上证所信息网络有限公司
SSE INFONET LTD

上海证券交易所
LDDS 系统港股商业行情接口说明书

文档状态	[ ] 初稿 [ ] 评审通过 [ ] 修改 [√] 发布 [ ] 作废	**文档标识**	LDDS 系统接口说明书港股商业行情分册
		当前版本	1.0.7
		作　　者	行情业务部
		发 布 者	上证所信息网络有限公司
		完成日期	2026/10/28

文档变动说明

日期	版本	说明
2017-02-09	1.0.0	首次发布
2017-11-21	1.0.1	增加 UA2221 和 UA2215 消息的部分字段
2018-03-14	1.0.2	1. 对 UA2221 消息进行调整，如下： 1）修改 TestSecurityFlag 和 StrikePrice 字段的注释内容； 2）增加部分字段（序号为 31-36）； 2. 修改 UA2215 消息中 TradingSessionID 字段的注释内容； 3. 修改 UA2223 消息中 CurrencyCode 字段的注释内容； 4. 修改 UA2203 消息中 TradeType 字段的注释内容。
2020-10-15	1.0.3	1. 对 UA2221 消息进行调整，新增部分字段（序号为 37-39）； 2. 对 UA2215 消息进行调整，如下： 1） 修改 TradingSessionSubID 及 TradingSesStatus 字段的必要性及注释内容； 2） 修改 OrigTime、OrigDate 及 TradingSessionID 字段的必要性 3） 修改 UA2215 消息的描述说明，明确发送周期 3. 修改 UA2202 消息，根据价差完整发送十档行情的申买及申卖； 4. 将 UA2207 消息合并入 UA2206 消息中，并对 UA2206 消息进行调整，如下： 1） 将 UA2206 消息名称改为集合竞价消息，调整 UA2206 消息的描述，同时取消 UA2207 消息； 2） UA2206 消息新增 Price、VirtualAuctionQty 等字段（原属 UA2207 消息），并修改相应字段的必要性、FAST 操作符及注释内容； 3） 修改 CASReffPrice、CASLowerPrice 和 CASUpperPrice 字段的字段名及注释内容； 4） 修改 OrdImbDirection、OrdImbQty 字段的注释内容。 5. 修改 UA2203 消息中 Price 、AggregateQuantity 及 TradeCancelFlag 字段的必要性 6. 对 UA2213 消息进行调整： 1） 完善消息的描述说明； 2） 修改 IndexSource 字段的注释内容。 7. 修改 UA2205 消息中 VCMStartTime 及 VCMEndTime 字段的必要性
2021-05-26	1.0.4	1. 对 UA2221 消息进行调整： 1） 新增部分字段（序号为 40-43）； 2） 修改 PreviousClosingPrice 及 ProductType 字段的注释内容 2. 修改 UA2213 消息中 IndexValue 字段的注释内容
2024-04-30	1.0.5	1. 根据沪深港通交易信息披露规则，调整 UA2213 消息中沪/深港通剩余额度、北向交易总买入成交额、北向交易总卖出成交额、北向交易买卖总成交额的取值及描述； 2. 调整之前已上线版本的接口描述，包括新增 UA2221 中

		ProductType 的产品取值、UA2204 中碎股订单上限说明
2025-06-24	1.0.6	1. UA2221 消息中，新增 DomainStmtSecurityCode 字段 2. UA2203 消息中，TradeTime 字段的 FAST 操作符修改为 default
2026-10-28	1.0.7	1. 修改 UA2213 消息名称为沪/深港通交易信息，并调整相关字段描述 2. 增加产品类别 34，以及指数信息消息 UA3401

1. 引言

1.1 目的

为配合本所与香港联合交易所推出的沪港通业务，上证所信息网络有限公司拟在证券公司互联网云行情服务平台推出的港股十档商业行情。该港股行情是由我公司直连港交所领航星并再通过 LDDS 系统发布至平台，行情记录编码成 STEP 及 FAST 消息格式进行发布。

