradeNumber	int64_t	8	成交笔数
TurnOver	int64_t	8	成交金额，乘以 100
TradingPhaseCode	char[8]	8	实时阶段及标志,保留
Last	int64_t	8	最新指数，乘以 100000
Open	int64_t	8	今开盘指数，乘以 100000
High	int64_t	8	当日最高指数，乘以 100000
Low	int64_t	8	当日最低指数，乘以 100000

2.2.8Level1 期权快照行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	int32_t	4	交易日期 YYYYMMDD
LastUpdateTime	int32_t	4	最新更新时间 HHMMSSsss
SecurityID	char[8]	8	产品代码

PreClose	int64_t	8	昨收盘价，乘以 100000
TradeVolume	int64_t	8	成交数量
TradeNumber	int64_t	8	成交笔数
TurnOver	int64_t	8	成交金额，乘以 100
TradingPhaseCode	char[8]	8	<p>实时阶段及标志</p> <p>第 0 位：</p> <p>S=启动(开市前)时段</p> <p>C=开盘结合竞价</p> <p>B=休市时段</p> <p>T=连续交易</p> <p>E=闭市时段</p> <p>V=波动性中断</p> <p>P=临时停牌</p> <p>M=可恢复交易的熔断时段</p> <p>N=不可恢复交易的熔断时段</p> <p>U=收盘集合竞价</p> <p>第 1 位：</p> <p>0=未连续停牌</p> <p>1=连续停牌</p>

			<p>第 2 位:</p> <p>0=不限制开仓</p> <p>1=限制备兑开仓</p> <p>2=卖出开仓</p> <p>3=限制卖出开仓、备兑开仓</p> <p>4=限制买入开仓</p> <p>5=限制买入开仓、备兑开仓</p> <p>6=限制买入开仓、卖出开仓</p> <p>7=限制买入开仓、卖出开仓、备兑开仓</p> <p>第 3 位:</p> <p>0=产品当前时段不接受新订单申报</p> <p>1=产品当前时段可接受新订单申报</p>
Last	int64_t	8	最新成交价，乘以 100000
Open	int64_t	8	今开盘价，乘以 100000

High	int64_t	8	当日最高成交价,乘以 100000
Low	int64_t	8	当日最低成交价,乘以 100000
Settlement	int64_t	8	今 结 算 价 , 乘 以 100000
Position	int64_t	8	总持仓量
PreSettlement	int64_t	8	昨 结 算 价 , 乘 以 100000
DynaRefPrice	int64_t	8	动态参考价格,乘以 100000
DepthMDField	BinaryDepthMDField[10]	160	买、卖五档价格盘口

注：价格档位字段 DepthMDField 涉及的结构 BinaryDepthMDField 定义如下：

名称	类型	长度	说明
Price	int64_t	8	价格, 乘以 100000
Volume	int64_t	8	申买量

2.2.9 新债券快照行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	char[8]	8	交易日, 暂未使用,

			可忽略
UpdateTime	int32_t	4	行情时间（秒） 143025002 表示 14:30:25.002
UpdateMsec	int32_t	4	行情时间（毫秒）， 保留字段，暂未用
SecurityID	char[8]	8	证券代码
PreClose	int32_t	4	昨收盘价，乘以 1000
Open	int32_t	4	今开盘价，乘以 1000
High	int32_t	4	最高价，乘以 1000
Low	int32_t	4	最低价，乘以 1000
Last	int32_t	4	最新价，乘以 1000
Close	int32_t	4	今收盘价，乘以 1000
InstrumentStatus	char[8]	8	ADD：产品未上市 START：启动 OCALL：开市集合 竞价 TRADE：连续自动 撮合

			<p>SUSP: 停牌</p> <p>CLOSE: 闭市, 自动 计算闭市价格</p> <p>ENDTR: 交易结束</p>
TradeNumber	int64_t	8	成交笔数
TradeVolume	int64_t	8	成交总量, 乘以 1000
TurnOver	int64_t	8	成交总金额 (元), 乘以 100000
TotalBidQty	int64_t	8	委托买入总量, 乘 以 1000
TotalOfferQty	int64_t	8	委托卖出总量, 乘 以 1000
AltWeightedAvgBidPx	int32_t	4	债券加权平均委买 价格 (元), 乘以 1000
AltWeightedAvgOfferPx	int32_t	4	债券加权平均委卖 价格 (元), 乘以 1000
WeightedAvgPx	int64_t	8	加权平均价, 乘以 1000
DepthMDField	CSSEDepthMDField[20]	320	买、卖十档价格盘

