

团 体 标 准

T/ZQX 0006.1—2025

期货公司柜台系统管理接口标准 第 1 部分：出入金接口

Interface standard for futures company multi-counter systems—
Part1: Fund data

2025 - 09 - 05 发布

2025 - 09 - 05 实施

中国期货业协会 发布

目 次

前言	II
引言	III
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
4 通信机制	2
4.1 接口与协议	2
4.2 请求命名规范	2
4.3 字段数据类型	3
4.4 交互模式	3
4.5 安全要求	6
4.6 风险控制	6
5 接口模式及接口清单	7
6 出入金场景接口标准	7
6.1 手工出入金	7
6.2 查询出入金	8
6.3 查询资金	9
6.4 设置当日基础保证金	12
6.5 查询当日基础保证金	12
6.6 设置转账限额	13
6.7 查询转账限额	13
6.8 设置当日转账限额	14
6.9 查询当日转账限额	15
6.10 设置当日可提资金比例	16
6.11 查询可提资金比例	16
6.12 冻结资金新增	17
6.13 查询资金冻结	18
6.14 资金解冻	19
7 数据字典	19
7.1 数据字典参考说明	19
7.2 错误代码数据字典	21
参考文献	22

前 言

本文件按照 GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第一部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由中国期货业协会提出并归口。

本文件起草单位：中国期货业协会、中信期货有限公司、海通期货有限公司、国泰君安期货有限公司、上海期货信息技术有限公司、中金所数据有限公司、上海汉霖信息科技有限公司。

本文件主要起草人：杨光、巫伟斐、王曦、艾青、张争妍、余以志、何铁军、万晓鹰、齐向明、张飞、王卫新、徐茜如、周超、龚林、商亚龙。

引 言

为有效提升市场运作效率，打破数据壁垒，为期货公司开展数字化转型创造条件，自2020年以来，在监管部门指导下，中国期货业协会已推动各期货交易所和信息技术系统服务机构开放了270余个信息技术系统接口。

为贯彻《证券期货业科技发展“十四五”规划》，落实监管部门指导意见，促进行业信息技术系统接口标准化建设，提升期货公司业务办理效率，降低人工操作风险，中国期货业协会组织相关单位开展了本标准研制工作。

本文件在期货行业信息技术系统接口开放工作成果的基础上，对柜台系统出入金场景相关接口的数据交换方式、数据接口内容进行了体系化、规范化的梳理与界定，供期货公司及有关技术服务机构参考使用。

期货公司柜台系统管理接口标准 第1部分：出入金接口

1 范围

本文件定义了期货公司内部系统间数据交换过程中的数据定义、数据内容和功能接口。
本文件适用于期货公司主次席柜台系统之间、主席柜台系统与其他系统之间的出入金数据交互场景。

2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅注日期的版本适用于本文件。
凡是不注明日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

JR/T 0111—2014 证券期货业数据通信协议应用指南

JR/T 0151—2016 期货公司柜台系统数据接口规范

JR/T 0160—2018 期货市场客户开户数据接口

JR/T 0274—2023 证券期货业机构内部接口 账户管理

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

柜台系统 over the counter system

期货公司柜台系统包括主席系统和次席系统，提供交易、清算、账户与资金、风控等功能。

[来源：JR/T 0151—2016, 3.5]

3.2

出入金 withdrawal and deposit

出入金是指交易者通过其在银行开立的期货结算账户与期货公司开立的期货保证金账户之间划拨资金的行为。其中，入金是指交易者将期货保证金从其期货结算账户划入期货公司期货保证金账户，期货公司增加交易者期货资金账户可用资金的行为；出金是指期货公司减少交易者期货资金账户可用资金，将期货保证金从期货公司期货保证金账户划入交易者期货结算账户的行为。

3.3

银期出入金 bank/futures withdrawal and deposit

银期出入金是指交易者在与期货公司和结算银行签署银期转账使用协议后，通过期货公司与结算银行共同建立的银期转账系统划拨资金进行出入金的行为。

手工出入金 manual withdrawal and deposit

手工出入金是指交易者通过手机银行、网银、银行柜台转账等方式划款至期货公司期货保证金账户进行出入金的行为。

3.4

资金调拨/资金同步 fund transfer

资金调拨/资金同步是指交易者同时使用多套柜台系统交易时,将其中一套系统中的可用资金调拨/同步至其他系统的行为。

3.5

通信机制 communication mechanism

通信机制是指期货柜台系统外部接口与外部系统之间进行数据交换的方式。

4 通信机制

4.1 接口与协议

4.1.1 RESTful API

RESTful是基于 REST (Representational State Transfer) 的架构风格, 通常使用HTTP、HTTPS 协议进行数据交换, 使用统一的URL来表示资源。RESTful API是无状态的, 服务端可以更好地处理并发请求, 提高系统的可扩展性, 同时可以支持多种数据格式(如JSON、XML等), 实现与各种客户端的兼容。

