# 概述

本模块提供以下功能

* 接收一个或多个下单委托或撤单委托
* 记录订单流水状态更新到本地
* 自动导出资金、持仓到本地

上述功能适用于**股票、信用、期货、期权账户**

本模块可用于指令交换、风控等应用。

**此功能是纯客户端策略，客户端关闭后扫描指令、数据输出都将停止**。

# 大致流程

用户向指令文件**追加**写入委托指令(每个委托一条记录)，程序会定时扫描处理该文件。并在收到后端的订单更新数据时**追加**到”订单流水文件”。

后端推送的资金与持仓会先缓存在本地内存，并定时**覆盖**“资产输出文件”。

# 各表结构与说明

## 指令表

### 概要说明

每行一条指令。

指令分两类：下单委托与撤单委托。用户负责向此表**追加**指令数据。在界面启动后程序会扫描此表，并解析执行未处理指令。

不同指令填写不同字段，非必须时可填默认值(系统不会读此字段)。

### 表结构

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **是否必须** | **备注** |
| inst\_type | char(1) | 指令类型，区分是下单还是撤单委托 | 是 | O:下单委托(大写字母O)  C:撤单委托 |
| client\_id | char(16) | 外部ID | 否  下单时使用 | 下单委托带入，会输出到订单流水表关联的记录里 |
| acct\_type | char(8) | 账户类型 | 是 | 参见数据字典章节 |
| acct | char(16)或char(64) | 交易账户 | 是 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是64位，没有勾选则是16位 |
| order\_no | char(32)或char(128) | 订单编码 | 撤单时必须 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是128位，没有勾选则是32位 |
| symbol | char(32) | 标的代码 | 下单时必须 | 带交易所，如600030.SH，交易所定义参见数据字典章节 |
| tradeside | char(8) | 交易方向 | 下单时必须 | 参见数据字典章节 |
| ord\_qty | int | 委托数量 | 下单时必须 | 股票单位为股 |
| ord\_price | float | 委托价格 | 下单时必须 | 市价单时建议填0 |
| ord\_type | char(8) | 委托类型 | 下单时必须 | 参考数据字典章节 |
| ord\_param | char(254) | 委托参数 | 特定场景使用 | 参见下面注释 |

注：order\_param字段在以下几种情况下使用：

* 期货下单：

|  |  |
| --- | --- |
| 套保标志 | ord\_param |
| 投机 | 1 |
| 套利 | 2 |
| 套保 | 3 |

如需要使用CTP的有效期类型（TimeCondition）和成交量类型（VolumeCondition）报价时，格式如下

|  |  |
| --- | --- |
| 套保标志|TimeCondition|VolumeCondition | ord\_param |
| 投机|TimeCondition|VolumeCondition | 1|TimeCondition|VolumeCondition |
| 套利|TimeCondition|VolumeCondition | 2|TimeCondition|VolumeCondition |
| 套保|TimeCondition|VolumeCondition | 3|TimeCondition|VolumeCondition |

TimeCondition字典：

|  |  |
| --- | --- |
| 数值 | 含义 |
| TC\_IOC | 立即完成，否则撤销 |
| TC\_GFS | 本节有效 |
| TC\_GFD | 当日有效 |
| TC\_GTD | 指定日期前有效 |
| TC\_GTC | 撤销前有效 |
| TC\_GFA | 集合竞价有效 |

VolumeCondition字典：

|  |  |
| --- | --- |
| 数值 | 含义 |
| VC\_AV | 任何数量 |
| VC\_MV | 最小数量 |
| VC\_CV | 全部数量 |

* 港股通下单：

|  |  |
| --- | --- |
| 申报和限价盘标志 | ord\_param |
| 港股订单申报，增强限价盘 | HKN,0 |
| 港股零股申报，增强限价盘 | HKO,0 |
| 港股订单申报，竞价限价盘 | HKN,1 |
| 港股零股申报，竞价限价盘 | HKO,1 |

* 信用账户专项头寸下单

|  |  |
| --- | --- |
| 融资融券账户 | ord\_param |
| 专项头寸融券卖出 | spcashStatus=1 |
| 非专项头寸融券卖出 | spcashStatus=0 |

