



交易 API 接口说明

南京艾科朗克（AceleCom）信息科技有限公司自主研发硬件极速交易平台 Xele-Trade：亚微秒级交易系统，独创完整流程的报单管理 FPGA 数据库系统，纳秒级响应速度，提供事前风控和合规检测。

AceleCom

南京艾科朗克信息科技有限公司

XELE-TRADE

交易 API 接口说明

声明

版权所有©南京艾科朗克信息科技有限公司 2016。保留一切权利。

非经本公司书面许可，任何单位和个人不得擅自摘抄、复制本文档内容的部分或全部，并不得以任何形式传播。

商标声明

AcceleCom和其他艾科朗克商标均为南京艾科朗克信息科技有限公司（以下简称艾科朗克）的商标。

本文档提及的其他所有商标或注册商标，由各自的所有人拥有。

注意

您购买的产品、服务或特性等应受艾科朗克商业合同和条款的约束，本文档中描述的全部或部分产品、服务或特性可能不在您的购买或使用范围之内。除非合同另有约定，艾科朗克对本文档内容不做任何明示或默示的声明或保证。

由于产品版本升级或其他原因，本文档内容会不定期进行更新。除非另有约定，本文档仅作为使用指导，本文档中的所有陈述、信息和建议不构成任何明示或暗示的担保。

南京艾科朗克信息科技有限公司

地址：南京市秦淮区永丰大道 8 号白下高新园区 3 号楼 B 栋 101

邮编：210014

电话：025-88017287

传真：025-85766287

邮件：support@accelecom.com

网址：www.accelecom.com

版本记录

日期	文档版本	Trade 版本	TDAPI 版本	备注
06/03/2015		Lichun 1.0	r542	
06/11/2015		Lichun 1.0	r542	补充有关报单，撤单的相关说明
06/19/2015		Lichun 1.0	r601	修正报单时组合投机套利套保标志的说明，修复排版校对错误，
06/26/2015		Lichun 1.0	r620	精简接口，新增合约保证金率查询，合约手续费率查询
09/29/2015		Lichun 1.0	r887	增加报单查询，成交查询，部分结构体少量变更以支持返回中金所 OrderSysID
11/04/2015	0.1	Lichun 1.0	r955	<ol style="list-style-type: none"> 1. 加入文档版本 2. 增加了通用的 API 业务类接口的返回值说明 3. TE_RESUME_TYPE 修正为 XELE_TE_RESUME_TYPE，包括每个枚举值的名称前加入“XELE_” 4. 增加“API 接口变化”章节
01/19/2016	0.1	Lichun 1.0	r965	API 更新为可支持中金所和上期所
01/21/2016	1.0	Lichun 1.0	r1117	增加报单录入应答 OnRspOrderInsert 方法对额外数据域的处理。
07/11/2016	1.0.1	Lichun 1.0	r1211	修复成交回报 OnRspQryTrade() 和报单回报 onRspQryOrder() 方法对 isLast 参数的处理。
08/04/2016	1.0.2	Lichun 1.0	r1502	头文件 CXeleFtdcUserApiStruct.h: 增加了宏 _XELE_TD_FTDCSTRUCT_H。
09/18/2016	1.0.3	Lichun 1.0	r1508	由于上期所报文顺序改变，修改成根据 FID 来判断报文内容，修复 RspInfo 信息错误的问题
11/25/2016	1.0.4	Lichun 1.0	r1585	新增 Error Code 错误说明

目录

声明.....	1
版本记录.....	2
1 前言.....	9
2 Xele-Trade 简介.....	9
3 FTD 通讯协议数据流.....	9
3.1 对话/查询通讯模式.....	9
3.1.1 请求接口参数说明.....	10
3.1.2 响应接口参数说明.....	10
3.2 私有流/公共流通讯模式.....	10
3.2.1 标准通知响应.....	10
3.2.2 错误通知响应.....	10
4 API 接口相关变化.....	10
4.1 r887.....	10
4.2 r955.....	10
5 用户使用 API 与交易系统交互.....	11
5.1 初始化连接.....	11
5.2 心跳机制.....	11
5.3 回应报文的通知机制.....	11
5.4 用户登录.....	11
5.5 报单.....	11
5.6 撤单.....	12
5.7 查询.....	12
6 Trader-API 接口参考说明.....	12
6.1 API 非业务类接口.....	12
6.1.1 CreateTraderApi 创建 API 对象.....	12
6.1.2 GetVersion 获取当前 API 的版本信息.....	12
6.1.3 Release 销毁 API 对象.....	12
6.1.4 Init 初始化网络连接.....	12
6.1.5 Join 等待线程结束.....	13
6.1.6 RegisterFront 注册连接地址.....	13

6.1.7	RegisterSpi 注册回调对象.....	13
6.2	API 业务类接口.....	13
6.2.1	ReqUserLogin 登录请求.....	13
6.2.2	ReqUserLogout 登出请求.....	13
6.2.3	ReqUserPasswordUpdate 修改用户密码.....	13
6.2.4	SubscribePrivateTopic 订阅私有流.....	13
6.2.5	SubscribePublicTopic 订阅公有流.....	14
6.2.6	SubscribeUserTopic 订阅交易员流.....	14
6.2.7	ReqOrderInsert 报单录入请求.....	14
6.2.8	ReqOrderAction 报单操作请求.....	15
6.2.9	ReqQryClientAccount 客户资金查询请求.....	15
6.2.10	ReqQryClientPosition 客户持仓查询请求.....	15
6.2.11	ReqQryInstrument 合约查询请求.....	15
6.2.12	ReqQryInstrumentMarginRate 合约保证金率查询请求.....	15
6.2.13	ReqQryInstrumentCommissionRate 合约手续费率查询请求.....	16
6.2.14	ReqUserPasswordUpdate 用户密码更新.....	16
6.2.15	ReqQryOrder 报单查询.....	16
6.2.16	ReqQryTrade 成交查询.....	16
6.3	Spi 连接管理类接口.....	16
6.3.1	OnFrontConnected.....	16
6.3.2	OnFrontDisconnected.....	16
6.3.3	OnPackageStart.....	16
6.3.4	OnPackageEnd.....	16
6.4	Spi 业务应答接口.....	17
6.4.1	OnRspError 错误应答.....	17
6.4.2	OnRspUserLogin 用户登录应答.....	17
6.4.3	OnRspUserLogout 用户登出应答.....	17
6.4.4	OnRspOrderInsert 报单录入应答.....	17
6.4.5	OnRspOrderAction 报单操作应答.....	17
6.4.6	OnRspQryClientAccount 客户资金查询应答.....	17
6.4.7	OnRspQryClientPosition 客户持仓查询应答.....	18

6.4.8	OnRspQryInstrument 合约查询应答.....	18
6.4.9	OnRspQryInstrumentMarginRate.....	18
6.4.10	OnRspQryInstrumentCommissionRate.....	18
6.5	Spi 业务回报类接口.....	18
6.5.1	OnRtnTrade 成交回报.....	18
6.5.2	OnRtnOrder 报单回报.....	19
6.5.3	OnRtnInstrumentStatus 合约交易状态通知.....	19
6.5.4	OnRtnInsInstrument 增加合约通知.....	19
6.5.5	OnErrRtnOrderInsert 报单录入错误回报.....	19
6.5.6	OnErrRtnOrderAction 报单操作错误回报.....	19
7	接口参数类型.....	19
7.1	XELE_TE_RESUME_TYPE.....	19
7.2	CXeleFtdcDisseminationField 信息分发.....	19
7.3	CXeleFtdcInstrumentStatusField 合约状态.....	20
7.4	CXeleFtdcUserPasswordUpdateField 用户口令修改.....	20
7.5	CXeleFtdcOrderField 报单(未开放).....	20
7.6	CXeleFtdcTradeField 成交(未开放).....	21
7.7	CXeleFtdcInstrumentStatusField 合约状态(未开放).....	21
7.8	CXeleFtdcInstrumentField 合约.....	22
7.9	CXeleFtdcInputOrderField 输入报单.....	22
7.10	CXeleFtdcOrderActionField 报单操作.....	23
7.11	CXeleFtdcReqUserLoginField 用户登录请求.....	23
7.12	CXeleFtdcReqUserLogoutField 用户登出请求.....	23
7.13	CXeleFtdcQryClientAccountField 客户资金查询.....	23
7.14	CXeleFtdcQryOrderField 报单查询.....	23
7.15	CXeleFtdcQryTradeField 成交查询.....	24
7.16	CXeleFtdcQryClientPositionField 客户持仓查询.....	24
7.17	CXeleFtdcQryInstrumentField 合约查询.....	24
7.18	CXeleFtdcQryInstrumentStatusField 合约状态查询(未开放).....	24
7.19	CXeleFtdcRspInfoField 响应信息.....	24
7.20	CXeleFtdcRspUserLoginField 用户登录应答.....	24

