



上海金融期货信息技术有限公司

Shanghai Financial Futures Information Technology Co., Ltd

飞马平台API接口介绍

2013.10



主要内容

一、交易接口

二、行情接口

三、使用中的问题

一、交易接口



中金所技术公司
CFFEX Technology

□ 本地接口

业务	接口
创建API	CUSTPFtdcTraderApi::CreateFtdcTradeApi
销毁API	CUSTPFtdcTraderApi::Release
初始API	CUSTPFtdcTraderApi::Init
等API结束	CUSTPFtdcTraderApi::Join
交易日	CUSTPFtdcTraderApi::GetTradingDay
注册SPI	CUSTPFtdcTraderApi::RegisterSpi
注册前置地址	CUSTPFtdcTraderApi::RegisterFront
注册域名（未启用）	CUSTPFtdcTraderApi::RegisterNameServer
订阅私有流	CUSTPFtdcTraderApi::SubscribePrivateTopic
订阅交易员流	CUSTPFtdcTraderApi::SubscribeUserTopic
订阅公共流	CUSTPFtdcTraderApi::SubscribePbulicTopic
连接前置成功后回调	CUSTPFtdcTraderSpi::OnFrontConnected
断开前置后回调	CUSTPFtdcTraderSpi::OnFrontDisconnected
心跳超时回调	CUSTPFtdcTraderSpi::OnHeartBeatWarning

一、交易接口



中金所技术公司
CFFEX Technology

□ 登录与报单

业务	请求接口	响应接口
登录	CUSTPFtdcTraderApi::ReqUserLogin	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspUserLogin
登出	CUSTPFtdcTraderApi::ReqUserLogout	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspUserLogout
修改用户口令	CUSTPFtdcTraderApi::ReqUserPasswordUpdate	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspUserPasswordUpdate
报单录入	CUSTPFtdcTraderApi::ReqOrderInsert	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspOrderInsert
撤单	CUSTPFtdcTraderApi::ReqOrderAction	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspOrderAction
成交回报		CUSTPFtdcTraderSpi::OnRtnTrade
报单回报		CUSTPFtdcTraderSpi::OnRtnOrder
报单录入错误回报		CUSTPFtdcTraderSpi::OnErrRtnOrderInsert
撤单错误回报		CUSTPFtdcTraderSpi::OnErrRtnOrderAction
出入金回报		CUSTPFtdcTraderSpi::OnRtnInvestorAccountDeposit

一、交易接口



中金所技术公司
CFFEX Technology

□ 查询

报单查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryOrder	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryOrder
成交查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryTrade	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryTrade
合约查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryInstrument	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryInstrument
可用投资者查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryUserInvestor	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryUserInvestor
资金账户查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryInvestorAccount	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryInvestorAccount
交易编码查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryTradingCode	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryTradingCode
交易所查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryExchange	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryExchange
投资者持仓查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryInvestorPosition	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryInvestorPosition
合规参数查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryComplianceParam	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryComplianceParam
手续费率查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryInvestorFee	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryInvestorFee
保证金率查询	CUSTPFtdcTraderApi::ReqQryInvestorMargin	CUSTPFtdcTraderSpi::OnRspQryInvestorMargin

一、交易接口



中金所技术公司
CFFEX Technology

■ 报单

///经纪公司编号

TUstpFtdcBrokerIDType BrokerID; //0001

///交易所代码

TUstpFtdcExchangeIDType ExchangeID; //CFFEX

///投资者编号

TUstpFtdcInvestorIDType InvestorID; // 01550001

///用户代码

TUstpFtdcUserIDType UserID; //test_user1

///用户本地报单号

TUstpFtdcUserOrderLocalIDType UserOrderLocalID; //00000000001

///投机套保标志

TUstpFtdcHedgeFlagType HedgeFlag; // 1:Speculation 2:Arbitrage 3:Hedge

///有效期类型

TUstpFtdcTimeConditionType TimeCondition; //1:FAK 2:本节有效 3:当日有效

///成交量类型

TUstpFtdcVolumeConditionType VolumeCondition; // 1

///用户自定义域

TUstpFtdcCustomType UserCustom;



