

Level-2系列产品说明书

	[√] 初稿	文档标识	PROJ-Level-2-SSEInfonet-Vendor-product
文档	[]评审通过	当前版本	2
H H 状	[] 修改	作者	Level2 项目组
态	[]发布	发布者	上证所信息网络有限公司
	[]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

©上证所信息网络有限公司. 版权所有

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	前时间、最新 A股指数、最 新B股指数、	指数代码、今开盘 指数、参与计算金 应指数的成交最级 、最高指数、最新指数、 指数、最新相应指数 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、最所指数、最新指数、参与计算相应指数的交易数量	动态/刷新				
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	毎日一次/ 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	毎日一次/ 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 有有竞价的报 集合竞价并予价据 规成交并予价格到 时揭示开盘起刻,算 大布时刻,算 大有一竞价的 据集 等得出的 据 报合价格。	Show2003 中为在当 前买入价 (申买从价 一) 以卖出 价中同 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)		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	成交金额=成交			
						算	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			开盘至行情发布 时的最高成交价		
						3秒/动态		格		
					最低价	25h/=h- }-		开盘至行情发布 时的最低成交价 格		
					最新价	3秒/动态 3秒/动态		最后一笔成交价		
					申买量一至十	3位/491心		买一至买十十个		
					中大里 王 	3秒/动态		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/纵念		^倍 卖一至卖十十个		
					中头里 王 	3秒/动态		最好卖价上的委		
					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			指申买量一(即 最佳买入价)上 前50笔分笔委托		
					申卖量一中的前50	3秒/动态		数量 指申卖量一(即		
					个明细委托数量	25h/=+ *		最佳卖出价)上 前50笔分笔委托		
					成交笔数	3秒/动态		数量 各股票总成交笔		
					风义毛数	3秒/动态		合		

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/动态计	成交总量=Σ每			
					成交总量	算	笔成交数量			
							成交总额=∑每			
						3秒/动态计	笔成交数量×成			
					成交总额	算	交价格			
					委托买入总量	つまか /ニャーナンし	委托买入总量=	ベナ マンチ <i>にも</i>		
						3秒/动态计	, , , , ,	所有买入委托的		
					10.14.17.14.14.14.14.14.14.14.14.14.14.14.14.14.	算		总数量		
					加权平均委买价格		加权平均委买价 格=(Σ(各委			
							买价位上的委托			
								以委托量为权重		
						3秒/动态计		的平均委托买入		
						算		价格		
					委托卖出总量		委托卖出总量=	W.1.16		
						3秒/动态计	Σ各价位上的委	所有卖出委托的		
						算	托卖出数量	总数量		
					加权平均委卖价格		加权平均委卖价			
							格=(∑(各委			
							卖价位上的委托			
						aずん (=1. - - > 1	量×委托价			
						3秒/动态计	格))/委托卖			
					* K = \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \	算		价格		
					委托买入总量与卖			委托买入总量与		
					出委托总量的比例	算		卖出委托总量的 比例		
				承 红排夕	排名序号(1至10)	升	头山心里			
				委托买入数量	雅石庁与(1主10) 					
1 1				最多的前十只						
				证券		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			委托买入/卖出总		
						3秒/动态		量		
					已成交总量	3秒/动态排				
						名		己成交的数量		

