

上海证券交易所 Level-1 行情说明书

目录

1 数据格式约定	1
2 LEVEL-1 行情接口.....	2
2.1 行情接口 mktDt00.txt.....	2
2.2 产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt	10

1 数据格式约定

该文档中描述文件分为 txt 格式。

txt 格式均遵循以下约定：

- （一）对于字符型字段，不足部分左对齐，右补空格；以 CX 格式表示，其中 X 代表长度。
- （二）对于整数数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度。
- （三）对于浮点数字型字段，不足部分右对齐，左补空格；以 NX (Y)格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度，Y 代表小数位数。X 包括一位小数点。带浮点的数字型字段包括小数位，如：123.00000 显示为 123.00000；
- （四）无特别声明，对于数字字段数值溢出，将填写全 9 数值，如 N6 (2) 填写 999.99。
- （五）竖线("|")为字段间分隔符。
- （六）竖线("|")不应用在每条记录的开头和结尾。
- （七）各字段均为一个遵循格式定义的字符串。每个字段均为定长字段。
- （八）每行以二进制 0x0A 结束
- （九）最后一行也以 0x0A 结束

其他补充约束参见字段具体描述。

2 LEVEL-1 行情接口

2.1 行情接口 mktdt00.txt

mktdt00.txt	行情文件接口
<p>描述:</p> <p>本文件为行情文件接口。对于竞价撮合平台，行情文件名为 mktdt00.txt，当日开市前至交易结束期间实时发送。（对于港交所，仅提供一档数据，其他档数据填空格）</p> <p>行情文件为文本 txt 文件，格式约定如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> （一）竖线()为字段间分隔符，字段数据内容不应含有分隔符； （二）竖线()不应用在每条记录的开头和结尾； （三）各字段均为一个遵循格式定义的字符串，字段间有严格前后顺序； （四）字段定长，字段格式定义约定了长度和精度；字符型字段以 CX 格式表示，其中 X 代表字符串长度，不足部分左对齐，右补空格；整数数字型字段以 NX 格式表示，其中 X 代表数字型字符串长度，不足部分右对齐，左补空格；浮点数字型字段以 NX (Y) 格式表示，其中 X 代表数字型字符串总长度，Y 代表小数位数，X 包括一位小数点，整数部分最多不超过 X-Y-1 位，小数部分最多不超过 Y 位，不足部分右对齐，左补空格； （五）每行以二进制 0x0A 结束，最后一行也以 0x0A 结束。 <p>文件描述:</p> <ul style="list-style-type: none"> （一）行情文件包含文件头、文件体、文件尾三个部分； （二）注意行情文件可扩展性，文件记录尾部可能随时增加扩展字段，接收处理方应能向下兼容处理，即增加扩展字段后，对新增字段无需识别处理的用户，不需要升级系统；注意根据文件体首字段 MDStreamID 取值解析不同的文件体记录格式； （三）文件体中，对于不同的行情数据类型，分别定义记录格式，接收处理方应根据行情数据类型识别处理； （四）文件体记录按行情数据类型递增，同一行情数据类型按证券代码递增； （五）对于暂停上市的股票，文件中不包含该股票的记录。发行期内对于未设定开始上市交易的产品，文件中不包含该产品的记录。对于摘牌后的产品，文件中不包含该产品的记录； （六）如文件中数值字段取值超过约定格式最大值，取最大值，如 N10 取 9999999999； （七）前收盘价格，在开市之前即行发布。 	

mktedt00.txt	行情文件接口
<p>(八) 当产品代码为债券(国债、企债、可转债)时, 由于债券交易的数量以手为单位, 成交金额为该债券每笔成交的价格*数量*10 的总和;</p> <p> 当产品代码为席位质押式国债回购代码 201***、席位质押式企业债回购代码 202***以及账户质押式国债回购代码 204***时, 成交金额为 100*成交数量*10;</p> <p> 当产品代码为买断式国债回购代码 203***时, 成交金额为其基础产品昨日收盘价*成交数量*10;</p> <p>(九) 对于产品价格、金额数据单位, 除 B 股为美元外, 其他为人民币元。对于产品数量数据单位, 股票为股, 基金、权证为份, 债券与回购为手。对于产品 TradeVolume 成交数量单位, 股票为股, 基金为份, 债券与回购为手, 权证为 100 份; 对于指数价格、金额、数量单位, 详见表格具体定义说明;</p> <p>(十) 在集合竞价时段内, 当前买入价和当前卖出价中同时为虚拟开盘参考价格, 即根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。同时申买量一和申卖量一为行情发布时刻的虚拟匹配量。申买量二为行情发布时刻的买方虚拟未匹配量。申卖量二为行情发布时刻的卖方虚拟未匹配量;</p> <p>(十一) 在开盘集合竞价之后的短暂休市和中午休市期间同样揭示各档买卖价格数量等全部信息;</p> <p>(十二) 临时停牌期间不揭示五档行情;</p> <p>(十三) 字段无意义或无该字段行情数据时, 字符填充格, 数值填 0;</p> <p>(十四) 交易所具体产品代码, 参见相关发文通知, 并参考以上处理。</p>	

