

LEVEL2 数据说明

网址：www.sdata.vip

管理员微信：oldjack2010

Level2逐笔全息数据说明

Wena

Level2逐笔全息数据定义：沪深两市所有股票每日逐笔成交明细，含委托信息

和分时成交数据区别：分时成交数据是指在一定时间内的成交和，如3秒内所有成交手数算在一起，是买单还是卖单；而level2逐笔成交是每笔真实成交，时间间隔可能只有几毫秒

字段包含：交易id(A列)，成交时间(B列)，成交价格(C列)，每笔成交量(D列)，卖单挂单量(E列)，买单挂单量(F列)，买卖单种类(G列)，卖单ID(H列)，卖单挂单价格(I列)，买单ID(J列)，买单挂单价格(K列)

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	
TranID	Time	Price	Volume	SaleOrder	BuyOrder	WType	SaleOrder	SaleOrder	BuyOrder	I	BuyOrder	Price
1349	9:25:00	26.94	200	200	700	B	103020	26.94	48019	26.94		
1350	9:25:00	26.94	200	200	700	B	136874	26.94	48019	26.94		
1351	9:25:00	26.94	200	200	700	B	144686	26.94	48019	26.94		
1352	9:25:00	26.94	100	300	700	B	148587	26.94	48019	26.94		
1353	9:25:00	26.94	200	300	700	B	148587	26.94	69513	26.94		
1354	9:25:00	26.94	400	400	700	B	154643	26.94	69513	26.94		
1355	9:25:00	26.94	100	100	700	B	149814	26.94	69513	26.94		
95544	9:30:00	26.93	3100	3100	3100	B	174387	26.93	181000	26.93		
105347	9:30:00	26.8	300	300	11100	B	185536	26.8	177873	26.8		
195044	9:30:02	26.88	1500	1500	1500	B	207146	26.88	249701	26.88		
216512	9:30:06	26.87	500	1900	500	B	269005	26.87	274581	26.87		
219389	9:30:08	26.86	300	300	300	B	275679	26.86	278366	26.86		
220841	9:30:09	26.8	500	500	11100	S	279939	26.8	177873	26.8		
223512	9:30:12	26.8	200	200	11100	S	282076	26.8	177873	26.8		
223514	9:30:12	26.8	200	200	11100	S	282081	26.8	177873	26.8		
223530	9:30:12	26.8	100	100	11100	S	282105	26.8	177873	26.8		
223553	9:30:12	26.8	200	200	11100	S	282143	26.8	177873	26.8		
226029	9:30:12	26.8	100	100	11100	S	282513	26.8	177873	26.8		
230604	9:30:17	26.8	100	100	11100	S	286443	26.8	177873	26.8		

Level2数据网址：<http://www.sdata.vip/>

L2数据说明：字段解释

Level2数据解释

交易id(A列)：交易的成交id，机器自动生成

成交时间(B列)：每一笔的成交时间，到秒

成交价格(C列)：每笔成交价

每笔成交量(D列)：每笔成交量，单位是股，不是手

卖单挂单量(E列)：卖单挂单量，单位是股，不是手

买单挂单量(F列)：买单挂单量，单位是股，不是手

买卖单种类(G列)：B代表主买，S是主卖

卖单ID (H列)：卖单ID

卖单挂单价格(I列)：卖单挂单价格

买单ID (J列)：买单ID

买单挂单价格(K列)：买单挂单价格

L2数据说明 2018-7-16到2019-2-28

Level2全息数据定义：沪深两市所有股票每日逐笔成交明细，**含委托信息**

和分时成交数据区别：分时成交数据是指在一定时间内的成交和，如3秒内所有成交手数算在一起，是买单还是卖单；而level2逐笔成交是每笔真实成交，时间间隔可能只有几毫秒

字段包含：成交时间(A列)，成交价格(B列)，每笔成交量(C列)，主动买卖属性(D列)，买委托价(E列)，买单委托数量(F列)，买单ID(G列)，买单成交状态(H列)，卖单委托价格(I列)，卖单委托数量(J列)，卖单ID(K列)，买单成交状态(L列)