* 科创板盘后固定价格下单

|  |  |
| --- | --- |
| 盘后固定价格标志 | ord\_param |
| 盘后固定价格申报 | PFP=1 |

* EQD Fix DMA市价单

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 账号类型 | 市场 | 是否支持市价 | 备注 |
| 境内互换（FEQD） | 上海（A股） | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优5档挂单 |
| 深圳（A股） | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优5档挂单 |
| 中金所 | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优1档挂单 |
| 上期所 | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优1档挂单 |
| 大商所 | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优1档挂单 |
| 郑商所 | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优1档挂单 |
| 上海能源 | 支持 | ord\_type=1，扫盘，最优1档挂单 |
| 境外互换（GFEQD） | 上海（陆股通） | 支持 | ord\_type=1，交易所市价 |
| 深圳（陆股通） | 支持 | ord\_type=1，交易所市价 |
| 港股 | 支持 | ord\_type=1，交易所市价 |
| 美股 | 支持 | ord\_type=1，交易所市价 |
| 境外期货 | 支持 | ord\_type=1，交易所市价（EQD-易盛交易链路） |
| ord\_type=1，扫盘，最优5档挂单（EQD-CATS-易盛交易链路） |
| 其他 | 支持 | ord\_type=1，交易所市价 |

* EQD Fix算法下单

|  |  |
| --- | --- |
| EQD Fix算法下单 | ord\_param |
| VWAP | 847@VWAP|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00 |
| TWAP | 847@TWAP|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00 |
| POV | 847@POV|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00|6204@20 |
| SmartVWAP | 847@SmartVWAP|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00 |
| SmartTWAP | 847@SmartTWAP|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00 |
| SmartPOV | 847@SmartPOV|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00|6204@20 |
| SNIPER | 847@SNIPER|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00 |
| DYNAMIC | 847@DYNAMIC|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00|6204@20|6209@10 |
| ICEBERG | 847@ICEBERG|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00|6231@100 |
| MOO | 847@MOO |
| MOC | 847@MOC |
| QMOC | 847@QMOC|6205@20200918-01:30:00 |

注：

6204：跟量比例，整数数值。譬如20表示20%。

6205：算法开始时间，格式为yyyyMMdd-HH:mm:ss，并且需要转换为UTC时间。

6206：算法结束时间，格式为yyyyMMdd-HH:mm:ss，并且需要转换为UTC时间。

6209：最小量比，整数数值。譬如10表示10%。

6231：暴露在外的数量，≥1手。如100表示100股。

* EQD HighTouch指令

|  |  |
| --- | --- |
| EQD Fix算法下单 | ord\_param |
| DMA | HighTouch |
| TWAP | 847@TWAP|6205@20200918-01:30:00|6206@20200918-06:55:00|TouchType@HighTouch |
| HighTouch空算法单(由EQD交易员指定算法) | AlgoIdEmpty|HighTouch |

注：

6205：算法开始时间，格式为yyyyMMdd-HH:mm:ss，并且需要转换为UTC时间。

6206：算法结束时间，格式为yyyyMMdd-HH:mm:ss，并且需要转换为UTC时间。

6204：跟量比例，整数数值。譬如20表示20%。

以订单类型视角，必填字段以黄底色标记

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **字段名** | **下单** | **撤单** |
| inst\_type |  |  |
| client\_id |  |  |
| acct\_type |  |  |
| acct |  |  |
| order\_no |  |  |
| symbol |  |  |
| tradeside |  |  |
| ord\_qty |  |  |
| ord\_price |  |  |
| ord\_type |  |  |
| ord\_param |  |  |

样例截图



## 订单流水表

### 概要说明

对每一笔委托，服务端会合并计算最新的状态与数据，并推送至客户端，客户端收到数据时**追加**写入本文件。

### 表结构

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| client\_id | char(16) | 下单时带入的id |  |
| ord\_no | char(32)或char(128) | 订单编码 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是128位，没有勾选则是32位 |
| ord\_status | char(4) | 订单状态 | 参见数据字典章节 |
| acct\_type | char(8) | 账户类型 | 参见数据字典章节 |
| acct | char(16)或char(64) | 交易账户 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是64位，没有勾选则是16位 |
| cats\_acct | char(16) | CATS账户 | 如果该交易账户有多个CATS账户绑定，可用于识别 |
| symbol | char(16) | 标的代码 |  |
| tradeside | char(8) | 交易方向 | 参见数据字典章节 |
| ord\_qty | char(9) | 委托数量 |  |
| ord\_px | char(8) | 委托价格 |  |
| ord\_type | char(8) | 委托类型 | 参见数据字典章节 |
| ord\_param | char(32) | 委托参数 | 某些类型的交易需要填写，默认为空 |
| corr\_type | char(32) | 下单来源类型 | 本面板下单固定为CLIENT\_SCAN\_ORDER@4 |
| corr\_id | char(64) | 下单来源ID |  |
| filled\_qty | char(9) | 成交数量 |  |
| avg\_px | char(8) | 成交均价 |  |
| cxl\_qty | char(9) | 撤单数量 |  |
| ord\_time | char(24) | 委托时间 | 格式yyyy-MM-ddHH:mm:ss |
| err\_msg | char(32) | 错误信息 | 如委托、撤单请求失败时有值 |
| write\_time | char(32) | 写入时间 |  |

