

飞马开放柜台 MdUserAPI 说明书



上海金融期货信息技术有限公司

Shanghai Financial Futures Information Technology Co., Ltd

文档标识

项目名称	飞马开放柜台 FIP
文档名称	MdUser API
版本号	1.12
状况	<input type="radio"/> 草案 <input type="radio"/> 评审过的 <input checked="" type="radio"/> 更新过的 <input type="radio"/> 定为基线的

文档修订历史

版本	日期	描述	修订者
V0.8	20121201	初稿	李华华
V0.10	20180201	增加了原油铁矿石业务支持，接口未变化	李华华
V0.12	20180416	增加境外投资者原油铁矿石业务支持，结构体变化，接口未变	李华华
V0.14	20180607	1. 修改 TftdcUstpHedgeFlagType 投机套保类型； 2. 增加 TftdcUstpArbiTypeType 策略类别类型； 3. 增加 TftdcUstpDeliveryFlagType 执行类型类型； 4. 增加 TftdcUstpCombActionStatusType 组合操作状态类型； 5. 结构体中 CustpFtdcInputMarginCombActionField 增加 3 个新字段； 6. 接口未变；	李华华
V1.01	20180921	增加铜期权行权对冲相关枚举值； 接口未变化；	李华华
V1.03	20181211	增加可开手数接口；接口未变化	李华华
V1.04	20190319	接口未变化	lihh
V1.05	20190729	接口未变化	lihh
V1.07	20191125	接口未变化	Lihh
V1.10	20200611	结构体 CUstpFtdcDepthMarketDataField 增加交易所代码	周超

此版本文档的正式核准

姓名	签字	日期

--	--	--

目录

第 1 章	介绍.....	1
第 2 章	体系结构.....	1
2.1	通讯模式.....	1
2.2	数据流.....	2
第 3 章	运行模式.....	1
3.1	工作线程.....	1
3.2	本地文件.....	1
第 4 章	开发接口.....	1
4.1	CUstpFtdcMduserSpi 接口.....	1
4.1.1	OnFrontConnected 方法.....	1
4.1.2	OnFrontDisconnected 方法.....	1
4.1.3	OnHeartBeatWarning 方法.....	2
4.1.4	OnRspUserLogin 方法.....	2
4.1.5	OnRspUserLogout 方法.....	3
4.1.6	OnRtnDepthMarketData 方法.....	4
4.1.7	OnRspError 方法.....	7
4.1.8	OnRspSubMarketData 方法.....	8
4.1.9	OnRspUnSubMarketData 方法.....	8
4.1.10	OnRspGetMarketTopic 方法.....	9
4.1.11	OnRspSubscribeTopic 方法.....	9
4.2	CUstpFtdcMduserApi 接口.....	10
4.2.1	CreateFtdcMduserApi 方法.....	10
4.2.2	Release 方法.....	10
4.2.3	Init 方法.....	10
4.2.4	Join 方法.....	11
4.2.5	GetTradingDay 方法.....	11
4.2.6	RegisterSpi 方法.....	11
4.2.7	RegisterFront 方法.....	11
4.2.8	RegisterNameServer 方法（未启用）.....	12
4.2.9	SubscribeMarketDataTopic 方法.....	12
4.2.10	ReqUserLogin 方法.....	13
4.2.11	ReqUserLogout 方法.....	14
4.2.12	SubMarketData 方法.....	14
4.2.13	UnSubMarketData 方法.....	15
4.2.14	GetMarketTopic 方法.....	15
第 5 章	开发示例.....	17

第1章 介绍

行情客户端系统 API 是一个基于 C++ 的类库，通过使用和扩展类库提供的接口来实现行情数据的接收。该类库包含以下 5 个文件：

文件名	版本	文件大小	文件描述
UstpFtdcMduserApi.h	V1.04		行情接口头文件
UstpFtdcUserApiDataType.h	V1.04		定义了 API 所需的一系列数据类型的头文件
UstpFtdcUserApiStruct.h	V1.04		定义了一系列业务相关的数据结构的头文件
USTPmduserapi.dll	V1.04		动态链接库二进制文件
USTPmduserapi.lib	V1.04		导入库文件

注：文件名称与多交易所版 API 相同

支持 MS VC 6.0, MS VC.NET 2003 编译器。需要打开多线程编译选项/MT。

第2章 体系结构

行情 API 使用建立在 TCP 协议之上 FTD 协议与飞马的行情发布服务器进行通讯。行情发布服务器负责行情信息的产生与发布，但不参与交易过程。参与交易需要使用另外的“交易员 API”。

