

文档标识	
文件状态:	<input type="checkbox"/> 草稿 <input checked="" type="checkbox"/> 正式发布 <input type="checkbox"/> 正在修改

综合交易平台 API 常见问题

版本：1.0.3

编制	温振晖	2018年04月23日
审核	周杰	2018年04月23日
批准		年 月 日
生效日期:		年 月 日

修订历史记录

日期	版本	修订说明	作者
2017-4-17	1.0.0	创建	周杰
2017-11-14	1.0.1	修订	温振晖、朱熹、杨伟涛
2018-01-08	1.0.2	修订	温振晖、朱熹、杨伟涛
2018-04-23	1.0.3	修订	温振晖、朱熹、杨伟涛

目 录

综合交易平台API常见问题	4
1 引言	4
1.1 编写目的.....	4
1.2 定义、首字母缩写词和缩略语	4
2 系统环境.....	4
3 问题说明	4
3.1 交易API接口.....	4
3.2 风控API接口.....	27
4 附录.....	29

综合交易平台API常见问题

1 引言

1.1 编写目的

本文档为综合交易平台API使用的FAQ整理。

1.2 定义、首字母缩写词和缩略语

2 系统环境

3 问题说明

3.1 交易api接口

1. 问题描述：

询价时报：“没有该合约的做市商”

【答】

询价合约不对，目前期权合约可以参加询价。

【问题单号：20170417-P001-H001】

2. 问题描述：

询价时报：“CTP：当前时间禁止询价”

【答】

期货公司一般把询价限制时间设置为60秒询价一次，周期内不能多次询价。

【问题单号：20170417-P001-H001】

3. 问题描述：

询价时报：“CTP：当前价差禁止询价”，但有时候能报入

【答】

交易所有询价价差的限制，期货公司可以在柜台上进行设置，一般如下

经纪公司代码	合约代码	交易所代码	最新价	价差
1008	SRC	CZCE	0	8
1008	SRC	CZCE	50	10
1008	SRC	CZCE	100	20
1008	SRC	CZCE	200	30
1008	SRC	CZCE	300	50
1008	SRC	CZCE	500	75

询价价差的判断过程

- 1) 看最新价对应于上面的哪一档，确定价差的最小值
- 2) 计算买价和卖价的价差，看是否大于设置的价差（等于也不行）
- 3) 如果2)通过，那么询价单报入交易所，否则会被CTP直接拒绝。

有时候能报入，有时候不行是因为买价和卖价的价值一直在变化。

【问题单号：20170417-P001-H001】

4. 问题描述：

询价为什么有时候OnRspForQuoteInsert无返回

【答】

对于询价，只有在询价失败的情况才会通过OnRspForQuoteInsert返回错误，此时OnErrRtnForQuoteInsert也会返回错误。

询价成功的响应是通过行情流中的OnRspSubForQuoteRsp返回的，该响应需要先订阅。

【问题单号：20170417-P001-H001】

5. 问题描述：

测试期权报价，报“非法的做市商响应”怎么办

【答】

一般报价填写以下接口，如果报“非法的做市商响应”，可能是所用交易编码非做市商专用所致。

```
CThostFtdcInputQuoteField t = { 0 };
strcpy_s(t.BrokerID, g_chBrokerID);
strcpy_s(t.InvestorID, g_chInvestorID);
strcpy_s(t.InstrumentID, g_chInstrumentID);
strcpy_s(t.QuoteRef, "3");
strcpy_s(t.UserID, g_chUserID);
t.AskPrice = 499; // 卖价格
t.BidPrice = 500; // 买价格
```

```

t.AskVolume = 1;///卖数量
t.BidVolume = 1;///买数量
t.AskOffsetFlag = THOST_FTDC_OF_Open;///卖开平标志
t.BidOffsetFlag = THOST_FTDC_OF_Open;///买开平标志
t.AskHedgeFlag = THOST_FTDC_HF_Speculation;///卖投机套保标志
t.BidHedgeFlag = THOST_FTDC_HF_Speculation;///买投机套保标志
strcpy_s(t.ForQuoteSysID, "2017042100261555");///应价编号
strcpy_s(t.ExchangeID, "CZCE");
//strcpy_s(t.InvestUnitID, "1");///投资单元代码
int a = m_pUserApi->ReqQuoteInsert(&t, 1);

