

**东吴证券快速交易平台接口**

**使用说明书**

(内部资料 请勿外传)

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **编 写：** |  | **日 期：** | 20180423 |
| **检 查：** |  | **日 期：** |  |
| **审 核：** |  | **日 期：** |  |
| **批 准：** |  | **日 期：** |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **信息技术总部** | **文档编号** |  | **版本** | V1.0 | **密级** | 信息B |
| **项目名称** | **东吴证券快速交易平台** | | | | |
| **项目来源** |  | | | | |

**东吴证券股份有限公司**

**版权所有不得复制**

**2018年4月**

文档变更记录

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **变更（+/-）说明** | **作者** | **版本号** | **日期** | **批准** |
| 1 | 文档新建 |  | V1.0 | 2018.4.23 |  |
| 2 | 新增批量委托接口 |  | V1.0.1 | 2018.5.20 |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

目录

[文档变更记录 2](#_Toc22952)

[【I. DTP接口简介】 4](#_Toc14876)

[1. 接口简介 4](#_Toc12709)

[2. 接口功能 4](#_Toc20939)

[【II. DTP接口设计规范】 5](#_Toc10444)

[3. 通信通道 5](#_Toc23138)

[4. 接口数据协议 5](#_Toc19206)

[5. 接口脚手架 6](#_Toc11606)

[【Ⅲ. DTP接口使用样例】 7](#_Toc23646)

[6. 代码样例 7](#_Toc13642)

[6.1、登录 7](#_Toc170)

[6.2、下单 7](#_Toc17296)

[6.3、回报 8](#_Toc21883)

[【Ⅳ. DTP接口详细说明】 9](#_Toc29398)

[7. 常量 9](#_Toc14498)

[8. 数据结构 11](#_Toc2074)

[8.1、请求响应标识 11](#_Toc1994)

[8.2、账户相关接口 12](#_Toc3162)

[8.3、委托相关接口 13](#_Toc18939)

[8.4、回报相关接口 13](#_Toc27799)

[8.5、查询相关接口 16](#_Toc31224)

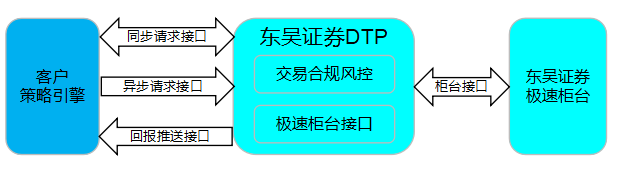
[9. 接口编号 21](#_Toc6951)

[【V-附录】 22](#_Toc8410)

# 【I. DTP接口简介】

# 接口简介

DTP是东吴证券为量化客户提供的集成交易合规风控能力的快速交易平台。DTP接口上下文关系如下所示。



# 接口功能

DTP接口功能按实现方式分为以下三类：

* 同步请求接口：

账号登录 账号登出 委托查询 成交查询 资金查询 持仓查询

* 异步请求接口：

委托申报 撤单申报

* 回报推送接口：

违规回报 委托回报 成交回报 撤单回报

# 【II. DTP接口设计规范】

DTP接口采用ZeroMQ作为通信通道，采用Google Protocol Buffer封装协议数据。

# 通信通道

DTP接口包含4个通道，分别使用ZeroMQ的三种通信模式。

* 同步请求通道，使用ZeroMQ的REQ/REP通信模式
* 异步请求通道，采用ZeroMQ的DEALER/DEALER通信模式
* 风控违规回报通道，采用ZeroMQ的PUB/SUB通信模式
* 柜台状态回报通道，采用ZeroMQ的PUB/SUB通信模式

