



## Level-2系列产品说明书

文档状态	<input checked="" type="checkbox"/> 初稿	文档标识	PROJ-Level-2-SSEInfonet-Vendor-product
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	2
	<input type="checkbox"/> 修改	作 者	Level2 项目组
	<input 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	2006-6-19

### 概要说明：

本文档定义了Level-2系列所提供的数据的内容，供Vendor参考。

### 文档修改说明：

V2.0 行情从5档增加为10档、增加了最有可能成交的委托明细  
增加了币种说明、增加了虚拟集合竞价说明

Level 2 产品内容

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
指数										
	指数总览		开盘前数据		指数代码、指数名称、前收盘指数					
	指数总览		盘中	同Show2003, 证券代码、当前时间、最新A股指数、最新B股指数、日期、结束标志、最新上证	指数代码、今开盘指数、参与计算相应指数的成交金额、最高指数、最低指数、最新指数、参与计算相应指数的交易数量	动态/刷新频率与show2003相同				
	分类指数		盘中		指数代码、今开盘指数、参与计算相应指数的成交金额、最高指数、最低指数、最新指数、参与计算相应指数的交易数量	动态/刷新频率与show2003相同				
股票（A、B股）、基金、权证										
	股票		开盘前数据		股票代码	每天一次/静态				
					股票中文简称	每日一次/静态				上海石化
					前收盘价格	每日一次/静态		上一交易日的收盘价		
					品种类型	每日一次/静态		交易品种类型		股票、基金、债券等
					所属行业代码	每日一次/静态				
					行业中文名称	每日一次/静态		各行业的中文名称		金融、房地产等
					流通股本	每日一次/静态		上市公司发行的可以交易的股本数量		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					总股本	每日一次/ 静态		上市公司发行的总股本数		
			集合竞价		股票代码	每日一次				
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/ 动态		指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003 中为在当前买入价（申买价一）以及当前卖出价中同时发布	
					虚拟匹配量	6秒左右/ 动态		指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003 中为在申买量一以及申卖量一中同时发布	
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/ 动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003 中为在申买量二中发布	
					卖方虚拟未匹配量	6秒左右/ 动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的卖方剩余申报数量	Show2003 中为在申卖量二中发布	
			盘中	逐笔成交数据（3秒钟发送一次，不含帐户及券商信息）	股票代码	3秒/ 动态				
					成交序列号	3秒/ 动态		各股票成交的序列编号		1,2,3...

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					成交时间	3秒/动态				
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格		
					成交数量	3秒/动态		各笔成交的数量		
					成交金额	3秒/动态计算	成交金额=成交价格*成交数量	各笔成交的金额		
			盘中快照	3秒钟发送一次的时点（快照）数据	股票代码	3秒/动态				
					今开盘价格	3秒/动态		当日开盘价格		
					最高价	3秒/动态		开盘至行情发布时的最高成交价格		
					最低价	3秒/动态		开盘至行情发布时的最低成交价格		
					最新价	3秒/动态		最后一笔成交价		
					申买量一至十	3秒/动态		买一至买十个最好买价上的委托数量		
					申买价一至十	3秒/动态		买一至买十个最好委托买入价格		
					申卖量一至十	3秒/动态		卖一至卖十个最好卖价上的委托数量		
					申卖价一至十	3秒/动态		卖一至卖十个最好委托卖价		
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					成交笔数	3秒/动态		各股票总成交笔数		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ 每笔成交数量			
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ 每笔成交数量×成交价格			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ 各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委托价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量=Σ 各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格=（Σ（各委托价位上的委托量×委托价格））/委托卖出总量	以委托量为权重的平均委托卖出价格		
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		
				委托排名——委托买入数量最多的前十只证券	排名序号（1至10）	3秒/动态				
					时间戳	3秒/动态				
					股票代码	3秒/动态				
					委买/委卖标志	3秒/动态		委买/委卖标志		
					委托总量	3秒/动态		委托买入/卖出总量		
					已成交总量	3秒/动态排名		已成交的数量		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					成交金额	3秒/动态	成交金额=Σ成交数量*成交价格	成交金额		
					行业排名	排名序号	3秒/动态			
						时间戳	3秒/动态			
						行业代码	3秒/动态			
						行业成交金额	3秒/动态计算	行业成交金额=Σ行业内各股票成交金额	行业内所有股票的成交总额	
						股票总成交金额	3秒/动态		整个市场成交总额	
						占总成交金额比重	3秒/动态	行业成交比重=行业成交金额/市场总成交金额	各行业成交额占总成交金额的比重	
				各行业成交金额前五位的个股	排名序号（1至5）	3秒/动态				
					时间戳	3秒/动态				
					行业代码	3秒/动态				
					股票代码	3秒/动态				
					成交金额	3秒/动态计算排名	成交金额=Σ成交数量*成交价格	股票的成交金额		
				单笔委托数量最大的10笔买/卖撤单	排名序号（1至10）	3秒/动态				
					时间戳	3秒/动态				
					委买/委卖	3秒/动态	注：用于统计的撤单指完全没有成交（不包含部分成交情况）、撤消数量与委托数量一致的撤单行为	分委托买入、委托卖出两个方向统计		
					股票代码	3秒/动态				
					委托时间	3秒/动态				
					委托数量	3秒/动态比较				
					委托价格	3秒/动态				

