1. SimTestFutureOrder.csv（期货报单明细文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TradingDay | 交易日 | 字符串 |  |
| BrokerID | 经纪公司代码 | 字符串 |  |
| InvestorID | 投资者代码 | 字符串 |  |
| OrderRef | 报单引用 | 字符串 |  |
| OrderPriceType | 报单价格条件 | char | 任意价 '1'  限价 '2'  最优价 '3'  最新价 '4'  卖一价 '8'  卖一价 '8'  买一价 ' C'  五档价 ' G' |
| Direction | 买卖方向 | char | 买 ‘0’  卖 ‘1’ |
| OffsetFlag | 开平标志 | char | 开仓 '0'  平仓 '1'  强平 '2'  平今 '3'  平昨 '4'  强减 '5'  本地强平 '6' |
| HedgeFlag | 投机套保标志 | char | Speculation '1'  Arbitrage '2'  Hedge '3' |
| LimitPrice | 委托价格 | double |  |
| VolumeTotalOriginal | 委托数量 | int |  |
| TimeCondition | 有效期类型 | char | 立即完成，否则撤销 '1'  本节有效 '2'  当日有效 '3'  指定日期前有效 '4'  撤销前有效 '5'  集合竞价有效 '6' |
| GTDDate | GTD日期 | 字符串 |  |
| VolumeCondition | 成交量类型 | char | 任何数量 '1'  最小数量 '2'  全部数量 '3' |
| MinVolume | 最小成交量 | int |  |
| ContingentCondition | 触发条件 | char | 立即 '1'  止损 '2'  止赢 '3'  预埋单 '4'  最新价大于条件价 '5'  最新价大于等于条件价 '6'  最新价小于条件价 '7'  最新价小于等于条件价 '8'  卖一价大于条件价 '9'  卖一价大于等于条件价 'A'  卖一价小于条件价 'B'  卖一价小于等于条件价 'C'  买一价大于条件价 'D'  买一价大于等于条件价 'E'  买一价小于条件价 'F'  买一价小于等于条件价 'H' |
| StopPrice | 止损价 | double |  |
| ForceCloseReason | 强平原因 | char | 非强平 '0'  资金不足 '1'  客户超仓 '2'  会员超仓 '3'  持仓非整数倍 '4'  违规 '5'  其它 '6'  自然人临近交割 '7' |
| RequestID | 请求编号 | int |  |
| OrderLocalID | 本地报单编号 | 字符串 |  |
| ExchangeID | 交易所代码 | 字符串 | CFFEX，SHFE，INE，DCE，CZCE，GFEX |
| OrderSysID | 报单编号 | 字符串 |  |
| OrderSource | 报单来源 | char | 来自参与者 '0'  来自管理员 '1' |
| OrderStatus | 报单状态 | char | 全部成交 '0'  部分成交 '1'  未成交 ' 3'  撤单 '5' |
| OrderType | 报单类型 | char | 正常 '0'  报价衍生 '1'  组合衍生 '2'  组合报单 '3'  条件单 '4'  互换单 '5'  大宗交易成交衍生 '6'  期转现成交衍生 '7' |
| VolumeTraded | 成交数量 | int |  |
| VolumeTotal | 剩余数量 | int |  |
| InsertDate | 报单日期 | 字符串 |  |
| InsertTime | 委托时间 | 字符串 |  |
| UpdateTime | 最后修改时间 | 字符串 |  |
| CancelTime | 撤销时间 | 字符串 |  |
| AccountID | 资金账号 | 字符串 |  |
| CurrencyID | 币种代码 | 字符串 |  |
| InstrumentID | 合约代码 | 字符串 |  |
| VolumeMutiple | 合约乘数 | int |  |
| TradeAmount | 报单的成交金额 | double |  |

1. SimTestFutureTrade.csv（期货成交明细文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TradingDay | 交易日 | 字符串 |  |
| TradeDate | 成交日期 | 字符串 |  |
| TradeTime | 成交时间 | 字符串 |  |
| TradeID | 成交编号 | 字符串 |  |
| Direction | 买卖方向 | char | 买 ‘0’  卖 ‘1’ |
| InvestorID | 投资者代码 | 字符串 |  |
| InstrumentID | 合约代码 | 字符串 |  |
| ExchangeID | 交易所代码 | 字符串 | CFFEX，SHFE，INE，DCE，CZCE，GFEX |
| OffsetFlag | 开平标志 | char | 开仓 '0'  平仓 '1'  强平 '2'  平今 '3'  平昨 '4'  强减 '5'  本地强平 '6' |
| Price | 成交价格 | double |  |
| Volume | 成交数量 | int |  |
| OrderRef | 报单引用 | 字符串 |  |
| BrokerID | 经纪公司代码 | 字符串 |  |
| TradeMDUpTime | 回测中驱动本次成交的行情 | 字符串 | 数据格式：HH:MM:SS.mmm  （HH:MM:SS 是24小时制显示，mmm是毫秒）。  通过InstrumentID，TradingDay，TradeMDUpTime三个字段便可以找到对应那条行情记录。 |
| OrderSysID | 报单编号 | 字符串 |  |
| TradingRole | 交易角色 | char | 代理 '1'  自营 '2'  做市商 '3' |
| HedgeFlag | 投机套保标志 | char | Speculation '1'  Arbitrage '2'  Hedge '3' |
| PriceSource | 成交价来源 | char | 前成交价 '0'  买委托价 '1'  卖委托价 '2' |
| OrderLocalID | 本地报单编号 | 字符串 |  |
| Commission | 手续费 | double |  |
| VolumeMutiple | 合约乘数 | int |  |