# 接口数据协议

DTP接口采用Google Protocol Buffer封装协议数据。

* 同步请求通道，每个接口的请求或响应都由header+body俩帧数据(详细定义请参考[接口详细说明](#_【Ⅳ-DTP接口详细说明】))组成：

账号登录

请求：RequestHeader + LoginAccountRequest

响应：ResponseHeader + LoginAccountResponse

账号登出

请求：RequestHeader + LogoutAccountRequest

响应：ResponseHeader + LogoutAccountResponse

委托查询

请求：RequestHeader + QueryOrdersRequest

响应：ResponseHeader + QueryOrdersResponse

成交查询

请求：RequestHeader + QueryFillsRequest

响应：ResponseHeader + QueryFillsResponse

资金查询

请求：RequestHeader + QueryCapitalRequest

响应：ResponseHeader + QueryCapitalResponse

持仓查询

请求：RequestHeader + QueryPositionRequest

响应：ResponseHeader + QueryPositionResponse

* 异步请求通道，每个接口的请求都由header+body俩帧数据(详细定义请参考[接口详细说明](#_【Ⅳ-DTP接口详细说明】))组成，每个请求的结果由相应的回报推送完成：

委托申报：RequestHeader + PlaceOrder

撤单申报：RequestHeader + CancelOrder

* 风控违规回报通道，每个接口的请求都由topic+header+body三帧数据(详细定义请参考[接口详细说明](#_【Ⅳ-DTP接口详细说明】))组成，topic用于区分不同的资金账号的订阅：

违规回报 topic + ReportHeader + PlacedReport

* 柜台状态回报通道，每个接口的请求都由topic+header+body三帧数据(详细定义请参考[接口详细说明](#_【Ⅳ-DTP接口详细说明】))组成，topic用于区分不同的资金账号的订阅：