4.1.2 WebSocket API

WebSocket是一种基于TCP的通信协议, 旨在建立客户端与服务端之间的实时双向通信连接, 实现实时数据传输。WebSocket允许服务端主动向客户端推送数据, 而不需要等待客户端的请求。

4.1.3 C++ API

期货交易、风控柜台等实时系统与其交互系统之间进行实时数据交换和通讯, 通常提供基于期货交易数据交换协议(Futures Trading Data Exchange Protocol, FTD协议)的C++ API接口。C++ API通常包含两类接口API和SPI实现对FTD协议的封装, API接口主动发起请求, 通过继承SPI接口并重载回调函数来处理柜台系统的响应或回报。此类API应符合JR/T 0111—2014的要求。

期货柜台系统接口与其他系统之间进行数据交换过程中常见的协议与接口方式包括RESTful API、WebSocket API、C++ API, 本标准将主要基于HTTPS协议的RESTful API进行具体说明。

4.2 请求命名规范

采用如下URL格式:

`https://server-address[:port]/sub-system/resource/operation`

其中, server-address[:port] 服务端地址及端口

sub-system 提供服务的子系统, 如CTP

resource 被访问的资源, 如费率

operation 对资源的操作，如查询

示例：<https://10.0.25.2:8443/ctp/commission-rate/query>

在下文接口中，/resource/operation段信息以“URL后缀”展示在接口首行中。

4.3 字段数据类型

接口字段数据类型规定见表1。

表1 接口字段数据类型规定

标识符	数据类型及描述	示例
C	字符串。 字段长度为X，表示该字段最长为X。	交易者代码，C12
N	数值型。 若仅有一个参数时，如N(X)，表示所定义的数字，最大长度不能超过X，如N(8)，代表传入整数长度不能超过8位；若有两个参数，如N(X,Y)，定义字段最大长度不能超过X，小数点后精度不能超过Y，如N(8,2)，代表传入数字长度不能超过8位（不含小数点），小数精度不能超过2位。	质押金额，N(22,6)
Date	日期。 格式为YYYYMMDD	交易日，20250408

4.4 交互模式

4.4.1 交互模式分类

客户端的请求有读取类、写入类等交互场景。其中，读取类请求直接在应答中返回读取的数据或出错信息，返回时间相对可预期，一般情况下不会超时；写入类请求在应答中返回一个唯一编号（processID），供请求方查询请求结果，返回时间不可预期，存在超时可能性，通信方式可以为异步，便于客户端和服务端系统解耦。对于消息的处理逻辑，messageNo作为消息的唯一标识，通过幂等控制机制，判断是否重发消息。

接口主要有两种交互模式，均由客户端发起：

1) 请求-应答（同步）

客户端向服务端发起请求，服务端收到请求后进行处理，并将应答结果返回至客户端。客户端等待服务端的应答后，才可进行后续的工作。

例如：部分数据查询、写入的请求，接口调用方可以能够实时获取处理结果，可以采用同步的方式。

2) 请求-应答（异步）

客户端向服务端发起请求，客户端无需等待服务端的应答，仍可继续处理其他事务，服务端收到请求后进行处理，并把应答结果返回给客户端。

例如：大数据量的写入请求，可以通过异步方式实现。由于接口调用方无法立即获取处理结果，会先返回processID给调用方（代表本次业务请求的唯一消息识别码），调用方可以通过processID跟踪定位进行查询，以确认本次业务是否处理成功。若失败，将收到失败原因。

通常情况下，上述两种交互模式的字符编码均采用UTF-8。

4.4.2 读取类请求

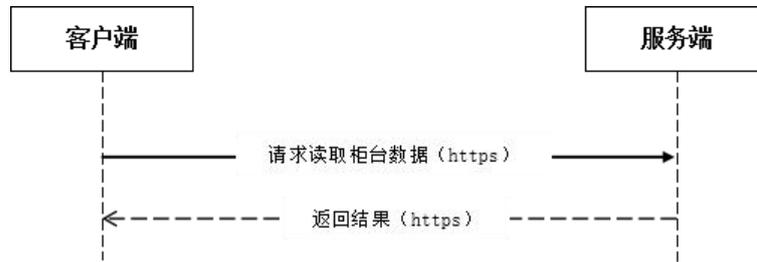


图 1 通信交互模式_读取类请求

读取类请求见图1，其步骤如下：

1) 客户端发请求给服务端

客户端发起HTTPS请求，请求体中包含userID、userPassword、clientName、messageNo属性，以及请求的具体内容（如QryInvestorCommRate）。

