|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 未命名.bmp | **Mini项目组** | **编 号** |  |
| **版 号** | **V1.1** |
| **CTPmini2说明手册** | | | |
| **发布日期： 实施日期:** | | | |

**修订记录、审核记录和审批记录**

**修订记录**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **版本编号** | **修订日期** | **修订人** | **主要修订摘要** |
| V1.0 | 2016/7/1 |  | 第一版 |
| V1.1 | 2016/1/5 |  | 排版并增加持仓明细，持仓组合明细查询 |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

目录

[一、 **概述** 4](#_Toc471482220)

[二、 **已经实现的接口列表(未列出的接口一律不支持)** 4](#_Toc471482221)

[三、 **已实现的查询接口** 8](#_Toc471482222)

[四、 **业务算法的修改** 10](#_Toc471482223)

# 概述

mini2的api接口与mini1是一致的，只是api内部采用了 UTP协议与后台进行通讯,所以对于原有的客户端程序，直接替换mini2 api的dll和头文件即可成功编译。

# 以下是已经实现的接口列表(未列出的接口一律不支持)：

///创建TraderApi

///@param pszFlowPath 存贮订阅信息文件的目录，默认为当前目录

///@return 创建出的UserApi

static CThostFtdcTraderApi \*CreateFtdcTraderApi(const char \*pszFlowPath = "");

///删除接口对象本身

///@remark 不再使用本接口对象时,调用该函数删除接口对象

virtual void Release() = 0;

///初始化

///@remark 初始化运行环境,只有调用后,接口才开始工作

virtual void Init() = 0;

///等待接口线程结束运行

///@return 线程退出代码

virtual int Join() = 0;

///注册前置机网络地址

///@param pszFrontAddress：前置机网络地址。

///@remark 网络地址的格式为：“protocol://ipaddress:port”，如：”tcp://127.0.0.1:17001”。

///@remark “tcp”代表传输协议，“127.0.0.1”代表服务器地址。”17001”代表服务器端口号。

virtual void RegisterFront(char \*pszFrontAddress) = 0;

///注册回调接口

///@param pSpi 派生自回调接口类的实例

virtual void RegisterSpi(CThostFtdcTraderSpi \*pSpi) = 0;

///订阅私有流。

///@param nResumeType 私有流重传方式

/// THOST\_TERT\_RESTART:从本交易日开始重传

/// THOST\_TERT\_RESUME:从上次收到的续传

/// THOST\_TERT\_QUICK:只传送登录后私有流的内容

///@remark 该方法要在Init方法前调用。若不调用则不会收到私有流的数据。

virtual void SubscribePrivateTopic(THOST\_TE\_RESUME\_TYPE nResumeType) = 0;

///订阅公共流。

///@param nResumeType 公共流重传方式

/// THOST\_TERT\_RESTART:从本交易日开始重传

/// THOST\_TERT\_RESUME:从上次收到的续传

/// THOST\_TERT\_QUICK:只传送登录后公共流的内容

///@remark 该方法要在Init方法前调用。若不调用则不会收到公共流的数据。

virtual void SubscribePublicTopic(THOST\_TE\_RESUME\_TYPE nResumeType) = 0;

///用户登录请求

virtual int ReqUserLogin(CThostFtdcReqUserLoginField \*pReqUserLoginField, int nRequestID)

///登出请求

virtual int ReqUserLogout(CThostFtdcUserLogoutField \*pUserLogout, int nRequestID)

///报单录入请求

virtual int ReqOrderInsert(CThostFtdcInputOrderField \*pInputOrder, int nRequestID)

///报单录入请求**CTP报错**时的响应

virtual void OnRspOrderInsert(CThostFtdcInputOrderField \*pInputOrder, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast)

///报单录入错误回报,**不再使用**

~~virtual void OnErrRtnOrderInsert(CThostFtdcInputOrderField \*pInputOrder, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo)~~

///报单通知

virtual void OnRtnOrder(CThostFtdcOrderField \*pOrder)

///成交通知

virtual void OnRtnTrade(CThostFtdcTradeField \*pTrade)