7.21	CXeleFtdcRspUserLogoutField 用户登出应答.....	25
7.22	CXeleFtdcRspClientPositionField 客户持仓应答.....	25
7.23	CXeleFtdcRspInstrumentField 合约查询应答.....	25
7.24	CXeleFtdcQryInstrumentMarginRateField 合约保证金率.....	26
7.25	CXeleFtdcQryInstrumentCommissionRateField 合约手续费率.....	26
8	字段类型.....	26
8.1	TXeleFtdcSequenceNoType 序列号类型.....	26
8.2	TXeleFtdcSequenceSeriesType 序列系列号类型.....	26
8.3	TXeleFtdcSettlementGroupIDType 结算组代码类型.....	26
8.4	TXeleFtdcInstrumentIDType 合约代码类型.....	26
8.5	TXeleFtdcInstrumentStatusType 合约交易状态类型.....	27
8.6	TXeleFtdcTradingSegmentSNTYPE 交易阶段编号类型.....	27
8.7	TXeleFtdcTimeType 时间类型.....	27
8.8	TXeleFtdcInstStatusEnterReasonType 品种进入交易状态原因类型（未使用） 27	
8.9	TXeleFtdcDateType 日期类型.....	27
8.10	TXeleFtdcSettlementIDType 结算编号类型.....	27
8.11	TXeleFtdcParticipantIDType 会员代码类型.....	27
8.12	TXeleFtdcClientIDType 客户代码类型.....	27
8.13	TXeleFtdcVolumeType 数量类型.....	27
8.14	TXeleFtdcMoneyType 资金类型.....	28
8.15	TXeleFtdcBulletinIDType 公告编号类型.....	28
8.16	TXeleFtdcNewsTypeType 公告类型类型.....	28
8.17	TXeleFtdcNewsUrgencyType 紧急程度类型.....	28
8.18	TXeleFtdcAbstractType 消息摘要类型.....	28
8.19	TXeleFtdcComeFromType 消息来源类型.....	28
8.20	TXeleFtdcOrderSysIDType 报单编号类型.....	28
8.21	TXeleFtdcUserIDType 交易用户代码类型.....	28
8.22	TXeleFtdcOrderPriceTypeType 报单价格条件类型.....	28
8.23	TXeleFtdcTradeIDType 成交编号类型.....	28
8.24	TXeleFtdcProductIDType 产品代码类型.....	28
8.25	TXeleFtdcProductGroupIDType 产品组代码类型.....	28

8.26	TXeleFtdcProductInfoType 产品信息类型.....	28
8.27	TXeleFtdcDataCenterIDType 数据中心代码类型.....	29
8.28	TXeleFtdcPriceType 价格类型.....	29
8.29	TXeleFtdcBoolType 布尔型类型.....	29
8.30	TXeleFtdcOrderLocalIDType 本地报单编号类型.....	29
8.31	TXeleFtdcContentType 消息正文类型.....	29
8.32	TXeleFtdcBusinessUnitType 业务单元类型.....	29
8.33	TXeleFtdcMonthCountType 月份数量类型.....	29
8.34	TXeleFtdcPositionTypeType 持仓类型类型.....	29
8.35	TXeleFtdcClientTypeType 客户类型类型.....	29
8.36	TXeleFtdcYearType 年份类型.....	29
8.37	TXeleFtdcMonthType 月份类型.....	29
8.38	TXeleFtdcAdvanceMonthType 提前月份类型.....	29
8.39	TXeleFtdcHedgeFlagType 投机套保标志类型.....	30
8.40	TXeleFtdcPosiDirectionType 持仓多空方向类型.....	30
8.41	TXeleFtdcProductClassType 产品类型类型.....	30
8.42	TXeleFtdcURLLinkType WEB 地址类型.....	30
8.43	TXeleFtdcMarketIDType 市场代码类型.....	30
8.44	TXeleFtdcOrderSourceType 报单来源类型.....	30
8.45	TXeleFtdcOrderStatusType 报单状态类型.....	30
8.46	TXeleFtdcOrderTypeType 报单类型类型.....	31
8.47	TXeleFtdcPriorityType 优先权类型.....	31
8.48	TXeleFtdcTimeSortIDType 按时间排队的序号类型.....	31
8.49	TXeleFtdcDirectionType 买卖方向类型.....	31
8.50	TXeleFtdcCombOffsetFlagType 组合开平标志类型.....	31
8.51	TXeleFtdcCombHedgeFlagType 组合投机套保标志类型.....	31
8.52	TXeleFtdcTimeConditionType 有效期类型类型.....	31
8.53	TXeleFtdcVolumeConditionType 成交量类型类型.....	31
8.54	TXeleFtdcContingentConditionType 触发条件类型.....	32
8.55	TXeleFtdcForceCloseReasonType 强平原因类型.....	32
8.56	TXeleFtdcOptionsTypeType 期权类型类型.....	32

8.57	TXeleFtdcVolumeMultipleType 合约数量乘数类型.....	32
8.58	TXeleFtdcUnderlyingMultipleType 合约基础商品乘数类型.....	32
8.59	TXeleFtdcInstrumentNameType 合约名称类型.....	32
8.60	TXeleFtdcActionFlagType 操作标志类型.....	32
8.61	TXeleFtdcErrorIDType 错误代码类型.....	33
8.62	TXeleFtdcErrorMsgType 错误信息类型.....	33
8.63	TXeleFtdcTradingSystemNameType 交易系统名称类型.....	33
8.64	TXeleFtdcAccountIDType 资金帐号类型.....	33
8.65	TXeleFtdcPartyNameType 参与人名称类型.....	33
8.66	TXeleFtdcIdCardTypeType 证件类型类型.....	33
8.67	TXeleFtdcIdentifiedCardNoV1Type 原证件号码类型.....	33
8.68	TXeleFtdcTradingRoleType 交易角色类型.....	33
8.69	TXeleFtdcIdentifiedCardNoType 证件号码类型.....	33
8.70	TXeleFtdcPasswordType 密码类型.....	33
8.71	TXeleFtdcOffsetFlagType 开平标志类型.....	34
8.72	TXeleFtdcTradeTypeType 成交类型类型.....	34
8.73	TXeleFtdcPriceSourceType.....	34
8.74	TXeleFtdcProtocolInfoType.....	34
8.75	TXeleFtdcClientTypeType 客户类型.....	34
9	附录 A 错误代码表.....	34

1 前言

该文档是极速交易系统 Xele-Trade 的投资者使用手册，它提供 API 功能及其使用说明。本说明书适用于极速交易系统 Xele-Trade 的交易 API。

2 Xele-Trade 简介

Xele-Trade 是业内领先的基于 FPGA、亚微秒级极速交易系统，独创完整流程的 FPGA 数据传输系统，拥有纳秒级响应速度，提供最快速准确的资讯通道；是为证券、期货高端人士及机构、基金类专业投资机构及产业巨头量身打造的高性能交易系统。

发布给用户的档案包以 xeletrade_api_版本号.tgz 命名， 包含的文件如下：

文件名	版本	说明
include/CXeleTraderApi. hpp	r955	交易员 API 接口头文件，定义了目前支持的接口
include/CXeleFtdcUserApiStruct. h	r955	定义了函数接口的参数结构体， 即域类型
include/CXeleFtdcUserApiDataType. h	r955	定义了域中的字段的类型
libXeleTdAPI64. so	r955	API 动态库
userdemo. cpp	r955	userdemo 示例程序
config_userdemo. ini	r955	userdemo 的配置文件
makefile	r955	userdemo 工程文件

3 FTD 通讯协议数据流

- 对话/查询通讯模式
- 私有流/公共流通讯模式

3.1 对话/查询通讯模式

```
////请求

int CXeleTraderApi::ReqXXX(
                                CXeleFtdcXXXField *pReqXXX,
                                int nRequestID)

////回应:

void CXeleTraderSpi::OnRspXXX(
                                CXeleFtdcXXXField *pRspXXX,
                                CXeleFtdcRspInfoField *pRspInfo,
                                int nRequestID, bool bIsLast)
```

该模式的相关接口以 ReqXXX, OnRspXXX 来命名。该模式调用 API 的 ReqXXX 来发起标识为 requestID 的请求, 在 RspXXX 中处理相应的 requestID 的请求。