2.1 通讯模式

FTD 协议中的所有通讯都基于某个通讯模式。通讯模式实际上就是通讯双方协同工作的方式。

行情发布涉及的通讯模式共有二种：

- 对话通讯模式
- 广播通讯模式

对话通讯模式是指由客户端主动发起的通讯请求。该请求被飞马服务端接收和处理，并给予响应。例如登入与登出。这种通讯模式与普通的客户/服务器模式相同。

广播通讯模式是指飞马服务端主动，向飞马系统中的相关客户发出相同的信息，例如行情等。

通讯模式和网络的连接不一定存在简单的一对一的关系。也就是说，一个网络连接中可能传送多种不同通讯模式的报文，一种通讯模式的报文也可以在多个不同的连接中传送。

无论哪种通讯模式，其通讯过程都如图 1 所示：

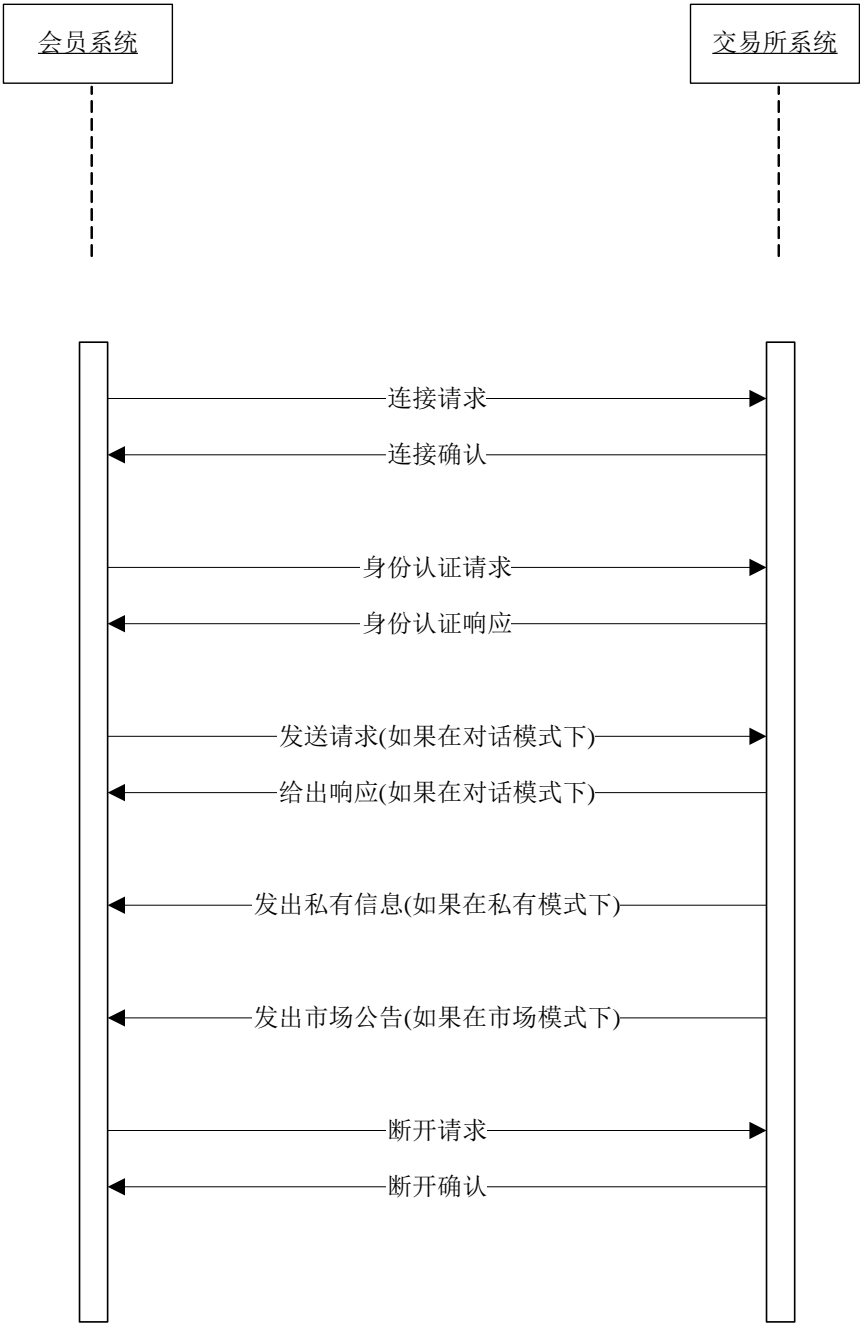


图1) 各通讯模式的工作过程

2.2 数据流

行情发布支持对话通讯模式、广播通讯模式。

对话通讯模式下支持对话数据流：

对话数据流是一个双向数据流，客户端发送请求，飞马行情发布系统反馈应

答。飞马系统不维护对话流的状态。系统故障时，对话数据流会重置，通讯途中的数据可能会丢失。

广播通讯模式下支持行情数据流：

行情数据流是一个单向数据流，由飞马行情发布系统发向客户端，用于发送行情信息；行情流是一个可靠的数据流，飞马行情系统维护整个系统的行情流，在一个交易日内，客户端系统断线恢复连接时，可以请求行情系统发送指定序号之后的行情流数据。

