

**中国期货监控交易报告库
(CFMMC-TR) 数据报送手册**

**中国期货市场监控中心
China Futures Market Monitoring Center**

2026 年 2 月

修订记录

修订日期	版本号	修订内容
2022年5月	V1.0	首次编制
2022年8月	V1.1	①“19.资产类型”增加“O（其他）”选项。 ②“31.期权产品结构”增加“GSA: 看涨自动赎回-小雪球/保本雪球”选项。 ③增加3个常见问题及解答。
2025年7月	V4.0.0 (适配接口 版本号)	①调整、扩充字段以包含累计期权、安全气囊、雪球变种、彩虹等奇异结构。 ②成交表、持仓表增加盈亏、保证金等相关字段。 ③增加全球唯一交易识别码（UTI）字段。 ④增加第三章《实际名义金额计算说明》。 ⑤增加累计期权报送规则等5个常见问题及解答。
2025年12月	V4.1.0	①调整资金文件的报送范围。
2026年2月	V4.1.1	①完善“AC-结算数量”的定义。 ②增加主交易确认书的命名规则。 ③完善“标的资产品种”的定义。

目录

一、信息报送总体要求	- 1 -
(一) 报告主体	- 1 -
(二) 报送范围	- 1 -
(三) 报送文件	- 1 -
(四) 报送时限	- 2 -
二、成交文件、持仓文件的字段解释及填报要求	- 2 -
(一) 交易对手方相关字段	- 2 -
1. 交易对手方 2 名称	- 2 -
2. 交易对手方 2 的统一社会信用代码	- 3 -
3. 交易对手方 2 的 LEI	- 3 -
4. 与交易对手方 1 是否为关联方	- 4 -
5. 交易所“保险+期货”业务编码	- 4 -
6. 主协议类型	- 4 -
7. 主协议日期	- 5 -
(二) 交易类型相关字段	- 5 -
8. 交易类型	- 5 -
9. 交易类型细分	- 6 -
(三) 清算、交易相关字段	- 7 -
10. 是否中央对手方清算	- 7 -
11. 中央清算平台名称	- 7 -
12. 交易平台	- 8 -
(四) 交易编码相关字段	- 8 -

13. 交易确认书编号	- 8 -
14. 成交编号	- 8 -
15. 持仓编号	- 9 -
16. UTI	- 9 -
17. 多腿编号	- 9 -
(五) 时间相关字段	- 9 -
18. 交易确认日期 (开仓)	- 10 -
19. 生效日	- 10 -
20. 到期日	- 10 -
21. 提前终止日期	- 10 -
22. 日期归属地	- 11 -
(六) 产品及标的的基本信息相关字段	- 11 -
23. 交易对手方 1 方向	- 11 -
24. 工具类型	- 12 -
25. 执行价格/远期价格取值方式	- 12 -
26. 标的个数	- 12 -
27. 多标的权重分配方式	- 13 -
28. 多标的权重	- 13 -
29. 资产类型	- 13 -
30. 标的资产所属板块	- 14 -
31. 标的资产品种	- 15 -
32. 标的资产对应合约	- 16 -

33. 标的期初价格.....	- 18 -
34. 标的期初价格货币.....	- 19 -
35. 标的期初价格符号.....	- 19 -
36. 平仓或终止时的标的价格.....	- 19 -
(七) 期权产品基本信息相关字段.....	- 20 -
37. 期权行权时间类型.....	- 20 -
38. 期权权利类型.....	- 20 -
39. 期权产品结构.....	- 21 -
40. 其他期权产品结构描述.....	- 30 -
41. 执行价格 1.....	- 30 -
42. 参与率 1.....	- 31 -
43. 执行价格 2.....	- 31 -
44. 参与率 2.....	- 32 -
45. 执行价格 3.....	- 32 -
46. 参与率 3.....	- 32 -
47. 执行价格 4.....	- 32 -
48. 参与率 4.....	- 32 -
49. 执行价格/障碍价货币.....	- 33 -
50. 执行价格/障碍价符号.....	- 33 -
51. 观察类型.....	- 33 -
52. 观察起始日 (含).....	- 34 -
53. 观察结束日 (含).....	- 34 -

54. 离散观察日	- 34 -
55. 敲出收益计算方式	- 35 -
56. 保底收益	- 35 -
57. 保底收益货币	- 35 -
58. 保底收益符号	- 35 -
59. 是否已敲入	- 36 -
(八) 奇异期权相关字段	- 36 -
60. 估值时已观察均值	- 36 -
61. 行权收益 1	- 37 -
62. 行权收益 2	- 37 -
63. 行权收益 3	- 38 -
64. 行权收益 4	- 38 -
65. 行权收益货币	- 38 -
66. 行权收益符号	- 38 -
67. 障碍价 1	- 39 -
68. 障碍价 1 触碰方向	- 39 -
69. 障碍价 1 类型	- 39 -
70. 障碍价 2	- 40 -
71. 障碍价 2 触碰方向	- 40 -
72. 障碍价 2 类型	- 41 -
73. 补偿收益 1	- 41 -
74. 补偿收益 2	- 41 -