1. SimTestFuturePosition.csv（期货综合持仓文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TradingDay | 交易日 | 字符串 |  |
| BrokerID | 经纪公司代码 | 字符串 |  |
| InvestorID | 投资者代码 | 字符串 |  |
| InstrumentID | 合约代码 | 字符串 |  |
| ExchangeID | 交易所代码 | 字符串 | CFFEX，SHFE，INE，DCE，CZCE，GFEX |
| PosiDirection | 持仓多空方向 | char | 多头 ‘2’  空头 ‘3’ |
| HedgeFlag | 投机套保标志 | char | Speculation '1'  Arbitrage '2'  Hedge '3' |
| PositionDate | 持仓日期 | char | 今日持仓：‘1’  历史持仓：‘2’ |
| YdPosition | 上日持仓 | int |  |
| Position | 今日持仓 | int |  |
| OpenVolume | 开仓量 | int |  |
| CloseVolume | 平仓量 | int |  |
| OpenAmount | 开仓金额 | double |  |
| CloseAmount | 平仓金额 | double |  |
| PositionCost | 持仓成本 | double |  |
| PreMargin | 上次占用的保证金 | double |  |
| UseMargin | 占用的保证金 | double |  |
| CashIn | 资金差额 | double |  |
| Commission | 手续费 | double |  |
| CloseProfit | 平仓盈亏 | double |  |
| PositionProfit | 持仓盈亏 | double |  |
| PreSettlementPrice | 上次结算价 | double |  |
| SettlementPrice | 本次结算价 | double |  |
| SettlementID | 结算编号 | int |  |
| OpenCost | 开仓成本 | double |  |
| ExchangeMargin | 交易所保证金 | double |  |
| CombPosition | 组合成交形成的持仓 | int |  |
| CloseProfitByDate | 逐日盯市平仓盈亏 | double |  |
| CloseProfitByTrade | 逐笔对冲平仓盈亏 | double |  |
| TodayPosition | 今日持仓 | double |  |
| MarginRateByMoney | 保证金率 | double |  |
| MarginRateByVolume | 保证金率(按手数) | double |  |
| InvestUnitID | 投资单位代码 | 字符串 |  |
| PositionCostOffset | 持仓成本差值 | double |  |
| TasPosition | tas持仓手数 | int |  |
| TasPositionCost | tas持仓成本 | double |  |
| VolumeMutiple | 合约乘数 | int |  |

1. SimTestFuturePositionDetail.csv（期货持仓明细文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TradingDay | 交易日 | 字符串 |  |
| BrokerID | 经纪公司代码 | 字符串 |  |
| InvestorID | 投资者代码 | 字符串 |  |
| InstrumentID | 合约代码 | 字符串 |  |
| ExchangeID | 交易所代码 | 字符串 | CFFEX，SHFE，INE，DCE，CZCE，GFEX |
| Direction | 买卖方向 | char | 买 ‘0’  卖 ‘1’ |
| HedgeFlag | 投机套保标志 | char | Speculation '1'  Arbitrage '2'  Hedge '3' |
| OpenDate | 开仓日期 | 字符串 |  |
| TradeID | 成交编号 | 字符串 |  |
| Volume | 数量 | int |  |
| OpenPrice | 开仓价格 | double |  |
| SettlementID | 结算编号 | int |  |
| CloseProfitByDate | 逐日盯市平仓盈亏 | double |  |
| CloseProfitByTrade | 逐笔对冲平仓盈亏 | double |  |
| PositionProfitByDate | 逐日盯市持仓盈亏 | double |  |
| PositionProfitByTrade | 逐笔对冲持仓盈亏 | double |  |
| Margin | 投资者保证金 | double |  |
| ExchMargin | 交易所保证金 | double |  |
| MarginRateByMoney | 保证金率 | double |  |
| MarginRateByVolume | 保证金率(按手数) | double |  |
| LastSettlementPrice | 昨结算价 | double |  |
| SettlementPrice | 结算价 | double |  |
| CloseVolume | 平仓量 | int |  |
| CloseAmount | 平仓金额 | double |  |
| TimeFirstVolume | 先开先平剩余数量 | int |  |
| InvestUnitID | 投资单元代码 | 字符串 |  |
| SpecPosiType | 特殊持仓标志 | char | 普通持仓明细 '#'  TAS合约成交产生的标的合约持仓明细 '0' |
| CombInstrumentID | 组合合约代码 | 字符串 |  |
| VolumeMutiple | 合约乘数 | int |  |