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			成交金额		
1 1						3秒/动态	交数量*成交价格			
				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		行业成交金额=			
1 1						3秒/动态计		行业内所有股票		
						算	成交金额	的成交总额		
1 1					股票总成交金额			整个市场成交总		
						3秒/动态		额		
					占总成交金额比重		行业成交比重=	各行业成交额占		
1 1								总成交金额的比		
1 1						3秒/动态	场总成交金额	重		
1					排名序号(1至5)					
				额前五位的个		3秒/动态				
				股	时间戳	3秒/动态 3秒/动态				
					时间截 行业代码	3秒/动态 3秒/动态				
					股票代码	3秒/动态				
					成交金额	3秒/动态计	成交金额=∑成			
					风义立例	算排名	交数量*成交价格	股 		
				单笔委托数量 最大的10笔买	排名序号(1至10)	并非石	又数里 从又折旧	双示的极义亚顿		
				取入的10毛头 /卖撤单		3秒/动态				
1 1				/头似中	时间戳	3秒/动态 3秒/动态				
1					可问似 委买/委卖	3秒/幼念	注:用于统计的			
1					安头/安头		撤单指完全没有			
							成交(不包含部			
1 1							分成交情况)、			
								分委托买入、委		
1 1								托卖出两个方向		
						3秒/动态		统计		
					股票代码	3秒/动态	,			
					委托时间	3秒/动态				
						3秒/动态比				
					委托数量	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	排名序号(1至10)					
				只股票		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	开盘前数据		基金代码	每日一次/ 静态	<i>3</i> , 1.			
					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		指特定與其地的財務,其時的有人的方式,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,因此,	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	基金代码					
				户及券商信 息)		3秒/动态				
					成交序列号	3秒/动态				
					成交时间	3秒/动态		to take 15 No. 11 14 14.		
					成交价格	3秒/动态		各笔成交的价格		
					成交数量	3秒/动态	6 3 4 3= 6 3	各笔成交的数量		
					成交金额	3秒/动态计	成交金额=成交			
					44 A 115 +++	算	价格*成交数量	各笔成交的金额		
				3秒钟发送一 次的时点(快	基金代码					
				照) 数据		3秒/动态				ı
					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			买一至买十十个 最好买价上的委		
						3秒/动态		托数量		
					申买价一至十			买一至买十十个 最好委托买入价		
				-		3秒/动态		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			卖一至卖十十个		
						ath (=1. ++		最好卖价上的委		
						3秒/动态		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			指申买量一(即		
					个明细委托数量			最佳买入价)上		
								前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					申卖量一中的前50			指申卖量一(即		
					个明细委托数量			最佳卖出价)上		
						2±h /=+- 		前50笔分笔委托		
					成交笔数	3秒/动态		数量 各基金总成交笔		
						3秒/动态		各基金总成文毛 数		
						3秒/动态计	成交总量=∑每	奴		
					成交总量	算	成文心量 — 乙 母 笔成交数量			
					八人心里	71'	成交总额=∑每			
						3秒/动态计	笔成交数量×成			
					成交总额	算	交价格			
					委托买入总量		委托买入总量=			
						3秒/动态计		所有买入委托的		
						算	托买入数量	总数量		
					加权平均委买价格		加权平均委买价			
							格=(∑(各委			
							买价位上的委托 量×委托价	N天红具头扣手		
						3秒/动态计		以委托量为权重 的平均委托买入		
						算	入总量	价格		
						71'	委托卖出总量=	ИТП		
						3秒/动态计		所有卖出委托的		
					委托卖出总量	算	托卖出数量	总数量		
							加权平均委卖价			
							格=(Σ(各委			
							卖价位上的委托			
						21h /=+ + >1	量×委托价			
							格))/委托卖			
					加权平均委卖价格	算	出总量	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 每日一次/				
			集合竞价		产品类型 基金代码	母日一次/ 静态 每日一次				
			朱石兄们		虚拟开盘参考价格	6秒左右/动 态		情发布时刻,根 据集合竞价算法	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		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		并予以即时揭示	Show2003 中为在申 买量二中 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
					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	基金代码	3秒/动态				
			益甲	息)	成交序列号	3秒/动态 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	成交金额=成交			
					,,,,,,	算		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		

