

上海证券交易所 LDDS 系统发布德意志证券交易所 行情数据接口说明书

文档 状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	LDDS 系统接口说明书德交所行情分册
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	1.0.0
	<input type="checkbox"/> 修改	作 者	数据技术部
	<input checked="" type="checkbox"/> 发布	发 布 者	上证所信息网络有限公司
	<input type="checkbox"/> 作废	完成日期	2017/08/22

文档变动说明

日期	版本	说明
2017-08-22	1.0.0	首次发布

1. 引言

1.1 目的

德意志证券交易所（以下简称德交所）行情包含德意志交易所指数（ASIA_DBAG_INDEX，简称 DAX）、斯托克指数（ASIA_STOXX_INDEX，简称 STOXX）、德国现货市场行情（ASIA_SPOT，简称 Xetra）、欧洲期货交易所行情（ASIA_EUREX，简称 Eurex）等产品，产品详情可参考《CEF Core Multicast Product Overview.xlsx》。

上证所 LDDS 系统通过 CEF 组播接收德交所行情，并通过 LDDS 系统转发。

1.2 阅读对象

文档适用于信息商及其他接入方的开发人员和技术支持人员。

1.3 参考文档

表 1-1 参考文档表

文档名称	文档来源
《上海证券交易所低延时行情发布系统(LDDS)接口说明书》	上证所信息网络有限公司
《CEF Core Multicast Connection Parameter.xlsx》	德意志证券交易所
《CEF Core Multicast Fields and Products.xlsx》	德意志证券交易所
《CEF Core Multicast Interface Specification.docx》	德意志证券交易所
《CEF Core Multicast Product Overview.xlsx》	德意志证券交易所

2. 系统接入

接入方只要已接入上交所 LDDS 系统，并与我公司签约，要求通过上交所 LDDS 系统接收德交所行情行数，我方将在 IDC 开通相应权限，接入方无须添加设备及更改配置，就可以在 VDE 中获得德交所行情数据。

有关 LDDS 系统架构及接入可以参考《上海证券交易所低延时行情发布系

统(LDDS)接口说明书》。

有关德交所产品带宽要求可以参考《CEF Core Multicast Fields and Products.xlsx》。

3. 数据定义

3.1 范围

德交所发布的 DAX、STOXX、Xetra、Eurex 等产品。

3.2 内容

德交所的实时数据为 DAX (UA8001)、Eurex (UA8002)、STOXX (UA8003)、Xetra (UA8004)。

3.3 时间表

每个德交所交易日北京时间 13:30—次日 6:30 发送。

3.4 数据格式

与 Level-2 实时行情数据格式相似，整体使用 STEP 协议封装，实时行情数据为德交所行情二进制数据，LDDS 系统对接收到的行情不进行处理，通过 tag96 嵌入 STEP 消息中。

tag96 包含的二进制数据结构为德交所行情数据。

4. 消息说明

DAX 的产品类别 (tag10142) 为 41，只包括一种消息，即 UA8001。

Eurex 的产品类别 (tag10142) 为 42，只包括一种消息，即 UA8002。

STOXX 的产品类别 (tag10142) 为 43, 只包括一种消息, 即 UA8003。

Xetra 的产品类别 (tag10142) 为 44, 只包括一种消息, 即 UA8004。

德交所行情的实时数据采用发送实时数据的方式, 不支持数据回补。因为实时数据中包含全量和增量行情, 所以下游系统丢包后, 不需要发送 Rebuild 请求, 请等待全量数据回补。

对 tag96 (二进制数据) 进行解码可参考《CEF Core Multicast Interface Specification.docx》。

德交所行情的实时数据内容可以参考《CEF Core Multicast Product Overview 1.0.xlsx》。

4.1 DAX 信息

DAX 数据消息号是 UA8001, 产品类别 (category) 是 41。

LDDS 系统即时发送 DAX 实时数据。

表 4-1 DAX 信息属性

Tag	Field Name	Req'd	Type	Comments
	<i>Standard Header</i>	Y		MsgType=UA8001
10142	CategoryID	Y	int	41
10072	MsgSeqID	Y	int	
95	RawDataLength	Y	Length	Length of binary data
96	RawData	Y	Data	市场行情二进制数据
	<i>Standard Trailer</i>	Y		

4.2 Eurex 信息

Eurex 数据消息号是 UA8002, 产品类别(category)是 42。

LDDS 系统即时发送 Eurex 实时数据。

表 4-2 Eurex 信息属性

Tag	Field Name	Req'd	Type	Comments
	<i>Standard Header</i>	Y		MsgType=UA8002
10142	CategoryID	Y	int	42
10072	MsgSeqID	Y	int	
95	RawDataLength	Y	Length	Length of binary data
96	RawData	Y	Data	市场行情二进制数据

	<i>Standard Trailer</i>	Y		
--	-------------------------	---	--	--

4.3 Xetra 信息

Xetra 数据消息号是 UA8003，产品类别（category）是 43。

LDDS 系统即时发送 Xetra 实时数据。

表 4-3 Xetra 信息属性

Tag	Field Name	Req'd	Type	Comments
	<i>Standard Header</i>	Y		MsgType=UA8003
10142	CategoryID	Y	int	43
10072	MsgSeqID	Y	int	
95	RawDataLength	Y	Length	Length of binary data
96	RawData	Y	Data	市场行情二进制数据
	<i>Standard Trailer</i>	Y		

4.4 STOXX 信息

STOXX 数据消息号是 UA8004，产品类别（category）是 44。

LDDS 系统即时发送 STOXX 实时数据。

表 4-4 STOXX 信息属性

Tag	Field Name	Req'd	Type	Comments
	<i>Standard Header</i>	Y		MsgType=UA8004
10142	CategoryID	Y	int	44
10072	MsgSeqID	Y	int	
95	RawDataLength	Y	Length	Length of binary data
96	RawData	Y	Data	市场行情二进制数据
	<i>Standard Trailer</i>	Y		