

版本说明

2022/09/05 初稿

2022/09/09 调整onOrder接口；新增onCancelOrder接口；

2022/09/19 增加配置文件部分线程运行模式说明；增加部分常见问题说明；

用法概览

以下是使用API的基本流程：

1. 配置API文件；
2. 启动应用；
3. 创建API对象；
4. 启动API对象；
5. 查询合约；
6. 发送报单；
7. 处理报单回报；
8. 处理成交回报；
9. 撤销报单；
10. 停止API对象；
11. 退出应用；

用法示例伪代码：

```
int main(int argc, const char *argv[]) {
    std::cout << "xtf api version: " << getXTFVersion() << std::endl;

    // 传入配置文件路径, 创建API对象
    XTFApi *api = makeXTFApi("./xtf_trader_api.config");
    if (api == nullptr) {
        std::cout << "xtf api make failed." << std::endl;
        return -1;
    }

    // 创建SPI回调处理对象
    XTFTTrader spi(api);

    // 启动API对象, 启动成功后会自动调用spi->onStart()接口
    int ret = api->start(&spi);
    if (ret != 0) {
        printf("api start failed, error code: %d\n", ret);
        exit(0);
    }
    sleep(1);

    // 登录柜台, 登录结果在spi->onLogin()接口中返回
    ret = api->login();
    if (ret != 0) {
        printf("api login failed, error code: %d\n", ret);
        exit(0);
    }
    sleep(1);

    // 创建报单对象
```

```

XTFInputOrder inputOrder;
inputOrder.localOrderID = 1; // 建议使用本地唯一的编号
inputOrder.direction = XTF_D_Buy;
inputOrder.offsetFlag = XTF_OF_Open;
inputOrder.orderType = XTF_ODT_FAK;
inputOrder.price = 326.20f;
inputOrder.volume = 1;
inputOrder.channelSelectionType = XTF_CS_Auto;
inputOrder.channelID = 0;
inputOrder.orderFlag = XTF_ODF_Normal;
// 查询可用的合约对象
inputOrder.instrument = api->getInstrumentByID("au2212");
if (inputOrder.instrument == nullptr) {
    printf("instrument not found\n");
    exit(0);
}

// 发送报单
ret = api->insertOrder(inputOrder);
if (ret != 0) {
    printf("api insert order failed, error code: %d\n", ret);
    exit(0);
}
sleep(1);

// 登出柜台
ret = api->logout();
if (ret != 0) {
    printf("api logout failed, error code: %d\n", ret);
    exit(0);
}
sleep(1);

// 停止API对象，API对象停止后，api即失效，不能再次使用。
ret = api->stop();
if (ret != 0) {
    printf("api stop failed, error code: %d\n", ret);
    exit(0);
}

api = nullptr;
sleep(1);

std::cout << "xtf api exit." << std::endl;
return 0;
}