委托回报 topic + ReportHeader + PlacedReport

成交回报 topic + ReportHeader + FillReport

撤单回报 topic + ReportHeader + CancellationReport

# 接口脚手架

为了方便客户使用，DTP接口脚手架封装了以上的通信信道和数据协议。客户可以基于脚手架开发，也可自行实现符合接口规范的代码直接接入DTP。

# 【Ⅲ. DTP接口使用样例】

本文档样例使用python版脚手架展开说明。

# 代码样例

## 6.1、登录

**# 登录样例代码Samply.py:**

**...**

**import dtp.type\_pb2 as dtp\_type**

**import dtp.api\_pb2 as dtp\_struct**

**import dtp.skeleton as dtp**

**...**

**# 连接同步请求通道**

**dtp\_sync\_channel = dtp.DtpSyncChannel()**

**dtp\_sync\_channel.connect()**

**# 初始化请求数据**

**header = dtp\_struct.RequestHeader()**

**header.request\_id = my\_data.generate\_request\_id()**

**body = dtp\_struct.LoginAccountRequest()**

**body.account\_no = "100900501"**

**body.password = "xxxx&xxxx"**

**payload = dtp.Payload(header, body)**

**# 调用接口获取返回数据**

**response\_payload = dtp\_sync\_channel.login\_account(payload)**

**# 检查返回值**

**print("ResponseHeader:")**

**print(response\_payload.header)**

**print("ResponseHeader:")**

**print(response\_payload.body)**

**# 关闭同步请求通道**

**dtp\_sync\_channel.disconnect()**

**...**

请参考test\_login\_account.py中对异常情况的处理。

## 6.2、下单

**# 下单样例代码test\_order\_report.py:**

**...**

**# 连接异步请求通道**

**dtp\_async\_channel = dtp.DtpAsyncChannel()**

**dtp\_async\_channel.connect()**

**# 初始化请求数据**

**header = dtp\_struct.RequestHeader()**

**header.request\_id = my\_data.generate\_request\_id()**

**header.token = my\_data.token\_unknown**

**body = dtp\_struct.PlaceOrder()**

**\_init\_order\_body(body, my\_data.normal\_order\_01)**

**order\_payload = dtp.Payload(header, body)**

**# 调用下单接口，直接返回；需要通过回报通道获取结果**

**dtp\_async\_channel.place\_order(order\_payload)**

**...**

## 

## 6.3、回报

**# 回报样例代码test\_order\_report.py:**

**...**

**# 连接回报通道**

**dtp\_subscribe\_channel = dtp.DtpSubscribeChannel()**

**dtp\_subscribe\_channel.connect()**

**...**

**# 注册违规回报通道回调函数**

**dtp\_subscribe\_channel.register\_compliance\_callback(**

**compiance\_failed\_callback)**

**# 注册柜台回报通道回调函数**

**dtp\_subscribe\_channel.register\_counter\_callback(**

**place\_report\_callback, fill\_report\_callback, cancel\_report\_callback)**

**...**

**# 启动回报订阅，设定订阅主题(资金账号)**

**dtp\_subscribe\_channel.start\_subscribe\_report(topic=body.account\_no)**

**...**

**# 回调函数: 违规回报**

**def compiance\_failed\_callback(response\_payload):**

**...**

**# 回调函数: 委托回报**

**def place\_report\_callback(response\_payload):**

**...**

**# 回调函数: 成交回报**

**def fill\_report\_callback(response\_payload):**

**...**

**# 回调函数: 撤单回报**

**def cancel\_report\_callback(response\_payload):**

**...**

# 【Ⅳ. DTP接口详细说明】

# 常量

* /\* API响应状态码 \*/

**enum ResponseStatusCode**

**{**

**RESPONSE\_STATUS\_CODE\_UNDEFINED = 0;**

**// 200:成功(服务器成功处理请求);**

**RESPONSE\_CODE\_OK = 200;**

**// 400:请求错误(请求参数有误,参考message)**

**RESPONSE\_CODE\_BAD\_REQUEST = 400;**

**// 401:未授权(需要登录)**

**RESPONSE\_CODE\_UNAUTHORIZED = 401;**

**// 403:拒绝(违规, 柜台拒绝)**

**RESPONSE\_CODE\_FORBIDDEN = 403;**

**// 500:服务器内部错误**

**RESPONSE\_CODE\_INTERNAL\_ERROR = 500;**

**}**

* /\* 交易所 \*/

**enum Exchange**

**{**

**EXCHANGE\_UNDEFINED = 0;**

**// 沪A**

**EXCHANGE\_SH\_A = 1;**

**// 深A**

**EXCHANGE\_SZ\_A = 2;**

**}**

* /\* 委托竞价类型 \*/

**enum OrderType**

**{**

**ORDER\_TYPE\_UNDEFINED = 0;**

**// 限价**

**ORDER\_TYPE\_LIMIT = 1;**

**}**

* /\* 委托竞价方向(买卖类型) \*/

