**期权做市商系统—模拟行情服务器需求设计**

1. 描述

模拟行情服务器，再发布时单独部署，只用于模拟交易和策略回放验证功能。不可同实盘交易系统关联。可实现账号登录CTP接口，或者行情后转发；从数据库加载历史数据转发；提供查询指定历史行情接口，从数据库查询后转发等功能。

1. 设计
2. 从数据库获取行情账号、行情服务器IP和端口、全部合约、连接CTP服务器，订阅全部行情数据。
3. 接收其他系统内服务器或客户端订阅、退订操作，保存订阅情况，并将接收到的行情数据转发给相应的服务器或客户端。
4. 根据配置文件时间，定时转换。从数据库加载某一天的历史行情数据，模拟历史行情间隔转发。
5. 新增接口，可支持指定查询历史行情“某年某月某日某时某分”。从数据库查询后将一分钟的全部行情打包发送给对应的服务器或客户端。（视包的大小可压缩）
6. 指定查询历史行情接口扩展为某一个或多个合约的某年某月某日某时某分的行情。（后期实现）
7. 说明：

1.2.3条机构版基本已实现。只需要新增第4点，第五点如果较复杂可在下一期实现。

1：现在的行情服务器不是主动读取数据库里的所有合约并订阅，而是被动接受合约订阅。2：现在的配置文件是周一到周日的模拟时间点，并以此作为实盘和模拟的转换条件。

服务端：

1. 行情落地按日建表
2. 配置中指定行情表保存时间，系统自动将此时间以前的表删除
3. 配置文件中指定实盘还是模拟
4. 如果配置为实盘系统，后台管理终端手动回放行情功能无法使用，服务器返回操作失败“此系统为实盘系统，回放功能被屏蔽”
5. 如果配置为模拟系统，根据后台管理终端上配置所用行情时间段(可以跨天)回放行情
6. 如果配置为模拟系统，根据后台管理终端上配置行情回放方式，按时间回放/连续回放(不做时间延迟)回放行情
7. 客户端：1. 从交易服务器查询当前系统是否是模拟系统
8. 如果为模拟系统，在管理终端上配置所用行情时间段(可以跨天)增加一个默认选项（最近一个交易日行情），并默认选在此项。
9. 如果为模拟系统，在管理终端上配置行情回放方式，按时间回放/连续回放(不做时间延迟)。默认选择为按时间回放。
10. 如果为模拟系统，在管理终端上可以停止回放/恢复回放/从头回放