75. 补偿收益货币	41 -
76. 补偿收益符号	41 -
77. AC-未敲入未敲出累计方式	42 -
78. AC-敲入累计方式	43 -
79. AC-敲出结算方式	44 -
80. AC-单次观察数量	45 -
81. AC-累计倍数	45 -
82. AC-额外买卖观察日	46 -
83. AC-敲入额外买卖数量	46 -
84. AC-保护期起始日 (含)	46 -
85. AC-保护期终止日 (含)	46 -
86. AC-结算数量	47 -
87. AC-计入估值的已累数量	47 -
88. SA&PA-敲入障碍价	47 -
89. SA&PA-敲入后是否观察敲出	48 -
90. SA&PA-敲出观察日	48 -
91. SA&PA-敲出障碍价	48 -
92. SA&PA-Coupon 收益率	48 -
93. SA&PA-Coupon 收益率符号	49 -
94. PA-Coupon 观察日	50 -
95. PA-Coupon 障碍价	50 -
(九) 远期交易相关字段	50 -

96. 远期价格.....	50 -
97. 远期价格货币.....	51 -
98. 远期价格符号.....	51 -
(十) 互换交易相关字段.....	51 -
99. 互换类型.....	51 -
100. 固定收益.....	52 -
101. 固定收益货币.....	52 -
102. 固定收益符号.....	52 -
103. 浮动方方向.....	53 -
104. 支付周期.....	53 -
105. 支付周期乘数.....	53 -
(十一) 名义金额、名义数量相关字段.....	54 -
106. 初始名义金额.....	54 -
107. 交易名义金额.....	54 -
108. 已平仓总名义金额.....	54 -
109. 外汇兑人民币期初汇率.....	56 -
110. 初始名义数量.....	56 -
111. 交易名义数量.....	57 -
112. 已平仓总名义数量.....	57 -
113. 数量单位.....	58 -
114. 是否为年化名义金额.....	59 -
115. 参与率.....	60 -

(十二) 估值相关字段.....	60 -
116. 合约估值时标的价格.....	60 -
117. 合约价值.....	61 -
118. 估值方法.....	61 -
119. 浮动盈亏.....	62 -
120. 保证金占用.....	62 -
121. 是否为组合保证金.....	62 -
122. 组合标识.....	62 -
123. 估值波动率.....	63 -
124. 一年有效天数.....	63 -
125. 无风险利率.....	63 -
126. 股息.....	63 -
127. Delta.....	64 -
128. Gamma.....	64 -
129. Vega.....	64 -
130. Theta.....	64 -
131. Rho.....	65 -
132. RhoQ.....	65 -
133. Delta cash.....	65 -
134. Gamma cash.....	65 -
(十三) 结算相关字段.....	68 -
135. 观察价格取值方式.....	68 -

136. 结算价取值方式.....	69 -
137. 结算价取值日.....	70 -
138. 收益划转时间.....	71 -
139. 结算方式.....	71 -
140. 最后结算日.....	71 -
141. 开仓收支或结算收益.....	71 -
142. 实现盈亏.....	72 -
三、实际名义金额计算说明	72 -
四、常见问题及解答	73 -
Q1.已完成场外衍生品业务备案，尚未开展交易，如何报送数据？.....	73 -
Q2.被暂停新增场外衍生品业务，如何报送数据？.....	73 -
Q3.风险管理公司现货团队开展的场外衍生品交易是否报送？.....	73 -
Q4.文件命名有何要求？.....	73 -
Q5.对于在境内证券或期货交易所交易日以外的自然日达成的交易，交易确认日期按哪天报送？.....	74 -
Q6.若发现历史报送数据出现错误怎么办？.....	74 -
Q7.若双方约定之前报送的某笔交易取消或修改怎么报送？.....	75 -
Q8.若出现新开仓交易时的个别交易要素与后来收到的交易确认书里的内容不一致的情况，如何填报？.....	76 -
Q9.涉及多腿的香草期权、奇异期权如何报送？...-	76 -

