

上海卡方信息科技有限公司

卡方ATX交易系统

DBF扫单模式操作指引



修订记录

[illegible]

目录

1 扫单总体介绍	4
1.1 客户端界面	4
1.2 扫单流程介绍	5
2 扫单功能使用说明	5
2.1 扫单文件格式	5
2.1.1 母单委托文件	6
2.1.2 撤单委托文件	7
2.1.3 母单委托回报文件	7
2.1.4 子单委托回报文件	8
2.1.5 资金回报文件	9
2.1.6 证券持仓回报文件	9
3 附录说明	10
3.1 数据字典说明	10
3.2 注意说明	13



1 扫单总体介绍

1.1 客户端界面



登录客户端界面后，点击上方【工具】模块，点击【扫单】，页面如上图所示；可以使用程序通过文件单接口来进行下单、撤单，并查询成交回报、持仓、资金信息；也可以查询手动委托文件、手工撤单的母单回报信息、持仓、资金信息。

“目录设置”处点击【...】按钮，选择扫单存放数据文件的目录路径，并设置资券导出间隔时间(资金、持仓查询间隔时间)，默认为 10 秒，界面可以选择使用UTF-8或者GBK编码，默认为UTF-8，生成文件后不允许修改编码，设置好后可点击【开始按钮】，也可以设置自动扫单功能，勾选上自动扫单，选择【启动立即开始】扫单方式，每次登录成功就会立即扫单；选择【指定时间开始】扫单方式，在客户端启动后，仅在该时间点开启扫单，如下图所示：

