

郑州商品交易所 ZCEAPI 参考手册

Version2.1

郑州商品交易所系统运行部

2014 年 02 月

目录

0.	修改历史.....	1
1.	数据元类型.....	1
2.	数据元定义.....	2
3.	业务命令报文.....	8
3.1	交易员登录请求 (PID): 0x00016	9
3.2	交易员登录应答 (PID): 0x10016	9
3.3	交易员登录退出请求 (PID): 0x00017	10
3.4	交易员登录退出应答 (PID): 0x10017	10
3.5	交易员修改密码请求: (PID): 0x00018	10
3.6	交易员修改密码应答 (PID): 0x10018	10
3.7	报单录入请求 (PID): 0x00003	11
3.8	报单应答 (PID): 0x10003	11
3.9	做市商报价响应录入请求 (PID): 0x03003.....	12
3.10	做市商报价响应应答 (PID): 0x13003	13
3.11	报单操作请求 (PID): 0x00004	13
3.12	报单操作应答 (PID): 0x10004	14
3.13	报单查询请求 (PID): 0x00006	14
3.14	报单查询应答 (PID): 0x10006	14
3.15	按定单类型报单查询请求 (PID) : 0x03010	16
3.16	按定单类型报单查询应答 (PID): 0x13010.....	16
3.17	按本地定单号报单查询请求 (PID): 0x03013.....	17
3.18	按本地定单号报单查询应答 (PID): 0x13013.....	18
3.19	按变化量报单查询请求 (PID): 0x03046.....	19
3.20	按变化量报单查询应答 (PID) :0x13046	19
3.21	套期保值额度查询请求 (PID): 0x03017.....	20
3.22	套期保值额度查询应答 (PID): 0x13017.....	21
3.23	套期保值确认查询请求 (PID): 0x03018.....	21
3.24	套期保值确认应答 (PID): 0x13018	21
3.25	跨期套利额度查询请求 (PID): 0x03019.....	22
3.26	跨期套利额度应答 (PID): 0x13019	22
3.27	跨期套利确认查询请求 (PID): 0x03020.....	23
3.28	跨期套利确认应答 (PID): 0x13020	23
3.29	做市商报价响应查询请求 (PID): 0x03026.....	24
3.30	做市商报价响应应答 (PID): 0x13026	24
3.31	期权执行查询请求 (PID): 0x03025	24
3.32	期权执行应答 (PID): 0x13025	25
3.33	市场查询请求 (PID): 0x0000B.....	25
3.34	市场查询应答 (PID): 0x1000B.....	25
3.35	市场交易状态查询请求 (PID): 0x0000D.....	26
3.36	市场交易状态应答 (PID): 0x1000D.....	26
3.37	合约查询请求 (PID): 0x00005	26
3.38	合约查询应答 (PID): 0x10005	26

3.39	合约交易状态查询请求 (PID): 0x0000E.....	27
3.40	合约交易状态应答 (PID): 0x1000E.....	27
3.41	组合合约查询请求 (PID): 0x03015.....	28
3.42	组合合约应答 (PID): 0x13015.....	28
3.43	客户信息查询请求 (PID): 0x0000C.....	28
3.44	客户信息应答 (PID): 0x1000C.....	29
3.45	会员资金查询请求 (PID): 0x00008.....	29
3.46	会员资金应答 (PID): 0x10008.....	29
3.47	成交行情查询请求 (PID): 0x00002.....	30
3.48	成交行情应答 (PID): 0x10002.....	30
3.49	按合同编号成交合约查询请求 (PID): 0x00007.....	31
3.50	按合同编号成交合约应答 (PID): 0x10007.....	31
3.51	按成交编号成交合约查询请求 (PID): 0x03014.....	32
3.52	按成交编号成交合约应答 (PID): 0x13014.....	32
3.53	会员持仓查询请求 (PID): 0x00009.....	33
3.54	会员持仓应答 (PID): 0x10009.....	33
3.55	会员客户持仓查询请求 (PID): 0x0000A.....	34
3.56	会员客户持仓应答 (PID): 0x1000A.....	35
3.57	会员客户组合持仓查询请求 (PID): 0x03031.....	36
3.58	会员客户组合持仓应答 (PID): 0x13031.....	36
3.59	错误响应 (PID): 0x10001.....	37
3.60	合约参数改变通知 (PID): 0x12007.....	37
3.61	合约状态改变通知 (PID): 0x12006.....	38
3.62	交易所告示广播 (PID): 0x12003.....	38
3.63	成交行情 (PID): 0x12004.....	38
3.64	组合行情 (PID): 0x13016.....	39
3.65	市场状态改变通知 (PID): 0x12005.....	40
3.66	报价请求 (PID): 0x13002.....	40
3.67	报单状态确认 (PID): 0x11003.....	40
3.68	跨期套利确认 (PID): 0x13041.....	42
3.69	套期保值确认 (PID): 0x13040.....	42
3.70	期权执行确认 (PID): 0x13042.....	42
3.71	做市商报价响应确认 (PID): 0x13026.....	43
3.72	单边成交回报 (PID): 0x11001.....	43
4.	业务处理流程.....	44
4.1	对话流交易员登录.....	44
4.2	私有流交易员登录.....	44
4.3	广播流交易员登录.....	45
4.4	行情发送方式.....	45
4.5	交易系统的合约组织.....	45
4.6	交易系统的持仓组织.....	46
4.7	交易系统的定单类型.....	46
4.8	报单录入和报单操作 (撤单) 过程.....	46
4.9	单腿定单成交过程.....	47

4.10	组合定单成交过程.....	47
4.11	止损定单触发成交过程.....	47
4.12	做市商在有报价请求时的报价过程.....	48
4.13	做市商主动报价.....	48
4.14	跨期套利确认.....	48
4.15	套期保值确认.....	49
4.16	期权执行(或放弃)申请.....	49
4.17	组合指令的价格.....	50
5.	报文描述.....	50
5.1	对话流交易员登录.....	50
5.1.1	会员系统请求.....	50
5.1.2	交易系统响应.....	51
5.2	私有流交易员登录.....	52
5.2.1	会员系统请求.....	52
5.2.2	交易系统响应.....	52
5.3	广播流交易员登录.....	53
5.3.1	会员系统请求.....	53
5.3.2	交易系统响应.....	54
5.4	交易员登录退出.....	55
5.4.1	会员系统请求.....	55
5.4.2	交易系统响应.....	55
5.5	交易员修改密码.....	56
5.5.1	会员系统请求.....	56
5.5.2	交易系统响应.....	56
5.6	下期货期权限价指令.....	56
5.6.1	会员系统请求.....	56
5.6.2	交易系统响应.....	57
5.7	下期货期权市价指令.....	58
5.7.1	会员系统请求.....	58
5.7.2	交易系统响应.....	58
5.8	下期货止损指令.....	59
5.8.1	会员系统请求.....	59
5.8.2	交易系统响应.....	60
5.9	下期货期权组合指令.....	60
5.9.1	会员系统请求.....	60
5.9.2	交易系统响应.....	61
5.10	下跨期套利确认指令.....	61
5.10.1	会员系统请求.....	61
5.10.2	交易系统响应.....	62
5.11	下套期保值确认指令.....	62
5.11.1	会员系统请求.....	62
5.11.2	交易系统响应.....	63
5.12	下报价请求指令.....	63
5.12.1	会员系统请求.....	63

5.12.2	交易系统响应.....	64
5.13	下期权权利行使指令.....	64
5.13.1	会员系统请求.....	64
5.13.2	交易系统响应.....	65
5.14	下期权权利放弃指令.....	65
5.14.1	会员系统请求.....	65
5.14.2	交易系统响应.....	66
5.15	下做市商报价响应指令.....	66
5.15.1	会员系统请求.....	66
5.15.2	交易系统响应.....	67
5.16	撤销期货期权限价指令.....	67
5.16.1	会员系统请求.....	67
5.16.2	交易系统响应.....	67
5.17	撤销期货止损指令.....	67
5.17.1	会员系统请求.....	67
5.17.2	交易系统响应.....	68
5.18	撤销期货组合定单.....	68
5.18.1	会员系统请求.....	68
5.18.2	交易系统响应.....	68
5.19	撤销跨期套利确认指令.....	69
5.19.1	会员系统请求.....	69
5.19.2	交易系统响应.....	69
5.20	撤销套期保值确认指令.....	69
5.20.1	会员系统请求.....	69
5.20.2	交易系统响应.....	70
5.21	撤销期权权力行使指令.....	70
5.21.1	会员系统请求.....	70
5.21.2	交易系统响应.....	70
5.22	撤销报价请求响应指令.....	71
5.22.1	会员系统请求.....	71
5.22.2	交易系统响应.....	71
5.23	撤销期权权力放弃指令.....	71
5.23.1	会员系统请求.....	71
5.23.2	交易系统响应.....	72
5.24	报单查询.....	72
5.24.1	会员系统请求.....	72
5.24.2	交易系统响应.....	72
5.25	按定单类型报单查询.....	73
5.25.1	会员系统请求.....	73
5.25.2	交易系统响应.....	73
5.26	按本地定单号报单查询.....	74
5.26.1	会员系统请求.....	74
5.27	按变化量报单查询.....	75
5.27.1	会员系统请求.....	75

5.27.2	交易系统响应.....	75
5.28	套期保值额度查询.....	76
5.28.1	会员系统请求.....	76
5.28.2	交易系统响应.....	76
5.29	套期保值确认查询.....	76
5.29.1	会员系统请求.....	76
5.29.2	交易系统响应.....	76
5.30	跨期套利额度查询.....	77
5.30.1	会员系统请求.....	77
5.30.2	交易系统响应.....	77
5.31	跨期套利确认查询.....	77
5.31.1	会员系统请求.....	77
5.31.2	交易系统响应.....	78
5.32	做市商报价响应查询.....	78
5.32.1	会员系统请求.....	78
5.32.2	交易系统响应.....	78
5.33	期权执行指令查询.....	78
5.33.1	会员系统请求.....	78
5.33.2	交易系统响应.....	79
5.34	市场查询.....	79
5.34.1	会员系统请求.....	79
5.34.2	交易系统响应.....	79
5.35	市场交易状态查询.....	79
5.35.1	会员系统请求.....	79
5.35.2	交易系统响应.....	80
5.36	合约查询.....	80
5.36.1	会员系统请求.....	80
5.36.2	交易系统响应.....	80
5.37	合约交易状态查询.....	80
5.37.1	会员系统请求.....	80
5.37.2	交易系统响应.....	81
5.38	组合合约查询.....	81
5.38.1	会员系统请求.....	81
5.38.2	交易系统响应.....	81
5.39	客户信息查询.....	81
5.39.1	会员系统请求.....	81
5.39.2	交易系统响应.....	82
5.40	会员资金查询.....	82
5.40.1	会员系统请求.....	82
5.40.2	交易系统响应.....	82
5.41	成交行情查询.....	82
5.41.1	会员系统请求.....	82
5.41.2	交易系统响应.....	82
5.42	按合同编号成交合约查询.....	83

5.42.1	会员系统请求.....	83
5.42.2	交易系统响应.....	83
5.43	按成交编号成交合约查询.....	83
5.43.1	会员系统请求.....	83
5.43.2	交易系统响应.....	84
5.44	会员持仓查询.....	84
5.44.1	会员系统请求.....	84
5.44.2	交易系统响应.....	84
5.45	会员客户持仓查询.....	85
5.45.1	会员系统请求.....	85
5.45.2	交易系统响应.....	85
5.46	会员客户组合持仓查询.....	85
5.46.1	会员系统请求.....	85
5.46.2	交易系统响应.....	86
5.47	私有流报文.....	86
5.47.1	报单状态确认 OrderConfirmation(TID=0x11003)报文.....	86
5.47.2	跨期套利确认 OrderSpdApply(PID=0x13041)报文.....	86
5.47.3	套期保值确认 OrderHedgeCfm(PID=0x13040)报文.....	86
5.47.4	期权执行报文确认 OrderOptionEApply(PID=0x13042)报文.....	86
5.47.5	做市商报价响应确认 QuotMarketConfirm(PID=0x13026)报文.....	86
5.47.6	单边成交回报 TradeInsertSingle(PID=0x11001)报文.....	86
5.48	广播流报文.....	87
5.48.1	合约参数改变通知 InstrumentChangeNotify(PID=0x12007)报文.....	87
5.48.2	合约状态改变通知 InstrumentStatusChangeNotify(PID=0x12006)报文.....	87
5.48.3	交易所告示 MarketBulletin(PID=0x12003)报文.....	87
5.48.4	成交行情 MarketMatchData(PID=0x12004)报文.....	87
5.48.5	组合行情 CMBInstrumentChangeNotify(PID=0x13016)报文.....	88
5.48.6	市场状态改变通知 MarketStatusChangeNotify(PID=0x12005)报文.....	88
5.48.7	做市商报价请求报文(交易所->做市商)(PID=0x13002)报文.....	89
附录一	错误代码表.....	90

0. 修改历史

时间	修改内容	修改人	说明
2007-12-19	增加 4XXX 的错误码	张卓亚	新版本适用
2007-12-19	修改文中对数据元 155 FID_ProtocolVersion 的说明。	张卓亚	
2009-03-02	增加了按照本地定单号查询	申超	添加新功能
2009-11-18	增加了按变化量报单查询	申超	添加新功能
2013.12.10	剔除私有流中与对话流中重复的报文； 不再支持 401 协议； FID_CancelFlag 字段增加了 3->做市商报价响应定单	刘相富 段其国	修改功能

1. 数据元类型

对于数据类型，根据定义的精确度，自动把小数位置移动，以整数进行存储传送，接收后再把小数点恢复到原来的位置，故下面说的数值范围考虑到了小数点后的数字。

数据类型	简写	说明
ShortInt	SI	短整数，一个字节-127..127，
Char	C	字符型，协议中的字符常量均为大写字母
Number	N	整数，四字节有符号整数
UnsignedNumber	UN	非负整数字，四字节无符号整数
LargeNumber	LN-4	12 位双精度浮点数,精度为 4 位
Date	D	日期
DateTime	DT	日期时间
String	S	字符串

注：Date 和 DateTime 其实为同一类型。某字段为 Date 型是指该字段表示时间的位为 0。即时间位没有意义。

DateTime 类型定义如下：

```
typedef struct tagDateTime
{
```



```

        unsigned short int   year;
        unsigned char        month,day,hour,minute,second;
        unsigned short int   microsec;
    }Date_Time;
    
```

2. 数据元定义

具体的数据元清单如下表所示：

FID	字段名称	类型	描述
2	FID_INIT_PASSWORD	S	链路初始密码, FTDSStringType<8>
3	FID_AUTH_SERIAL_NO	S	授权序列号, FTDSStringType<17>
4	FID_AUTH_CODE	S	授权码, FTDSStringType<17>
6	FID_Chain	C	报文链 'Y'仍有后续报文, 'N'没有后续报文
16	FID_Abstract	S	摘要/说明, 目前未用, FTDSStringType<80>
17	FID_ActionLocalId	S	报单操作本地编号, FTDSStringType<24>
18	FID_ActionType	C	执行类型'E'-执行 (OPTION_EXEC)'C'-放弃 (OPTION_ABANDON)
19	FID_ActiveTime	DT	激活时间
20	FID_ActiveUserId	S	操作交易员编码, FTDSStringType<15>
21	FID_AddValue	LN-2	本交易日新增资金, FTDFloatType<14, 2>
22	FID_AlwDate	D	允许建仓最后日期
23	FID_AlwHisDate	D	历史持仓确认最后日期 AlwHisDate<= AlwDate
24	FID_AlwQty	UN	批准数量 交易所批准数量, 二进制网络序
25	FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序
26	FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
27	FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
28	FID_AveragePrice	LN-4	均价, FTDFloatType<12, 4>
29	FID_Balance	UN	已建仓数量, 二进制网络序
30	FID_BalanceValue	LN-2	可用保证金余额, FTDFloatType<14, 2>
31	FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
32	FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
33	FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序
34	FID_BroadcastSequenceSeries	UN	广播模式序列类别号, 二进制网络序
35	FID_BuyHedgeOffsetMargin	LN-2	买保平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
36	FID_BuyHedgeOffsetProfit	LN-2	买保平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
37	FID_BuyHedgeOpenFrozMargin	LN-2	买保开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
38	FID_BuyHedgeOpenUsedMargin	LN-2	买保开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
39	FID_BuyHedgePosition	UN	买开仓量(保), 二进制网络序
40	FID_BuyHedgeTurnOver	LN-2	买保成交额, FTDFloatType<14, 2>
41	FID_BuyHedgeVolume	UN	买成交量(保), 二进制网络序