```

配置API

API提供配置文件的方式创建实例和设置运行参数。

配置文件内容如下：

```

#####
# 创建API实例时，请使用独立的配置文件。

```

```
# 多个账号请创建多个API实例，每个API实例使用各自不同的配置文件。

# 资金账号
ACCOUNT_ID=41008313_1

# 账号密码
ACCOUNT_PWD=111111

# 看穿式监管需要的APP_ID
APP_ID=1234

# 看穿式监管需要的授权码
AUTH_CODE=1234

# 查询使用的地址和端口（TCP）
QUERY_SERVER_IP=192.168.4.63
QUERY_SERVER_PORT=33333

# 交易使用的地址和端口（UDP）
TRADE_SERVER_IP=192.168.4.63
TRADE_SERVER_PORT=62000

# 回报数据处理线程绑核，默认不绑核，该线程以busy loop模式运行
# 回报数据处理线程的绑核，可以加快数据的接收和处理，建议为每个API实例绑定一个隔离的CPU核。
#TCP_WORKER_CORE_ID=3

# UDP预热处理时间间隔，单位：毫秒，取值范围：[10,50]
WARM_INTERVAL=20

# UDP预热处理线程绑核，默认不绑核，该线程不是以busy loop模式运行
# 建议将预热线程与用户策略线程绑在同一个物理CPU上
#TRADE_WORKER_CORE_ID=4

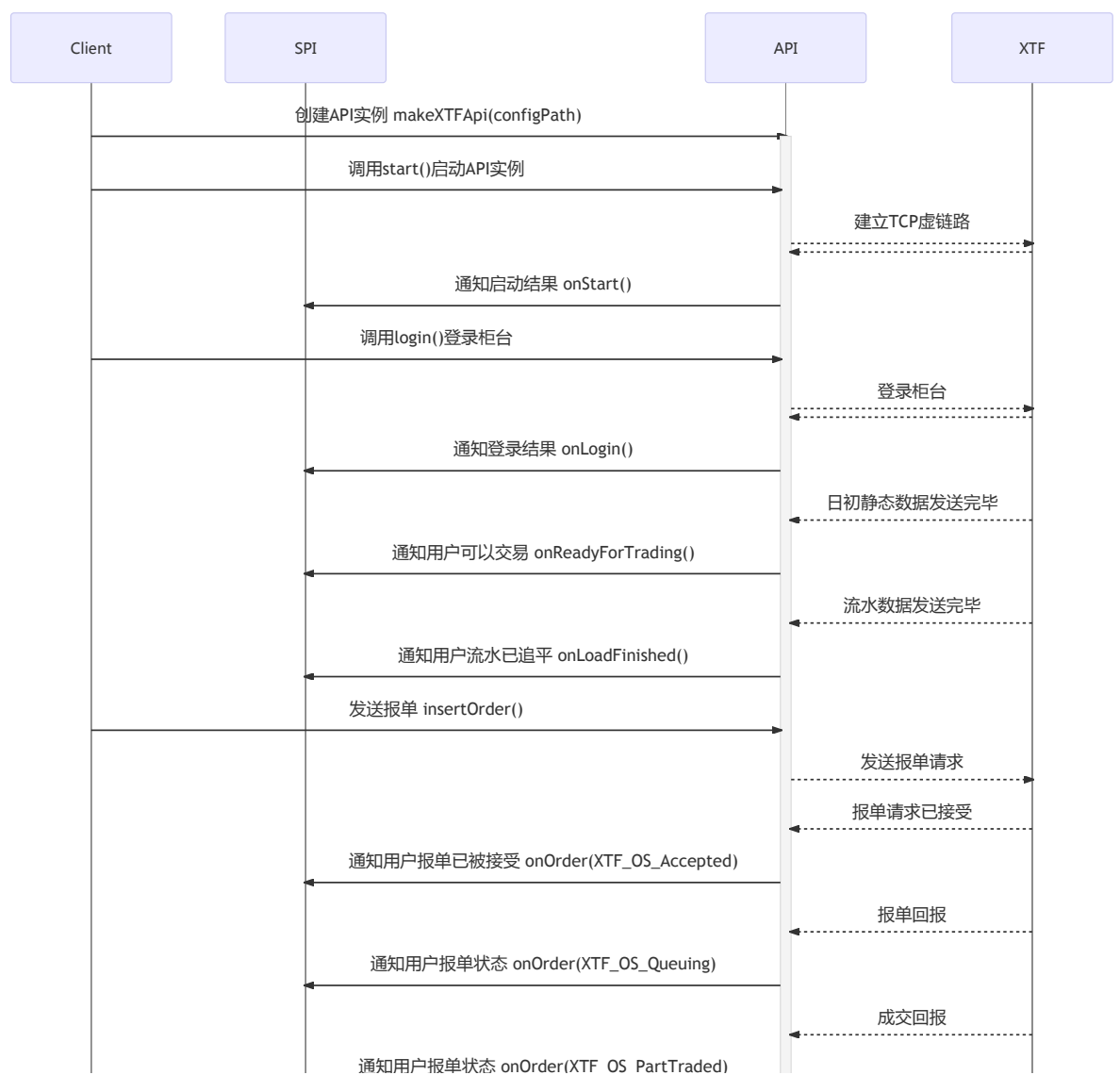
# 公共处理线程绑核，默认不绑核，该线程不是以busy loop模式运行
# 公共处理线程主要用于处理通用任务，例如：
# - 慢速数据处理；
# - 心跳超时维护；
# - 超时重连处理；
# - 其他任务，等；
# 说明：
# - 负数表示不绑核；
# - 公共处理线程是多个API实例共用的，只需要在不同的API实例配置文件中设置一次即可，以第一个API实例创建的配置生效；
#TASK_WORKER_CORE_ID=5
```

