

广州期货交易所深度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	最新一次撮合成交易的成交量（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	当日买方申请套利订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订单的下单数量。
12	最低卖价	当日卖方申请套利订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订单的下单数量。
14	生成时间	本次快照时间内最后一笔行情的产生时间。

3、“五档深度委托行情”内容如下

序号	字段	简要描述
1	价格 (1-5 档)	档位委托价格。
2	委托量	在该委托价格上的委托量, 包含了由套利订单推导出来的推导量。
3	推导量	由套利订单推导出来的推导量, 套利合约的深度行情该字段一直为 0。
4	买卖标志	1 是买, 3 是卖。
5	生成时间	值为空。

4、“最优价位前十笔委托量”内容如下

序号	字段	简要描述
1	买最优价格	基本定单中的买方向的最优价格。
2	委托量(1-10笔)	最优价上,按时间排序的前10笔委托。
3	卖最优价格	基本定单中的卖方向的最优价格。
4	委托量(1-10笔)	最优价上,按时间排序的前10笔委托。
5	生成时间	值为空

5、“委托统计行情”内容如下

序号	字段	简要描述
1	合约号	合约代号。
2	买委托总量	所有买委托单的委托买总量,不包括推导量。
3	卖委托总量	所有卖委托单的委托卖总量,不包括推导量。
4	加权平均委买价格	买方向所有委托的加权平均价,计算公式= $\Sigma(\text{委托价} \times \text{委托量}) / \text{买委托总量}$ 。
5	加权平均委卖价格	卖方向所有委托的加权平均价,计算公式= $\Sigma(\text{委托价} \times \text{委托量}) / \text{卖委托总量}$ 。

6、“分价位成交量”内容如下

序号	字段	简要描述
1	合约号	合约代号。
2	价格1	成交量第一大的价位区间。 每个成交价位区间涵盖三个 tick 值,每个价位区间的价格标识为这三个 tick 价位的最小值。
3	买开数量1	对应价格1区间内买开成交数量。
4	买平数量1	对应价格1区间内买平成成交数量。
5	卖开数量1	对应价格1区间内卖开成交数量。
6	卖平数量1	对应价格1区间内卖平成成交数量。
7	价格2	成交量第二大的价位区间。
8	买开数量2	对应价格2区间内买开成交数量。
9	买平数量2	对应价格2区间内买平成成交数量。
10	卖开数量2	对应价格2区间内卖开成交数量。

11	卖平数量 2	对应价格 2 区间内卖平成交数量。
12	价格 3	成交量第二大的价位区间。
13	买开数量 3	对应价格 3 区间内买开成交数量。
14	买平数量 3	对应价格 3 区间内买平成交数量。
15	卖开数量 3	对应价格 3 区间内卖开成交数量。
16	卖平数量 3	对应价格 3 区间内卖平成交数量。
17	价格 4	成交量第二大的价位区间。
18	买开数量 4	对应价格 4 区间内买开成交数量。
19	买平数量 4	对应价格 4 区间内买平成交数量。
20	卖开数量 4	对应价格 4 区间内卖开成交数量。
21	卖平数量 4	对应价格 4 区间内卖平成交数量。
22	价格 5	成交量第二大的价位区间。
23	买开数量 5	对应价格 5 区间内买开成交数量。
24	买平数量 5	对应价格 5 区间内买平成交数量。
25	卖开数量 5	对应价格 5 区间内卖开成交数量。
27	卖平数量 5	对应价格 5 区间内卖平成交数量。

7、“实时结算价”内容如下

序号	字段	简要描述
1	合约号	合约代号。
2	实时结算价	某合约当天的成交价格按照成交量的加权平均。 计算公式：当日均价=成交额/成交量。