```

【问题单号：20170421-P001-H001】

6. 问题描述：

测试期权行权，报“报单字段有误”怎么办

【答】

一般行权填写以下字段

```

CThostFtdcInputExecOrderField OrderInsert = { 0 };
strcpy_s(OrderInsert.BrokerID, g_chBrokerID);
strcpy_s(OrderInsert.InvestorID, g_chInvestorID);
strcpy_s(OrderInsert.InstrumentID, g_chInstrumentID);
strcpy_s(OrderInsert.UserID, g_chUserID);
OrderInsert.Volume = 1;
OrderInsert.RequestID = 1;
OrderInsert.OffsetFlag = THOST_FTDC_OF_Close;///开平标志
OrderInsert.HedgeFlag = THOST_FTDC_HF_Speculation;///投机套保标志
OrderInsert.ActionType = THOST_FTDC_ACTP_Exec;///执行类型类型
OrderInsert.PosiDirection = THOST_FTDC_PD_Long;///持仓多空方向类型
OrderInsert.ReservePositionFlag = THOST_FTDC_EOPF_Reserve;///期权行权后是否保留期货
头寸的标记类型
OrderInsert.CloseFlag = THOST_FTDC_EOCF_NotToClose;///期权行权后生成的头寸是否自动平
仓类型
strcpy_s(OrderInsert.ExchangeID, g_chExchangeID);
int a = m_pUserApi->ReqExecOrderInsert(&OrderInsert, 1);

```

【问题单号：20170420-P001-H001】

7. 问题描述：

对于单向大边计算保证金，如何确定合约是否以单边计算

【答】

查询合约时可以得到MaxMarginSideAlgorithm字段，1代表以单边计算。

///不使用大额单边保证金算法

```
#define THOST_FTDC_MMSA_NO '0'  
///使用大额单边保证金算法  
#define THOST_FTDC_MMSA_YES '1'
```

【问题单号：20170414-P001-H002】

8. 问题描述：

对于单向大边计算保证金，开仓检查时是否按照优惠收取

【答】

是的。

【问题单号：20170414-P001-H002】

9. 问题描述：

对于郑商所锁仓保证金优惠，如何确定合约是否已经享受优惠

【答】

郑商所规则确定，交易时自然优惠。

【问题单号：20170414-P001-H003】

10. 问题描述：

对于郑商所锁仓保证金优惠，开仓检查时是否按照优惠收取

【答】

持仓保证金按照优惠收取，冻结保证金按照非优惠收取。

【问题单号：20170414-P001-H003】

11. 问题描述

询价中，在交易和行情中都有OnRtnForQuoteRsp（询价通知）这个函数，但是在询价成功后，只有行情中的这个函数有回调，交易中没有显示。

【答】

OnRtnForQuoteRsp, 这个函数在交易里面暂不启用。

【问题单号：20170424-P001-H001】

12. 问题描述

在手动计算大商所的平仓手续费的时候，根据CTP查询到的费率算出来的和CTP的资金查询结果里的手续费对不上

【答】

大商所的手续费率优惠规则，是当你有历史仓和今仓的时候，先平的是昨仓，但是手续费率是按平今的收取的。

【问题单号：20170424-P007-H001】

13. 问题描述

机构户通过api接口把自己的程序对接ctpmini系统，动态口令是每次进去都不一样吗？

【答】

如果期货公司启用了动态口令，客户会有一个电子口令牌，把生成的值，输入到登录报文里的OneTimePassword(动态密码)这个字段中去即可

【问题单号：20170427-P007-H001】

14. 问题描述

郑商所的结算价在盘中也会送出，但数值在盘中不会变化，这和盘后推送的结算价怎么区分？

【答】

郑商所夜盘收盘后会推送结算价，这也就是早上行情中有可能会收到结算价的原因，盘中行情中推送的结算价数值不会发生变化。无夜盘的合约，盘中不会收到结算价。白盘收盘后郑商所也会推送所有合约最新的结算价，CTP对交易所推送的结算价不做处理，直接转发。

【问题单号：20170503-P009-H001】

15. 问题描述

在Login逻辑中，客户端可以填写IP和MAC。但是在后台来看，无论填入的是什么内容，后台都是显示本机的真实MAC和IP

【答】

对Login逻辑，客户端填写IP和MAC无效。

【问题单号：20170504-P001-H001】

16. 问题描述

登陆后如果只想接收查询类的接口返回的数据，如查合约、持仓和资金，但又不想接收委托和成交回报，在订阅流时应该怎样操作？

【答】

只能通过过滤接收的报文达到目的。订阅解决不了

【问题单号：20170505-P007-H001】

17. 问题描述

郑商所白糖期权的跨式和宽跨式套利指令，在ctp里如何实现。

【答】

和普通的限价单类似，不同的地方是在填写InstrumentID的时候

郑商所跨式组合（STD）：

STD SR703C5300&SR703P5300

郑商所宽跨式组合（STG）：

STG SR703C5300&SR703P5200

支持FAK和FOK

【问题单号：2010503-P008-H003】

18. 问题描述

用ReqParkedOrderAction（）撤预埋单的时候提示“无权限”