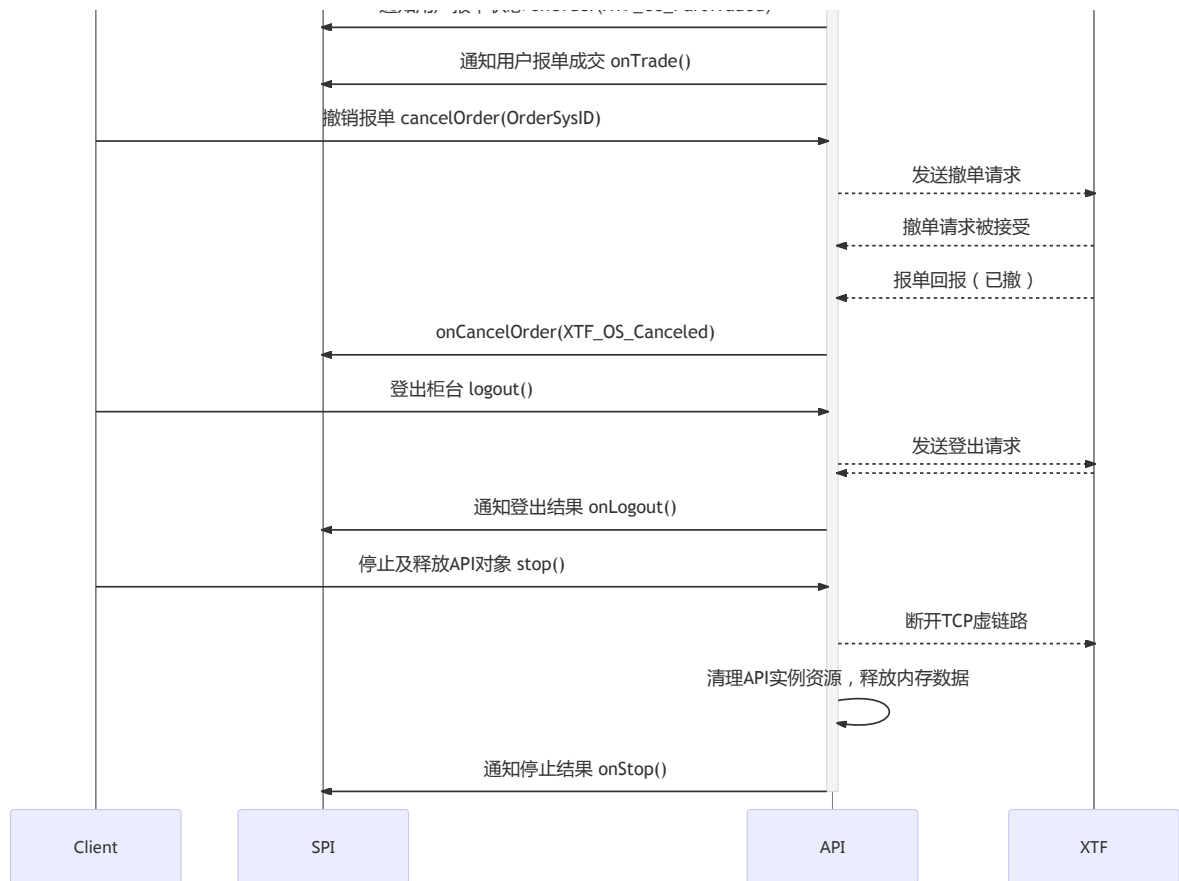
以下参数是必选配置，需要用户根据实际的内容进行编辑配置：

- ACCOUNT_ID
- ACCOUNT_PWD
- APP_ID
- AUTH_CODE
- QUERY_SERVER_IP
- QUERY_SERVER_PORT
- TRADE_SERVER_IP
- TRADE_SERVER_PORT

事件时序图

调用不同的API接口，会触发不同的事件回调。下图是一个API生命周期内的核心事件回调时序图：





创建API

接口定义：XTFApi* makeXTFApi(const char *configPath)；

接口功能：创建一个API实例。API实例的参数配置由configPath指定的配置文件确定。

有两种方式创建API实例：

1. 配置文件方式，需要传入配置文件路径。如果传入的路径打开失败，那么创建API实例失败，返回空指针；
2. 参数设置方式，不需要传入配置文件路径。调用函数时配置文件路径参数传入空指针（ nullptr ）即可。

创建成功后，需要通过API->setConfig()接口设置以下必选参数：

"ACCOUNT_ID"：资金账户ID

"ACCOUNT_PWD"：资金账户密码

"APP_ID"：应用程序ID

"AUTH_CODE"：认证授权码

"TRADE_SERVER_IP"：交易服务地址

"TRADE_SERVER_PORT"：交易服务端口

"QUERY_SERVER_IP"：查询服务地址

"QUERY_SERVER_PORT"：查询服务端口

详细内容请参考API->setConfig()接口注释说明。

启动API

使用API对象之前，需要启动API。

接口定义：int start(XTFSpi *spi)；

接口功能：启动API，传入XTFSpi回调对象。

API启动后，会分配所需的各类资源，并自动向配置文件中设置的柜台地址发起连接。在一切准备就绪后，调用XTFSpi->onStart()接口，通知用户启动成功与否。

停止API

使用API结束，需要停止API，释放相关资源。

接口定义：int stop()；

接口功能：停止API。