行情服务所提供的行情内容是按照主题组织的。每个主题包括一组合约的行情，还包括了行情发布内容和发布方式，包括行情深度、采样频率、延迟时间等。目前飞马行情系统参考各个交易所公布的各行情主题，为每个交易所分别设定了行情主题。每个行情主题对应着某一个交易所的行情流。

要获得行情通知，客户端必须在连接行情服务器时，订阅一个或多个行情发布主题。

第3章 运行模式

3.1 工作线程

交易员客户端应用程序至少由两个线程组成，一个是应用程序主线程，一个是行情 API 工作线程。客户端应用程序与飞马系统的通讯是由 API 工作线程驱动的。

UstpFtdcMduserApi 提供的接口是线程安全的，可以有多个应用程序线程同时发出请求。

UstpFtdcMduserSpi 提供的接口回调是由 API 工作线程驱动，如果重载的某个回调函数阻塞，则等于阻塞了 API 工作线程，API 与飞马系统的通讯会停止。因此，在 UstpFtdcTraderSpi 派生类的回调函数中，通常应迅速返回，可以利用将数据放入缓冲区或通过 Windows 的消息机制来实现。

3.2 本地文件

行情 API 在运行过程中，会将一些数据写入本地文件中。调用 CreateFtdcMduserApi 函数，可以传递一个参数，指明存贮本地文件的路径。该路径必须在运行前已创建好。本地文件的扩展名都是“.con”。

第4章 开发接口

行情客户端系统 API 提供了二类接口，分别为 CUSTpFtdcMduserApi 和 CUSTpFtdcMduserSpi。

4.1 CUSTpFtdcMduserSpi 接口

CUSTpFtdcMduserSpi 实现了事件通知接口。用户必需派生 CUSTpFtdcMduserSpi 接口，编写事件处理方法来处理感兴趣的事件。

4.1.1 OnFrontConnected 方法

当客户端与行情发布服务器建立起通信连接时（还未登录前），该方法被调用。

函数原型：

```
void OnFrontConnected();
```

本方法在完成初始化后调用，可以在其中完成用户登录任务。

4.1.2 OnFrontDisconnected 方法

当客户端与交易后台通信连接断开时，该方法被调用。当发生这个情况后，API 会自动重新连接，客户端可不做处理。

函数原型：

```
void OnFrontDisconnected (int nReason);
```

参数：

nReason: 连接断开原因，主要包括以下几种原因

0x1001 网络读失败

0x1002 网络写失败

0x2001 接收心跳超时

0x2002 发送心跳失败

0x2003 收到错误报文

4.1.3 OnHeartBeatWarning 方法

心跳超时警告。当长时间未收到报文时，该方法被调用。

函数原型：

```
void OnHeartBeatWarning(int nTimeLapse);
```

参数：

nTimeLapse: 距离上次接收报文的时间，单位：秒

4.1.4 OnRspUserLogin 方法

当客户端发出登录请求之后，该方法会被调用，通知客户端登录是否成功。

函数原型：

```
void OnRspUserLogin(  
    CUstpFtdcRspUserLoginField *pRspUserLogin,  
    CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo,  
    int nRequestID,  
    bool bIsLast);
```

参数：

pRspUserLogin: 返回用户登录信息的地址。

用户登录信息结构：

```
struct CUstpFtdcRspUserLoginField  
{  
    ///交易日  
    TUstpFtdcDateType    TradingDay;  
    ///经纪公司编号  
    TUstpFtdcBrokerIDType    BrokerID;  
    ///交易用户代码  
    TUstpFtdcUserIDType    UserID;  
    ///登录成功时间  
    TUstpFtdcTimeType    LoginTime;  
    ///登录成功时的交易所时间  
    TUstpFtdcTimeType    ExchangeTime;  
    ///用户最大本地报单号  
    TUstpFtdcUserOrderLocalIDType    MaxOrderLocalID;
```

```

    ///交易系统名称
    TUstpFtdcTradingSystemNameType   TradingSystemName;
    ///数据中心代码
    TUstpFtdcDataCenterIDType DataCenterID;
    ///会员私有流当前长度
    TUstpFtdcSequenceNoType   PrivateFlowSize;
    ///交易员私有流当前长度
    TUstpFtdcSequenceNoType   UserFlowSize;
    ///业务发生日期
    TUstpFtdcDateType         ActionDay;
    ///飞马版本号
    TUstpFtdcFemasVersionType FemasVersion;
    ///飞马生命周期号
    TUstpFtdcFemasLifeCycleType FemasLifeCycle;
};

