# 行情中心设计文档

## 行情中心功能：

### 结构图



### 行情订阅

全部订阅

通过证券代码和交易所的单个订阅

通过交易所订阅

### 行情推送

行情中心向行情客户端推送行情，如果行情provider推送来行情，行情中心实时推送给客户端。行情中心也会缓存行情，每1分钟比对一下缓存中的行情时间是不是有变化，如果没变化推送一次。

### 行情来源

#### 上交所行情

上交所行情：上交所行情通过文件读取，每两秒读取一次文件，通过文件头时间和行情时间比对来发送行情。

期权行情：上交所期权行情和上交所A股行情相同

沪港通行情：和上交所A股行情相同

行情来源：

A股行情来源mktdt00.txt文件

期权行情来源mktdt03.txt、reff03yyyyMMdd.txt

沪港通行情来源mktdt04.txt

#### 2） 深交所行情

深交所行情：深交所行情是通过行情网关推送过来的，深交所的推送规则是行情变量在三秒内推送过来,如果行情一直不变1分钟推送一次。

深港通行情：和深交所A股行情相同

行情来源：深交所行情都是通过行情网关获得，港股行情网关step协议要升级到1.01

#### 3） 期货行情

期货行情：现在期货行情是通过券商获得的，在券商资金账号登录后，查询所有的期货合约，再通过合约订阅所有行情。期货的行情是行情变化就会推送。

行情来源： 通过券商获得行情

#### 4） 银行间行情

银行间行情是从中债估值文件中获得的静态行情

## 数据中心功能

### 结构图

### 功能



#### 场内证券信息

场内证券信息包括：深交所、上交所的股票、债券、基金、期权等信息

深交所证券类型是通过交易所的类型进行转换获得我们自己的证券类型

上交所证券类型是通过证券代码转换成我们自己的证券类型（具体转换关系）

#### 银行间证券信息

提供银行间债券信息，银行间回购信息是通过sql直接写入到数据库的，更新的时候只更新时间

数据来源：ZQXX文件

#### 篮子信息

篮子信息是通过交易所文件获得，ETF类型先查询文件，看文件是否配置对应关系，如果配置对应关系，按照配置的类型使用。如果没有配置就按照成分股的交易所判断ETF类型，如果成分股都是本市场的，ETF类型为单市场，如果成分股有跨市场，ETF类型为跨市场。如果成分股有不是A股市场的，就是跨境ETF

深交所篮子文件：pcf开头的文件

上交所篮子文件：.ETF结尾的文件

#### 港股信息

港股信息包括：港股的买入、卖出、中间汇率，当日的初始额度，当日剩余额度。

额度信息是从上交所获得（深交所上交所额度是否共用）：trdses04.txt

汇率信息是通过深交所获得: imcexchangerate\_yyyyMMdd.xml

#### 5） 公司行文数据

#### 6） 债券估值信息

债券估值信息包括：中证、中债估值信息

#### 7） 场外基金信息

通过读取OPENFUNDINFOYYYYMMDD.XLS文件获取场外基金信息。场外基金净值是通过TZJJJZ\_XLS文件获得

#### 8） 期货合约

期货合约是从券商获得，在券商资金账户登录的时会从券商查询期货合约缓存到行情中心的ctp provider。期货合约导入都是通过缓存获得。

#### 9） 发行人信息

发行人信息是通过财货的FXRXX(n)文件导入进来的。

#### 10） 对手方信息

对手方信息是有银行间盘前和盘后两个文件，我们现在获得是盘后数据

文件名称：BasicTraderInfo.xls