中大行情API说明

### 1 介绍

中大行情API是一个基于c++的类库，该api主要是针对特定客户在内网环境下使用，使用该api接收行情不需要做身份认证，接入后，直接订阅行情即可。

该api包含的文件如下：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 文件名 | 版本 | 文件描述 |
| ZDQHMdApi.h | V1.0 | 行情接口文件 |
| ZDQHUserApiStruct.h | V1.0 | 数据结构文件 |
| ZDQHUserApiType.h | V1.0 | 数据类型文件 |
| ZDQHMdUserAPI.dll | V1.0 | 行情动态库 |
| ZDQHMdUserAPI.lib | V1.0 | 导入库文件 |

### 2 接口说明

#### 2.1 CZDQHFtdcMdApi接口

#### 2.2 CZDQHFtdcMdSpi接口

接口详见ZDQHMdApi.h和ZDQHFtdcTradeApi.h

### 3 授权说明

Api使用需要得到授权，请将zdqhapi.cert授权文件放在程序运行目录下。

### 4 开发案例

Demo实例源码请看附件TestTrade3

**初始化**

void CTestTradeDlg::OnBtnLogin()

{

if( g\_pZDQHApi == NULL)

{

char ip[25]={0};

int port;

//创建行情api

g\_pZDQHApi = CreateFtdcMdApi("");

//注册回调类

CZDQHAPISpi\* pSpi = new CZDQHAPISpi();

g\_pZDQHApi->RegisterSpi(pSpi);

g\_pZDQHApi->Init();

}

}

**回调类实现**

void CZDQHAPISpi::OnFrontConnected()

{

}

void CZDQHAPISpi::OnFrontDisconnected()

{

}

Void CZDQHAPISpi::OnRtnDepthMarketData(CZDQHFtdcDepthQuoteDataField \*pDepthMarketData)

{

if (pDepthMarketData)

{

try

{

if (pDepthMarketData->AskPrice1 > 1000000)

{

return;

}

SYSTEMTIME t;

GetLocalTime(&t);

char szbuffer[512] ={0};

sprintf(szbuffer, "%02d:%02d:%02d %03d %d 代码：%s 最新价：%.1lf 持仓量:%.0f 成交量:%d 买一价：%10.1lf 买一量:%10d 卖一价：%.1lf 卖一量：%10d",

t.wHour,t.wMinute,t.wSecond,t.wMilliseconds,((t.wMinute\*60)+t.wSecond)\*1000+t.wMilliseconds,pDepthMarketData->InstrumentID, pDepthMarketData->LastPrice,pDepthMarketData->OpenInterest,pDepthMarketData->Volume

,pDepthMarketData->BidPrice1,pDepthMarketData->BidVolume1,pDepthMarketData->AskPrice1,pDepthMarketData->AskVolume1

);

WriteLog(szbuffer, false);

::PostMessage(CTestTradeDlg::s\_pThis->GetSafeHwnd(), UM\_ADD\_MSG, NULL, (LPARAM)szbuffer);

}

catch(...)

{

}

//sprintf(pszMsg, "★成交回报, 帐号:%s, 合约:%s, 买卖:%c, 开平:%c, 数量:%d, 价格:%.2lf, 套保:%c, 单号:%s", pTrade->InvestorID, pTrade->InstrumentID, pTrade->Direction, pTrade->OffsetFlag, pTrade->Volume, pTrade->Price, pTrade->HedgeFlag, strOrderSysID);

}

}

**订阅行情**

void CTestTradeDlg::OnButtonSub()

{

// TODO: Add your control notification handler code here

if (g\_pZDQHApi)

{

TZDQHExchangeType exchange = {0};

strcpy(exchange, "CFFEX");

char\* contract = "IF1310";

g\_pZDQHApi->SubscribeMarketData(&exchange,&contract,1);

}

}

**退订行情**

void CTestTradeDlg::OnButton3()

{

// TODO: Add your control notification handler code here

if (g\_pZDQHApi)

{

TZDQHExchangeType exchange = {0};

strcpy(exchange, "CFFEX");

char\* contract = "IF1310";

g\_pZDQHApi->UnSubscribeMarketData(&exchange,&contract,1);

}

}