

大商所 Level-2 历史数据格式说明

大连飞创信息技术有限公司

共通说明:

- ◆ 数据保存为 csv 文件，命名规则为 lv2qYYYYMMDD.csv。
- ◆ 数据格式为 UTF-8 编码，所有标点符号均为英文格式。
- ◆ 所有的行情数据都以;结尾
- ◆ 所有价格相关字段均保留 2 位小数，采用四舍五入原则
- ◆ 价格相关字段内容为无意义的数字时，记录为 N/A
- ◆ 所有行情格式为固定规则，没有内容的部分，每个字段记为空。如深度行情中只有 2 档内容，其余内容全部记为空，只保留逗号区分各字段。

1: 基本最优行情和深度行情

基本规则: b;最优行情(不同字段用','隔开) ;深度行情 1(不同字段用','隔开)|深度行情 2(不同字段用','隔开)... |深度行情 10(不同字段用','隔开);

详细规则:

b; 交易日期, 合约号, 事务编号, 合约名称, 最新价, 最高价, 最低价, 最新成交量, 成交量, 成交额, 初始持仓量, 持仓量, 持仓量变化, 今结算价, 历史最低价, 历史最高价, 涨停板, 跌停板, 上日结算价, 上日收盘价, 最高买, 申买量, 申买推导量, 最低卖, 申卖量, 申卖推导量, 当日均价, 生成时间, 开盘价, 收盘价; 价格 1, 委托量, 推导量, 买卖标志, 生成时间 | 价格 2, 委托量, 推导量, 买卖标志, 生成时间 | 价格 3, 委托量, 推导量, 买卖标志, 生成时间 | 价格 4, 委托量, 推导量, 买

卖标志, 生成时间|价格 5,委托量,推导量,买卖标志, 生成时间|价格 6,
委托量,推导量,买卖标志, 生成时间|价格 7,委托量,推导量,买卖标志,
生成时间|价格 8,委托量,推导量,买卖标志, 生成时间|价格 9,委托量,
推导量,买卖标志, 生成时间|价格 10,委托量,推导量,买卖标志,生成时
间;

举例:

b;20130201,a1303,0, 豆 一
1303,0.00,0.00,0.00,0,0,0.00,160,160,0,0.00,4160.00,5044.00,4992.00,46
08.00,4800.00,4800.00,4762.00,6,00,4982.00,2,0,0.00,08:55:06.818,
0.00,0.00;4762.00,6,0,1, 08:55:06.818|4612.00,2,0,1,
08:55:06.818|4982.00,2,0,3, 08:55:06.818|4612.00,2,0,1,
08:55:06.818|4982.00,2,0,3, 08:55:06.818|4612.00,2,0,1,
08:55:06.818|4982.00,2,0,3, 08:55:06.818|4612.00,2,0,1,
08:55:06.818|4982.00,2,0,3, 08:55:06.818|4612.00,2,0,1,
08:55:06.818|4982.00,2,0,3, 08:55:06.818;

2: 十笔委托行情

基本规则: c;十笔委托行情(不同字段用','隔开);

详细规则: c;合约号,买最优价格,委托量 1,委托量 2,委托量 3,委
托量 4,委托量 5,委托量 6,委托量 7,委托量 8,委托量 9,委托量 10,卖最
优价格,委托量 1,委托量 2,委托量 3,委托量 4,委托量 5,委托量 6,委托
量 7,委托量 8,委托量 9,委托量 10,生成时间;

举例:

c;a1201,4762.00,6,0,0,0,0,0,0,0,0,4982.00,2,0,0,0,0,0,0,0,0,0,09:01:05.

676;

3: 套利最优行情以及深度行情

基本规则: e;套利最优行情(不同字段用','隔开);深度行情 1(不同字段用','隔开)|深度行情 2(不同字段用','隔开) |.....| 深度行情 10(不同字段用','隔开);

详细规则: e;交易日期, 套利合约号, 事务编号, 最新价, 最低价, 最高价, 历史最低价, 历史最高价, 涨停板, 跌停板, 最高买, 申买量, 最低卖, 申卖量, 生成时间;价格 1,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 2,委托量,推导量,买卖标志, 生成时间|价格 3,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 4,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 5,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 6,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 7,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 8,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 9,委托量,推导量,买卖标志,生成时间|价格 10,委托量,推导量,买卖标志, 生成时间;

举例:

e;20130201,SP

a1305&a1309,0,0.00,0.00,0.00,0.00,0.00,402.00,-372.00,10.00,10,21.00,

1, 09:00:01.121, 09:00:01.000;10.00,10,0,1, 09:00:01.121,

09:00:01.000|9.00,3,0,1, 09:00:01.121, 09:00:01.000|-11.00,35,0,1,

09:00:01.121, 09:00:01.000|21.00,1,0,3, 09:00:01.121,
09:00:01.000|22.00,1,0,3, 09:00:01.121, 09:00:01.000|26.00,1,0,3,
09:00:01.121, 09:00:01.000|28.00,2,0,3, 09:00:01.121,
09:00:01.000|,,,,,|,,,,,|,,,,,;

4: 委托统计行情

基本规则: f;委托统计行情(不同字段用','隔开)

详细规则: f;合约号, 买委托总量, 卖委托总量, 加权平均委买价格, 加权平均委卖价格;

举例:

f;a1305,3247,1779,4777.51,4891.47;

5: 分价成交行情

基本规则: g;分价成交行情(不同字段用逗号隔开)

详细规则: 合约号,价格 1,买开数量,买平数量,卖开数量,卖平数量,价格 2,买开数量,买平数量,卖开数量,卖平数量,价格 3,买开数量,买平数量,卖开数量,卖平数量,价格 4,买开数量,买平数量,卖开数量,卖平数量,价格 5,买开数量,买平数量,卖开数量,卖平数量;

举例:

g;a1305,4845.00,27,40,11,3,4854.00,1,1,0,0,0.00,0,0,0,0,0.00,0,0,0,
0,0.00,0,0,0,0;

6: 实时结算行情

基本规则: h;实时结算行情(不同字段用逗号隔开)

详细规则: h;合约号,实时结算价;

举例:

h;a1303,0.00;