**enum OrderSide**

**{**

**ORDER\_SIDE\_UNDEFINED = 0;**

**ORDER\_SIDE\_BUY = 1;**

**// 买入**

**ORDER\_SIDE\_SELL = 2;**

**// 卖出**

**ORDER\_SIDE\_CREATION = 11;**

**// ETF申购**

**ORDER\_SIDE\_REDEMPTON = 12;**

**// ETF赎回**

**ORDER\_SIDE\_REVERSE\_REPO = 21;**

**// 质押式逆回购(国债逆回购)**

**}**

* /\* 委托状态 \*/

**enum OrderStatus**

**{**

**// 该状态只体现交易所委托状态**

**// 柜台直接拒单时，不使用该状态，通过ReportHeader的code和message**

**ORDER\_STATUS\_UNDEFINED = 0;**

**// 正报: 交易所处理中(order\_exchange\_id已产生)**

**ORDER\_STATUS\_PLACING = 1;**

**// 已报: 交易所已挂单**

**ORDER\_STATUS\_PLACED = 2;**

**// 部分成交**

**ORDER\_STATUS\_PARTIAL\_FILLED = 3;**

**// 全部成交**

**ORDER\_STATUS\_FILLED = 4;**

**// 待撤**

**ORDER\_STATUS\_CANCELLING = 5;**

**// 已撤**

**ORDER\_STATUS\_CANCELLED = 6;**

**// 部分成交其余待撤**

**ORDER\_STATUS\_PARTIAL\_CANCELLING = 7;**

**// 部分成交其余已撤**

**ORDER\_STATUS\_PARTIAL\_CANCELLED = 8;**

**// 废单**

**ORDER\_STATUS\_FAILED = 9;**

**}**

* /\* 成交状态 \*/

**enum FillStatus**

**{**

**FILL\_STATUS\_UNDEFINED = 0;**

**// 成交**

**FILL\_STATUS\_FILLED = 1;**

**// 撤单成功**

**FILL\_STATUS\_CANCELLED = 2;**

**// 废单**

**FILL\_STATUS\_FAILED = 3;**

**}**

* /\* 委托查询限制 \*/

**enum QueryOrderCriteria**

**{**

**// 只查询委托（不包含撤单委托）**

**QUERY\_ONLY\_ORDER = 0;**

**// 只查可撤**

**QUERY\_ORDER\_CAN\_BE\_CANCELLED = 1;**

**// 只查询撤单委托**

**QUERY\_ONLY\_CANCEL\_ORDER = 2;**

**// 查询全部类型**

**QUERY\_ORDER\_ALL = 3;**

**}**

# 数据结构

## 8.1、请求响应标识

* /\* API Request Header \*/

**message RequestHeader**

**{**

**uint32 api\_id = 1;**

**// API编号**

**string request\_id = 2;**

**// 请求唯一标识UUID**

**string token = 3;**

**// 所有接口请求都需带上该标识,除了LoginRequest.**

**}**

* /\* API Response Header \*/

**message ResponseHeader**

**{**

**uint32 api\_id = 1;**

**string request\_id = 2;**

**// 带回相应Request的request\_id**

**ResponseStatusCode code = 3;**

**string message = 4;**

**}**

* /\* API Report Header \*/

**message ReportHeader**

**{**

**uint32 api\_id = 1;**

**ResponseStatusCode code = 2;**

**string message = 3;**

**// 例: 违规**

**// ResponseHeader.ResponseStatusCode = RESPONSE\_CODE\_FORBIDDEN**

**// ResponseHeader.message = 违规信息**

**// 例: 柜台拒绝**

**// ResponseHeader.ResponseStatusCode = RESPONSE\_CODE\_FORBIDDEN**

**// ResponseHeader.message = 无法连接柜台/碎股/验资验券**

**}**

## 8.2、账户相关接口

* /\* 登录: 获取token \*/

**message LoginAccountRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10001001，token不用填**

**string account\_no = 1;**

**// 资金账号**

**string password = 2;**

**}**

**// 调用时payload = RequestHeader + LoginAccountRequest**

**message LoginAccountResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11001001**

**string token = 1;**

**}**

**// 调用时 payload = ResponseHeader + LoginAccountResponse**

* /\* 退出: token失效 \*/

**message LogoutAccountRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10001002**

**string account\_no = 1;**

**// 资金账号**

**}**

**// 调用时 payload = RequestHeader + LogoutAccountRequest**

**message LogoutAccountResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11001002**

**}**

**// 调用时 payload = ResponseHeader + LogoutAccountResponse**

## 8.3、委托相关接口

* /\* 提交单笔委托 \*/

