

上海证券交易所 Level-2 产品说明书

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	Level-2 产品说明书
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	2.0.0
	<input type="checkbox"/> 修改	作 者	市场数据部
	<input checked="" type="checkbox"/> 发布	发 布 者	上证所信息网络有限公司
	<input type="checkbox"/> 作废	完成日期	2022/03/15

文档变动说明

日期	版本	说明
2017-05-26	1.0.0	首次发布
2019-02-19	1.1.0	1. 更新静态数据内容表 2. 新增盘后固定价格交易行情数据和盘后固定价格交易逐笔成交数据
2020-12-16	1.1.1	更新静态数据内容表
2022-03-15	2.0.0	1. 补充产品概述 2. 补充逐笔委托数据 3. 完善数据接口

1. 产品概述

上交所 Level-2 行情为上证所信息网络有限公司推出的增值行情，以更好地满足机构投资者和专业投资者对行情信息的差异化需求。上交所 Level-2 行情采用基于 STEP/FAST 协议的接口，可通过上证云和运营商专线进行传输接收。

作为增值行情，上交所 Level-2 行情具有以下特点：

1. 更丰富的信息：更多的盘口订单数据、逐笔成交数据、逐笔委托数据、成交与订单关联数据及增值数据，揭示交易细节，全方位反映市场状态；
2. 更丰富的盘口信息：提供买卖双方 10 个价位的价格、股数和委托笔数信息，同时提供第一档位的前 50 笔订单的委托量，揭示买卖双方行为细节；
3. 更好的低延时技术：采用国际一流的 FAST 协议，毫秒级时延的技术系统让数据更迅速直达用户；
4. 更高的服务质量保障：提供重发机制，确保数据可靠、准确，不丢失任何一笔数据。

2. 产品内容

2.1 静态数据

静态数据主要包括产品基础信息文件、非交易基础信息文件、竞价行情文件以及债券行情文件等。详细的内容可参见《上海证券交易所 LDDS 系统静态数据接口说明书》。

2.2 实时数据

2.2.1 快照类数据

2.2.1.1 竞价行情数据

竞价行情数据包括证券代码、昨收盘价格、开盘价格、最高价格、最低价格、最新价格、收盘价格、成交笔数、成交量、成交金额、委托买入总量、加权平均委买价格、委托卖出总量、加权平均委卖价格、ETF 净值估值、ETF 申购笔数、ETF 申购数量、ETF 申购金额、ETF 赎回笔数、ETF 赎回数量、ETF 赎回金额、买入撤单笔数、买入撤单数量、买入撤单金额、卖出撤单笔数、卖出撤单数量、卖出撤单金额、买入总笔数、卖出总笔数、买入委托成交最大等待时间、卖出委托成交最大等待时间、买卖 10 档价格和数量、最优价位上前 50 笔委托队列。

2.2.1.2 债券行情数据

债券行情数据包括证券代码、昨收盘价格、开盘价格、最高价格、最低价格、最新价格、收盘价格、成交笔数、成交量、成交金额、委托买入总量、债券加权平均委买价格、委托卖出总量、债券加权平均委卖价格、加权平均价、买入撤单笔数、买入撤单数量、买入撤单金额、卖出撤单笔数、卖出撤单数量、卖出撤单金额、买入总笔数、卖出总笔数、买入委托成交最大等待时间、卖出委托成交最大等待时间、买卖 10 档价格和数量、最优价位上前 50 笔委托队列。

2.2.1.3 指数行情数据

指数快照数据包括指数代码、昨收盘指数、今开盘指数、最高指数、最低指数、最新指数、收盘指数、成交量、成交金额以及指数计算时间。

2.2.1.4 盘后固定价格交易行情数据

盘后固定价格交易行情数据包括证券代码、今收盘价格、成交笔数、成交量、

成交金额、委托买入总量、买入撤单笔数、买入撤单数量、买入撤单金额、卖出撤单笔数、卖出撤单数量、卖出撤单金额、买入/卖出 1 档数量、买入/卖出档位上前 50 笔委托队列。

2.2.2 逐笔类数据

2.2.2.1 逐笔成交数据

逐笔成交数据包括证券代码、成交时间、成交价格、成交数量、成交金额、成交序号、成交通道、买方订单号、卖方订单号以及内外盘标志。

2.2.2.2 逐笔委托数据

逐笔委托数据包括证券代码、委托时间、委托价格、委托数量、委托序号、委托通道、原始订单号以及内外盘标志。

2.2.2.3 盘后固定价格交易逐笔成交数据

盘后固定价格交易逐笔成交数据包括证券代码、成交时间、成交价格、成交数量、成交金额、成交序号、成交通道、买方订单号、卖方订单号以及内外盘标志。

2.3 数据接口

静态数据为文件格式，实时数据为 FAST 流行情格式，具体见表 2-1 所示。

表 2-1 Level-2 行情数据接口参考表

产品类别	数据格式	参考文档
上交所静态数据	静态文件	《上海证券交易所 LDDS 系统静态数据接口说明书》
上交所竞价 Level-2 实时数据 (包括股票、基金和债券分销)	实时 FAST 流	《上海证券交易所 LDDS 系统竞价 Level-2 行情接口说明书》
上交所债券	实时 FAST 流	《上海证券交易所 LDDS 系统债券 Level-2 行情接口

Level-2 实时数据		说明书》
--------------	--	------