

大连商品交易所 Level-2 行情产品说明书

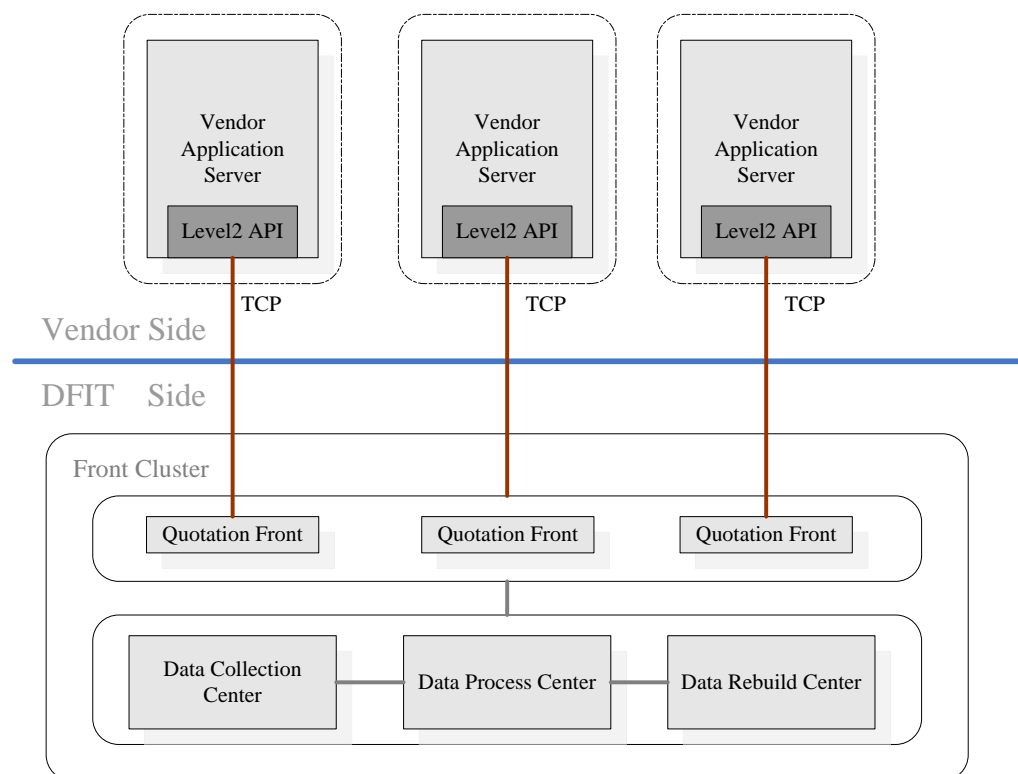
| | | | |
|------|--|------|---------------------|
| 文档状态 | <input type="checkbox"/> 初稿 | 文档标识 | DCE-Level-2-product |
| | <input type="checkbox"/> 评审通过 | 当前版本 | 1 |
| | <input type="checkbox"/> 修改 | 作者 | 苏树涛 |
| | <input checked="" type="checkbox"/> 发布 | 发布者 | 大连飞创信息技术有限公司 |
| | <input type="checkbox"/> 作废 | 完成日期 | 2012 年 5 月 9 日 |

概要说明：

本文档定义了Level-2系列所提供的数据的内容，供行情转发商参考。

大连商品交易所Level-2行情是大连商品交易所全资子公司---大连飞创信息技术有限公司借鉴国外期货市场信息产品服务的成功经验，凝聚期货专业人士及信息服务业者睿智，与多家信息服务商合作，有偿推出的期货市场增值信息服务。

DCE Level-2 系统由 4 大子系统组成：数据处理子系统、信息发布子系统、会员数据服务子系统、接入集群。DCE Level-2 系统结构如下图所示：



图表 1：系统简要架构图

获取 level-2 行情的信息商需获得飞创公司的授权许可，飞创为每个授权认证的信息服务商提供专用的 Level-2 API, 信息服务商通过 API 接收 TCP 行情数据流。Level-2 系统的外部数据接口为 FTD 协议，可以参考文档《期货交易数据交换协议》。Level-2 API 的使用方法请参考文件《大连商品交易所 Level 2 行情系统信息服务商接口说明》。Level-2 数据内容如下表所示：