**message PlaceOrder**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10002001**

**string account\_no = 1;**

**// 资金账号**

**string order\_original\_id = 2;**

**// 客户委托号**

**Exchange exchange = 3;**

**// 交易所**

**string code = 4;**

**// 证券代码**

**string price = 5;**

**// 价格留3位小数**

**uint32 quantity = 6;**

**// 委托数量**

**OrderSide order\_side = 7;**

**// 委托方向**

**OrderType order\_type = 8;**

**// 委托竞价类型**

**}**

**// 调用时 payload = RequestHeader + PlaceOrder**

**// PlaceOrder的响应使用PlacedReport**

* /\* 提交单笔撤单委托 \*/

**message CancelOrder**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10002002**

**string account\_no = 1;**

**Exchange exchange = 2;**

**string order\_exchange\_id = 3;**

**// 要撤的委托：交易所委托号**

**}**

**// 调用时 payload = RequestHeader + CancelOrder**

**// CancelOrder的响应使用CancellationReport**

* /\* 提交批量委托操作 \*/

**message PlaceBatchOrder**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10002003**

**string account\_no = 1;**

**// 资金账号**

**uint32 order\_counte = 2;**

**// 委托笔数**

**repeated BatchOrderItem order\_list = 3;**

**message BatchOrderItem**

**{**

**Exchange exchange = 1;**

**// 交易所**

**string code = 2;**

**// 证券代码**

**OrderSide order\_side = 3;**

**// 委托方向，只支持买卖**

**string price = 4;**

**// 价格留3位小数**

**uint32 quantity = 5;**

**// 委托数量**

**OrderType order\_type = 6;**

**// 委托竞价类型**

**string order\_original\_id = 7;**

**// 客户委托号**

**}**

**}**

## 8.4、回报相关接口

* /\* 消息: 委托确认回报 \*/

**message PlacedReport**

**{**

**// MUST: ReportHeader.api\_id = 20001001**

**string order\_exchange\_id = 1;**

**// 交易所委托号**

**string placed\_time = 2;**

**// 交易所委托确认时间, HH:MM:SS格式**

**string freeze\_amount = 3;**

**// 冻结金额(负数表示解冻)**

**OrderStatus status = 4;**

**// 委托状态: 申报结果**

**string order\_original\_id = 5;**

**// 客户委托号**

**string account\_no = 6;**

**// 资金账号**

**Exchange exchange = 7;**

**// 交易所**

**string code = 8;**

**// 证券代码**

**uint32 quantity = 9;**

**// 委托数量**

**OrderSide order\_side = 10;**

**// 委托竞价方向**

**string price = 11;**

**// 价格留3位小数**

**}**

**// 调用时payload = ReportHeader + PlacedReport**

* /\* 消息: 委托成交回报 \*/

**message FillReport**

**{**

**// MUST: ReportHeader.api\_id = 20001002**

**string fill\_exchange\_id = 1;**

**// 交易所成交编号**

**string fill\_time = 2;**

**// 交易所委托确认时间, HH:MM:SS格式**

**FillStatus fill\_status = 3;**

**// 成交状态 0:未知 1:成交**

**string fill\_price = 4;**

**// 本次成交价格**

**uint32 fill\_quantity = 5;**

**// 本次成交数量; fill\_status为撤单时，此数值为撤单数量**

**string fill\_amount = 6;**

**// 本次成交金额**

**string clear\_amount = 7;**

**// 本次清算资金(委托为卖出方向时表示本次成交新增的可用资金)**

**uint32 total\_fill\_quantity = 8;**

**// 该委托总成交数量(本笔成交处理后)**

**string total\_fill\_amount = 9;**

**// 该委托总成交金额(本笔成交处理后)**

**uint32 total\_cancelled\_quantity = 10;**

**// 该委托已撤单数量? 怀疑撤单成功会有该回报?**

**string order\_exchange\_id = 11;**

**// 交易所委托号**

**string order\_original\_id = 12;**

**// 客户委托号**

**string account\_no = 13;**

**// 资金账号**

**Exchange exchange = 14;**

**string code = 15;**

**string price = 16;**

**// 价格留3位小数**

**uint32 quantity = 17;**

**// 委托数量**

**OrderSide order\_side = 18;**

**// 委托竞价方向**

**}**

**// 调用时payload = ReportHeader + FillReport**

* /\* 消息: 委托撤单确认回报 \*/

