

# 上海证券交易所 Level-1 产品说明书

---

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	Level-1 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
2020-12-16	1.0.1	更新静态数据内容表
2022-03-15	2.0.0	1. 补充产品概述 2. 完善数据接口

## 1. 产品概述

上交所 Level-1 行情是根据《上海证券交易所交易规则》规定，通过 LDDS 系统发布的基本行情。上交所 Level-1 行情主要提供股票、债券、基金和指数等业务品种的行情信息。

上交所 Level-1 行情可通过上证云、运营商专线或者互联网进行传输接收。

上交所 Level-1 行情数据格式包括三种格式——文件行情、Binary 流行情和 FAST 流行情。

## 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 集合竞价数据

集合竞价期间提供证券代码、证券简称、前收盘价格、虚拟开盘价、虚拟匹配量、虚拟未匹配量和虚拟未匹配量的剩余方向等。

#### 2.2.2 证券快照数据

证券快照数据包括证券代码、证券简称、前收盘价格、最新成交价格、当日

最高成交价格、当日最低成交价格、当日累计成交量、当日累计成交金额、实时最高五个买入申报价格和数量、实时最低五个卖出申报价格和数量等。

### 2.2.3 指数快照数据

指数快照数据包括证券代码、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、成交量、成交金额以及成交时间等。

## 2.3 数据接口

静态数据为文件格式，实时数据支持文件行情、Binary 流行情和 FAST 流行情三种格式，具体见表 2-1 所示。

表 2-1 Level-1 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-1 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 Level-1 FAST 行情接口说明书》
	实时 Binary 流	《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》
	实时文件 mkttdt00.txt	《IS101_上海证券交易所竞价撮合平台市场参与者接口规格说明书》
上交所债券 Level-1 实时数据	实时 FAST 流	《上海证券交易所 LDDS 系统 Level-1 FAST 行情接口说明书》
	实时 Binary 流	《IS120_上海证券交易所行情网关 BINARY 数据接口规范》
	实时文件 mkttdt02.txt	《IS124 上海证券交易所市场数据文件交换接口规格说明书》