上证所信息网络有限公司
SSE INFONET LTD

上海证券交易所
LDDS 系统恒生指数行情接口说明书

文档状态			
	[ ] 初稿	文档标识	LDDS 系统接口说明书恒生指数行情分册
	[ ] 评审通过	当前版本	1.0.0
	[ ] 修改	作　　者	市场数据部
	[√] 发布	发布者	上证所信息网络有限公司
	[ ] 作废	完成日期	2020/07/24

文档变动说明

日期	版本	说明
2020-07-24	1.0.0	首次发布

1. 引言

恒生指数（以下简称恒指）行情由香港恒生指数发布的基本行情信息。

上交所 LDDS 系统通过恒生指数的行情系统接收报文行情数据，并根据恒生指数的报文数据协议来解析报文得到基本行情数据，并通过 LDDS 行情发布系统转发。

1.1 目的

文档介绍了恒生指数行情转发系统的接入方式，详细说明了恒生指数行情数据格式，以方便信息商接收恒生指数行情数据。

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恒生指数行情技术支持人员。

1.3 参考文档

表 1-1 参考文档表

文档名称	文档来源
IndexBroadcastSpecification.v10.1.pdf	恒生指数公司

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 系统接收恒生指数行情数据，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 中获得恒生指数行情数据。

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》。

3. 数据定义

3.1 范围

恒生指数行情数据

3.2 内容

恒生指数行情的消息号为 UA4601。

3.3 时间表

交易日时间表：09:20-16:00

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，实时行情数据为恒生指数行情二进制数据，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恒生指数行情结构体（参考消息详细说明）。

数据采用大端发送。

4. 消息说明

恒生指数行情数据的产品类别（tag10142）为 46。

恒生指数行情的实时数据采用更新加定时全量的方式，不支持数据回补。所以下游系统丢包后，不需要发起 Rebuild 请求，请等待全量数据回补。

恒生指数行情结构体采用 1 字节对齐方式下发，当对 tag96（二进制数据）进行解码时不需要补齐字节数。

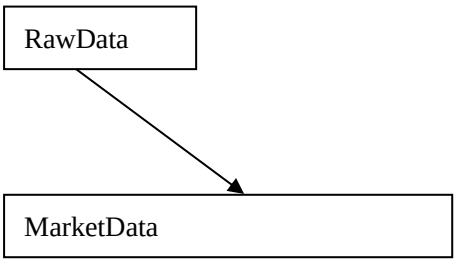
4.1 实时行情

实时行情数据消息号是 UA4601，产品类别(category)是 46。

上交所 LDDS 系统每 90s 重发全量恒生指数行情数据，更新数据即时发送。

表 4-1 实时行情属性

Tag	Field Name	Req'd	Type	Comments
	Standard Header	Y		MsgType=UA4601
10142	CategoryID	Y	Int	46
10072	MsgSeqID	Y	Int	
95	RawDataLength	Y	Length	Length of binary data 实时行情二进制数据长度，实时行情二进制数据由一个或多个实时行情结构组成
96	RawData	Y	Data	实时行情二进制数据 由一个或多个实时行情结构体组成，具体二进制格式请参考下面的 RawData 格式说明
	Standard Trailer	Y		



sizeof(MarketData) bytes

实时行情结构

```
struct MarketData
{
    char indexCode[7];          /*指数代码*/
    char indexStatus;           /*指数状态*/
```

```
    char indexTime[8];          /*指数发布时间*/
    double indexValue;          /*指数最新值*/
    double netChgPreDay;        /*指数变化*/
    double highValue;           /*指数最高值*/
    double lowValue;            /*指数最低值*/
    double EASValue;            /*均值*/
    int64 indexTurnover;        /*指数成交量*/
    double openingValue;        /*开盘价*/
    double closingValue;        /*收盘价*/
    double previousSesClose;    /*前收盘价*/
    double netChgPreDayPct;     /*指数变化率*/
};
```