| 内容 | 详细介绍 | 发布频率 (秒/次) |
|--------------------|--|---------------|
| 5 级深度委托行情 | 基本行情发布买一和卖一委托行情。大连商品交易所 Level-2 行情增加了买二到买五委托行情、卖二到卖五委托行情，形成了 5 级深度委托行情。 | 0.25 |
| 最佳买卖价位上前 10 笔分笔委托量 | 基本行情分别显示买一价位和卖一价位上的总委托量。大连商品交易所 Level-2 行情增加显示买一价位和卖一价位上前 10 笔分笔委托量行情。 | 0.25 |
| 加权平均委托买价格 | 大连商品交易所 Level-2 行情提供所有买委托单的加权平均委买价格。 | 0.25 |
| 加权平均委卖价格 | 大连商品交易所 Level-2 行情提供所有卖委托单的加权平均委卖价格。 | 0.25 |
| 委托买总量 | 大连商品交易所 Level-2 行情提供所有买委托单的委托买总量。 | 0.25 |
| 委托卖总量 | 大连商品交易所 Level-2 行情提供所有买委托单的委托卖总量。 | 0.25 |
| 实时结算价 | 大连商品交易所 Level-2 行情提供实时结算价。 | 6 |
| 分价位成交量统计 | 大连商品交易所 Level-2 行情提供分价位的成交量统计。Level-2 提供 5 个成交量最大的价位区间，分别显示每个价位区间上的买开、卖开、买平、卖平成交量。 | 6 |

按照数据包分类，Level-2 和基本行情的差异如下：

| 行情种类 | 数据包 | 输出频率（秒/次） |
|------------|----------------------------------|-----------|
| level-2 行情 | 直接市场最优行情+深度行情+最优报价委托数量行情+期权参数（空） | 0.25 |
| | 套利市场最优行情+深度行情（空）+最优报价委托数量行情（空） | 0.25 |
| | Level-2 实时结算价行情 | 6 |
| | Level-2 委托统计行情 | 0.25 |
| | Level-2 分价成交量行情 | 6 |
| 基本行情 | 直接市场最优行情+期权参数（空） | 0.5 |
| | 套利市场最优行情+深度行情（空）+最优报价委托数量行情（空） | 0.5 |

Level-2 行情的详细内容列表如下：

| 行情分类 | 数据包 | 数据内容 | 字段 | 输出频率（秒/次） |
|------------|---------|----------|-------|-----------|
| Level-2 行情 | 直接市场行情包 | 直接市场最优行情 | 交易日期 | 0.25 |
| | | | 合约号 | 0.25 |
| | | | 事务编号 | 0.25 |
| | | | 合约名称 | 0.25 |
| | | | 最新价 | 0.25 |
| | | | 最高价 | 0.25 |
| | | | 最低价 | 0.25 |
| | | | 最新成交量 | 0.25 |
| | | | 成交量 | 0.25 |
| | | | 成交额 | 0.25 |
| | | | 初始持仓量 | 0.25 |

| | | | | |
|------------|--|--|------------|------|
| | | | 持仓量 | 0.25 |
| | | | 持仓量变化 | 0.25 |
| | | | 今结算价 | 0.25 |
| | | | 历史最低价 | 0.25 |
| | | | 历史最高价 | 0.25 |
| | | | 涨停板 | 0.25 |
| | | | 跌停板 | 0.25 |
| | | | 上日结算价 | 0.25 |
| | | | 上日收盘价 | 0.25 |
| | | | 最高买 | 0.25 |
| | | | 申买量 | 0.25 |
| | | | 申买推导量 | 0.25 |
| | | | 最低卖 | 0.25 |
| | | | 申卖量 | 0.25 |
| | | | 申卖推导量 | 0.25 |
| | | | 当日均价 | 0.25 |
| | | | 生成时间 | 0.25 |
| | | | 开盘价 | 0.25 |
| | | | 收盘价 | 0.25 |
| | | | 最优买委托价格 | 0.25 |
| 最优报价委托数量行情 | | | 委托量 1 | 0.25 |
| | | | 买委托 1 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 2 | 0.25 |
| | | | 买委托 2 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 3 | 0.25 |
| | | | 买委托 3 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 4 | 0.25 |
| | | | | |

| | | | | |
|--|--|--|-------------|------|
| | | | 买委托 4 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 5 | 0.25 |
| | | | 买委托 5 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 6 | 0.25 |
| | | | 买委托 6 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 7 | 0.25 |
| | | | 买委托 7 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 8 | 0.25 |
| | | | 买委托 1 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 9 | 0.25 |
| | | | 买委托 9 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 10 | 0.25 |
| | | | 买委托 10 开平标志 | 0.25 |
| | | | 最优卖委托价格 | 0.25 |
| | | | 委托量 1 | 0.25 |
| | | | 卖委托 1 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 2 | 0.25 |
| | | | 卖委托 2 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 3 | 0.25 |
| | | | 卖委托 3 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 4 | 0.25 |
| | | | 卖委托 4 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 5 | 0.25 |
| | | | 卖委托 5 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 6 | 0.25 |
| | | | 卖委托 6 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 7 | 0.25 |