3.1.1 请求接口参数说明

接口名称: ReqXXX

- pReqXXX: 请求的参数结构体指针
- nRequestID: 由用户管理的请求标识, 与回应关联

3.1.2 响应接口参数说明

接口名称: OnRspXXX

- pRspXXX: 响应报文的参数结构体指针
- pRspInfo: RspInfo 表示结果域, 含有 ErrorID 和 ErrorMsg 表达该次请求的状态
- nRequestID: 响应的请求 id
- bIsLast: 该次请求 ID 是否响应完毕, 即一次回应报文中, 该响应回调函数可能会被多次调用, 标识最后一次调用

3.2 私有流/公共流通讯模式

```
void CXeleTraderSpi::OnRtnXXX(CXeleFtdcXXXField *pXXX);
////或者
void CXeleTraderSpi::OnErrRtnXXX(CXeleFtdcXXXField *pXXX,
    CXeleFtdcRspInfoField *pRspInfo);
```

该模式的相关接口以 OnRtnXXX, OnErrRtnXXX 来命名。

3.2.1 标准通知响应

接口名称: OnRtnXXX

- pXXX 相应的通知回调数据域指针

3.2.2 错误通知响应

接口名称: OnErrRtnXXX

- pXXX 相应的通知回调数据域指针
- pRspInfo 错误类型和错误信息

4 API 接口相关变化

4.1 r887

CXeleFtdcInputOrderField 域的最后一个字段改为 ExchangeOrderSysID, 交易所交易编码。CXeleFtdcQryOrderField, CXeleFtdcQryTradeField 有所变化。

4.2 r955

回调机制回滚至 r620, 去除长时间连接可能引起不稳定的因素

4.3 r965

CreateTraderApi 增加选择交易所类别的选项。

5 用户使用 API 与交易系统交互

5.1 初始化连接

- CreateTraderApi() 获取可用的 API 对象指针（中金所或者上期所）
- RegisterSpi(pspi)，注册用户继承自 CXeleTraderSpi 的自有子类对象的地址
- RegisterFront 设置分配给用户的通道连接地址和端口，格式为“tcp://<ip_address>:<port>”，如“tcp://127.0.0.1:8080”
- 在 Init 前需要使用 SubscribeXXXTopic 订阅相应的流，如 SubscribePrivateTopic
- Init，如果连接成功，Spi 的 OnFrontConnected() 会被调用

5.2 心跳机制

Xele-Trade 系统每隔一定时间发送心跳报文来维持连接，API 对此报文自动进行回应，无需用户干预。

5.3 回应报文的机制

用户自定义响应处理的方法为创建一个类为 CXeleTraderSpi 的子类，并使用 RegisterSpi 接口注册给 API。在 CXeleTraderSpi 回调基类中有两个接口 OnPackageStart() 和 OnPackageEnd()，参数均为 (topic, sequenceNo)，用于通知用户收到了 topic 类型的流，该流的编号是 sequenceNo。所有回调类型的响应接口均会在调用之前调用 OnPackageStart，在回调完毕后调用 OnPackageEnd。

5.4 用户登录

初始化网络连接后，就可以使用对话流接口 [ReqUserLogin](#) 进行登录请求了，[OnRspUserLogin](#) 处理登录请求的状态，只有登录成功后才能进行业务处理。

5.5 报单

使用对话流接口 [ReqOrderInsert](#) 进行报单录入请求，[OnRspOrderInsert](#) 响应此次报单录入请求（无论成功与否），根据具体情况也会有私有流接口 [OnRtnOrder](#)，[OnErrRtnOrderInsert](#) 被回调。

有关如何填写报单的参数的详细说明，见对话流接口 [ReqOrderInsert](#) 的手册，这里描述有关报单的单号如何进行管理。

报单时需要维护的 ID 字段有 *OrderLocalID* 和 *OrderSysID*。*OrderLocalID* 是交易系统用于维护报单动作的 ID，标识这个单是新增还是删除的动作，*OrderSysID* 是实际用来标识新增单的编号，也是唯一的撤单依据，使用方法举例：

报单 1：

OrderLocalID=" 0001" , 在 *OnRspOrderInsert* 中得到的 *OrderSysID*=" 000009" 。

报单 2:

OrderLocalID=" 0002" , 在 *OnRspOrderInsert* 中得到的 *OrderSysID*=" 000010" ,

OrderSysID 用来作为唯一的撤单依据。

5.6 撤单

使用对话流接口 [ReqOrderAction](#) 进行撤单请求发送, [OnRspOrderAction](#) 处理该次请求的应答。

ReqOrderAction 中的 *ActionLocalID* 和 *OrderLocalID* 都指的是本地报单编号, 是同一种类型的不同名称, 因此不能重用, 需要使用字符串比较后递增的本地报单编号。目前的交易系统**仅支持 OrderSysID 撤单**, 只能使用 *OrderInsert* 时回应的信息中的 *OrdersysID* 来唯一确定撤掉哪个单。例如:

撤单 1:

ActionLocalID= "0003" , 撤掉 *OrderSysID*= " 000010" 单号。

5.7 查询

根据查询内容的不同调用对应的 *ReqQryXXX* 查询流接口, 对应的 *OnRspRqyXXX* 作出响应。

注意每种查询接口有连续查询间隔不少于 **500ms** 的限制。

6 Trader-API 接口参考说明

6.1 API 非业务类接口

6.1.1 *CreateTraderApi* (int exchange) 创建 API 对象

Exchange = 0 中金所

Exchange = 1 上期所

返回: 合法的 API 对象指针

6.1.2 *GetVersion* 获取当前 API 的版本信息

返回: API 版本信息字符串

6.1.3 *Release* 销毁 API 对象

说明: 调用者为 *CreateTraderApi* 生成的合法指针对象

返回: 无

6.1.4 *Init* 初始化网络连接

返回: 无

6.1.5Join 等待线程结束

返回：0

6.1.6RegisterFront 注册连接地址

说明：需要在 Init 之前调用

参数：

- pszFrontAddress
交易系统连接地址和端口， 格式为<protocol>://<address>:<port>， 如
tcp://1.1.1.1:32001

6.1.7RegisterSpi 注册回调对象

说明：注册 CXeleTraderSpi 的子类指针， 用户可通过继承该类实现自定义

6.2 API 业务类接口

业务类接口的通用返回值说明如下表：

返回值	类型	说明
0	Success	请求成功， 链路数据已发送
-1	RequestID_Out_Of_Range	交易系统目前支持的 request_id 范围为 0~0xffffffff(十进制 268435455)， 超出这个范围的 request_id 会报错
正数	socket 连接出错	系统 socket 错误码

6.2.1ReqUserLogin 登录请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcReqUserLoginField	登录请求域	
int	请求 ID	

6.2.2ReqUserLogout 登出请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcReqUserLogoutField	登出请求域	
int	请求 ID	

6.2.3ReqUserPasswordUpdate 修改用户密码

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcUserPasswordUpdateField	密码修改域	
int	请求 ID	

6.2.4SubscribePrivateTopic 订阅私有流

参数类型	名称	说明
XELE TE RESUME TYPE	重传方式	目前仅支持 TERT_QUICK

该方法要在 Init 之前调用

6.2.5SubscribePublicTopic 订阅公有流

参数类型	名称	说明
XELE_TE_RESUME_TYPE	重传方式	目前仅支持 TERT_QUICK

该方法要在 Init 之前调用。

6.2.6SubscribeUserTopic 订阅交易员流

参数类型	名称	说明
XELE_TE_RESUME_TYPE	重传方式	目前仅支持 TERT_QUICK

该方法要在 Init 之前调用。

6.2.7ReqOrderInsert 报单录入请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcInputOrderField	报单录入	1. GTDDate (GTD 暂不支持, 不填) 2. StopPrice 止损价 (不支持, 不填)
int	请求 ID	

必须填充的字段:

- 1) OrderLocalID, 参考报单说明;
- 2) ParticipantID, 会员号, 形如“2008”;
- 3) ClientID, 客户号, 形如“10000029”;
- 4) UserID, 交易用户代码, 形如“200801”;
- 5) InstrumentID, 合约代码, 形如“IF1109”;
- 6) Direction, 买卖方向, XELE_FTDC_D_Buy 表示买, XELE_FTDC_D_Sell 表示卖;
- 7) VolumeTotalOriginal, 数量, 例如 5 表示 5 手;
- 8) CombOffsetFlag, 组合开平标志, 参考开平标志类型, 仅支持 XELE_FTDC_OF_Open 开仓, XELE_FTDC_OF_Close 平仓;
- 9) CombHedgeFlag, 组合投机套保标志, 参考[投机套保标志类型](#), 默认只支持“投机”, 如需要“套保”, “套利”, 请和我司联系;
- 10) ContingentCondition 触发条件, 只支持 XELE_FTDC_CC_Immediately (“立即”);
- 11) ForceCloseReason 强平原因, 只支持 XELE_FTDC_FCC_NotForceClose (“非强平”);