文档介绍了 LDDS 系统中港股商业行情数据的接入方式，详细说明了港股商业行情实时数据的数据格式，以方便信息商接收港股商业行情。

1.2 阅读对象

文档适用于信息商及其他接入方的开发人员和港股商业行情技术支持人员。

1.3 参考文档

表 1-1 参考文档表

文档名称	文档来源
《上海证券交易所低延时行情发布系统(LDDS)接口说明书》	上证所信息网络有限公司

2. 系统接入

接入方只要已接入上交所 LDDS 系统，并与我公司签约，要求通过上交所 LDDS 系统接收港股商业行情数据，我方将在 IDC 开通相应权限，接入方无须添加设备及更改配置，就可以在 VDE 中获得港股商业行情数据。

有关 LDDS 系统架构及接入可以参考《上海证券交易所低延时行情发布系统(LDDS)接口说明书》。

3. 数据定义

3.1 范围

港股商业行情数据仅包含实时数据。

3.2 内容

港股商业行情数据产品类别（tag10142）为 8 和 34，其中产品类别 8 有 **11** 个消息，分别是市场定义（UA2220）、证券定义（UA2221）、做市商信息（UA2222）、汇率信息（UA2223）、市场总览（UA2215）、快照信息（UA2202）、分笔信息（UA2203）、沪/深港通交易信息（UA2213）、碎股订单消息（UA2204）、市场波动调节消息（UA2205）、集合竞价消息（UA2206）；产品类别 34 有 1 个消息，为指数信息（UA3401）。

市场总览消息包括行情时间、行情日期、市场状态、市场总成交。

快照消息包括证券代码、最高价、最低价、最新价、按盘价、收盘价、买一价、买一量、买二价、买二量、买三价、买三量、买四价、买四量、买五价、买五量、买六价、买六量、买七价、买七量、买八价、买八量、买九价、买九量、买十价、买十量、卖一价、卖一量、卖二价、卖二量、卖三价、卖三量、卖四价、卖四量、卖五价、卖五量、卖六价、卖六量、卖七价、卖七量、卖八价、卖八量、卖九价、卖九量、卖十价、卖十量、成交总量、成交总金额、证券状态。

碎股订单消息包括证券代码买卖盘的碎股订单编号、订单价格、订单量、经济人编号。

市场波动调节消息包括证券代码、VCM 起始时间、VCM 结束时间、VCM 参考价格、VCM 上下限价格。

集合竞价消息包括证券代码、参考价格、上下限价格、虚拟未匹配量、未匹配方向、虚拟开收盘参考价、虚拟匹配量。

3.3 数据格式

整体使用 STEP 协议封装。实时行情数据分为两类，其中市场定义、证券定义、做市商信息、汇率信息（原港交所领航星的静态数据）直接将数据内容嵌入 tag96 发布；其他实时消息以 FAST 编码的二进制数据，通过 tag96 嵌入 STEP 消息中。

4. 消息说明

港股商业行情只提供实时数据，不支持 Rebuild。

4.1 市场定义—UA2220

市场定义消息每 5 分钟发送一次全量。

表 4-1 市场定义 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType = UA2220
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	数据长度
96	RawData	Y	Data	数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-2 市场定义数据内容

序号	字段名	类型	说明
1	MarketCode	String	取值： MAIN GEM NASD ETS
2	MarketName	String	字母加数字
3	CurrencyCode	String	汇率代码
4	NumberOfSecurities	int	该市场的证券数量

注：数据内容以“|”分隔，每行记录以回车换行符分隔。

4.2 证券定义—UA2221

证券定义消息每 5 分钟发送一次全量。

表 4-3 证券定义 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType = UA2221
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	数据长度
96	RawData	Y	Data	数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-4 证券定义数据内容

序号	字段名	类型	说明
1	SecurityCode	String	证券代码
2	MarketCode	String	取值： MAIN GEM NASD ETS
3	ISINCode	String	ISIN 代码
4	InstrumentType	String	证券类型 BOND Bonds BWRT Basket Warrants EQTY Equities TRST Trusts WRNT Warrants & structured products (DW & CBBC)
5	SpreadTableCode	String	价差类别
6	SecurityShortName	String	简称
7	CurrencyCode	String	汇率代码
8	SecurityNameGCCS	String	繁体名称
9	SecurityNameGB	String	简体名称
10	LotSize	int	最小交易单位
11	PreviousClosingPrice	int	Previous closing price of the security; or Net asset value (NAV) published by issuer for ETF or L&I Product on the trading day before its first day listing 3 位小数 如 1000 表示 1.000