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
				撤消买入/卖出委托累计数量最多的前10只股票	排名序号（1至10）	3秒/动态				
					时间戳	3秒/动态				
					委买/委卖	3秒/动态				
					股票代码	3秒/动态				
					撤消委托累计数量	3秒/动态计算排名	撤消委托累计数量=Σ撤消委托数量			
	基金	封闭式基金	开盘前数据		基金代码	每日一次/静态				
					基金中文简称	每日一次/静态				
					前收盘价格	每日一次/静态				
					产品类型	每日一次/静态				
			集合竞价		基金代码	每日一次				
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/动态		指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003中为在当前买入价以及当前卖出价中同时发布	
					虚拟匹配量	6秒左右/动态		指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003中为在申买量一以及申卖量一中同时发布	

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003中为在申买量二中发布	
					卖方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的卖方剩余申报数量	Show2003中为在申卖量二中发布	
			盘中	逐笔成交数据（3秒钟发送一次，不含帐户及券商信息）	基金代码	3秒/动态				
					成交序列号	3秒/动态				
					成交时间	3秒/动态				
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格		
					成交数量	3秒/动态		各笔成交的数量		
					成交金额	3秒/动态计算	成交金额=成交价格*成交数量	各笔成交的金额		
				3秒钟发送一次的时点（快照）数据	基金代码	3秒/动态				
					今开盘价格	3秒/动态				
					最高价	3秒/动态				
					最低价	3秒/动态				
					最新价	3秒/动态		最后一笔成交价		
					申买量一至十	3秒/动态		买一至买十个最好买价上的委托数量		
					申买价一至十	3秒/动态		买一至买十个最好委托买入价格		



数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					申卖量一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好卖价上的委托数量		
					申卖价一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好委托卖价		
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					成交笔数	3秒/动态		各基金总成交笔数		
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ每笔成交数量			
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ每笔成交数量×成交价格			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委托买价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量=Σ各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格=（Σ（各委托卖价位上的委托量×委托价格））/委托卖出总量	以委托量为权重的平均委托卖出价格		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		
		ETF	开盘前数据		基金代码	每日一次/静态				
					基金中文简称	每日一次/静态				
					前收盘价格	每日一次/静态				
					产品类型	每日一次/静态				
			集合竞价		基金代码	每日一次				
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/动态		指特定时刻的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003 中为在当前买入价以及当前卖出价中同时发布	
					虚拟匹配量	6秒左右/动态		指特定时刻按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003 中为在申报量一以及申报量一中同时发布	
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时刻不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003 中为在申报量二中发布	