除了输出正常的订单流水，以下两种特殊类型的信息也会被输出：

* 撤单的确认

client\_id,order\_no,acct\_type,acct,cats\_acct,corr\_type,corr\_id有值，其余字段为空或者0

* 委托出错

client\_id,acct\_type,acct,cats\_acct,corr\_type,corr\_id,err\_msg有值，其余字段为空或者0

## 新版订单流水表

### 概要说明

对每一笔委托，服务端会合并计算最新的状态与数据，并推送至客户端，客户端收到数据时**追加**写入本文件。与旧版订单流水表相比，增加了柜台订单编号、预留字段输出。

### 表结构

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| client\_id | char(16) | 下单时带入的id |  |
| ord\_no | char(128) | 订单编码 |  |
| ord\_status | char(4) | 订单状态 | 参见数据字典章节 |
| acct\_type | char(8) | 账户类型 | 参见数据字典章节 |
| acct | char(64) | 交易账户 |  |
| cats\_acct | char(16) | CATS账户 | 如果该交易账户有多个CATS账户绑定，可用于识别 |
| symbol | char(16) | 标的代码 |  |
| tradeside | char(8) | 交易方向 | 参见数据字典章节 |
| ord\_qty | char(9) | 委托数量 |  |
| ord\_px | char(8) | 委托价格 |  |
| ord\_type | char(8) | 委托类型 | 参见数据字典章节 |
| ord\_param | char(32) | 委托参数 | 某些类型的交易需要填写，默认为空 |
| corr\_type | char(32) | 下单来源类型 | 本面板下单固定为CLIENT\_SCAN\_ORDER@4 |
| corr\_id | char(64) | 下单来源ID |  |
| filled\_qty | char(9) | 成交数量 |  |
| avg\_px | char(8) | 成交均价 |  |
| cxl\_qty | char(9) | 撤单数量 |  |
| counter\_no | char(128) | 柜台订单编号 |  |
| ord\_time | char(24) | 委托时间 | 格式yyyy-MM-ddHH:mm:ss |
| err\_msg | char(32) | 错误信息 | 如委托、撤单请求失败时有值 |
| write\_time | char(32) | 写入时间 |  |
| reserve1 | char(128) | 保留字段1 |  |
| reserve2 | char(128) | 保留字段2 |  |
| reserve3 | char(128) | 保留字段3 |  |
| reserve4 | char(128) | 保留字段4 |  |

除了输出正常的订单流水，以下两种特殊类型的信息也会被输出：

* 撤单的确认

client\_id,order\_no,acct\_type,acct,cats\_acct,corr\_type,corr\_id有值，其余字段为空或者0

* 委托出错

client\_id,acct\_type,acct,cats\_acct,corr\_type,corr\_id,err\_msg有值，其余字段为空或者0

## 成交明细表

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| accttype | char(8) | 账户类型 | 参见数据字典章节 |
| account | char(16)或char(64) | 账户 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是64位，没有勾选则是16位 |
| symbol | char(32) | 标的代码 |  |
| tradeside | char(8) | 交易方向 | 参见数据字典章节 |
| orderno | char(64)或char(128) | 订单编码 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是128位，没有勾选则是64位 |
| tradeno | char(64)或char(128) | 成交编码 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是128位，没有勾选则是64位 |
| fillqty | char(16) | 成交数量 |  |
| fillprice | char(16) | 成交均价 |  |
| trdtype | char(8) | 交易类型 | 参见数据字典章节 |
| time | char(32) | 成交时间 | 格式yyyy-MM-ddHH:mm:ss.fff |
| balance | char(16) | 成交金额 |  |