12	VCMFlag	String	**Y** VCM applicable **N** VCM not applicable
13	ShortSellFlag	String	Y 表示允许卖空 N 表示不允许卖空
14	CASFlag	String	**Y** CAS applicable **N** CAS not applicable
15	CCASSFlag	String	Y 表示 CCASS 证券 N 表示非 CCASS 证券
16	DummySecurityFlag	String	Y 表示虚拟股票 N 表示一般股票
17	TestSecurityFlag	String	无意义
18	StampDutyFlag	String	Y 需要缴纳印花税 N 无需缴纳印花税
19	ListingDate	String	上市日期 YYYYMMDD
20	DelistingDate	String	退市日期 YYYYMMDD
21	FreeText	String	备注
22	EFNFlag	String	债券外部融资标识
23	AccruedInterest	int	债券应计利息 3 位小数
24	CouponRate	int	债券票面息率 3 位小数
25	ConversionRatio	int	权证行权比例 3 位小数
26	StrikePrice	int	权证行权价格或下限价格 3 位小数
27	MaturityDate	String	权证到期日 YYYYMMDD
28	CallPutFlag	String	买空卖空标志 C-call P-put
29	Style	String	权证行权方式 A- 美式 E- 欧式
30	NoUnderlyingSecurities	int	权证标的数量
→	UnderlyingSecurityCode	String	权证标的
→	UnderlyingSecurityWeight	int	权证标的权重

31	ProductType	int	证券产品类型 Equity 1 Equity – Ordinary Shares 2 Equity – Preference Shares 6 Equity – Rights 7 Equity – Depository Receipt (HDR) – Ordinary Shares 12 Equity – Depository Receipt (HDR) – Preference Shares 24 Equity – SPAC Shares Warrant 3 Warrant – Derivative Warrant (DW) 11 Warrant – Callable Bull/Bear Contract (CBBC) 13 Warrant – Equity Warrant 14 Warrant – Equity Linked Instrument (ELI) 15 Warrant – Inline Warrant 21 Warrant – SPAC Warrants Bond 4 Bond – Debt Security Trust 8 Trust – Real Estate Investment Trust (REIT) 9 Trust – Other Unit Trusts 10 Trust – Leveraged and Inverse Product (LIP) 16 Trust – Equity ETF 17 Trust – Fixed Income and Money Market ETF 18 Trust – Commodities ETF 99 Others – None of the above
32	StrikePrice2	int	权证行权价格上限价格 3 位小数
33	WarrantType	String	权证类型 N Normal instrument X Exotic instrument “0” Not available
34	CallPrice	Double	Call price for CBBC
35	Entitlement	Double	Entitlement of the warrant
36	NoWarrantsPerEntitlement	int	Number of warrants per entitlement

37	POSFlag	String	Indicates whether Pre-Opening Session (POS) is applicable to the security Y POS applicable N POS not applicable
38	POSUpperLimit	int	开盘集合竞价时段买卖盘输入阶段的买卖盘上限价、开盘集合竞价时段不可撤销及随机对盘阶段的卖盘上限价 (Upper price limit of all orders in POS Order Input period, and At-auction Limit sell order in POS No Cancellation and Random Matching periods) 3位小数 如1000表示1.000 0 means Not available
39	POSLowerLimit	int	开盘集合竞价时段买卖盘输入阶段的买卖盘下限价、开盘集合竞价时段不可撤销及随机对盘阶段的买盘下限价 (Lower price limit of all orders in POS Order Input period, and At-auction Limit buy order in POS No Cancellation and Random Matching periods) 3位小数 如1000表示1.000 0 means Not available
40	FaceValue	Double	债券证券的面值 0 means Not available
41	FaceValueCurrency	String	债券面值货币代码
42	MaturityDate	int	债券证券的到期日YYYYMMDD
43	InvestorType	String	债券证券的投资者类型 R Retail Investor P Professional Investor
44	DomainStmtSecurityCode	String	Security code of the corresponding Domain Settlement Counter Value is “0” if the security itself is already the domain settlement counter

