

上海证券交易所 历史数据产品说明书

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	历史数据产品说明书
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	2.0.0
	<input type="checkbox"/> 修改	作者	行情业务部
	<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	2025/06/12

文档变动说明

日期	版本	说明
2020-02-19	1.0.0	首次发布
2025-06-12	2.0.0	根据最新产品内容进行更新

1. 产品概述

行情历史数据产品为上证所信息网络有限公司以特定格式提供的与证券行情相关的历史数据服务，具有数据内容丰富、可靠性高的特点。

从行情品种来看，包括 Level-1 行情、Level-2 行情及股票期权历史数据。从数据内容来看，包括快照类数据、逐笔类数据及 K 线数据，其中快照类数据包括开盘集合竞价数据、行情快照数据、盘后固定价格交易行情快照；逐笔类数据包括竞价逐笔数据、债券逐笔数据、盘后固定价格交易逐笔成交数据；K 线数据包括分钟 K 线和日 K 线数据。

2. 产品内容

不同行情品种提供的历史数据种类有所差异，具体见表 2-1 所示。

表 2-1 行情品种和数据种类对照表

品种	快照类数据	逐笔类数据	日 K 线	分钟 K 线
Level-1 行情	√		√	√
Level-2 行情	√	√	√	√
股票期权行情	√		√	√

2.1 Level-1 行情历史数据

Level-1 行情历史数据提供快照类数据和 K 线数据。其中，快照类数据包括行情快照和盘后固定价格交易行情快照；K 线数据包括日 K 线和分钟 K 线两种。

行情快照数据包括证券代码、日期时间、昨收价、开始价、最高价、最低价、最新价、成交量、成交金额、申买五价、申买五量、申卖五价、申卖五量、成交笔数、ETF 净值估值（IOPV）、ETF 净资产价值（NAV）、交易时段、均价、收盘价、消息序号和发送时间等。

盘后固定价格交易行情快照数据包括证券代码、日期时间、成交数量、成交金额、今日收盘价、买入申报数量、卖出申报数量、产品实时阶段及标志、最新

成交时间戳等。

K 线数据包括证券代码、日期时间、昨收价、开始价、最高价、最低价、收盘价、成交量、成交金额、ETF 净值估值（IOPV）、盘后固定价格交易成交量、盘后固定价格交易成交金额、均价、K 线数量、交易日等。

2.2 Level-2 行情历史数据

Level-2 行情历史数据提供快照类数据、逐笔类数据和 K 线数据。其中，快照类数据包括行情快照和盘后固定价格交易行情快照；逐笔类数据包括竞价逐笔数据、债券逐笔数据、盘后固定价格交易逐笔成交数据；K 线数据包括日 K 线和分钟 K 线两种。

行情快照数据包括证券代码、日期时间、昨收价、开始价、最高价、最低价、最新价、成交总量、成交总金额、交易状态、申买十价、申买十量、申买十实际总委托笔数、申买一前 50 笔订单、申卖十价、申卖十量、申卖十实际总委托笔数、申卖一前 50 笔订单、成交笔数、ETF 净值估值（IOPV）、委托买入总量、委托卖出总量、加权平均委买价格、加权平均委卖价格、买入总笔数、卖出总笔数、买入成交最大等待时间、卖出成交最大等待时间、买方委托价位数、卖方委托价位数、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、均价、收盘价、消息序号、发送时间、债券质押式回购品种加权均价、产品实时阶段、快照类型等。

盘后固定价格交易行情快照数据包括证券代码、日期时间、收盘价、交易状态、成交笔数、成交总量、成交总金额、委托买入总量、委托卖出总量、买入撤单笔数、买入撤单数量、卖出撤单笔数、卖出撤单数量、申买量、申买实际总委托数、申买前 50 笔订单、申卖量、申卖实际总委托数、申卖前 50 笔订单等。

竞价逐笔数据包括证券代码、订单或成交时间、类型、买方订单、卖方订单、价格、数量、成交金额、买卖标志、逐笔序号、通道代码、发送时间等。

债券逐笔数据包括证券代码、订单或成交时间、类型、买方订单、卖方订单、价格、数量、成交金额、买卖标志、逐笔序号、通道代码、发送时间等。

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

等。

K 线数据包括证券代码、日期时间、昨收价、开始价、最高价、最低价、收盘价、成交量、成交金额、ETF 净值估值（IOPV）、盘后固定价格交易成交量、盘后固定价格交易成交金额等。

2.3 股票期权行情历史数据

股票期权历史数据提供快照类数据和 K 线数据。其中，快照类数据为行情快照；K 线数据包括日 K 线和分钟 K 线两种。

行情快照数据包括证券代码、日期时间、昨日收盘价、开始价、最高价、最低价、最新价、总持仓量、当日累计成交数量、当日累计成交金额、申买五价、申买五量、申卖五价、申卖五量、交易时段、均价、昨日结算价、今日结算价等。

K 线数据包括证券代码、日期时间、昨收价、开始价、最高价、最低价、收盘价、成交量、成交金额、持仓量、均价、昨日结算价、今日结算价等。