示例：

```

{
  "userID": "ctp-0001234",
  "userPassword": "0659c7992e268962384eb17fafa88364",
  "clientName": "CTP-mini2-#3",
  "messageNo": "1",
  "QryInvestorCommRate": {
    "brokerID": "8888",
    "investorRange": "1",
    "investorID": "00000000",
    "investorUnitID": "00000000",
    "exchangeID": "",
    "instrumentID": ""
  }
}
  
```

2) 服务端返回应答

读取类的请求，应答都会包含processID、errorNo和errorInfo，以及查询结果resultList。

示例：

```

{
  "processID": "P00001",
  "errorNo": 0,
  "errorInfo": "查询成功",
  "resultList": [
    { "brokerId": "8888", "investorID": "00001", "investUnitID": "00001", ... },
    { "brokerId": "8888", "investorID": "00002", "investUnitID": "00002", ... },
    ...
    { "brokerId": "8888", "investorID": "01001", "investUnitID": "01001", ... }
  ]
}
  
```

4.4.3 写入类请求



图 2 通信交互模式_写入类请求

写入类请求见图2，其步骤如下：

1) 客户端发起HTTPS请求，请求体中包含userID、userPassword、clientName、messageNo属性，以及请求的具体内容。这部分与读取请求格式相同。

2) 服务端返回ProcessID给客户端用于对上述请求结果的后续查询。

应答中会包含processID（唯一编号），errorNo（0为正确，非0为错误），和errorInfo（结果的文本描述）。

示例：

```

"processID": "001293892",
"errorNo": 0,
"errorInfo": "请求被接受"

```

或

```

"processID": "",
"errorNo": -1,
"errorInfo": "操作员用户名或密码错误"

```

3) 客户端按需发起HTTPS结果查询请求，用于查询写入类请求的柜台处理结果。如无需要，可以不做查询。

示例：

```

https://server-address[:port]/CTP/CurrentStatus/Query
{
  "userID": "ctp-0001234",
  "userPassword": "0659c7992e268962384eb17fafa88364",
  "clientName": "CTP-mini2-#3",
  "messageNo": "5",
  "processIDs": [
    {"processID": "68962384e"},
    {"processID": "2341235"},
    {"processID": "68962384f"}
  ]
}

```

查询条件可以有多个，可以指定processID。服务端会根据userID和clientName进行过滤，只返回该userID/clientName所发请求的结果。

4) 服务端将查询结果返回给客户端。

4.4.4 单一/批量发送

各接口中的单一/批量发送标记指明对应消息对象的发送格式为单一发送或批量发送。单一发送的消息体仅允许发送一个消息对象至接收方；批量发送支持多个消息对象以list形式发送至接收方。

4.5 安全要求

4.5.1 传输安全

使用HTTPS协议加密，HTTPS通过SSL/TLS加密保证数据在传输过程中的机密性和完整性，防止数据被窃取、篡改或监听。同时，可以使用证书加强数据传输安全。

4.5.2 登录认证

对外提供的服务使用HTTPS协议，并支持服务端证书以防止中间人攻击。统一配置API的登录账户，并以此对请求方进行身份验证。外部系统客户端发起HTTPS请求，请求体中包含业务入参和公共入参。其中公共入参包含每个接口都设置的userID（操作员ID）、userPassword（登录密码）、messageNo（消息编号）和clientName（客户端名称）。收到请求后，会验证公共入参中的userID和userPassword是否合法。

除用户名与密码的方式，关于安全登录与认证模式也可以使用token的方式，该方式无需在公共入参提供userID、userPassword，可以通过登录请求接口获取token，其余业务接口要在header里填写token发起请求，每次请求可以达到安全验证的目的，但需考虑token方式有效期等因素的影响。

此外，服务端可以考虑增加客户端的IP白名单校验，仅允许白名单中的IP地址通过接口与服务端进行数据交互。

数据加密和数字签名所采用的技术方案由各方协商确定。

4.6 风险控制

4.6.1 审计

记录所有请求的访问账户、访问时间、访问接口、成功与否等信息。

4.6.2 限流

为保障系统资源的合理使用，避免因高频访问导致服务过载，可对来自同一IP地址、同一账户或同一接口的请求实施访问流量限制。管理端可灵活配置相关参数，例如设置同一IP地址每秒的访问次数上限，动态调整限流策略，确保服务的稳定性和可用性。

4.6.3 限制消息大小

对报文内容的大小做出限制，对超出限制的请求予以拒绝。如报文请求超过此限制，需要API调用者分成多个请求。

例如：客户端通过接口发送的消息体长度不得超过4M，超过4M服务端会进行报错并拦截。部分接口会结合消息长度限制给出服务端建议发送条数，超过此建议条数但消息体总大小小于4M的，服务端不会进行报错；超过此条数且消息体总大小超过4M，服务端会进行报错并拦截。