注：数据内容以“|”分隔，每行记录以回车换行符分隔。

4.3 做市商信息—UA2222

做市商信息每 5 分钟发送一次全量。

表 4-5 做市商信息 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释

	Standard Header	Y		MsgType = UA2222
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	数据长度
96	RawData	Y	Data	数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-6 做市商信息数据内容

序号	字段名	类型	说明
1	SecurityCode	String	证券代码
2	NoLiquidityProviders	int	做市商数量
→	LPBrokerNumber	int	做市商 ID

注：数据内容以“|”分隔，每行记录以回车换行符分隔。

4.4 汇率信息—UA2223

汇率信息每 5 分钟发送一次全量。

表 4-7 汇率信息 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2223
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	数据长度
96	RawData	Y	Data	数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-8 汇率信息数据内容

序号	字段名	类型	说明
1	CurrencyCode	String	汇率代码 ‘HKD’ – 港币, ‘USD’ – 美元, ‘EUR’ – 欧元, ‘JPY’ – 日元, ‘GBP’ – 英镑, ‘CAD’ – 加拿大元, ‘SGD’ – 新加坡元, ‘CNY’ – 人民币 ‘CNH’ – 离岸人民币
2	CurrencyFactor	int	汇率因子
3	CurrencyRate	int	汇率 4 位小数

注：数据内容以“|”分隔，每行记录以回车换行符分隔。

4.5 市场总览—UA2215

市场总览消息每 3 秒发送一次。若字段数据发生变化也会进行发送。

表 4-9 市场总览 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2215
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-10 市场总览 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2215
35	MessageType	Y	constant	String	UA2215
10178	DataTimeStamp	Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
10241	MarketCode	Y	none	String	市场代码 **MAIN** **GEM** **NASD** **ETS**
42	OrigTime	N	default	int	行情系统时间
10003	OrigDate	N	default	int	行情系统日期
10242	TradingSessionID	N	default	int	无意义

10243	TradingSessionSubID	N	default	int	市场子状态 0 = 全日收市 1 = 输入买卖盘(开盘集合竞价时段) 2 = 对盘(开盘集合竞价时段) 3 = 持续交易 4 = 对盘(收盘集合竞价时段) 5 = 输入买卖盘(收盘集合竞价时段) 7 = 暂停 100 = 未开市 101 = 不可取消 (开盘集合竞价时段) 102 = Exchange Intervention 103 = 收市 104 = 取消买卖盘 105 = 参考价定价(收盘集合竞价时段) 106 = 不可取消(收盘集合竞价时段) 107 = 随机收市(收盘集合竞价时段) 108 = 随机对盘(开盘集合竞价时段)
10244	TradingSesStatus	N	default	int	市场状态 0 Unknown (for NO) 10 Halted (for EI) 20 Pre-Open (for [POS] OI, NW, RM, MA, and BL) 30 Open (for CT and OC) 40 Pre-Close (for [CAS] RP, OI, NW, RC, MA) 50 Closed (for CL) 100 Day Closed (for DC)
10245	TradingSesControlFlag	Y	none	String	市场状态控制方式 0-自动 1-手动
10246	StartDateTime	Y	none	String	状态起始时间 YYYYMMDDHHMMSS
10247	EndDateTime	Y	none	String	状态结束时间 YYYYMMDDHHMMSS
8504	TurnOver	N	default	64-bit int	成交金额 3 decimal places

4.6 快照信息—UA2202

定时全量快照，全量周期 1 分钟。其中将根据价差发送完整的 10 档申买申卖，若无某档位数据则相应数量值为 0。

表 4-13 快照信息 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2202
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-14 快照信息 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2202
35	MessageType	Y	constant	String	UA2202
10178	DataTimeStamp	Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
48	SecurityID	Y	none	String	证券代码，5 位长度
10146	ImageStatus	Y	none	int	快照类型 1=全量 2=更新
332	HighPx	N	default	int	最高价 3 decimal places
333	LowPx	N	default	int	最低价 3 decimal places
31	LastPx	N	default	int	现价 3 decimal places
10204	ClosePx	N	default	int	收盘价 3 decimal places
10078	NorminalPx	N	default	int	按盘价,-1 表示该数值无效
10068	NoBidPriceLevel	N	none	int	