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			指申买量一(即		
					个明细委托数量			最佳买入价)上		
								前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					申卖量一中的前50			指申卖量一(即		
					个明细委托数量			最佳卖出价)上		
								前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					成交笔数			各ETF总成交笔		
						3秒/动态		数		
						3秒/动态计	成交总量=Σ每			
					成交总量	算	笔成交数量			
							成交总额=Σ每			
						3秒/动态计	笔成交数量×成			
					成交总额	算	交价格			
					委托买入总量		委托买入总量=			
						3秒/动态计		所有买入委托的		
						算	托买入数量	总数量		
					加权平均委买价格		加权平均委买价			
							格= (Σ(各委			
							买价位上的委托	いるとロッしる		
						ユエル /ニムーナ ソし	量×委托价	以委托量为权重		
						3秒/动态计		的平均委托买入		
						算		价格		
						3秒/动态计	委托卖出总量=	化大去山禾红色		
					禾 红毒山	算	Σ各价位上的委 托卖出数量	所有卖出委托的 总数量		
					委托卖出总量	升	加权平均委卖价			
							加权下均安实证 格=(Σ(各委			
							卖价位上的委托			
							量×委托价			
						3秒/动态计	格))/委托卖			
						算		价格		
					委托买入总量与卖	⊅ Γ		委托买入总量与		
						3秒/动态计	买入总量/委托	卖出委托总量的		
					四人,100至11/07	算	卖出总量	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	毎日一次/ 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		指特克克克斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯斯	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				
				7ES 7	成交序列号	3秒/动态				
					成交时间 成交价格	3秒/动态 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			
				3秒钟发达一 次的时点(快	权证代码					
				照) 数据	A T to 14 16	3秒/动态				
					今开盘价格 最高价	3秒/动态 3秒/动态				
					最低价	3秒/动态 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			买一至买十十个		
						3秒/动态		最好买价上的委 托数量		
					申买价一至十	3/2/ <i>1</i> /2/10		买一至买十十个		
								最好委托买入价		
						3秒/动态		格		
					申卖量一至十			卖一至卖十十个 最好卖价上的委		
						3秒/动态		托数量		
					申卖价一至十			卖一至卖十十个		
						3秒/动态		最好委托卖价		
					申买量一中的前50			指申买量一(即		
					个明细委托数量			最佳买入价)上 前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					申卖量一中的前50		1	指申卖量一(即		
					个明细委托数量			最佳卖出价)上		
						3秒/动态		前50笔分笔委托 数量		
					成交笔数	3-12-1-941 L.		各权证总成交笔		
						3秒/动态		数		
					. D V. E	3秒/动态计	成交总量=∑每			
					成交总量	算	笔成交数量 成交总额=Σ每			
						3秒/动态计	定成交数量×成			
					成交总额	算	交价格			
					委托买入总量	ath (=1, +) 1	委托买入总量=	~		
						3秒/动态计 算	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	分	加权平均委买价	心奴里		
					MARK T PASS OF THE		格=(Σ(各委			
							买价位上的委托			
						3秒/动态计	量×委托价 格))/委托买	以委托量为权重 的平均委托买入		
						算		的中均安托头八 价格		
							委托卖出总量=	× 1 1 1 1		
						3秒/动态计		所有卖出委托的		
1					委托卖出总量	算	托卖出数量	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=(Σ(各委			
							卖价位上的委托			
							量×委托价	以委托量为权重		
					加权平均委卖价格	3秒/动态计 算	格))/委托卖 出总量	的平均委托卖出 价格		
					委托买入总量与卖			委托买入总量与		
					出委托总量的比例	3秒/动态计	买入总量/委托	卖出委托总量的		
ᄪᄼᅶᄮ						算	卖出总量	比例		
固定收益						每日一次/				
	债券	普通债券	开盘前数据		债券代码	静态				
					债券中文简称	每日一次/				
					票面利率	静态 每日一次/		(主光小公司)		
					宗 川 州 平	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/		74H2741FEI 14 1		21170
						静态				
					到期日	每日一次/		固定收益品种到 期并偿付本金及		
						静态		利息的日期		
					付息频率	每日一次/		一年中付息的次		
					11 4 1	静态		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/		☐ <i>79</i> ↓		
						静态				
					起息日	每日一次/		开始计算利息的		
					发行价	静态 每日一次/		日子		
					1X11 M	静态		债券发行价格		
					剩余时间			当日至债券到期		
						每日一次/		日间所剩余的时		
			集合竞价	ı	 债券代码	静态 每日一次		间		