【答】

预埋单的取消用的函数

ReqRemoveParkedOrder（）//请求删除预埋单

预埋一笔撤单用

ReqParkedOrderAction（）//预埋撤单录入请求

注意：不要用ReqOrderInsert（）去下预埋单。

【问题单号：20170505-P001-H001】

19. 问题描述

ctp支持将郑商所的历史期权持仓确认为跨式或者宽跨式组合的指令吗？

【答】

针对郑商所的跨式和宽跨式的组合指令，CTP盘中是支持申报的，但是不支持盘中历史仓确认为组合指令。

【问题单号：20170508-P001-H001】

20. 问题描述

请问ctp支持ssl连接吗？

【答】

支持前置要配置ssl。

【问题单号：20170509-P008-H001】

21. 问题描述

交易api中查询合约的ReqQryInstrument能查到期货套利合约，但是为什么查不到期权套利合约、比如郑商所的跨式和宽跨式套利合约？

【答】

郑商所没有推跨式和宽跨式套利合约。

【问题单号：20170510-P001-H001】

22. 问题描述

1、个股、现货、期货的查询持仓接口是同一个吗？

2、个股期权的帐号查询持仓的时候，会把锁定解锁证券持仓也返回吗？

【答】

1、个股、现货、期货的查询持仓接口是同一个。在个股端只能查询个股持仓，在现货端只能查询现货持仓，在期货端只能查询期货持仓。

2、不会返回，查询锁定证券仓位使用ReqQryLockPosition。查询锁定使用ReqQryLock。注意ReqQryLockPosition和ReqQryLock在个股端使用才有效。另外注意，锁仓先今仓后昨仓。

【问题单号：20170503-P007-H001】

23. 问题描述

郑商所的组合合约下单，交易所返回“已撤单报单被拒绝CZCE:出错:不支持无限制期权组合订单”

【答】

TimeCondition应该用THOST_FTDC_TC_IOC（1）而不是THOST_FTDC_TC_GFD（3）。郑商所的跨式期权组合单目前只支持FOK和FAK。

【问题单号：20170503-P007-H001】

24. 问题描述

在ReqQryTradingAccount ()中返回的balance字段是投资者的总权益吗？

【答】

是

【20170605-P001-H001】

25. 问题描述

行权结果能在当前交易日查询么？

卖方履约能在当前交易日查询到么？

分别调用哪些接口？

【答】

行权的履约配对是在结算的时候进行的，是盘后的事情了。可以在下一交易日看结算单里的行权情况。

【20170606-P007-H001】

26. 问题描述

在50ETF期权中的CThostFtdcOptionInstrMarginGuardField （当前期权合约保证金保障系数），从哪一个函数查询得到？

【答】

查期权保证金用ReqQryOptionInstrTradeCost;

保证金=max(权利金+FixedMargin, MiniMargin);

而tradecost里FixedMargin和MiniMargin都有了，所以就能计算出实时保证金。

【20170608-P007-H001】

27. 问题描述

盘中货币质押是否有API回调通知？

【答】

暂时没有通知，只能查询资金账户来查看。

【20170608-P001-H005】

28. 问题描述

在期货期权中或个股期权中，能否收到合约状态通知OnRtnInstrumentStatus()？

【答】

期权里暂时没有。

【20170612-P001-H001】

29. 问题描述

订阅行情时候返回errorID = 77 ErrorMsg = CTP:无此功能。

【答】

行情端口误填为交易端口，则可能报此错误。

【20170621-P007-H002】

30. 问题描述

期权中持仓盈亏为何为0？

【答】

期权中没有持仓盈亏，显示为0。

【20170621-P001-H001】

31. 问题描述

simnow环境下，资金账户中“可用资金”（available）和“可取资金”（WithdrawQuota）在测试时候，发现（available）在持仓不变的情况下，不随行情变，但是（WithdrawQuota）会变化。

【答】

这个要看CTP系统设置中各字段的计算是否包含盈亏。

【20170627-P008-H001】

32. 问题描述

CTP个股期权版本里面，保证金和手续费的获取方式和计算方式是不是和商品期权是一样的？

【答】

个股期权取手续费的接口为ReqQryETFOptionInstrCommRate()。

现货查询手续费率是用ReqQryInstrumentCommissionRate();//请求查询合约手续费率
期货上面的，查询期权手续费率是调用接口ReqQryOptionInstrCommRate();//请求查询
期权手续费率