限价单的字段还包括:

- 1) OrderPriceType, 报单价格条件, 为 XELE_FTDC_OPT_LimitPrice 限价单;
- 2) LimitPrice, 价格, 形如 3500.00;
- 3) TimeCondition 和 VolumeCondition, 有效期与成交量类型的组合。

TimeCondition 有效期	VolumeCondition 成交量类型
XELE_FTDC_TC_GFD 当日有效	XELE_FTDC_VC_AV 任意数量
XELE_FTDC_TC_IOC 立即完成, 否则撤销	XELE_FTDC_VC_AV
XELE_FTDC_TC_IOC	XELE_FTDC_VC_MV 最小数量
XELE_FTDC_TC_IOC	XELE_FTDC_VC_CV 全部数量

市价单的字段还包括:

1) OrderPriceType, 报单价格条件, 只能为 XELE_FTDC_OPT_AnyPrice;

2) TimeCondition 和 VolumeCondition, 有效期与成交量类型的组合。

TimeCondition 有效期	VolumeCondition 成交量类型
XELE_FTDC_TC_GFD 当日有效	XELE_FTDC_VC_AV 任意数量
XELE_FTDC_TC_IOC 立即成交, 否则撤销	XELE_FTDC_VC_AV
XELE_FTDC_TC_IOC	XELE_FTDC_VC_MV 最小数量
XELE_FTDC_TC_IOC	XELE_FTDC_VC_CV 全部数量

6.2.8 ReqOrderAction 报单操作请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcOrderActionField	报单操作	1. OrderLocalID 暂不支持 2. LimitPrice 不填 3. VolumeChange 不填 4. BusinessUnit 业务单元
int	nRequestID 请求 ID	

必须填充的字段:

- 1) OrderSysID, 参见撤单;
- 2) ActionFlag, 操作标志, 只支持“撤单”;
- 3) ParticipantID, 会员代码;
- 4) ClientID 客户代码;
- 5) UserID 交易用户代码;
- 6) ActionLocalID, 参见 [撤单](#)。

6.2.9 ReqQryClientAccount 客户资金查询请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryClientAccountField *	客户资金查询	1. AccountID 可选
int	请求 ID	

6.2.10 ReqQryClientPosition 客户持仓查询请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryClientPositionField	客户持仓查询	1. ClientType 可选
int	请求 ID	

6.2.11 ReqQryInstrument 合约查询请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryInstrumentField	合约查询	
int	请求 ID	

6.2.12 ReqQryInstrumentMarginRate 合约保证金率查询请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryInstrumentMarginRateField	合约保证金率查询	

int	请求 ID	
-----	-------	--

6.2.13 ReqQryInstrumentCommissionRate 合约手续费率查询请求

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryInstrumentCommissionRateField	合约手续费率	
int	请求 ID	

6.2.14 ReqUserPasswordUpdate 用户密码更新

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcUserPasswordUpdateField	密码域	
int	请求 ID	

6.2.15 ReqQryOrder 报单查询

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryOrderField	报单查询请求	
int	请求 ID	

6.2.16 ReqQryTrade 成交查询

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcQryTradeField	成交查询请求	
int	请求 ID	

6.3 Spi 连接管理类接口

6.3.1 OnFrontConnected

说明：当客户端成功建立网络连接时被调用

6.3.2 OnFrontDisconnected

说明：当客户端失去网络连接时被调用

参数类型	名称	说明
int	nReason 错误代码	低 16 位[15:0]为系统错误号, 高 16 位[31:16]为 API 内部错误模块代码

6.3.3 OnPackageStart

说明：报文回调开始

参数类型	名称	说明
int	nTopic	流代号, 主题代码
int	nSequenceNo	流的报文序号

6.3.4 OnPackageEnd

说明：报文回调结束

参数类型	名称	说明
int	nTopic	流代号, 主题代码

int	nSequenceNo	流的报文序号
-----	-------------	--------

6.4 Spi 业务应答接口

6.4.1 OnRspError 错误应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.2 OnRspUserLogin 用户登录应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspUserLoginField	pRspUserLogin	用户登录应答
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.3 OnRspUserLogout 用户登出应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspUserLogoutField	pRspUserLogout	用户登出应答
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.4 OnRspOrderInsert 报单录入应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcInputOrderField	pInputOrder	输入报单
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.5 OnRspOrderAction 报单操作应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcOrderActionField	pOrderAction	报单操作
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.6 OnRspQryClientAccount 客户资金查询应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspClientAccountField	pClientAccount	客户资金应答

CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.7 OnRspQryClientPosition 客户持仓查询应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspClientPositionField	pRspClientPosition	客户持仓应答
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.8 OnRspQryInstrument 合约查询应答

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspInstrumentField	pRspClientPosition	客户持仓应答
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.9 OnRspQryInstrumentMarginRate

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspInstrumentMarginRateField	pRspInstrumentMarginRate	合约保证金率
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.4.10 OnRspQryInstrumentCommissionRate

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcRspInstrumentCommissionRateField	pRspInstrumentCommissionRate	合约保证金率
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息
int	nRequestID	请求 ID
bool	bIsLast	此次请求的响应的最后一次回调标志

6.5 Spi 业务回报类接口

6.5.1 OnRtnTrade 成交回报

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcTradeField	pTrade	成交回报
	TradingRole	交易角色, 未使用
	AccountID	资金账号, 未使用

		TradeType 成交类型, 未使用 PriceSource 成交价来源, 未使用 ClearingPartID 未使用
--	--	---

6.5.2 OnRtnOrder 报单回报

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcOrderField	pOrder	报单回报 TradingDay, SettlementGroupID, SettlementID, OrderSource, OrderType, VolumeTraded, InsertTime, ActiveTime, Suspendtime, CancelTime, timeSortID, ClearingPartID, BusinessUnit 未使用

6.5.3 OnRtnInstrumentStatus 合约交易状态通知

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcInstrumentStatusField	pInstrumentStatus	合约交易状态

6.5.4 OnRtnInsInstrument 增加合约通知

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcInstrumentField	pInstrument	合约

6.5.5 OnErrRtnOrderInsert 报单录入错误回报

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcInputOrderField	pInputOrder	报单录入
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息

6.5.6 OnErrRtnOrderAction 报单操作错误回报

参数类型	名称	说明
CXeleFtdcOrderActionField	pOrderAction	报单操作
CXeleFtdcRspInfoField	pRspInfo	响应信息

7 接口参数类型

7.1 XELE_TE_RESUME_TYPE

- XELE_TERT_RESTART
- XELE_TERT_RESUME
- XELE_TERT_QUICK 从当前的流开始传送

该参数目前均按照 TERT_QUICK 处理

7.2 CXeleFtdcDisseminationField 信息分发

参数类型	名称	说明
------	----	----

TXeleFtdcSequenceSeriesType	SequenceSeries	序列系列号
TXeleFtdcSequenceNoType	SequenceNo	序列号

7.3 CXeleFtdcInstrumentStatusField 合约状态

参数类型	名称	说明
TXeleFtdcSettlementGroupIDType	SettlementGroupID	结算组代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcInstrumentStatusType	InstrumentStatus	合约交易状态
TXeleFtdcTradingSegmentSNTYPE	TradingSegmentSN	交易阶段编号
TXeleFtdcTimeType	EnterTime	进入本状态时间
TXeleFtdcInstStatusEnterReasonType	EnterReason	进入本状态原因

7.4 CXeleFtdcUserPasswordUpdateField 用户口令修改

参数类型	名称	说明
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码
TXeleFtdcPasswordType	OldPassword	旧密码
TXeleFtdcPasswordType	NewPassword	新密码

