

## 大连商品交易所 Level-1 行情数据内容明细表

1、“基本最优行情”内容如下：

序号	字段	简要描述
1	交易日期	当前交易日，格式：YYYYMMDD，如 20180207
2	合约号	合约代号。
3	合约名称	合约名称。
4	最新价	最新成交价。套利定单直接成交，不刷新最新价。
5	最高价	当前交易日的最高成交价。套利定单直接成交，不刷新最高价。
6	最低价	当前交易日的最低成交价。套利定单直接成交，不刷新最低价。
7	最新成交量	最新一次撮合成交的成交量（单边）。
8	总成交量	成交总手数（单边）。
9	成交额	当前交易日交易期间所有成交合约的成交金额（单边）。计算公式：成交额=∑成交价*成交量*交易单位（单边）。
10	初始持仓量	上一交易日结算后，交易者所持有的未平仓合约的单边数量。
11	持仓量	当前交易日交易期间交易者所持有的未平仓合约的单边数量。
12	持仓量变化	计算公式：持仓量变化=持仓量-初始持仓量。
13	今结算价	当前交易日结算价。
14	历史最低价	从上市以来的最低成交价格。
15	历史最高价	从上市以来的最高成交价格。
16	涨停板	当前交易日价格涨幅的上限。
17	跌停板	当前交易日价格跌幅的上限。
18	上日结算价	上一交易日的结算价。
19	上日收盘价	上一交易日的收盘价。
20	最高买价	当日交易所交易系统中未成交的最高买价位。
21	申买量	当日交易所交易系统中未成交的最高价位申请买入的下单数量，包含了申买推导量。
22	申买推导量	最优买价位上，由套利定单推导出来的该合约的申买数量。
23	最低卖价	当日交易所交易系统中未成交的最低卖价位。
24	申卖量	当日交易所交易系统中未成交的最低价位申请卖出的下单数量，包含了申卖推导量。
25	申卖推导量	最低卖价位上，由套利定单推导出来的该合约的申卖数量。
26	当日均价	该合约当前成交均价。双边总成交额/（双边总成交量*合约单位），按 tick 向下取整。
27	开盘价	集合竞价产生开盘价；集合竞价未产生开盘价的，取开市后第一笔成交价。
28	收盘价	指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价，闭市时更改此值。
29	生成时间	行情产生时的当前时间（即撮合产生此行情的时间）。时间精度为毫秒。

2、“套利最优行情”内容如下：

序号	字段	简要描述
1	交易日期	当前交易日，格式：YYYYMMDD。
2	套利合约号	格式：套利策略腿 1 合约代码&腿 2 合约代码。 套利策略有 SP 跨期套利，SPC 跨品种套利。
3	最新价	始终是 0，没有值。
4	最高价	始终是 0，没有值。
5	最低价	始终是 0，没有值。
6	历史最高价	始终是 0，没有值。
7	历史最低价	始终是 0，没有值。
8	涨停板	第一个合约涨停板价—第二个合约跌停板价。
9	跌停板	第一个合约跌停板价—第二个合约涨停板价。
10	最高买价	当日买方申请套利定单买入的即时最高价格。
11	申买量	当日交易所交易系统中未成交的最高价位申请买入的套利定单的下单数量。
12	最低卖价	当日卖方申请套利定单卖出的即时最低价格。
13	申卖量	当日交易所交易系统中未成交的最低价位申请卖出的套利定单的下单数量。
14	生成时间	本次快照时间内最后一笔行情的产生时间。