## 资产表

### 3.5.1概要说明

根据启动本地扫单策略的设置，程序会定时将CATS绑定的各交易账户的资金、持仓，定时**覆盖**写入资产表。

### 3.5.2表结构

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型，资金与持仓写入不同列。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| a\_type | char(8) | 识别记录是资金还是持仓 | F: 资金  P: 持仓 |
| acct\_type | char(8) | 账户类型 | 参见数据字典章节 |
| acct | char(32)或char(64) | 交易账户 | 在界面上勾选了<<加长资金账号格式>>则是64位，没有勾选则是32位 |
| s1 | char(32) | 以下字段含义，见下文  未使用字段为预留 |  |
| s2 | char(32) |  |
| s3 | char(32) |  |
| s4 | char(32) |  |
| s5 | char(32) |  |
| s6 | char(32) |  |
| s7 | char(32) |  |
| s8 | char(32) |  |
| s9 | char(32) |  |
| s10 | char(32) |  |

资金的s1-s10含义

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **字段名** | **含义** | **备注** |
| s1 | 资金账户 | 暂时和acct一样，预留字段 |
| s2 | 币种 | 参见数据字典章节 |
| s3 | 当前余额 |  |
| s4 | 可用余额 |  |
| s5 | 当前保证金/已用保证金 | **期货账户**是当前保证金，**期权账户**是已用保证金 |
| s6 | 冻结保证金/可用保证金 | **期货账户**是冻结保证金，**期权账户**是可用保证金 |

持仓的s1-s10含义

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **字段名** | **含义** | **备注** |
| s1 | 标的代码 |  |
| s2 | 当前数量 |  |
| s3 | 可用数 |  |
| s4 | 成本价 |  |
| s5 | 持仓方向 | **期货账户**时才有意义 |
| s6 | 投机套保标记 | **期货账户**时才有意义 |
| s7 | 昨仓数 | **期货账户**时才有意义 |
| s8 | 参考市值 |  |

## 撤单拒单表

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| client\_id | char(64) | 下单时带入的id |  |
| ord\_no | char(128) | 撤单原始委托编号 |  |
| cancel\_no | char(128) | 撤单编号 |  |
| ord\_status | char(4) | 订单状态 | 固定为202 |
| ord\_text | char(254) | 撤单拒单信息 |  |
| write\_time | char(32) | 写入时间 |  |

## 订单流水附加输出表

### 3.7.1概要说明

订单流水表中状态为拒单且拒单信息不为空会写入此表

### 3.7.2表结构

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| client\_id | char(64) | 下单时带入的id |  |
| ord\_no | char(128) | 订单编码 |  |
| ord\_status | char(4) | 订单状态 | 参见数据字典章节 |
| ord\_text | char(254) | 订单信息 |  |
| write\_time | char(32) | 写入时间 |  |

## 融资融券合约表

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| acct | char(32) | 交易账户 |  |
| accttype | char(16) | 交易账户类型 |  |
| opendate | char(8) | 合约开仓日期 |  |
| compactid | char(64) | 合约编号 |  |
| clientid | char(32) | 客户编号 |  |
| fundacct | char(32) | 资金账号 |  |
| moneytype | char(4) | 币种 | 见币种数据字典 |
| stockacct | char(32) | 证券账号 |  |
| stockcode | char(16) | 证券代码 |  |
| crdtratio | char(16) | 融资融券保证金比例 |  |
| etrstno | char(16) | 委托编号 |  |
| etrstprice | char(16) | 委托价格 |  |
| etrstamt | char(16) | 委托数量 |  |
| bizamount | char(16) | 合约开仓数量 |  |
| bizbalance | char(16) | 合约开仓金额 |  |
| bizfare | char(16) | 合约开仓费用 |  |
| cmptype | char(4) | 合约类型 | 0:融资 1:融券 |
| cmpstatus | char(4) | 合约状态 | 0:未了结 1:已了结 |
| rcmbalance | char(16) | 未还合约金额 |  |
| rcmamount | char(16) | 未还合约数量 |  |
| rcmfare | char(16) | 未还合约费用 |  |
| rcinterest | char(16) | 未还合约利息 |  |
| rpinterest | char(16) | 已还利息 |  |
| rpamount | char(16) | 已还数量 |  |
| rpbalance | char(16) | 已还金额 |  |
| cminterest | char(16) | 合约总利息 |  |
| ubbalance | char(16) | 占用保证金 |  |
| yearrate | char(16) | 合约年利率 |  |
| enddate | char(8) | 归还截止日 |  |
| cleardate | char(8) | 了结日期 |  |
| write\_time | char(32) | 写入时间 |  |

## 融券可用数量表

为兼顾多种软件读取此表，全设置为char类型

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **字段名** | **类型** | **描述** | **备注** |
| acct | char(32) | 交易账户 |  |
| accttype | char(16) | 交易账户类型 |  |
| symbol | char(16) | 标的代码 |  |
| qty | char(16) | 可用数量 |  |
| write\_time | char(32) | 写入时间 |  |