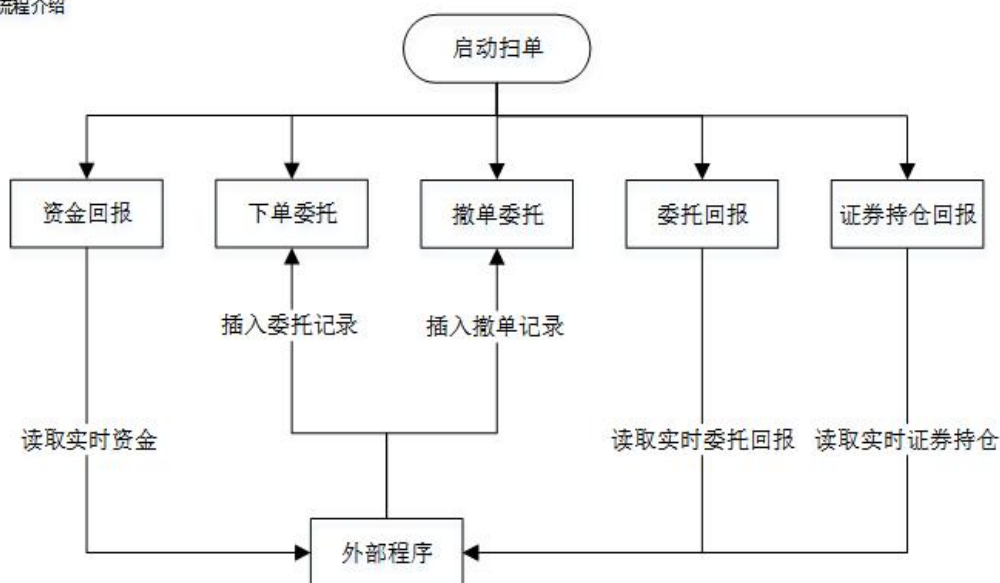


交易日志框内和交易状态菜单会简单提示程序的运行情况，程序运行异常也会有相应的提示。



1.2 扫单流程介绍

扫单流程介绍



注意： 读写文件，需要使用共享模式读写，不能使用独占模式读写。

2 扫单功能使用说明

2.1 扫单文件格式

AlgoOrderTobeConfirmed_20230803.dbf	2023/8/3 10:33	DBF 文件
CancelOrderAlgo_20230803.dbf	2023/8/3 10:32	DBF 文件
CancelOrderCache_20230803.dat	2023/8/3 10:32	DAT 文件
OrderAlgo_20230803.dbf	2023/8/3 10:33	DBF 文件
OrderAlgoCache_20230803.dat	2023/8/3 10:33	DAT 文件
OrderScan.lock	2023/8/3 10:34	LOCK 文件
ReportBalance_20230803.dbf	2023/8/3 10:34	DBF 文件
ReportOrderAlgo_20230803.dbf	2023/8/3 10:33	DBF 文件
ReportPosition_20230803.dbf	2023/8/3 10:32	DBF 文件
ScanKey_20230803.dat	2023/8/3 10:32	DAT 文件
SubOrderAlgo_20230803.dbf	2023/8/3 10:32	DBF 文件

文件说明如下：

其中 YYYYMMDD 为日期



文件名称	文件说明
OrderAlgo_YYYYMMDD. dbf	母单委托文件；
AlgOrderTobeComfirmed_YYYYMMDD. dbf	扫单二次确认文件； (需开启扫单二次确认才会写入数据)
CancelOrderAlgo_YYYYMMDD. dbf	母单撤单文件
ReportOrderAlgo_YYYYMMDD. dbf	母单回报文件；
SubOrderAlgo_YYYYMMDD. dbf	子单回报文件；
ReportBalance_YYYYMMDD. dbf	实时资金回报文件；
ReportPosition_YYYYMMDD. dbf	实时证券持仓回报文件；
Scankey_YYYYMMDD. dat	扫单文件夹key文件；
OrderScan. lock	扫单开启锁定文件；

意：程序会自动生成OrderAlgoCache_XXXXX. dat、CancelOrderCache_XXXXX. dat两个缓存文件，不要改动和删除缓存文件，防止委托和撤单读取错误。

2.1.1 母单委托文件

扫单功能启动后，会自动生成 OrderAlgo_YYYYMMDD. dbf 文件；客户可在文件中增加记录条数，进行下单委托，可填写字段及释义如下表所示：

字段名	字段类型	字段长度	精度	是否必须	备注
ExternalId	Character	30		N	自定义委托编号
ClientName	Character	255		Y	账户名称
Symbol	Character	40		Y	证券代码，例如： 000001. SZ
Side	Number	3		Y	买卖方向； 见附录，字段说明
OrderQty	Number	10		Y	委托数量
OrdType	Number	6		Y	算法类型； 见附录，字段说明
EffTime	Character	17		Y	开始时间(20201106102101000)
ExpTime	Character	17		Y	结束时间(20201106102101000)
LimAction	Number	1		Y	0-涨停不卖跌停不买 1-涨跌停继续交易 2-涨跌停终止交易 3-涨停不买跌停不卖
AftAction	Number	1		Y	0-时间过期后不交易 1-时间过期后仍交易
AlgoParam	Character	255		N	策略参数； 见附录，字段说明

以上字段， 只需包含 ATX “算法单-篮子委托” 时必填的字段即可，其他字段并非为必填项。如填入“自定义委托编号”，回报数据中会带回对应的自定义编号，作为标识。



2.1.2 撤单委托文件

扫单功能启动后，会自动生成 CancelOrderAlgo_YYYYMMDD.dbf 文件；客户可在文件中增加记录条数，进行撤单委托，可填写字段及释义如下表所示：

字段名	字段类型	字段长度	精度	是否必须	备注
QuoteId	Character	20		Y	母单委托编号
CxlType	Number	3		Y	撤单类型(1-撤单, 2-禁开)

2.1.3 母单委托回报文件

扫单功能启动后，会自动生成 ReportOrderAlgo_YYYYMMDD.dbf 文件；客户委托成功后，程序会实时推送一条母单回报记录，并会实时推送更新该回报记录的变化数据；客户委托失败后，程序会往回报文件中插入一条委托或者撤单失败记录。回报填写字段及释义如下表所示：

