

SS_MARKET_Leve12 说明文档

TRAN code:000002.SZ time:144629250 14-46-29-280
TRAN code:000002.SZ time:144629240 14-46-29-280

实测上海阿里云内网互联延迟数据为交易所时间戳与本地时间（原子钟校准后）。（特别提示盘前数据峰值可达 20m/s 以上，因数据量较大对程序处理性能有一定考验，建议将必要数据存入内存字典中调用，以保证速度。撤单数据在深圳的逐笔成交中推送。）如有疑问请联系作者：QQ994143128

交易所	数据类型
上交所	十档行情快照 (Level-2)
	委托队列 (Level-2)
	逐笔成交 (Level-2)
深交所	十档行情快照 (Level-2)
	逐笔成交 (Level-2)
	逐笔委托 (Level-2)
	委托队列 (Level-2)
上海深圳交易所	期权

消息类型：

消息	说明
Market_Data	行情快照数据
Index_Data	指数行情快照数据
Tran_Data	逐笔成交

Queue_Data	委托队列
Order_Data	逐笔委托

1.1.1 MARKET_DATA

字段名	类型	备注
temp_x[0]	String	代码 如: 600001.SH
temp_x[1]	String	原始 Code 如: 600001
temp_x[2]	String	日期 (YYMMDD)
temp_x[3]	String	时间 (HHMMSSmmm)
temp_x[4]	String	状态 (0 开盘前, 1 集合竞价, 2 集合竞价至连续竞价, 3 连续竞价, 4 中午休市, 5 收盘集合竞价, 6 闭市)
temp_x[5]	String	前收盘价
temp_x[6]	String	开盘价
temp_x[7]	String	最高价
temp_x[8]	String	最低价
temp_x[9]	String	最新价
temp_x[10]-temp_x[19]	String	申卖价
temp_x[20]-temp_x[29]	String	申卖量
temp_x[30]-temp_x[39]	String	申买价
temp_x[40]-temp_x[49]	String	申买量
temp_x[50]	String	成交笔数
temp_x[51]	String	成交总量
temp_x[52]	String	成交总金额
temp_x[53]	String	委托买入总量
temp_x[54]	String	委托卖出总量
temp_x[55]	String	加权平均委买价格
temp_x[56]	String	加权平均委卖价格
temp_x[57]	String	涨停价
temp_x[58]	String	跌停价
temp_x[59]	String	买入总笔数, 仅上交所提供

temp_x[60]	String	卖出总笔数，仅上交所提供
temp_x[61]	String	买入撤单笔数，仅上交所提供
temp_x[62]	String	买入撤单数量，仅上交所提供
temp_x[63]	String	卖出撤单笔数，仅上交所提供
temp_x[64]	String	卖出撤单数量，仅上交所提供

1.1.2 INDEX_DATA

字段名	类型	备注
temp_x[0]	String	代码 如：600001.SH
temp_x[1]	String	原始 Code 如：600001
temp_x[2]	String	日期 (YYMMDD)
temp_x[3]	String	时间 (HHMMSSmmm)
temp_x[4]	String	开盘指数
temp_x[5]	String	最高指数
temp_x[6]	String	最低指数
temp_x[7]	String	最新指数
temp_x[8]	String	交易数量
temp_x[9]	String	成交金额
temp_x[10]	String	前收盘指数

1.1.3 TDF_ORDER_QUEUE

字段名	类型	备注
temp_x[0]	String	代码 如：600001.SH
temp_x[1]	String	原始 Code 如：600001
temp_x[2]	String	日期 (YYMMDD)
temp_x[3]	String	时间 (HHMMSSmmm)
temp_x[4]	String	卖一价
temp_x[5]	String	卖一队列数
temp_x[6]	String	买一价

temp_x[7]	String	买一队列数
temp_x[8]-temp_x[57]	String	卖订单明细
temp_x[58]-temp_x[107]	String	买订单明细

1.1.4 TDF_TRANSACTION

字段名	类型	备注
temp_x[0]	String	代码 如: 600001.SH
temp_x[1]	String	原始 Code 如: 600001
temp_x[2]	String	日期 (YYMMDD)
temp_x[3]	String	时间 (HHMMSSmmm)
temp_x[4]	String	成交编号
temp_x[5]	String	成交价格
temp_x[6]	String	成交数量
temp_x[7]	String	成交金额
temp_x[8]	String	成交方向 (0 方向不明 1 买方成交 2 卖方成交)
temp_x[9]	String	成交类别 (0 成交, 1 撤单)
temp_x[10]	String	频道代码 (无特殊意义)
temp_x[11]	String	叫卖方委托序号
temp_x[12]	String	叫买方委托序号

1.1.5 TDF_ORDER (仅深交所提供)

字段名	类型	备注
temp_x[0]	String	代码 如: 600001.SH
temp_x[1]	String	原始 Code 如: 600001
temp_x[2]	String	日期 (YYMMDD)
temp_x[3]	String	时间 (HHMMSSmmm)
temp_x[4]	String	委托号
temp_x[5]	String	委托价格
temp_x[6]	String	委托数量
temp_x[7]	String	委托类别 (1 市价 2 限价 3 本方优先)

temp_x[8]	String	委托代码(1 买 2 卖)
-----------	--------	---------------

Demo 请联系作者 994143128