

一、资金更新字段

中文字段名称	英文字段名称	公式说明
可用资金	Available	可用资金 I = 结算准备金 (Balance) - 保证金占用 (Margin) - 冻结保证金 (FrozenMargin) - 冻结手续费 (FrozenFee) - 冻结权利金 (FrozenPremium)
昨日可用		
当日释放保证金	ReleaseMargin	平仓成交释放保证金 K = 持仓均价 × 成交量 × 合约乘数 × 保证金率
平仓盈亏	CloseProfit	平仓盈亏 F = 买平仓盈亏 + 卖平仓盈亏 = (空头持仓均价 - 成交价) × 成交手数 × 合约乘数 + (成交价 - 多头持仓均价) × 成交手数 × 合约乘数
动态权益	DynamicRights	
今日出入金	TodayInOut	
多头冻结的保证金	LongFrozenMargin	委托冻结保证金 A = 客户当日交易保证金率 × 委托价 × 委托量 × 合约乘数
空头冻结的保证金	ShortFrozenMargin	委托冻结保证金 A = 客户当日交易保证金率 × 委托价 × 委托量 × 合约乘数
总冻结		
冻结的保证金	FrozenMargin	冻结保证金 = 多头 + 空头冻结保证金
多头保证金	LongMargin	成交占用保证金 C = 当日交易保证金率 × 成交价 × 成交量 × 合约乘数
空头保证金	ShortMargin	成交占用保证金 C = 当日交易保证金率 × 成交价 × 成交量 × 合约乘数
占用保证金	Margin	占用保证金 = 多头保证金 + 空头保证金
手续费	Fee	成交占用手续费 D = 当日交易手续费率 × 成交价 × 成交量 × 合约乘数
冻结手续费	FrozenFee	委托冻结手续费 B = 客户当日交易手续费率 × 委托价 × 委托量 × 合约乘数
其他费用		
上次结算准备金	PreBalance	
结算准备金	Balance	结算准备金 H = 上次结算准备金 (PreBalance) - 今日出金 (Deposit) + 今日入金 (Withdraw) + 平仓盈亏 (CloseProfit); + 持仓盈亏 (PositionProfit) + 权利金 (Premium) - 手续费 (Fee) - 其他费用 (OtherFee)
入金金额	Deposit	
出金金额	Withdraw	
持仓盈亏	PositionProfit	持仓盈亏 L = 该资金账户下所有客户持仓的持仓盈亏 其中多头持仓记录的持仓盈亏 = (当前价 - 持仓均价) × 持仓量 × 合约乘数 空头持仓记录的持仓盈亏 = (持仓均价 - 当前价) × 持仓量 × 合约乘数
期权权利金收支	Premium	

二、持仓更新字段

中文字段名称	英文字段名称	公式说明
经纪公司编号	BrokerID	
交易日		
交易类型		
客户号	ClientID	
交易所客户编码		
资金账号	InvestorID	
交易所代码	ExchangeID	
合约代码	InstrumentID	
买卖方向	Direction	
投机套保标志	HedgeFlag	
占用的保证金	UsedMargin	成交占用保证金 $C = \text{当日交易保证金率} \times \text{成交价} \times \text{成交量} \times \text{合约乘数}$
今日持仓	Position	
持仓成本	PositionCost	持仓成本增加 $J = \text{成交价} \times \text{成交量} \times \text{合约乘数}$
昨日持仓	YdPosition	
昨日持仓成本	YdPositionCost	
冻结的保证金	FrozenMargin	委托冻结保证金 $A = \text{客户当日交易保证金率} \times \text{委托价} \times \text{委托量} \times \text{合约乘数}$
冻结持仓	FrozenPosition	
平仓冻结	FrozenClosing	
冻结的权利金	FrozenPremium	
最后一笔成交编号	LastTradeID	
最后一笔本地报单编号	LastOrderLocalID	