如何看懂大商所Level-2

大商所level-2行情是飞创公司向期货市场推出的一款高端行情产品，level-2行情主要的特点是发布频率高（**每秒4次**），数据内容更多（**包含深度行情、十笔委托行情、委托统计行情、分价成交行情、实时结算行情等8项指标**）。目前level-2行情的存储方式以字符流的形式保存，每天形成一个文档，可以直接用程序调用level-2文件进行数据挖掘及测算。为了方便各位更好的了解level-2文件包里面到底有哪些内容，下面我将举例为大家介绍level-2行情的录制规则。

**1：基本最优行情和深度行情**

**规则：**b；最优行情(不同字段用‘，’隔开）；深度行情1(不同字段用逗号隔开)|深度行情2(不同字段用逗号隔开)... ....

**范例：**为了方便观察特将数据进行了转置处理。数据顺序与数据包数据顺序相同。

|  |  |
| --- | --- |
| 交易日期 | b;20120802 |
| 合约号 | a1209 |
| 事务编号 | 0 |
| 合约名称 | 豆一1209 |
| 最新价 | 4600 |
| 最高价 | 4600 |
| 最低价 | 4600 |
| 最新成交量 | 10 |
| 成交量 | 10 |
| 成交额 | 460000 |
| 初始持仓量 | 18624 |
| 持仓量 | 18624 |
| 持仓量变化 | 0 |
| 今结算价 | 0 |
| 历史最低价 | 4160 |
| 历史最高价 | 4942 |
| 涨停板 | 4830 |
| 跌停板 | 4460 |
| 上日结算价 | 4645 |
| 上日收盘价 | 4629 |
| 最高买 | 4600 |
| 申买量 | 106 |
| 申买推导量 | 0 |
| 最低卖 | 4605 |
| 申卖量 | 3 |
| 申卖推导量 | 0 |
| 当日均价 | 4600 |
| 生成时间 | 59:01.0 |
| 开盘价 | 4600 |
| 收盘价 | 0.00; |
| 价格 | 4600 |
| 委托量 | 106 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |4597.00 |
| 委托量 | 111 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |4592.00 |
| 委托量 | 111 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |4587.00 |
| 委托量 | 111 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |4580.00 |
| 委托量 | 111 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |4605.00 |
| 委托量 | 3 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 3 |
| 价格 | |4614.00 |
| 委托量 | 2 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 3 |
| 价格 | |4622.00 |
| 委托量 | 1 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 3 |
| 价格 | |4647.00 |
| 委托量 | 20 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 3 |
| 价格 | |4654.00 |
| 委托量 | 8 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 3 |
| 生成时间 | ;1343869140.90 |

**2：十笔委托行情**

**规则：**c; 十笔委托行情(不同字段用‘，’隔开）

**范例：**为了方便观察特将数据进行了转置处理。数据顺序与数据包数据顺序相同。

|  |  |
| --- | --- |
| 价格 | c;4600.00 |
| 委托量1 | 106 |
| 委托量2 | 0 |
| 委托量3 | 0 |
| 委托量4 | 0 |
| 委托量5 | 0 |
| 委托量6 | 0 |
| 委托量7 | 0 |
| 委托量8 | 0 |
| 委托量9 | 0 |
| 委托量10 | 0 |
| 价格 | 4605 |
| 委托量1 | 3 |
| 委托量2 | 0 |
| 委托量3 | 0 |
| 委托量4 | 0 |
| 委托量5 | 0 |
| 委托量6 | 0 |
| 委托量7 | 0 |
| 委托量8 | 0 |
| 委托量9 | 0 |
| 委托量10 | 0 |
| 生成时间 | ;1343869140.90 |

**3：期权行情**

**规则：**d；期权行情(不同字段用‘，’隔开）

**范例：**目前所内尚无期权交易，所以暂无实例。

**4：套利最优行情以及深度行情**

**规则：**e； 套利最优以及深度行情（格式与最优行情相同）

**范例：**为了方便观察特将数据进行了转置处理。数据顺序与数据包数据顺序相同。

|  |  |
| --- | --- |
| 交易日期 | e;20120802 |
| 套利合约号 | SP a1209&a1301 |
| 事务编号 | 0 |
| 最新价 | 0 |
| 最低价 | 0 |
| 最高价 | 0 |
| 历史最低价 | 0 |
| 历史最高价 | 0 |
| 涨停板 | 249 |
| 跌停板 | -501 |
| 最高买 | -129 |
| 申买量 | 5 |
| 最低卖 | 0 |
| 申卖量 | 0 |
| 生成时间 | 9:00:00 |
| 价格 | ;-129.00 |
| 委托量 | 5 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |-135.00 |
| 委托量 | 20 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 价格 | |-139.00 |
| 委托量 | 1 |
| 推导量 | 0 |
| 买卖标志 | 1 |
| 生成时间 | ;1343869198.842 |

**5：委托统计行情**

**规则：**f；委托统计行情(不同字段用‘，’隔开）

**范例：**数据顺序与数据包数据顺序相同。

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 生成时间 |
| f;a1301 | 3309 | 3795 | 4656.4 | 4771.36 | ;1343869198.846 |

**6：分价成交行情**

**规则：**g；分价成交行情(不同字段用‘，’隔开）

**范例：**为了方便观察特将数据进行了转置处理。数据顺序与数据包数据顺序相同。

|  |  |
| --- | --- |
| 合约号 | g;m1301 |
| 价格 | 3948 |
| 买开数量 | 3001 |
| 买平数量 | 2175 |
| 卖开数量 | 2871 |
| 卖平数量 | 3696 |
| 价格 | 3954 |
| 买开数量 | 390 |
| 买平数量 | 316 |
| 卖开数量 | 61 |
| 卖平数量 | 135 |
| 价格 | 3951 |
| 买开数量 | 301 |
| 买平数量 | 174 |
| 卖开数量 | 35 |
| 卖平数量 | 161 |
| 价格 | 3945 |
| 买开数量 | 27 |
| 买平数量 | 0 |
| 卖开数量 | 13 |
| 卖平数量 | 40 |
| 价格 | 0 |
| 买开数量 | 0 |
| 买平数量 | 0 |
| 卖开数量 | 0 |
| 卖平数量 | 0 |
| 生成时间 | ;1343869200.489 |

**7：实时结算行情**

**规则：**h；实时结算行情(不同字段用‘，’隔开）

**范例：**数据顺序与数据包数据顺序相同。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 合约号 | 实时结算价 | 生成时间 |
| h;a1303 | 0 | ;1343869211.383 |

以上，为level-2行情数据包内字段的编制规则及范例，请大家对照编制规则理解level-2行情的字段含义，希望level-2行情能助各位在期市投资一臂之力。

飞创公司

2012/8/7