FID	字段名称	类型	描述
42	FID_BuyOffsetFlag	SI	买开平仓标志 0—开仓 1—平仓
43	FID_BuyOffsHPosition	UN	买平今量(保), 二进制网络序
44	FID_BuyOffsSPosition	UN	买平今量(投), 二进制网络序
45	FID_BuyPrice	LN-4	买报价, FTDFloatType<12, 4>
46	FID_BuySpecOffsetMargin	LN-2	买投平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
47	FID_BuySpecOffsetProfit	LN-2	买投平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
48	FID_BuySpecOpenFrozMargin	LN-2	买投开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
49	FID_BuySpecOpenUsedMargin	LN-2	买投开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
50	FID_BuySpecPosition	UN	买开仓量(投), 二进制网络序
51	FID_BuySpecTurnOver	LN-2	买投成交额, FTDFloatType<14, 2>
52	FID_BuySpecVolume	UN	买成交量(投), 二进制网络序
53	FID_CancelDate	D	取消日期 目前未用
54	FID_CancelFlag	SI	定单类型 0—普通定单 1—止损定单 2—组合定单 3—做市商报价响应定单
55	FID_CancelTime	DT	取消时间 目前未用
56	FID_ClearDate	D	清算日期 目前未用
57	FID_ClearPrice	LN-4	结算价, FTDFloatType<12, 4>
58	FID_ClientId	S	客户编号, FTDDStringType<8>
59	FID_ClientName	S	客户名称, FTDDStringType<80>
60	FID_ClientType	C	客户类别 目前未用
61	FID_ClosePrice	LN-4	收盘价, FTDFloatType<12, 4>
62	FID_CmbType	SI	组合定单类型, 0-SPZ 1-SPD 2-IPS 3-BUL 4-BER 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG 9-PRT
63	FID_ComeFrom	S	消息来源 目前未用, FTDDStringType<20>
64	FID_ConnectionReference	S	链路标示 目前未用, FTDDStringType<5>
65	FID_Content	S	消息正文, FTDDStringType<500>
66	FID_Currency	S	交易用的货币 交易用的货币, 目前="RMB", FTDDStringType<3>
67	FID_DealQty	UN	成功处理数量 缺省=0, 二进制网络序, 未处理
68	FID_DealStatus	SI	处理状态 0—删除 1—挂起 2—激活
69	FID_DelValue	LN-2	本交易日提出资金, FTDFloatType<14, 2>
70	FID_DeriveAskLot	UN	组合卖出数量
71	FID_DeriveAskPrice	LN-4	组合卖出价
72	FID_DeriveBidLot	UN	组合买入数量
73	FID_DeriveBidPrice	LN-4	组合买入价
74	FID_Direction	SI	买卖方向 0—买, 1—卖 2—所有 可以不用输入
75	FID_EndDelvDate	D	最后交割日
76	FID_EndTrdDate	D	最后交易日
77	FID_ErrorCode	S	错误代码, FTDDStringType<10>
78	FID_ErrorText	S	错误正文, FTDDStringType<100>

FID	字段名称	类型	描述
79	FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyyymmddhhmmss
80	FID_Forcedistime	UN	强平的撮合间隔, 二进制网络序, 目前未用
81	FID_ForceExitCode	SI	强制退出号 目前为 0
82	FID_ForceExitMsg	S	强制退出原因, FTDSStringType<100>
83	FID_ForceGroupId	S	强平组号 目前未用, FTDSStringType<24>
84	FID_FuseFlag	SI	熔断标记 1->真, 0->假 目前未用
85	FID_Fuselimit	LN-2	熔断限额 目前未用
86	FID_Fusepersisttime	UN	熔断最大持续时间, 二进制网络序, 目前未用
87	FID_Fusepoint	DT	在该时间点后不可熔断 目前未用
88	FID_FuseRights	SI	可否熔断 1->真, 0->假, 目前为 0
89	FID_HedgeDate	D	申请日期
90	FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
91	FID_HighLimit	LN-4	涨停板, FTDFloatType<12, 4>
92	FID_HighLimitRate	S	涨停板率 目前未用, FTDSStringType<4>
93	FID_HighPrice	LN-4	最高价, FTDFloatType<12, 4>
94	FID_HoldQty	UN	持仓数量, 二进制网络序, 目前未用
95	FID_InitMargin	LN-2	初始保证金, FTDFloatType<14, 2>
96	FID_InsertTime	DT	录入时间
97	FID_InstrStopCode	SI	停止交易原因 目前为 0
98	FID_InstrumentId	S	合约编码, 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600, FTDSStringType<20>
99	FID_InstrumentName	S	合约名称, FTDSStringType<80>
100	FID_InstrumentStatus	C	合约交易状态 (N-正常, S-挂起, D-删除)
101	FID_InstrumentType	SI	合约类型 0:期货, 1:期权, 2:组合
102	FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
103	FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 如 192.168.99.100, FTDSStringType<20>
104	FID_LastLot	UN	最后一笔成交手数, 双向计算, 二进制网络序
105	FID_LastPrice	LN-4	最新价, FTDFloatType<12, 4>
106	FID_LifeHigh	LN-4	历史最高成交价格, FTDFloatType<12, 4>
107	FID_LifeLow	LN-4	历史最低成交价格, FTDFloatType<12, 4>
108	FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损订单的保护价) FTDFloatType<12, 4>
109	FID_LongOffsFrozHPosition	UN	多头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
110	FID_LongOffsFrozSPosition	UN	多头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
111	FID_LongOpenFrozHPosition	UN	多头开仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
112	FID_LongOpenFrozSPosition	UN	多头开仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
113	FID_LowLimit	LN-4	跌停板, FTDFloatType<12, 4>
114	FID_LowLimitRate	S	跌停板率 目前未用, FTDSStringType<4>
115	FID_LowPrice	LN-4	最低价, FTDFloatType<12, 4>
116	FID_Margin	LN-4	保证金, FTDFloatType<12, 4>

FID	字段名称	类型	描述
117	FID_MarketId	S	市场编码 目前为“ZCE001”, FTDStringType<10>
118	FID_MarketMatchDataStatus	SI	是否主动发送成交行情 1->真,0->假
119	FID_MarketName	S	市场名称,FTDStringType<80>
120	FID_MarketStatusId	SI	市场交易状态: 8->系统未装载, 未就绪, 1->系统就绪, 可以登录, 3->开盘竞价入单开始阶段, 13->开盘竞价入单结束阶段, 开盘集合竞价开始, 14->开盘竞价结束, 4 或 9->连续交易阶段, 5 或 11->暂停阶段, 6->系统挂起阶段, 7 或 10->交易闭市
121	FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
122	FID_MatchDate	D	成交日期
123	FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
124	FID_MatchTime	DT	成交时间
125	FID_MaxLot	UN	最大可下单手数, 限价单每笔的最大手数, 目前为 1000, 二进制网络序
126	FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号,FTDStringType<24>
127	FID_MessageReference	S	用户自定义数据。备注信息, FTDStringType<6>
128	FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
129	FID_MinLot	UN	最小可下单手数 目前为 1, 二进制网络序
130	FID_NewPassword	S	新口令,FTDStringType<40>
131	FID_NewsType	S	消息类型 目前='0',FTDStringType<3>
132	FID_NewsUrgency	C	紧急程度 目前未用
133	FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
134	FID_OldPassword	S	旧口令,FTDStringType<40>
135	FID_OpenInterest	UN	持仓量, 二进制网络序
136	FID_OpenPrice	LN-4	开盘价,FTDFloatType<12, 4>
137	FID_OpenQty	UN	已建仓数量, 二进制网络序
138	FID_OrderActionCode	SI	报单操作类型码 0->删除, 1->挂起, 2->激活
139	FID_OrderCMBType	SI	报单类型:按位处理, bit0->限价, bit1->市价, bit3->止损 bit7->组合定单
140	FID_OrderDate	DT	申请日期
141	FID_OrderLocalId	S	委托编号,FTDStringType<24>
142	FID_OrderStatus	SI	报单状态 0->全部成交, 1->部分成交还在队列中, 2->部分成交不在队列中, 3->未成交还在队列中, 4->未成交不在队列中, 5->撤单 6->止损单触发
143	FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
144	FID_OrderSysId	S	合同编号,FTDStringType<20>

FID	字段名称	类型	描述
145	FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 /*101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求报价, 104->期权权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
146	FID_ParticipantId	S	交易会员编码, FTDSStringType<24>
147	FID_ParticipantName	S	会员名称, FTDSStringType<80>
148	FID_ParticipantType	SI	会员类型 0->自营, 1->经纪, 2->综合, 3->特别, 4->做市商
149	FID_PartTrdRight	SI	会员权限 0->完全, 1->只可平, 2->不准交易
150	FID_Password	S	口令, FTDSStringType<20>
151	FID_PreClose	LN-4	前收盘价格, FTDFloatType<12, 4>
152	FID_PreOpenInterest	UN	昨日空盘量, 双向计算, 二进制网络序
153	FID_PreSettle	LN-4	前结算价格, FTDFloatType<12, 4>
154	FID_Price	LN-4	价格, FTDFloatType<12, 4>
155	FID_ProtocolVersion	S	使用 FTD 版本号 目前版本只能取 2, 11 FTDSStringType<8>
156	FID_Pubstyle	SI	竞价阶段合约行情发布方式 0->不发 1->发布
157	FID_Qty	UN	申请数量, 二进制网络序
158	FID_RemainQty	UN	剩余额度 (可建仓数量), 二进制网络序
159	FID_ReqDate	D	申请建仓开始日期
160	FID_ReqQty	UN	申请数量 会员申请数量, 二进制网络序
161	FID_ReqSeqNum	S	报价请求序列号, FTDSStringType<20>
162	FID_RequestBy	SI	请求方 (0->一般会员, 1->交易所)
163	FID_ResponseTime	DT	请求响应时间
164	FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿, FTDSStringType<20>
165	FID_SellHedgeOffsetMargin	LN-2	卖保平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
166	FID_SellHedgeOffsetProfit	LN-2	卖保平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
167	FID_SellHedgeOpenFrozMargin	LN-2	卖保开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
168	FID_SellHedgeOpenUsedMargin	LN-2	卖保开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
169	FID_SellHedgePosition	UN	卖开仓量(保), 二进制网络序
170	FID_SellHedgeTurnOver	LN-2	卖保成交额, FTDFloatType<14, 2>
171	FID_SellHedgeVolume	UN	卖成交量(保), 二进制网络序
172	FID_SelloffsetFlag	SI	卖开平仓标志 0-开仓 1-平仓
173	FID_SelloffsHPosition	UN	卖平今量(保), 二进制网络序
174	FID_SelloffsSPosition	UN	卖平今量(投), 二进制网络序
175	FID_SellPrice	LN-4	卖报价, FTDFloatType<12, 4>
176	FID_SellSpecOffsetMargin	LN-2	卖投平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
177	FID_SellSpecOffsetProfit	LN-2	卖投平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
178	FID_SellSpecOpenFrozMargin	LN-2	卖投开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
179	FID_SellSpecOpenUsedMargin	LN-2	卖投开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
180	FID_SellSpecPosition	UN	卖开仓量(投), 二进制网络序
181	FID_SellSpecTurnOver	LN-2	卖投成交额, FTDFloatType<14, 2>

FID	字段名称	类型	描述
182	FID_SellSpecVolume	UN	卖成交量(投), 二进制网络序
183	FID_SendTime	DT	发送时间 hhmmss
184	FID_SequenceNo	UN	序列号 , 二进制网络序
185	FID_SequenceSeries (同 FID_DataFlowFlag)	SI	序列类别号, 二进制网络序 数据流名称: 0->对话流 1->私有流 2->广播流
186	FID_ServerAppName	S	会员应用系统名称 目前未用, FTDStringType<20>
187	FID_SettleFlag	SI	0—开仓 1—平仓
188	FID_SettlePrice	LN-4	当日交割结算价, FTDFloatType<12, 4>
189	FID_ShortCutKey	C	输入快捷键, 目前未用 目前为 0
190	FID_ShortOffsFrozHPosition	UN	空头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
191	FID_ShortOffsFrozSPosition	UN	空头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
192	FID_ShortOpenFrozHPosition	UN	空头开仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
193	FID_ShortOpenFrozSPosition	UN	空头开仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
194	FID_SpdDate	D	开始日期
195	FID_SpdEndDate	D	结束日期
196	FID_StartDelvDate	D	开始交割日 目前未用
197	FID_StartTime	DT	开始时间 目前未用
198	FID_StartTrdDate	D	开始交易日
199	FID_StayTime	UN	设定停留时间(秒), 0 表示不限制, 二进制网络序
200	FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
201	FID_SuspendTime	DT	挂起时间
202	FID_ThroughTime	DT	直到时间 目前未用
203	FID_Tick	LN-4	最小变动价位, FTDFloatType<12, 4>, 例如, 小麦为 1, 棉花为 5
204	FID_TimeOut	S	发送监测信号时间间隔 目前未用, FTDStringType<3>
205	FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用, FTDStringType<3>
206	FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss
207	FID_TotalMarketMatchData	UN	发送成交行情记录总数, 二进制网络序
208	FID_TotalVolume	UN	总成交量, 二进制网络序
209	FID_TradeDate	D	交易委托日期
210	FID_TradeId	S	成交编号, FTDStringType<20>
211	FID_TradeLot	UN	总成交手数, 双向计算, 二进制网络序
212	FID_TradePrice	LN-4	最新成交价格, FTDFloatType<12, 4>
213	FID_TradeRights	SI	交易权限 0->完全, 1->只可平, 2->不准交易
214	FID_TradeTurnover	UN	总成交金额, 双向计算, 二进制网络序
215	FID_TradeType	SI	市场交易类型 目前为 0
216	FID_TradeVolume	UN	今成交量, 二进制网络序

FID	字段名称	类型	描述
217	FID_Unbalance	UN	未建仓数量, 二进制网络序
218	FID_Unit	UN	每手乘数, 例如, WT/WT/GN=10, CF=5, 二进制网络序
219	FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
220	FID_URLLink	S	此消息的 WEB 联结 目前未用, FTDSStringType<200>
221	FID_UserId	S	交易员编码, FTDSStringType<15>
222	FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyymmdd
223	FID_VirtualQty	UN	可建仓数量, 二进制网络序
224	FID_VolAskLot	UN	总卖出数量, 二进制网络序
225	FID_VolBidLot	UN	总买入数量, 二进制网络序
226	FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
227	FID_VolumeTotal	UN	剩余总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
228	FID_VolumeTotalOrginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
229	FID_WDTime	DT	撤消时间
230	FID_YdBuyHedgePosition	UN	前买持仓量(保), 二进制网络序
231	FID_YdBuyOffsHPosition	UN	买平昨量(保), 二进制网络序
232	FID_YdBuyOffsSPosition	UN	买平昨量(投), 二进制网络序
233	FID_YdBuySpecPosition	UN	前买持仓量(投), 二进制网络序
234	FID_YdLongOffsFrozHPosition	UN	上日多头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
235	FID_YdLongOffsFrozSPosition	UN	上日多头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
236	FID_YdSellHedgePosition	UN	前卖持仓量(保), 二进制网络序
237	FID_YdSellOffsHPosition	UN	卖平昨量(保), 二进制网络序
238	FID_YdSellOffsSPosition	UN	卖平昨量(投), 二进制网络序
239	FID_YdSellSpecPosition	UN	前卖持仓量(投), 二进制网络序
240	FID_YdShortOffsFrozHPosition	UN	上日空头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
241	FID_YdShortOffsFrozSPosition	UN	上日空头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序

3. 业务命令报文

说明: 在以下每个请求中 (即用户要发送的数据包) 除了表格中所列的字段外, 还需填写 FID_SequenceNo 字段, 在收到的数据包中除了表中所列的字段还将得到 FID_Chain、FID_SequenceNo、FID_DataFlowFlag 三个字段。

3.1 交易员登录请求 (PID): 0x00016

ReqUserLogin 命令号 (PID): 0x00016

字段:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称: 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ConnectionReference	S	链路标示, 目前未用
FID_ServerAppName	S	会员应用系统名称
FID_ProtocolVersion	S	使用 FTD 版本号, 目前=2, 11
FID_TimeOut	S	发送监测信号时间间隔, 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址, 如 192.168.99.100
FID_SequenceNo	UN	序列号, 二进制网络序
FID_INIT_PASSWORD	S	链路初始密码
FID_AUTH_SERIAL_NO	S	授权序列号
FID_AUTH_CODE	S	授权码

3.2 交易员登录应答 (PID): 0x10016

RspUserLogin 命令号 (PID): 0x10016

字段:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址<-交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号
FID_MarketId	S	市场编码 目前为"ZCE001"
FID_MarketStatusId	SI	市场交易状态
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyyymmddhhmmss

3.3 交易员登录退出请求 (PID): 0x00017

ReqUserLogout 命令号 (PID): 0x00017

字段:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码

3.4 交易员登录退出应答 (PID): 0x10017

RspUserLogout 命令号 (PID): 0x10017

字段:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyyymmddhhmmss
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyyymmddhhmmss

3.5 交易员修改密码请求: (PID): 0x00018

ReqUserPasswordUpdate 命令号 (PID): 0x00018

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_NewPassword	S	新口令
FID_OldPassword	S	旧口令

3.6 交易员修改密码应答 (PID): 0x10018

RspUserPasswordUpdate 命令号 (PID): 0x10018

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码

FID_NewPassword	S	新口令
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.7 报单录入请求 (PID): 0x00003

ReqOrderInsert 命令号 (PID): 0x00003

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损订单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOriginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求报价, 104->期权权力行使, 106->期权权力放弃
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_MessageReference	S	用户自定义数据。备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿

3.8 报单应答 (PID): 0x10003

RspOrderInsert 命令号 (PID): 0x10003

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损订单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOriginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求 报价, 104->期权权力行使, 106->期权权力放弃
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_MessageReference	S	用户自定义数据。备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyyymmddhhmmss

3.9 做市商报价响应录入请求 (PID): 0x03003

ReqQuotMarketRsp 命令号 (PID): 0x03003

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	序列号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码

FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_BuyOffsetFlag	SI	买开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_BuyPrice	LN-4	买报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SellOffsetFlag	SI	卖开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_SellPrice	LN-4	卖报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_StayTime	UN	设定停留时间(秒), 0 表示不限制, 二进制网络序
FID_ReqSeqNum	S	报价请求序列号

3.10 做市商报价响应应答 (PID): 0x13003

RspQuotMarketRsp 命令号 (PID) :0x13003

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	序列号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_BuyOffsetFlag	SI	买开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_BuyPrice	LN-4	买报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SellOffsetFlag	SI	卖开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_SellPrice	LN-4	卖报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_StayTime	UN	设定停留时间(秒), 0 表示不限制, 二进制网络序
FID_ReqSeqNum	S	报价请求序列号
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.11 报单操作请求 (PID): 0x00004

ReqOrderAction 命令号 (PID): 0x00004

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderActionCode	SI	报单操作类型码 0->删除, 1->挂起, 2->激活
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_ActionLocalId	S	报单操作本地编号
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0

FID_UserId	S	交易员编码
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 104->期权 权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃

3.12 报单操作应答 (PID): 0x10004

RspOrderAction 命令号 (PID): 0x10004

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderActionCode	SI	报单操作类型码 0->删除, 1->挂起, 2->激活
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_ActionLocalId	S	报单操作本地编号
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_UserId	S	交易员编码
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 104->期权 权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.13 报单查询请求 (PID): 0x00006

ReqQryOrder 命令号 (PID): 0x00006

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderSysId	S	合同编号

3.14 报单查询应答 (PID): 0x10006

RspQryOrder 命令号 (PID): 0x10006

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号

FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损定单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOriginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求报价, 104->期权权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
FID_VolumeTotal	UN	剩余总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_OrderStatus	SI	报单状态 0->全部成交, 1->部分成交还在队列中, 2->部分成交不在队列中, 3->未成交还在队列中, 4->未成交不在队列中, 5->撤单 6->止损单触发 部分成交还在队列中: 定单激活, 未成交量<申报数量 部分成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量<申报数量 未成交还在队列中: 定单激活, 未成交量=申报数量 未成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量=申报数量
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_ActiveTime	DT	激活时间
FID_SuspendTime	DT	挂起时间
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_ActiveUserId	S	操作交易员编码
FID_Margin	LN-4	保证金, FTDFloatType<12, 4>
FID_ForceGroupId	S	强平组号 目前未用
FID_TradePrice	LN-4	最新成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_TradeVolume	UN	今成交量, 二进制网络序
FID_MessageReference	S	用户自定义数据。备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿
FID_ErrorCode	S	错误代码

FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.15 按定单类型报单查询请求 (PID) : 0x03010

ReqQryOrderBySysId 命令号 (PID) : 0x03010

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	起始合同编号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_OrderCMBType	SI	报单类型: 按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损 bit7->组合定单

3.16 按定单类型报单查询应答 (PID): 0x13010

RspQryOrderBySysId 命令号 (PID): 0x13010

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损定单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOrginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求报价, 104->期权权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
FID_VolumeTotal	UN	剩余总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyymmdd

FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_OrderStatus	SI	报单状态 0->全部成交, 1->部分成交还在队列中, 2->部分成交不在队列中, 3->未成交还在队列中, 4->未成交不在队列中, 5->撤单 6->止损单触发 部分成交还在队列中: 定单激活, 未成交量<申报数量 部分成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量<申报数量 未成交还在队列中: 定单激活, 未成交量=申报数量 未成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量=申报数量
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_ActiveTime	DT	激活时间
FID_SuspendTime	DT	挂起时间
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_ActiveUserId	S	操作交易员编码
FID_Margin	LN-4	保证金, FTDFloatType<12, 4>
FID_ForceGroupId	S	强平组号 目前未用
FID_TradePrice	LN-4	最新成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_TradeVolume	UN	今成交量, 二进制网络序
FID_MessageReference	S	用户自定义数据。备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.17 按本地定单号报单查询请求 (PID): 0x03013

ReqQryOrderByLocalId 命令号 (PID): 0x03013

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_CMBType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_Reserve	S	保留字段, 暂时未用

3.18 按本地定单号报单查询应答 (PID): 0x13013

RspQryOrderByLocalId 命令号 (PID): 0x13013

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损定单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOriginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求报价, 104->期权权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
FID_VolumeTotal	UN	剩余总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_OrderStatus	SI	报单状态 0->全部成交, 1->部分成交还在队列中, 2->部分成交不在队列中, 3->未成交还在队列中, 4->未成交不在队列中, 5->撤单 6->止损单触发 部分成交还在队列中: 定单激活, 未成交量<申报数量 部分成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量<申报数量 未成交还在队列中: 定单激活, 未成交量=申报数量 未成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量=申报数量
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_ActiveTime	DT	激活时间
FID_SuspendTime	DT	挂起时间
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_ActiveUserId	S	操作交易员编码
FID_Margin	LN-4	保证金, FTDFloatType<12, 4>
FID_ForceGroupId	S	强平组号 目前未用

FID_TradePrice	LN-4	最新成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_TradeVolume	UN	今成交量, 二进制网络序
FID_MessageReference	S	用户自定义数据。备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.19 按变化量报单查询请求 (PID): 0x03046

ReqQryByChgTime 命令号 (PID): 0x03046

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderCMBType	SI	报单类型: 按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损 bit7->组合定单
FID_MessageReference	S	定单备拷, 用 A-Z 的字母表示的变化量
FID_Reserve	S	保留字段

3.20 按变化量报单查询应答 (PID): 0x13046

RspQryByChgTime 命令号 (PID): 0x13046

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损定单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOrginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序

FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求报价, 104->期权权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
FID_VolumeTotal	UN	剩余总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_OrderStatus	SI	报单状态 0->全部成交, 1->部分成交还在队列中, 2->部分成交不在队列中, 3->未成交还在队列中, 4->未成交不在队列中, 5->撤单 6->止损单触发 部分成交还在队列中: 定单激活, 未成交量<申报数量 部分成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量<申报数量 未成交还在队列中: 定单激活, 未成交量=申报数量 未成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量=申报数量
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_ActiveTime	DT	激活时间
FID_SuspendTime	DT	挂起时间
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_ActiveUserId	S	操作交易员编码
FID_Margin	LN-4	保证金, FTDFloatType<12, 4>
FID_ForceGroupId	S	强平组号 目前未用
FID_TradePrice	LN-4	最新成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_TradeVolume	UN	今成交量, 二进制网络序
FID_MessageReference	S	用户自定义数据. 备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.21 套期保值额度查询请求 (PID): 0x03017

ReqQryHedge 命令号 (PID): 0x03017

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码

FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderStatus	SI	报单类型 目前未用

3.22 套期保值额度查询应答 (PID): 0x13017

RspQryHedge 命令号 (PID): 0x13017

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	申请序号, yyyymmdd+序号
FID_HedgeDate	D	申请日期
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0—买 1—卖
FID_OrderStatus	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ReqQty	UN	申请数量 会员申请数量, 二进制网络序
FID_ReqDate	D	申请建仓开始日期
FID_AlwQty	UN	批准数量 交易所批准数量, 二进制网络序
FID_Unbalance	UN	未建仓数量, 二进制网络序
FID_VirtualQty	UN	可建仓数量, 二进制网络序
FID_OpenQty	UN	已建仓数量, 二进制网络序
FID_AlwDate	D	允许建仓最后日期
FID_AlwHisDate	D	历史持仓确认最后日期 AlwHisDate<=AlwDate
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.23 套期保值确认查询请求 (PID): 0x03018

ReqQryHedgeCfm 命令号 (PID): 0x03018

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderStatus	SI	报单类型 目前未用

3.24 套期保值确认应答 (PID): 0x13018

RspQryHedgeCfm 命令号 (PID): 0x13018

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_ReqDate	D	申请建仓开始日期
FID_OrderLocalId	S	本地定单号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0—买 1—卖
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ReqQty	UN	申请数量, 二进制网络序
FID_DealQty	N	成功处理数量 缺省=0, 二进制网络序, 未处理
FID_DealStatus	SI	处理状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.25 跨期套利额度查询请求 (PID): 0x03019

ReqQrySpdFirm 命令号 (PID): 0x03019

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderStatus	SI	报单类型 目前未用

3.26 跨期套利额度应答 (PID): 0x13019

RspQrySpdFirm 命令号 (PID): 0x13019

字段:

名称	类型	描述
FID_SpdDate	D	开始日期
FID_SpdEndDate	D	结束日期
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	第一腿合约编码
FID_SecondLeg	S	第二腿合约编码
FID_Direction	SI	组合合约的买卖 0—买 1—卖
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ReqQty	UN	申请数量 会员申请数量, 二进制网络序

FID_AlwQty	UN	批准数量 交易所批准数量, 二进制网络序
FID_RemainQty	UN	剩余额度 (可建仓数量), 二进制网络序
FID_Balance	UN	已建仓数量, 二进制网络序
FID_HoldQty	UN	持仓数量, 二进制网络序, 目前未用
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.27 跨期套利确认查询请求 (PID): 0x03020

ReqQrySpdApply 命令号 (PID): 0x03020

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderStatus	SI	报单类型 目前未用

3.28 跨期套利确认应答 (PID): 0x13020

RspQrySpdApply 命令号 (PID): 0x13020

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderDate	DT	申请日期
FID_OrderLocalId	S	本地定单号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	第一腿合约编码
FID_SecondLeg	S	第二腿合约编码
FID_Direction	SI	组合合约买卖 0—买 1—卖
FID_CmbType	SI	组合类型 0-SPZ 1-SPD 2-IPS 3-BUL 4-BER 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ReqQty	UN	申请数量, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳, format=yyyymmddhhmmss

3.29 做市商报价响应查询请求 (PID): 0x03026

ReqQryQuotMarket 命令号 (PID): 0x03026

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码, 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600

3.30 做市商报价响应应答 (PID): 0x13026

RspQryQuotMarket 命令号 (PID): 0x13026

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	序列号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_BuyOffsetFlag	SI	买开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_BuyPrice	LN-4	买报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SellOffsetFlag	SI	卖开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_SellPrice	LN-4	卖报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_StayTime	UN	设定停留时间(秒), 0 表示不限制, 二进制网络序
FID_ReqSeqNum	S	报价请求序列号
FID_WDTime	DT	撤消时间
FID_OrderStatus2	SI	状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ResponseTime	DT	请求响应时间
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.31 期权执行查询请求 (PID): 0x03025

ReqQryOptionEApply 命令号 (PID): 0x03025

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码

FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 期权=WS509C1600

3.32 期权执行应答 (PID): 0x13025

RspQryOptionEApply 命令号 (PID): 0x13025

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 期权=WS509C1600
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_ReqDate	DT	申请日期
FID_WDTime	DT	撤单时间
FID_ReqQty	UN	申请数量, 二进制网络序
FID_SettleFlag	SI	0—开仓 1—平仓
FID_ActionType	C	执行类型, 'E'—执行 (OPTION_EXEC), 'C'—放弃 (OPTION_ABANDON)
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.33 市场查询请求 (PID): 0x0000B

ReqQryMarket 命令号 (PID): 0x0000B

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 "ZCE001"

3.34 市场查询应答 (PID): 0x1000B

RspQryMarket 命令号 (PID): 0x1000B

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 目前为"ZCE001"
FID_MarketName	S	市场名称
FID_BroadcastSequenceSeries	UN	广播模式序列类别号, 二进制网络序

FID_TradeType	SI	市场交易类型 目前为 0
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.35 市场交易状态查询请求 (PID): 0x0000D

ReqQryMarketStatus 命令号 (PID): 0x0000D

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 "ZCE001"

3.36 市场交易状态应答 (PID): 0x1000D

RspQryMarketStatus 命令号 (PID): 0x1000D

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 目前为 "ZCE001"
FID_MarketStatusId	SI	市场交易状态
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.37 合约查询请求 (PID): 0x00005

ReqQryInstrument 命令号 (PID): 0x00005

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 "ZCE001"
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600

3.38 合约查询应答 (PID): 0x10005

RspQryInstrument 命令号 (PID): 0x10005

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 目前为 "ZCE001"
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_InstrumentName	S	合约名称

FID_ShortCutKey	C	输入快捷键 目前未用 目前为 0
FID_StartTrdDate	D	开始交易日
FID_EndTrdDate	D	最后交易日
FID_InstrumentType	SI	合约类型 0:期货, 1:期权, 2:组合
FID_EndDelvDate	D	最后交割日
FID_StartDelvDate	D	开始交割日 目前未用
FID_InstrStopCode	SI	停止交易原因 目前为 0
FID_Currency	S	交易用的货币 交易用的货币, 目前="RMB"
FID_TradeRights	SI	交易权限 0->完全, 1->只可平, 2->不准交易
FID_FuseRights	SI	可否熔断 1->真, 0->假, 目前为 0
FID_Unit	UN	每手乘数, 例如, WT/WT/GN=10, CF=5, 二进制网络序
FID_Tick	LN-4	最小变动价位, FTDFloatType<12, 4>, 例如, 小麦为 1, 棉花为 5
FID_HighLimitRate	S	涨停板率 目前未用
FID_LowLimitRate	S	跌停板率 目前未用
FID_MaxLot	UN	最大可下单手数, 限价单每笔的最大手数, 目前为 1000, 二进制网络序
FID_MinLot	UN	最小可下单手数 目前为 1, 二进制网络序
FID_Pubstyle	SI	竞价阶段合约行情发布方式 0->不发布, 1->发布
FID_Fuselimit	LN-2	熔断限额 目前未用
FID_Fusepersisttime	UN	熔断最大持续时间, 二进制网络序, 目前未用
FID_Fusepoint	DT	在该时间点后不可熔断 目前未用
FID_FuseFlag	SI	熔断标记 1->真, 0->假 目前未用
FID_Forcedistime	UN	强平的撮合间隔, 二进制网络序, 目前未用
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.39 合约交易状态查询请求 (PID): 0x0000E

ReqQryInstrumentStatus 命令号 (PID): 0x0000E

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 "ZCE001"
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600

3.40 合约交易状态应答 (PID): 0x1000E

RspQryInstrumentStatus 命令号 (PID): 0x1000E

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600

FID_InstrumentStatus	C	合约交易状态 (N—正常, S—挂起, D—删除)
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.41 组合合约查询请求 (PID): 0x03015

ReqQryCMBInstrument 命令号 (PID): 0x03015

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 "ZCE001"
FID_CmbType	SI	组合类型 1-SPD, 2--IPS
FID_InstrumentId	S	第 1 腿期货合约
FID_SecondLeg	S	第 2 腿期货合约

3.42 组合合约应答 (PID): 0x13015

RspQryCMBInstrument 命令号 (PID): 0x13015

字段:

名称	类型	描述
FID_CmbType	SI	组合类型 1-SPD, 2 -IPS
FID_InstrumentId	S	第 1 腿期货合约
FID_SecondLeg	S	第 2 腿期货合约
FID_InstrumentName	S	合约名称
FID_InstrumentStatus	C	合约交易状态 N—正常, S—挂起, D—删除
FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序
FID_VolBidLot	UN	总买入数量, 二进制网络序
FID_VolAskLot	UN	总卖出数量, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.43 客户信息查询请求 (PID): 0x0000C