```

pRspInfo: 返回用户响应信息的地址。**特别注意在有连续的成功响应数据时，中间有可能返回 NULL，但第一次不会**，以下同。错误代码为 0 时，表示操作成功，以下同。

响应信息结构：

```

struct CUstpFtdcRspInfoField
{
    ///错误代码,0 表示正确
    TUstpFtdcErrorIDType   ErrorID;
    ///错误信息
    TUstpFtdcErrorMsgType   ErrorMsg;
};

```

nRequestID: 返回用户登录请求的 ID，该 ID 由用户在登录时指定。

bIsLast: 指示该次返回是否为针对 nRequestID 的最后一次返回。

4.1.5 OnRspUserLogout 方法

当客户端发出登出请求之后，该方法会被调用，通知客户端登出是否成功。

函数原型：

```

void OnRspUserLogout(
    CUstpFtdcRspUserLogoutField *pRspUserLogout,
    CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo,
    int nRequestID,
    bool bIsLast);

```

参数:

pRspUserLogout: 返回用户登出信息的地址。

用户登出信息结构:

```
struct CUstpFtdcRspUserLogoutField
{
    ///交易用户代码
    TUstpFtdcUserIDType  UserID;
    ///会员代码
    TUstpFtdcParticipantIDType ParticipantID;
};
```

pRspInfo: 返回用户响应信息的地址。

响应信息结构:

```
struct CUstpFtdcRspInfoField
{
    ///错误代码
    TUstpFtdcErrorIDType  ErrorID;
    ///错误信息
    TUstpFtdcErrorMsgType  ErrorMsg;
};
```

nRequestID: 返回用户登出请求的 ID, 该 ID 由用户在登出时指定。

bIsLast: 指示该次返回是否为针对 nRequestID 的最后一次返回。

4.1.6 OnRtnDepthMarketData 方法

行情通知, 飞马接收到交易所行情后, 飞马行情服务器会主动通知客户端程序。客户端要接收飞马实时行情, 必须实现该方法。

函数原型:

```
void OnRtnDepthMarketData(CUstpFtdcDepthMarketDataField *pDepthMarketData);
```

参数:

pDepthMarketData: 返回市场行情信息的地址。

深度市场行情信息结构:

///深度行情

```
struct CUstpFtdcDepthMarketDataField
{
    ///交易日
    TUstpFtdcDateType    TradingDay;
    ///结算组代码
    TUstpFtdcSettlementGroupIDType    SettlementGroupID;
    ///结算编号
    TUstpFtdcSettlementIDType    SettlementID;
    ///昨结算
    TUstpFtdcPriceType    PreSettlementPrice;
    ///昨收盘
    TUstpFtdcPriceType    PreClosePrice;
    ///昨持仓量
    TUstpFtdcLargeVolumeType    PreOpenInterest;
    ///昨虚实度
    TUstpFtdcRatioType    PreDelta;
    ///今开盘
    TUstpFtdcPriceType    OpenPrice;
    ///最高价
    TUstpFtdcPriceType    HighestPrice;
    ///最低价
    TUstpFtdcPriceType    LowestPrice;
    ///今收盘
    TUstpFtdcPriceType    ClosePrice;
    ///涨停板价
    TUstpFtdcPriceType    UpperLimitPrice;
    ///跌停板价
    TUstpFtdcPriceType    LowerLimitPrice;
    ///今结算
    TUstpFtdcPriceType    SettlementPrice;
    ///今虚实度
    TUstpFtdcRatioType    CurrDelta;
    ///最新价
    TUstpFtdcPriceType    LastPrice;
    ///数量
    TUstpFtdcVolumeType    Volume;
    ///成交金额
    TUstpFtdcMoneyType    Turnover;
    ///持仓量
    TUstpFtdcLargeVolumeType    OpenInterest;
    ///申买价一
    TUstpFtdcPriceType    BidPrice1;
    ///申买量一
    TUstpFtdcVolumeType    BidVolume1;
```

```
///申卖价一
TUstpFtdcPriceType    AskPrice1;
///申卖量一
TUstpFtdcVolumeType   AskVolume1;
///申买价二
TUstpFtdcPriceType    BidPrice2;
///申买量二
TUstpFtdcVolumeType   BidVolume2;
///申买价三
TUstpFtdcPriceType    BidPrice3;
///申买量三
TUstpFtdcVolumeType   BidVolume3;
///申卖价二
TUstpFtdcPriceType    AskPrice2;
///申卖量二
TUstpFtdcVolumeType   AskVolume2;
///申卖价三
TUstpFtdcPriceType    AskPrice3;
///申卖量三
TUstpFtdcVolumeType   AskVolume3;
///申买价四
TUstpFtdcPriceType    BidPrice4;
///申买量四
TUstpFtdcVolumeType   BidVolume4;
///申买价五
TUstpFtdcPriceType    BidPrice5;
///申买量五
TUstpFtdcVolumeType   BidVolume5;
///申卖价四
TUstpFtdcPriceType    AskPrice4;
///申卖量四
TUstpFtdcVolumeType   AskVolume4;
///申卖价五
TUstpFtdcPriceType    AskPrice5;
///申卖量五
TUstpFtdcVolumeType   AskVolume5;
///合约代码
TUstpFtdcInstrumentIDType InstrumentID;
///最后修改时间
TUstpFtdcTimeType      UpdateTime;
///最后修改毫秒
TUstpFtdcMillisecType  UpdateMillisec;
///业务发生日期
TUstpFtdcDateType      ActionDay;
```

```
///历史最高价
TUstpFtdcPriceType    HisHighestPrice;
///历史最低价
TUstpFtdcPriceType    HisLowestPrice;
///最新成交量
TUstpFtdcVolumeType   LatestVolume;
///初始持仓量
TUstpFtdcVolumeType   InitVolume;
///持仓量变化
TUstpFtdcVolumeType   ChangeVolume;
///申买推导量
TUstpFtdcVolumeType   BidImpliedVolume;
///申卖推导量
TUstpFtdcVolumeType   AskImpliedVolume;
///当日均价
TUstpFtdcPriceType     AvgPrice;
///策略类别
TUstpFtdcArbiTypeType   ArbiType;
///第一腿合约代码
TUstpFtdcInstrumentIDType InstrumentID_1;
///第二腿合约代码
TUstpFtdcInstrumentIDType InstrumentID_2;
///合约名称
TUstpFtdcInstrumentIDType InstrumentName;
///总买入量
TUstpFtdcVolumeType     TotalBidVolume;
///总卖出量
TUstpFtdcVolumeType     TotalAskVolume;
///交易所代码
TUstpFtdcVolumeType     ExchangeID;
};
```

4.1.7 OnRspError 方法

针对用户请求的出错通知。

函数原型:

```
void OnRspError(
    CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo,
    int nRequestID,
    bool bIsLast)
```

参数:

pRspInfo: 返回用户响应信息的地址。

响应信息结构:

```
struct CUstpFtdcRspInfoField
{
    ///错误代码
    TUstpFtdcErrorIDType ErrorID;
    ///错误信息
    TUstpFtdcErrorMsgType ErrorMsg;
};
```

nRequestID: 返回用户登出请求的 ID, 该 ID 由用户在登出时指定。

4.1.8 OnRspSubMarketData 方法

针对用户请求订阅的合约返回已经订阅的合约结果。

函数原型:

```
void OnRspSubMarketData(CUstpFtdcSpecificInstrumentField *pSpecificInstrument,
CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast)
```

参数:

pSpecificInstrument: 返回用户成功订阅的合约。

nRequestID: 返回用户登出请求的 ID, 该 ID 由用户在登出时指定。这里无效。

bIsLast: 指示该次返回是否为针对 nRequestID 的最后一次返回。

4.1.9 OnRspUnSubMarketData 方法

针对用户请求退订的合约返回退订的合约结果。

函数原型:

```
void OnRspUnSubMarketData(CUstpFtdcSpecificInstrumentField *pSpecificInstrument,
CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast)
```

参数:

pSpecificInstrument: 返回用户成功退订的合约。

nRequestID: 返回用户登出请求的 ID, 该 ID 由用户在登出时指定。这里无

效。

bIsLast: 指示该次返回是否为针对 nRequestID 的最后一次返回。

4.1.10 OnRspGetMarketTopic 方法

针对用户请求的获取行情主题信息返回行情主题结果。

函数原型:

```
void OnRspGetMarketTopic(CUstpFtdcRspMarketTopicField *pRspMarketTopic, CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast)
```

