

# 沪深 Level2 实时推送行情接口数据说明

## 一、数据范围

数据范围包括上交所+深交所的逐笔成交、逐笔委托，品种包括A股、B股、债券、ETF等等。  
由于行情快照用户较少暂不提供，如有需要联系客服沟通定制。

## 二、接入方式

通信方式采用TCP实时推送数据，支持C++/C#/Python/PHP/JAVA等各种语言接入，简单易用。其中提供Python范例，零代码即可体验。

1、首先通过socket发起connect连接服务地址端口；

2、连接成功后，全量推送只需发送【用户口令】进行登录；订阅接入需要发送【用户口令+逗号+订阅代码】进行登录，股票代码为6位字符用逗号拼接（订阅后不能增删，如需调整则重新登录即可）。

#如果登录成功，会收到数据(盘中)或心跳(休市)；

#如果登录失败，会收不到回应。

（联系客服获取服务地址端口、用户口令、范例代码）

## 三、推送规则

| 时段                   | 上证   |      | 深证           |    |
|----------------------|------|------|--------------|----|
|                      | 成交   | 委托   | 成交           | 委托 |
| 9:15-9:20<br>(可撤)    | 无    | 无    | 即时<br>(全是撤单) | 即时 |
| 9:20-9:25<br>(不可撤)   | 无    | 无    | 无            | 即时 |
| 9:25                 | 集中到达 | 集中到达 | 集中到达         | 无  |
| 9:30-11:30           | 即时   | 即时   | 即时           | 即时 |
| 13:00-14:57          | 即时   | 即时   | 即时           | 即时 |
| 14:57-15:00<br>(不可撤) | 无    | 无    | 无            | 即时 |
| 15:00                | 集中到达 | 集中到达 | 集中到达         | 无  |

备注：服务器服务时段为交易日 9:00-15:30，其他时段停机，建议 9:10 左右连接即可。

## 四、编码方式

接口通过TCP方式以固定长度字节数据形式，持续发送给客户端。数据编码采用大端模式（逐笔成交为42bytes，逐笔委托为26bytes），客户端接收数据后只需按照定长截取，然后进行解包处理，即可得到连续的结构化字段数据。（具体参考Python范例代码）

## 五、数据结构

### 1、逐笔成交 Trans

| 字段            | 类型     | 上证   | 深证  |
|---------------|--------|--|---|
| stock_code    | char*6 | 证券代码   | 证券代码  |
| created_at    | uint32 | 时间(时分秒毫秒)  | 时间(时分秒毫秒)   |
| trade_id      | uint32 | 成交编号   | 成交编号  |
| price         | uint32 | 成交单价(元/10000)  | 成交单价(元/10000)   |
| volume        | uint32 | 成交数量(股)  | 成交数量(股)   |
| amount        | uint64 | 成交金额(元)  | 成交金额(元)   |
| tx_dir        | uint8  | 交易方向：1-买方成交，2-卖方成交   | 交易方向：1-买方成交，2-卖方成交                                    |
| tx_kind       | uint8  | 交易类型：全部为0<br>(全是成交，不含撤单)   | 交易类型：0-成交，1-撤单<br>(撤单时，price=0，amount=0，需要对比 order)   |
| buy_order_id  | uint32 | 买方委托编号<br>(主动成交无委托记录，剩余转委托；被动成交都有委托记录，成交价一定等于委托价；集合竞价都有委托记录，成交价不一定等于委托价) | 买方委托编号<br>(主动被动都有委托记录；对手价扫单 1-5 档，未成转限价、转撤单；排队价被动成交)  |
| sell_order_id | uint32 | 卖方委托编号<br>(主动成交无委托记录，剩余转委托；被动成交都有委托记录，成交价一定等于委托价；集合竞价都有委托记录，成交价不一定等于委托价) | 卖方委托编号<br>(主动被动都有委托记录；对手价扫单 1-5 档，未成转限价、转撤单；本方优先只有被动) |

注：深证不能直接按照成交价计算订单簿，需要对照委托下单价。

## 2、逐笔委托 Order

| 字段         | 类型     | 上证   | 深证   |
|------------|--------|--|--|
| stock_code | char*6 | 证券代码   | 证券代码   |
| created_at | uint32 | 时间(时分秒毫秒)  | 时间(时分秒毫秒)  |
| order_id   | uint32 | 委托编号，也是撤单凭据<br>(不唯一，联合证券代码唯一。主动成交部分无委托记录)              | 委托编号，也是撤单凭据<br>(不唯一，联合证券代码唯一。主动成交部分有委托记录)                                  |
| price      | uint32 | 委托单价(元/10000)  | 委托单价(元/10000)  |
| volume     | uint32 | 委托数量(股)  | 委托数量(股)  |
| tx_dir     | uint8  | 交易方向：1-买入，2-卖出   | 交易方向：1-买入，2-卖出   |
| tx_kind    | uint8  | 交易类型：2-限价，10-撤单<br>(每笔撤单有对应下单，但撤单量可能小于下单量，因为部分成交剩余转限价) | 交易类型：1-对手价，2-限价，3-排队价<br>(限价价格与成交一致；对手价价格不准，因为主动成交剩余转限价或撤单；排队价价格不准，需要对比下单) |