			口 0-9 为买盘十档价 位 10-19 为卖盘十档 价位 参考 2.2.4 快照行情 的 DepthMDField
--	--	--	--

2.2.10 新债券逐笔行情域格式

名称	类型	长度	说明
TradingDay	char[8]	8	交易日，暂未使用，可忽略
TickIndex	int32_t	4	逐笔序号，从 1 开始，按 Channel 连续
Channel	int32_t	4	通道
SecurityID	char[8]	8	证券代码
TickTime	int32_t	4	订单或成交时间（毫秒） 143025006 表示 14:30:25.006
Type	char[4]	4	类型： A：新增委托订单 D：删除委托订单 S：产品状态订单 T：成交

BuyOrderNo	int64_t	8	买方订单 若为产品状态订单或卖方订单，则 无意义
SellOrderNo	int64_t	8	卖方订单 若为产品状态订单或买方订单，则 无意义
Price	int64_t	8	价格（元），乘以 1000 若为产品状态订单、删除订单，则 无意义
Qty	int64_t	8	数量（手），乘以 1000 若为产品状态订单，则无意义
TradeMoney	int64_t	8	成交金额（元），乘以 100000 仅适用于 TYPE 的类型=T
TickBSFlag	char[8]	8	若为新增或删除委托订单（TYPE 的类型=A 或 D）： B - 买单 S - 卖单 若为产品状态订单（TYPE 的类型 =S）： ADD - 产品未上市 START - 启动 OCALL - 开市集合竞价

			TRADE – 连续自动撮合 SUSP – 停牌 CLOSE – 闭市 ENDTR – 交易结束 若为成交 (TYPE 的类型=T): B – 外盘, 主动买 S – 内盘, 主动卖 N – 未知
--	--	--	---

2.3 深交所输出行情消息域

2.3.1 逐笔成交行情域格式

名称	类型	长度	说明
ApplSeqNum	int64_t	8	消息记录号, 从 1 开始计数
ChannelNo	uint32_t	4	频道代码
MDStreamID	char[4]	4	行情类别
BidApplSeqNum	int64_t	8	买方委托索引, 从 1 开始计数, 0 表示无对应委托
OfferApplSeqNum	int64_t	8	卖方委托索引, 从 1 开始计数, 0 表示无对应委托
SecurityID	char[8]	8	证券代码
LastPx	int64_t	8	成交价格, 乘以 10000
LastQty	int64_t	8	成交数量, 乘以 100

SecurityIDSource	char[4]	4	证券代码源 102-深圳证券交易所 103-香港交易所
ExecType	char[4]	4	成交类别 4-撤销 F-成交
TransactTime	int64_t	8	成交时间，格式 YYYYMMDDHHMMSSsss 其中 sss=0-000，表示毫秒

2.3.2 逐笔委托行情域格式

名称	类型	长度	说明
ApplSeqNum	int64_t	8	消息记录号，从 1 开始计数
ChannelNo	uint32_t	4	频道代码
MDStreamID	char[4]	4	行情类别
SecurityID	char[8]	8	证券代码
Price	int64_t	8	委托价格，乘以 10000
OrderQty	int64_t	8	委托数量，乘以 100
TransactTime	int64_t	8	成交时间，格式 YYYYMMDDHHMMSSsss 其中 sss=0-000，表示毫秒
SecurityIDSource	char[4]	4	证券代码源 102-深圳证券交易所

			103-香港交易所
Side	char[2]	2	买卖方向 1-买 2-卖 G-借入 F-出借
OrdType	char[2]	2	订单类别 1-市价 2-限价 U-本方最优

2.3.3 快照行情域格式（现货、质押式回购、债券分销）

名称	类型	长度	说明
OrigTime	int64_t	8	数据生成时间，格式 YYYYMMDDHHMMSSsss 其中 sss=0-000，表示毫秒
ChannelNo	uint32_t	4	频道代码
MDStreamID	char[4]	4	行情类别
SecurityID	char[8]	8	证券代码
SecurityIDSource	char[8]	8	证券代码源 102-深圳证券交易所 103-香港交易所
TradingPhaseCode	char[8]	8	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
PrevClosePx	int64_t	8	昨收价，乘以 10000
NumTrades	int64_t	8	成交笔数
TotalVolumeTrade	int64_t	8	成交总量，乘以 100
TotalValueTrade	int64_t	8	成交总金额，乘以 10000
Last	int64_t	8	最新价，乘以 1000000
Open	int64_t	8	开盘价，乘以 1000000
High	int64_t	8	最高价，乘以 1000000
Low	int64_t	8	最低价，乘以 1000000
UpperLimit	int64_t	8	涨停价，乘以 1000000