# 特别说明

### 4.1有效申报价格

买卖上交所主板股票及存托凭证、深交所主板股票及存托凭证、创业板股票及存托凭证，在连续竞价阶段的限价申报，应当符合下列要求：

1. 买入申报价格不得高于买入基准价格102%和买入基准价格以上10个 申报价格最小变动单位的孰高值；
2. 卖出申报价格不得低于卖出基准价格的98%和卖出基准价格以下10个申报价格最

小变动单位的孰低值。

买卖科创板股票，在连续竞价阶段的限价申报，应当符合下列要求：

（一）买入申报价格不得高于买入基准价格的102%；

（二）卖出申报价格不得低于卖出基准价格的98%。

对于买入（卖出）基准价格，为即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格；

无即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格的，为即时揭示的最高买入（最低卖出）申报价格；

无即时揭示的最高买入（最低卖出）申报价格的，为最新成交价；当日无成交的，为前收盘价。

开市期间临时停牌阶段的限价申报，不适用本条前两款规定。

根据市场情况，交易所可以调整科创板股票的有效申报价格范围。

请务必注意上述的有效申报价格要求，不符合要求的申报会产生废单，过多废单可能触发扫单功能的风控和监管风险。

### 4.2市价委托

科创板的市价委托类型包括：

1. 最优五档即时成交剩余撤销
2. 最优五档即时成交剩余转限价
3. 对手方最优价格
4. 本方最优价格
5. 上交所主板股票、存托凭证、基金和科创板市价委托时，必须指定保护限价。

### 4.3盘后固定价格委托

科创板盘后固定价格委托需要在委托指令的order\_param字段中填写：PFP=1

# 数据字典

|  |  |
| --- | --- |
| **tradeside (交易方向)** | |
| 数值 | 含义 |
| 1 | 买入 |
| 2 | 卖出 |
| A | 融资买入 |
| B | 融券卖出 |
| C | 买券还券 |
| D | 卖券还款 |
| E | 先买券还券，再担保品买入 |
| F | ETF申购 |
| G | ETF赎回 |
| FA | 开多仓（开仓买入），适用于期货和期权 |
| FB | 开空仓（开仓卖出），适用于期货和期权 |
| FC | 平空仓（平仓买入），适用于期货和期权 |
| FD | 平多仓（平仓卖出），适用于期货和期权 |
| FG | 平今空（平今买入），适用于期货 |
| FH | 平今多（平今卖出），适用于期货 |
| OA | 备兑开仓，适用于期权 |
| OB | 备兑平仓，适用于期权 |
| E30 | 卖空,仅适用于EQD账户交易股票、期货、期权 |
| E40 | 平空,仅适用于EQD账户交易股票、期货、期权 |
| BII | 债券质押入库 |
| BIO | 债券质押出库 |

|  |  |
| --- | --- |
| **order\_status (订单状态)** | |
| 数值 | 含义 |
| 0 | 已报 |
| 1 | 部分成交 |
| 2 | 全部成交 |
| 3 | 部分撤单 |
| 4 | 全部撤单 |
| 5 | 交易所拒单 |
| 6 | 柜台未接受 |

|  |  |
| --- | --- |
| **currency (币种)** | |
| 数值 | 含义 |
| 0 | 人民币 |
| 1 | 美元 |
| 2 | 港币 |