- Q10.如果期权产品结构为 O（其他），如何填报？ - 77 -
- Q11.如果标的资产为多资产，填报时需要注意什么？ - 77 -
- Q12.成交文件和持仓文件中哪些字段填报时需要考虑
买卖方向？填报哪一方的方向？ - 78 -
- Q13.资金文件中“当日出入金”是站在哪个账户角度的
出入金？ - 78 -
- Q14.商品 ETF 属于商品类还是权益类？ - 78 -
- Q15.同一交易确认书包含多笔交易，是否需要多次上传
该交易确认书？ - 79 -
- Q16.公司与客户平仓时未签署平仓交易确认书，而是出
具清算报告，清算报告是否要上传？ - 79 -
- Q17.公司与客户签署交易确认书时只加盖单章，公司并
无必须加盖双章的相关规定，是否只上传加盖单章的交易确
认书？ - 79 -
- Q18.客户端安装完成后需要配置什么？ - 79 -
- Q19.收不到验证码怎么办？ - 79 -
- Q20.挂钩外盘标的的交易由于获取某些交易要素时间
晚，无法在 T+1 日 14 点前完成报送怎么办？ - 80 -
- Q21.累计期权新开仓和观察后如何报送成交、持仓？ - 80 -
- Q22.对于观察后不即期结算，仅累计数量的累计期权，
若对已累数量进行部分平仓，如何报送交易名义金额和数量？
..... - 82 -

一、信息报送总体要求

(一) 报告主体

在中国期货业协会完成场外衍生品业务备案的公司。

(二) 报送范围

报告主体开展的所有场外衍生品业务。

(三) 报送文件

序号	文件类型	解释	文件格式	命名规则
1	成交文件	某一交易日确认的所有新开仓、取消、平仓、终止等的场外衍生品成交明细	Excel	otctrddata+交易确认日期
2	持仓文件	某一交易日未平仓的场外衍生品持仓明细	Excel	otcposdata+持仓日期
3	资金文件	某一交易日交易对手方的资金相关信息,包括当日有成交、持仓、现金或抵押品及其流水、授信额度、交易权限的交易对手方	Excel	funddata+结算日期
4	主协议	某一交易日与对手方签署的主协议	Pdf 或 Word	交易对手方 2 名称+签署日期+主
5	补充协议	某一交易日与对手方签署的补充协议	Pdf 或 Word	交易对手方 2 名称+签署日期+补
6	履约担保协议	某一交易日与对手方签署的履约担保协议	Pdf 或 Word	交易对手方 2 名称+签署日期+履
7	交易确认书	某一交易日确认的所有新开仓、平仓、终止等的场外衍生品交易确认书	Pdf 或 Word	1. 主交易确认书: 交易对手方 2 名称+XX 主交易确认书+签署日期

				2.不涉及主交易 确认书：交易确 认书编号+交易 确认日期
--	--	--	--	--

（四）报送时限

成交文件、持仓文件、资金文件：逐日报送，T+1 日下午 14 点前报送 T 日（交易日）信息，原则上 T-1 日 16:00 至 T 日 16:00 定义为 T 日，请注意要在 14 点前上报成功，而不是 14 点前点击报送按钮。

主协议：原则上主协议签署后的 5 个工作日内（即 T+5）上报双方盖章版的主协议。

补充协议：原则上补充协议签署后的 5 个工作日内（即 T+5）上报双方盖章版的补充协议。

履约担保协议：原则上履约担保协议签署后的 5 个工作日内（即 T+5）上报双方盖章版的履约担保协议。

交易确认书：逐日报送，原则上 T+1 日下午 14 点前报送 T 日的交易确认书（未盖章版或盖章版均可），双方盖章版的交易确认书（如有）不得晚于 T+1 月最后一个工作日（含）之前上报。

二、成交文件、持仓文件的字段解释及填报要求

（一）交易对手方相关字段

1.交易对手方 2 名称

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指签署交易确认书的交易对手方全称，一般情况下与其统一社会信用代码一一对应，勿填写简称。例：若对手方为 XXXX 有限公司，请填“XXXX 有限公司”，勿填“XXXX”。

若交易对手方为子公司某事业部，需填写子公司名称，而非某事业部。例：若对手方为 XXXX 有限公司-YYYY 部、XXXX 有限公司-ZZZZ 部等，请填写该公司全称“XXXX 有限公司”。

若交易对手方为产品，只填报产品名称即可，无需按照“产品名称-产品管理人全称”填写。产品名称应与其在中国证券投资基金业协会备案产品时的产品名称一致。

2.交易对手方 2 的统一社会信用代码

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易对手方营业执照上的统一社会信用代码。请注意填报格式为文本格式，防止统一社会信用代码出现科学计数法的格式。

若交易对手方为境外法人，则填写该公司在注册地的商业登记号码。

若交易对手方为产品，请填写该产品对应管理人的统一社会信用代码。

3.交易对手方 2 的 LEI

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：LEI (Legal Entity Identifier) 指“法人机构识别编码”，是给机构分配的一个编码，用于识别法人机构，功能类似