数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					成交笔数	3秒/动态		各ETF总成交笔数		
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ每笔成交数量			
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ每笔成交数量×成交价格			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委买价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量=Σ各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格=（Σ（各委卖价位上的委托量×委托价格））/委托卖出总量	以委托量为权重的平均委托卖出价格		
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
				5秒钟发送一次的时点（快照）数据	IOPV 净值估值	3秒/动态				
	权证		开盘前数据		权证代码	每日一次/静态				
					权证中文简称	每日一次/静态				
					基础证券名称	每日一次/静态		行权时可以买入或卖出的基础股票的名称		
					基础证券价格	每日一次/静态		基础股票的价格		
					行权比例	每日一次/静态		每一权证可以认购或认沽的股票数量		1:10
					认购/认沽标志	每日一次/静态		购买/出售标志		
					行权时间	每日一次/静态		权证可以购买/出售基础股票的时间		
					美式/欧式	每日一次/静态		权证类型，美式权证可以在一段时间内行权，欧式权证只能在特定日期行权		
			集合竞价		权证代码	每日一次				
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/动态		指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003中为在当前买入价以及当前卖出价中同时发布	

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					虚拟匹配量	6秒左右/动态		指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003 中为在申买量一以及申卖量一中同时发布	
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003 中为在申买量二中发布	
					卖方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的卖方剩余申报数量	Show2003 中为在申卖量二中发布	
			盘中	逐笔成交数据（3秒钟发送一次，不含帐户及券商信息）	权证代码	3秒/动态				
					成交序列号	3秒/动态				
					成交时间	3秒/动态				
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格		
					成交数量	3秒/动态		各笔成交的数量		
					成交金额	3秒/动态计算	成交金额=成交价格*成交数量	各笔成交的金额		
				3秒钟发送一次的时点（快照）数据	权证代码	3秒/动态				
					今开盘价格	3秒/动态				
					最高价	3秒/动态				
					最低价	3秒/动态				
					最新价	3秒/动态		最后一笔成交价		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					申买量一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好买价上的委托数量		
					申买价一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好委托买入价格		
					申卖量一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好卖价上的委托数量		
					申卖价一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好委托卖价		
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					成交笔数	3秒/动态		各权证总成交笔数		
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ每笔成交数量			
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ每笔成交数量×成交价格			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委买价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量=Σ各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格 = ( $\Sigma$ ( 各委卖价位上的委托量 $\times$ 委托价格 ) ) / 委托卖出总量	以委托量为权重的平均委托卖出价格		
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		
固定收益										
	债券	普通债券	开盘前数据		债券代码	每日一次/静态				
					债券中文简称	每日一次/静态				
					票面利率	每日一次/静态		债券发行时所标明的票面利率		3.4%
					当年利率	每日一次/静态				
					到期日	每日一次/静态		固定收益品种到期并偿付本金及利息的日期		
					付息频率	每日一次/静态		一年中付息的次数		1， 2
					付息日	每日一次/静态		发放利息的具体日期		
					面值	每日一次/静态				
					起息日	每日一次/静态		开始计算利息的日子		
					发行价	每日一次/静态		债券发行价格		
					剩余时间	每日一次/静态		当日至债券到期日间所剩余的时间		
					集合竞价		债券代码	每日一次		



数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/动态		指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003中为在当前买入价以及当前卖出价中同时发布	
					虚拟匹配量	6秒左右/动态		指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003中为在申买量一以及申卖量一中同时发布	
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003中为在申买量二中发布	
					卖方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的卖方剩余申报数量	Show2003中为在申卖量二中发布	
			盘中数据	逐笔成交数据（3秒钟发送一次，不含帐户及券商信息）	债券代码	3秒/动态				
					成交序列号	3秒/动态				
					成交时间	3秒/动态				
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格		
					成交数量	3秒/动态		各笔成交的数量		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
				3秒钟发送一次的时点（快照）数据	成交金额	3秒/动态计算	成交金额=成交价格*成交数量	各笔成交的金额		
					债券代码	3秒/动态				
					今开盘价格	3秒/动态				
					最高价	3秒/动态				
					最低价	3秒/动态				
					最新价	3秒/动态		最后一笔成交价		
					申买量一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好买价上的委托数量		
					申买价一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好委托买入价格		
					申卖量一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好卖价上的委托数量		
					申卖价一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好委托卖价		
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					到期收益率	3秒/动态计算	公式见附件	以成交价格计算的持有债券到期后的收益率		
					成交笔数	3秒/动态		各债券总成交笔数		
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ每笔成交数量			