7.5 CXeleFtdcOrderField 报单(未开放)

- [TXeleFtdcDateType](#) TradingDay 交易日
- [TXeleFtdcSettlementGroupIDType](#) SettlementGroupID 结算组代码
- [TXeleFtdcSettlementIDType](#) SettlementID 结算编号
- [TXeleFtdcOrderSysIDType](#) OrderSysID 报单编号
- [TXeleFtdcParticipantIDType](#) ParticipantID 会员代码
- [TXeleFtdcClientIDType](#) ClientID 客户代码
- [TXeleFtdcUserIDType](#) UserID 交易用户代码
- [TXeleFtdcInstrumentIDType](#) InstrumentID 合约代码
- [TXeleFtdcOrderPriceTypeType](#) OrderPriceType 报单价格条件
- [TXeleFtdcDirectionType](#) Direction 买卖方向
- [TXeleFtdcCombOffsetFlagType](#) CombOffsetFlag 组合开平标志
- [TXeleFtdcCombHedgeFlagType](#) CombHedgeFlag 组合投机套保标志
- [TXeleFtdcPriceType](#) LimitPrice 价格
- [TXeleFtdcVolumeType](#) VolumeTotalOriginal 数量
- [TXeleFtdcTimeConditionType](#) TimeCondition 有效期类型
- [TXeleFtdcDateType](#) GTDDate GTD 日期
- [TXeleFtdcVolumeConditionType](#) VolumeCondition 成交量类型
- [TXeleFtdcVolumeType](#) MinVolume 最小成交量
- [TXeleFtdcContingentConditionType](#) ContingentCondition 触发条件
- [TXeleFtdcPriceType](#) StopPrice 止损价
- [TXeleFtdcForceCloseReasonType](#) ForceCloseReason 强平原因
- [TXeleFtdcOrderLocalIDType](#) OrderLocalID 本地报单编号
- [TXeleFtdcBoolType](#) IsAutoSuspend 自动挂起标志
- [TXeleFtdcOrderSourceType](#) OrderSource 报单来源

• TXeleFtdcOrderStatusType	OrderStatus	报单状态
• TXeleFtdcOrderTypeType	OrderType	报单类型
• TXeleFtdcVolumeType	VolumeTraded	今成交数量
• TXeleFtdcVolumeType	VolumeTotal	剩余数量
• TXeleFtdcDateType	InsertDate	报单日期
• TXeleFtdcTimeType	InsertTime	插入时间
• TXeleFtdcTimeType	ActiveTime	激活时间
• TXeleFtdcTimeType	SuspendTime	挂起时间
• TXeleFtdcTimeType	UpdateTime	最后修改时间
• TXeleFtdcTimeType	CancelTime	撤销时间
• TXeleFtdcUserIDType	ActiveUserID	最后修改交易用户代码
• TXeleFtdcPriorityType	Priority	优先权
• TXeleFtdcTimeSortIDType	TimeSortID	按时间排队的序号
• TXeleFtdcParticipantIDType	ClearingPartID	结算会员编号
• TXeleFtdcBusinessUnitType	BusinessUnit	业务单元

7.6 CXeleFtdcTradeField 成交（未开放）

• TXeleFtdcDateType	TradingDay	交易日
• TXeleFtdcSettlementGroupIDType	SettlementGroupID	结算组代码
• TXeleFtdcSettlementIDType	SettlementID	结算编号
• TXeleFtdcTradeIDType	TradeID	成交编号
• TXeleFtdcDirectionType	Direction	买卖方向
• TXeleFtdcOrderSysIDType	OrderSysID	报单编号
• TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码
• TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码
• TXeleFtdcTradingRoleType	TradingRole	交易角色
• TXeleFtdcAccountIDType	AccountID	资金帐号
• TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
• TXeleFtdcOffsetFlagType	OffsetFlag	开平标志
• TXeleFtdcHedgeFlagType	HedgeFlag	投机套保标志
• TXeleFtdcPriceType	Price	价格
• TXeleFtdcVolumeType	Volume	数量
• TXeleFtdcTimeType	TradeTime	成交时间
• TXeleFtdcTradeTypeType	TradeType	成交类型
• TXeleFtdcPriceSourceType	PriceSource	成交价来源
• TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
• TXeleFtdcOrderLocalIDType	OrderLocalID	本地报单编号
• TXeleFtdcParticipantIDType	ClearingPartID	结算会员编号
• TXeleFtdcBusinessUnitType	BusinessUnit	业务单元

7.7 CXeleFtdcInstrumentStatusField 合约状态（未开放）

• TXeleFtdcSettlementGroupIDType	SettlementGroupID	结算组代码
--	-------------------	-------

- [TXeleFtdcInstrumentIDType](#) InstrumentID 合约代码
- [TXeleFtdcInstrumentStatusType](#) InstrumentStatus 合约交易状态
- [TXeleFtdcTradingSegmentSNTYPE](#) TradingSegmentSN 交易阶段编号
- [TXeleFtdcTimeType](#) EnterTime 进入本状态时间
- [TXeleFtdcInstStatusEnterReasonType](#) EnterReason 进入本状态原因

7.8 CXeleFtdcInstrumentField 合约

参数类型	名称	说明
TXeleFtdcSettlementGroupIDType	SettlementGroupID	结算组代码
TXeleFtdcProductIDType	ProductID	产品代码
TXeleFtdcProductGroupIDType	ProductGroupID	产品组代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	UnderlyingInstrID	基础商品代码
TXeleFtdcProductClassType	ProductClass	产品类型
TXeleFtdcPositionTypeType	PositionType	持仓类型
TXeleFtdcPriceType	StrikePrice	执行价
TXeleFtdcOptionsTypeType	OptionsType	期权类型
TXeleFtdcVolumeMultipleType	VolumeMultiple	合约数量乘数
TXeleFtdcUnderlyingMultipleType	UnderlyingMultiple	合约基础商品乘数
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcInstrumentNameType	InstrumentName	合约名称
TXeleFtdcYearType	DeliveryYear	交割年份
TXeleFtdcMonthType	DeliveryMonth	交割月
TXeleFtdcAdvanceMonthType	AdvanceMonth	提前月份
TXeleFtdcBoolType	IsTrading	当前是否交易

7.9 CXeleFtdcInputOrderField 输入报单

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcOrderSysIDType	OrderSysID	报单编号
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcOrderPriceTypeType	OrderPriceType	报单价格条件
TXeleFtdcDirectionType	Direction	买卖方向
TXeleFtdcCombOffsetFlagType	CombOffsetFlag	组合开平标志
TXeleFtdcCombHedgeFlagType	CombHedgeFlag	组合投机套保标志
TXeleFtdcPriceType	LimitPrice	价格
TXeleFtdcVolumeType	VolumeTotalOriginal	数量
TXeleFtdcTimeConditionType	TimeCondition	有效期类型
TXeleFtdcDateType	GTDDate	GTD 日期
TXeleFtdcVolumeConditionType	VolumeCondition	成交量类型
TXeleFtdcVolumeType	MinVolume	最小成交量
TXeleFtdcContingentConditionType	ContingentCondition	触发条件

TXeleFtdcPriceType	StopPrice	止损价
TXeleFtdcForceCloseReasonType	ForceCloseReason	强平原因
TXeleFtdcOrderLocalIDType	OrderLocalID	本地报单编号
TXeleFtdcBoolType	IsAutoSuspend	自动挂起标志
TXeleFtdcOrderLocalIDType	ExchangeOrderSysID	交易所报单编号, RspOrderInsert 时有意义

7.10 CXeleFtdcOrderActionField 报单操作

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcOrderSysIDType	OrderSysID	报单编号
TXeleFtdcOrderLocalIDType	OrderLocalID	本地报单编号
TXeleFtdcActionFlagType	ActionFlag	报单操作标志
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcPriceType	LimitPrice	价格
TXeleFtdcVolumeType	VolumeChange	数量变化
TXeleFtdcOrderLocalIDType	ActionLocalID	操作本地编号
TXeleFtdcBusinessUnitType	BusinessUnit	业务单元

7.11 CXeleFtdcReqUserLoginField 用户登录请求

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcDateType	TradingDay	交易日
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码
TXeleFtdcPasswordType	Password	密码
TXeleFtdcProductInfoType	UserProductInfo	用户端产品信息
TXeleFtdcProductInfoType	InterfaceProductInfo	接口端产品信息
TXeleFtdcProtocolInfoType	ProtocolInfo	协议信息
TXeleFtdcDataCenterIDType	DataCenterID	数据中心代码

7.12 CXeleFtdcReqUserLogoutField 用户登出请求

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码

7.13 CXeleFtdcQryClientAccountField 客户资金查询

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码
TXeleFtdcAccountIDType	AccountID	资金账号

7.14 CXeleFtdcQryOrderField 报单查询

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码

TXeleFtdcOrderSysIDType	OrderSysID	报单编号
TXeleFtdcTimeType	TimeStart	开始时间
TXeleFtdcTimeType	TimeEnd	结束时间