结构图如下:



文件结构描述参考:

BeginString|Version|BodyLength|TotNumTradeReports|MDReportID|SenderCompID|MDTime|MDUpdateType|MDSesStatus

MDStreamID|SecurityID|Symbol|TradeVolume|TotalValueTraded|PreClosePx|OpenPrice|HighPrice|LowPrice|TradePrice|BuyPrice1|BuyVolume1|SellPrice1|SellVolume1|BuyPrice2|BuyVolume2|SellPrice2|SellVolume2|BuyPrice3|BuyVolume3|SellPrice3|SellVolume3|BuyPrice4|BuyVolume4|SellPrice4|SellVolume4|BuyPrice5|BuyVolume5|SellPrice5|SellVolume5|TradingPhaseCode|Timestamp

.....

EndString|Checksum

文件头定义第一行特殊记录，：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	BeginString	起始标识符	C6	HEADER
2	Version	版本	C8	MTP1.00
3	BodyLength	数据长度	N10	计算出的长度字段分隔符后面的字节数（不包含本字段后面的分隔符），包含其他字段后面的分隔符、换行符。
4	TotNumTradeReports	文件体记录数	N5	文件体记录数
5	MDReportID	行情序号	N8	行情文件序号（预留，暂不填）
6	SenderCompID	发送方	C6	发送方标示符，取 XSHG01
7	MDTime	行情时间	C21	行情时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000
8	MDUpdateType	发送方式	N1	0 = 快照 Full refresh 1 = 增量 Incremental（暂不支持）
9	MDSesStatus	市场行情状态	C8	全市场行情状态： 该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 第 1 位：‘S’表示全市场启动期间（开市前），‘T’表示全市场处于交

				易期间（含中间休市），‘E’表示全市场处于闭市期间。 第2位：‘1’表示开盘集合竞价结束标志，未结束取‘0’。 第3位：‘1’表示市场行情结束标志，未结束取‘0’。 第4位：‘1’表示上海市场行情结束标志，未结束取‘0’。
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

文件文件体定义，多条记录。

行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号，当取值为 MD001 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MDStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD001 表示指数行情数据格式类型，其中指数目前实际精度为 4 位小数；
2	SecurityID	产品代码	C6	指数代码
3	Symbol	产品名称	C8	指数简称
4	TradeVolume	成交数量	N16	参与计算相应指数的交易数量，股票指数交易数量单位是 100 股，基金指数的交易数量单位是 100 份，债券指数的交易数量单位是手。
5	TotalValueTraded	成交金额	N16(2)	参与计算相应指数的成交金额，单位均为人民币元。
6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(4)	前收盘指数
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(4)	今开盘指数
8	HighPrice	最高价	N11(4)	最高指数
9	LowPrice	最低价	N11(4)	最低指数
10	TradePrice	最新价	N11(4)	最新指数

11	ClosePx	今收盘价	N11(4)	今收盘指数，无取值取空格
12	TradingPhaseCode	指数实时阶段及标志	C8	该字段为8位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填空格。 (预留)
13	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.000
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

行情数据类型取值标识字母 MD 加类型编号，当取值为 MD002、MD003、MD004 时，文件体记录格式如下：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	MStreamID	行情数据类型	C5	行情数据类型标识符，取值 MD002 表示股票（A、B 股）行情数据格式类型； MD003 表示债券行情数据格式类型； MD004 表示基金行情数据格式类型；
2	SecurityID	产品代码	C6	证券代码
3	Symbol	产品名称	C8	证券简称
4	TradeVolume	成交数量	N16	
5	TotalValueTraded	成交金额	N16(2)	
6	PreClosePx	昨日收盘价	N11(3)	
7	OpenPrice	今日开盘价	N11(3)	
8	HighPrice	最高价	N11(3)	
9	LowPrice	最低价	N11(3)	
10	TradePrice	最新价	N11(3)	最新成交价
11	ClosePx	今收盘价	N11(3)	
12	BuyPrice1	申买价一	N11(3)	当前买入价
13	BuyVolume1	申买量一	N12	

