

中金所非展示型行情源数据服务

申请材料及流程简介（指定机房）

一、非展示型行情源数据

非展示型用途是指将中金所行情源数据用于展示、传输以外的用途。非展示型行情源数据通过特定的数据接口接收，数据类型为 Level-2 实时行情（又称“五档实时行情”，详细格式参见附件 2）。

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、服务申请流程

（1）提交申请材料：

材料 1. 《中国金融期货交易所非展示型行情源数据服务申请表（指定机房）》

材料 2. 工商行政管理部门核发的营业执照复印件；

材料 3. 金融牌照（如经营证券期货业务许可证等证书）复印件；

材料 4. 经会计师事务所审核的最近一个会计年度的财务报告（如有）；

材料 5. 技术方案书（包含权限管理系统及源数据分发系统的详细说明）；

材料 6. 机房说明书（是否自有机房、非自有机房是否有机柜租赁合同、机房建设标准等说明）；

材料 7. 申请机构简介；

材料 8. 特许行业者需附主管机关的许可证照（非特许行业者无需提供）。

材料 9. 承诺函

注：以上材料均需加盖单位公章。

（2）申请审批；

（3）审批通过后，申请机构开展技术准备工作，包括行情接口开发、链路建设（若从数据传输机构接入行情，需联系相关机构），同时双方沟通后续商务流程；

（4）机房现场检查；

（5）系统及环境验收完成后，双方签署协议，链路可进场；

（6）申请机构缴纳费用；

（7）服务开通。

3、数据使用要求

对申请机构的数据使用要求包括但不限于：

（1）按许可协议的用途、范围在许可有效期内使用非展示型行情源数据；

（2）对非展示型行情源数据的安全性负责，并保证对用户的有效管理；

（3）按《中金所非展示型行情源数据服务申请指引（指定机房）》及协议的要求对应用及其更新进行报备；

（4）按《中金所非展示型行情源数据服务申请指引（指定机房）》及协议的要求每月或每季向中金所数据有限公司报送应用数及缴费；

(5) 向中金所数据有限公司提供可实时查询应用数量的电子接口；

(6) 接受中金所数据有限公司的审计；

(7) 不得采取冒用中国金融期货交易所名义、夸大产品功能、贬损竞争对手等手段进行虚假、误导性宣传。

(8) 上述内容仅为事前告知，具体经营要求以许可单位和中金所签订的合同规定的内容为准。上述内容解释权和调整权归中国金融期货交易所所有。

附件：1. 中国金融期货交易所行情数据（Level-2）文件格式明细

中国金融期货交易所行情数据（Level-2） 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
Bid(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）
Ask(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
OpenInterest	number(19, 3)	持仓量	持仓量，单边统计
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