API停止后，会自动断开与柜台的TCP连接，并释放所有相关的资源。

API停止后，API实例对象不再有效，不可使用。

登录柜台

API启动后，用户并没有登录柜台。需要调用登录接口，向柜台发起登录。

接口定义：int login()；

接口功能：登录柜台。

登录接口默认是没有参数的，登录的用户和密码等参数，默认从配置文件读取。为方便使用，增加了两个重载接口，可以设置登录用户和密码等参数，如下：

```
int login(const char *accountID, const char *password);
int login(const char *accountID, const char *password, const char *appID, const char *authCode);
```

需要说明的是：每个API实例，只能对应一个用户登录。如果API登出后，使用另外的用户再次登录，将会报用户错误。例如：

```
api->login("abc", "111111"); // OK
api->logout(); // OK
api->login("cde", "222222"); // Error, 每个API实例, 只能对应一个用户登录。
```

接口定义：

```
int logout();
```

接口功能：登出柜台。

登出柜台后，用户不能报单和查询等操作。必须重新登录后，才能进行下一步操作。

说明：登录柜台后，API与柜台之间的TCP连接依然保留，API内部保留了用户的所有数据，并没有释放。调用stop()接口，才真正的释放资源。

登录柜台后，柜台返回用户相关的所有数据。

当数据准备好之后，API调用onReadyForTrading()接口通知用户，可以开始报单。

注意：此时用户虽可以报单，但当日的流水数据并没有接收完毕。如果需要计算仓位和资金，还需要等待流水数据接收完毕，才能处理。

当流水数据接收完毕后，API调用onLoadFinished()接口通知用户，表明流水数据已追平，可以计算仓位和资金。

建议：如果用户不关心流水，则收到onReadyForTrading()接口之后，即可进行报单操作。反之，应该等待 onLoadFinished() 接口之后，再进行报单操作。