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		指特定时有集合党 集的 集合党 化 电 大大 的 大 的	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 成交时间	3秒/动态 3秒/动态				
					成交价格 成交数量	3秒/动态 3秒/动态		各笔成交的价格 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
					成交金额	3秒/动态计	成交金额=成交			
						算	价格*成交数量	各笔成交的金额		
				3秒钟发送一	债券代码					
				次的时点(快						
				照)数据		ath (=1+				
				,,,, ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	Λ Τ΄ ἡ. /\ .\Α	3秒/动态				
					今开盘价格	3秒/动态				
					最高价	3秒/动态				
					最低价 最新价	3秒/动态 3秒/动态		最后一笔成交价		
					申买量一至十	3秒/纵念		买一至买十十个		
					中大里 土			最好买价上的委		
						3秒/动态		托数量		
					申买价一至十	7,7,7,7		买一至买十十个		
								最好委托买入价		
						3秒/动态		格		
					申卖量一至十			卖一至卖十十个		
								最好卖价上的委		
						3秒/动态		托数量		
					申卖价一至十			卖一至卖十十个		
						3秒/动态		最好委托卖价		
					申买量一中的前50			指申买量一(即		
					个明细委托数量			最佳买入价)上 前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					申卖量一中的前50			指申卖量一(即		
					个明细委托数量			最佳卖出价)上		
					1 77福文10			前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					到期收益率			以成交价格计算		
						3秒/动态计		的持有债券到期		
						算	公式见附件	后的收益率		
					成交笔数			各债券总成交笔		
						3秒/动态		数		
					n v =	3秒/动态计	成交总量=∑每			
					成交总量	算	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
						3秒/动态计	成交总额=Σ每 笔成交数量×成			
					成交总额	算	宅成父数里へ成 交价格			
					委托买入总量		委托买入总量=			
						3秒/动态计		所有买入委托的		
					加权平均委买价格	算	托买入数量 加权平均委买价	总数量		
					加伐下均支入价值		格=(Σ(各委			
							买价位上的委托			
						3秒/劫态计	量×委托价 格))/委托买	以委托量为权重 的平均委托买入		
						算		价格		
							委托卖出总量=			
						3秒/动态计 算		所有卖出委托的		
					委托卖出总量	异	托卖出数量 加权平均委卖价	总数量		
							格= (∑(各委			
							卖价位上的委托			
						3秒/动态计	量 × 委 托 价 格))/委托卖	以委托重为权重 的平均委托売出		
								价格		
					委托买入总量与卖			委托买入总量与		
					出委托总量的比例	3秒/郊念计 算	买入总量/委托 卖出总量	卖出委托总量的 比例		
		可转换债	- A see No. No.		A-1- VA A1	弄 每日一次/	关口心里	ניקן טו		
		券	开盘前数据		债券代码	静态				
					债券中文简称	每日一次/				
						静态 每日一次/		可以成的基础股		
					基础证券名称	静态		票的名称		
					票面利率(首年利			债券发行时所标		
					率)	静态		明的票面利率		
					当年利率	每日一次/ 静态				
						11, 10)		固定收益品种到		
						每日一次/		期并偿付本金及		
1						静态		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/		一年中付息的次		
						静态		数		
					起息日	每日一次/		开始计算利息的		
					10.75.18	静态		日子		
					发行价	每日一次/		(丰米 (L) (二) (人) (A)		
					五体	静态 每日一次/		债券发行价格		
					面值	静态				
					转股代码	每日一次/		可转债对应的转		
						静态		股代码		
					*+ Or. I/\ \+\	每日一次/		事先约定的购买		
					转股价格	静态		基础股票的价格		
								一定数量的债券		
					转股比例	每日一次/		可以转换成的基		
						静态		础股票的数量		
					转股时间	每日一次/		可转换为股票的		
						静态		时间 火口では光が開		
					剩余时间	每日一次/		当日至债券到期 日间所剩余的时		
						静态		间		
			集合竞价	ı	债券代码	毎日一次		11.5		
			JK H JUV		12/24 41:4			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		
					虚拟开盘参考价格				Show2003	
									中为在当	
									前买入价 以及当前	
						6秒左右/动			以及 ヨ 削 卖出 价 中	
						态		撮合价格。	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		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	中为在申	
					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	中为在申	
			盘中	逐笔成交数据 (3秒钟发送 一次,不含帐 户及券商信 息)		3秒/动态				
					成交序列号	3秒/动态 3秒/动态				
					成交时间 成交价格	3秒/动态 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			买一至买十十个 最好买价上的委		
						3秒/动态		托数量		
					申买价一至十			买一至买十十个		
						3秒/动态		最好委托买入价 格		
					申卖量一至十	3/2/3/16		卖一至卖十十个		
						oth (=1, ++		最好卖价上的委		
					申卖价一至十	3秒/动态		托数量 卖一至卖十十个		
					中关师 主丁	3秒/动态		最好委托卖价		
					申买量一中的前50			指申买量一(即		
					个明细委托数量			最佳买入价)上 前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					申卖量一中的前50			指申卖量一(即		