5 接口模式及接口清单

目前业务接口主要分为两种模式：

模式一：该模式请求数据后返回processId，在获取processId之后需要再次调用实时状态同步查询接口，获取接口状态；

模式二：该模式请求后直接返回响应数据，无需再次调用实时状态同步接口获取结果。

出入金场景接口清单及对应接口模型见表2。

表 2 出入金场景接口清单

场景类型	接口名称	URL 后缀	接口模式
出入金	手工出入金	InvestorFundChange/Create	模式一
	查询出入金	InvestorFundChange/Query	模式一、模式二
	查询资金	InvestorFund/Query	模式二
	设置当日基础保证金	CurrentInvestorBaseMargin/Setting	模式一
	查询当日基础保证金	TodayBaseMargin/Query	模式二
	设置转账限额	Restriction/Create (或者 Modify 或者 Delete)	模式一
	查询转账限额	Restriction/Query	模式二
	设置当日转账限额	TodayRestriction/Create (或者 Modify 或者 Delete)	模式一
	查询当日转账限额	TodayRestriction/Query	模式二
	设置当日可提资金比例	CurrInvestorWidrAlm/Create(或者 Modify 或者 Delete)	模式一
	查询当日可提资金比例	CurrInvestorWidrAlm/Query	模式二
	资金冻结新增	FundFrozen/Create	模式一
	查询资金冻结	FundFrozen/Query	模式二
	资金解冻	FundFrozen/Repeal	模式一

注：WidrAlm 为 WithdrawAlgorithm 单词缩写

6 出入金场景接口标准

6.1 手工出入金

业务场景1：期货公司调用柜台系统提供的手工出入金接口，将期货公司自有管理类业务系统涉及的手工出入金操作自动同步到柜台系统，主席柜台系统厂商需要提供该类型接口。

业务场景2：期货公司调用柜台系统提供的出入金接口，可以实现异构系统间资金同步、调拨，次席柜台系统厂商需要提供该类型接口。

接口名称：手工出入金接口（接口标准见表3）

URL后缀：InvestorFundChange/Create

表 3 出入金场景_手工出入金接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型及长度	是否必填	备注
业务入参	InvestorFundChange				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	

表3 出入金场景_手工出入金接口(续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型及长度	是否必填	备注
	billNo	票据号	C14	N	
	fundType	资金类型	C1	Y	该字段用来区分资金同步、资金划转、资金内转等类型 参见数据字典 0007
	fundDirection	出入金方向	C1	Y	参见数据字典 0006
	bankFlag	银行统一标识	C3	N	参见数据字典 0002
	deposite	发生金额	N(22, 6)	Y	
	operationMemo	操作摘要	C4000	N	
	fundProjectID	分项资金代码	C4	N	
	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典 0003
	clientID	交易编码	C10	N	
	investorBankAccountID	交易者期货结算账户	C40	N	
	brokerBankAccountID	经纪公司期货结算账户	C40	N	
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

6.2 查询出入金

业务场景：期货公司调用柜台系统提供的查询出入金接口，可以实现异构次席柜台系统出入金结果的查询，次席柜台系统厂商需要提供该类型接口。

接口名称：查询出入金接口（接口标准见表4）

URL后缀：InvestorFundChange/Query

表4 出入金场景_查询出入金接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	InvestorFundChange				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	beginDate	开始日期	Date	Y	
	endDate	结束日期	Date	Y	
	investorID	交易者代码	C12	N	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	depositSeqNo	流水号	C14	N	
	fundDirection	出入金方向	C1	N	参见数据字典 0006
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

表4 出入金场景_查询出入金接口(续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	tradingDay	交易日	Date	Y	发生出入金的交易日
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	billNo	票据号	C14	N	
	fundType	资金类型	C1	N	参见数据字典0007
	fundDirection	出入金方向	C1	Y	参见数据字典0006
	bankFlag	银行统一标识	C3	N	参见数据字典0002
	deposit	发生金额	N(22,6)	Y	
	operationMemo	操作摘要	C4000	N	
	fundProjectID	分项资金代码	C4	N	
	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典0003
	clientID	交易编码	C10	N	
	investorBankAccountID	交易者期货结算账户	C40	N	
	brokerBankAccountID	经纪公司期货结算账户	C40	N	

6.3 查询资金

业务场景：期货公司可以通过调用柜台系统提供的查询资金接口，实现对交易者资金的业务查询，可支持查询主席柜台结算结果数据的资金、主席柜台盘中资金、异构柜台盘中资金等。

接口名称：查询资金接口（接口标准见表5）

URL后缀：InvestorFund/Query

表5 出入金场景_查询资金接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	InvestorFund				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	tradingDay	结算日期	Date	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	accountID	资金账号	C12	N	
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典0003