///报单操作请求

virtual int ReqOrderAction(CThostFtdcInputOrderActionField \*pInputOrderAction, int nRequestID)

///报单操作请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspOrderAction(CThostFtdcInputOrderActionField \*pInputOrderAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast)

///报单操作**交易所报错**时的回报

virtual void OnErrRtnOrderAction(CThostFtdcOrderActionField \*pOrderAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo)

///批量报单操作请求

virtual int ReqBatchOrderAction(CThostFtdcInputBatchOrderActionField \*pInputBatchOrderAction, int nRequestID) = 0;

///批量报单操作请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspBatchOrderAction(CThostFtdcInputBatchOrderActionField \*pInputBatchOrderAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};

///批量报单操作**交易所报错**回报

virtual void OnErrRtnBatchOrderAction(CThostFtdcBatchOrderActionField \*pBatchOrderAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo) {};

///执行宣告录入请求

virtual int ReqExecOrderInsert(CThostFtdcInputExecOrderField \*pInputExecOrder, int nRequestID) = 0;

///执行宣告录入请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspExecOrderInsert(CThostFtdcInputExecOrderField \*pInputExecOrder, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};

///执行宣告录入错误回报,不再使用

~~virtual void OnErrRtnExecOrderInsert(CThostFtdcInputExecOrderField \*pInputExecOrder, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo) {};~~

///执行宣告通知

virtual void OnRtnExecOrder(CThostFtdcExecOrderField \*pExecOrder) {};

///执行宣告操作请求

virtual int ReqExecOrderAction(CThostFtdcInputExecOrderActionField \*pInputExecOrderAction, int nRequestID) = 0;

///执行宣告操作请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspExecOrderAction(CThostFtdcInputExecOrderActionField \*pInputExecOrderAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};

///执行宣告操作**交易所报错**回报

virtual void OnErrRtnExecOrderAction(CThostFtdcExecOrderActionField \*pExecOrderAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo) {};

///询价录入请求

virtual int ReqForQuoteInsert(CThostFtdcInputForQuoteField \*pInputForQuote, int nRequestID) = 0;

///询价录入请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspForQuoteInsert(CThostFtdcInputForQuoteField \*pInputForQuote, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};

///询价录入**交易所报错**回报

virtual void OnErrRtnForQuoteInsert(CThostFtdcInputForQuoteField \*pInputForQuote, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo) {};

///报价录入请求

virtual int ReqQuoteInsert(CThostFtdcInputQuoteField \*pInputQuote, int nRequestID) = 0;

///报价录入请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspQuoteInsert(CThostFtdcInputQuoteField \*pInputQuote, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};

///报价录入错误回报,不再使用

~~virtual void OnErrRtnQuoteInsert(CThostFtdcInputQuoteField \*pInputQuote, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo) {};~~

///报价通知

virtual void OnRtnQuote(CThostFtdcQuoteField \*pQuote) {};

///报价操作请求

virtual int ReqQuoteAction(CThostFtdcInputQuoteActionField \*pInputQuoteAction, int nRequestID) = 0;

///报价操作请求**CTP报错**时响应

virtual void OnRspQuoteAction(CThostFtdcInputQuoteActionField \*pInputQuoteAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};

///报价操作**交易所报错**回报

virtual void OnErrRtnQuoteAction(CThostFtdcQuoteActionField \*pQuoteAction, CThostFtdcRspInfoField \*pRspInfo) {};

# 以下是已实现的查询接口

///请求查询报单

virtual int ReqQryOrder(CThostFtdcQryOrderField \*pQryOrder, int nRequestID) = 0;

///请求查询成交

virtual int ReqQryTrade(CThostFtdcQryTradeField \*pQryTrade, int nRequestID) = 0;

///请求查询投资者持仓

virtual int ReqQryInvestorPosition(CThostFtdcQryInvestorPositionField \*pQryInvestorPosition, int nRequestID) = 0;

///请求查询投资者持仓明细  
virtual int ReqQryInvestorPositionDetail(CThostFtdcQryInvestorPositionDetailField \*pQryInvestorPositionDetail, int nRequestID) = 0;