深市

成交时间	成交价格	成交数量	主动买卖属性	买委托价格	买委托数量	买成交序号	买单成交状态	卖委托价格	卖委托数量	卖成交序号	卖单成交状态
2018/7/16 9:25	10.45	5	B	10.46	5	1	b*●	10	30	1	s*▲
2018/7/16 9:25	10.45	25	B	10.45	100	2	b*▲	10	30	1	s*▼
2018/7/16 9:30	10.45	18	S	10.45	100	2	b*◆	10.45	18	3	s*●
2018/7/16 9:30	10.45	14	S	10.45	100	2	b*◆	10.45	14	4	s*●
2018/7/16 9:30	10.45	1	S	10.45	100	2	b*◆	10.45	1	5	s*●
2018/7/16 9:30	10.45	1	S	10.45	100	2	b*◆	10.45	1	6	s*●

上市

成交时间	成交价格	成交数量	主动买卖属性	买委托价格	买委托数量	买成交序号	买单成交状态	卖委托价格	卖委托数量	卖成交序号	卖单成交状态
2018/7/13 9:25	9.57	1	B	0	3	38521	b*▲	0	1	27878	s*●
2018/7/13 9:25	9.57	2	B	0	3	38521	b*▼	0	120	8159	s*▲
2018/7/13 9:25	9.57	118	B	0	583	74997	b*▲	0	120	8159	s*▼
2018/7/13 9:25	9.57	146	B	0	583	74997	b*◆	0	146	8160	s*●
2018/7/13 9:25	9.57	41	B	0	583	74997	b*◆	0	41	31878	s*●
2018/7/13 9:25	9.57	5	B	0	583	74997	b*◆	0	5	15326	s*●

上市无委托价格，可用成交价代替

L2数据说明2018-7-16到2019-2-28

Level2数据解释

成交时间(A列)：什么时间成交，每秒可能有很多成交

成交价格(B列)：什么价位成交

每笔成交量(C列)：重要字段，每笔真实成交量，最细数据，单位是手

主动买买属性(D列)：是买单还是卖单，买是B(buy)，卖是S(sell)

买委托价(E列)：挂单是买，买的价格是多少

买单委托数量(F列)：买单挂单时的量，不是成交量，单位是手

买单ID (G列)：挂单是买，会有一个买单号

买单成交状态(H列)：b*▲成交开始，b*◆正在成交，b*▼成交结束，b*●完全成交

卖单委托价格 (I列)：挂单是卖，卖的价格是多少

卖单委托数量(J列)：卖单挂单时的量，不是成交量，单位是手

卖单ID (K列)：挂单是卖，会有一个卖单号

卖单成交状态(L列)：s*▲成交开始，s*◆正在成交，s*▼成交结束，s*●完全成交

注：b*●完全成交
代表一次性成交

价量数据 - 说明

价量数据 解释

- 价格成交量数据：沪深两市所有股票每日开盘，收盘，最高，最低价，成交量数据。

	A	B	C	D	E	F	G	H
1	股票代码	日期	开盘价	最高价	最低价	收盘价	成交量	
2	sz300338	2017/7/18	19.41	19.88	19.07	19.5	10581	
3	sz300338	2017/7/17	20.8	20.8	19.28	19.58	16517	
4	sz300338	2017/7/14	21.2	21.25	20.6	20.8	15342	
5	sz300338	2017/7/13	21.2	21.45	20.95	21.25	5451	
6	sz300338	2017/7/12	21.55	21.7	20.9	21.2	15549	
7	sz300338	2017/7/11	21.68	22.14	20.94	21.87	13223	
8	sz300338	2017/7/10	22.2	22.2	21.59	21.7	7948	
9	sz300338	2017/7/7	21.68	22.2	21.6	22.05	8959	
10	sz300338	2017/7/6	21.57	21.85	21.45	21.6	5736	
11	sz300338	2017/7/5	21.61	21.9	21.49	21.66	7340	
12	sz300338	2017/7/4	21.7	21.84	21.49	21.61	8245	
13	sz300338	2017/7/3	21.55	21.87	21.55	21.7	13927	
14	sz300338	2017/6/30	20.73	21.5	20.44	21.5	17752	
15	sz300338	2017/6/29	20.4	20.91	20.4	20.73	12998	
16	sz300338	2017/6/28	20.71	20.72	20.28	20.48	14012	

账号获取

- 获取账号请联系管理员微信号oldjack2010，注明“股票”。
- Level2股票逐笔成交数据服务价格仅为209元，只需一顿饭的价格，您就可获得1年的会员资格。加微信号红包209元给管理员即可。
- 获取会员后，**您可下载两年的Level2数据**。例如，您在2016年8月8日获得会员资格，您登录后可下载2015年8月到2016年8月的所有L2数据，以及2016年8月8日到2017年8月7日的Level2数据。
- 网站有数据统计工具，可下载整理数据。