接口定义：

```
int insertOrder(const XTFInputOrder &inputOrder);
```

接口说明：向柜台发送一个报单。

返回值：如果报单发送成功，则返回0；否则，返回非0值。

发送报单，需要构造报单对象。报单对象的定义如下：

```
class XTFInputOrder {
public:
    XTFLocalOrderID      localOrderID;

    //本地报单编号（用户）
    //本地报单编号需要由用户保证唯一性，用于本地存储索引。

    //注意不能与柜台保留的几个特殊ID冲突：

    //1. 非本柜台报单固定为0x88888888;

    //2. 柜台清流启动后的历史报单固定为0xd8888888;

    //3. 柜台平仓报单固定为0xe8888888;

    //为保证报单性能，API不做本地报单编号重复的校验。
};
```

```

        ///< 如果API发生了断线重连，在历史流水追平之后，请继续保持后续本地报单编号与历史报单编号的唯一性。
        ///< 如果不能保证本地报单编号的唯一性，请不要使用API的订单管理功能。
        ///< API允许客户端使用同一用户名/口令多次登录，但客户端需要使用某种机制确保本地报单编号不发生重复。
        ///< 比如：（奇偶交替、分割号段）+单向递增。

        XTFDirection          direction;          ///< 买卖方向
        XTFOffsetFlag         offsetFlag;         ///< 开平仓标志
        XTFOderType           orderType;         ///< 报单类型：限价(GFD)/市价/FAK/FOK
        double                price;             ///< 报单价格
        uint32_t               volume;            ///< 报单数量
        uint32_t               minVolume;        ///< 最小成交数量。当报单类型为FAK时，
        ///< 如果 minVolume > 1，那么API默认使用最小成交数量进行报单；
        ///< 如果 minVolume ≤ 0，那么API默认使用任意成交数量进行报单；
        XTFCannelSelectionType channelSelectionType; ///< 席位编号选择类型
        uint8_t                channelID;         ///< 席位编号
        XTFOderFlag            orderFlag;         ///< 报单标志（不使用，默认都是普通报单）

        XTF_CONST XTFInstrument *instrument;      ///< 报单合约对象
};

```

参数各字段详细说明，可以参考头文件注释，按需填写即可。这里，主要说明一下合约对象instrument。

合约对象是一个本地对象的指针，保存了报单需要的各类信息。建议在报单之前，调用API查询接口预先做查询，并保存起来，避免每次报单都需要做查询操作。

批量报单

API支持一次发送最大16个报单。

接口定义：

```
int insertOrders(const XTFInputOrder inputOrders[], size_t orderCount);
```

接口说明：向柜台发送批量报单，最大16个。

返回值：如果报单发送成功，则返回0；否则，返回非0值。

批量报单对象的设置与单个报单接口相同，请参考“插入报单”部分。

报单回报

报单发送成功后，会调用多次onOrder接口处理报单回报。

接口定义：

```
void onOrder(int errorCode, const XTFOrder *order);
```

接口说明：当报单成功或报单状态变化时，收到该接口的回调。

详细流程，参考[报单回调流程](#)一节；

撤单流程

API提供了多个撤单接口，可以按照报单对象XTFOrder直接撤单，也可以按照报单编号进行撤单。两种方式的撤单，都提供了批量撤单接口。

按报单对象撤单

接口定义：

```
int cancelOrder(const XTFOrder *order);
int cancelOrders(const XTFOrder *orders[], size_t orderCount);
```