| | | | | |
|--|---------|--------|-------------|------|
| | | | 卖委托 7 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 8 | 0.25 |
| | | | 卖委托 8 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 9 | 0.25 |
| | | | 卖委托 9 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 10 | 0.25 |
| | | | 卖委托 10 开平标志 | 0.25 |
| | | | 生成时间 | 0.25 |
| | | 深度行情 | 价格 | 0.25 |
| | | | 委托量 | 0.25 |
| | | | 推导量 | 0.25 |
| | | | 买卖标志 | 0.25 |
| | | | 生成时间 | 0.25 |
| | | 期权行情 | 标的物价格 | 0.25 |
| | | | 标底物价格的波动率 | 0.25 |
| | | | 期权执行价格 | 0.25 |
| | | | 期权的当前价格 | 0.25 |
| | | | 国内无风险利率 | 0.25 |
| | | | 国外无风险利率 | 0.25 |
| | | | 距离到期日的剩余时间 | 0.25 |
| | | | 期权种类 | 0.25 |
| | 套利市场行情包 | 套利最优行情 | 交易日期 | 0.25 |
| | | | 套利合约号 | 0.25 |
| | | | 事务编号 | 0.25 |
| | | | 最新价 | 0.25 |
| | | | 最低价 | 0.25 |
| | | | 最高价 | 0.25 |

| | | | |
|------------|------------|---------------|---------|
| | | 历史最低价 | 0.25 |
| | | 历史最高价 | 0.25 |
| | | 涨停板 | 0.25 |
| | | 跌停板 | 0.25 |
| | | 最高买 | 0.25 |
| | | 申买量 | 0.25 |
| | | 最低卖 | 0.25 |
| | | 申卖量 | 0.25 |
| | | 生成时间 | 0.25 |
| | | 最优报价委托数量行情（空） | 最优买委托价格 |
| | 委托量 1 | | 0.25 |
| | 买委托 1 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 2 | | 0.25 |
| | 买委托 2 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 3 | | 0.25 |
| | 买委托 3 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 4 | | 0.25 |
| | 买委托 4 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 5 | | 0.25 |
| | 买委托 5 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 6 | | 0.25 |
| | 买委托 6 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 7 | | 0.25 |
| | 买委托 7 开平标志 | | 0.25 |
| | 委托量 8 | 0.25 | |
| 买委托 1 开平标志 | 0.25 | | |
| 委托量 9 | 0.25 | | |

| | | | | |
|--|--|---------|-------------|------|
| | | | 买委托 9 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 10 | 0.25 |
| | | | 买委托 10 开平标志 | 0.25 |
| | | | 最优卖委托价格 | 0.25 |
| | | | 委托量 1 | 0.25 |
| | | | 卖委托 1 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 2 | 0.25 |
| | | | 卖委托 2 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 3 | 0.25 |
| | | | 卖委托 3 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 4 | 0.25 |
| | | | 卖委托 4 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 5 | 0.25 |
| | | | 卖委托 5 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 6 | 0.25 |
| | | | 卖委托 6 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 7 | 0.25 |
| | | | 卖委托 7 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 8 | 0.25 |
| | | | 卖委托 8 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 9 | 0.25 |
| | | | 卖委托 9 开平标志 | 0.25 |
| | | | 委托量 10 | 0.25 |
| | | | 卖委托 10 开平标志 | 0.25 |
| | | | 生成时间 | 0.25 |
| | | 深度行情(空) | 价格 | 0.25 |
| | | | 委托量 | 0.25 |

| | | | | |
|------------------|-----------------|--|------|------|
| | | | 推导量 | 0.25 |
| | | | 买卖标志 | 0.25 |
| | | | 生成时间 | 0.25 |
| | | | 合约号 | 6 |
| Level-2 分价成交量行情包 | Level-2 分价成交量行情 | | 价格 | 6 |
| | | | 买开数量 | 6 |
| | | | 买平数量 | 6 |
| | | | 卖开数量 | 6 |
| | | | 卖平数量 | 6 |
| | | | 价格 | 6 |
| | | | 买开数量 | 6 |
| | | | 买平数量 | 6 |
| | | | 卖开数量 | 6 |
| | | | 卖平数量 | 6 |
| | | | 价格 | 6 |
| | | | 买开数量 | 6 |
| | | | 买平数量 | 6 |
| | | | 卖开数量 | 6 |
| | | | 卖平数量 | 6 |
| | | | 价格 | 6 |
| | | | 买开数量 | 6 |
| | | | 买平数量 | 6 |
| | | | 卖开数量 | 6 |
| | | | 卖平数量 | 6 |
| | | | 价格 | 6 |
| | | | 买开数量 | 6 |
| | | | 买平数量 | 6 |

| | | | | |
|--|------------------|-----------------|----------|------|
| | | | 卖开数量 | 6 |
| | | | 卖平数量 | 6 |
| | Level-2 委托统计行情包 | Level-2 委托统计行情 | 合约号 | 0.25 |
| | | | 买委托总量 | 0.25 |
| | | | 卖委托总量 | 0.25 |
| | | | 加权平均委买价格 | 0.25 |
| | | | 加权平均委卖价格 | 0.25 |
| | Level-2 实时结算价行情包 | Level-2 实时结算价行情 | 合约号 | 6 |
| | | | 实时结算价 | 6 |