7.15 CXeleFtdcQryTradeField 成交查询

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcTradeIDType	TradeID	报单编号
TXeleFtdcTimeType	TimeStart	开始时间
TXeleFtdcTimeType	TimeEnd	结束时间

7.16 CXeleFtdcQryClientPositionField 客户持仓查询

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcClientTypeType	ClientType	客户类型

7.17 CXeleFtdcQryInstrumentField 合约查询

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcProductIDType	ProductID	产品代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码

7.18 CXeleFtdcQryInstrumentStatusField 合约状态查询（未开放）

7.19 CXeleFtdcRspInfoField 响应信息

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcErrorIDType	ErrorID	错误代码
TXeleFtdcErrorMsgType	ErrorMsg	错误信息（Gb2312 编码）

7.20 CXeleFtdcRspUserLoginField 用户登录应答

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcDateType	TradingDay	交易日
TXeleFtdcTimeType	LoginTime	登录成功时间
TXeleFtdcOrderLocalIDType	MaxOrderLocalID	最大本地报单号
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码
TXeleFtdcTradingSystemNameType	TradingSystemName	交易系统名称
TXeleFtdcDataCenterIDType	DataCenterID	数据中心代码
TXeleFtdcSequenceNoType	PrivateFlowSize	会员私有流当前长度
TXeleFtdcSequenceNoType	UserFlowSize	交易员私有流当前长度

7.21 CXeleFtdcRspUserLogoutField 用户登出应答

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcUserIDType	UserID	交易用户代码
TXeleFtdcParticipantIDType	ParticipantID	会员代码

7.22 CXeleFtdcRspClientPositionField 客户持仓应答

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcDateType	TradingDay	交易日
TXeleFtdcSettlementGroupIDType	SettlementGroupID	结算组代码
TXeleFtdcSettlementIDType	SettlementID	结算编号
TXeleFtdcHedgeFlagType	HedgeFlag	投机套保标志
TXeleFtdcPosiDirectionType	PosiDirection	持仓多空方向
TXeleFtdcVolumeType	YdPosition	上日持仓
TXeleFtdcVolumeType	Position	今日持仓
TXeleFtdcVolumeType	LongFrozen	多头冻结
TXeleFtdcVolumeType	ShortFrozen	空头冻结
TXeleFtdcVolumeType	YdLongFrozen	昨日多头冻结
TXeleFtdcVolumeType	YdShortFrozen	昨日空头冻结
TXeleFtdcVolumeType	BuyTradeVolume	当日买成交量
TXeleFtdcVolumeType	SellTradeVolume	当日卖成交量
TXeleFtdcMoneyType	PositionCost	持仓成本
TXeleFtdcMoneyType	YdPositionCost	昨日持仓成本
TXeleFtdcMoneyType	UseMargin	占用的保证金
TXeleFtdcMoneyType	FrozenMargin	冻结的保证金
TXeleFtdcMoneyType	LongFrozenMargin	多头冻结的保证金
TXeleFtdcMoneyType	ShortFrozenMargin	空头冻结的保证金
TXeleFtdcMoneyType	FrozenPremium	冻结的权利金
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码

7.23 CXeleFtdcRspInstrumentField 合约查询应答

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcSettlementGroupIDType	SettlementGroupID	结算组代码
TXeleFtdcProductIDType	ProductID	产品代码
TXeleFtdcProductGroupIDType	ProductGroupID	产品组代码
TXeleFtdcInstrumentIDType	UnderlyingInstrID	基础商品代码
TXeleFtdcProductClassType	ProductClass	产品类型
TXeleFtdcPositionTypeType	PositionType	持仓类型
TXeleFtdcPriceType	StrikePrice	执行价
TXeleFtdcOptionsTypeType	OptionsType	期权类型
TXeleFtdcVolumeMultipleType	VolumeMultiple	合约数量乘数
TXeleFtdcUnderlyingMultipleType	UnderlyingMultiple	合约基础商品乘数
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcInstrumentNameType	InstrumentName	合约名称

TXeleFtdcYearType	DeliveryYear	交割年份
TXeleFtdcMonthType	DeliveryMonth	交割月
TXeleFtdcAdvanceMonthType	AdvanceMonth	提前月份
TXeleFtdcBoolType	IsTrading	当前是否交易
TXeleFtdcDateType	CreateDate	创建日
TXeleFtdcDateType	OpenDate	上市日
TXeleFtdcDateType	ExpireDate	到期日
TXeleFtdcDateType	StartDelivDate	开始交割日
TXeleFtdcDateType	EndDelivDate	最后交割日
TXeleFtdcPriceType	BasisPrice	挂牌基准价
TXeleFtdcVolumeType	MaxMarketOrderVolume	市价单最大下单量
TXeleFtdcVolumeType	MinMarketOrderVolume	市价单最小下单量
TXeleFtdcVolumeType	MaxLimitOrderVolume	限价单最大下单量
TXeleFtdcVolumeType	MinLimitOrderVolume	限价单最小下单量
TXeleFtdcPriceType	PriceTick	最小变动价位
TXeleFtdcMonthCountType	AllowDelivPersonOpen	交割月自然人开仓

7.24 CXeleFtdcQryInstrumentMarginRateField 合约保证金率

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码
TXeleFtdcHedgeFlagType	HedgeFlag	投机套保标志

7.25 CXeleFtdcQryInstrumentCommissionRateField 合约手续费率

字段类型	名称	说明
TXeleFtdcInstrumentIDType	InstrumentID	合约代码
TXeleFtdcClientIDType	ClientID	客户代码

8 字段类型

8.1 TXeleFtdcSequenceNoType 序列号类型

类型: int

8.2 TXeleFtdcSequenceSeriesType 序列系列号类型

类型: short

8.3 TXeleFtdcSettlementGroupIDType 结算组代码类型

类型: 字符数组

8.4 TXeleFtdcInstrumentIDType 合约代码类型

类型: 字符数组

8.5 TXeleFtdcInstrumentStatusType 合约交易状态类型

类型：字符型枚举

合约状态类型	说明	枚举值(可显示字符)
XELE_FTDC_IS_BeforeTrading	开盘前	'0'
XELE_FTDC_IS_NoTrading	非交易	'1'
XELE_FTDC_IS_Continuous	连续交易	'2'
XELE_FTDC_IS_AuctionOrdering	集合竞价报单	'3'
XELE_FTDC_IS_AuctionBalance	集合竞价价格平衡	'4'
XELE_FTDC_IS_AuctionMatch	集合竞价撮合	'5'
XELE_FTDC_IS_Closed	收盘	'6'

8.6 TXeleFtdcTradingSegmentSNTYPE 交易阶段编号类型

类型：int

8.7 TXeleFtdcTimeType 时间类型

类型：字符数组

8.8 TXeleFtdcInstStatusEnterReasonType 品种进入交易状态原因类型（未使用）

类型：字符型枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_IER_Automatic	自动切换	'1'
XELE_FTDC_IER_Manual	手动切换	'2'
XELE_FTDC_IER_Fuse	熔断	'3'
XELE_FTDC_IER_FuseManual	熔断手动	'4'

8.9 TXeleFtdcDateType 日期类型

类型：字符数组

8.10 TXeleFtdcSettlementIDType 结算编号类型

类型：int

8.11 TXeleFtdcParticipantIDType 会员代码类型

类型：字符数组

8.12 TXeleFtdcClientIDType 客户代码类型

类型：字符数组

8.13 TXeleFtdcVolumeType 数量类型

类型：int

8.14 TXeleFtdcMoneyType 资金类型

类型: double

8.15 TXeleFtdcBulletinIDType 公告编号类型

类型: int

8.16 TXeleFtdcNewsTypeType 公告类型类型

类型: 字符数组

8.17 TXeleFtdcNewsUrgencyType 紧急程度类型

类型: 字符

8.18 TXeleFtdcAbstractType 消息摘要类型

类型: 字符数组

8.19 TXeleFtdcComeFromType 消息来源类型

类型: 字符数组

8.20 TXeleFtdcOrderSysIDType 报单编号类型

类型: 字符数组

8.21 TXeleFtdcUserIDType 交易用户代码类型

类型: 字符数组

8.22 TXeleFtdcOrderPriceTypeType 报单价格条件类型

类型: 字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_OPT_AnyPrice	任意价	'1'
XELE_FTDC_OPT_LimitPrice	限价	'2'
XELE_FTDC_OPT_BestPrice	最优价	'3'
XELE_FTDC_OPT_FiveLevelPrice	5 档价	'4'

