



文档名称：

## **极速行情 EFH3.2 硬核输出结构说明**

### **——支持上期所 SMDP2.0 协议**

版本：

**3.2**

发布日期：

**2019-12-13**

## 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(EFH3.2)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 节至 2.4 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

### 2.1 期货 level1 输出的行情格式（72）

名称	类型	Offset	长度	说明
sequence	uint32	0	4	此通过的编号
exchange_id	char	4	1	市场说明 ‘1’ 表示上期 ‘2’ 表示金属指数 ‘7’ 表示能源
channel_id	uint8	5	1	表示从那个通道选出的数据
symbol	char	6	8	合约名称(左对齐右补\0)
update_time_h	uint8	14	1	最后更新的时间 hh
update_time_m	uint8	15	1	最后更新的时间 mm
update_time_s	uint8	16	1	最后更新的时间 ss
millisecond	uint16	17	2	最后更新的时间毫秒数
last_px	double	19	8	最新价
last_share	uint32	27	4	最新成交量（注意，这是总量，而非差额）
total_value	double	31	8	成交金额
total_pos	double	39	8	持仓量
bid_px	double	47	8	买一价
bid_share	uint32	55	4	买一量
ask_px	double	59	8	卖一价
ask_share	uint32	67	4	卖一量
reserve	binary	71	1	保留字段

### 2.2 期权 level1 输出的行情格式（80）

名称	类型	Offset	长度	说明
sequence	uint32	0	4	此通过的编号
exchange_id	char	4	1	市场说明 ‘1’ 表示上期 ‘2’ 表示金属指数 ‘7’ 表示能源
channel_id	uint8	5	1	表示从那个通道选出的数据

symbol	char	6	16	合约名称(左对齐右补\0)
update_time_h	uint8	22	1	最后更新的时间 hh
update_time_m	uint8	23	1	最后更新的时间 mm
update_time_s	uint8	24	1	最后更新的时间 ss
millisecond	uint16	25	2	最后更新的时间毫秒数
last_px	double	27	8	最新价
last_share	uint32	35	4	最新成交量(注意, 这是总量, 而非差额)
total_value	double	39	8	成交金额
total_pos	double	47	8	持仓量
bid_px	double	55	8	买一价
bid_share	uint32	63	4	买一量
ask_px	double	67	8	卖一价
ask_share	uint32	75	4	卖一量
reserve	binary	79	1	保留字段

## 2.3 期货 level2 输出的行情格式（168）

名称	类型	Offset	长度	说明
sequence	uint32	0	4	此通道的编号
exchange_id	char	4	1	市场说明 ‘1’ 表示上期 ‘2’ 表示金属指数 ‘7’ 表示能源
channel_id	uint8	5	1	表示从那个通道选出的数据
symbol	char	6	8	合约名称(左对齐右补\0)
update_time_h	uint8	14	1	最后更新的时间 hh
update_time_m	uint8	15	1	最后更新的时间 mm
update_time_s	uint8	16	1	最后更新的时间 ss
snap_millisecond	uint16	17	2	毫秒级采样时间
last_px	double	19	8	最新价
volume	uint32	27	4	最新总成交量
turnover	double	31	8	成交金额
open_interest	double	39	8	持仓量
bid1_px	double	47	8	买一价
bid1_share	uint32	55	4	买一量
bid2_px	double	59	8	买二价

bid2_share	uInt32	67	4	买二量
bid3_px	double	71	8	买三价
bid3_share	uInt32	79	4	买三量
bid4_px	double	83	8	买四价
bid4_share	uInt32	91	4	买四量
bid5_px	double	95	8	买五价
bid5_share	uInt32	103	4	买五量
ask1_px	double	107	8	卖一价
ask1_share	uInt32	115	4	卖一量
ask2_px	double	119	8	卖二价
ask2_share	uInt32	127	4	卖二量
ask3_px	double	131	8	卖三价
ask3_share	uInt32	139	4	卖三量
ask4_px	double	143	8	卖四价
ask4_share	uInt32	151	4	卖四量
ask5_px	double	155	8	卖五价
ask5_share	uInt32	163	4	卖五量
reserve	binary	167	1	保留字段

## 2.4 期权 level2 输出的行情格式（176）

名称	类型	Offset	长度	说明
sequence	uint32	0	4	此通道的编号
exchange_id	char	4	1	市场说明 ‘1’ 表示上期 ‘2’ 表示金属指数 ‘7’ 表示能源
channel_id	uint8	5	1	表示从那个通道选出的数据
symbol	char	6	16	合约名称(左对齐右补\0)
update_time_h	uInt8	22	1	最后更新的时间 hh
update_time_m	uInt8	23	1	最后更新的时间 mm
update_time_s	uInt8	24	1	最后更新的时间 ss
snap_millisec	uInt16	25	2	毫秒级采样时间
last_px	double	27	8	最新价
volume	uInt32	35	4	最新总成交量
turnover	double	39	8	成交金额
open_interest	double	47	8	持仓量
bid1_px	double	55	8	买一价
bid1_share	uInt32	63	4	买一量
bid2_px	double	67	8	买二价

bid2_share	uint32	75	4	买二量
bid3_px	double	79	8	买三价
bid3_share	uint32	87	4	买三量
bid4_px	double	91	8	买四价
bid4_share	uint32	99	4	买四量
bid5_px	double	103	8	买五价
bid5_share	uint32	111	4	买五量
ask1_px	double	115	8	卖一价
ask1_share	uint32	123	4	卖一量
ask2_px	double	127	8	卖二价
ask2_share	uint32	135	4	卖二量
ask3_px	double	139	8	卖三价
ask3_share	uint32	147	4	卖三量
ask4_px	double	151	8	卖四价
ask4_share	uint32	159	4	卖四量
ask5_px	double	163	8	卖五价
ask5_share	uint32	171	4	卖五量
reserve	binary	175	1	保留字段