■ 撤单

///交易所代码

TUstpFtdcExchangeIDType ExchangeID;

///报单编号

TUstpFtdcOrderSysIDType OrderSysID; // order唯一标示

///经纪公司编号

TUstpFtdcBrokerIDType BrokerID;

///投资者编号

TUstpFtdcInvestorIDType InvestorID;

///用户代码

TUstpFtdcUserIDType UserID;

///操作本地编号

TUstpFtdcUserOrderLocalIDType UserOrderActionLocalID; //同一个序列

///本地报单编号

TUstpFtdcUserOrderLocalIDType UserOrderLocalID; //被撤的订单本地报单编号

///报单操作标志

TUstpFtdcActionFlagType ActionFlag; // 0:删除

一、交易接口



中金所技术公司
CFFEX Technology

■ 新增报单类型

订单类型	OrderPriceType	TimeCondition	VolumeCondition	备注
FOK	USTP_FTDC_OPT_LimitPrice	USTP_FTDC_TC_IOC	USTP_FTDC_VC_CV	立即全部成交否则自动撤销
市价转限价	USTP_FTDC_OPT_AnyPrice	USTP_FTDC_TC_GFD	USTP_FTDC_VC_AV	市价单未成交部分转为最新价限价单
五档市价	USTP_FTDC_OPT_FiveLevelPrice	USTP_FTDC_TC_IOC	USTP_FTDC_VC_AV	市价单与对手方五档价格报单尝试成交，剩余未成交部分撤销
五档市价转限价	USTP_FTDC_OPT_FiveLevelPrice	USTP_FTDC_TC_GFD	USTP_FTDC_VC_AV	市价单与对手方五档价格报单尝试成交，剩余未成交部分转为最新价限价单
最优价	USTP_FTDC_OPT_BestPrice	USTP_FTDC_TC_IOC	USTP_FTDC_VC_AV	市价单与对手方最优一档价格报单尝试成交，剩余未成交部分撤销
最优价转限价	USTP_FTDC_OPT_BestPrice	USTP_FTDC_TC_GFD	USTP_FTDC_VC_AV	市价单与对手方最优一档价格报单尝试成交，剩余未成交部分转为最新价限价单



主要内容

一、交易接口

二、行情接口

三、使用中的问题



■ 请求接口

- CUstpFtdcMduserApi::SubscribeMarketDataTopic
- CUstpFtdcMduserApi::SubMarketData
- CUstpFtdcMduserApi::UnSubMarketData

■ 回调接口

- CUstpFtdcMduserSpi::OnRspSubMarketData
- CUstpFtdcMduserSpi::OnRspUnSubMarketData
- CUstpFtdcMduserSpi::OnRtnDepthMarketData