表5 出入金场景_查询资金接口(续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
返回消息					
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	tradingDay	交易日	Date	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	accountID	资金账号	C12	N	
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典 0003
	deposit	存款额	N(22,6)	N	
	lastDeposit	昨日存款额	N(22,6)	N	
	depositByTrade	存款额(逐笔)	N(22,6)	N	
	lastDepositByTrade	昨日存款额(逐笔)	N(22,6)	N	
	remain	结算准备金余额	N(22,6)	N	
	prepa	开仓准备金	N(22,6)	N	
	withdrawQuota	可取资金	N(22,6)	N	
	credit	资金冻结	N(22,6)	N	
	callMargin	追加保证金	N(22,6)	N	
	reserve	基础准备金	N(22,6)	N	
	lowestInterest	最低权益标准	N(22,6)	N	
	mortgage	质押金额	N(22,6)	N	
	lastMortgage	昨日质押金额	N(22,6)	N	
	fundOut	出金金额	N(22,6)	N	
	fundIn	入金金额	N(22,6)	N	
	fundMortgageIn	货币质入金额	N(22,6)	N	
	fundMortgageOut	货币质出金额	N(22,6)	N	
	lastFundMortgageIn	昨日货币质入金额	N(22,6)	N	
	lastFundMortgageOut	昨日货币质出金额	N(22,6)	N	
	fundMortgageMargin	货币质押保证金占用	N(22,6)	N	
	fundMortgageExchMargin	货币质押交易所保证金占用	N(22,6)	N	
	interestBase	利息基数	N(22,6)	N	
	marketDeposit	市值权益	N(22,6)	N	
	fundMortgageChange	货币质押变化金额	N(22,6)	N	
	margin	保证金总额	N(22,6)	N	
	SMargin	投机保证金	N(22,6)	N	
	HMargin	保值保证金	N(22,6)	N	
	delivMargin	交割保证金	N(22,6)	N	

表5 出入金场景_查询资金接口(续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
	exchMargin	交易所保证金总额	N(22,6)	N	
	exchSMargin	交易所投机保证金	N(22,6)	N	
	exchHMargin	交易所保值保证金	N(22,6)	N	
	exchDelivMargin	交易所交割保证金	N(22,6)	N	
	actual	当日盈亏	N(22,6)	N	
	closeProfit	平仓盈亏	N(22,6)	N	
	positionProfit	持仓盈亏	N(22,6)	N	
	floatProfit	浮动盈亏	N(22,6)	N	
	closeProfitByTrade	逐笔平仓盈亏	N(22,6)	N	
	positionProfitByTrade	逐笔持仓盈亏	N(22,6)	N	
	transFee	交易手续费	N(22,6)	N	
	delivFee	交割手续费	N(22,6)	N	
	settlementFee	结算手续费	N(22,6)	N	
	transferPosFee	移仓手续费	N(22,6)	N	
	strikeFee	执行手续费	N(22,6)	N	
	performFee	履约手续费	N(22,6)	N	
	specMargin	特殊产品保证金	N(22,6)	N	
	specActual	特殊产品盈亏	N(22,6)	N	
	specFee	特殊产品手续费	N(22,6)	N	
	exchTransFee	交易所交易手续费	N(22,6)	N	
	exchDelivFee	交易所交割手续费	N(22,6)	N	
	exchSettlementFee	交易所结算手续费	N(22,6)	N	
	exchTransferPosFee	交易所移仓手续费	N(22,6)	N	
	exchStrikeFee	交易所执行手续费	N(22,6)	N	
	exchPerformFee	交易所履约手续费	N(22,6)	N	
	specExchMargin	特殊产品交易所保证金	N(22,6)	N	
	optPremiumIncome	期权权利金收入	N(22,6)	N	
	optPremiumPay	期权权利金支出	N(22,6)	N	
	optStrikeProfit	期权执行盈亏	N(22,6)	N	
	B0ptMarketValue	期权多头持仓市值	N(22,6)	N	
	S0ptMarketValue	期权空头持仓市值	N(22,6)	N	
	specOptPremium	特殊产品期权权利金收支	N(22,6)	N	

6.4 设置当日基础保证金

业务场景：期货公司调用柜台系统接口设置当日交易者基础保证金，管控交易者出金风险。

接口名称：设置当日基础保证金接口（接口标准见表6）

URL后缀：CurrentInvestorBaseMargin/Setting

表6 出入金场景_设置当日基础保证金接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	CurrInvBaseMargin				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	baseMargin	基础保证金	N(22, 6)	Y	
	memo	备注	C160	N	
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