【20170630-P008-H002】

33. 问题描述

原油期货里，开仓后发现资金查询里的货币质押余额并没有变动，是否没有被使用？

【答】

货币质押余额目前还是一个静态的值，但开仓实际上是会先扣除它再使用人民币资金的。

可以自己根据持仓维护实际的货币质押余额。

【20170704-P001-H001】

34. 问题描述

期货品种的套保仓、投机仓、套利仓的单向大边是单独计算，还是一起计算的？

对于能源中心INE目前的交易细则是不是也有单向大边的规则？

【答】

单向大边目前只有上期所和中金所有此项业务。对于上期所，同品种的买卖双边分别计算，取买卖双边中保证金金额较大的一边单向实时收取。对于中金所，套利、套保和投机的交易编码不同，计算的时候首先是区分交易编码的，每个交易编码下同品种的买卖双边再分别计算取大边。

对于能源中心，sc目前是单向大边的规则。

【20170705-P008-H002】

35. 问题描述

冻结手续费计算的问题，比如我有大商所的持仓 i1709 10手昨仓，这个时候我平仓2手挂单了，请问此时的平仓手续费率是采用平昨手续费还是平今手续费，还是这两个费率取较大的？从CTP接口查询资金返回来看冻结手续费，采用的不是平昨的手续费率，而是平今的手续费率计算出来的，这是为什么？

【答】

短线开平仓合约的平仓（不管平仓还是平今）在成交的时候是按平今手续费收取的，在冻结的时候是按平仓手续费收取。

【20170710-P007-H001】

36. 问题描述

计算期权保证金在仿真环境里面，分别通过交易成本（ReqQryOptionInstrTradeCost）

持仓明细 (ReqQryInvestorPositionDetail) 资金账号 (ReqQryTradingAccount) 之后计算出来的保证金和实际的计算对不上

【答】

如果权利金类型是max(昨结算价, 最新价), 且最新价>昨结算价的时候, 保证金会随最新价变动而变动。查询的时候可能最新价已经变动了, 导致结果不一致。

【20170711-P007-H005】

37. 问题描述

当密码错误登录失败时也会触发OnFrontDisconnected, 是一定是这样, 还是柜台可以配置?

【答】

交易前置如果设置了ConnectFrq (每秒连接数), 终端认证失败或者登陆错误都会触发掉线。

【20170719-P001-H001】

38. 问题描述

Api的release()函数如何正确释放?

【答】

Release()必须要在回调函数之外释放, 否则不会被成功释放, 且api线程会依然存在。

【20170719-P007-H005】

39. 问题描述

组合持仓明细应该如何去判断谁和谁是一对?

【答】

用CombTradeID判断。注意以下几点:

- 1) CombTradeID是CTP定义的; 盘中新开仓的时候CombTradeID比如是115, 在盘后结算完成后为了防止重复会重新打上编号, 编号里带上交易日, 如20170720000003;
- 2) CombTradeID并不一定是成对出现。比如下单五手组合合约: 左腿全部成交, 右腿是分笔成交的1, 1, 3的方式成交的。所以总的收到的成交回报就会有4条。这四条的combtradeid, 在盘中是一致的。

【20170720-P007-H001】

40. 问题描述

郑商所的UDP行情里，Tradingday和AveragePrice字段都是空的，但是TCP行情里有，这是为什么？

【答】

UDP行情不推送AveragePrice字段；TCP行情里的Tradingday和AveragePrice是CTP给的。

【20170726-P007-H002】

41. 问题描述

投资者发现自己账号里面多了一条“PRT SR711&SR711C6000”的持仓。

【答】

这个合约是郑商所跨式，宽跨式期权组合合约。此合约不需要投资者使用特别的指令构建，只要客户持有可以构成备兑期权组合的持仓，在每日结算的时候。郑商所会将符合条件的期权和期货持仓自动确认为备兑期权套利持仓，包括备兑看涨期权套利和备兑看跌期权套利，并给予保证金优惠。

对于此期权合约，投资者需要分腿平仓，不需要管这个是否为备兑组合。

【20170731-P008-H001】

42. 问题描述

用ctp的linux接口，调用了api函数就会收到SIGUSR1的信号，这个正常吗？

【答】

在gdb中调试api，会在req请求发送失败的情况下，触发SIGUSR1信号，该信号在程序里无法被屏蔽，却会导致程序自动退出，可以在调试器里屏蔽，“handle SIGUSR1 nostop ” 加到调试器里。

【20170802-P007-H003】

43. 问题描述

预埋单测试，报入预埋单之后触发，在回报中没有显示status=2(预埋单状态是已接收)，只有status=1（已提交）？

【答】

目前status=2的状态不会主动推送，而是要通过查询才能得知。

【20170808-P001-H001】

44. 问题描述

在做监控中心密钥查询的时候，OnRspQryCFMMCTradingAccountKey查询返回是空的。

【答】

OnRspQryCFMMCTradingAccountKey 这个函数已弃用，请使用ReqQueryCFMMCTradingAccountToken查询，查询后，会推送私有流OnRtnCFMMCTradingAccountToken。