接口说明：按照指定的报单对象进行撤单。

按照报单对象进行撤单，效率比按照编号撤单更好一些。避免了报单的本地查找开销。不过，需要用户自己保存需要撤单的对象指针。

按报单编号撤单

接口定义：

```
int cancelOrder(XTFOrderIDType orderIDType, long orderID);
int cancelOrders(XTFOrderIDType orderIDType, long orderIDs[], size_t orderCount);
```

接口说明：按照报单编号进行撤单。

接口提供了按多种报单编号类型进行撤单，报单编号类型包括：

1. 本地报单编号；
2. 柜台报单编号；
3. 交易所报单编号；

目前，仅支持柜台报单编号撤单，保留后续支持本地报单编号和交易所报单编号的撤单功能。

撤单回报

撤单成功或失败后，会调用撤单回报接口处理。

接口定义：

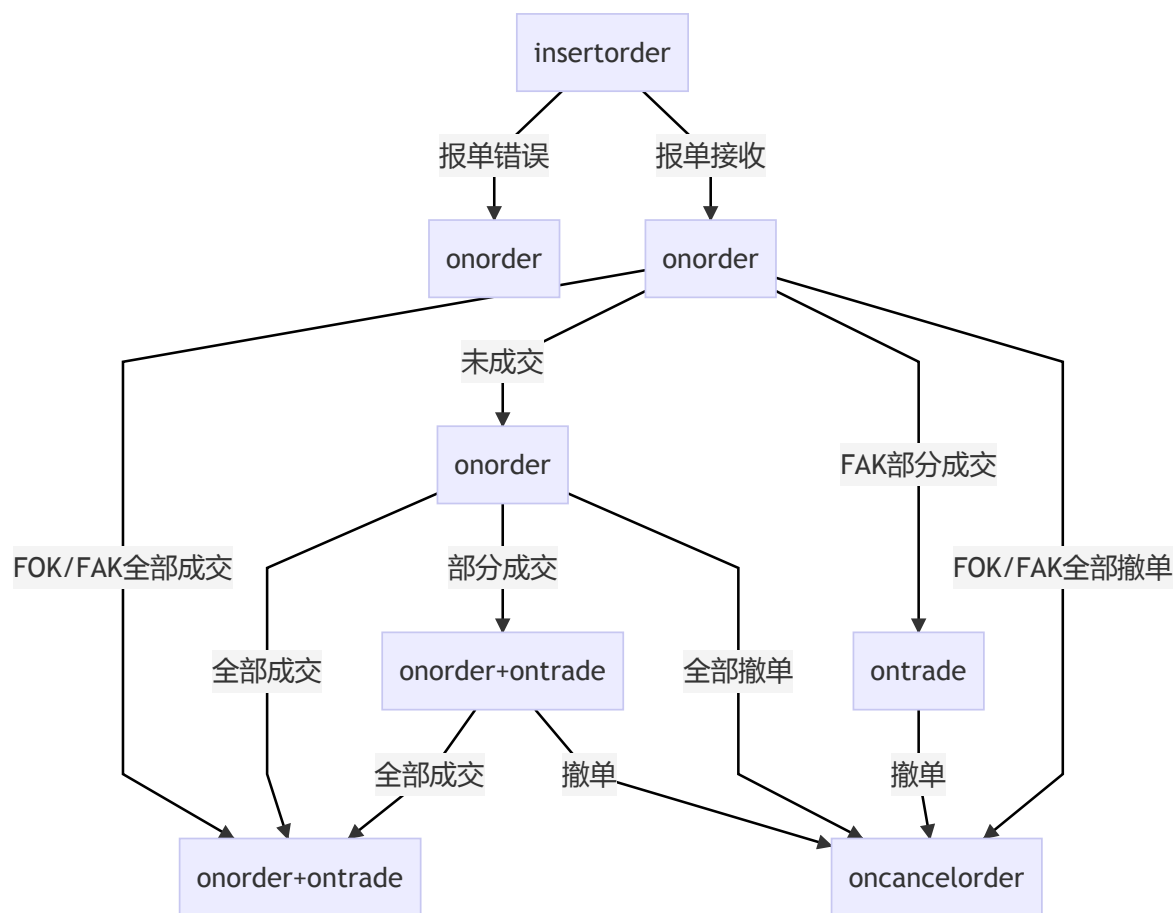
```
void onCancelOrder(int errorCode, const XTFOrder *cancelOrder);
```

