附件３

上海期货交易所第二代行情发布平台接口规范Q&A

问：主题快照行情是否只有在行情查询服务中查询时才会返回一次数据，后续变化的主题快照行情并不会在行情查询服务中主动推送？

答：是的。快照行情需要通过主动查询获得。SMDP2.0不提供快照行情的组播推送。

问：主题增量行情中包含的多个合约增量行情是在时间切片到的时刻统一发送的吗？

答：是的。不过，一起切片的增量行情可能会被拆分成多个MIRP包发送，但拆分时会保证同一个合约增量行情一定会在同一个MIRP包中。

问：增量行情推送采用组播方式，交易所对于会员的接入方式是否有具体要求？

答：具体请参考交易所发布的SMDP2.0接入指引。

问：对于五档行情，快照查询应答中的分价表域是否已经经过排序？是否bid方向的价格是由高到低，ask方向的价格是由低到高？

答：分价表域中已经包含了每一档行情的详细信息，协议本身不规定分价表域的档位排序。目前分价表域档位排序是最优的价位（买最高卖最低）排在最前进行排序的。

问：SMDP2.0协议包含了一些具有一定解析复杂性的元素，是否会影响行情实时性？

答：上期所第二代行情平台接口规范协议的设定思路是在保证较低的网络负载的前提下尽量降低解码难度。用户可以通过优化解码算法甚至使用硬件解码等方式来提高解码效率。

问：如何降低丢包率？

答：组播行情采用UDP协议推送，有效率高，速度快等特点，但UDP为非连接不可靠协议，没有拥塞控制和重传机制。建议双路接收增量行情服务，以减少丢包造成频繁查询当前主题行情。在丢包率居高不下的情况下，建议使用上期所第一代行情系统。

问：第二代系统发布是否会和第一代系统并行使用一段时间？

答：是。

问：为什么平台限制最多查询连续10条增量行情报文？

答：在交易时间段内，增量行情查询功能主要用来补足丢失的增量行情报文。增量行情报文的丢失率非常低，无需大量补足。同时查询条数的限制是为了保证行情查询服务的稳定。如果出现大量报文丢失，建议使用快照恢复的方式恢复行情。

问：是否能够提供单个合约快照的查询？

答：不提供。

问：快照中的合约增量行情编号ChangeNo的作用是什么？

答：合约增量行情自己的合约级别的快照编号，与主题级别的快照编号不同。请参考2.2节的编号相关介绍。合约级别的快照编号提供给仅关心个别合约的用户进行快速处理，使其在出现包丢失时可以仅在ChangeNo出现跳号的情况下才进入补足流程。