LowerLimit	int64_t	8	跌停价，乘以 1000000
BidDepthMD	DepthField[10]	160	买入委托十档盘口
BidWeightedAvgPx	int64_t	8	买入委托加权平均价，乘以 1000000
BidTotalQty	int64_t	8	买入委托总量，乘以 100
AskDepthMD	DepthField[10]	160	卖出委托十档盘口
AskWeightedAvgPx	int64_t	8	卖出委托加权平均价，乘以 1000000
AskTotalQty	int64_t	8	卖出委托总量，乘以 100
IOPV	int64_t	8	股票-基金实时参考净值，乘以 1000000 质押式回购、债券分销快照 -该字段无效

注：字段 BidDepthMD 和 AskDepthMD 涉及的结构 DepthField 定义如下

名称	类型	长度	说明
Price	int64_t	8	价格，乘以 1000000
Volume	int64_t	8	数量，乘以 100

2.3.4 期权快照行情域格式

名称	类型	长度	说明
OrigTime	int64_t	8	数据生成时间，格式 YYYYMMDDHHMMSSsss 其中 sss=0-000，表示毫秒

ChannelNo	uint32_t	4	频道代码
MDStreamID	char[4]	4	行情类别
SecurityID	char[8]	8	证券代码
SecurityIDSource	char[8]	8	证券代码源 102-深圳证券交易所 103-香港交易所
TradingPhaseCode	char[8]	8	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
PrevClosePx	int64_t	8	昨收价，乘以 10000
NumTrades	int64_t	8	成交笔数

TotalVolumeTrade	int64_t	8	成交总量，乘以 100
TotalValueTrade	int64_t	8	成交总金额，乘以 10000
Last	int64_t	8	最新价，乘以 1000000
Open	int64_t	8	开盘价，乘以 1000000
High	int64_t	8	最高价，乘以 1000000
Low	int64_t	8	最低价，乘以 1000000
UpperLimit	int64_t	8	涨停价，乘以 1000000
LowerLimit	int64_t	8	跌停价，乘以 1000000
BidDepthMD	DepthField[10]	160	买入委托十档盘口
BidWeightedAvgPx	int64_t	8	买入委托加权平均价，乘以 1000000
BidTotalQty	int64_t	8	买入委托总量，乘以 100
AskDepthMD	DepthField[10]	160	卖出委托十档盘口
AskWeightedAvgPx	int64_t	8	卖出委托加权平均价，乘以 1000000
AskTotalQty	int64_t	8	卖出委托总量，乘以 100
Position	int64_t	8	期权合于持仓量，乘以 100

注：字段 BidDepthMD 和 AskDepthMD 涉及的结构 DepthField 定义如下

名称	类型	长度	说明
Price	int64_t	8	价格，乘以 1000000
Volume	int64_t	8	数量，乘以 100

2.3.5 指数行情域格式

名称	类型	长度	说明
OrigTime	int64_t	8	数据生成时间，格式 YYYYMMDDHHMMSSsss 其中 sss=0-000，表示毫秒
ChannelNo	uint32_t	4	频道代码
MDStreamID	char[4]	4	行情类别
SecurityID	char[8]	8	证券代码
SecurityIDSource	char[8]	8	证券代码源 102-深圳证券交易所 103-香港交易所
TradingPhaseCode	char[8]	8	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
PrevClosePx	int64_t	8	昨收价, 乘以 10000
NumTrades	int64_t	8	成交笔数
TotalVolumeTrade	int64_t	8	成交总量, 乘以 100
TotalValueTrade	int64_t	8	成交总金额, 乘以 10000
PreCloseIdx	int64_t	8	昨收盘指数, 乘以 1000000
Last	int64_t	8	最新价, 乘以 1000000
Open	int64_t	8	开盘价, 乘以 1000000
High	int64_t	8	最高价, 乘以 1000000
Low	int64_t	8	最低价, 乘以 1000000