8.23 TXeleFtdcTradeIDType 成交编号类型

类型: 字符数组

8.24 TXeleFtdcProductIDType 产品代码类型

类型: 字符数组

8.25 TXeleFtdcProductGroupIDType 产品组代码类型

类型: 字符数组

8.26 TXeleFtdcProductInfoType 产品信息类型

类型: 字符数组

8.27 TXeleFtdcDataCenterIDType 数据中心代码类型

类型: int

8.28 TXeleFtdcPriceType 价格类型

类型: double

8.29 TXeleFtdcBoolType 布尔型类型

类型: int

8.30 TXeleFtdcOrderLocalIDType 本地报单编号类型

类型: 字符数组

8.31 TXeleFtdcContentType 消息正文类型

类型: 字符数组

8.32 TXeleFtdcBusinessUnitType 业务单元类型

类型: 字符数组

8.33 TXeleFtdcMonthCountType 月份数量类型

类型: int

8.34 TXeleFtdcPositionTypeType 持仓类型类型

类型: 字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_PT_Net	净持仓	'1'
XELE_FTDC_PT_Gross	综合持仓	'2'

8.35 TXeleFtdcClientTypeType 客户类型类型

类型: 字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_CT_Person	自然人	'0'
XELE_FTDC_CT_Company	法人	'1'
XELE_FTDC_CT_Fund	投资基金	'2'

8.36 TXeleFtdcYearType 年份类型

类型: int

8.37 TXeleFtdcMonthType 月份类型

类型: int

8.38 TXeleFtdcAdvanceMonthType 提前月份类型

类型: 字符数组

8.39 TXeleFtdcHedgeFlagType 投机套保标志类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_HF_Speculation	投机	'1'
XELE_FTDC_HF_Arbitrage	套利	'2'
XELE_FTDC_HF_Hedge	套保	'3'

8.40 TXeleFtdcPosiDirectionType 持仓多空方向类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_PD_Net	净	'1'
XELE_FTDC_PD_Long	多头	'2'
XELE_FTDC_PD_Short	空头	'3'

8.41 TXeleFtdcProductClassType 产品类型类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_PC_Futures	期货	'1'
XELE_FTDC_PC_Options	期权	'2'
XELE_FTDC_PC_Combination	组合	'3'
XELE_FTDC_PC_Spot	即期	'4'
XELE_FTDC_PC_EFP	期转现	'5'

8.42 TXeleFtdcURLLinkType WEB 地址类型

类型：字符数组

8.43 TXeleFtdcMarketIDType 市场代码类型

类型：字符数组

8.44 TXeleFtdcOrderSourceType 报单来源类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_OSRC_Participant	来自参与者	'0'
XELE_FTDC_OSRC_Administrator	来自管理员	'1'

8.45 TXeleFtdcOrderStatusType 报单状态类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_OST_AllTraded	全部成交	'0'
XELE_FTDC_OST_PartTradedQueueing	部分成交还在队列中	'1'
XELE_FTDC_OST_PartTradedNotQueueing	部分成交不在队列中	'2'
XELE_FTDC_OST_NoTradeQueueing	未成交还在队列中	'3'

XELE_FTDC_OST_NoTradeNotQueueing	未成交不在队列中	'4'
XELE_FTDC_OST_Canceled	撤单	'5'

8.46 TXeleFtdcOrderTypeType 报单类型类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_ORDT_Normal	正常	'0'
XELE_FTDC_ORDT_DeriveFromQuote	报价衍生	'1'
XELE_FTDC_ORDT_DeriveFromCombination	组合衍生	'2'

8.47 TXeleFtdcPriorityType 优先权类型

类型：int

8.48 TXeleFtdcTimeSortIDType 按时间排队的序号类型

类型：int

8.49 TXeleFtdcDirectionType 买卖方向类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_D_Buy	买	'0'
XELE_FTDC_D_Sell	卖	'1'

8.50 TXeleFtdcCombOffsetFlagType 组合开平标志类型

类型：字符数组

8.51 TXeleFtdcCombHedgeFlagType 组合投机套保标志类型

类型：字符数组

参照：[TXeleFtdcHedgeFlagType](#) 投机套保标志类型

8.52 TXeleFtdcTimeConditionType 有效期类型类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_TC_IOC	立即完成，否则撤销	'1'
XELE_FTDC_TC_GFS	本节有效	'2'
XELE_FTDC_TC_GFD	当日有效	'3'
XELE_FTDC_TC_GTD	指定日期前有效	'4'
XELE_FTDC_TC_GTC	撤销前有效	'5'
XELE_FTDC_TC_GFA	集合竞价有效	'6'

8.53 TXeleFtdcVolumeConditionType 成交量类型类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_VC_AV	'1'	任何数量
XELE_FTDC_VC_MV	'2'	最小数量
XELE_FTDC_VC_CV	'3'	全部数量

8.54 TXeleFtdcContingentConditionType 触发条件类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_CC_Immediately	立即	'1'
XELE_FTDC_CC_Touch	止损	'2'

8.55 TXeleFtdcForceCloseReasonType 强平原因类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_FCC_NotForceClose	非强平	'0'
XELE_FTDC_FCC_LackDeposit	资金不足	'1'
XELE_FTDC_FCC_ClientOverPositionLimit	客户超仓	'2'
XELE_FTDC_FCC_MemberOverPositionLimit	会员超仓	'3'
XELE_FTDC_FCC_NotMultiple	持仓非整数倍	'4'
XELE_FTDC_FCC_Violation	违规	'5'
XELE_FTDC_FCC_Other	其它	'6'
XELE_FTDC_FCC_PersonDeliv	自然人临近交割	'7'

8.56 TXeleFtdcOptionsType 期权类型类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_OT_NotOptions	非期权	'0'
XELE_FTDC_OT_CallOptions	看涨	'1'
XELE_FTDC_OT_PutOptions	看跌	'2'

8.57 TXeleFtdcVolumeMultipleType 合约数量乘数类型

类型：int

8.58 TXeleFtdcUnderlyingMultipleType 合约基础商品乘数类型

类型：double

8.59 TXeleFtdcInstrumentNameType 合约名称类型

类型：字符数组

8.60 TXeleFtdcActionFlagType 操作标志类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_AF_Delete	删除	'0'
XELE_FTDC_AF_Suspend	挂起	'1'
XELE_FTDC_AF_Active	激活	'2'
XELE_FTDC_AF_Modify	修改	'3'

8.61 TXeleFtdcErrorIDType 错误代码类型

类型: int

参见: [附录 A 错误代码表](#)

8.62 TXeleFtdcErrorMsgType 错误信息类型

类型: 字符数组

参见: [附录 A 错误代码表](#)

8.63 TXeleFtdcTradingSystemNameType 交易系统名称类型

类型: 字符数组

8.64 TXeleFtdcAccountIDType 资金帐号类型

类型: 字符数组

8.65 TXeleFtdcPartyNameType 参与人名称类型

类型: 字符数组

8.66 TXeleFtdcIdCardTypeType 证件类型类型

类型: 字符数组

8.67 TXeleFtdcIdentifiedCardNoV1Type 原证件号码类型

类型: 字符数组

8.68 TXeleFtdcTradingRoleType 交易角色类型

类型: 字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_ER_Broker	代理	'1'
XELE_FTDC_ER_Host	自营	'2'
XELE_FTDC_ER_MarketMaker	做市商	'3'

8.69 TXeleFtdcIdentifiedCardNoType 证件号码类型

类型: 字符数组

8.70 TXeleFtdcPasswordType 密码类型

类型: 字符数组

8.71 TXeleFtdcOffsetFlagType 开平标志类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_OF_Open	开仓	'0'
XELE_FTDC_OF_Close	平仓	'1'

8.72 TXeleFtdcTradeTypeType 成交类型类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_TRDT_Common	普通成交	'0'
XELE_FTDC_TRDT_OptionsExecution	期权执行	'1'
XELE_FTDC_TRDT_OTC	OTC 成交	'2'
XELE_FTDC_TRDT_EFPDerived	期转现衍生成交	'3'
XELE_FTDC_TRDT_CombinationDerived	组合衍生成交	'4'

8.73 TXeleFtdcPriceSourceType

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_PSRC_LastPrice	前成交价	'0'
XELE_FTDC_PSRC_Buy	买委托价	'1'
XELE_FTDC_PSRC_Sell	卖委托价	'2'

8.74 TXeleFtdcProtocolInfoType

类型：字符数组

8.75 TXeleFtdcClientTypeType 客户类型

类型：字符枚举

枚举类型	说明	枚举值
XELE_FTDC_CT_Person	代理	'1'
XELE_FTDC_CT_Company	自营	'2'
XELE_FTDC_CT_Fund	做市商	'3'