→ repeating group 1	***134***	***BidSize***	Y	none	64-bit int	申买量
→ repeating group 1	***132***	***BidPx***	Y	none	int	申买价 3 decimal places
→ repeating group 1	***10258***	***BidOrderNumbers***	Y	none	int	经纪人数量
10069	NoOfferPriceLevel		N	none	int	
→ repeating group 2	***135***	***OfferSize***	Y	none	64-bit int	申卖量
→ repeating group 2	***133***	***OfferPx***	Y	none	int	申卖价 3 decimal places
→ repeating group 2	***10259***	***OfferOrderNumbers***	Y	none	int	经纪人数量
10252	NoBidBrokerQueue		N	none	int	
→ repeating group 3	***10253***	***BidItem***	Y	none	int	经纪人 ID 或价差
→ repeating group 3	***10254***	***BidType***	Y	none	string	B 表示 BidItem 值为经纪人 ID S 表示 BidItem 值为价差
10255	NoOffBrokerQueue		N	none	int	
→ repeating group 4	***10256***	***OffItem***	Y	none	int	经纪人 ID 或价差
→ repeating group 4	***10257***	***OffType***	Y	none	string	B 表示 OffItem 值为经纪人 ID S 表示 OffItem 值为价差
10060	Yield		N	default	int	债券收益 3 decimal places
10248	ShortSellSharesTraded		N	default	int	抛空数量
10249	ShortSellTurnover		N	default	64-bit int	抛空金额 3 decimal places
387	TotalVolumeTrade		N	default	64-bit int	成交数量

8504	TotalValueTrade	N	default	64-bit int	成交金额 3 decimal places
10131	TradingStatus	N	default	int	**2** Trading Halt **3** Resume

4.7 分笔信息—UA2203

表 4-15 分笔信息 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2203
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-16 分笔信息 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2203
35	MessageType	Y	constant	String	UA2203
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
10011	TickId	Y	increment	int	成交序号
48	SecurityID	Y	none	String	证券代码，5 位长度
10014	Price	N	default	int	成交价格 3 decimal places
10015	AggregateQuantity	N	default	64-bit int	成交量
10013	TradeTime	N	default	int	成交时间 格式为 HHMMSS

10260	TradeType	N	default	int	成交类型 **0** Automatch normal (Public Trade Type <space>) **4** Late Trade (Off-exchange previous day) (Public Trade Type “P”) **22** Non-direct Off-Exchange Trade (Public Trade Type “M”) **100** Automatch internalized (Public Trade Type “Y”) **101** Direct off-exchange Trade (Public Trade Type “X”) **102** Odd-Lot Trade (Public Trade Type “D”) **103** Auction Trade (Public Trade Type “U”)
10261	TradeCancelFlag	N	default	string	是否取消： **Y** Cancelled **N** Not cancelled

4.8 沪/深港通交易信息—UA2213

沪/深港通交易信息只发送全量数据，全量周期 1 分钟。

沪/深港通交易信息仅包含两支代码：CSCSHQ（上海）及 CSCSZQ（深圳），其“IndexSource”字段都为“C”，其“IndexVolume”字段表示沪/深港通的剩余额度、“LowValue”字段表示沪/深港通北向交易总买入成交额、“EASValue”字段表示沪/深港通南向交易总买入成交额、“IndexTurnover”字段表示沪/深港通北向交易总卖出成交额、“OpeningValue”字段表示沪/深港通南向交易总卖出成交额、“ClosingValue”字段表示沪/深港通北向交易买卖总成交额、“PreviousSesClose”字段表示沪/深港通南向交易买卖总成交额。（注：北向单位为 RMB、南向单位为 HKD）