**message CancellationReport**

**{**

**// MUST: ReportHeader.api\_id = 20001003**

**string order\_exchange\_id = 1;**

**// 要撤的委托：交易所委托号**

**string order\_original\_id = 2;**

**// 要撤的委托：客户委托号**

**string account\_no = 3;**

**// 资金账号**

**Exchange exchange = 4;**

**string code = 5;**

**uint32 quantity = 6;**

**// 委托数量**

**OrderSide order\_side = 7;**

**// 委托竞价方向**

**OrderStatus status = 8;**

**// 委托状态**

**uint32 total\_fill\_quantity = 9;**

**// 该委托已成交数量**

**uint32 cancelled\_quantity = 10;**

**// 撤单数量(实际撤单数量)**

**string freeze\_amount = 11;**

**// 冻结金额(负数表示解冻)**

**}**

**// 调用时payload = ReportHeader + CancellationReport**

## 8.5、查询相关接口

* /\* 查询委托详情 \*/

**message QueryOrdersRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10003001**

**string account\_no = 1;**

**string order\_exchange\_id = 2;**

**// 空则查询全部**

**QueryOrderCriteria query\_criteria = 3;**

**// 查询全部委托或只查可撤单委托**

**QueryPagination pagination = 4;**

**// 查询结果分页标识**

**Exchange exchange = 5;**

**string code = 6;**

**string order\_original\_id = 7;**

**// 空则查询全部**

**OrderSide order\_side = 8;**

**}**

**// 调用时payload = RequestHeader + QueryOrdersRequest**

**message QueryOrdersResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11003001**

**repeated Order order\_list = 1;**

**// 委托明细**

**message Order**

**{**

**string order\_exchange\_id = 1;**

**// 交易所委托号**

**string order\_original\_id = 2;**

**// 客户委托号**

**Exchange exchange = 3;**

**string code = 4;**

**string name = 5;**

**string price = 6;**

**// 价格留3位小数**

**uint32 quantity = 7;**

**// 委托数量**

**OrderSide order\_side = 8;**

**// 委托竞价方向**

**OrderType order\_type = 9;**

**// 委托竞价类型**

**OrderStatus status = 10;**

**string order\_time = 11;**

**// 交易所委托时间, HH:MM:SS 格式**

**string account\_no = 12;**

**string average\_fill\_price = 13;**

**// 成交均价**

**uint32 total\_fill\_quantity = 14;**

**// 该委托总成交数量**

**string total\_fill\_amount = 15;**

**// 该委托总成交金额**

**string freeze\_amount = 16;**

**// 冻结金额(负数表示解冻)**

**string clear\_amount = 17;**

**// 清算资金**

**uint32 total\_cancelled\_quantity = 18;**

**// 该委托已撤单数量**

**string status\_message = 19;**

**// 委托状态的文字说明，包括废单原因**

**}**

**}**

**// 调用时payload = ResponseHeader + QueryOrdersResponse**

* /\* 查询成交详情 \*/

**message QueryFillsRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10003002**

**string account\_no = 1;**

**string order\_exchange\_id = 2;**

**// 空则查询全部**

**QueryPagination pagination = 3;**

**// 查询结果分页标识**

**Exchange exchange = 4;**

**string code = 5;**

**string order\_original\_id = 6;**

**// 空则查询全部**

**OrderSide order\_side = 7;**

**bool include\_cancel\_fill = 8;**

**// fasle 不包括撤单成交**

**}**

**// 调用时payload = RequestHeader + QueryFillsRequest**

**message QueryFillsResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11003002**

**repeated Fill fill\_list = 1;**

**// 分笔成交明细**

**message Fill**

**{**

**string fill\_exchange\_id = 1;**

**// 交易所成交编号**

**string fill\_time = 2;**

**// 成交的时间,单位毫秒,不存日期 ;顶点柜台返回的是 HH:MM:SS 格式，**

**// 推断交易所返回的也是这个格式，所以改成字符串格式 yinwb**

**FillStatus fill\_status = 3;**

**// 成交状态 0:未知 1:成交 2:撤单 3: 废单 4:确认**

**string fill\_price = 4;**

**// 本次成交价格**

**uint32 fill\_quantity = 5;**

**// 本次成交数量; fill\_status为撤单时，此数值为撤单数量**

**string fill\_amount = 6;**

**// 本次成交金额**

**string clear\_amount = 7;**

**// 本次清算资金(委托为卖出方向时表示本次成交新增的可用资金)**

**string order\_exchange\_id = 8;**

**// 交易所委托号**

**string order\_original\_id = 9;**

**// 客户委托号**

**Exchange exchange = 10;**

**string code = 11;**

**string name = 12;**

**OrderSide order\_side = 13;**

**// 委托竞价方向**

**}**

**}**

**// 调用时payload = ResponseHeader + QueryFillsResponse**

* /\* 查询资产 \*/

