
中国金融期货交易所行情授权 申请指引（Level-2 行情）

2014年10月，中国金融期货交易所（以下简称“中金所”）正式授权其下属子公司上海金融衍生品研究院有限责任公司开展中金所期货信息在境内外的经营业务。为便于各类机构申请经营中金所的 Level-2 行情数据产品，特编写以下申请指引。

一、Level-2 行情

Level-2 行情（又称“五档行情”），其内容包括：合约名称、交割月份、最新价、成交量、持仓量、申买价（最优五笔）、申卖价（最优五笔）、申买量（最优五笔）、申卖量（最优五笔）、结算价、开盘价、收盘价、最高价、最低价、前结算价、成交额等（详细格式详见附件 1）。Level-2 行情采取行情快照（Snapshot）方式对成交流水进行切片采样，采样频率为 500ms/次，因此行情发送频率也为 500ms 每次。在特殊情况下，对于流动性不足的远月合约，如果行情采样时发现与上次采样没有发生成交和委托的变化，将不推送行情，因此可能会出现远月合约行情没有更新的情况，属正常现象。

二、申请指引

任何单位需转发或者经营中金所的 Level-2 行情须向上海金融衍生品研究院有限责任公司申请办理行情信息授权许可。

1、申请条件

任何合法成立的信息经营单位，符合以下全部条件，可以提出申请：

- （1）具有固定的营业场所；
- （2）营业执照经营范围包含行情相关的信息经营内容；
- （3）持有目前信息经营所需的全部相关资质和合法许可等；
- （4）注册资金 1000 万元人民币以上（含），财务状况良好，技术实力可靠并具备为市场提供可靠服务的能力；
- （5）自身、母公司或控股股东、子公司及控股公司、关联公司近三年内无非法或不良的经营记录；
- （6）符合相关技术要求；
- （7）曾经获得经营中金所 Level-1 行情授权一年以上（含），且业绩良好。

2、行情申请流程

(1) 技术准备（详见附件 2）：完成行情转发链路建设并完成两项技术测试：行情接口适应性测试、链路连通性测试；

(2) 申请方提交申请材料：中国金融期货交易所行情经营许可申请表及其附件；

(3) 申请审批；

(4) 通过审批后，双方签署行情经营许可协议；

(5) 申请方缴纳相关费用；

(6) 颁发信息经营许可证，并将完成合同签署及缴费的申请方名称在网站公示。

3、经营要求

(1) 按许可的用途、范围在许可有效期内经营行情，不得将授权许可进行出售或者转让；

(2) 未经中金所或上海金融衍生品研究院有限责任公司书面许可，信息商不得将全部或部分中金所行情信息传播到许可证指定以外的任何单位或个人及用于许可证指定以外的任何用途；

(3) 不得将全部或部分中金所行情信息用于非法目的，或者主动提供给第三方用于非法目；

(4) 未经中金所或上海金融衍生品研究院有限责任公司书面许可，不得使用中金所及关联单位的名称与标识（文字、图案或记号等）；

(5) 对 Level-2 行情数据的安全性负责，并保证对用户进行有效管理；

(6) 符合上海金融衍生品研究院有限责任公司对 Leve-2 行情产品进行上线要求；

(7) 应当根据信息经营许可协议中约定每月向中金所报送终端用户数及缴费；

(8) 涉及中金所、上海金融衍生品研究院有限责任公司、中金所行情相关的广告宣传事前应当报上海金融衍生品研究院有限责任公司审核；

(9) 接受上海金融衍生品研究院有限责任公司的信息经营审计；

(10) 不得采取冒用中金所名义、夸大产品功能、贬损竞争对手等手段进行虚假、误导性宣传。

上述内容仅为事前告知，具体经营要求以许可以申请方与上海金融衍生品研究院有限责任公司签订的信息经营许可协议为准。

本文档的解释权和调整权归中金所及上海金融衍生品研究院有限责任公司所有。

附件 1

中国金融期货交易所 Level-2 行情数据文件格式明细

name	type	label	description
TradingDay	char(8)	交易日	交易发生的日期
SettlementGroupID	char(8)	结算组代码	一个结算组的编号
SettlementID	number(3)	结算编号	结算编号
LastPrice	number(12,3)	最新价	当日该合约交易期间的最新成交价格
BidPrice (1-5)	number(12,3)	申买价 (一到五)	该合约当前的最好申买价 (一到五)
BidVolume (1-5)	number(10)	申买量 (一到五)	当前最好申买价上的申报数量 (一到五)
AskPrice (1-5)	number(12,3)	申卖价 (一到五)	该合约当前的最好申卖价 (一到五)
AskVolume (1-5)	number(10)	申卖量 (一到五)	当前最好申卖价上的申报数量 (一到五)
PreSettlementPrice	number(12,3)	昨结算	上一日的结算价
PreClosePrice	number(12,3)	昨收盘	上一日收盘价
PreOpenInterest	number(19,3)	昨持仓量	前最后持仓量, 单边统计
OpenPrice	number(12,3)	今开盘	该期货合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格
HighestPrice	number(12,3)	最高价	指一定时间内该合约成交价中的最高成交价格
LowestPrice	number(12,3)	最低价	指一定时间内该合约成交价中的最低成交价格
Volume	number(10)	数量	该合约在当日交易期间所有成交合约的数量, 单边统计
Turnover	number(19,3)	成交金额	该合约完成交易的市值, 单边统计

name	type	label	description
OpenInterest	number(19,3)	持仓量	持仓量，单边计算
ClosePrice	number(12,3)	今收盘	该合约当日交易的最后一笔成交价格
SettlementPrice	number(12,3)	今结算	该合约当日成交价格按成交量的加权平均价，当日无成交的，按上一日结算价
UpperLimitPrice	number(12,3)	涨停板价	涨停板价
LowerLimitPrice	number(12,3)	跌停板价	跌停板价
PreDelta	number(10,4)	昨虚实度	期权用的昨日虚实度
CurrDelta	number(10,4)	今虚实度	期权用的今日虚实度
UpdateTime	char(8)	最后修改时间	最后修改时间
UpdateMillisec	number(3)	最后修改毫秒	最后修改毫秒
InstrumentID	char(30)	合约代码	合约在系统中的编号

附件 2

申请 Level-2 行情的技术准备工作

申请中金所 Level-2 行情授权的，须采取直接连接交易所的方式获取行情数据，建立连接主中心至少 2 条，连接备中心至少 1 条专线，带宽应在 2M 以上（含）；或通过中金所或上海金融衍生品研究院有限责任公司授权的托管机房内的信息接入点驳接；或通过上海金融衍生品研究院有限责任公司授权的数据传输授权机构获取。

具体技术要求如下：

1、须先行完成相关行情接收程序的开发工作。开发完成后，可以接入互联网测试环境进行接口适应性测试。

2、完成行情接收程序的开发及互联网环境接口适应性测试之后，申请机构应当先行完成链路建设，通过中金所或上海金融衍生品研究院有限责任公司授权的托管机房内的信息接入点驳接。

3、完成上述两项技术准备之后，可与我司进行后续商务及协议谈判程序。

中金所行情信息业务联系人：

许颖菲，021-50160901，xuyf@cffex.com.cn