9 附录 A 错误代码表

错误代码 ErrorID	错误提示 ErrorMsg	补充说明
0		操作成功
1	会话不正确	
2	合约找不到	
3	会员找不到	
4	客户找不到	

6	报单字段错误	报单中有字段值不合法（枚举值越界）或发现非强平单中设置了强平原因
8	报单操作字段错误	报单操作中有字段值不合法（枚举值越界）
12	重复的报单	
15	客户没有在该会员开户	报单中的客户并没有在指定的会员中开户
16	IOC 需在连续交易阶段	在非连续交易阶段企图报入 IOC 单
17	GFA 需在集合竞价阶段	在非集合竞价阶段企图报入 GFA 的报单
18	市价单不能排队	市价单的时间条件不是 IOC
19	数量约束应在 IOC 单上	数量约束不是任意数量的报单的时间条件不是 IOC
20	GTD 报单过期了	GTD 报单中的 GTD 日期已经过期了
21	最小数量大于报单数量	有最小数量条件的报单的最小数量大于报单数量
22	交易所数据没有同步	交易系统尚未初始化完毕，可以稍后再重试
23	结算组数据没有同步	交易系统尚未初始化完毕，可以稍后再重试
24	报单找不到	找不到要操作的报单
26	当前状态禁止此项操作	<ol style="list-style-type: none"> 1. 插入报单时，发现合约交易状态不是连续交易、集合竞价报单或者集合竞价平衡 2. 在报单操作时，对于激活操作，发现合约交易状态不是连续交易、集合竞价报单或者集合竞价平衡 3. 对于其他操作对于非管理用户，发现合约交易状态不是连续交易或者集合竞价报单 4. 对于管理用户对于撤单或者挂起操作，发现合约交易状态是已收盘 5. 对于其他操作，发现合约交易状态不是连续交易或者集合竞价报单
28	报单已经全部成交	
29	报单已经撤销	
31	平仓时客户持仓不足	报入平仓报单时，客户的持仓不足
32	超出客户限仓	报入开仓报单时，超过了客户的投机限仓
34	超出会员限仓	报入开仓报单时，超过了会员限仓
35	找不到帐号	找不到报单使用的资金帐号
36	资金不足	资金帐号中没有足够的资金
37	不合法的数量	报单数量不是最小报单数量要求的正整数倍， 或者超过最大报单数量
45	结算组初始化状态不对	在用户登录时，发现没有任何一个结算组数据已经完成过同步

48	价格非最小单位的倍数	报单的价格不是合约的最小变动单位的整数倍
49	价格超出涨停板	报单的价格高于合约的涨停板
50	价格跌破跌停板	报单的价格低于合约的跌停板
51	没有交易权限	对指定合约、或者客户对指定的合约、或者交易员没有的交易权限
52	只能平仓	会员对指定合约、或者客户对指定的合约、或者交易员只有平仓的权限
53	没有此项交易角色	会员在指定合约上不具有该客户对应的交易角色
57	不能为其他会员操作	交易员给非其所属的会员进行操作
58	用户不匹配	报单中的交易员和登录时的交易员不匹配
59	用户重复登录	在用户登录时，发现此用户已经登录过了
60	用户名或口令错误	在用户登录或者修改口令时，发现用户名找不到或者口令错误
62	用户不活跃	在用户登录时，发现该用户不活跃
66	用户尚未登录	
76	报单已经被挂起	
77	报单已经被激活	
78	GTD 报单没有设定日期	
79	不被支持的报单类型	
80	用户无此权限	只能查询本会员下的情况
83	止损单仅用于连续交易	在非连续交易阶段报入止损单
84	止损单需是 IOC 或 GFD	止损单时的时间条件既不是 IOC，也不是 GFD
95	止损报单需说明止损价	
96	保值额度不足	报入保值报单时，客户的套期保值额度不足
97	重复的操作	报单操作的本地操作号重复
99	不能为其他用户操作	非授权交易员操作同会员的其他交易员报入的报单
103	当日套保仓位不能平仓	套保仓位不应使用平今仓报单进行平仓
104--113	预留	
114	最优价单不能排队	最优价单的时间条件不是 IOC
115--1119	预留	
1120	该合约限制买入	
1121	该合约限制卖出	
1122	该合约限制卖空	
1123	不支持	
1124	不允许跨市扫货单	
1125	不允许市价单	
1126	价格超出范围	
1127	单笔手数超出平均日交易数量	

1128	报价最小值错误	
1129	单笔交易额过小	
1130	单笔交易额过大	
1131	单笔手数过小	
1132	单笔手数过大	
1133	当日用户报单 ID 重复	
1134	没找到合约	
1135	不合法有效期类型	
1136	XeleTrade 停止交易	
1137	当日累计交易额过大	
1138	没有贷款经纪人标识	
1139	报单速率过快	
1140	报单表地址冲突	
1141	不合法的报单类型	
1142	不合法的报单方向	
1143	不允许 IPO 交易	
1144	未成交单过多	
1145	业务范围不正确	
1146	不允许有担保单的卖空	
1147	不正确的最小价格变化值	
1148	不正确的最小手数	
1149	报单不匹配或者报单表已满	
1150	缺失字段	
1151	Xele-Trade 超时	
1152	改单时不允许增加， 只能减少	
1153	字段错误	
1154	该机构不允许买入	
1155	该机构不允许卖出	
1156	该机构不允许卖空	
1157	不允许自营买	
1158	不允许自营卖	
1159	不允许自营卖空	
1160	完全不允许买	
1161	完全不允许卖	
1162	不支持	
1163	卖出超出持仓	
1164	当天卖出方向累计超额	
1165	卖出超出持仓	
1166	卖空超出借入	
1167	未答应报单	
1168	XeleTrade 限制交易	
1169	该合约未成交买单超出上限	未成交买单过多，超过风控设定值

1170	该合约未成交卖单超出上限	
1171	改单的合约不匹配	
1172	该报单不存在	
1173	报单查找表搜索超时	
1174	该合约持仓过多	
1175	该合约多头持仓过多	
1176	该合约空头持仓过多	
1177	该合约多头平仓量大于可平仓量，平仓卖的数量大于可平量	
1178	该合约空头平仓量大于可平量	
1179	可用资金量小于该笔报单保证金	
1180	保证金占可用资金百分比过高	
1181	当天改合约撤单次数超限，不允许撤单	
1182	客户报单 ID 与登录 ID 不一致	
1183	报单价格格式错误	
1184	报单价格条件字段不在枚举范围之内	
1185	报单买卖方向条件字段不在枚举范围之内	
1186	报单开平字段不在枚举范围之内	
1187	报单投机套保标志字段不在枚举范围之内	
1188	报单有效期类型字段不在枚举范围之内	
1189	报单操作标志字段不在枚举范围之内	
1190	交易所端在途订单过多，限制报单	
1191	xele_trade 系统高负载，报单过多，限制报单	
1192	xele_trade 系统高负载，持仓过多，限制报单	
1193	报单投机套保标志与客户交易类型不一致	
1194	交易所端流控达到上限	
1195	交易所端流控达到上限	
1196	交易所端流控达到上限	

1197	xele-monitor 强平单不能被用户通过 API 撤掉	
1198	这个报单已经被撤掉了	
1199--2000	预留	
2001	此功能暂时不支持	主题查询请求
2002	预留	
2003	预留	
2004	VENUE 未连接	
2005--2008	预留	
2009	没有对应信息	持仓，保证金率，资金，报单，成交单查询没有对应的信息记录
2010	错误的客户号	持仓，保证金率，手续费，资金，手续费率查询时客户号填写错误
2011	当前此查询不可用	暂时没有使用（事前定义，API 暂时遇不见该报错）
2012	用户名或口令错误	
2013	会员找不到	登录信息中的会员号填写错误
2014	用户已登录	
2015	并没有以此用户登录	用户申请登出时填写的用户号错误
2016	并没有以此会员登录	用户申请登出时填写的会员号错误
2017	用户不匹配	暂时没有使用（事前定义，API 暂时遇不见该报错）
2018	禁止在登陆之后订阅对话流和查询流	暂时没有使用（事前定义，API 暂时遇不见该报错）
2019	系统尚未初始化完成	
2020	此功能请通过 Xele_Monitor 处理	
2021	用户尚未登录	
2022	错误的交易用户代码	查询保单时用户号填写错误
2023	错误的资金账号	查询资金时资金账号填写错误
2024	错误的合约号	查询手续费率时合约号填写错误
2025	错误的交易类型	保证金率查询时交易类型填写错误
2026	不支持的版本	