【20170815-P007-H001】

45. 问题描述

在某些终端软件上面有个查询月结算单的按钮。调用的是api的什么接口查询得到的？

【答】

这个接口即可以查询日结算单，也可以查询月结算单。只需要对TradingDay字段输入对应的年月即可，例如：201702，要注意CTP系统要有生成对应投资者的月结算单才能查到。

【20170822-P001-H001】

46. 问题描述

个股期权里，通过交易接口ReqQryInstrument查询合约000016.sh 和 000300.sh都查不到，这是什么原因？这两个合约分别是上证50和沪深300。

【答】

在个股中不推送指数行情。

【20170825-P007-H001】

47. 问题描述

ReqQueryMaxOrderVolume 查询最大报单数量这个方法，其传递的结构体是不带价格参数的，然而 THOSTUSER 上面是可以按照价格查询报单数量的，请问这是怎么实现的？

【答】

这个功能在userapi中有，traderapi中没有。

【20170825-P008-H002】

48. 问题描述

客户在使用API进行银期转账的时候，查询出来的签约关系的BankBranchID是6243，但

是转账时应该要填总行0000机构代码，不可以填写分行的机构代码，否则会报“CTP: 报盘未连接到银行”。

【答】

BankBranchID写死0000，不能填其他的。

【20170911-P007-H001】

49. 问题描述

接口“OnRtnForQuoteRsp”在上期所和中金所询价通过该接口返回（仅做市商客户可以收到该通知），请问大商所和郑商所的返回是否也是通过此接口？

【答】

目前ctp中四所的询价响应都是通过该接口返回。

【20170914-P001-H001】

50. 问题描述

是否可以不通过账号和密码校验，获取到系统里的合约相关信息？

【答】

目前API的查询功能都是需要登录后才能查询。

【20170914-P001-H002】

51. 问题描述

是否能够通过api不登录就能查询brokerid？

【答】

不能，登录时就需要brokerid，具体brokerid请咨询期货公司。

【20170914-P001-H003】

52. 问题描述

关于合约最大报单数，报单超过该数值，会报什么错？

【答】

报单超过该数量，会收到交易所报错。比如：“已撤单报单被拒绝 INE: 不合法的数量”。

【20170915-P001-H001】

53. 问题描述

投资者做“银期转期货”操作时，发现误把字段TradeCode填写为“202002”也能转账

成功。

【答】

TradeCode为“202001”代表期货发起银行资金转期货。

TradeCode为“202002”代表期货发起期货资金转银行。

目前这个字段API中无需填写，由后台自动填写。

【20170922-P001-H001】

54. 问题描述

现在投资者登录的时候，有时候会被锁定，请问会有什么原因？

【答】

CTP有单独锁IP的功能。被锁定的情况下继续登录会报“CTP：登录失败次数超限，IP被禁止”。目前这个阈值一般设置为5000，单个交易日内累积计算。

CTP有锁IP+账号的功能。被锁定的情况下继续登录会报“CTP：连续登录失败次数超限，登录被禁止”。目前这个阈值一般设置为6-10，注意这里的登录错误次数CTP是连续计算的。

