

卡方科技-ATGO 系统

CS 端 DBF 扫单模式操作指引

文档修改记录

版本号	日期	说明	编写者	审核者
V0.9	2021-01-25	创建初稿	郭乃梁	

文档修改记录	1
1 前言	错误!未定义书签。
2 业务介绍	3
2.1 系统支持版本	3
2.2 扫单流程介绍	4
3 系统相关配置	4
4 扫单功能使用说明	4
4.1 客户端界面	3
4.2 扫单文件格式	4
4.2.1 母单委托文件	5
4.2.2 撤单委托文件	6
4.2.3 母单委托回报文件	6
4.2.4 子单委托回报文件	7
4.2.5 资金回报文件	8
4.2.6 证券持仓回报文件	8
4.2.7 期货持仓回报文件	8
5 附录说明	9
5.1 数据字典说明	9
5.2 注意说明	11

1 扫单总体介绍

1.1 客户端界面



“目录设置”处点击【浏览】按钮，输入存放数据文件的目录路径，并设置数据文件导出间隔（秒），默认为 10 秒，设置好后可点击【开始按钮】，如下图所示：

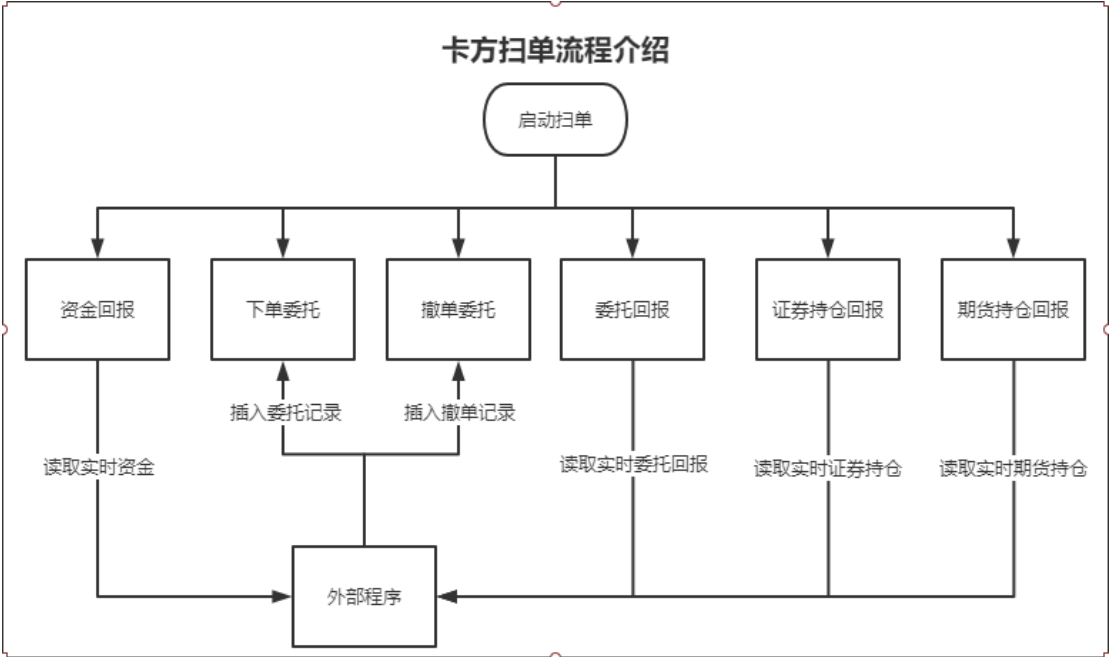


1.2 系统支持版本

系统版本支持如下：

【ATGO 系统】： V1.6.2.0

1.3 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。

1.4 系统相关配置

暂时无

2 扫单功能使用说明

2.1 扫单文件格式

	CancelOrderAlgo_20210208.dbf	2021/2/8 13:31	Microsoft Visual...	1 KB
	CancelOrderCache_20210208.dat	2021/2/8 13:31	DAT 文件	1 KB
	OrderAlgo_20210208.dbf	2021/2/8 13:31	Microsoft Visual...	1 KB
	OrderAlgoCache_20210208.dat	2021/2/8 13:31	DAT 文件	1 KB
	ReportOrderAlgo_20210208.dbf	2021/2/8 13:32	Microsoft Visual...	20,440 KB
	SubOrderAlgo_20210208.dbf	2021/2/8 13:37	Microsoft Visual...	209,571 KB
	ReportBalance_20210208.dbf	2021/2/8 13:37	Microsoft Visual...	2 KB
	ReportPosition_20210208.dbf	2021/2/8 13:37	Microsoft Visual...	1,807 KB
	ReportPositionOfFuture_20210208.dbf	2021/2/8 13:37	Microsoft Visual...	1 KB