14	SellPrice1	申卖价一	N11 (3)	当前卖出价
15	SellVolume1	申卖量一	N12	
16	BuyPrice2	申买价二	N11 (3)	
17	BuyVolume2	申买量二	N12	
18	SellPrice2	申卖价二	N11 (3)	
19	SellVolume2	申卖量二	N12	
20	BuyPrice3	申买价三	N11 (3)	
21	BuyVolume3	申买量三	N12	
22	SellPrice3	申卖价三	N11 (3)	
23	SellVolume3	申卖量三	N12	
24	BuyPrice4	申买价四	N11 (3)	
25	BuyVolume4	申买量四	N12	
26	SellPrice4	申卖价四	N11 (3)	
27	SellVolume4	申卖量四	N12	
28	BuyPrice5	申买价五	N11 (3)	
29	BuyVolume5	申买量五	N12	
30	SellPrice5	申卖价五	N11 (3)	
31	SellVolume5	申卖量五	N12	
32	PreCloseIOPV	基金 T-1 日收盘时刻 IOPV	N11 (3)	可选字段，仅当 MDStreamID=MD004 时存在该字段。取前一日 nav 净值。
33	IOPV	基金 IOPV	N11 (3)	可选字段，仅当 MDStreamID=MD004 时存在该字段。
34	TradingPhaseCode	产品实时阶段及标志	C8	该字段为 8 位字符串，左起每位表示特定的含义，无定义则填充空格。 第 1 位：‘S’表示启动（开市前）时段，‘C’表示集合竞价时段，‘T’表示连续交易时段，‘B’表示休市时段，‘E’表示闭市时段，‘P’表示产

				<p>品停牌，‘M’表示可恢复交易的熔断时段（盘中集合竞价），‘N’表示不可恢复交易的熔断时段（暂停交易至闭市），‘D’表示开盘集合竞价阶段结束到连续竞价阶段开始之前的时段（如有）。</p> <p>第2位：‘0’表示此产品不可正常交易，‘1’表示此产品可正常交易，无意义填充格。</p> <p>第3位：‘0’表示未上市，‘1’表示已上市。</p> <p>第4位：‘0’表示此产品在当前时段不接受进行新订单申报，‘1’表示此产品在当前时段可接受进行新订单申报。无意义填充格。</p>
35	Timestamp	时间戳	C12	HH:MM:SS.000
		扩展区域	不定	系统应能支持记录尾部扩展新的字段。

说明：当日交易时段内，产品可能出现的状态包括：开盘集合竞价，连续交易，停牌，熔断（盘中集合竞价，暂停交易至闭市）。对于上述字段 34 (TradingPhaseCode)，其取值的第2位（是否可正常交易）在产品进入开盘集合竞价、连续交易、熔断（盘中集合竞价）状态时值为‘1’，在产品进入停牌、熔断（暂停交易至闭市）状态时值为‘0’，且闭市后保持该产品盘前的是否可正常交易状态。其取值的第4位（是否接受新订单申报），仅在交易时段有效，在非交易时段无效。

文件尾定义，最后一行特殊记录：

序号	域名	字段名	字段类型	描述
1	EndString	结束标识符	C7	TRAILER
2	CheckSum	校验和	C3	校验和，3位校验和 校验和是通过计算不包括校验和字段（也不包括该字段后的换行符）数值的文件中其他每一个字符（包含分隔符、换

				<p>行符)之和然后模 256 得出,然后转化为 3 位 ASCII 码。例如,如果经计算校验和为 274,则模 256 后的数为 18,校验和域将取为 ASCII 字符串 018</p> <p>校验和字段可用于开盘前和收盘后文件正确性校验。在实时交易期间,因文件按记录循环写入覆盖,校验和字段存在一定的概率与记录内容不匹配。</p>
--	--	--	--	---

2.2 产品非交易基础信息接口 fjyYYYYMMDD.txt

fjyYYYYMMDD.txt	产品非交易基础信息接口
描述: 本文件为与产品相关的非交易基础信息数据。文件名中 YYYYMMDD 表示年月日格式的文件适用日期，在交易日开市前通过单向卫星发送。（交易日内不更新）	

