



文档名称：

极速行情 EFH3.0 输出五档结构说明 ——支持上期所 SMDP2.0 协议

版本：

3.0

发布日期：

2018-12-13

版权声明：

本文档内容归属于盛立金融软件开发（杭州）有限公司的商业机密和知识产权。您不得擅自披露这些机密信息，您只有在和盛立金融软件开发（杭州）有限公司签订授权协议的情况下，遵循协议条款使用该文档内容。在未经盛立金融软件开发（杭州）有限公司书面同意的情况下，本文档中的任何信息不允许以任何方式或以任何形式予以复制和转发。盛立金融软件开发（杭州）有限公司有权在非另行通知的情况下对文档中所有或部分内容做修订和编辑。

1 概述

盛立极速行情系统(EFH3.0)在接收到上期所新一代(SMDP2.0)行情后转换成自定义的行情格式，通过 UDP 发送出来(采用组播方式)。转发的行情格式请参考 2.1 节

行情的组播地址可以通过极速行情系统的配置程序按用户的具体情况配置。

2 类型字段说明

类型	长度(字节)	对应 c/c++类型
uint8	1	unsigned char
uint16	2	unsigned short
uint32	4	unsigned int
uint64	8	unsigned long long int
int8	1	char
int16	2	short
int32	4	int
int64	8	long long int
byte	1	unsigned char
char	1	char
char[x]	x	char[]
double	8	double

3 自定义行情结构

3.1 深档行情信息

名称	类型	长度	说明
----	----	----	----

sequence	uint32	4	此通道的编号
exchange_id	char	1	市场说明 0 表示中金 1 表示上期
channel_id	char	1	表示从那个通道选出的数据
symbol_type_id	int	1	合约标志(当前版本恒为 0)
symbol_code	Int	4	合约编码
symbol	char	31	合约代码
snap_time	char	9	采样时间(到秒级)
snap_millisec	int32	4	毫秒级采样时间
quote_flag	char	1	恒为 3
last_px	double	8	最新价
volume	int32	4	最新总成交量
turnover	double	8	成交金额
open_interest	double	8	持仓量
bid1_px	double	8	买一价
bid1_share	int32	4	买一量
bid2_px	double	8	买二价
bid2_share	int32	4	买二量
bid3_px	double	8	买三价
bid3_share	int32	4	买三量
bid4_px	double	8	买四价
bid4_share	int32	4	买四量
bid5_px	double	8	买五价
bid5_share	int32	4	买五量
ask1_px	double	8	卖一价
ask1_share	int32	4	卖一量
ask2_px	double	8	卖二价
ask2_share	int32	4	卖二量
ask3_px	double	8	卖三价
ask3_share	int32	4	卖三量
ask4_px	double	8	卖四价
ask4_share	int32	4	卖四量
ask5_px	double	8	卖五价
ask5_share	int32	4	卖五量