具体的阈值以期货公司设置的为准。

【20171110-P008-H001】 【20171113-P009-H002】

55. 问题描述：

前置登录了一段时间后被onfrontdisconnected了，返回的nreason是8193，是什么意思？

【答】

转换成16进制，对应错误：0x2001 心跳超时。

详见头文件。

【问题单号：20171116-P007-H001】 【问题单号：20171207-P001-H001】

56. 问题描述：

查询时遇到报“OnRspError[90]：CTP：查询未就绪，请稍后重试”是什么原因？

【答】

这是因为此时查询核心还没有就绪，此类情况一般发生在系统初始化过程中，建议稍后再做一次查询操作。

【问题单号：20171120-P007-H001】 【问题单号：20171124-P001-H001】

57. 问题描述：

请问ctp的API支持申报组合策略指令和申报解除组合策略指令吗？

【答】

支持，可以使用ReqCombActionInsert接口来申报，其中TThostFtdcCombDirectionType
字段用来表示申请组合或申请拆分。

【问题单号：20171130-P007-H001】

58. 问题描述：

期货公司给了一个产品标识，请问登录的时候要赋值给哪个字段？ UserProductInfo
还是InterfaceProductInfo？

【答】

UserProductInfo

【问题单号：20171130-P007-H003】

59. 问题描述：

查询月结单是不是Tradingday字段送201711这样的值？

【答】

是的，前提是系统生成了对应的月结算单。

【问题单号：20171201-P001-H001】

60. 问题描述：

期货期权合约盘中没有成交的话，盘后会收不到结算价行情？

【答】

期货期权合约盘中没有成交，盘后会收不到结算价行情，这个属于正常现象。目前郑州
大连都是如此。

【问题单号：20171214-P001-H001】

61. 问题描述：

请问对于首次登陆修改密码，API只做了Init，连接柜台成功后，此时能不能直接调用
更改密码的功能对账户进行更改密码。还是说必须登录成功之后才能修改密码？

【答】

必须先用正确的密码登录，以获取合法session。之后才能操作修改密码。

【问题单号：20171220-P001-H001】

62. 问题描述：

投资者报单遇到报错“ctp: 每秒报单数超过许可数”，是为什么？

【答】

这个是由于报单频率太快被前置流控所引起的报错。

投资者可询问期货公司具体的流控设置。期货公司可以自行查看FLEX“程序化交易频繁报撤单管理”中的设置，以及Front的流控配置。

【问题单号：20171221-P001-H001】

63. 问题描述：

怎样通过API获取全部合约的保证金率？

通过 ReqQryInstrumentMarginRate ，如不指定合约名称，返回的是所有有持仓合约的保证金信息。那其他没有持仓的合约保证金率，有快捷的方式可以批量查询吗？

【答】

暂时没有，只能逐个查询。

【问题单号：20171222-P001-H001】

64. 问题描述：

连续委托5笔，有四笔是废单；怀疑本地报单号没有填，所以会成为废单，是否是这样？

5笔报单和4条报错如图。

```
"InvestorID":"202105036","InstrumentID":"ni1805","OrderRef":"767000580",'
"InvestorID":"202105036","InstrumentID":"ru1805","OrderRef":"767000579",'
"InvestorID":"202105036","InstrumentID":"rb1805","OrderRef":"767000577",'
"InvestorID":"202105036","InstrumentID":"rb1805","OrderRef":"767000578",'
"InvestorID":"202105036","InstrumentID":"hc1805","OrderRef":"767000576",'
```

```
INFO - 废单 : 767000578,reason : CTP:报单错误: 不允许重复报单
INFO - 废单 : 767000579,reason : CTP:报单错误: 不允许重复报单
INFO - 废单 : 767000576,reason : CTP:报单错误: 不允许重复报单
INFO - 废单 : 767000577,reason : CTP:报单错误: 不允许重复报单
```

【答】

这是因为OrderRef没有递增，后面四笔的报单引用号都比第一笔小，所以只有第一笔报

入成功了，后面4笔都失败了。

在CTP中OrderRef要求必须递增，但不需要连续递增，否则会提示“重复报单”。另外本地报单号不是必填项，如果填空，CTP会自动递增。

【问题单号：20171222-P001-H002】

65. 问题描述：

登录报“重复的登录”，是什么原因？

【答】

正常情况下，收到登录成功的响应后再发起登录，是没有响应的，这是因为如果前置收到登陆成功的响应，则会过滤后续的同Session的登陆请求。

极端情况下，当前置还没收到核心返回的登录成功响应，而此时又再次收到来自客户端的登录请求，就不会过滤，核心收到重复的登录请求后就会返回“重复的登录”的错误响应。

【问题单号：20171228-P007-H001】

66. 问题描述：

查询投资者合约手续费率时(ReqQryInstrumentCommissionRate)，返回的instrumentId字段有时候是产品ID。

【答】

这是期货公司系统设置问题，如果在柜台没有设置具体合约的手续费率，则默认会返回产品的手续费率，InstrumentID就为对应产品ID。

【问题单号：20180102-P001-H001】

67. 问题描述：

持仓查询响应、成交回报、报单回报的SettlementID字段，有什么具体的用处？

【答】

这个字段暂时没有用。

【问题单号：20180109-P007-H001】

68. 问题描述：

OnRspQryBrokerTradingParams中返回的权利金价格类型是否区分今仓和昨仓？

【答】

只针对今开仓。

【问题单号：20180208-P007-H001】

69. 问题描述：

个股API报单时，OnErrRtnOrderAction中收到返回信息“Errid: 91”“ErrMsg: 17648”
应该怎么处理。

【答】

这属于上证所错误提示，可查看上证所官网内部错误代码对照表

【问题单号：20180208-P007-H002】

70. 问题描述：

询价的行情，是不是要有做市商的账号才可以收到？还是只要订阅都可以收到？

【答】

普通投资者是否可以通过订阅询价请求来收取场上的询价申报：

CFFEX	能
SHFE	能
DCE	不能
CZCE	不能

【问题单号：20180212-P001-H001】

71. 问题描述：

期权自对冲CTP是否已经支持？

【答】

上期所支持，新的CTP API版本中新增了期权自对冲接口

【问题单号：20180222-P008-H001】

72. 问题描述：

原油上市后，CTP 的API版本最低版本要求是多少？

【答】

6.3.8_2017-11-23以上版本的交易API

【问题单号：20180226-P008-H001】

73. 问题描述:

人民币账户和美元账户都有余额，下原油单是先扣哪个账户的资金？

【答】

美元质押成人民币的资金存放在货币质押账户中

原油的保证金先从货币质押账户上扣取，不够时再使用人民币主账户资金，按目前方案手续费及亏损从人民币主账户扣取

原油的持仓盈利或者相关冻结资金释放，若存在借用人民币账户资金时，先返还给人民币账户，超出部分再加入质押账户

【问题单号：20180301-P001-H001】

74. 问题描述:

在ctp的fix的说明文档里面，field11规定 只能是“int” (integer) ，然后最大的长度是12 characters。国际上的fix4.2是“String” type and the max character length is 30 characters。这个type是否可以选？

【答】

该字段是order_ref，ctp的数据结构是12位，没办法修改。

【问题单号：20180306-P001-H001】

75. 问题描述:

CTP系统在开盘前推过来的第一笔行情数据不对,数字很大,这个问题一般怎么处理

【答】

极大值表示空值。

【问题单号：20180320-P001-H001】

76. 问题描述:

linux 下面 pRspInfo->ErrorMsg 都是乱码，怎么处理？

【答】

linux使用的字符编码是GB18030，远程如果是CRT的话外部使用的字符编码需要GB2312。

【问题单号：20180320-P001-H002】

77. 问题描述:

原油平今和上期一样是用 THOST_FTDC_OF_CloseToday，平昨是用 THOST_FTDC_OF_Close吗？

【答】

和上期所一致

【问题单号：20180326-P001-H001】

78. 问题描述：

撤单时，为何有些交易所没有返回撤单时间？

【答】

有些交易所不推送撤单时间：

CFFEX	无
SHFE	无
DCE	有
CZCE	有

【问题单号：20180327-P007-H001】

79. 问题描述：

客户在用个股api收行情的时候，发现连上前置后，收到的行情涨跌停板价是0。

【答】

首先检查dll或so版本是否正确；如果连接mdfront前置，并且mdfront级联了mdfront，则这两个mdfront如果版本不一致或不对，也同样会导致这个问题。

【问题单号：20180328-P007-H001】

80. 问题描述：

通过api查询合约保证金和手续费时，可以查所有合约，或者通过按品种、按交易所这种方式进行批量查询吗？

【答】

要填具体合约才能查，如果填空，则返回有持仓的合约

【问题单号：20180329-P007-H001】

81. 问题描述：

onRtnInstrumentStatus这个接口，状态9是什么状态

【答】

9是波动性中断

【问题单号：20180410-P007-H001】

82. 问题描述：

报单回报报错：SHFE:结算组数据没有同步，表示什么？

【答】

交易所还未完成交易初始化。

【问题单号：20180411-P001-H002】

83. 问题描述：

CTP6.3.11版本 ReqOptionSelfCloseAction 这个请求是什么意思？应该怎么使用呢？

【答】

这个是预留给上期所铜期权业务使用的，暂时线上的版本还用不上

【问题单号：20180412-P008-H001】

84. 问题描述：

报单后在什么情况下会触发自动撤单操作？

【答】

错单、非交易时段下单、特殊交易指令（如FAK）等，在条件不满足的情况下都会触发自动撤单。

【问题单号：20180412-P008-H002】

85. 问题描述：

CTP接口里，哪个函数可以查询历史成交数据

【答】

历史成交数据，在api中可以通过查询历史结算单去看。

CTP有标准结算接口，如果对接了CRM系统，则可以通过CRM来查询历史数据。

【问题单号：20180416-P001-H001】

86. 问题描述：

为何郑商所盘中推送的行情会有结算价？

【答】

CTP的结算价和收盘价都是转发交易所的，不会去主动处理。这个问题是因为郑商所开盘的时候发的快照里有结算价，而CTP的行情是更新机制，字段有变化则更新，无变化则保持不变。所以，导致白盘行情一直会有结算价。

【问题单号：20180606-P007-H001】

87. 问题描述：

业务人员做了出入金，但用ReqQryTransferSerial查询银行转账流水，查询结果却为空。

【答】

ReqQryTransferSerial只能查银期转账，不能查手工出入金。

这里的银期转账是指，通过调用接口，从期货端发起的期货转银行或者银行转期货。

【问题单号：20180627-P007-H001】

88. 问题描述：

在查询合约的时候，合约的限价单和市价单的最大下单量是100。但是实际报单的时候报到10手的时候发现被交易所打回来了，报错（CZCE：出错：买卖数量超过交易所最大下单量限制）。