					个明细委托数量			最佳卖出价)上 前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					到期收益率	3秒/动态计		以成交价格计算		
						算		的持有债券到期 后的收益率		
					成交笔数			各可转债总成交		
						3秒/动态	小女 公目	笔数		
					成交总量	3秒/动态计 算	成交总量=Σ每 笔成交数量			
					/从人心里		成交总额=∑每			
					武 六	3秒/动态计 算	笔成交数量×成			
					成交总额 委托买入总量	异	交价格 委托买入总量=			
					文化八八心里	3秒/动态计	Σ各价位上的委	所有买入委托的		
					加热亚历美亚 丛林	算	托买入数量	总数量		
					加权平均委买价格		加权平均委买价 格=(Σ(各委			
							买价位上的委托			
						3秒/动态计	量×委托价 格))/委托买	以委托量为权重 的平均委托买入		
						算	入总量	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	托卖出数量	所有卖出委托的 总数量		
							加权平均委卖价 格=(Σ (各委 卖价位上的委托			
						3秒/动态计				
					委托买入总量与卖 出委托总量的比例			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				
			开盆削剱炻		回购简称	每日一次/ 静态				
			集合竞价		回购代码	每日一次		+154± 2-70+ 1: 64 5C		
								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,	Show2003	
					虚拟开盘参考价格	6 秒左右/动 态		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。	中为在当前买入价以及当前中 当时发布	
					虚拟匹配量	恋 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		• P1 111 / 42 17 7 7 7 9	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	回购代码					
				息)	成交序列号	3秒/动态 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		<u> </u>			
				思ノ 致1店		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	2秒/钟士		买一至买十十个 最好买价上的委		
					申买价一至十	3秒/动态		托数量 买一至买十十个		
					中头狈一至十 	3秒/动态		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			卖一至卖十十个		
						a # 1 (-1 -1-		最好卖价上的委		
					中土从 不工	3秒/动态		托数量 表		
					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			指申买量一(即		
					个明细委托数量			最佳买入价)上		
								前50笔分笔委托		
						3秒/动态		数量		
					申卖量一中的前50			指申卖量一(即		
					个明细委托数量			最佳卖出价)上		
						211 /=L +		前50笔分笔委托		
					Tr 子 体 W	3秒/动态		数量		
					成交笔数	3秒/动态		各回购总成交笔 数		
						3秒/动态计	成交总量=∑每	奴		
					成交总量	算	成文心里— 2 母 笔成交数量			
					从 文心里	71'	成交总额=∑每			
						3秒/动态计	笔成交数量×			
					成交总额	算	1000			
					委托买入总量		委托买入总量=			
						3秒/动态计	Σ各价位上的委	所有买入委托的		
						算	托买入数量	总数量		
					加权平均委买价格		加权平均委买价			
							格= (Σ(各委			
							买价位上的委托	17 圣社 巨 生 担 壬		
						3秒/动太计	量×委托价 格))/委托买	以委托量为权重 的平均委托买入		
						算	帝 / / 安元矢 入总量	的干均安托关八 价格		
)1	委托卖出总量=	DI TE		
						3秒/动态计		所有卖出委托的		
					委托卖出总量	算	托卖出数量	总数量		
							加权平均委卖价			
							格= (Σ(各委			
							卖价位上的委托			
						a たん /=Jナ・) !	量×委托价			
							格))/委托卖			
1					加权平均委卖价格	算	出总量	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		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	Instrument	Instrument			
channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
Index			_		
	Index			Index code,Index name,Previous	
	Overview		Pre-Market Data	closing price	
				Like Show2003, Securities code,	Index code, Opening index, transaction value involved in calculation of corresponding Index, index high, index low, latest, trading volume
				current date&time, latest A Share	involved in calculation of corresponding Index,
	Index			Index, latest B Share Index, End of	• •
	Overview		Intraday Trading	Day marker, Latest SSE Index	
	3 7 62 7 10 11			g uj mumer, zucest aaz meen	Index code, Index name, latest closing index, opening index, transaction
					value involved in calculation of corresponding Index, index high, index
	Classified				low, latest index, trading volume involved in calculation of
	Index		Intraday Trading		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
					Stock Code
				Tick-By-Tick data (to be	
				delivered every three seconds,	
				not including account and	
			Intraday Trading	broker ID)	