字段名	字段类型	字段长度	精度	备注
ExternalId	Character	30		自定义委托编号
QuoteId	Character	20		母单委托编号
ClientName	Character	255		账户名称
Symbol	Character	40		证券代码
SecType	Number	3		证券类型； 见附录，字段说明
SecExch	Number	3		交易所类型；
Side	Number	3		买卖方向； 见附录，字段说明
TransTime	Character	17		委托时间(20201217091705000)
OrderQty	Number	10		委托数量
OrdType	Number	6		算法类型； 见附录，字段说明
Price	Number	10	3	委托价格
EffTime	Character	17		开始时间(20201217091705000)
ExpTime	Character	17		结束时间(20201217091705000)
LimAction	Number	1		0-涨停不卖跌停不买 1-涨跌停继续交易 2-涨跌停终止交易 3-涨停不买跌停不卖
AftAction	Number	1		0-时间过期后不交易 1-时间过期后仍交易
AlgoParam	Character	255		策略参数
CumQty	Number	10		累计成交数量
LeavesQty	Number	10		剩余数量
OutstaQty	Number	10		未成交数量
AvgPx	Number	10	3	平均成交价格
OrdStatus	Number	3		母单状态； 见附录，字段说明



CxlType	Integer	3		撤单类型
BasketId	Character	255		篮子编号
Text	Character	255		备注信息
UpdateTime	Character	17		更新时间(20201217091705000)

2.1.4 子单委托回报文件

扫单功能启动后，会自动生成 SubOrderAlgo_YYYYMMDD.dbf 文件；客户子单信息变化后，会实时推送一条子单回报记录，更新到子单回报文件中。回报填写字段及释义如下表所示：

字段名	字段类型	字段长度	精度	备注
ExternalId	Character	30		自定义委托编号
QuoteId	Character	20		母单委托编号
ClOrdId	Character	20		子单委托编号
OrderId	Character	20		外部委托编号
ClientName	Character	255		账户名称
TransTime	Character	17		委托时间(20201217091705000)
OrdStatus	Number	3		委托状态
Symbol	Character	40		证券代码
Side	Number	3		买卖方向； 见附录，字段说明
SecType	Number	3		证券类型； 见附录，字段说明
SecExch	Number	3		交易所类型；
Price	Number	10	3	委托价格
OrdType	Number	6		算法类型； 见附录，字段说明
OrderQty	Number	10		委托股数
CumQty	Number	10		累计成交数量
LeavesQty	Number	10		仍可撮合量
AvgPx	Number	10	3	成交均价
UpdateTime	Number	17		更新时间(20201217091705000)
Text	Character	255		备注
PriceType	Number	3		价格类型； 1—限价



2.1.5 资金回报文件

扫单功能启动后，会自动生成 ReportBalance_YYYYMMDD.dbf 资金回报文件；并每隔设定的时间间隔更新回报文件，最低设定时间为 5 秒；回报填写字段及释义如下表所示：

字段名	字段类型	字段长度	精度	备注
ClientName	Character	255		账户名称
EnBalance	Number	23	3	可用资金
CrBalance	Number	23	3	融资可用资金
AssetAmt	Number	23	3	总资产
MarketAmt	Number	23	3	总市值
UpdateTime	Character	17		更新时间 (20201217091705000)

2.1.6 证券持仓回报文件

扫单功能启动后，会自动生成 ReportPosition_YYYYMMDD.dbf 证券持仓回报文件；并每隔设定的时间间隔更新回报文件，最低设定时间为 5 秒；回报填写字段及释义如下表所示：

字段名	字段类型	字段长度	精度	备注
ClientName	Character	255		账户名称
Exchange	Number	3		证券市场
Symbol	Character	40		证券代码
CurrentQ	Number	10		当前数量
EnableQty	Number	10		可用数量
ShortQty	Number	10		融券可用 (该字段默认读取为0)
UpdateTime	Character	17		更新时间 (20201217091705000)



3 附录说明

3.1 数据字典说明

Side 数据字典：

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
side	买卖方向	-1	Invalid	非法字典
		0	T0	T0 交易
		1	Buy	普通买入
		2	Sell	普通卖出
		3	Close Buy	买券还券
		4	Short Sell	融券卖出
		5	Short Buy	融资买入
		6	Close Sell	卖券还款

