



Data is the future

# 万得行情分钟数据标准

版本 v2.1

2020.06.16



Win.d

# Catalog

<b>1</b>	<b>背景介绍.....</b>	<b>1</b>
<b>2</b>	<b>处理规则.....</b>	<b>1</b>
2.1	1 分钟线处理规则.....	1
2.2	5、10、15 分钟线处理规则.....	1
2.3	30、60、120、240 分钟处理规则.....	2
2.4	周、月、季、半年、年线处理规则 .....	3

# 1 背景介绍

分钟数据是 tick 数据基础上加工而成的行情数据，大量的日内交易产品均是基于分钟数据进行分析，为规范分钟数据加工处理，特制定本标准，以明确万得行情分钟数据的相关处理规则。

## 2 处理规则

### 2.1 1 分钟线处理规则

对 1 分钟线采取去尾原则进行处理。例如：

[10:30:00-10:30:59) -> 10:30

[10:31:00-10:31:59) -> 10:31

对国内六所（沪、深、中金、上期、大商、郑商）、港股及部分万得指数（A 股指数、国内品种期货指数）的集合竞价及特殊时点（如收盘时点、沪铜的 21:00 点等）进行“特殊处理”：

- 开盘数据处理方式：不出现集合竞价 1 分钟线，以及交易开始时间之前的 1 分钟线，均合并入当日第一根 1 分钟线（例如，沪深股票第一根线为 9:30，上期所、郑商所、大商所夜盘品种第一根线为 21:00）；
- 收盘数据处理方式：不出现交易结束时间后的 1 分钟线，如有交易结束时间后的数据，则合并入当日最后一根 1 分钟线（如沪深股票，15:00）。
- 沪深股票按上述理论，最多会出现 242 根 1 分钟 K 线（11:30 及 15:00 有成交明细）

### 2.2 5、10、15 分钟线处理规则

按交易日开盘时间，以变频周期进行切分。如：

- 9:31 9:32 9:33 9:34 9:35 -> 9:35（5 分钟线）
- 9:31 9:32 9:33 9:34 9:35 9:36 9:37 9:38 9:39 9:40 -> 9:40（10 分钟线）

按数据驱动方式以区间结束时间作为 K 线的显示时间（如下，**粗体下划线**的时间将是在 K

线图上显示的时间):

9:31 9:32 9:33 9:34 9:35 | 9:36 9:37 9:38 9:39 9:40 | 9:41 9:42 9:43 9:44 9:45 |  
9:46 9:47 9:48 9:49 9:50 | 9:51 9:52 9:53 9:54 9:55 | 9:56 9:57 9:58 9:59 10:00 |  
10:01 10:02 10:03

早盘、午休、茶歇等特殊时间的处理方式：

- 合并 9:30、9:31 为 9:31 分数据参与所有变频计算
- 合并 13:00、13:01 为 13:01 数据参与所有变频计算
- 合并期货茶歇时段（如上期所 郑商所 大商所）10:30、10:31 为 10:31 数据参与所有变频计算

## 2.3 30、60、120、240 分钟处理规则

由 1 分钟线变频为 30、60、120、240 分钟线有以下两个原则：

原则 1：足额交易时间切分原则（适用非 24 小时交易）

原则 2：自然时钟切分原则（适用 24 小时交易）

对于沪深交易所（A 股、B 股）、中金所（股指期货、国债期货）、港交所（含股票、港股权证，不含港股期货和港股期权）、NYSE 和 NASDAQ（美股）及这些交易所交易的基金、期权、债券和关联指数等，采用原则 1 “足额交易时间切分原则” 进行处理。

沪深 A 股、中金所股指期货，交易时间为 9:30-11:30、13:00-15:00

30 分钟线：10:00、10:30、11:00、11:30、13:30、14:00、14:30、15:00

60 分钟线：10:30、11:30、14:00、15:00

港股，交易时间为 9:30-12:00、13:00-16:00

30 分钟线：10:00、10:30、11:00、11:30、12:00、13:30、14:00、14:30、15:00、15:30、16:00

60 分钟线：10:30、11:30、13:30、14:30、15:30、16:00

中金所国债期货，交易时间为 9:30-11:30、13:00-15:15

30 分钟线：10:00、10:30、11:00、11:30、13:30、14:00、14:30、15:00、15:15

60 分钟线：10:30、11:30、14:00、15:00、15:15

注：中金所国债期货交易时段在 2020 年 07 月 20 日修改之前

中金所国债期货，交易时间为 9:15-11:30、13:00-15:15

30 分钟线：9:45、10:15、10:45、11:15、13:15、13:45、14:15、14:45、15:15

60 分钟线：10:15、11:15、13:45、14:45、15:15

**对于多时段交易、24 小时连续交易或接近 24 小时交易的商品期货、外汇、期权、指数等交易品种采用原则 2 “自然时钟切分原则” 进行处理。**

上期所黄金品种，交易时间为 20:59，21:00~(次日)2:30，9:00~10:15，10:30~11:30，13:30~15:00

30 分钟线：21:30、22:00、22:30、23:00、23:30、24:00、0:30、1:00、1:30、2:00、2:30、9:30、10:00、10:30、11:00、11:30、14:00、14:30、15:00

60 分钟线：22:00、23:00、24:00、1:00、2:00、2:30、10:00、11:00、11:30、14:00、15:00

## **2.4 周、月、季、半年、年线处理规则**

以自然周、月、季、半年、年进行数据切分，以区间最后一个交易日期标注为 K 线日期。

In virtue of specific privileged information in relation to technology and business practice contained in this document, all materials herein shall be kept strictly confidential. As an authorized client of our company, you shall make promises not to disclose any information herein to any third.



Wind Information Co., Ltd.

Add: 7/F Wind Plaza, No.1500 Puming Road, Shanghai, China

Tel: (8621) 2070 0800

Fax: (8621) 2070 0888

Email: [sales@wind.com.cn](mailto:sales@wind.com.cn)

Http: [//www.wind.com.cn](http://www.wind.com.cn)