参数:

pRspMarketTopic: 返回行情订阅主题号代码

```
struct CUstpFtdcRspMarketTopicField
{
    ///交易所代码
    TUstpFtdcExchangeIDType ExchangeID;
    ///订阅号
    TUstpFtdcSequenceSeriesType TopicID;
};
```

nRequestID: 返回用户登出请求的 ID, 该 ID 由用户在登出时指定。这里无效。

bIsLast: 指示该次返回是否为针对 nRequestID 的最后一次返回。

4.1.11 OnRspSubscribeTopic 方法

针对用户请求的订阅行情主题信息返回已经成功订阅行情主题的结果。

函数原型:

```
void OnRspSubscribeTopic(CUstpFtdcDisseminationField *pDissemination, CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast) {};
```

4.2 CUstpFtdcMduserApi 接口

CUstpFtdcMduserApi 接口提供给客户端登陆、登出飞马行情服务器, 进行行情查询、主题订阅等基本行情功能。

4.2.1 CreateFtdcMduserApi 方法

产生一个 CUstpFtdcMduserApi 的一个实例, **不能通过 new 来产生**。

函数原型:

```
static CUstpFtdcMduserApi *CreateFtdcMduserApi(const char *pszFlowPath = "");
```

参数:

pszFlowPath: 常量字符指针, 用于指定一个客户端本地文件目录来存贮行情服务发布消息的状态。 要求目录必须已经存在。默认值代表当前目录。

返回值:

返回一个指向 CUstpFtdcMduserApi 实例的指针。

4.2.2 Release 方法

释放一个 CUstpFtdcMduserApi 实例。

函数原型:

```
void Release();
```

4.2.3 Init 方法

使客户端开始与行情发布服务器建立连接, 连接成功后可以进行登陆。

函数原型:

```
void Init();
```

4.2.4 Join 方法

客户端等待一个接口实例线程的结束。

函数原型：

```
void Join();
```

4.2.5 GetTradingDay 方法

获得当前交易日。只有当与服务器连接建立后才会取到正确的值。

函数原型：

```
const char *GetTradingDay();
```

返回值：

返回一个指向日期信息字符串的常量指针。

4.2.6 RegisterSpi 方法

注册一个派生自 CUstpFtdcMduserSpi 接口类的实例，该实例将完成事件处理。

函数原型：

```
void RegisterSpi(CUstpFtdcMduserSpi *pSpi);
```

参数：

pSpi: 实现了 CUstpFtdcMduserSpi 接口的实例指针。

4.2.7 RegisterFront 方法

设置飞马行情发布服务器的地址。

函数原型：

```
void RegisterFront(char *pszFrontAddress);
```

参数：

pszFrontAddress: 指向后台服务器地址的指针。服务器地址的格式为：

“protocol://ipaddress:port”，如：“tcp://127.0.0.1:17001”。“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。

4.2.8 RegisterNameServer 方法（未启用）

设置飞马 NameServer 的网络通讯地址，用于获取行情服务列表。交易系统拥有多个 NameServer，用户可以同时注册多个 NameServer 的网络通讯地址。

该方法要在 Init 方法之前调用。

函数原型：

```
void RegisterNameServer (char *pszNsAddress);
```

参数：

pszNsAddress：指向交易所服务端 NameServer 网络通讯地址的指针。网络地址的格式为：“protocol://ipaddress:port”，如：“tcp://127.0.0.1:17001”。“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。

注意：此接口保留，但目前并未启用！

4.2.9 SubscribeMarketDataTopic 方法

客户端订阅自己需要的行情。订阅后行情服务器会自动发出行情通知给客户端。没有对应的 onRspXXX 方法，表示客户端调用该方法一定保证成功。需要在方法 SubMarketData()和 Init()之前调用。

函数原型：

```
void SubscribeMarketDataTopic (int nTopicID, TE_RESUME_TYPE nResumeType);
```

参数：

nTopicID：代表深度行情的主题，由飞马系统指定，每套飞马系统可能不同，可以通过 GetMarketTopic 方法请求查询主题号。

nResumeType：市场行情重传方式

TERT_RESTART:从本交易日开始重传

TERT_RESUME:从上次收到的续传(非订阅全部合约时，不支持续传模式)

TERT_QUICK:先传送当前行情快照,再传送登录后市场行情的内容

4.2.10 ReqUserLogin 方法

用户发出登陆请求。登陆行情不需要验证登陆密码是否正确,任何合法用户均可登陆成功。

函数原型:

```
int ReqUserLogin(  
    CUstpFtdcReqUserLoginField *pReqUserLoginField,  
    int nRequestID);
```