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
1	参考数据类型	技术实现固定值 竞价撮合平台非交易，该值固定填写为R0001 后续格式仅当参考数据类型字段为R0001 时对应格式类型 后续若加入其他平台非交易数据，则该字段有新的取值，对于不同的参考数据类型取值，后续字段格式则可能不一样。	C5
2	非交易证券代码	非交易证券代码，如无则为空	C6
3	非交易证券名称	非交易证券名称	C8
4	产品证券代码	产品证券代码，如无则为空	C6
5	产品证券名称	产品证券名称，如无则为空	C8
6	非交易业务类型	非交易业务类型： IN 上网证券发行申购 IS 老股东增发证券发行申购 PH IPO配号 KK IPO扣款 HK IPO还款	C2

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
		CV 可转债转股/可交换公司债换股	
		CR 可转债回售	
		R1 股票配股行权行权	
		R2 股票转配股配股行权	
		R3 职工股转配股配股行权	
		R4 股票配转债行权	
		OS 开放式基金认购	
		OC 开放式基金申购	
		OR 开放式基金赎回	
		OD 开放式基金分红选择	
		OT 开放式基金份额转出	
		OV 开放式基金转换	
		EC ETF申购	
		ER ETF赎回	
		EZ 申赎资金代码	
		VT 投票（自 2015 年 2 月 14 日新网络投票切 换上线后停用）	
		BD 回购入库	
		BW 回购出库	
		FS 要约预受	
		FC 要约撤销	
		ST 余券划转	
		SR 还券划转	
		CI 担保品划入	
		CO 担保品划出	

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
		SI 券源划入 SO 券源划出 PA 密码激活(注销) DT 指定登记 DC 指定撤销 QT 其它 当非交易类型为PA, DT, DC时, 除非交易证券代码外的其余字段无实际意义。	
7	非交易订单输入开始日期	订单输入开始日期。	C8 YYYYMMDD
8	非交易订单输入结束日期	订单输入结束日期。	C8 YYYYMMDD
9	非交易订单整手数	整手数。指订单的数量必须为该字段取值的整数倍。	N12
10	非交易订单最小订单数量	非交易订单的最小订单数量。指订单的数量必须比该字段取值大。	N12
11	非交易订单的最大订单数量	非交易订单的最大订单数量。指订单的数量必须比该字段取值小。	N12

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
12	非交易价格	当非交易业务类型为IN、IS时，为发行价格。 当非交易业务类型为PH、KK、HK时，为产品发行价格。 当非交易业务类型为FS、FC时，为要约预受和撤销的固定价格。 当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4时，为配股、配债价格。 当非交易业务类型为CR时，为回售价格。 当非交易业务类型为CV时，为转股/换股价格。 其他非交易业务，该字段默认填写为 1.00000，无实际意义。	N13(5)
13	IPO总量	当非交易业务类型为IN、IS时，发行总量。	N16
14	IPO分配方法	当非交易业务类型为IN、IS时，IPO分配方法。 L-摇号抽签 A-竞价分配 P-比例配售	C1
15	IPO竞价分配或比例配售日期	当非交易业务类型为IN、IS时，执行竞价分配或比例配售的日期。	C8 YYYYMMDD
16	IPO验资或配号日期	当非交易业务类型为IN、IS时，进行验资或配号的日期。	C8 YYYYMMDD
17	IPO摇号抽签的日期	当非交易业务类型为IN、IS时，进行摇号抽签的日期。	C8 YYYYMMDD
18	IPO申购价格区间下限	当非交易业务类型为IN、IS时，IPO申购价格区间的下限。	N11(3)

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
19	IPO申购价格区间上限	当非交易业务类型为IN、IS时，IPO申购价格区间的上限。	N11(3)
20	IPO比例配售比例	当非交易业务类型为IN、IS时，比例配售的比例。 最小值为 0.001；最大值为 100.000。	N11(3)
21	配股股权登记日	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股的股权登记日。	C8 YYYYMMDD
22	配股除权日	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股的除权日。	C8 YYYYMMDD
23	配股比例	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股比例。	N11(6)
24	配股总量	当非交易业务类型为R1、R2、R3、R4 时，配股总量。	N16
25	T-2 日基金收益/基金净值	当非交易业务类型为OC、OR时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-2 日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-2 日每百份基金净值；	N13(5)
26	T-1 日基金收益/基金净值	当非交易业务类型为OC、OR时，如果基金类型为货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-1 日每百万份基金收益；如果基金类型为非货币市场开放式基金申购赎回，该值为T-1 日每百份基金净值；	N13(5)

fjyYYYYMMDD.txt		产品非交易基础信息	
序号	字段名称	描述	类型
27	发行方式	当非交易业务类型为IN、IS且分配方法为L（摇号中签）时，发行方式。 001-按市值限额申购 002-增发资金申购 003-按资金申购	C3
28	备注	保留字段，用于扩展	C46