ReqQryClient 命令号 (PID): 0x0000C

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码

FID_ClientId	S	客户编码
--------------	---	------

3.44 客户信息应答 (PID): 0x1000C

RspQryClient 命令号 (PID): 0x1000C

字段:

名称	类型	描述
FID_ClientId	S	客户编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientName	S	客户名称
FID_ClientType	C	客户类别 目前未用
FID_TradeRights	SI	交易权限 目前=0
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.45 会员资金查询请求 (PID): 0x00008

ReqQryDeposit 命令号 (PID): 0x00008

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码

3.46 会员资金应答 (PID): 0x10008

RspQryDeposit 命令号 (PID): 0x10008

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ParticipantType	SI	会员类型 0->自营, 1->经纪, 2->综合, 3->特别, 4->做市商
FID_TradeDate	D	交易委托日期
FID_InitMargin	LN-2	初始保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuySpecOpenUsedMargin	LN-2	买投开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuyHedgeOpenUsedMargin	LN-2	买保开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellSpecOpenUsedMargin	LN-2	卖投开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellHedgeOpenUsedMargin	LN-2	卖保开仓使用保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuySpecOffsetProfit	LN-2	买投平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuyHedgeOffsetProfit	LN-2	买保平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellSpecOffsetProfit	LN-2	卖投平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellHedgeOffsetProfit	LN-2	卖保平仓盈亏, FTDFloatType<14, 2>

FID_BuySpecOpenFrozMargin	LN-2	买投开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuyHedgeOpenFrozMargin	LN-2	买保开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellSpecOpenFrozMargin	LN-2	卖投开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellHedgeOpenFrozMargin	LN-2	卖保开仓冻结保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuySpecOffsetMargin	LN-2	买投平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuyHedgeOffsetMargin	LN-2	买保平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellSpecOffsetMargin	LN-2	卖投平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellHedgeOffsetMargin	LN-2	卖保平仓返回保证金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuySpecTurnOver	LN-2	买投成交额, FTDFloatType<14, 2>
FID_BuyHedgeTurnOver	LN-2	买保成交额, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellSpecTurnOver	LN-2	卖投成交额, FTDFloatType<14, 2>
FID_SellHedgeTurnOver	LN-2	卖保成交额, FTDFloatType<14, 2>
FID_AddValue	LN-2	本交易日新增资金, FTDFloatType<14, 2>
FID_DelValue	LN-2	本交易日提出资金, FTDFloatType<14, 2>
FID_BalanceValue	LN-2	可用保证金余额, FTDFloatType<14, 2>
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.47 成交行情查询请求 (PID): 0x00002

ReqQryMarketMatchData 命令号 (PID): 0x00002

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600

3.48 成交行情应答 (PID): 0x10002

RspQryMarketMatchData 命令号 (PID): 0x10002

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_PreClose	LN-4	前收盘价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_PreSettle	LN-4	前结算价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_PreOpenInterest	UN	昨日空盘量, 双向计算, 二进制网络序
FID_OpenPrice	LN-4	开盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序

FID_LastPrice	LN-4	最新价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LastLot	UN	最后一笔成交手数, 双向计算, 二进制网络序
FID_TradeLot	UN	总成交手数, 双向计算, 二进制网络序
FID_TradeTurnover	UN	总成交金额, 双向计算, 二进制网络序
FID_OpenInterest	UN	持仓量, 二进制网络序
FID_HighPrice	LN-4	最高价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowPrice	LN-4	最低价, FTDFloatType<12, 4>
FID_ClosePrice	LN-4	收盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SettlePrice	LN-4	当日交割结算价, FTDFloatType<12, 4>
FID_ClearPrice	LN-4	结算价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AveragePrice	LN-4	均价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LifeHigh	LN-4	历史最高成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LifeLow	LN-4	历史最低成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_HighLimit	LN-4	涨停板, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowLimit	LN-4	跌停板, FTDFloatType<12, 4>
FID_TotalVolume	UN	总成交量, 二进制网络序
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_MarketMatchDataStatus	SI	是否主动发送成交行情 1->真, 0->假
FID_TotalMarketMatchData	UN	发送成交行情记录总数, 二进制网络序
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.49 按合同编号成交合约查询请求 (PID): 0x00007

ReqQryTrade 命令号 (PID): 0x00007

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_StartTime	DT	开始时间 目前未用
FID_ThroughTime	DT	直到时间 目前未用

3.50 按合同编号成交合约应答 (PID): 0x10007

RspQryTrade 命令号 (PID): 0x10007

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_CancelFlag	SI	定单类型 0->普通定单, 1->止损定单, 2->组合定单 3->做市商报价响应定单
FID_CancelDate	D	取消日期 目前未用
FID_CancelTime	DT	取消时间 目前未用
FID_TradeId	S	成交编号
FID_MatchDate	D	成交日期
FID_MatchTime	DT	成交时间
FID_ClearDate	D	清算日期 目前未用
FID_Price	LN-4	价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_OrderSysId	S	合同编号 (定单合约号)
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.51 按成交编号成交合约查询请求 (PID): 0x03014

ReqQryTradeByTradeId 命令号 (PID): 0x03014

字段:

名称	类型	描述
FID_TradeId	S	起始成交编号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_OrderCMBType	SI	报单类型: 按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损 bit7->组合定单

3.52 按成交编号成交合约应答 (PID): 0x13014

RspQryTradeByTradeId 命令号 (PID): 0x13014

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_CancelFlag	SI	定单类型 0->普通定单, 1->止损定单, 2->组合定单 3->做市商报价响应定单
FID_CancelDate	D	取消日期 目前未用
FID_CancelTime	DT	取消时间 目前未用
FID_TradeId	S	成交编号
FID_MatchDate	D	成交日期
FID_MatchTime	DT	成交时间
FID_ClearDate	D	清算日期 目前未用
FID_Price	LN-4	价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_OrderSysId	S	合同编号 (定单合约号)
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.53 会员持仓查询请求 (PID): 0x00009

ReqQryPPosition 命令号 (PID): 0x00009

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_InstrumentId	S	合约编码例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600

3.54 会员持仓应答 (PID): 0x10009

RspQryPPosition 命令号 (PID): 0x10009

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_InstrumentId	S	合约编码例如, 期货为 WS509 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_TradeDate	D	交易委托日期

FID_YdBuyHedgePosition	UN	前买持仓量(保), 二进制网络序
FID_YdBuySpecPosition	UN	前买持仓量(投), 二进制网络序
FID_YdSellHedgePosition	UN	前卖持仓量(保), 二进制网络序
FID_YdSellSpecPosition	UN	前卖持仓量(投), 二进制网络序
FID_BuyHedgeVolume	UN	买成交量(保), 二进制网络序
FID_BuySpecVolume	UN	买成交量(投), 二进制网络序
FID_SellHedgeVolume	UN	卖成交量(保), 二进制网络序
FID_SellSpecVolume	UN	卖成交量(投), 二进制网络序
FID_BuyHedgePosition	UN	买开仓量(保), 二进制网络序
FID_BuySpecPosition	UN	买开仓量(投), 二进制网络序
FID_SellHedgePosition	UN	卖开仓量(保), 二进制网络序
FID_SellSpecPosition	UN	卖开仓量(投), 二进制网络序
FID_BuyOffsHPosition	UN	买平今量(保), 二进制网络序
FID_BuyOffsSPosition	UN	买平今量(投), 二进制网络序
FID_SellOffsHPosition	UN	卖平今量(保), 二进制网络序
FID_SellOffsSPosition	UN	卖平今量(投), 二进制网络序
FID_YdBuyOffsHPosition	UN	买平昨量(保), 二进制网络序
FID_YdBuyOffsSPosition	UN	买平昨量(投), 二进制网络序
FID_YdSellOffsHPosition	UN	卖平昨量(保), 二进制网络序
FID_YdSellOffsSPosition	UN	卖平昨量(投), 二进制网络序
FID_LongOpenFrozHPosition	UN	多头开仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_LongOpenFrozSPosition	UN	多头开仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_ShortOpenFrozHPosition	UN	空头开仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_ShortOpenFrozSPosition	UN	空头开仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_LongOffsFrozHPosition	UN	多头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_LongOffsFrozSPosition	UN	多头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_ShortOffsFrozHPosition	UN	空头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_ShortOffsFrozSPosition	UN	空头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_YdLongOffsFrozHPosition	UN	上日多头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_YdLongOffsFrozSPosition	UN	上日多头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_YdShortOffsFrozHPosition	UN	上日空头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_YdShortOffsFrozSPosition	UN	上日空头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.55 会员客户持仓查询请求 (PID): 0x0000A

ReqQryPosition 命令号 (PID): 0x0000A

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码

FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码例如, 期货为 WS509 期权为 WS509C1600

3.56 会员客户持仓应答 (PID): 0x1000A

RspQryPosition 命令号 (PID): 0x1000A

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码例如, 期货为 WS509 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_TradeDate	D	交易委托日期
FID_YdBuyHedgePosition	UN	前买持仓量(保), 二进制网络序
FID_YdBuySpecPosition	UN	前买持仓量(投), 二进制网络序
FID_YdSellHedgePosition	UN	前卖持仓量(保), 二进制网络序
FID_YdSellSpecPosition	UN	前卖持仓量(投), 二进制网络序
FID_BuyHedgeVolume	UN	买成交量(保), 二进制网络序
FID_BuySpecVolume	UN	买成交量(投), 二进制网络序
FID_SellHedgeVolume	UN	卖成交量(保), 二进制网络序
FID_SellSpecVolume	UN	卖成交量(投), 二进制网络序
FID_BuyHedgePosition	UN	买开仓量(保), 二进制网络序
FID_BuySpecPosition	UN	买开仓量(投), 二进制网络序
FID_SellHedgePosition	UN	卖开仓量(保), 二进制网络序
FID_SellSpecPosition	UN	卖开仓量(投), 二进制网络序
FID_BuyOffsHPosition	UN	买平今量(保), 二进制网络序
FID_BuyOffsSPosition	UN	买平今量(投), 二进制网络序
FID_SellOffsHPosition	UN	卖平今量(保), 二进制网络序
FID_SellOffsSPosition	UN	卖平今量(投), 二进制网络序
FID_YdBuyOffsHPosition	UN	买平昨量(保), 二进制网络序
FID_YdBuyOffsSPosition	UN	买平昨量(投), 二进制网络序
FID_YdSellOffsHPosition	UN	卖平昨量(保), 二进制网络序
FID_YdSellOffsSPosition	UN	卖平昨量(投), 二进制网络序
FID_LongOpenFrozHPosition	UN	多头开仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_LongOpenFrozSPosition	UN	多头开仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_ShortOpenFrozHPosition	UN	空头开仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_ShortOpenFrozSPosition	UN	空头开仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_LongOffsFrozHPosition	UN	多头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_LongOffsFrozSPosition	UN	多头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_ShortOffsFrozHPosition	UN	空头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_ShortOffsFrozSPosition	UN	空头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_YdLongOffsFrozHPosition	UN	上日多头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序

FID_YdLongOffsFrozSPosition	UN	上日多头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_YdShortOffsFrozHPosition	UN	上日空头平仓冻结持仓手(保), 二进制网络序
FID_YdShortOffsFrozSPosition	UN	上日空头平仓冻结持仓手(投), 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.57 会员客户组合持仓查询请求 (PID): 0x03031

ReqQryCMBPosition 命令号 (PID): 0x03031

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_Direction	SI	买卖方向 0—买 1—卖
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 0-SPZ 1-SPD 2-IPS 3-BUL 4-BER 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG 9-PRT
FID_InstrumentId	S	第一腿合约编码
FID_SecondLeg	S	第二腿合约编码

3.58 会员客户组合持仓应答 (PID): 0x13031

RspQryCMBPosition 命令号 (PID): 0x13031

字段:

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_Direction	SI	买卖方向 0—买 1—卖
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 0-SPZ 1-SPD 2-IPS 3-BUL 4-BER 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG 9-PRT
FID_InstrumentId	S	第一腿合约编码
FID_SecondLeg	S	第二腿合约编码
FID_Volume	UN	组合数量, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.59 错误响应（PID）： 0x10001

Error 命令号（PID）： 0x10001

字段：

名称	类型	描述
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss
FID_SequenceSeries	SI	序列类别号，二进制网络序
FID_SequenceNo	UN	序列号，二进制网络序
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号

3.60 合约参数改变通知（PID）： 0x12007

InstrumentChangeNotify 命令号（PID）： 0x12007

字段：

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 目前为“ZCE001”
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如，期货为 WS509，期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_InstrumentName	S	合约名称
FID_ShortCutKey	C	输入快捷键 目前未用 目前为 0
FID_StartTrdDate	D	开始交易日
FID_EndTrdDate	D	最后交易日
FID_InstrumentType	SI	合约类型 0:期货, 1:期权, 2:组合
FID_EndDelvDate	D	最后交割日
FID_StartDelvDate	D	开始交割日 目前未用
FID_InstrStopCode	SI	停止交易原因 目前为 0
FID_Currency	S	交易用的货币 交易用的货币，目前为“RMB”
FID_TradeRights	SI	交易权限 0->完全, 1->只可平, 2->不准交易
FID_FuseRights	SI	可否熔断 1->真, 0->假，目前为 0
FID_Unit	UN	每手乘数，例如，WT/WT/GN=10, CF=5, 二进制网络序
FID_Tick	LN-4	最小变动价位，FTDFloatType<12, 4>，例如，小麦为 1，棉花为 5
FID_HighLimitRate	S	涨停板率 目前未用
FID_LowLimitRate	S	跌停板率 目前未用
FID_MaxLot	UN	最大可下单手数，限价单每笔的最大手数，目前为 1000，二进制网络序
FID_MinLot	UN	最小可下单手数 目前为 1, 二进制网络序
FID_Pubstyle	SI	竞价阶段合约行情发布方式 0->不发布, 1->发布
FID_Fuselimit	LN-2	熔断限额 目前未用

FID_Fusepersisttime	UN	熔断最大持续时间, 二进制网络序, 目前未用
FID_Fusepoint	DT	在该时间点后不可熔断 目前未用
FID_FuseFlag	SI	熔断标记 1->真, 0->假 目前未用
FID_Forcedistime	UN	强平的撮合间隔, 二进制网络序, 目前未用
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.61 合约状态改变通知 (PID): 0x12006

InstrumentStatusChangeNotify 命令号 (PID): 0x12006

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentStatus	C	合约交易状态 (N-正常, S-挂起, D-删除)
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.62 交易所告示广播 (PID): 0x12003

MarketBulletin 命令号 (PID): 0x12003

字段:

名称	类型	描述
FID_NewsType	S	消息类型 目前=' 0'
FID_NewsUrgency	C	紧急程度 目前未用
FID_SendTime	DT	发送时间 hhmmss
FID_Abstract	S	摘要/说明 目前未用
FID_ComeFrom	S	消息来源 目前未用
FID_MarketId	S	市场编码 目前为"ZCE001"
FID_Content	S	消息正文
FID_URLLink	S	此消息的 WEB 联结 目前未用

3.63 成交行情 (PID): 0x12004

MarketMatchData 命令号 (PID): 0x12004

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0

FID_PreClose	LN-4	前收盘价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_PreSettle	LN-4	前结算价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_PreOpenInterest	UN	昨日空盘量, 双向计算, 二进制网络序
FID_OpenPrice	LN-4	开盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序
FID_LastPrice	LN-4	最新价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LastLot	UN	最后一笔成交手数, 双向计算, 二进制网络序
FID_TradeLot	UN	总成交手数, 双向计算, 二进制网络序
FID_TradeTurnover	UN	总成交金额, 双向计算, 二进制网络序
FID_OpenInterest	UN	持仓量, 二进制网络序
FID_HighPrice	LN-4	最高价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowPrice	LN-4	最低价, FTDFloatType<12, 4>
FID_ClosePrice	LN-4	收盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SettlePrice	LN-4	当日交割结算价, FTDFloatType<12, 4>
FID_ClearPrice	LN-4	结算价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AveragePrice	LN-4	均价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LifeHigh	LN-4	历史最高成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LifeLow	LN-4	历史最低成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_HighLimit	LN-4	涨停板, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowLimit	LN-4	跌停板, FTDFloatType<12, 4>
FID_TotalVolume	UN	总成交量, 二进制网络序
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_MarketMatchDataStatus	SI	是否主动发送成交行情 1->真, 0->假
FID_TotalMarketMatchData	UN	发送成交行情记录总数, 二进制网络序
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_DeriveBidPrice	LN-4	组合买入价
FID_DeriveAskPrice	LN-4	组合卖出价
FID_DeriveBidLot	UN	组合买入数量
FID_DeriveAskLot	UN	组合卖出数量

3.64 组合行情 (PID): 0x13016

CMBInstrumentChangeNotify 命令号 (PID): 0x13016

字段:

