报盘模块CTP风控接口报盘和交易终端推送报盘

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 文件状态：  **√** 草稿   正式发布   正在修改 | 文件标识： |  |
| 当前版本： | V1.0.0.1 |
| 作 者： |  |
| 完成日期： | 13年2月05日 |
| 审 定： |  |

# 需求

1. 抽象风控报盘或者交易终端报盘为统一的报盘接口。至于选择哪种报盘接口，可以通过配置文件来决定。
2. 另外风控业务服务和交易辅助服务可以通过该模块进行强行平仓。

# 参考文档

1. 机构交易版本架构设计.docx

# 流程图



# 类图



COfferMgr:程序主线程，负责接收风控接口的数据

CClientMgr：交易软件客户端发送数据接收

CQutoMgr：负责接收行情数据

# 数据结构

风控和交易软件里面数据结构的字段基本相同，沿用

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 风控 | 交易软件 | 机构版 |
| 成交 | SequencialTradeField | CThostFtdcTradeField | CTradeField |
| 报单 | SequencialOrderField | CThostFtdcOrderField | COrderField |
| 合约手续费率 | InstrumentCommissionRateField | CThostFtdcInstrumentCommissionRateField | CCommissionRateField |
| 合约保证金率 | InstrumentMarginRateField | CThostFtdcInstrumentMarginRateField | CInstrumentMarginRateField |
| 行情 |  |  |  |

# 与客户端通讯协议

### 成交推送

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| PkgHead | len | sizeof(CThostFtdcTradeField) |
| cmdid | Cmd\_Offer\_Trade\_Push |
| moduleid | 0 |
| PkgBody |  | CThostFtdcTradeField |
| PkgTail |  |  |

### 报单推送

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| PkgHead | len | sizeof(CThostFtdcOrderField) |
| cmdid | Cmd\_Offer\_Order\_Push |
| moduleid | 0 |
| PkgBody |  | CThostFtdcOrderField |
| PkgTail |  |  |

### 合约手续费率

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| PkgHead | len | sizeof(CCommissionRateField) |
| cmdid | Cmd\_Offer\_InstrumentCommissionRate\_Push |
| moduleid | 0 |
| PkgBody |  | CCommissionRateField |
| PkgTail |  |  |

### 合约保证金率

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| PkgHead | len | sizeof(CInstrumentMarginRateField) |
| cmdid | Cmd\_Offer\_InstrumentMarginRate\_Push |
| moduleid | 0 |
| PkgBody |  | CInstrumentMarginRateField |
| PkgTail |  |  |

# 报盘模块推送数据：

头文件：..\CommonDef\UserApiStruct.h

1》成交: SequencialTradeField

调用交易数据管理模块：

void AddSequencialTradeField（SequencialTradeField &sField）;

2》报单：SequencialOrderField

调用交易数据管理模块：

void AddSequencialOrderField（SequencialOrderField &sField）;

3》费率：InstrumentCommissionRateField

调用费率模块数据接口

Void AddInstrumentCommissionRateField（InstrumentCommissionRateField& rate）；

4》合约保证金率： InstrumentMarginRateField

调用费率模块数据接口

Void AddInstrumentMarginRateField（InstrumentMarginRateField& rate）；

5》深度行情：DepthMarketDataField

调用行情数据管理模块：

Void Add DepthMarketDataField（DepthMarketDataField & data）；