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ 每笔成交数量×成交价格			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ 各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委买价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量=Σ 各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格=（Σ（各委卖价位上的委托量×委托价格））/委托卖出总量	以委托量为权重的平均委托卖出价格		
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		
		可转换债券	开盘前数据		债券代码	每日一次/静态				
					债券中文简称	每日一次/静态				
					基础证券名称	每日一次/静态		可以成的基础股票的名称		
					票面利率（首年利率）	每日一次/静态		债券发行时所标明的票面利率		
					当年利率	每日一次/静态				
					到期日	每日一次/静态		固定收益品种到期并偿付本金及利息的日期		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					付息日	每日一次/ 静态				
					付息频率	每日一次/ 静态		一年中付息的次数		
					起息日	每日一次/ 静态		开始计算利息的日子		
					发行价	每日一次/ 静态		债券发行价格		
					面值	每日一次/ 静态				
					转股代码	每日一次/ 静态		可转债对应的转股代码		
					转股价格	每日一次/ 静态		事先约定的购买基础股票的价格		
					转股比例	每日一次/ 静态		一定数量的债券可以转换成的基础股票的数量		
					转股时间	每日一次/ 静态		可转换为股票的时间		
					剩余时间	每日一次/ 静态		当日至债券到期日间所剩余的时间		
			集合竞价		债券代码	每日一次				
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/ 动态		指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003 中为在当前买入价以及当前卖出价中同时发布	

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					虚拟匹配量	6秒左右/动态		指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003 中为在申买量一以及申卖量一中同时发布	
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003 中为在申买量二中发布	
					卖方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的卖方剩余申报数量	Show2003 中为在申卖量二中发布	
			盘中	逐笔成交数据 (3秒钟发送一次, 不含帐户及券商信息)	债券代码	3秒/动态				
					成交序列号	3秒/动态				
					成交时间	3秒/动态				
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格		
					成交数量	3秒/动态		各笔成交的数量		
					成交金额	3秒/动态计算	成交金额=成交价格*成交数量	各笔成交的金额		
				3秒钟发送一次的时点(快照)数据	债券代码	3秒/动态				
					今开盘价格	3秒/动态				
					最高价	3秒/动态				
					最低价	3秒/动态				
					最新价	3秒/动态		最后一笔成交价		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					申买量一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好买价上的委托数量		
					申买价一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好委托买入价格		
					申卖量一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好卖价上的委托数量		
					申卖价一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好委托卖价		
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					到期收益率	3秒/动态计算		以成交价格计算的持有债券到期后的收益率		
					成交笔数	3秒/动态		各可转债总成交笔数		
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ每笔成交数量			
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ每笔成交数量×成交价格			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委买价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量= $\Sigma$ 各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格= $(\Sigma(\text{各委卖价位上的委托量} \times \text{委托价格})) / \text{委托卖出总量}$	以委托量为权重的平均委托卖出价格		
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		
	回购		开盘前数据		回购代码	每日一次/静态				
					回购简称	每日一次/静态				
			集合竞价		回购代码	每日一次				
					虚拟开盘参考价格	6秒左右/动态		指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格，即从开盘起到行情发布时刻，根据集合竞价算法计算得出的虚拟撮合价格。	Show2003中为在当前买入价以及当前卖出价中同时发布	
					虚拟匹配量	6秒左右/动态		指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量	Show2003中为在申报量一以及申卖量一中同时发布	

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例	
					买方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方剩余申报数量	Show2003中为在申买量二中发布		
					卖方虚拟未匹配量	6秒左右/动态		指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的卖方剩余申报数量	Show2003中为在申卖量二中发布		
			盘中	逐笔成交数据（3秒钟发送一次，不含帐户及券商信息）	回购代码	3秒/动态					
					成交序列号	3秒/动态					
					成交时间	3秒/动态					
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格			
					成交数量	3秒/动态		各笔成交的数量			
					成交金额	3秒/动态计算	成交金额=成交量×1000	各笔成交的金额			
				3秒钟发送一次的时点（快照）数据	回购代码	3秒/动态					
					今开盘价格	3秒/动态					
					最高价	3秒/动态					
					最低价	3秒/动态					
					最新价	3秒/动态		最后一笔成交价			
					申买量一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好买价上的委托数量			
					申买价一至十	3秒/动态		买一至买十十个最好委托买入价格			