参数:

pReqUserLoginField: 指向用户登录请求结构的地址。

用户登录请求结构:

```
struct CUstpFtdcReqUserLoginField  
{  
    ///交易日  
    TUstpFtdcDateType    TradingDay;  
    ///交易用户代码  
    TUstpFtdcUserIDType  UserID;  
    ///经纪公司编号  
    TUstpFtdcBrokerIDType  BrokerID;  
    ///密码  
    TUstpFtdcPasswordType  Password;  
    ///用户端产品信息  
    TUstpFtdcProductInfoType  UserProductInfo;  
    ///接口端产品信息  
    TUstpFtdcProductInfoType  InterfaceProductInfo;  
    ///协议信息  
    TUstpFtdcProtocolInfoType  ProtocolInfo;  
    ///IP 地址  
    TUstpFtdcIPAddressType  IPAddress;  
    ///Mac 地址  
    TUstpFtdcMacAddressType  MacAddress;  
    ///数据中心代码  
    TUstpFtdcDataCenterIDType  DataCenterID;  
    ///客户端运行文件大小  
    TUstpFtdcFileSizeType  UserProductFileSize;  
    ///客户认证类型  
    TUstpFtdcFactor2TypeType  Factor2Type;
```

```
///客户认证密码
TUstpFtdcFactor2PasswordType Factor2Password;
///开发厂商终端编码
TUstpFtdcTerminalCodeType TerminalCode;
};
```

nRequestID: 用户登录请求的 ID，该 ID 由用户指定，管理。

返回值:

0，代表成功。其它值代表失败。

4.2.11 ReqUserLogout 方法

用户发出登出请求。

函数原型:

```
int ReqUserLogout(
CUstpFtdcReqUserLogoutField *pReqUserLogout,
int nRequestID);
```

参数:

pReqUserLogout: 指向用户登出请求结构的地址。

用户登出请求结构:

```
struct CUstpFtdcReqUserLogoutField
{
    ///经纪公司编号
    TUstpFtdcBrokerIDType BrokerID;
    ///交易用户代码
    TUstpFtdcUserIDType UserID;
};
```

nRequestID: 用户登出请求的 ID，该 ID 由用户指定，管理。

返回值:

0，代表成功。其它值代表失败。

4.2.12 SubMarketData 方法

用户请求订阅的合约号。需要在方法 `SubscribeMarketDataTopic()` 之后调用。

函数原型:

```
int SubMarketData(char *ppInstrumentID[], int nCount)
```

参数:

ppInstrumentID: 合约 ID 数组地址。

nCount: 合约的个数。不支持 “*”代表订阅所有合约。支持模糊查询订阅，例如“IF*”代表订阅所有 IF 合约。

返回值:

0, 代表成功。其它值代表失败。

4.2.13 UnSubMarketData 方法

用户请求去除订阅的合约号。

函数原型:

```
int UnSubMarketData(char *ppInstrumentID[], int nCount)
```

参数:

ppInstrumentID: 退订合约 ID 数组地址。

nCount: 合约的个数。

返回值:

0, 代表成功。其它值代表失败。

4.2.14 GetMarketTopic 方法

获取某个交易所的行情主题号的方法。

函数原型:

```
int GetMarketTopic(char *pExchangeID)
```

参数:

