

## 铜期权上市后盛立 EFH 行情使用注意事项

由于近期铜期权即将上市，盛立的 EFH 上期所行情系统也参加多次的模拟演练。在演练中现有的 EFH 系统工作正常，可以正常输出上期所期货行情。随后的新升级版本会同时支持期货与期权行情。

值得注意的是现有 EFH 系统会因为期权上市产生些无效数据，这些无效数据可以不做处理。这些无效数据产生源于现有系统是针对期货定制的高速行情系统，输出的行情结构的 symbol 字段长度为 8 个字节。交易所送来的期权合约有效长度超过了 8 个字节，而系统只取交易所送来的期权合约名的前 8 个字节，形成无效数据。

针对此种情况，现对使用我公司 EFH 行情的客户做如下提醒：

- 1、在接收 EFH 行情时最好对自己关心的合约做好过滤判断，对不关心的合约全部忽略。
- 2、合约长度超过 6 个字节的合约行情都将其视作无效的行情，可以不做处理。目前有效的期货合约的长度都是小于或等于 6 个字节的。期货合约在当前的 symbol 字段中的存放形式是左对齐右补/0，例如，合约 cu1810 在 symbol 字段中的存放形式如下表所示：

c	u	1	8	1	0	/0	/0
---	---	---	---	---	---	----	----

而期权合约的在当前的 symbol 字段中会填满 symbol 字段的所有 8 个字节。例如，以合约 cu1911C50000 为例，其在 symbol 字段中的存放形式如下表所示：

c	u	1	9	1	1	C	5
---	---	---	---	---	---	---	---

- 3、新的版本会同时支持期货与期权行情，**期货行情会保持当前同样的结构输出**，同样的组播通道传送，并且该组播通道不会再有在原版本的无效数据；**期权行情会采用新的组播通道，新的结构输出**。期权行情协议中主要变化是合约名(symbol)域的字节长度扩大以覆盖铜期权和以后期权的合约名长度。也就是说升级后，原来的客户不需要做任何修改就能使用(接收原来期货的所有行情)。如果客户需要接收期权行情，只需要按新的组播通道，接新的结构接收就能获取新的期权行情。附录中把期货与期权的两种结构对比整理，其中着色部分是有差异的部分。有关期货公司支持期货期权新版本具体上线时间请联系相应的期货公司。

如有任何疑问，请随时与盛立金融软件公司的技术支持联系。

联系电话： 0571-87809027-8033      13372552942

## 附录:同时支持期货与期权的新版本说明

新的版本会同时支持期货与期权行情，**期货行情保持与当前线上版本同样的结构组播送出**，期权行情的输出采用新的结构，这两种结构对比如下，其中着色部分是有差异的部分：

期货			期权		
字段	长度	说明	字段	长度	说明
sequence	4	播通道的序号	sequence	4	播通道的序号
exchange_id		市场说明	exchange_id	1	市场说明
channel_id	1	输入会话号	channel_id	1	输入会话号
quote_flag	1	行情标志			
			symbol_type_id	1	恒为 0
			symbol_code	4	恒为 0
symbol	8	合约	symbol	31	合约
update_time	9	行情时间	update_time	9	行情时间
millisecond	4	行情毫秒数	millisecond	4	行情毫秒数
			quote_flag	1	行情标志
last_px	8	最新价	last_px	8	最新价
last_share	4	最新量	last_share	4	最新量
total_value	8	成交金额	total_value	8	成交金额
total_pos	8	持仓量	total_pos	8	持仓量
bid_px	8	买一价	bid_px	8	买一价
bid_share	4	买一量	bid_share	4	买一量
ask_px	8	卖一价	ask_px	8	卖一价
ask_share	4	卖一量	ask_share	4	卖一量

上表中是对期货与期权做了结构的对比，下面是对期货与期权的完整结构分别进行说明：

### 1、期货行情结构（保持跟当前线上的结构一致）

名称	类型	长度	说明
sequence	unsigned int	4	此组播通道的序号
exchange_id	char	1	市场说明 1 表示上期
channel_id	char	1	表示从那个通道选出的数据
quote_flag	char	1	0 无 time sale, 无 lev1 1 有 time sale, 无 lev1 2 无 time sale, 有 lev1 3 有 time sale, 有 lev1

			<p>说明: timesale 与 lev1 对应这字段说明</p> <p>time sale 对应字段: last_px last_share total_value total_pos</p> <p>lev1 对应字段: bid_px bid_share ask_px ask_share</p> <p>注意事项: 此字段的值是十进制, 而非字符方式(不能用'0','1','2','3'方式来判断), 取值范围是 0 - 255</p>
symbol	char	8	合约名称 比如 cu1810 后补\0
update_time	char	9	最后更新的时间 hh:mm:ss 格式 后补\0
millisecond	int	4	最后更新的时间毫秒数
last_px	double	8	最新价
last_share	int	4	最新成交量(注意, 这是总量, 而非差额)
total_value	double	8	成交金额
total_pos	double	8	持仓量
bid_px	double	8	买一价
bid_share	int	4	买一量
ask_px	double	8	卖一价
ask_share	int	4	卖一量

## 2、期权行情结构（新的结构）

名称	类型	长度	说明
sequence	unsigned int	4	此组播通道的序号
exchange_id	char	1	市场说明 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	合约编号(当前版本恒为 0)
symbol	char	31	合约名称 比如 cu1810 后补\0
update_time	char	9	最后更新的时间 hh:mm:ss 格式 后补\0
millisecond	int	4	最后更新的时间毫秒数
quote_flag	char	1	0 无 time sale, 无 lev1 1 有 time sale, 无 lev1 2 无 time sale, 有 lev1

			<p>3 有 time sale, 有 lev1</p> <p>说明: timesale 与 lev1 对应这字段说明</p> <p>time sale 对应字段: last_px last_share total_value total_pos</p> <p>lev1 对应字段: bid_px bid_share ask_px ask_share</p> <p>注意事项: 此字段的值是十进制, 而非字符方式(不能用'0', '1', '2', '3'方式来判断), 取值范围是 0 – 255</p>
last_px	double	8	最新价
last_share	int	4	最新成交量（注意，这是总量，而非差额）
total_value	double	8	成交金额
total_pos	double	8	持仓量
bid_px	double	8	买一价
bid_share	int	4	买一量
ask_px	double	8	卖一价
ask_share	int	4	卖一量