数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					申卖量一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好卖价上的委托数量		
					申卖价一至十	3秒/动态		卖一至卖十十个最好委托卖价		
					申买量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申买量一（即最佳买入价）上前50笔分笔委托数量		
					申卖量一中的前50个明细委托数量	3秒/动态		指申卖量一（即最佳卖出价）上前50笔分笔委托数量		
					成交笔数	3秒/动态		各回购总成交笔数		
					成交总量	3秒/动态计算	成交总量=Σ每笔成交数量			
					成交总额	3秒/动态计算	成交总额=Σ每笔成交数量×1000			
					委托买入总量	3秒/动态计算	委托买入总量=Σ各价位上的委托买入数量	所有买入委托的总数量		
					加权平均委买价格	3秒/动态计算	加权平均委买价格=（Σ（各委托买价位上的委托量×委托价格））/委托买入总量	以委托量为权重的平均委托买入价格		
					委托卖出总量	3秒/动态计算	委托卖出总量=Σ各价位上的委托卖出数量	所有卖出委托的总数量		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计算	加权平均委卖价格=（Σ（各委托卖价位上的委托量×委托价格））/委托卖出总量	以委托量为权重的平均委托卖出价格		

数据发送频道	品种类别	品种子类别	所处阶段	数据项	明细指标	数据属性	公式	含义	备注	范例
					委托买入总量与卖出委托总量的比例	3秒/动态计算	委托比例=委托买入总量/委托卖出总量	委托买入总量与卖出委托总量的比例		

注：

Level—2产品中成交单位和货币说明如下：

- 一、 参与计算相应指数的成交金额单位是人民币元。
- 二、 参与计算相应指数的交易数量的单位和参与计算的证券类型相关，证券类型是股票的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。
- 三、 成交数量的单位对股票为股，基金为份，债券与回购为手，权证为100份。
- 四、 货币： 价格、金额单位除B股为美元外，其他均为人民币元。

## Level 2 Product Content

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
Index					
	Index Overview		Pre-Market Data	Index code,Index name,Previous closing price	
	Index Overview		Intraday Trading	Like Show2003, Securities code, current date&time, latest A Share Index, latest B Share Index, End of Day marker, Latest SSE Index	Index code, Opening index, transaction value involved in calculation of corresponding Index, index high, index low, latest, trading volume involved in calculation of corresponding Index,
	Classified Index		Intraday Trading		Index code, Index name, latest closing index, opening index, transaction value involved in calculation of corresponding Index, index high, index low, latest index, trading volume involved in calculation of corresponding Index
、 B share), Fund, Warrants					
	Stock		Pre-Market Data		Stock Code
					Short Chinese Name of Stock
					Previous closing price
					Instrument Type
					Industry Codes
					Industry Chinese Name
					Total issued floating shares
					Total issued Shares
			Auction period		Stock Code
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
			Intraday Trading	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	Stock Code

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	Stock Code
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Prices of unexecuted orders
					Ten best ask Prices of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Trade number
					Total volume
					Total value
					Total bid Volume
					Volume Weighted average bid price
					Total ask Volume
					Volume Weighted average ask price
					Total bid volume over total ask volume
				Order Ranking - Top 10 stocks in order volume	Ranking No.(From 1 to 10)
					Time stampe
					Stock Code
					Bid/Ask Indicator
					Total volume of Orders
					Total Trading volume
				Total trading value	
				Industry Ranking	Ranking No.
					Time stampe
					Industry Code
					Industry trading value

