

沪深股票 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 (可撤)	无	无	即时 (全是撤单)	即时
9:20-9:25 (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 (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 (全是成交，不含撤单)	交易类型：0-成交，1-撤单 (撤单时，price=0，amount=0，需要对比 order)
buy_order_id	uint32	买方委托编号 (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 (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 (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 (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)
separator	char*2	分隔符'#'	分隔符'#'

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 (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 (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 (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 (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)
separator	char*2	分隔符'#'	分隔符'#'