【答】

最大下单量在CTP柜台里维护，检查下期货公司合约设置是否有误。

【问题单号：20180709-P001-H001】

89. 问题描述：

对大商所的行权，报入放弃指令会遇到报错“CTP：该期权合约不支持放弃执行”。应该如何操作？

【答】

目前大商所的期权不支持放弃行权指令，若想执行放弃行权指令，可以把执行手数填“0”方向填“执行”报入即可放弃大商所行权。

【问题单号：20180807-P001-H001，20180807-P001-H002】

90. 问题描述：

郑商所行情中，成交总额是如何获取的？

【答】

成交总额郑商所不推送，所以是通过计算获得的。公式为：“成交总额=成交均价*成交

数量”。而对于其他交易所这个字段都是推送的。

相反的，`cffex,dce,shfe,ine`这几家的成交均价是不推送的，由CTP自己计算。

【问题单号：20180807-P001-H001】

91. 问题描述：

请问股票期权API如何支持“指派行权”及“备兑证券不足”的查询功能？

【答】

备兑不足会通过交易通知提醒。

被指派行权，这些在行权日结算单上会体现配对结果，并且被指派行权也会有交易通知提醒。

【问题单号：20180817-P001-H001】

92. 问题描述：

客户下套保单的时候，API中投保类型是否应该选择“套保”，CTP系统会不会检查客户有没有套保编码？

【答】

下套保单时需要选择“套保”标识，对于套保单只有中金所有交易编码的区分，CTP会检查客户是否有套保编码。

【问题单号：20180824-P001-H001】

93. 问题描述：

关于ReqQryOptionInstrTradeCost接口几点说明。

【答】

1. 保证金= $\max(\text{权利金} + \text{FixedMargin}, \text{MiniMargin})$ 中的权利金，即Royalty字段，不适用max算法，也就是说该接口只是单纯的将InputPrice拿来作权利金计算。

2. max算法只体现在真实的保证金计算中，例如持仓查询里的卖方保证金占用字段。

3. 交易成本就是保证金。

【问题单号：20180905-P001-H001】

3.2 风控api接口

1. 问题描述

使用风控的报单接口 ReqRiskOrderInsert () 报入成功后，会返回 OnRspRiskOrderInsert () 响应，且为正确。

【答】

风控的这个接口比较特殊，报入成功后，如果是正确的也会返回Rsp响应。而交易的 ReqOrderInsert，报入成功后，如果是正确的则不会有OnRspOrderInsert响应，错误才有。

【20170608-P001-H002】

2. 问题描述

在风控api中，订阅持仓ReqSubscribePosition ()，其中有三个字段，保证金率、保证金率（按手数）、手续费和实际查询的结果不同。

【答】

这三个字段不能作为实际的使用，只是用来方便内部计算，并不能用来实际计算、如果需要的话可以调用对应的查询接口查询。

在一般情况下，这三个字段数值为0、但是在报单的时候这三个字段数值有变、只是方便api的内部使用，不做实际运用。

【20170710-P001-H002】

3. 问题描述

想要获得risk推送的风险度，需要从系统的函数中获取，问需要获取哪个字段？

【答】

风险度请根据保证金和权益，自行计算

【20170713-P001-H001】

4. 问题描述

通过风控api方式接收实时数据，资金、持仓，目前测下来 存在一个“出入金丢失”问题，譬如当日出入金100条 最终只收到了96、7条 （个别客户当天出入金 一条都没有收到）

【答】

在ctp系统里，当天加的投资者收不到相关的出入金记录。

【20170829-P008-H001】

5. 问题描述

OnRtnRiskSyncAccount（资金回报）和OnRtnSequentialPosition（有序的持仓回报）
这两个都是有变化才推送还是间隔时间才推送。

【答】

都是有变化才推送。

【20171027-P001-H001】

6. 问题描述：

CTP风控接口OnRtnIndexNPP（净持仓保证金回报）里面的多头和空头保证金能作为所有投资者多头和空头的情况吗？

【答】

不能。

【问题单号：20180522-P001-H001】

7. 问题描述：

风控中，订阅手机短信ReqSubSeqData中DataType该如何填写？

【答】

可以填写BizNotice也可以填写IPGroupMargin。

【问题单号：20180806-P001-H001】

8. 问题描述：

关于风控接口ReqSetSmsStatus（设置短信通知状态）该接口是否能修改短信通知状态？

【答】

V6.3.11_20180223 15:54:19 以后的版本支持修改。

【问题单号：20181017-P001-H001】

4 附录