6.5 查询当日基础保证金

业务场景：期货公司调用柜台系统接口查询当日交易者基础保证金信息。

接口名称：查询当日基础保证金接口（接口标准见表7）

URL后缀：TodayBaseMargin/Query

表7 出入金场景_查询当日基础保证金接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	QryTodayBaseMargin				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
返回消息					
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	tradingDay	结算日期	Date	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	baseMargin	当日基础保证金	N(22, 6)	N	
	memo	备注	C160	N	
	investorID	交易者代码	C12	N	
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典0003
	operatorID	操作人代码	C64	N	
	operateDate	操作日期	Date	N	
	operateTime	操作时间	C8	N	
investorName	交易者名称	C160	N		

6.6 设置转账限额

业务场景：期货公司调用柜台系统接口设置转账限额，实现自动化管理交易者银期转账个性化需求。

接口名称：设置转账限额接口（接口标准见表8）

URL后缀：Restriction/Create（或者Modify或者Delete）

表 8 出入金场景_设置转账限额接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	Restriction				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	singleMaxAmt	单笔最高限额	N(22, 6)	N	
	singleMinAmt	单笔最低限额	N(22, 6)	N	
	totalTimes	每日累计转账次数	N(8)	N	
	totalAmt	每日累计转账额度	N(15, 2)	N	
	transferDirection	银期转账方向	C1	Y	参见数据字典0008
返回消息	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典0003
	memo	备注	C256	N	
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
返回消息	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

6.7 查询转账限额

业务场景：期货公司调用柜台系统接口为交易者提供转账限额查询服务。

接口名称：查询转账限额接口（接口标准见表9）

URL后缀：Restriction/Query

表 9 出入金场景_查询转账限额接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	QryRestriction				
	accountID	资金账号	C12	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	transferDirection	银期转账方向	C1	N	参见数据字典0008
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典0003
返回消息	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

表9 出入金场景_查询转账限额接口(续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	accountID	资金账号	C12	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	custType	交易者类型	C1	N	
	singleMaxAmt	单笔最高限额	N(22, 6)	N	
	singleMinAmt	单笔最低限额	N(22, 6)	N	
	totalTimes	每日累计转账次数	N(8)	N	
	totalAmt	每日累计转账额度	N(22, 6)	N	
	transferDirection	银期转账方向	C1	N	参见数据字典0008
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典0003
	memo	备注	C256	N	
	operatorID	操作人代码	C64	N	
	operateDate	操作日期	Date	N	
	operateTime	操作时间	C8	N	
	investorName	交易者名称	C160	N	

6.8 设置当日转账限额

业务场景：期货公司调用柜台系统接口设置当日转账限额，实现自动化管理交易者银期转账个性化需求。

接口名称：设置当日转账限额接口（接口标准见表10）

URL后缀：TodayRestriction/Create（或者Modify或者Delete）

表10 出入金场景_设置当日转账限额接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	TodayRestriction				
	brokerID	期货公司编码	C10	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	singleMaxAmt	单笔最高限额	N(22, 6)	N	
	singleMinAmt	单笔最低限额	N(22, 6)	N	
	totalTimes	每日累计转账次数	N(8)	N	
	totalAmt	每日累计转账额度	N(22, 6)	N	
	transferDirection	银期转账方向	C1	Y	参见数据字典0008
	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典0003
	memo	备注	C256	N	
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	

表 10 出入金场景_设置当日转账限额接口 (续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

6.9 查询当日转账限额

业务场景：期货公司调用柜台系统接口为交易者提供转账限额查询服务。

接口名称：查询当日转账限额接口（接口标准见表11）

URL后缀：TodayRestriction/Query

表 11 出入金场景_查询当日转账限额接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	QryTodayRestriction				
	accountID	资金账号	C12	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	transferDirection	银期转账方向	C1	N	参见数据字典0008
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典0003
返回消息					
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	tradingDay	结算日期	Date	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	custType	交易者类型	C1	N	
	singleMaxAmt	单笔最高限额	N(22,6)	N	
	singleMinAmt	单笔最低限额	N(22,6)	N	
	totalTimes	每日累计转账次数	N(8)	N	
	totalAmt	每日累计转账额度	N(22,6)	N	
	transferDirection	银期转账方向	C1	N	参见数据字典0008
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典0003
	memo	备注	C256	N	
	operatorID	操作人代码	C64	N	
	operateDate	操作日期	Date	N	
	operateTime	操作时间	C8	N	
	investorName	交易者名称	C160	N	

6.10 设置当日可提资金比例

业务场景：期货公司调用柜台系统接口设置交易者当日可提资金比例。

接口名称：设置当日可提资金比例接口（接口标准见表12）

URL后缀：CurrInvestorWidrAlm/Create（或者Modify或者Delete）

表 12 出入金场景_设置当日可提资金比例接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	CurrInvestorWidrAlm				
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典 0003
	usingRatio	可提资金比例	N(22,6)	Y	
	memo	备注	C160	N	
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