pExchangeID: 需要获取主题号的交易所代码。

返回值：

0，代表成功。其它值代表失败。

第5章 开发示例

```
// mddemo.cpp :  
// 一个简单的例子，介绍UstpFtdcMduserApi和UstpFtdcMduserSpi接口的使用。  
  
#include <stdio.h>  
#include <string.h>  
#include <float.h>  
#include "UstpFtdcMduserApi.h"  
  
class CSimpleHandler : public CUstpFtdcMduserSpi  
{  
public:  
    // 构造函数，需要一个有效的指向CUstpFtdcMduserApi实例的指针  
    CSimpleHandler(CUstpFtdcMduserApi *pUserApi) : m_pUserApi(pUserApi) {}  
  
    ~CSimpleHandler() {}  
  
    // 当客户端与行情发布服务器建立起通信连接，客户端需要进行登录  
    void OnFrontConnected()  
    {  
        CUstpFtdcReqUserLoginField reqUserLogin;  
        strcpy(reqUserLogin.TradingDay, m_pUserApi->GetTradingDay());  
        strcpy(reqUserLogin.BrokerID, "0001");  
        strcpy(reqUserLogin.UserID, "000101");  
        strcpy(reqUserLogin.Password, "111111");  
        m_pUserApi->ReqUserLogin(&reqUserLogin, 0);  
    }  
  
    // 当客户端与行情发布服务器通信连接断开时，该方法被调用  
    void OnFrontDisconnected()  
    {  
        // 当发生这个情况后，API会自动重新连接，客户端可不做处理  
        printf("OnFrontDisconnected. \n");  
    }  
  
    // 当客户端发出登录请求之后，该方法会被调用，通知客户端登录是否成功  
    void OnRspUserLogin(CUstpFtdcRspUserLoginField *pRspUserLogin,  
CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool bIsLast)  
    {  
        printf("OnRspUserLogin:\n");  
        printf("ErrorCode=[%d], ErrorMsg=[%s]\n", pRspInfo->ErrorID,
```

```
pRspInfo->ErrorMsg);
    printf("RequestID=[%d], Chain=[%d]\n", nRequestID, bIsLast);

    if (pRspInfo->ErrorID != 0)
    {
        // 端登失败, 客户端需进行错误处理
        printf("Failed to login, errorcode=%d errmsg=%s requestid=%d
chain=%d", pRspInfo->ErrorID, pRspInfo->ErrorMsg, nRequestID, bIsLast);
        return;
    }
    char * contracts[3]={"", "", ""};
    contracts[0]="IF1212";
    contracts[1]="IF1303";
    contracts[2]="IF1210";
    m_pUserApi->SubMarketData(contracts, 3);

    char * uncontracts[2]={"", ""};
    uncontracts[0]="IF1211";
    uncontracts[1]="IF1212";
    m_pUserApi->UnSubMarketData(uncontracts, 2);
}

// 深度行情通知, 行情服务器会主动通知客户端
void OnRtnDepthMarketData(CUstpFtdcDepthMarketDataField *pMarketData)
{
    // 客户端按需处理返回的数据

    printf("%s,%s,%d, ", pMarketData->InstrumentID, pMarketData->UpdateTime, pMar
ketData->UpdateMillisec);
    if (pMarketData->AskPrice1==DBL_MAX)
        printf("%s, ", "");
    else
        printf("%f, ", pMarketData->AskPrice1);

    if (pMarketData->BidPrice1==DBL_MAX)
        printf("%s \n", "");
    else
        printf("%f \n", pMarketData->BidPrice1);
}

// 针对用户请求的出错通知
void OnRspError(CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool
bIsLast)
{
```

```
        printf("OnRspError:\n");
        printf("ErrorCode=[%d], ErrorMsg=[%s]\n", pRspInfo->ErrorID,
pRspInfo->ErrorMsg);
        printf("RequestID=[%d], Chain=[%d]\n", nRequestID, bIsLast);
        // 客户端需进行错误处理
    }

    ///订阅合约的相关信息
    void OnRspSubMarketData(CUstpFtdcSpecificInstrumentField
*pSpecificInstrument, CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool
bIsLast)
    {
        printf("Sub 返回订阅合约: %s \n",pSpecificInstrument->InstrumentID);
    }

    ///订阅合约的相关信息
    void OnRspUnSubMarketData(CUstpFtdcSpecificInstrumentField
*pSpecificInstrument, CUstpFtdcRspInfoField *pRspInfo, int nRequestID, bool
bIsLast)
    {
        printf("UnSub 返回订阅合约: %s
\n",pSpecificInstrument->InstrumentID);
    }

private:
    // 指向CUstpFtdcMduserApi实例的指针
    CUstpFtdcMduserApi *m_pUserApi;
};

int main()
{
    // 产生一个CUstpFtdcMduserApi实例
    CUstpFtdcMduserApi *pUserApi = CUstpFtdcMduserApi::CreateFtdcMduserApi();
    // 产生一个事件处理的实例
    CSimpleHandler sh(pUserApi);
    // 注册一事件处理的实例
    pUserApi->RegisterSpi(&sh);
    // 注册需要的深度行情主题
    ///          TERT_RESTART:从本交易日开始重传
    ///          TERT_RESUME:从上次收到的续传
    ///          TERT_QUICK:先传送当前行情快照,再传送登录后市场行情的内容
    pUserApi->SubscribeMarketDataTopic (101, TERT_RESUME);
    pUserApi->SubscribeMarketDataTopic (110, USTP_TERT_RESTART);
    // 设置行情发布服务器的地址
```

```
pUserApi->RegisterFront("tcp://127.0.0.1:9987");  
  
// 使客户端开始与行情发布服务器建立连接  
pUserApi->Init();  
// 释放useapi实例  
pUserApi->Release();  
return 0;  
}
```