目前只支持大商所

///请求查询投资者组合持仓明细  
virtual int ReqQryInvestorPositionCombineDetail(CThostFtdcQryInvestorPositionCombineDetailField \*pQryInvestorPositionCombineDetail, int nRequestID) = 0;  
目前只支持大商所

///请求查询资金账户

virtual int ReqQryTradingAccount(CThostFtdcQryTradingAccountField \*pQryTradingAccount, int nRequestID) = 0;

///请求查询交易编码

virtual int ReqQryTradingCode(CThostFtdcQryTradingCodeField \*pQryTradingCode, int nRequestID) = 0;

///请求查询合约保证金率

virtual int ReqQryInstrumentMarginRate(CThostFtdcQryInstrumentMarginRateField \*pQryInstrumentMarginRate, int nRequestID) = 0;

///请求查询合约手续费率

virtual int ReqQryInstrumentCommissionRate(CThostFtdcQryInstrumentCommissionRateField \*pQryInstrumentCommissionRate, int nRequestID) = 0;

///请求查询行情

virtual int ReqQryDepthMarketData(CThostFtdcQryDepthMarketDataField \*pQryDepthMarketData, int nRequestID) = 0;

///请求查询合约

virtual int ReqQryInstrument(CThostFtdcQryInstrumentField \*pQryInstrument, int nRequestID) = 0;

///请求查询投资者

virtual int ReqQryInvestor(CThostFtdcQryInvestorField \*pQryInvestor, int nRequestID) = 0;

///请求查询交易所

virtual int ReqQryExchange(CThostFtdcQryExchangeField \*pQryExchange, int nRequestID) = 0;

///请求查询产品

virtual int ReqQryProduct(CThostFtdcQryProductField \*pQryProduct, int nRequestID) = 0;

///请求查询合约状态

virtual int ReqQryInstrumentStatus(CThostFtdcQryInstrumentStatusField \*pQryInstrumentStatus, int nRequestID) = 0;

///请求查询期权交易成本

virtual int ReqQryOptionInstrTradeCost(CThostFtdcQryOptionInstrTradeCostField \*pQryOptionInstrTradeCost, int nRequestID) = 0;

///请求查询期权合约手续费

virtual int ReqQryOptionInstrCommRate(CThostFtdcQryOptionInstrCommRateField \*pQryOptionInstrCommRate, int nRequestID) = 0;

///请求查询执行宣告

virtual int ReqQryExecOrder(CThostFtdcQryExecOrderField \*pQryExecOrder, int nRequestID) = 0;

///请求查询询价

virtual int ReqQryForQuote(CThostFtdcQryForQuoteField \*pQryForQuote, int nRequestID) = 0;

///请求查询报价

virtual int ReqQryQuote(CThostFtdcQryQuoteField \*pQryQuote, int nRequestID) = 0;

# 业务算法的修改：

(a).资金表(TradingAccount),仅计算以下字段：

FrozenMargin:冻结保证金---期货：限价单以开仓价计算，其余以涨停价计算；期权：一律以昨结算价计算

FrozenCash:冻结权利金

CurrMargin:保证金---期货：昨仓以昨结算价计算，今仓以开仓价计算；平仓后减少的保证金为持仓均价\*平仓数量;支持按产品组收取大边保证金

期权：一律以昨结算价计算

Commission:手续费,分开仓，平今，平昨计算

CloseProfit:平仓盈亏，由于不使用持仓明细计算，所以平仓盈亏=(成交价-持仓均价)\*平仓数量

CashIn:权利金

Available:可用资金，随且仅随着以上字段的变化而变化

(b).持仓表(InvestorPosition),初始化数据需要这张表(不再使用原来的持仓明细表

)；仅计算以下字段:

LongFrozen:买冻结,平空头仓时会更新该字段

ShortFrozen:卖冻结,平多头仓时会更新该字段

Position:总仓

TodayPosition:今仓

PositionCost：持仓成本

CloseProfit:平仓盈亏