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
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
ReportPositionOfFuture_YYYYMMDD.dbf	实时期货持仓回报文件

另外：程序会自动生成 OrderAlgoCache_YYYYMMDD.dat 和 CancelOrderCache_YYYYMMDD.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

CS 端扫单功能启动后，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
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	3		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-涨跌停后不交易 1-涨跌停后仍交易
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 ATGO “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。
- 如过填入 “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

CS 端扫单功能启动后，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

CS 端扫单功能启动后，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	是否必须	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；见附录，字段说明
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	3			算法类型；见附录，字段说明
Price	Number	10	3		价格
EffTime	Character	17			开始时间(20201217091705000)
ExpTime	Character	17			结束时间(20201217091705000)
LimAction	Number	1			0-涨跌停后不交易 1-涨跌停后仍交易
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	Number	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

CS 端扫单功能启动后，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	是否必须	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；见附录，字段说明
Price	Number	10	3		委托价格
OrdType	Number	3			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

2.1.5 资金回报文件

CS 端扫单功能启动后，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 10 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	是否必须	备注
ClientName	Character	255			账户名称
EnBalance	Number	14	3		可用资金
CrBalance	Number	14	3		融资可用资金
UpdateTime	Character	17			更新时间 (20201217091705000)

2.1.6 证券持仓回报文件

CS 端扫单功能启动后，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 10 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	是否必须	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
UpdateTime	Character	17			更新时间 (20201217091705000)

2.1.7 期货持仓回报文件

CS 端扫单功能启动后，会自动生成 ReportPositionOfFuture_YYYYMMDD.dbf 期货持仓回报文件；并每隔设定的时间间隔更新回报文件，最低设定时间为 10 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	是否必须	备注
ClientName	Character	255			账户名称
Exchange	Number	3			证券市场

Symbol	Character	40			证券代码
LTdCurQty	Number	10			多头今仓
LTdTrdQty	Number	10			多头今可卖
LYdCurQty	Number	10			多头昨仓
LYdTrdQty	Number	10			多头昨可卖
STdCurQty	Number	10			空头今仓
STdTrdQty	Number	10			空头今可卖
SYdCurQty	Number	10			空头昨仓
SYdTrdQty	Number	10			空头昨可卖
UpdateTime	Character	17			更新时间

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
		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
		101	Future Open Buy	买入开仓
		102	Future Open Sell	卖出开仓
		103	Future Close Buy	买入平仓
		106	Future Close Sell	卖出平仓

OrdType 数据字典:

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
OrdType	算法类型	-1	Invalid	无效委托单
		101	TWAP_Plus	TWAP_Plus 算法单
		102	VWAP_Plus	VWAP_Plus 算法单
		103	TWAP_Core	TWAP_Core 算法单

		104	VWAP_Core	VWAP_Core 算法单
		105	POV_Core	POV_Core 算法单
		201	Passthru	Passthru 算法单

OrdStatus 数据字典:

数据字典	字典名称	字典子项	子项含义	备注
OrdStatus	订单状态	-1	Invalid	无效
		0	New	已报
		1	PartialFill	部成
		2	Filled	已成
		4	Canceled	已撤
		6	PendingCancel	部撤
		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

AlgoParam 字段参数说明:

(1) basket_id: string 类型, 可填可不填; 示例: basket_id=123

(2) target_percentage: 参与市场成交的最大百分比, POV_Core 算法单必填; 示例: maxpercentageF=1

(3) price: 买入委托的最高限价/卖出委托的最低限价, Passthru 算法单必填。示例: priceF=10.01

字段之间使用“:”分隔

示例: basket_id=123: maxpercentageF=1: priceF=10.01

3.2 注意说明

注意点:读写文件，需要使用共享模式读写，不能使用独占模式读写。