1. SimTestTradingAccount.csv（资金账户明细文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TradingDay | 交易日 | 字符串 |  |
| BrokerID | 经纪公司代码 | 字符串 |  |
| AccountID | 投资者帐号 | 字符串 |  |
| PreMortgage | 上次质押金额 | double |  |
| PreCredit | 上次信用额度 | double |  |
| PreDeposit | 上次存款额 | double |  |
| PreBalance | 上次结算准备金 | double |  |
| PreMargin | 上次占用的保证金 | double |  |
| InterestBase | 利息基数 | double |  |
| Interest | 利息收入 | double |  |
| Deposit | 入金金额 | double |  |
| Withdraw | 出金金额 | double |  |
| CurrMargin | 当前保证金总额 | double |  |
| CashIn | 资金差额 | double |  |
| Commission | 手续费 | double |  |
| CloseProfit | 平仓盈亏 | double |  |
| PositionProfit | 持仓盈亏 | double |  |
| Balance | 期货结算准备金 | double |  |
| Available | 可用资金 | double |  |
| WithdrawQuota | 可取资金 | double |  |
| Reserve | 基本准备金 | double |  |
| Credit | 信用额度 | double |  |
| Mortgage | 质押金额 | double |  |
| ExchangeMargin | 交易所保证金 | double |  |
| DeliveryMargin | 投资者交割保证金 | double |  |
| ExchangeDeliveryMargin | 交易所交割保证金 | double |  |
| ReserveBalance | 保底期货结算准备金 | double |  |
| CurrencyID | 币种代码 | 字符串 |  |
| PreFundMortgageIn | 上次货币质入金额 | double |  |
| PreFundMortgageOut | 上次货币质出金额 | double |  |
| FundMortgageIn | 货币质入金额 | double |  |
| FundMortgageOut | 货币质出金额 | double |  |
| FundMortgageAvailable | 货币质押余额 | double |  |
| MortgageableFund | 可质押货币金额 | double |  |
| SpecProductMargin | 特殊产品占用保证金 | double |  |
| SpecProductCommission | 特殊产品手续费 | double |  |
| SpecProductPositionProfit | 特殊产品持仓盈亏 | double |  |
| SpecProductCloseProfit | 特殊产品平仓盈亏 | double |  |
| SpecProductPositionProfitByAlg | 根据持仓盈亏算法计算的特殊产品持仓盈亏 | double |  |
| SpecProductExchangeMargin | 特殊产品交易所保证金 | double |  |
| BizType | 业务类型 | char | 期货：‘1’  证券：‘2’ |
| FrozenSwap | 延时换汇冻结金额 | double |  |
| RemainSwap | 剩余换汇额度 | double |  |

1. SimTestInitalPosition.csv（ 初始持仓文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| OpenDate | 开仓交易日 | 字符串 |  |
| ExchangeID | 交易所代码 | 字符串 | CFFEX，SHFE，INE，DCE，CZCE，GFEX |
| InstrumentID | 合约代码 | 字符串 |  |
| PosiDirection | 持仓多空方向 | char | 多头 ‘2’  空头 ‘3’ |
| Volume | 持仓 | int |  |
| OpenPrice | 开仓价 | double |  |
| InstrumentType | 合约类型 | 字符串 | 期货 ：’1’  期权 : ‘2’ |
| VolumeMutiple | 合约乘数 | int |  |

1. SimTestSubMD.csv（行情订阅明细文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TradingDay | 交易日 | 字符串 |  |
| ExchangeID | 交易所代码 | 字符串 | CFFEX，SHFE，INE，DCE，CZCE，GFEX |
| InstrumentID | 合约代码 | 字符串 |  |
| InstrumentType | 合约类型 | 字符串 | 期货 ：’1’  期权 : ‘2’ |
| VolumeMutiple | 合约乘数 | int |  |

1. SimTestInfo.csv（回测概要信息文件）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 字段名称 | 字段说明 | 字段类型 | 字段取值范围 |
| TestID | 本次回测标识号 | 字符串 |  |
| TestName | 本次回测名称 | 字符串 |  |
| BrokerID | 经纪公司代码 | 字符串 |  |
| InvestorID | 投资者代码 | 字符串 |  |
| InitalAmount | 初始资金 | 字符串 |  |
| TestBeginTime | 测试开始时间 | 字符串 | 格式YYYYMMDDhhmmss |
| TestEndTime | 测试完成时间 | 字符串 | 格式YYYYMMDDhhmmss |
| ActualMDBeginDate | 回测历史行情实际开始日期 | 字符串 |  |
| ActualMDEndDate | 回测历史行情实际结束日期 | 字符串 |  |
| SetMDBeginDate | 设置的回测历史行情开始日期 | 字符串 |  |
| SetMDEndDate | 设置的回测历史行情结束日期 | 字符串 |  |