# YaoTrader

## 设计

## 仓位的处理

1. 通过CTP获取当前的昨仓和今仓。昨仓YdPosition := Position - TodayPosition，并将仓位存储到总仓位文件中
2. 使用python根据配置，为每个so分配仓位，将每个so的仓位分别存储到按策略名命名的文件中。仓位分配脚本为so分配仓位时，需要区分当前昨仓和当前今仓
3. 正式启动trader，为每个so从相应的so文件中读取仓位，将当前昨仓、今仓推送给so
4. 在交易阶段，trader推送给so的实时仓位，只是推送对应so的总仓位（不区分今仓、昨仓）
5. So在发信号时，平仓时需要维护平仓指令是平今还是平昨

## 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？

OnRtnOrder. VolumeTraded有累计成交量，故OnRtnTrade忽略不用。

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

资金不足，在CTP通过OnRspOrderInsert返回。见

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

通过OnRtnOrder返回拒绝信息（已撤），不会调OnRspOrderInsert，OnErrRtnOrderInsert。见

影响：

因拒绝的状态也是已撤，从而会造成多统计撤单次数。（影响忽略不计，因为很少发生拒绝场景，如果出现，也是出现了逻辑错误）

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
* 部分成交
* 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：

当委托未处于终结状态时，每执行一次撤单，都会通过OnRtnOrder返回最新的状态。见

影响：

合规检查：没有影响

Strategy：会造成同一状态的多次返回，但是没有逻辑问题。

1. 平今与平昨仓

上期所区分昨仓和今仓。

平昨仓时，开平标志类型设置为平仓THOST\_FTDC\_OF\_Close； 平今仓时，开平标志类型设置为平今仓THOST\_FTDC\_OF\_CloseToday

其他交易所不区分昨仓和今仓。开平标志类型统一设置为平仓THOST\_FTDC\_OF\_Close。对大连或者郑州使用CloseToday问题，后台有对应的转换，对DCE和CZCE的仓位使用平今或平昨都转换为平仓

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

1. 撤单指令

CTP撤单分为委托在CTP和委托在交易所2个场景

需要验证没有ordersystemid的场景

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

VolumeTraded：累计成交量

VolumeTotal：剩余量

ZCETotalTradedVolume：需要验证？

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

OrderSubmitStatus：是提交动作的状态，逻辑上不需要改状态

OrderStatus：委托单的状态，逻辑上使用改状态

1. 函数中的nRequestID和结构中的RequestID关系，以及如何应用？

暂时不需要要处理

## 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
3. 要能处理一次有多个信号

需要检查处理信号相关的代码

1. 要支持逐步建仓，如最大仓位200手，可能分几次建仓
2. 平今，平昨有策略实现
3. 要支持多个so
4. 加昨仓字段
5. 支持一个策略多个合约

## 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

在上期机房部署trader。

在郑州大连机房部署行情转发程序，通过专线转发行情到上期

1. 上期行情
2. 大连行情
3. 郑州行情