OrdType 数据字典：

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
OrdType	算法实例	-1	Invalid	无效委托单
		101	kf_twap_plus	卡方TWAP智能算法
		102	kf_vwap_plus	卡方VWAP智能算法
		103	kf_twap_core	卡方TWAP机械算法
		104	kf_vwap_core	卡方VWAP机械算法
		105	kf_pov_core	卡方POV机械算法
		106	kf_t0	卡方T0智能算法
		201	kf_passthru	卡方直连单

OrdStatus 数据字典：

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
		-1	Invalid	无效



OrdStatus	订单状态	0	New	已报
		1	PartialFill	部成
		2	Filled	已成
		4	Canceled	已撤
		6	PendingCancel	待撤
		7	Scrapped	内部废单
		8	Rejected	拒绝
		9	Suspend	暂停
		10	PendingNew	未报

CxlType 数据字典:

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
CxlType	撤单属性	-1	Invalid	非法参数
		0	NotCanceled	未发起撤单
		1	StopTrade	已发起撤单
		2	StopInit	禁开
		3	Expired	已过期

SecType 数据字典:

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
SecType	证券类型	0	CS	普通股票
		12	CB	可转债
		15	ETF	交易所交易基金



3.2 AlgoParam 字段参数说明：

(1) basket_id: 篮子编号, string 类型, 非必填项; 示例: basket_id=123 (长度为255字节以内, 支持字母、数字、下划线和特殊符号(不含冒号))

(2) maxpercentageF: 参与市场成交的最大百分比, pov_core 算法单必填; 示例: maxpercentageF=10

(3) PriceF: 买入委托的最高限价/卖出委托的最低限价, 示例: priceF=10.01

(4) PriceTypeI: 价格类型, passthru算法单必填, 可选择限价、卖五价、卖四价、卖三价、卖二价、卖一价、最新价、买一价、买二价、买三价、买四价、买五价, 数字枚举依次为 0-11 (当价格类型选择限价时, 需同时搭配priceF参数使用)
示例: PriceTypeI=0:priceF=58 (限价 58 元)、PriceTypeI=1 (卖五价)

(5) buyside: 买入方向, t0 算法必填 (1: 普通买入, 5: 融资买入) 示例: buyside=1

(6) sellside: 卖出方向, t0 算法必填 (2: 普通卖出, 4: 融券卖出) 示例: sellside=2

注: 目前版本kf_t0算法仅支持这几种交易方向

(7) costBPF: 绩效基点, 单位bps, 仅TWAP_Plus、VWAP_Plus算法可以设置

(8) UpLimitF / DownLimitF: 下单报单价格区间, 只可填写正数; TWAP_Plus、VWAP_Plus、TWAP_Core、VWAP_Core选填: 示例: UpLimitF=2, DownLimitF=5 (则表示下单价格在昨收价的2%至-5%之间)

(9) amountF: 盘口限制, 涨跌停时停在一档盘口低于限制金额才委托, 仅TWAP、VWAP算法可以设置, 且只有涨跌停支持交易时, 该参数才生效

(10) risk_level: 风险偏好, t0算法选填 (0: 保守, 1: 激进) 示例: risk_level=0

字段之间使用":"分隔



3.3 注意说明

- (1) 读写文件，需要使用共享模式读写，不能使用独占模式读写。
- (2) 成功开启扫单后生成锁定文件，文件中记录开启日期，停止扫单后删除锁定文件，锁定后该目录则无法被其他客户端再次开启扫单，防止同一目录被多个客户端扫单。
- (3) 成功开启扫单后生成扫单文件夹key文件，文件中记录客户端mac地址&扫单目录行号，下单时拼接行号后作为下单唯一值提供给服务端做防重校验。
- (4) 换行符使用/r/n，其他换行符会导致扫单漏扫情况。
- (5) 扫单文件路径建议使用本地磁盘，若是网络盘可能遇到读写异常的情况。