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Total market trading value
					Industry Weight in the total value
				Top 5 stocks with biggest trading values by industry	Ranking No.(From 1 to 5)
					Time stampe
					Industry Code
					Stock Code
					Trading value
				Top 10 Withdrawal Ask/Bid Orders with absolute largest volume	Ranking No.(From 1 to 10)
					Time stampe
					BID /ASK
					Stock Code
					Time of order dropping
					Volume of Order
					Price of Order
				absolute withdrawn intraday accumulated Order volumes	Ranking No.(From 1 to 10)
					Time stampe
					BID /ASK
					Stock Code
					Accumulated absolute Withdrawn volume
	Fund	Close-ended Fund	Pre-Market Data		Fund Code
					Short Chinese Name of fund
					Pre Closing Price
					Product Type
			Auction period		Fund Code
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
			Intraday Trading	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	Fund Code
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	Fund Code
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Price of unexecuted orders
					Ten best ask Price of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Trade number
					Total volume
					Total value
		ETF	Pre-Market Data	Fund Code	
				Short Chinese Name of fund	
				Pre Closing Price	
				Product Type	
			Auction period	Fund Code	
				Virtual open reference price	
				Virtual matched volume	
				Virtual unmatched bid volume	

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Virtual unmatched ask volume
			Intraday Trading	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	Fund Code
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	Fund Code
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Price of unexecuted orders
					Ten best ask Price of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Trade number
					Total volume
					Total value
					Total bid Volume
					Volume Weighted average bid price
					Total ask Volume
					Volume Weighted average ask price
					Total bid volume over total ask volume
				Snapshot data to be delivered every Ten seconds	IOPV Indicated Optimized Portfolio Value
	Warrants		Pre-Market Data		Warrants Code
					Short Chinese Name of Warrants
					Underlying Name
					Underlying Price
					Exercise Ration

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
			Auction period		Call/Put Indicator
					Exercise Period
					American/European
					<b>Warrants Code</b>
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
			Intraday Trading	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	<b>Warrants Code</b>
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	<b>Warrants Code</b>
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Price of unexecuted orders
					Ten best ask Price of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Trade number
					Total volume
					Total value
					Total bid Volume
					Volume Weighted average bid price
					Total ask Volume
					Volume Weighted average ask price
					Total bid volume over total ask volume



Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
Fixed Income					
	Bond (Common)	Bond	Pre-Market Data		<b>Bond code</b>
					Short Chinese Name of bond
					Coupon Rate
					Current rate
					Maturity Date
					Interested Payment Frequency
					Payment Date
					Issuing price
					Value date
					Nominal Value
					Residual maturity
			Auction period		<b>Bond Code</b>
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
			Intraday Trading Data	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	<b>Bond Code</b>
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	<b>Bond Code</b>
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Price of unexecuted orders
					Ten best ask Price of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Yield To Maturity
					Trade number
					Total volume
					Total value
					Total bid Volume
					Volume Weighted average bid price
					Total ask Volume
					Volume Weighted average ask price
					Total bid volume over total ask volume
		Convertible Bond	Pre-Market Data		<b>Bond Code</b>
					Short Chinese Name of bond
					Coupon Rate
					Current rate
					Underlying Security Name
					Maturity Date
					Interest Payment Frequency
					Payment Date
					Nominal Value
					Issuing price
					Value date
					Conversion code
					Conversion Price
					Conversion Ration
					Conversion Period
					Time remaining
			Auction period		<b>Bond Code</b>
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
			Intraday Trading	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	<b>Bond Code</b>

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	<b>Bond code</b>
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Price of unexecuted orders
					Ten best ask Price of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Yield To Maturity
					Trade number
					Total volume
					Total value
					Total bid Volume
					Volume Weighted average bid price
					Total ask Volume
					Volume Weighted average ask price
					Total bid volume over total ask volume
		Repo	Pre-Market Data		<b>Repo Code</b>
					Repo Name
			Auction period		<b>Repo Code</b>
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
			Intraday Trading	Tick-By-Tick data ( to be delivered every three seconds, not including account and broker ID)	<b>Repo Code</b>

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered every three seconds	Repo Code
					Open price
					High
					Low
					Latest price
					Ten best Bid Price of unexecuted orders
					Ten best ask Price of unexecuted orders
					Volumes of Ten best bid prices
					Volumes of Ten best ask prices
					First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best ask
					Trade number
					Total volume
					Total value
					Total bid Volume
					Volume Weighted average bid price
					Total ask Volume
					Volume Weighted average ask price
					Total bid volume over total ask volume