表 4-17 沪/深港通交易信息 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2213

10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-18 沪/深港通交易信息 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2213
35	MessageType	Y	constant	String	UA2213
10178	DataTimeStamp	Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
48	SecurityID	Y	none	String	证券代码 仅包含 CSCSHQ（上海）及 CSCSZQ（深圳）两个代码
10268	IndexSource	N	none	String	取值为 C
10262	CurrencyCode	N	none	String	默认为 CNY
10263	IndexStatus	N	none	String	状态标识： **C** Closing value **I** Indicative **O** Opening index **P** Last close value (prev. ses.) **R** Preliminary close **S** Stop loss index **T** Real-time index value
10264	IndexTime	N	copy	int	额度发布时间 格式为 HHMMSS
10008	IndexValue	N	default	64-bit int	无意义
10265	NetChgPreDay	N	default	64-bit int	无意义
10009	HighValue	N	default	64-bit int	无意义
10010	LowValue	N	default	64-bit int	沪/深港通北向交易总买入成交额，盘中不发布 4 decimal places
10266	EASValue	N	default	64-bit int	沪/深港通南向交易总买入成交额，盘中不发布 2 decimal places

10118	IndexTurnover	N	default	64-bit int	沪/深港通北向交易总卖出成交额，盘中不发布 4 decimal places
10006	OpeningValue	N	default	64-bit int	沪/深港通南向交易总卖出成交额，盘中不发布 4 decimal places
10205	ClosingValue	N	default	64-bit int	沪/深港通北向交易买卖总成交额，盘中不发布 4 decimal places
10007	PreviousSesClose	N	default	64-bit int	沪/深港通南向交易买卖总成交额，盘中不发布 4 decimal places
387	IndexVolume	N	default	64-bit int	沪/深港通的剩余额度，取值如下： 1.当日剩余额度大于或等于每日初始额度的 30%时，不揭示具体数值，取值为负值，表示额度充足； 2.当日剩余额度小于每日初始额度的 30%时，取值为实际剩余额度，直到交易结束。
10267	NetChgPreDayPct	N	default	int	无意义

4.9 碎股订单消息—UA2204

如有发送全量数据，如无变化也会定时发送全量数据，全量周期 1 分钟，如无数据则不发送。

表 4-19 碎股订单 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2204
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-20 碎股订单 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2204
35	MessageType	Y	constant	String	UA2204

10178	DataTimeStamp		Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus		N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
48	SecurityID		Y	none	String	证券代码
10279	NoOddLotOder		N	none	int	单支证券的碎股订单上限为 4500，超过则仅保留最新的 4500 个碎股订单
→ repeating group 1	***10280***	***OrderId***	Y	none	64-bit int	订单编号
→ repeating group 1	***44***	***Price***	Y	none	int	价格 3 decimal places
→ repeating group 1	***38***	***OrderQty***	Y	none	64-bit int	量
→ repeating group 1	***10281***	***BrokerID***	Y	none	int	经纪人编号
→ repeating group 1	***10282***	***Side***	Y	none	int	买卖方向 0 Bid 1 Offer

4.10 市场波动调节消息—UA2205

如有市场波动调节消息发送全量数据，如无变化也会定时发送全量数据，全量周期 1 分钟，如无数据则不发送。

表 4-21 市场波动调节 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2205
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-22 市场波动调节 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释

999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2205
35	MessageType	Y	constant	String	UA2205
10178	DataTimeStamp	Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
48	SecurityID	Y	none	String	证券代码
10269	VCMStartTime	N	default	int	市场调节机制起始时间 143025 表示 14:30:25
10270	VCMEndTime	N	default	int	市场调节机制结束时间 143025 表示 14:30:25
10271	VCMReffPrice	N	default	int	市场调节机制参考价 3 decimal places
10272	VCMLowerPrice	N	default	int	市场调节下限价 3 decimal places
10273	VCMUpperPrice	N	default	int	市场调节上限价 3 decimal places

4.11 集合竞价消息—UA2206

UA2206 消息包含开盘集合竞价消息及收盘集合竞价消息，只会在开盘集合竞价及收盘集合竞价阶段进行发送。如有集合竞价消息则发送全量数据，如无变化也会定时发送全量数据，全量周期 1 分钟。

表 4-23 集合竞价 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA2206
10142	CategoryID	Y	int	8
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-24 集合竞价 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=2206
35	MessageType	Y	constant	String	UA2206