名称	类型	描述
FID_CmbType	SI	组合类型 1-SPD, 2-IPS
FID_InstrumentId	S	第1腿期货合约
FID_SecondLeg	S	第2腿期货合约

FID_InstrumentName	S	合约名称
FID_InstrumentStatus	C	合约交易状态 N—正常, S—挂起, D—删除
FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序
FID_VolBidLot	UN	总买入数量, 二进制网络序
FID_VolAskLot	UN	总卖出数量, 二进制网络序

3.65 市场状态改变通知 (PID): 0x12005

MarketStatusChangeNotify 命令号 (PID): 0x12005

字段:

名称	类型	描述
FID_MarketId	S	市场编码 目前为“ZCE001”
FID_MarketStatusId	SI	市场交易状态
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.66 报价请求 (PID): 0x13002

QuotRsp 命令号 (PID): 0x13002

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	序列号
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖, 2->所有 可以不用输入
FID_RequestBy	SI	请求方 (0->一般会员, 1->交易所)

3.67 报单状态确认 (PID): 0x11003

OrderConfirmation 命令号 (PID): 0x11003

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码

FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_StopPrice	LN-4	止损价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LimitPrice	LN-4	限价 (或止损定单的保护价), FTDFloatType<12, 4>
FID_VolumeTotalOriginal	UN	原始总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_OrderType	SI	报单类型 0->限价, 1->市价, 3->止损, 7->组合定单 101->跨期套利确认, 102->持仓套保确认, 103->请求 报价, 104->期权权力行使, 105->报价请求响应, 106->期权权力放弃
FID_VolumeTotal	UN	剩余总申报数量 (以手为单位), 二进制网络序
FID_MatchCondition	SI	报单成交属性 1->即时全部成交, 2->即时部分成交, 3->当日有效, 4->取消前有效, 5->指定日期前有效
FID_MatchSession	C	报单成交时间 目前未用
FID_ValidThrough	D	有效时间约束 yyyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	最小成交量, 二进制网络序, 目前未用
FID_AutoSuspend	SI	自动挂起标志 1->真, 0->假
FID_OrderStatus	SI	报单状态 0->全部成交, 1->部分成交还在队列中, 2-> 部分成交不在队列中, 3->未成交还在队列中, 4->未成交 不在队列中, 5->撤单 6->止损单触发 部分成交还在队列中: 定单激活, 未成交量<申报数量 部分成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量<申报数量 未成交还在队列中: 定单激活, 未成交量=申报数量 未成交不在队列中: 定单挂起, 未成交量=申报数量
FID_InsertTime	DT	录入时间
FID_ActiveTime	DT	激活时间
FID_SuspendTime	DT	挂起时间
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_ActiveUserId	S	操作交易员编码
FID_Margin	LN-4	保证金, FTDFloatType<12, 4>
FID_ForceGroupId	S	强平组号 目前未用
FID_TradePrice	LN-4	最新成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_TradeVolume	UN	今成交量, 二进制网络序
FID_MessageReference	S	用户自定义数据. 备注信息
FID_CmbType	SI	组合定单类型, 1-期货跨期套利, 2-期货跨品种套利, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_SecondLeg	S	组合定单第二腿
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

3.68 跨期套利确认 (PID): 0x13041

OrderSpdApply 命令号 (PID): 0x13041

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderDate	DT	申请日期
FID_OrderLocalId	S	本地定单号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	第一腿合约编码
FID_SecondLeg	S	第二腿合约编码
FID_Direction	SI	组合合约买卖 0—买 1—卖
FID_CmbType	SI	组合类型 0-SPZ 1-SPD 2-IPS 3-BUL 4-BER 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ReqQty	UN	申请数量, 二进制网络序

3.69 套期保值确认 (PID): 0x13040

OrderHedgeCfm 命令号 (PID): 0x13040

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_ReqDate	D	日期
FID_OrderLocalId	S	本地定单号
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_Direction	SI	买卖方向 0—买 1—卖
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ReqQty	UN	申请数量, 二进制网络序
FID_DealQty	N	成功处理数量 缺省=0, 二进制网络序, 未处理
FID_DealStatus	SI	处理状态 0—删除 1—挂起 2—激活

3.70 期权执行确认 (PID): 0x13042

OrderOptionEApply 命令号 (PID): 0x13042

字段:

名称	类型	描述
----	----	----

FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 期权=WS509C1600
FID_OrderSysId	S	合同编号
FID_OrderLocalId	S	本地定单号
FID_OrderDate	DT	请求日期
FID_WDTime	DT	撤消时间
FID_Qty	UN	申请数量, 二进制网络序
FID_SettleFlag	SI	0—开仓 1—平仓
FID_ActionType	C	执行类型, 'E'—执行 (OPTION_EXEC), 'C'—放弃 (OPTION_ABANDON)
FID_OrderStatus2	SI	报单状态 0—删除 1—挂起 2—激活

3.71 做市商报价响应确认 (PID): 0x13026

QuotMarketConfirm 命令号 (PID): 0x13026

字段:

名称	类型	描述
FID_OrderSysId	S	序列号
FID_OrderLocalId	S	委托编号
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_BuyOffsetFlag	SI	买开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_BuyPrice	LN-4	买报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SellOffsetFlag	SI	卖开平仓标志 0—开仓 1—平仓
FID_SellPrice	LN-4	卖报价, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_StayTime	UN	设定停留时间 (秒), 0 表示不限制, 二进制网络序
FID_ReqSeqNum	S	报价请求序列号
FID_WDTime	DT	撤消时间
FID_OrderStatus2	SI	状态 0—删除 1—挂起 2—激活
FID_ResponseTime	DT	请求响应时间

3.72 单边成交回报 (PID): 0x11001

TradeInsertSingle 命令号 (PID): 0x11001

字段:

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码, 例如, 期货为 WS509, 期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0

FID_CancelFlag	SI	定单类型 0->普通定单 1->止损定单 2->组合定单 3->做市商报价响应定单
FID_CancelDate	D	取消日期 目前未用
FID_CancelTime	DT	取消时间 目前未用
FID_TradeId	S	成交编号
FID_MatchDate	D	成交日期
FID_MatchTime	DT	成交时间
FID_ClearDate	D	清算日期 目前未用
FID_Price	LN-4	价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_OrderSysId	S	合同编号(定单合约号)
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Direction	SI	买卖方向 0->买, 1->卖
FID_OffsetFlag	SI	开平仓标记 0->开仓, 1->平仓, 2->强平
FID_HedgeFlag	SI	投保标记 1->投机, 3->套期保值
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_ClientId	S	客户编码
FID_OrderLocalId	S	委托编号

4. 业务处理流程

4.1 对话流交易员登录

- 1) 会员系统在发送任何请求报文之前, 首先进行登录;
- 2) 用 API_connect 建立通讯连接;
- 3) 会员系统发出对话流登录请求(必要信息: 数据流号(序列类别号)=0, 交易员代码, 密码, 序列号=0 等);
- 4) 成功登录, 交易系统响应:(该交易员本日最大下单成功的本地委托编号 MaxOrderLocalId, 交易系统状态, 交易日期时间); 登录失败, 交易系统给出失败原因。

4.2 私有流交易员登录

- 1) 会员系统在接收私有流数据之前, 首先进行登录;
- 2) 用 API_connect 建立通讯连接;
- 3) 会员系统发出私有流登录请求(必要信息: 数据流号=1, 交易员代码, 密码, 请求从 iStart_SeqNo 序号后开始通过私有流发送数据等);
- 4) 交易系统响应, 成功登录:(交易系统返回该交易员本日最大私有流序号->MaxOrderLocalId 字段);
- 5) 如果 iStart_SeqNo=0, 则交易系统从序列号 1 开始通过私有流发送报文;
- 6) 如果 iStart_SeqNo>0, 则交易系统从序列号 iStart_SeqNo+1 开始通过私有流发送

报文。

4.3 广播流交易员登录

- 1) 会员系统在接收广播流数据之前，首先进行登录；
- 2) 用 API_connect 建立通讯连接；
- 3) 会员系统发出广播流登录请求（必要信息：数据流号=2，交易员代码，密码，请求从 iStart_SeqNo 序号后开始发送广播流数据等）；
- 4) 交易系统响应，成功登录：（交易系统返回本日最大广播流序号—>MaxOrderLocalId 字段）；
- 5) 交易系统在广播流上发送序列号=0 的特殊报文，即单腿成交行情 MarketMatchData 报文；
- 6) 如果 iStart_SeqNo=0，则交易系统从序列号 1 开始发送广播流报文；
- 7) 如果 iStart_SeqNo>0，则交易系统从序列号 iStart_SeqNo+1 开始发送广播流报文。

4.4 行情发送方式

ZCE AMCS4.0 市场交易行情分单腿行情和组合行情，单腿行情和组合行情的发送机制采用完全成交行情发送方式，即会员系统登录广播流时交易系统主动发送单腿完整行情，会员系统使用组合合约查询功能取得完整组合行情，在交易过程中，当单腿行情或组合行情发生变化时，交易系统发送变化的单腿成交行情报文或组合行情报文。

单腿成交行情 MarketMatchData 报文有两种可能的情况，分别是完整的成交行情和变化的成交行情。

完整的成交行情是对一个合约当前行情的完整描述，而变化的成交行情提供的是一个合约行情信息中不断变化的信息。完整的成交行情在正常的广播流中是不发送的，要想得到完整的成交行情有两种方式：

- 1) 广播流登录后，交易系统主动发送完整的成交行情，序列号为 0；
- 2) 使用查询方式查询成交行情。

期贷的跨期套利（SPD）和跨产品套利（IPS）存在组合行情。组合行情有两个报文，分别是 RspQryCMBInstrument 和 CMBInstrumentChangeNotify（在没有错误发生时，这两个报文包含相同的字段；有错误发生时，RspQryCMBInstrument 报文还将包含 3 个描述错误信息的字段）。组合行情包含对一个组合合约当前行情的完整描述。当有组合行情发生变化时，交易系统在广播流中发送 CMBInstrumentChangeNotify（PID=0x13016）报文。CMBInstrumentChangeNotify 报文只发送变化的组合行情。会员系统要想得到完整的组合合约信息（行情），需要使用组合行情信息查询 ReqQryCMBInstrument（PID=0x03015）报文。

4.5 交易系统的合约组织

- 1) 单腿合约表
- 2) 组合合约表

通常在会员系统初始化时，通过合约查询 ReqQryInstrument(PID=0x00005)指令得到完整单腿合约信息，通过组合合约查询 ReqQryCMBInstrument(PID=0x03015)指令得到完整的

组合合约信息。

4.6 交易系统的持仓组织

- 1) 单腿持仓
- 2) 组合持仓

通常在会员系统初始化时，通过会员单腿持仓查询ReqQryPPosition (PID=0x00009) 指令，查询会员单腿持仓。通过客户单腿持仓查询ReqQryPosition (PID=0x0000A) 指令，查询客户单腿持仓。通过客户组合持仓查询ReqQryCMBPosition (PID=0x03031) 指令，查询客户组合持仓。组合持仓的类型分为：0-SPZ、1-SPD、2-IPS、3-BUL、4-BER、5-BLT、6-BRT、7-STD、8-STG和 9-PRT（有保护期权期货组合）。

4.7 交易系统的定单类型

- 1) 正常单腿定单 Order
- 2) 止损定单 StopOrder
- 3) 组合定单 CmbOrder
- 4) 跨期套利确认定单 SpdOrder
- 5) 套期保值确认定单 HedgeOrder
- 6) 期权执行定单 OptExeOrder
- 7) 做市商报价响应定单 QuotRspOrder

以上每一种定单的每一个记录的数量或状态发生变化，交易系统给相应交易员的私有流发送一条报单状态确认报文。

注意：在查询定单时需要指明查询哪一种类型的定单，查询跨期套利确认定单、套期保值确认定单、期权执行定单和做市商报价响应定单需用不同的指令。

4.8 报单录入和报单操作（撤单）过程

- 1) 会员通过对话流发出报单录入 ReqOrderInsert (PID=0x00003) 报文；
- 2) 交易系统确认此报文后，通过对话流给予报单应答 RspOrderInsert (PID=0x10003) 报文；
- 3) 交易系统更新 Order 表，生成报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003) 报文，通过私有流发送给交易员（OrderConfirmation 报文实际上是最新定单变化情况报文）；根据 OrderConfirmation 报文，会员系统随时更新自己的定单表；在每日会员系统初始化数据时，从交易系统查询自己的全部定单（这些定单主要是长期有效定单），之后根据 OrderConfirmation 报文，更新定单状态（报单状态确认 OrderConfirmation 报文与报单录入 ReqOrderInsert 报文并不一一对应，报单状态确认 OrderConfirmation 报文不包括报单录入 ReqOrderInsert 报文的失败信息，如果想得到报单录入 ReqOrderInsert 报文的失败信息，可以使用对话流的报单应答 RspOrderInsert 报文。）；
- 4) 在成交发生后，交易系统在私有流向双方交易员分别发出单边成交回报 TradeInsertSingle (PID=0x11001) 报文；

- 5) 如果行情有变化，交易所在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData (PID=0x12004) 报文（变化的成交行情）；
- 6) 会员通过对话流发出报单操作 ReqOrderAction (PID=0x00004) 报文（撤单报文）；
- 7) 交易系统确认上述报文后，修改（撤销）指定的委托单，通过对话流给予报单操作应答 RspOrderAction (PID=0x10004) 报文；
- 8) 交易系统更新 Order 表，生成报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003) 报文，通过私有流发送给交易员；
- 9) 如果行情有变化，交易系统在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData 报文；
- 10) 对于止损指令和组合指令的报单录入和撤单操作过程与单腿指令的操作过程基本相同。

4.9 单腿定单成交过程

- 1) 本交易员在交易系统 Order 队列中的单腿定单，由于其他会员下单导致与本交易员的定单成交；
- 2) 交易系统在本交易员的私有流中发出单腿报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003) 报文；
- 3) 交易系统在本交易员的私有流中发出单边成交回报 TradeInsertSingle (PID=0x11001) 报文；
- 4) 交易系统在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData (PID=0x12004) 报文。

4.10 组合定单成交过程

- 1) 本交易员在交易系统 CmbOrder 队列中的组合定单，由于其他会员下单腿定单或组合定单或止损定单触发而导致本交易员的组合定单与其成交；
- 2) 交易系统在本交易员的私有流中发出组合报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003) 报文；
- 3) 交易系统在本交易员的私有流中发出单腿报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003) 报文；
- 4) 交易系统在本交易员的私有流中发出单边成交回报 TradeInsertSingle (PID=0x11001) 报文；
- 5) 交易系统在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData (PID=0x12004) 报文；
- 6) 交易系统在广播流中发出组合行情 CMBInstrumentChangeNotify (PID=0x13016) 报文。

4.11 止损定单触发成交过程

- 1) 本交易员在交易系统 StopOrder 队列中的止损定单，由于触发条件满足止损条件，由止损单变为市价单进行撮合成交，如果不能全部成交或没有成交，变为限价单在 Order 队列中等待；
- 2) 交易系统在私有流中发出止损报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003) 报文；

- 3) 交易系统在私有流中发出单腿报单状态确认 OrderConfirmation(PID=0x11003) 报文;
- 4) 交易系统在私有流中发出单边成交回报 TradeInsertSingle(PID=0x11001) 报文;
- 5) 交易系统在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData(PID=0x12004) 报文。

4.12 做市商在有报价请求时的报价过程

- 1) 非做市商客户或交易所管理人员通过对话流发出报价请求 ReqOrderInsert(PID=0x00003) 报文;
- 2) 交易系统确认此报文后, 通过对话流给予报单应答 RspOrderInsert(PID=0x10003) 报文;
- 3) 交易系统产生报价请求报文 QuotRsp(PID=0x13002), 通过广播流发给所有交易员;
- 4) 做市商客户根据请求报价号通过对话流发送报价响应 ReqQuotMarketRsp(PID=0x03003) 报文;
- 5) 交易系统确认上述报文后, 通过对话流给予报价响应应答 RspQuotMarketRsp(PID=0x13003) 报文;
- 6) 交易系统在私有流中发出报价响应确认 QuotMarketConfirm(PID=0x13026) 报文;
- 7) 交易系统在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData(PID=0x12004) 报文。

4.13 做市商主动报价

- 1) 做市商客户将请求报价号置 0(ReqQuotMarketRsp 报文中的 FID_ReqSeqNum 字段=0), 通过对话流发送报价响应录入 ReqQuotMarketRsp(PID=0x03003) 报文;
- 2) 交易系统确认此报文后, 通过对话流给予报价响应应答 RspQuotMarketRsp(PID=0x13003) 报文;
- 3) 交易系统在私有流中发出报价响应确认 QuotMarketConfirm(PID=0x13026) 报文;
- 4) 交易系统在广播流中发出单腿成交行情 MarketMatchData(PID=0x12004) 报文。