Data delivery	Instrument	Instrument			
channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered	Stock Code
				every three seconds	
					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	Ranking No.(From 1 to 10)
				in order volume	
					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
				ı	, ,

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

Data delivery channel	Instrument Class	Instrument Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
Chamici	Citass	Bubciass	1 CHOU	Tick-By-Tick data (to be	Fund Code
				delivered every three seconds,	
				not including account and	
			Intraday Trading	broker ID)	
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered	Fund Code
				every three seconds	
					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
		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

Intraday Trading Intrading Time Trading yolume Intrading Time Intrading Time Intrading Yolume Intrading	Data delivery	Instrument	Instrument			
Tick-By-Tick data (to be delivered every three seconds, not including account and broker ID) Sequence No Trading Time Trading price Trading value Trading Volume Snapshot data to be delivered every three seconds Open price High Low Latest price Ten best Bid Price of unexecuted orders Ten best ask Price of unexecuted orders Volumes of Ten best ask prices First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best bid Total volume Total volume Total volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price	channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
Intraday Trading Intrading Price Intrading Price Intrading Volume Intradin						
Intraday Trading Intraday Trading Intraday Trading Sequence No Trading Time Trading price Trading Volume Snapshot data to be delivered every three seconds Open price High Low Latest price Ten best Bid Price of unexecuted orders Ten best Bid Price of unexecuted orders Ten best Bid Price of unexecuted orders Volumes of Ten best ask prices First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best ask Trade number Total volume Total volume Total volume Total volume Volume Weighted average bid price Total sk Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Intraday Trading Broker ID) Sequence No Trading Time Trading price Trading value Trading Volume Snapshot data to be delivered every three seconds Open price High Low Latest price Ten best Bid Price of unexecuted orders Ten best ask 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 value Total value Total bid Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price					•	
Sequence No Trading Time Trading price Trading value Trading Volume Snapshot data to be delivered every three seconds 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 bid prices First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best ask Trade number Total volume Total volume Total volume Total volume Total sak Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Trading Time Trading price Trading Value Trading Volume Snapshot data to be delivered Fund Code every three seconds 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 sak prices First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best ask Trade number Total volume Total volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price				Intraday Trading	broker ID)	
Trading price Trading value Trading Volume Snapshot data to be delivered every three seconds 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 bid prices Volumes of Ten best bid 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						*
Trading value Trading Volume Snapshot data to be delivered every three seconds Open price High Low Latest price Ten best Bid Price of unexecuted orders Ten best ask Price of unexecuted orders Volumes of Ten best ask 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 value Total value Total value Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Trading Volume Snapshot data to be delivered Fund Code every three seconds 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 volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						<u> </u>
Snapshot data to be delivered every three seconds 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 bid prices First 50 split(detailed) volumes of best bid First 50 split(detailed) volumes of best ask Trade number Total volume Total volume Total volume Total volume Volume Weighted average bid price Volume Weighted average ask price						·
every three seconds 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 volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						· ·
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 volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price					_	Fund Code