10178	DataTimeStamp	Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
48	SecurityID	Y	none	String	证券代码
10274	ReffPrice	N	default	int	Reference price of the security for order input in POS and CAS. Value is 0 if the reference price is not available. 3 decimal places
10275	LowerPrice	N	default	int	开盘集合竞价时段不可撤销及随机对盘阶段的卖盘下限价、收盘集合竞价时段的买卖盘下限价 (Lower price limit of at-auction Limit sell order in POS No Cancellation and Random Matching periods. Lower price of the allowed price band for order input in CAS.) 0 means N/A 3 decimal places
10276	UpperPrice	N	default	int	开盘集合竞价时段不可撤销及随机对盘阶段的买盘上限价、收盘集合竞价时段的买卖盘上限价 (Upper price limit of at-auction Limit buy order in POS No Cancellation and Random Matching periods. Upper price of the allowed price band for order input in CAS.) 0 means N/A 3 decimal places

10277	OrdImbDirection	N	none	String	CAS、POS 阶段未能配对买卖盘的方向 N = 买卖盘量相等 B = 买盘比卖盘多 S = 卖盘比买盘多 <空格> = 不适用(未有参考平衡价格)
10278	OrdImbQty	N	default	64-bit int	CAS、POS 阶段未能配对买卖盘的数量
44	Price	N	none	int	虚拟开盘参考价/虚拟收盘参考价（元）（根据所处集合竞价阶段） 3 decimal places
10127	VirtualAuctionQty	N	none	64-bit int	虚拟匹配量（根据所处集合竞价阶段）

4.12 指数信息—UA3401

指数信息只发送全量数据，如无变化也会定时发送全量数据，全量周期 1 分钟。

表 4-25 指数信息 STEP 消息

标记	域名称	必须	类型	注释
	Standard Header	Y		MsgType=UA3401
10142	CategoryID	Y	int	34
10072	MsgSeqID	Y	int	消息序号
95	RawDataLength	Y	Length	FAST 数据长度
96	RawData	Y	Data	FAST 数据
	Standard Trailer	Y		

表 4-26 指数信息 FAST 消息

标记	域名称	必须	FAST 操作符	类型	注释
999	TemplateID	Y	copy	int	模板标识号=3401
35	MessageType	Y	constant	String	UA3401
10178	DataTimeStamp	Y	copy	int	时间戳（行情发送时间） 143025 表示 14:30:25
10121	DataStatus	N	default	int	1=重复数据（无需处理和展示，只要检查序号是否连续） 2=未获授权（删除）
48	SecurityID	Y	none	String	指数代码 00000 为特殊代码揭示指数数量

10268	IndexSource	N	none	String	指数来源 C CSI or other source of market information H HSI
10262	CurrencyCode	N	none	String	汇率代码
10263	IndexStatus	N	none	String	指数状态： **C** Closing value **I** Indicative **O** Opening index **P** Last close value (prev. ses.) **R** Preliminary close **S** Stop loss index **T** Real-time index value
10264	IndexTime	N	copy	int	指数发布时间 格式为 HHMMSS
10008	IndexValue	N	default	64-bit int	指数 当指数代码为**“00000”**时，揭示当日发送的指数个数 4 decimal places
10265	NetChgPreDay	N	default	64-bit int	指数变化（与昨日收盘指数相比） 4 decimal places
10009	HighValue	N	default	64-bit int	最高指数 4 decimal places
10010	LowValue	N	default	64-bit int	最低指数 4 decimal places
10266	EASValue	N	default	64-bit int	均值 2 decimal places
10118	IndexTurnover	N	default	64-bit int	成交额 4 decimal places
10006	OpeningValue	N	default	64-bit int	开盘指数 4 decimal places
10205	ClosingValue	N	default	64-bit int	收盘指数 4 decimal places
10007	PreviousSesClose	N	default	64-bit int	前收盘指数 (previous day’s closing value for CSI and S&P, previous session for HSI) 4 decimal places
387	IndexVolume	N	default	64-bit int	成交量

10267	NetChgPreDayPct	N	default	int	指数变化率（与昨日收盘指数相比） 4 decimal places