接口说明：当撤单成功或失败时，收到该接口的回调。

详细流程，参考[报单回调流程](#)一节；

报单回调流程

接口回调顺序图如下：



正常的报单回报流程

	actionCode	errorCode	orderStatus	
第1次回 调	XTF_OA_Insert	交易所错误 码	XTF_OS_Accepted	收到插入报单的操作 应答
第2次回 调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_Queueing	收到柜台返回的报单 回报
第3次回 调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_AllTraded	收到柜台返回的全成 回报
成交回报				

存在部分成交的报单回报流程

	actionCode	errorCode	orderStatus	
第1次回调	XTF_OA_Insert	交易所错误码	XTF_OS_Accepted	收到插入报单的操作应答
第2次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_Queueing	收到柜台返回的报单回报
第3次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_PartTraded	收到柜台返回的部成回报
成交回报				
第4次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_AllTraded	收到柜台返回的全成回报
成交回报				

说明：对于报单数量（volume字段）较大的场景，部分成交的回调可能有多次。

撤单的报单回报流程

	actionCode	errorCode	orderStatus	
第1次回调	XTF_OA_Insert	交易所错误码	XTF_OS_Accepted	收到插入报单的操作应答
第2次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_Queueing	收到柜台返回的报单回报
第3次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_Canceled	收到柜台返回的撤单回报

说明：对于FAK/FOK报单，交易所返回的报单状态可能为已撤销，并没有Queueing这个中间状态。如果是这种情况，第2次回调（已加入队列）将会被跳过，直接进入已撤状态。

存在部分成交的撤单回报流程

	actionCode	errorCode	orderStatus	
第1次回调	XTF_OA_Insert	交易所错误码	XTF_OS_Accepted	收到插入报单的操作应答
第2次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_Queueing	收到柜台返回的报单回报
第3次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_PartTraded	收到柜台返回的部成回报
成交回报				
第4次回调	XTF_OA_Return	0	XTF_OS_Canceled	收到柜台返回的撤单回报

交易所拒单的报单回报流程

	actionCode	errorCode	orderStatus	
第1次回调	XTF_OA_Return	交易所错误码	XTF_OS_Rejected	收到柜台返回的拒单回报

柜台重启

在API使用过程中，如果盘中柜台发生重启，那么需要API调用者实现 `onServerReboot()` 接口，完成失效数据的清理。

清理的数据类型包括所有的XTF开头的数据结构。

查询接口

查询账户

接口定义：

```
const XTFAccount* getAccount();
```

接口说明：查询当前账户信息。

查询合约

接口定义：

```
int getInstrumentCount();
const XTFInstrument* getInstrument(int pos);
const XTFInstrument* getInstrumentByID(const char *instrumentID);
```

接口说明：查询合约数量和指定合约。

建议报单前，先把目标合约对象查找并存储起来，以加快报单的速度。

查询仓位

接口定义：

```
int XTFAccount::getPositionCount() const;
const XTFPosition* XTFAccount::getPosition(int pos) const;
```

接口说明：查询当前用户下的所有仓位信息。

说明：如果仓位已平，通过该接口是无法查询的。

查询报单

接口定义：

```
int XTFAccount::getOrderCount() const;  
const XTFOrder* XTFAccount::getOrder(int pos) const;
```

接口说明：查询当前用户下的所有报单信息，包括所有状态的报单。