## 中信行情接口

见《中信期货深度行情升级后的接入方式.docx》

## 中信行情对接处理方案

## 对期权行情的处理

对于合约长度大于6的，则是期权行情，丢弃

## 对非主力合约的处理

这里的非主力合约是指策略不交易的合约。

对于非主力合约，收到后立即抛弃。

## 对期货行情的处理

## 寻找起点

由于系统可能是盘中启动，为了保证接收的数据都是完整的数据帧，则必须寻找完整数据帧的起点。

收到合约为”last”数据之前的数据，都抛弃掉，之后的数据开始，则都是完整的数据帧。

## 如何处理行情

要点：

* 要考虑涨停，跌停情况

前置条件：保证接收的数据都是完整的数据帧。

## 接收数据

当接收的是买方向数据，按顺序存放在买方向数组中。并用写游标（初始指向数组的首位置）记录下一个可写位置；读游标（初始指向数组的首位置）记录下一个可读位置

当接收的是卖方向数据，按顺序存放在卖方向数组中。并用写游标（初始指向数组的首位置）记录下一个可写位置；读游标（初始指向数组的首位置）记录下一个可读位置。

## 抽取数据：

何时抽取数据：当收到卖方向数据时，新的合约与当前的合约不同时，则需要抽取数据当前合约的所有数据。抽取数据分如下3中场景：

普通场景：

要抽取数据的合约与买方向队列中读游标指定的数据的合约相同（比较品种）。

对买、卖队列中与要抽取的合约相同的数据抽取出来进行处理。

涨停场景：

要抽取数据的合约比买方向队列中读游标指定的数据的合约大（比较品种）。

对涨停数据的抽取--对买队列数据进行抽取，直到合约与要抽取的合约相同之前的数据，进行整合发送(要对合约进行比较，因为有可能同品种不同月份都涨停)。

对买队列的与要抽取的合约的数据进行抽取，其过程与普通场景相同

跌停场景：

要抽取数据的合约比买方向队列中读游标指定的数据的合约小（比较品种）。

只抽取卖方向与要抽取的合约相同的数据进行处理。

如上3中场景，抽取万数据后，都需要调整买、卖对了的读、写游标。

## 如何比较合约

只需比较品种和末一位即可