4.14 跨期套利确认

- 1) ZCE AMCS4.0 系统除了支持直接下组合指令外, 还支持将两个单腿投机持仓确认为组合持仓。
- 2) ZCE AMCS4.0 支持三期系统实行的跨期套利(SPZ) 功能。首先会员提出跨期套利额度申请, 交易所审批, 形成跨期套利额度。客户先建单腿持仓, 然后通过跨期套利确认申请将两个单腿持仓确认为组合持仓。跨期套利确认在交易期间提出, 交易系统接收请求后, 检查可建仓数量, 累计申请量必须小于等于可建仓数量。每日闭市后, 交易系统根据申请量、单腿持仓量和可建仓数量, 将单腿持仓变成组合持仓。组合类型为 SPZ。
- 3) 跨期套利额度中变量包括: 批准数量 AlwQty、剩余额度(可建仓数量)RemainQty 与已建仓数量 Balance。批准数量是固定值, 剩余额度是每日可以建仓的数量:

$$\text{RemainQty} \leq \text{AlwQty} - \text{Balance}$$

已建仓数量是截至当日已建仓跨期套利数量, 如果平仓, 该量减少。

- 4) ZCE AMCS4.0 支持没有额度限制的期货跨期套利和跨品种套利确认。期货跨期套利和期货跨品种套利确认的实现有两个条件：
 - 1) 交易所允许将两个单腿持仓变成 SPD 或 IPS;
 - 2) 组合关系必须符合交易所对第一腿与第二腿合约组合关系的规定。

客户下 SPD 和 IPS 跨期套利确认申请, 交易系统接收后, 检查申请量, 累计申请量必须小于等于第一腿与第二腿合约的单腿持仓量的最小值。每日闭市后, 交易系统根据申请量和单腿持仓量, 将单腿持仓变成组合持仓。
- 5) ZCE AMCS4.0 支持没有额度限制的期权跨期套利确认。这些确认分别是 BUL, BER, BLT, BRT, STD 和 STG。实现这些跨期套利确认有两个条件：
 - 1) 交易所允许这种组合;
 - 2) 组合关系必须符合交易所对第一腿与第二腿合约的组合关系的规定。

客户下期权跨期套利确认申请, 交易系统接收后, 检查申请量, 累计申请量必须小于第一腿合约的单腿持仓量与第二腿合约的单腿持仓量的最小量。每日闭市后, 交易系统根据申请量, 单腿持仓量, 将单腿持仓变成组合持仓。
- 6) 会员系统可以查询 SPZ 的跨期套利额度。
- 7) 闭市前, 客户可以查询及撤销已经下的跨期套利确认指令。

4.15 套期保值确认

进行期货套期保值交易, 首先会员须向交易所提出套期保值申请, 交易所审批, 形成套期保值额度。有两种方式建立套期保值持仓:

- 1) 在下委托单时, 指定套期保值标志。
- 2) 对历史投机持仓申请变成套期保值持仓。在交易期间, 客户通过会员系统下套期保值确认申请, 交易系统接收后, 检查套期保值额度, 累计申请量必须小于可建仓数量。每日闭市后, 交易系统根据套期保值额度、投机持仓量和套期保值确认申请量, 将投机持仓变成套期保值持仓。

套期保值额度中有4个量: 批准数量AlwQty, 未建仓数量Unbalance, 已申请数量VirtualQty, 已建仓数量OpenQty。批准数量是固定值, 已建仓数量是截至当时已经建立的套期保值持仓数量, 如果平仓, 该值减少。每日初始化时, 满足

$$\text{Unbalance} = \text{AlwQty} - \text{OpenQty} \quad \text{VirtualQty}=0$$

直接下套期保值委托单时, VirtualQty不变, Unbalance不变; 成交时, Unbalance减少, OpenQty增加。下套期保值确认指令时, VirtualQty增加, 其它量不变。

会员系统可以查询套期保值额度。

在闭市前, 会员系统可以查询及撤销套期保值确认指令。

4.16 期权执行(或放弃)申请

- 1) 期权的买方在期权到期日之前的任何交易日, 可以提出期权执行申请。
- 2) 客户在交易期间, 提出期权执行申请; 交易系统接收后, 进行合法性检查。
- 3) 每日闭市后, 交易系统根据客户期权买方持仓量和期权执行申请量, 进行期权执行, 期权部位减少, 并建立相应的期货部位。
- 4) 期权最后交易日闭市后, 如果客户不提出期权放弃申请, 交易系统对实值额满足设

定条件（大于某一值）的实值期权全部执行，并放弃实值额不满足该条件的实值期权和虚值期权。

- 5) 在闭市前，客户可以撤销期权执行（或放弃）申请。期权放弃申请只在期权最后交易日有效在闭市前，客户可以撤销期权执行（或放弃）申请。期权放弃申请只在期权最后交易日有效，在最后交易日的 15 点 20 分之前，客户都可以提出期权放弃申请。
- 6) 。
- 7) 客户可以查询期权执行（或放弃）申请。

4.17 组合指令的价格

- 1) 期货组合（SPD 和 IPS）的组合价格为价差。

价差 = 第一腿合约价格 - 第二腿合约价格

- 2) 期权组合（BUL、BER、BLT 和 BRT）的组合价格为价差。

价差 = 第一腿合约价格 - 第二腿合约价格

- 3) 期权组合（STD 和 STG）组合价格为价和。

价和 = 第一腿合约价格 + 第二腿合约价格

组合价格可以为负数。

5. 报文描述

这里约定：	m/M	必填
	BLK/BLANK	填充格
	ZERO	填 0
	N/A	不关心，不修改，不使用

ZCE FTD1.1 根据 ZCE AMCS4.0 系统的功能要求，增加了一些新的报文和数据域。

以下以“0001”号会员，“00010010”号交易员为例说明主要报文的请求和应答过程。

说明：在以下每个请求中（即用户要发送的数据包）除了表格中所列的字段，还需填写 FID_SequenceNo 字段，在收到的数据包中除了表中所列的字段还将得到 FID_Chain、FID_SequenceNo、FID_DataFlowFlag 三个字段。

5.1 对话流交易员登录

5.1.1 会员系统请求

登录请求报文：PID=0x00016

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_DataFlowFlag	SI	M（此时填 0）	0、1、2

FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_UserId	S	M (如 “00010010”)	
FID_Password	S	M (如 “1234567890”)	
FID_ConnectionReference	S	BLK	
FID_ServerAppName	S	BLK	
FID_ProtocolVersion	S	M	2, 11
FID_TimeOut	S	BLK	
FID_IpAddr	S	M (如 “192. 168. 99. 100”)	
FID_SequenceNo	UN	0	
FID_INIT_PASSWORD	S	M	
FID_AUTH_SERIAL_NO	S	M	
FID_AUTH_CODE	S	M	

5.1.2 交易系统响应

交易员登录应答: PID=0x10016

1. 登录成功得到的 API 数据包中的字段为:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 <- 交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号
FID_MarketId	S	市场编码 目前为“ZCE001”
FID_MarketStatusId	SI	市场交易状态
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序

登录成功, 收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

其中, FID_MaxOrderLocalId 字段: 最大成功报单本地编号。每日初次连接时, 该值为 BLK。

从断点恢复连接, 该值表示本日本交易员成功报单本地最大编号;

FID_MarketStatusId: 交易系统目前状态。

交易系统状态:

MarketStatusId	交易系统的状态
8	系统未装载, 未就绪
1	系统就绪, 可以登录
3	开盘竞价入单开始阶段
13	开盘竞价入单结束阶段, 开盘集合竞价开始
14	开盘竞价结束
4 或 9	连续交易阶段
5 或 11	暂停阶段
6	系统挂起阶段

7 或 10	交易闭市
--------	------

2. 登录失败得到的 API 数据包中的字段为:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 <- 交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyymmddhhmmss

登录失败, 收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

5.2 私有流交易员登录

5.2.1 会员系统请求

登录请求报文: PID=0x00016

会员录入:

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_DataFlowFlag	SI	M (此时填 1)	0、1、2
FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_UserId	S	M (如 “00010010”)	
FID_Password	S	M (如 “1234567890”)	
FID_ConnectionReference	S	BLK	
FID_ServerAppName	S	BLK	
FID_ProtocolVersion	S	M	2, 11
FID_TimeOut	S	BLK	
FID_IpAddr	S	M (如 “192. 168. 99. 100”)	
FID_SequenceNo	UN	M(填 iStart_SeqNo)	
FID_INIT_PASSWORD	S	M	
FID_AUTH_SERIAL_NO	S	M	
FID_AUTH_CODE	S	M	

5.2.2 交易系统响应

交易员登录应答: PID=0x10016

1. 登录成功得到的 API 数据包中的字段为:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 <- 交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号

登录成功, 收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

其中, FID_MaxOrderLocalId: 交易系统中该交易员的最大私有流序号。

如果 $0 < iStart_SeqNo < \text{该交易员的最大私有流序号}$, 交易系统从 $iStart_SeqNo+1$ 开始通过私有流发送数据。如果 $iStart_SeqNo=0$, 交易系统从序列号 1 开始通过私有流发送数据。

2. 登录失败得到的 API 数据包中字段为:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 <- 交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyymmddhhmmss

登录失败, 收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

5.3 广播流交易员登录

5.3.1 会员系统请求

登录请求报文: PID=0x00016

会员录入:

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_DataFlowFlag	SI	M (此时填 2)	0、1、2
FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_UserId	S	M (如 “00010010”)	
FID_Password	S	M (如 “1234567890”)	
FID_ConnectionReference	S	BLK	
FID_ServerAppName	S	BLK	

FID_ProtocolVersion	S	M	2, 11
FID_TimeOut	S	BLK	
FID_IpAddr	S	M (如 “192. 168. 99. 100”)	
FID_SequenceNo	UN	M (填 iStart_SeqNo)	
FID_INIT_PASSWORD	S	M	
FID_AUTH_SERIAL_NO	S	M	
FID_AUTH_CODE	S	M	

5.3.2 交易系统响应

交易员登录应答: PID=0x10016

1. 登录成功得到的 API 数据包中的字段为:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 <- 交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号

登录成功, 收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

其中, FID_MaxOrderLocalId: 交易系统中最大广播流序号。交易系统在广播流中发送 MarketMatchData (PID=0x12004) 成交行情报文, 序列号=0。

如果 $0 < iStart_SeqNo < \text{交易系统的最大广播流序号}$, 交易系统从 $iStart_SeqNo+1$ 开始发送广播流数据。 $iStart_SeqNo=0$, 交易系统从序列号 1 开始发送广播流数据。

2. 登录失败得到的 API 数据包中字段为:

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_Password	S	口令
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyymmddhhmmss
FID_TimeSpan	S	时区, 正数表示东区, 负数表示西区 目前未用
FID_IpAddr	S	登录者的 IP 地址 <- 交易员登录请求数据域的 IpAddr
FID_MaxOrderLocalId	S	最大成功报单本地编号
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyymmddhhmmss

登录失败, 收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

5.4 交易员登录退出

5.4.1 会员系统请求

交易员登录退出报文：PID=0x00017

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_DataFlowFlag	SI	M	0、1、2
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	M（如“00010010”）	

说明：DataFlowFlag=0 交易员退出对话流

DataFlowFlag=1 交易员退出私有流

DataFlowFlag=2 交易员退出广播流

5.4.2 交易系统响应

交易员登录退出应答：PID=0x10017

1. 登录退出成功收到的 API 数据包中的字段为：

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyyymmddhhmmss

登录退出成功，收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

2. 登录退出失败收到的 API 数据包中的字段为：

名称	类型	描述
FID_DataFlowFlag	SI	数据流名称 0->对话流, 1->私有流, 2->广播流
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_ExchangeDateTime	DT	交易所系统时间 yyyyymmddhhmmss
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyyymmddhhmmss

登录退出失败，收到的交易员登录应答数据包个数为 1。

5.5 交易员修改密码

5.5.1 会员系统请求

交易员修改密码报文：PID=0x00018

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	M（如“00010010”）	
FID_NewPassword	S	M	
FID_OldPassword	S	M	

5.5.2 交易系统响应

交易员修改密码应答：PID=0x10018

1. 修改密码成功收到的 API 数据包中的字段为：

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_NewPassword	S	新口令

收到得数据包个数为 1。

2. 修改密码失败收到的 API 数据包中的字段为：

名称	类型	描述
FID_ParticipantId	S	交易会员编码
FID_UserId	S	交易员编码
FID_NewPassword	S	新口令
FID_ErrorCode	S	错误代码
FID_ErrorText	S	错误正文
FID_TimeStamp	DT	时间戳 format=yyyymmddhhmmss

收到得数据包个数为 1。

5.6 下期货期权限价指令

5.6.1 会员系统请求

下期货期权限价指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	

FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_OffsetFlag	SI	M	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	M	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZREO	
FID_LimitPrice	LN-4	M	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	0	
FID_MatchCondition	SI	M	1, 2, 3, 4, 5
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	M	yyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	BLK	
FID_SecondLeg	S	BLK	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=0。

FID_MatchCondition 取值的含意：1->FOK, 2->IOC, 3->GFD, 4->GTC, 5->GTD。

FID_MatchCondition=5 时，FID_ValidThrough 为到期日（yyyymmdd）。

FID_MatchCondition≠5 时，FID_ValidThrough 为 BLK。

FID_Direction 取值的含意：0->买 1->卖。

FID_OffsetFlag 取值的含意：0->开仓 1->平仓。

FID_HedgeFlag 取值的含意：1->投机 3->套期保值。

委托编号 FID_OrderLocalId，交易所建议会员系统采用“8 位日期+8 位序列号”的编码格式，原因是由于存在长期有效定单。例如 10 天前下的一个长期有效定单今天可能成交了，使用“8 位日期+8 位序列号”的 FID_OrderLocalId 会员系统可以定位所下的每一个委托。

5.6.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）；通过私有流又接收一份报单状态确认 OrderConfirmation（PID=0x11003）。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）

说明：下单成功时收到的报单应答数据包和报单状态确认中均不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.7 下期货期权市价指令

5.7.1 会员系统请求

下期货期权市价指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_OffsetFlag	SI	M	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	M	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZREO	
FID_LimitPrice	LN-4	0	
FID_VolumeTotalOrginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	1	
FID_MatchCondition	SI	M	1, 2, 3, 4, 5
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	M	yyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	BLK	
FID_SecondLeg	S	BLK	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，入单成功，交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=1

FID_MatchCondition=5 时 FID_ValidThrough 为到期日，yyyymmdd

FID_MatchCondition≠5 时 FID_ValidThrough 为 BLK

5.7.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）；通过私有流又接收一份报单状态确认 OrderConfirmation（PID=0x11003）。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包和报单状态确认中均不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.8 下期货止损指令

5.8.1 会员系统请求

下期货止损指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_OffsetFlag	SI	1	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	M	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	M	
FID_LimitPrice	LN-4	M	
FID_VolumeTotalOrginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	3	
FID_MatchCondition	SI	M	1, 2, 3, 4, 5
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	M	yyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	BLK	
FID_SecondLeg	S	BLK	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=3，FID_OffsetFlag=1，止损单为平仓单。

FID_StopPrice 是触发价。对于买止损指令，最新价>=触发价，止损单激活为市价买单进行撮合。对于卖止损指令，最新价<=触发价，止损单激活为市价卖单进行撮合。

FID_LimitPrice 是保护价，保护价=0，止损单激活后变为市价单进行撮合，如果撮合不完，买止损单变为价格为涨停板价的限价单；卖止损单变为价格为跌停板价的限价单。保护价>0，止损单激活后变为市价单进行撮合，如果撮合不完，买止损单变为价格为保护价的限价单，卖止损单变为价格为保护价的限价单。

FID_MatchCondition=5 时 FID_ValidThrough 为到期日，格式：yyyymmdd。

FID_MatchCondition≠5 时 FID_ValidThrough 为 BLK。

5.8.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）；通过私有流又接收一份报单状态确认 OrderConfirmation（PID=0x11003）。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包和报单状态确认中均不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.9 下期货期权组合指令

5.9.1 会员系统请求

期货期权组合指令：TID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_OffsetFlag	SI	M	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	M	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	0	
FID_LimitPrice	LN-4	M	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	7	
FID_MatchCondition	SI	M	1, 2, 3, 4, 5
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	M	yyyymmdd
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	M	
FID_SecondLeg	S	M	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=7。

FID_CmbType 组合类型，1-期货 SPD，2-期货 IPS，3-期权 BUL，4-BER，5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG。

