

上海证券交易所 历史数据产品说明书

文档 状态	☐ 初稿	文档标识	历史数据产品说明书
	☐ 评审通过	当前版本	1.0.0
	☐ 修改	作 者	市场数据部
	☒ 发布	发布者	上证所信息网络有限公司
	☐ 作废	完成日期	2020/02/19

文档变动说明

日期	版本	说明
2020-02-19	1.0.0	首次发布

1. 产品定义及服务

行情历史数据产品是指本公司以特定格式提供的与证券行情相关的历史数据服务，为客户提供行情回放、指标回测等支持的一项产品。产品具有数据内容丰富、可靠性高的特点。

从市场划分来看，包括上交所的 Level-1 行情、Level-2 行情、股票期权等；从数据内容来看，包括集合竞价数据、行情快照数据、逐笔成交数据、日 K 线和分钟 K 线数据等，科创板上市后新增盘后固定价格交易行情快照（Level-1、Level-2）、逐笔成交（Level-2），同时还提供相关证券基本信息文件。具体包括的数据内容如下表：

品种	证券基本信息	开盘集合竞价	行情快照	逐笔成交	日 K 线	分钟 K 线
Level-1	√		√		√	√
Level-2	√	√	√	√	√	√
期权	√		√		√	√

其中，数据内容具体信息如下：

（1）证券基本信息：该文件主要包含交易所提供的证券基本信息内容。

（2）开盘集合竞价：提供证券的开盘集合竞价数据，将全天所有证券的数据保存在同一个文件中，支持按证券顺序存放和按时间顺序存放两种格式。

数据内容包括成交价、虚拟匹配量、虚拟未匹配量以及匹配情况等。

（3）行情快照：包括科创板盘后固定价格交易快照，每幅快照间隔为 3 秒或 5 秒（其中，3 秒为个股快照间隔，5 秒为指数快照间隔，相邻快照如果完全相同就保留第一幅），将全天所有证券的快照保存在同一个文件中，支持按证券顺序存放和按时间顺序存放两种方式。需要注意的是，收盘集合竞价数据包含在行情快照中。

数据内容包括开盘价、最高价、最低价、最新价、成交量、成交金额、五档（Level-1、期权）或十档（Level-2）盘口等。

（4）逐笔成交：包括科创板盘后固定价格交易逐笔成交，提供证券的每一

笔成交明细数据，将全天所有证券的成交保存在同一个文件中，支持按证券顺序存放和按时间顺序存放两种格式。

数据内容包括成交时间、成交价格、成交量以及成交金额等。

（5）分钟 K 线、日 K 线：在提供 K 线基本数据的基础上，提供了昨收盘价、ETF 的 IOPV 值以及期权持仓量等。

2. 收费标准

行情历史数据文件定价为：

- （1）Level-2 行情：12 万元/年；
- （2）Level-1 行情：3 万元/年；
- （3）期权行情：3 万元/年。

同时，对上述任何一类数据，单购日 K 线定价为 1 万元/年，单购分钟 K 线定价为 2 万元/年。

3. 客户对象及要求

客户对象为使用行情历史数据产品进行算法验证、数据研究等应用的最终用户。

客户使用行情历史数据产品限于客户内部场所和网络范围内，不包括公开的互联网（含移动互联网）。

行情历史数据产品仅供客户在其自身系统内自用，不得转发转存。

4. 产品申请与审核

信息公司对于行情历史数据产品采用申请审核机制，符合要求的客户可向信息公司提交申请材料（申请材料包括申请表格等内容）。

信息公司在收到申请材料后对客户申请进行审核。审核通过后，信息公司和客户签署相关合同，客户按合同规定使用行情历史数据产品。