2021年2月23日星期二

陈老师，您好，麻烦您请教一下关于委托回报的几个问题：

**1.如果我发一个10手的委托，是不是vnpy会自动把这10手委托拆分为10个1手的委托，并缓存到vt\_orderids这个列表中再发出去？**

答：不会哦，要自己分拆。vt\_orderids是做锁仓或者上期所拆分的，所以会可能有多个。

**2.如果是上面这样，是不是分多少次成交，on\_order和on\_trade就会收到多少次回报，而且每次成交价格很有可能不一样？**

答：一笔委托，本来就可能分多次成交回来

**3.为什么本地停止单的状态回报只有WAITING = "等待中"、 CANCELLED = "已撤销"、 TRIGGERED = "已触发"这几种呢？如果只有这几个回报，怎么确定本地停止单是否还处于活跃状态还是已经结束了呢？**

答：可以通过on\_stop\_order返回的限价单委托号，来跟踪。停止单是记录了信息，在行情触到设定价格时才以五档或者涨跌停价发出的，那么WAITING就是还没触发，CANCELLED就是被策略撤销了，TRIGGERED就是已经触发了，那么此时就发出了超价的限价单，之后的状态就是这个限价单的变化了。

停止单撮合成交逻辑：（以买入方向为例）先确定是否发生成交，成交标准为委托价<= 下一根K线的最高价；然后确定成交价格，成交价格为委托价与下一根K线开盘价的最大值。除了部分支持服务器停止单的币圈接口之外（支持的话，接口的ContractData里的stop\_supported会等于true），其他接口使用的是本地停止单。本地停止单只是在本地缓存了信息，触发条件才会以涨停跌停价或者盘口五档价格发出下单。