FID_InstrumentId 第一腿合约。

FID_SecondLeg 第二腿合约。

FID_Direction 为买组合或卖组合标识。

FID_LimitPrice 为组合合约的价格，对于 SPD, IPS, NUL, BER, BLT, BRT 组合，
FID_LimitPrice=第一腿合约的价格-第二腿合约的价格。

对于 STD, STG 组合，FID_LimitPrice=第一腿合约的价格+第二腿合约的价格。

对于期权组合 FID_MatchCondition 只能=1 (FOK) 或 2 (IOC)。

5.9.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包 (PID=0x10003)；通过私有流接收一份报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003)。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包 (PID=0x10003)。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包和报单状态确认中均不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.10 下跨期套利确认指令

5.10.1 会员系统请求

跨期套利确认指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_OffsetFlag	SI	ZERO	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	ZERO	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZERO	
FID_LimitPrice	LN-4	ZERO	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	101	
FID_MatchCondition	SI	ZERO	
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	ZERO	
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	

FID_CmbType	SI	M	
FID_SecondLeg	S	M	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=101。

FID_CmbType 组合类型, 0-期货 SPZ 1-期货 SPD, 2-期货 IPS, 3-期权 BUL, 4-BER, 5-BLT 6-BRT 7-STD 8-STG。

FID_InstrumentId 第一腿合约。

FID_SecondLeg 第二腿合约。

FID_Direction 为买组合或卖组合标识。

FID_VolumeTotalOriginal 申请数量。

5.10.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包 (PID=0x10003)；通过私有流接收一份跨期套利确认 OrderSpdApply (PID=0x13041)。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包 (PID=0x10003)。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.11 下套期保值确认指令

5.11.1 会员系统请求

套期保值确认指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_OffsetFlag	SI	ZERO	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	ZERO	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZERO	
FID_LimitPrice	LN-4	ZERO	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	102	
FID_MatchCondition	SI	ZERO	
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	ZERO	

FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	BLK	
FID_SecondLeg	S	BLK	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=102。

FID_VolumeTotalOriginal 申请数量。

5.11.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）；通过私有流又接收一份套期保值确认 OrderHedgeCfm(PID=0x13040)。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.12 下报价请求指令

5.12.1 会员系统请求

报价请求指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	N/A	0, 1, 2
FID_OffsetFlag	SI	ZERO	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	ZERO	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZERO	
FID_LimitPrice	LN-4	ZERO	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	ZERO	
FID_OrderType	SI	103	
FID_MatchCondition	SI	ZERO	
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	ZERO	
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	

FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	BLK	
FID_SecondLeg	S	BLK	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=103

5.12.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。
2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.13 下期权权利行使指令

5.13.1 会员系统请求

期权权利行使指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	N/A	0, 1, 2
FID_OffsetFlag	SI	ZERO	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	ZERO	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZERO	
FID_LimitPrice	LN-4	ZERO	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	104	
FID_MatchCondition	SI	ZERO	
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	ZERO	
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	

FID_CmbType	SI	BLK	
FID_SecondLeg	S	BLK	

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=104。

FID_VolumeTotalOriginal 申请数量。

5.13.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）；通过私有流又接收一份期权执行报文确认 OrderOptionEApply（PID=0x13042）。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.14 下期权权利放弃指令

5.14.1 会员系统请求

期权权利放弃指令：PID=0x00003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_Direction	SI	N/A	0, 1, 2
FID_OffsetFlag	SI	ZERO	0, 1
FID_HedgeFlag	SI	ZERO	1, 3
FID_StopPrice	LN-4	ZERO	
FID_LimitPrice	LN-4	ZERO	
FID_VolumeTotalOriginal	UN	M	
FID_OrderType	SI	106	
FID_MatchCondition	SI	ZERO	
FID_MatchSession	C	BLK	
FID_ValidThrough	D	ZERO	
FID_MinimalVolume	UN	ZERO	
FID_AutoSuspend	SI	1	
FID_InsertTime	DT	BLK	
FID_MessageReference	S	N/A	
FID_CmbType	SI	BLK	

FID_SecondLeg	S	BLK	
---------------	---	-----	--

说明：FID_OrderSysId 和 FID_InsertTime，若入单成功，由交易系统填写。

指令类型 FID_OrderType=106。

FID_VolumeTotalOriginal 申请数量。

5.14.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）；通过私有流又接收一份期权执行报文确认 OrderOptionEApply（PID=0x13042）。

2. 下单失败时，从对话流接收一份报单应答数据包（PID=0x10003）。

说明：下单成功时收到的报单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode，FID_ErrorText，FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.15 下做市商报价响应指令

5.15.1 会员系统请求

做市商报价响应指令：TID=0x03003

会员录入：

名称	类型	客户填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	BLK	
FID_OrderLocalId	S	M	yyyymmddxxxxxxxxx
FID_UserId	S	M	
FID_ClientId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_BuyOffsetFlag	SI	M	0, 1
FID_BuyPrice	LN-4	M	
FID_SellOffsetFlag	SI	M	0, 1
FID_SellPrice	LN-4	M	
FID_Volume	UN	M	
FID_StayTime	UN	M	
FID_ReqSeqNum	S	M	

说明：FID_OrderSysId，若入单成功，由交易系统填写。

FID_Volume 双边报价的数量。

FID_StayTime 停留时间(秒)，0 表示不限制停留时间。

FID_ReqSeqNum 报价请求序列号，非做市商客户或交易所管理员发出的报价请求的请求序列号，这个请求序列号来自广播流的报价请求。如果做市商客户主动报价，即没有用户要求报价或没有收到报价请求，FID_ReqSeqNum 置 0。

做市商必须双边报价。

5.15.2 交易系统响应

1. 下单成功时，从对话流接收一份做市商报价响应应答数据包 RspQuotMarketRsp (PID=0x13003)；通过私有流又接收一份做市商报价响应确认 QuotMarketConfirm(PID=0x13026)。
2. 下单失败时，从对话流接收一份做市商报价响应应答数据包 RspQuotMarketRsp (PID=0x13003)。

说明：下单成功时收到的做市商报价响应应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.16 撤销期货期权限价指令

5.16.1 会员系统请求

撤销期货期权限价指令：PID=0x00004

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	0	0

说明：撤销期货期权限价指令 FID_OrderType=0，由于市价指令是 IOC 指令，没有撤单问题。

FID_OrderSysId：交易系统的限价指令合同编号。

FID_ActionLocalId：会员系统本地委托编号。

5.16.2 交易系统响应

1. 撤单成功，从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)；通过私有流又接收一份报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003)。
2. 撤单失败，从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明：撤单成功时收到的撤单应答数据包和报单状态确认数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.17 撤销期货止损指令

5.17.1 会员系统请求

撤销期货止损指令：PID=0x00004

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	3	0

说明: 撤销期货止损指令类型 FID_OrderType=3。

FID_OrderSysId: 交易系统给出的止损指令合同编号。

FID_ActionLocalId: 会员系统本地委托编号。

5.17.2 交易系统响应

1. 撤单成功, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004); 通过私有流接收一份报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003)。

2. 撤单失败, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明: 撤单成功时收到的撤单应答数据包和报单状态确认数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.18 撤销期货组合定单

5.18.1 会员系统请求

撤销期货组合定单指令: PID=0x00004

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	7	0

说明: 撤销期货组合定单指令 FID_OrderType=7。

FID_OrderSysId: 交易系统给出的组合订单合同编号。

FID_ActionLocalId: 会员系统本地委托编号。

5.18.2 交易系统响应

1. 撤单成功, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004); 通过私有

流接收一份报单状态确认 OrderConfirmation (PID=0x11003)。

2. 撤单失败, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明: 撤单成功时收到的撤单应答数据包和报单状态确认数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.19 撤销跨期套利确认指令

5.19.1 会员系统请求

撤销跨期套利确认指令: PID=0x00004

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	101	0

说明: 撤销跨期套利确认指令 FID_OrderType=101。

FID_OrderSysId: 交易系统给出的跨期套利确认合同编号。

FID_ActionLocalId: 会员系统本地委托编号。

5.19.2 交易系统响应

1. 撤单成功, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004); 通过私有流接收一份跨期套利确认 OrderSpdApply (PID=0x13041)。

2. 撤单失败, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明: 撤单成功时收到的撤单应答数据包和报单状态确认数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.20 撤销套期保值确认指令

5.20.1 会员系统请求

撤销套期保值确认指令: PID=0x00004

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	

FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	102	0

说明：撤销套期保值确认指令 FID_OrderType=102。

FID_OrderSysId 交易系统给出的套期保值确认合同编号。

FID_ActionLocalId 会员系统本地委托编号。

5.20.2 交易系统响应

1. 撤单成功, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004); 通过私有流接收一份套期保值确认 OrderHedgeCfm (PID=0x13040)。

2. 撤单失败, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明：撤单成功时收到的撤单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.21 撤销期权权力行使指令

5.21.1 会员系统请求

撤销期权权力行使指令: PID=0x00004

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	104	0

说明：撤销期权权力行使指令 FID_OrderType=104。

FID_OrderSysId 交易系统给出的期权权力行使合同编号。

FID_ActionLocalId 会员系统本地委托编号。

5.21.2 交易系统响应

1. 撤单成功, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004); 通过私有流接收一份期权权力行使确认 OrderOptionEApply (PID=0x13042)。

2. 撤单失败, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明：撤单成功时收到的撤单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.22 撤销报价请求响应指令

5.22.1 会员系统请求

撤销报价请求响应指令：PID=0x00004

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	105	0

说明：撤销报价请求响应指令 FID_OrderType=105。

FID_OrderSysId 交易系统给出的报价请求响应合同编号。

FID_ActionLocalId 会员系统本地委托编号。

5.22.2 交易系统响应

1. 撤单成功，从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)；通过私有流又接收一份报价请求响应确认 RspQuotMarketRsp (PID=0x13003)。

2. 撤单失败，从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明：撤单成功时收到的撤单应答数据包和报价请求响应确认数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.23 撤销期权权力放弃指令

5.23.1 会员系统请求

撤销期权权力放弃指令：PID=0x00004

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderActionCode	SI	0	0, 1, 2
FID_OrderSysId	S	M	
FID_ActionLocalId	S	M	
FID_InstrumentId	S	M	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_UserId	S	M	
FID_OrderType	SI	106	0

说明：撤销期权权力放弃指令 FID_OrderType=106。

FID_OrderSysId 交易系统给出的期权权力放弃合同编号。

FID_ActionLocalId 会员系统本地委托编号。

5.23.2 交易系统响应

1. 撤单成功, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004); 通过私有流接收一份期权权力放弃确认 OrderOptionEApply (PID=0x13042)。

2. 撤单失败, 从对话流接收一份撤单应答报文 RspOrderAction (PID=0x10004)。

说明:撤单成功时收到的撤单应答数据包中不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

5.24 报单查询

5.24.1 会员系统请求

报单查询报文: PID=0x00006

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	
FID_InstrumentVersion	SI	0	0
FID_ParticipantId	S	M(如 “0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员; 填写具体交易员编码 (如 “00090090”) 表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户; 填写具体客户编码 (如 “00090007”) 表示编号代表的具体客户	
FID_OrderSysId	S	不填或填空格表示全部定单; 填具体合同编号 (如 “2005121300000028”) 表示编号代表的具体合同	

说明:

该请求报文只能查询本交易员的合同编号=FID_OrderSysId 的单腿定单, 不能查询本交易员的止损定单和组合定单。对于具有公司管理员权限的交易员, FID_UserId=空格时, 查本公司全部报单。对于一般交易员, FID_UserId=空格时, 查询本交易员的报单。

5.24.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个 (最少为 1) 报单查询应答数据包 RspQryOrder (PID=0x10006); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个报单查询应答数据包 RspQryOrder (PID=0x10006);

5.25 按定单类型报单查询

5.25.1 会员系统请求

按定单类型报单查询报文: PID=0x03010

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderSysId	S	不填或填空格表示全部定单; 填具体合同编号 (如 “2005121300000028”) 表示编号代表的具体合同	
FID_ParticipantId	S	M(如 “0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员; 填写具体交易员编码 (如 “00090090”) 表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户; 填写具体客户编码 (如 “00090007”) 表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	
FID_OrderCMBType	SI	M	

FID_OrderCMBType 字段是按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损, bit7->组合定单

因此, FID_OrderCMBType=0xff //全部定单

FID_OrderCMBType=1 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=2 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=8 //止损定单

FID_OrderCMBType=128 //组合定单

说明: 查询本交易员的合同编号>FID_OrderSysId 的单腿、止损和组合报单。若为具有公司管理员权限的交易员, FID_UserId=空格时, 可以查询本公司全部交易员的报单; 若为一般交易员, FID_UserId=空格时, 可以查询本交易员的报单。

5.25.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个 (最少为 1) 按订单类型报单查询应答数据包 RspQryOrderBySysId (PID=0x13010); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个按订单类型报单查询应答数据包 RspQryOrderBySysId (PID=0x13010)。

5.26 按本地定单号报单查询

5.26.1 会员系统请求

按本地定单号报单查询报文：PID=0x03013

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_OrderLocalId	S	M	
FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码 (如 “00090090”) 表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码 (如 “00090007”) 表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	
FID_OrderCMBType	SI	M	
FID_Reserve	S	N/A	

FID_OrderCMBType 字段是按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损, bit7->组合定单

因此, FID_OrderCMBType=0xff 或者 255 //全部定单

FID_OrderCMBType=1 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=2 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=8 //止损定单

FID_OrderCMBType=128 //组合定单

说明：查询本交易员的本地定单号=FID_OrderLocalId 的报单，若 FID_OrderLocalId 为空，则返回该交易员的全部报单。若为具有公司管理员权限的交易员，FID_UserId=空格时，可以查询本公司全部交易员的报单；若为一般交易员，FID_UserId=空格时，可以查询本交易员的报单。

5.26.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个 (最少为 1) 按本地订单号报单查询应答数据包 RspQryOrderByLocalId (PID=0x13013)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个按本地订单号报单查询应答数据包 RspQryOrderByLocalId (PID=0x13013)。

5.27 按变化量报单查询

5.27.1 会员系统请求

按本地定单号报单查询报文：PID=0x03046

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	
FID_OrderCMBType	SI	M	
FID_MessageReference	S	不填或填空格表示全部定单	
FID_Reserve	S	N/A	

FID_OrderCMBType 字段是按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损, bit7->组合定单

因此, FID_OrderCMBType=0xff 或者 255 //全部定单

FID_OrderCMBType=1 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=2 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=8 //止损定单

FID_OrderCMBType=128 //组合定单

说明：查询本交易员的报单变化量>FID_MessageRefence 的单腿、止损和组合报单。若为具有公司管理员权限的交易员，FID_UserId=空格时，可以查询本公司全部交易员的报单；若为一般交易员，FID_UserId=空格时，查询本交易员的报单。

5.27.2 交易系统响应

1. 请求成功：从对话流收到任意个（最少为 1）按变化量报单查询应答数据包 RspQryOrderByChgTime（PID=0x13046）；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败：从对话流收到一个按变化量报单单查询应答数据包 RspQryOrderByChgTime（PID=0x13046）。

5.28 套期保值额度查询

5.28.1 会员系统请求

套期保值额度查询报文：PID=0x03017

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_OrderStatus	SI	N/A	

5.28.2 交易系统响应

1. 请求成功：从对话流收到任意个（最少为 1）套期保值额度查询应答数据包 RspQryHedge（PID=0x13017）；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败：从对话流收到一个套期保值额度查询应答数据包 RspQryHedge（PID=0x13017）。

5.29 套期保值确认查询

5.29.1 会员系统请求

套期保值确认查询报文：PID=0x03018

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_OrderStatus	SI	N/A	

5.29.2 交易系统响应

1. 请求成功：从对话流收到任意个（最少为 1）套期保值确认应答数据包 RspQryHedgeCfm（PID=0x13018）；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信

息的字段。

2. 请求失败：从对话流收到一个套期保值确认查询应答数据包 RspQryHedgeCfm (PID=0x13018)。

5.30 跨期套利额度查询

5.30.1 会员系统请求

跨期套利额度查询报文：PID=0x03019

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_OrderStatus	SI	N/A	

5.30.2 交易系统响应

1. 请求成功：从对话流收到任意个（最少为 1）跨期套利额度应答数据包 RspQrySpdFirm (PID=0x13019)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败：从对话流收到一个跨期套利额度应答数据包 RspQrySpdFirm (PID=0x13019)。

5.31 跨期套利确认查询

5.31.1 会员系统请求

跨期套利确认查询报文：PID=0x03020

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_OrderStatus	SI	N/A	

5.31.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个(最少为 1)跨期套利确认应答数据包 RspQrySpdApply (PID=0x13020); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到一个跨期套利确认应答数据包 RspQrySpdApply (PID=0x13020)。

