# YaoTrader

## 问题列表

## CTP

1. 如何处理“状态信息与成交信息分开返回”这个情况？

方案：

* 在TunnRptProducer::OnRtnTrade中，rpt.OrderStatus = THOST\_FTDC\_OST\_Unknown
* 在Strategy中，收到THOST\_FTDC\_OST\_AllTraded、THOST\_FTDC\_OST\_PartTradedQueueing、THOST\_FTDC\_OST\_PartTradedNotQueueing，先不报给策略so。等收到成交回报（状态：THOST\_FTDC\_OST\_Unknown）再发给策略so

1. 验证在CTP节点验证委托出错的场景（OnRspOrderInsert）

方法：不指定exchangeid

结果：

1. 验证在交易所节点验证委托出错的场景（OnErrRtnOrderInsert）

方法：指定价格超过涨停价，看执行流程“是否回调OnRspOrderInsert，OnErrRtnOrderInsert，OnRtnOrder”

结果：

1. 需要确认是否“当对处于部分成交状态的单执行撤单时，会收到被撤委托单的报入状态的回报”？

方法：

* 发一个不能成交的委托
* 收到报入状态
* 对上边委托进行撤单
* 看是否会再收到一个新的“报入状态的回报”

结果：

影响：会影响合规检查等逻辑

1. 平今与平昨仓

要考虑一个信号的平仓量正好

上期所要区分平今与平昨仓，要考虑如何实现。另外，要在启动时进行查询仓位，知道昨仓今仓都是多少。

要确认：如果昨仓平掉了一部分，在次查询时，昨仓是否相应的减少了。

1. CTP需要结算单确认
2. 撤单指令

CTP撤单分为委托在CTP和委托在交易所2个场景

1. MaxOrderRef的处理
2. CThostFtdcOrderField的ZCETotalTradedVolume，VolumeTraded，VolumeTotal的用途。

如果VolumeTraded，VolumeTotal有意义，则不需要OnRtnTrade

1. CThostFtdcOrderField的OrderSubmitStatus, OrderStatus如何应该用？

需要看这2个字段的逻辑关系

1. 函数中的nRequestID和结构中的RequestID关系，以及如何应用？
2. 持仓查询记录中的昨持仓是今天开盘前的一个初始值，不会因为平昨或者平仓而减少。当前时侯的昨持仓=总持仓-今持仓。YdPosition := Position - TodayPosition。

## Strategy

1. 策略so交易多个合约

要考虑如何支持多合约问题

1. 在config中给我trading\_day和日夜盘吧
2. 保存为: 日期\日夜盘\主力\主力合约数据 和 日期\日夜盘\次主力\次主力合约数据， 这样子

# 《综合交易平台API开发常见问题列表

1. 》40. 还有就是OnRtnOrder有重复推送的问题。

ActiveUserID字段的用途

## 其它

1. YaoTrader需要交易大商所，郑商所，上期所3个市场的品种，该部署到哪个机房；选择哪个通道交易3个市场的品种
2. 如果接收多市场的行情

可能的方案：

* 开发转发程序，需要期货公司提供外网IP
* 期货公司提供外网行情

1. 考虑超涨停报单被拒绝（在交易所拒绝）和在CTP被拒绝的流程
2. 还有就是OnRtnOrder有重复推送的问题比如发一个单，OnRtnOrder推了一个“已报”状态回来。然后我开始撤单，撤单一报入，OnRtnOrder首先又推一个“已报”的状态
3. 上期行情
4. 大连行情
5. 郑州行情
6. 通道选择