6.11 查询可提资金比例

业务场景：期货公司调用柜台系统接口为交易者提供可提资金比例查询服务。

接口名称：查询可提资金比例接口（接口标准见表13）

URL后缀：CurrInvestorWidrAlm/Query

表 13 出入金场景_查询当日可提资金比例接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	QryCurrInvestorWidrAlm				
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	tradingDay	结算日期	Date	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典 0003
返回消息					
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	

表 13 出入金场景_查询当日可提资金比例接口 (续)

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
	usingRatio	可提资金比例	N(22, 6)	Y	
	memo	备注	C160	Y	
	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典 0003
	operatorID	操作人代码	C64	N	
	operateDate	操作日期	Date	N	
	operateTime	操作时间	C8	N	
	investorRange	交易者范围	C1	N	参见数据字典 0009
	investorName	交易者名称	C160	N	
	tradingDay	结算日期	Date	N	

6.12 冻结资金新增

业务场景：期货公司调用柜台系统提供的资金同步类接口，将期货公司管理类业务系统涉及的资金冻结操作自动同步到主席柜台系统，提高公司运营效率，降低管理成本和操作风险。在资金划转过程中需要冻结次席柜台系统盘中资金，以控制出金风险。

接口名称：资金冻结新增接口（接口标准见表14）

URL后缀：FundFrozen/Create

表 14 出入金场景_冻结资金新增接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	FundFrozen				单一发送
	tradingDay	交易日	Date	N	如果接口调用时 未传入此字段， 则采用服务端系 统默认交易日
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	frozen	资金冻结	N(22, 6)	Y	入参小于 0
	endDate	截止日期	Date	Y	
	accountID	资金账号	C12	Y	
	memo	备注	C1024	N	
	frozenType	冻结类型	C1	Y	参见数据字典 0028
	currencyID	币种	C3	Y	参见数据字典 0003
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

6.13 查询资金冻结

业务场景：期货公司调用柜台系统查询资金冻结信息。

接口名称：查询资金冻结接口（接口标准见表15）

URL后缀：FundFrozen/Query

表 15 出入金场景_查询资金冻结接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	QryFundFrozen				单一发送
	tradingDay	交易日	Date	N	
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	isAudit	是否已复核	N(1)	N	1-是, 0-否
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典 0003
	frozenType	冻结类型	C1	N	参见数据字典 0028
	isDefrozen	解冻状态	N(1)	N	1-已解冻; 0-未解冻
返回消息					
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	
业务返回结果		resultList			返回查询结果
	tradingDay	结算日期	Date	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
	investorRange	交易者范围	C1	N	参见数据字典 0009
	investorID	交易者代码	C12	Y	
	isAudit	是否已复核	C1	N	
	frozen	资金冻结	N(22, 6)	N	
	endDate	截止日期	Date	N	
	currencyID	币种	C3	N	参见数据字典 0003
	accountID	资金账号	C12	N	
	memo	备注	C1024	N	
	operatorID	操作人代码	C64	N	
	operatedDate	操作日期	Date	N	
	operateTime	操作时间	C8	N	
	checkerID	复核员代码	C64	N	
	checkDate	复合日期	Date	N	
	checkTime	复核时间	C8	N	
	checkComment	复核说明	C128	N	

表 15 出入金场景_查询资金冻结接口（续）

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
	operateSeqNo	操作序列号	N(8)	N	
	checkSeqNo	复核序列号	N(8)	N	
	frozenType	冻结类型	C1	N	参见数据字典 0028
	originSeqNo	原始序列号	N(8)	N	

6.14 资金解冻

业务场景：期货公司调用柜台系统接口完成资金解冻。

接口名称：资金解冻接口（接口标准见表16）

URL后缀：FundFrozen/Repeal

表 16 出入金场景_资金解冻接口

数据类型	字段名	中文名	字段类型(长度)	是否必填	备注
业务入参	FundDefrozen				单一发送
	operateSeqNo	操作序列号	N(8)	Y	
	brokerID	经纪公司代码	C10	Y	
返回消息					
	processID	消息的唯一标识	C32	Y	
	errorNo	处理状态	N(8)	Y	
	errorInfo	处理结果	C4000	Y	

7 数据字典

7.1 数据字典参考说明

本文件所用数据字典见表17。

表 17 数据字典参考说明

编号	字段	中文名	取值	含义
0001	exchangeID	交易所代码	SHFE	上海期货交易所
0001	exchangeID	交易所代码	CZCE	郑州商品交易所
0001	exchangeID	交易所代码	DCE	大连商品交易所
0001	exchangeID	交易所代码	CFFEX	中国金融期货交易所
0001	exchangeID	交易所代码	INE	上海国际能源交易中心股份有限公司
0001	exchangeID	交易所代码	GFEX	广州期货交易所
0002	bankFlag	银行统一标识	1	工商银行
0002	BankFlag	银行统一标识	2	农业银行
0002	BankFlag	银行统一标识	3	中国银行
0002	BankFlag	银行统一标识	4	建设银行