**message QueryCapitalRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10003003**

**string account\_no = 1;**

**}**

**// 调用时payload = RequestHeader + QueryCapitalRequest**

**message QueryCapitalResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11003003**

**string account\_no = 1;**

**string balance = 2;**

**// 账户余额**

**string available = 3;**

**// 可用资金**

**string freeze = 4;**

**// 冻结金额**

**string securities = 5;**

**// 证券市值**

**string total = 6;**

**// 总资产**

**}**

**// 调用时payload = ResponseHeader + QueryCapitalResponse**

* /\* 查询持仓 \*/

**message QueryPositionRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10003004**

**string account\_no = 1;**

**Exchange exchange = 2;**

**string code = 3;**

**// 为空时查询全部**

**QueryPagination pagination = 4;**

**// 查询结果分页标识**

**}**

**// 调用时payload = RequestHeader + QueryPositionRequest**

**message QueryPositionResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11003004**

**repeated PositionDetail position\_list = 1;**

**QueryPagination pagination = 2;**

**message PositionDetail**

**{**

**Exchange exchange = 1;**

**// 交易所**

**string code = 2;**

**// 证券代码**

**string name = 3;**

**// 证券名称**

**int64 balance = 4;**

**// 剩余数量(TBD: 今持仓量)**

**int64 available\_quantity = 5;**

**// 可用数量(可卖出数量)**

**int32 freeze\_quantity = 6;**

**// 冻结数量(可能是真正的冻结数量，例如：司法冻结等)**

**int64 buy\_quantity = 7;**

**// 当日买入数量**

**int64 sell\_quantity = 8;**

**// 当日卖出数量**

**string market\_value = 9;**

**// 最新市值**

**string cost = 10;**

**// 持仓均价**

**}**

**}**

**// 调用时payload = ResponseHeader + QueryPositionResponse**

* /\*查询客户配售权益\*/

**message QueryRationRequest**

**{**

**// MUST: RequestHeader.api\_id = 10005001**

**string account\_no = 1;**

**}**

**message QueryRationResponse**

**{**

**// MUST: ResponseHeader.api\_id = 11005001**

**repeated Ration ration\_list = 1;**

**message Ration**

**{**

**string account\_no = 1;**

**Exchange exchange = 2;**

**uint32 quantity = 3;**

**//权益数量**

**}**

**}**

* /\* 分页游标 \*/

**message QueryPagination**

**{**

**uint32 offset = 1;**

**// 起始位置**

**uint32 size = 2;**

**// 每页数据量**

**}**

# 接口编号

* 同步请求接口

**LOGIN\_ACCOUNT\_REQUEST = 10001001**

**LOGIN\_ACCOUNT\_RESPONSE = 11001001**

**LOGOUT\_ACCOUNT\_REQUEST = 10001002**

**LOGOUT\_ACCOUNT\_RESPONSE = 11001002**

**QUERY\_ORDERS\_REQUEST = 10003001**

**QUERY\_ORDERS\_RESPONSE = 11003001**

**QUERY\_FILLS\_REQUEST = 10003002**

**QUERY\_FILLS\_RESPONSE = 11003002**

**QUERY\_CAPITAL\_REQUEST = 10003003**

**QUERY\_CAPITAL\_RESPONSE = 11003003**

**QUERY\_POSITION\_REQUEST = 10003004**

**QUERY\_POSITION\_RESPONSE = 11003004**

**QUERY\_RATION\_REQUEST = 10005001**

**QUERY\_RATION\_RESPONSE = 11005001**

* 异步请求接口

**PLACE\_ORDER = 10002001**

**CANCEL\_ORDER = 10002002**

**PLACE\_BATCH\_ORDER = 10002003**

* 回报推动接口

**PLACE\_REPORT = 20001001**

**FILL\_REPORT = 20001002**

**CANCEL\_REPORT = 20001003**

# 【V-附录】