|  |  |
| --- | --- |
| **acct\_type(账户类型)** | |
| 数值 | 含义 |
| 股票账户 |  |
| 0 | 股票集中交易 |
| C | 信用集中交易 |
| HK0 | 港股通 |
| SHDDF0 | 顶点快速（上海股票） |
| SHDDFC | 顶点快速（上海信用） |
| SZDDF0 | 顶点快速（深圳股票） |
| SZDDFC | 顶点快速（深圳信用） |
| SHHTS0 | HTS快速（上海股票） |
| SHHTSC | HTS快速（上海信用） |
| SZHTS0 | HTS快速（深圳股票） |
| SZHTSC | HTS快速（深圳信用） |
| EQD | 境内互换EQD |
| FEQD | 境内互换EQDFIX |
| GFEQD | 跨境互换EQDFIX |
| LEQD | 跨境互换EQD |
| EQDG50 | 境内互换G50 |
| S0 | 股票模拟 |
| 期货账户 |  |
| A | 中信期货 |
| DHA | 东航期货 |
| DWA | 东吴期货 |
| ESA | 中证国际 |
| G2A | 期货自营 |
| GFGA | 收益互换 |
| GJA | 国泰君安期货 |
| GLA | 格林大华期货 |
| HTA | 海通期货 |
| HUTA | 华泰期货 |
| HXA | 华信万达期货 |
| HZA | 海证期货 |
| JXA | 建信期货 |
| XZA | 兴证期货 |
| YAA | 永安期货 |
| YHA | 银河期货 |
| ZDA | 中大期货 |
| SA | 期货模拟 |
| 期权账户 |  |
| 0B | 个股期权 |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **order\_type(委托类型)** | | |
| 市场 | 数值 | 含义 |
| 深圳股票 | 0 | 限价单 |
| Q | 市价单（对手方最优价格） |
| S | 市价单（本方最优价格） |
| T | 市价单（即时成交剩余撤销） |
| U | 市价单（最优五档即时成交剩余撤销） |
| V | 市价单（全额成交或撤单） |
| 上海股票 | 0 | 限价单 |
| U | 市价单（最优五档即时成交剩余撤销） |
| R | 市价单（最优五档即时成交剩余转限价） |
| Q | 市价单（对手方最优价格） |
| S | 市价单（本方最优价格） |
| 期货 | 0 | 限价单 |
| 1 | 任意价 |
| 上海期权 | 0 | 限价GFD |
| OPA | 限价FOK |
| OPB | 市价IOC |
| OPC | 市价FOK |
| OPD | 市价剩转限价GFD |
| 深圳期权 | 0 | 限价GFD |
| OPA | 限价FOK |
| Q | 市价单（对手方最优价格） |
| S | 市价单（本方最优价格） |
| T | 市价单（即时成交剩余撤销） |
| U | 市价单（最优五档即时成交剩余撤销） |
| V | 市价单（全额成交或撤单） |

|  |  |
| --- | --- |
| **trdtype (成交明细中的交易类型)** | |
| 数值 | 含义 |
| F | 成交 |
| EC | ETF资金划转 |
| C | 撤单 |
| R | 废单 |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **持仓方向** | | |
| 品种 | 数值 | 含义 |
| 期货 | 1 | 净仓 |
| 2 | 买入 |
| 3 | 卖出 |
| 期权 | 0 | 权利仓 |
| 1 | 义务仓 |
| 2 | 备兑仓 |

|  |  |
| --- | --- |
| **交易所（symbol中的交易所后缀）** | |
| 数值 | 含义 |
| SZ | 深圳证券交易所 |
| SH | 上海证券交易所 |
| HKSH | 沪港通 |
| HKSZ | 深港通 |
| HKZ | H股转 |
| BJ | 北交所 |
| SGE | 上海黄金交易所 |
| CFFEX | 中国金融期货交易所 |
| DCE | 大连商品期货交易所 |
| SHFE | 上海期货交易所 |
| CZCE | 郑州商品期货交易所 |
| INE | 上海国际能源交易中心 |
| HKEX | 港交所 |
| CBOT | 芝加哥期货交易所 |
| CME | 芝加哥商品交易所 |
| EUREX | 欧洲期货交易所 |
| LIFFE | 伦敦国际金融期货交易所 |
| LME | 伦敦金属交易所 |
| NYMEX | 纽约商业交易所 |
| SGX | 新加坡证券交易所 |
| COMEX | 纽约COMEX |
| ICEE | 洲际交易所 |
| ICEU | 洲际交易所 |
| ICUS | 美国期货交易所 |
| OSE | 大阪期货交易所 |
| TOCOM | 东京期货交易所 |
| CBOE | 芝加哥期权交易所 |
| SZB | 深圳B股 |
| SHB | 上海B股 |
| HK | 港股 |
| US | 美股 |
| SG | 新加坡股 |
| GR | 德國股 |
| JP | 日本股 |
| TH | 泰國股 |
| UK | 英國股 |
| TW | 台灣股 |
| MY | 馬來西亞股 |
| AU | 澳洲股 |
| PH | 菲律賓股 |
| BJ | 北交所 |
| SGE | 上海黄金交易所 |

# 其他事项

* 要持续启用本功能，窗口要处于打开状态，不是当前活跃程序和活跃子窗口也没关系
* 建议提供的C lib库封装读写上述表文件，不要用第三方代码，因为进程同步机制可能做得不完善
* 程序目录的scan\_order\empty里有上述三表的空文件，请勿删除。同时这些文件可根据需要复制使用