****

文档名称：

**多市场极速行情系统行情格式说明**

版本：

**1.1**

发布日期：

**2015-04-23**

**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。

# 概述

盛立极速行情系统是在接收到中金与上期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节与2.2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。

# 自定义行情结构

## 2.1组播输出的行情格式(高频率数据)

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 名称 | 类型 | 长度 | 说明 |
| sequence | unssigned int | 4 | 此通过的编号 |
| exchange\_id | char | 1 | 市场说明 0 表示中金  1 表示上期 |
| channel\_id | char | 1 | 目前恒为0 (只有一个组播输出通道) |
| symbol\_type\_flag | char | 1 | 1. 表示 IF 2. 表示 TF |
| symbol\_code | int | 4 | 合约的月份 |
| symbol | char | 31 | 合约名称 比如 IF1412 后补\0 |
| update\_time | char | 9 | 最后更新的时间hhmmss格式 后补\0 |
| millisecond | int | 4 | 最后更新的时间毫秒数 |
| quote\_flag | char | 1 | 1. 无time sale, 无lev1 2. 有time sale， 无lev1 3. 无time sale,  有 lev1 4. 有time sale, 有lev1 |
| last\_px | double | 8 | 最新价 |
| last\_share | int | 4 | 最新成交量 |
| 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 | 卖一价 |

## 2.2组播输出的行情格式(低频率数据)

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 名称 | 类型 | 长度 | 说明 |
| sequence | unssigned int | 4 | 此通过的编号 |
| exchange\_id | char | 1 | 市场说明 0 表示中金  1 表示上期 |
| channel\_id | char | 1 | 目前恒为0 (只有一个组播输出通道) |
| symbol\_type\_flag | char | 1 | 1. 表示 IF 2. 表示 TF |
| symbol\_code | int | 4 | 合约的月份 |
| update\_time | char | 9 | 最后更新的时间hhmmss格式 后补\0 |
| millisecond | int | 4 | 最后更新的时间毫秒数 |
| quote\_flag | char | 1 | 1. summary信息 |
| open\_px | double | 8 | 今开盘 |
| high\_px | double | 8 | 最高价 |
| low\_px | double | 8 | 最低价 |
| today\_close\_px | double | 8 | 今收盘 |
| high\_limit\_px | double | 8 | 涨停价 |
| low\_limit\_px | double | 8 | 跌停价 |
| today\_settle\_px | double | 8 | 今结算价 |
| curr\_delta | double | 8 | 今虚实度 |