主要内容

一、交易接口

二、行情接口

三、使用中的问题

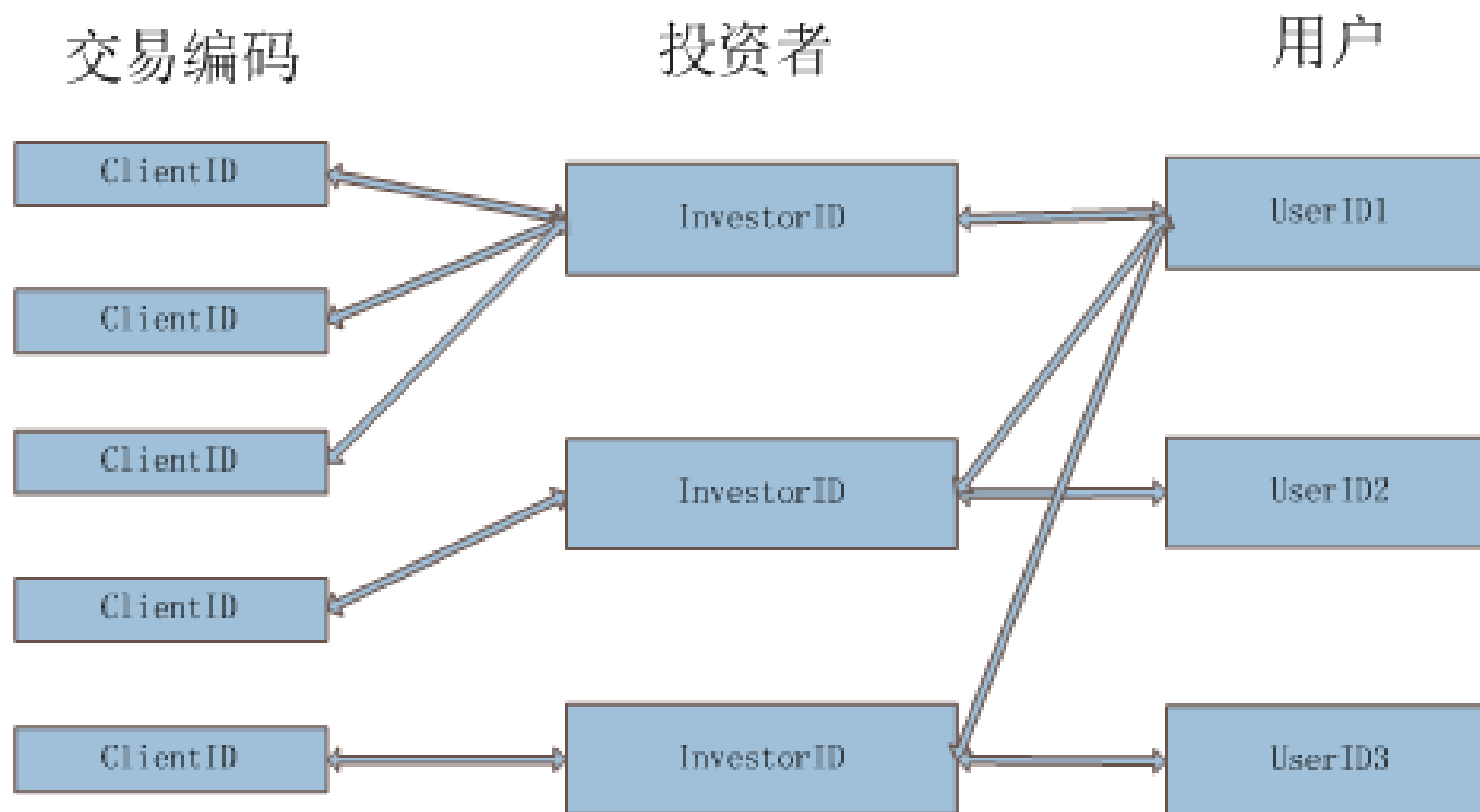


- UserOrderLocalID, UserOrderActionLocalID, OrderSysID, OrderLocalID关系
 - UserOrderLocalID 用户本地报单号
 - UserOrderActionLocalID 用户本地撤单号
 - OrderSysID 交易所报单号
 - OrderLocalID 飞马本地报单号

三、使用中的问题



■ InvestorID, UserID, ClientID关系





- 飞马服务器地址和端口
 - tcp://117.184.207.108:6888（互联网）
- 飞马API版本
 - V0.92以上
- 经纪公司编号

- 本地报单号递增
- 撤单请求号与报单请求号共用同一个序列
- 交易合约品种与生产不同

- 行情流动性不足可能收不到行情信息，无五档深度行情
- 行情主题号=100

谢 谢 ！

飞马平台QQ交流群：154929875



中金所技术公司
CFFEX Technology