表 17 数据字典参考说明（续）

编号	字段	中文名	取值	含义
0002	BankFlag	银行统一标识	5	交通银行
0002	BankFlag	银行统一标识	6	浦发银行
0002	BankFlag	银行统一标识	7	兴业银行
0002	BankFlag	银行统一标识	8	汇丰银行
0002	BankFlag	银行统一标识	9	光大银行
0002	BankFlag	银行统一标识	10	招商银行
0002	BankFlag	银行统一标识	11	中信银行
0002	BankFlag	银行统一标识	12	民生银行
0002	BankFlag	银行统一标识	13	平安银行
0002	BankFlag	银行统一标识	14	农发银行
0002	BankFlag	银行统一标识	15	星展银行
0002	BankFlag	银行统一标识	16	广发银行
0002	BankFlag	银行统一标识	17	邮储银行
0002	BankFlag	银行统一标识	18	花旗银行
0002	BankFlag	银行统一标识	19	渣打银行
0002	BankFlag	银行统一标识	Z	其他银行
0003	currencyID	币种	CNY	人民币
0003	currencyID	币种	USD	美元
0003	currencyID	币种	HKD	港币
0006	fundDirection	出入金方向	1	入金
0006	fundDirection	出入金方向	2	出金
0007	fundType	资金类型	1	银行存款
0007	fundType	资金类型	2	分项资金
0007	fundType	资金类型	3	公司调整
0007	fundType	资金类型	4	资金内转
0007	fundType	资金类型	5	结息
0007	fundType	资金类型	6	交割贷款
0007	fundType	资金类型	7	资金调拨
0007	fundType	资金类型	8	手续费返还
0008	transferDirection	银期转账方向	1	入金，银行转期货
0008	transferDirection	银期转账方向	2	出金，期货转银行
0009	InvestorRange	交易者范围	1	所有/公司标准
0009	InvestorRange	交易者范围	2	交易者组/模板
0009	InvestorRange	交易者范围	3	单一交易者
0028	frozenType	冻结类型	1	司法冻结
0028	frozenType	冻结类型	2	交割贷款冻结
0028	frozenType	冻结类型	3	仓单转让冻结
0028	frozenType	冻结类型	4	仓储费冻结
0028	frozenType	冻结类型	5	质押手续费冻结

表 17 数据字典参考说明（续）

编号	字段	中文名	取值	含义
0028	frozenType	冻结类型	6	仓单质出冻结
0028	frozenType	冻结类型	7	质检费冻结
0028	frozenType	冻结类型	8	风险计算冻结
0028	frozenType	冻结类型	9	质押超配比
0028	frozenType	冻结类型	a	交割预报定金
0028	frozenType	冻结类型	z	其他冻结

7.2 错误代码数据字典

本文件所用错误代码见表18。

表 18 错误代码数据字典

错误代码 (ErrorNo)	错误信息 (ErrorInfo)	处理规则
0	业务处理成功	通过所有校验并且柜台处理成功（成功返回 http 200；其余-1 至-6 情况返回 http 500）
99	请求仍在处理中，请稍后查询	实时状态查询接口对于仍在处理中的消息返回的状态码
-1	业务处理失败	不具备通用性和统一处理的报错信息，包含业务处理失败、网关登录信息错误等
-2	数据不符合接口规范	长度/精度/必填未按接口文档要求进行填写或包含非法字符
-3	消息已被消费	重复消费同一消息
-4	系统状态不允许	当前系统正在结算，或交易启动开始或者结算未完成初始化状态下，不允许做查询以外的的工作
-5	枚举值有误	传入数据不在规定的枚举值表范围内
-6	查询结果数量超过最大上限 10 万条，请调整查询条件重新查询。	用于大数据量查询结果返回报错信息
备注	报错时，错误信息 ErrorInfo 应该给出具体的报错信息，比如： <pre>{ "errorNo": -1, "errorInfo": "数据来源-网关：查询交易者期权标的保证金率失败：输入日期必须是交易日", "resultList": [] }</pre> <pre>{ "errorNo": -2, "errorInfo": "不符合接口规范：Query[0].InvstOptMarginRateULDay.investorID 不能为空", "resultList": [] }</pre>	

参 考 文 献

- [1] JR/T 0016—2014 期货交易数据交换协议
 - [2] JR/T 0022—2014 证券交易数据交换协议
 - [3] JR/T 0046.1—2020 证券期货业与银行间业务数据交换协议 第1部分：三方存管、银期转账和结售汇业务
 - [4] JR/T 0181—2020 期货合约要素
 - [5] JR/T 0248—2022 证券期货业机构内部接口 证券交易
-