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 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 volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price					every three seconds	
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 volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
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 volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask 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 volume Total volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
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 volume Total bid Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						*
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						
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						
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						
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						
Trade number Total volume Total value Total bid Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Total volume Total value Total bid Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Total value Total bid Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Total bid Volume Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Volume Weighted average bid price Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Total ask Volume Volume Weighted average ask price						
Volume Weighted average ask price						<u> </u>
· · · · · ·						
Total hid valuma avar total ask valuma						ŭ i
						Total bid volume over total ask volume
Snapshot data to be delivered					_	
every Ten seconds IOPV Indicated Optimized Portfolio Value					every Ten seconds	
Warrants Pre-Market Data Warrants Code		Warrants		Pre-Market Data		
Short Chinese Name of Warrants						
Underlying Name						
Underlying Price						
Exercise Ration						Exercise Ration

Data delivery	Instrument	Instrument	Post d	Data Itam	Data Tad Indian
channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator Call/Put Indicator
					Exercise Period
					American/European
			Auction period		Warrants Code
			Auction period		Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
				Tick-By-Tick data (to be	
				delivered every three seconds,	
				not including account and	
			Intraday Trading	broker ID)	
			Invitating 11 manage		Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered	
				every three seconds	
				I	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	Instrument	Instrument			
channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
Fixed Income					
	Bond				
	(Common	Bond	Pre-Market Data		Bond code
					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		Bond Code
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
				Tick-By-Tick data (to be	Bond Code
				delivered every three seconds,	
			Intraday Trading	not including account and	
			Data	broker ID)	
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered	Bond Code
				every three seconds	
					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
Chaimei	Class	Subciass	reriou		First 50 split(detailed) volumes of best bid
					First 50 split(detailed) volumes of best bld
					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			Town old folding of the town was folding
			Pre-Market Data		Bond Code
					Short Chinese Name of bond
					Coupon Rate
					Current rate
					Underlying Security Name
					Maturity Date
					Interested Payment Frequency
					Payment Date
					Nominal Value
					Issuing price
					Value date
					Conversion code
					Conversion Price
					Conversion Ration
					Conversion Period
					Time remaining
			Auction period		Bond Code
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
				Tick-By-Tick data (to be	
				delivered every three seconds,	
				not including account and	
			Intraday Trading	broker ID)	Bond Code

Data delivery	Instrument	Instrument	5.1.1		D. H. J. H. J.
channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered	
					Bond 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
					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		Repo Code
					Repo Name
			Auction period		Repo Code
					Virtual open reference price
					Virtual matched volume
					Virtual unmatched bid volume
					Virtual unmatched ask volume
				Tick-By-Tick data (to be	Repo Code
				delivered every three seconds,	
				not including account and	
			Intraday Trading	broker ID)	
1		l	1	~~ ~~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~ ~	

Data delivery	Instrument	Instrument			
channel	Class	Subclass	Period	Data Item	Detailed Indicator
					Sequence No
					Trading Time
					Trading price
					Trading value
					Trading Volume
				Snapshot data to be delivered	Repo Code
				every three seconds	
					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