5.32 做市商报价响应查询

5.32.1 会员系统请求

做市商报价响应查询报文: PID=0x03026

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员; 填写具体交易员编码 (如 “00090090”) 表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户; 填写具体客户编码 (如 “00090007”) 表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	

5.32.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个(最少为 1)做市商报价响应应答数据包 RspQryQuotMarket (PID=0x13026); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到一个做市商报价响应应答数据包 RspQryQuotMarket (PID=0x13026)。

5.33 期权执行指令查询

5.33.1 会员系统请求

期权执行指令查询报文: PID=0x03025

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员; 填写具体交易员编	

		码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	

5.33.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个(最少为 1)期权执行应答数据包 RspQryOptionEApply (PID=0x13025); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到一个期权执行应答数据包 RspQryOptionEApply (PID=0x13025);

5.34 市场查询

5.34.1 会员系统请求

市场查询请求报文: PID=0x0000B

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_MarketId	S	M (这里填“ZCE001”)	

5.34.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个(最少为 1)市场查询应答数据包 RspQryMarket (PID=0x1000B); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到一个市场查询应答数据包 RspQryMarket (PID=0x1000B)。

5.35 市场交易状态查询

5.35.1 会员系统请求

市场交易状态查询请求报文: PID=0x0000D

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_MarketId	S	M (这里填“ZCE001”)	

5.35.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个(最少为 1)市场交易状态应答数据包 RspQryMarketStatus (PID=0x1000D); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。
2. 请求失败: 从对话流收到一个市场交易状态应答数据包 RspQryMarketStatus (PID=0x1000D)。

5.36 合约查询

5.36.1 会员系统请求

合约查询报文: PID=0x00005

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_MarketId	S	M (这里填 “ZCE001”)	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	

5.36.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个 (最少为 1) 合约查询应答数据包 RspQryInstrument (PID=0x10005); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。
2. 请求失败: 从对话流收到一个合约查询应答数据包 RspQryInstrument (PID=0x10005)。

5.37 合约交易状态查询

5.37.1 会员系统请求

查询合约交易状态请求报文: PID=0x0000E

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_MarketId	S	M (这里填 “ZCE001”)	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	

5.37.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个 (最少为 1) 合约交易状态应答数据包 RspQryInstrumentStatus (PID=0x1000E); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到 1 个合约交易状态应答数据包 RspQryInstrumentStatus (PID=0x1000E)。

5.38 组合合约查询

5.38.1 会员系统请求

组合合约查询报文: PID=0x03015

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_MarketId	S	M (这里填 “ZCE001”)	
FID_CmbType	SI	M	1, 2
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	
FID_SecondLeg	S	不填或填空格表示全部合约; 填写具体合约编号 (如 “CF512”) 表示编号代表的具体合约	

5.38.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个 (最少为 1) 组合合约应答数据包 RspQryCMBInstrument (PID=0x13015); 不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个组合合约应答数据包 RspQryCMBInstrument (PID=0x13015)。

5.39 客户信息查询

5.39.1 会员系统请求

客户信息查询报文: PID=0x0000C

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M (如 “0001”)	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户; 填写具体客户编码 (如 “00090007”) 表示编号代表的具体客户	

5.39.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个（最少为 1）客户信息应答数据包 RspQryClient (PID=0x1000C)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到 1 个客户信息应答数据包 RspQryClient (PID=0x1000C)。

5.40 会员资金查询

5.40.1 会员系统请求

会员资金查询报文: PID=0x00008

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M（如“0001”）	

5.40.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个（最少为 1）会员资金应答数据包 RspQryDeposit (PID=0x10008)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到一个会员资金应答数据包 RspQryDeposit (PID=0x10008)。

5.41 成交行情查询

5.41.1 会员系统请求

成交行情查询报文: PID=0x00002

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	

5.41.2 交易系统响应

1. 请求成功:从对话流收到任意个（最少为 1）成交行情应答数据包 RspQryMarketMatchData (PID=0x10002)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败:从对话流收到 1 个成交行情应答数据包 RspQryMarketMatchData (PID=0x10002)。

5.42 按合同编号成交合约查询

5.42.1 会员系统请求

按合同编号成交合约查询报文：PID=0x00007

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	
FID_InstrumentVersion	SI	M(这里填 0)	0
FID_ParticipantId	S	M(如“0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_OrderSysId	S	不填或填空格表示全部定单；填具体合同编号（如“20051213000000028”）表示编号代表的具体合同	
FID_StartTime	DT	N/A	
FID_ThroughTime	DT	N/A	

说明：请求交易系统查询合同编号> OrderSysId 的本交易员的全部成交合约。

5.42.2 交易系统响应

1. 请求成功：从对话流收到任意个（最少为 1）按合同编号成交合约应答数据包 RspQryTrade (PID=0x10007)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。
2. 请求失败：从对话流收到一个按合同编号成交合约应答数据包 RspQryTrade (PID=0x10007)。

5.43 按成交编号成交合约查询

5.43.1 会员系统请求

按成交编号成交合约查询报文：PID=0x03014

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_TradeId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	
FID_ParticipantId	S	M(“0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会	

		员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	
FID_OrderCMBType	SI	M	

FID_OrderCMBType 字段是按位处理, bit0->限价和市价, bit1->限价和市价, bit3->止损, bit7->组合定单

因此, FID_OrderCMBType=0xff //全部定单

FID_OrderCMBType=1 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=2 //单腿限价和单腿市价

FID_OrderCMBType=8 //止损定单

FID_OrderCMBType=128 //组合定单

说明：请求交易系统查询成交编号>FID_TradeId 的本交易员的全部成交合约。

5.43.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个（最少为 1）按成交编号成交合约应答数据包 RspQryTradeByTradeId(PID=0x13014)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个按成交编号成交合约应答数据包 RspQryTradeByTradeId(PID=0x13014)。

5.44 会员持仓查询

5.44.1 会员系统请求

会员持仓查询报文: PID=0x00009

会员录入:

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M(“0001”)	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	

5.44.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个（最少为 1）会员持仓应答数据包 RspQryPPosition(PID=0x10009)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个会员持仓应答数据包 RspQryPPosition(PID=0x10009)。

5.45 会员客户持仓查询

5.45.1 会员系统请求

会员客户持仓查询报文：PID=0x0000A

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M(“0001”)	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	

5.45.2 交易系统响应

1. 请求成功：从对话流收到任意个（最少为 1）会员客户持仓应答数据包 RspQryPosition (PID=0x1000A)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败：从对话流收到一个会员客户持仓应答数据包 RspQryPosition (PID=0x1000A)。

5.46 会员客户组合持仓查询

5.46.1 会员系统请求

会员客户组合持仓查询报文：PID=0x03031

会员录入：

名称	类型	会员填写	取值范围
FID_ParticipantId	S	M(“0001”)	
FID_UserId	S	不填或填空格表示本会员；填写具体交易员编码（如“00090090”）表示编号代表的具体会员	
FID_ClientId	S	不填或填空格表示全部客户；填写具体客户编码（如“00090007”）表示编号代表的具体客户	
FID_Direction	SI	M	0, 1
FID_CmbType	SI	M	0, 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9
FID_InstrumentId	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	
FID_SecondLeg	S	不填或填空格表示全部合约；填写具体合约编号（如“CF512”）表示编号代表的具体合约	

5.46.2 交易系统响应

1. 请求成功: 从对话流收到任意个（最少为 1）会员客户组合持仓应答数据包 RspQryCMBPosition(PID=0x13031)；不包括 FID_ErrorCode, FID_ErrorText, FID_TimeStamp 这三个描述错误信息的字段。

2. 请求失败: 从对话流收到一个会员客户组合持仓应答数据包 RspQryCMBPosition(PID=0x13031)。

5.47 私有流报文

5.47.1 报单状态确认 OrderConfirmation(TID=0x11003)报文

当单腿定单簿 Order、止损定单簿 StopOrder 和组合定单簿 CmbOrder 的记录发生状态变化或数量变化时，交易系统发送此报文。

5.47.2 跨期套利确认 OrderSpdApply(PID=0x13041)报文

当跨期套利确认定单簿 SpdOrder 的记录发生状态变化或数量变化时，交易系统发送此报文。

5.47.3 套期保值确认 OrderHedgeCfm(PID=0x13040)报文

当套期保值确认定单簿 HedgeOrder 的记录发生状态变化或数量变化时，交易系统发送此报文。

5.47.4 期权执行报文确认 OrderOptionEApply(PID=0x13042)报文

当期权执行定单簿 OptExeOrder 的记录发生状态变化或数量变化时，交易系统发送此报文。

5.47.5 做市商报价响应确认 QuotMarketConfirm(PID=0x13026)报文

当做市商报价响应定单簿 QuotOrder 的记录发生状态变化或数量变化时，交易系统发送此报文。

5.47.6 单边成交回报 TradeInsertSingle(PID=0x11001)报文

当成交合约记录表的记录发生状态变化或数量变化时，交易系统发送此报文。

5.48 广播流报文

5.48.1 合约参数改变通知 InstrumentChangeNotify(PID=0x12007)报文

当合约参数改变时交易系统发送此报文。

5.48.2 合约状态改变通知 InstrumentStatusChangeNotify(PID=0x12006)报文

当合约状态改变时，交易系统发送此报文。

5.48.3 交易所告示 MarketBulletin(PID=0x12003)报文

当交易所所有告示信息时，发送此报文。

5.48.4 成交行情 MarketMatchData(PID=0x12004)报文

当单腿行情有变化时，交易系统发送此报文（任意个）。

在正常情况下，交易系统只发送变化的成交行情报文，其字段为：

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如，期货为 WS509，期权为 WS509C1600
FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_OpenPrice	LN-4	开盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序
FID_LastPrice	LN-4	最新价, FTDFloatType<12, 4>
FID_OpenInterest	UN	持仓量, 二进制网络序
FID_HighPrice	LN-4	最高价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowPrice	LN-4	最低价, FTDFloatType<12, 4>
FID_Volume	UN	数量, 二进制网络序
FID_DeriveBidPrice	LN-4	组合买入价
FID_DeriveAskPrice	LN-4	组合卖出价
FID_DeriveBidLot	UN	组合买入数量
FID_DeriveAskLot	UN	组合卖出数量
FID_AveragePrice	LN-4	均价, FTDFloatType<12, 4>
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间

而在交易员广播流登录成功后，交易系统才发送完整的成交行情，其字段如下：

名称	类型	描述
FID_InstrumentId	S	合约编码 例如，期货为 WS509，期权为 WS509C1600

FID_InstrumentVersion	SI	合约版本号 目前为 0
FID_PreClose	LN-4	前收盘价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_PreSettle	LN-4	前结算价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_PreOpenInterest	UN	昨日空盘量, 双向计算, 二进制网络序
FID_OpenPrice	LN-4	开盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidPrice	LN-4	买入价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_BidLot	UN	买入数量, 二进制网络序
FID_AskPrice	LN-4	卖出价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AskLot	UN	卖出数量, 二进制网络序
FID_LastPrice	LN-4	最新价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LastLot	UN	最后一笔成交手数, 双向计算, 二进制网络序
FID_TradeLot	UN	总成交手数, 双向计算, 二进制网络序
FID_TradeTurnover	UN	总成交金额, 双向计算, 二进制网络序
FID_OpenInterest	UN	持仓量, 二进制网络序
FID_HighPrice	LN-4	最高价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowPrice	LN-4	最低价, FTDFloatType<12, 4>
FID_ClosePrice	LN-4	收盘价, FTDFloatType<12, 4>
FID_SettlePrice	LN-4	当日交割结算价, FTDFloatType<12, 4>
FID_ClearPrice	LN-4	结算价, FTDFloatType<12, 4>
FID_AveragePrice	LN-4	均价, FTDFloatType<12, 4>
FID_LifeHigh	LN-4	历史最高成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_LifeLow	LN-4	历史最低成交价格, FTDFloatType<12, 4>
FID_HighLimit	LN-4	涨停板, FTDFloatType<12, 4>
FID_LowLimit	LN-4	跌停板, FTDFloatType<12, 4>
FID_TotalVolume	UN	总成交量, 二进制网络序
FID_UpdateTime	DT	最后修改时间
FID_MarketMatchDataStatus	SI	是否主动发送成交行情 1->真, 0->假
FID_TotalMarketMatchData	UN	发送成交行情记录总数, 二进制网络序
FID_BroadcastSequenceNo	UN	广播模式中的数据序列号, 二进制网络序

在其他时刻, 会员系统想得到完整的成交行情, 只有通过对话流发送成交行情查询报文 (PID=0x00002)。

5.48.5 组合行情 CMBInstrumentChangeNotify(PID=0x13016)报文

当组合行情发生变化时, 交易系统发送此报文 (任意个)。如果会员系统想得到完整组合合约信息 (组合行情), 只有通过对话流发送组合行情查询报文 (PID=0x03015)。

5.48.6 市场状态改变通知 MarketStatusChangeNotify(PID=0x12005)报文

当交易系统发生开市, 闭市, 暂停等的状态变化时, 发送此报文。

5.48.7 做市商报价请求报文(交易所->做市商)(PID=0x13002)报文

附录一 错误代码表

ErrorCode	ErrorText
=====	
0	成功操作
1	出错：非法交易员代码
100	出错：Internal Error
1000	出错：系统内存表已满
11	出错：买卖数量不能为零或负数
13	出错：现在是非交易时间
14	出错：非法口令
150	指定会员委托单撤销成功
2	出错：非法会员公司代码
2001	报文类型错误或不可识别
2002	报文正文类型错误或系统不支持
2003	报文完整性错误（报文实际正文长度不等于报头中正文长度）
2004	报文链代码错
2005	版本错误（允许版本号=1）
2006	域个数错误
2007	数据流登录模式不正确(只能是 0, 1, 2)
2009	最新本地委托单号必须大于已下成功本地委托单号
201	你对指定商品没有交易权限
202	出错：会员没有相应的买卖权限
203	出错：该客户没有相应的买卖权限
206	出错：该会员公司保证金不足
207	出错：平仓数量超过持仓量
208	出错：没有相应的保值申请，不能输入保值单
210	出错：限价单价格不能为 0
214	出错：指定的交易品种不进行开盘竞价
215	出错：会员持仓超限
221	出错：委托单价格低于下停板额
222	出错：止损定单价格不能是可成交的价格
223	出错：现在不能输入市价委托单
225	出错：委托单价格不是最小变动价位整数倍
231	出错：该客户没有在你公司处登记
232	出错：非法开平仓标志
233	出错：委托定单限制域不正确
234	出错：买卖数量超过限价单最大下单量限制
235	出错：指定商品现在不能进行交易
236	出错：贵公司持仓已经超过交易所规定最大持仓限制
237	出错：贵公司持仓已经超过交易所规定最大持仓限制
239	出错：套期保值标志不正确

240	出错：组合定单方式不正确
241	出错：组合定单限制方式不正确
242	出错：没有这样的组合方式
243	出错：SPD 组合定单错误
244	出错：IPS 组合定单错误
245	出错：BUL 组合定单错误
246	出错：BER 组合定单错误
247	出错：BLT 组合定单错误
248	出错：BRT 组合定单错误
249	出错：STD 组合定单错误
250	出错：STG 组合定单错误
251	出错：现在是协议平仓时间, 您的公司不在协议平仓之列
260	出错：委托单修改定义错误
3	出错：非法客户代码
301	出错：定单有效日期不正确
303	出错：定单类型不正确
35	出错：所撤委托单没有找到
39	出错：非法登录请求
4	出错：非法交易商品代码
40	出错：你不能从该工作站登录系统
43	出错：报单请求数超过最大值
44	出错：没有查询到相应的记录
44	没有新成交合约
46	出错：非法客户代码
9	出错：非法买卖标志
3001	还没有打开信道，不能登录
3002	发送链路密钥协商请求失败
3003	链路密钥协商应答超时
3004	发送登录请求失败
3005	登录应答超时
3006	此数据流不在登录状态，不能退出登录
3007	发送退出登录请求失败
3008	退出登录应答超时
3009	不在登录状态，不能发送数据
3010	FTD 报文打包出错
3011	接收数据错误
3012	FTD 流序号错误：有些请求没有得到应答或者应答顺序不正确(应该先请求先应答)
3013	FTD 流序号错误：应答记录没有找到对应请求
3014	FTD 报文格式出现错误
3015	无法识别的事务应答，可能是 API 版本过低
4001	登录协议版本号错误
4002	登录删除 Arithm 失败
4003	UDP 端口打开失败

4004	UDP 接收线程启动失败
4005	析构删除 Arithm 失败