于国内的统一社会信用代码，区别在于统一社会信用代码就像给企业颁布的“身份证”，LEI 编码用于国际交易，正如给企业颁发的“护照”。若交易对手方有 LEI 编码，则填写，若无，则无需填写。

4.与交易对手方 1 是否为关联方

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：如果双方的交易符合填报方的关联交易管理制度中对关联交易的认定，则该字段应填 Y（是）。如果填报方没有关联方的认定依据，则可参考财政部《企业会计准则第 36 号-关联方披露》中的第二章。以下为参考网址：

https://kjs.mof.gov.cn/zt/kjzzss/kuaijizhunzeshishi/200806/t20080618_46245.htm

5.交易所“保险+期货”业务编码

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指商品交易所为其“保险+期货”项目分配的项目编号。

6.主协议类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：交易双方已签署的主协议类型，如 SAC2019（中国证券期货市场场外衍生品交易主协议）、ISDA（国际场外衍生品交易标准协议）、NAFMII（中国银行间市场金融衍生产品交易主协议）等。

7.主协议日期

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方签署主协议的日期。

(二) 交易类型相关字段

8.交易类型

所在文件：仅成交文件

字段释义：指该笔成交的具体类型，可选项包括 NT、MD、OB、ER、FU、PU、ED。各选项释义如下：

NT（新交易）：表示新开仓的交易。

MD（修改）：先前上报的该笔交易各字段信息均无误，但是双方约定对交易的内容进行修改，新交易要素替换原交易要素，如展期、名义金额变更、股票除权除息等。

OB（已观察）：对于在到期前涉及部分结算的交易，记录观察事件发生后的结算操作，如累计期权。

ER（取消）：先前上报的该笔成交尚未生效，但是交易双方约定取消该笔交易。

FU（完全解约）：交易双方主动协商通过一笔反向交易平仓。

PU（部分解约）：交易双方主动协商通过一笔反向交易部分平仓。

ED（终止）：根据合约条款，该笔交易在该时间点结束，或合约赋予一方或双方终止合约的权利。填报该字段时还需注意：

（1）若标的资产价格触及敲出障碍价，合约终止，敲出当

日该笔交易按照 ED 进行上报。

(2) 对于提前终止的交易，若以平仓形式提前终止，则填报 FU；若以行权形式提前终止，则填报 ED。

(3) 若由于发生交易对手方违约或不可抗力事件，被迫提前终止原交易，而非交易双方主动自愿协商提前平仓，则按照 ED 进行上报。

(4) 涉及到个股标的除权除息的情况，成交文件中“交易类型”填报为 MD，其他交易要素按照除权除息后的最新情况进行上报，持仓文件按照最新的信息填报即可。

(5) 若与交易对手方协商通过修改原交易的“到期日”实现展期，其他交易要素均不变，则该笔交易按照 MD 进行上报。

9.交易类型细分

所在文件：仅成交文件

字段释义：指该笔成交的交易类型的细分情况，可选项包括 DMD、EXMD、POB、FWOB、DED、KED、EED、DFED、FMED、O。各选项释义如下：

DMD (展期)：通过修改原交易的“到期日”实现展期，其他交易要素均不变。

EXMD (除权除息)：由于发生除权除息而修改原交易的相关交易要素。

POB (部分结算)：记录交易到期前，观察后提前结算的部分，如累计期权。

FWOB (新生成远期/互换): 表示观察后自动生成的远期/互换交易, 如累计期权。

DED (到期终止): 存续期内未发生提前终止事件, 按约定的到期日正常到期终止。

KED (敲出终止): 发生敲出事件导致交易提前终止。

EED (提前行权): 美式期权提前行权。

DFED (违约终止): 指由于交易对手方违约而提前终止原交易。

FMED (不可抗力终止): 指由于不可抗力而提前终止原交易。

O (其他): 其他非上述细分的交易类型。

(三) 清算、交易相关字段

10.是否中央对手方清算

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 用于标识该笔交易是否在中央对手方清算或计划提交至中央对手方清算。

11.中央清算平台名称

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 若“是否中央对手方清算”填写 Y, 则在这里填写具体的中央清算平台名称。若“是否中央对手方清算”填写 N, 则该字段无需填写。中央对手方清算与第三方交易平台不同, 中央对手方具有履约担保的作用。例: 目前大商所场外交易平台不提

供中央对手方清算服务，因此不是中央清算平台，仅作为第三方交易平台。

12. 交易平台

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易达成的交易平台，包含 C（公司柜台）、S（上海期货交易所场外交易平台）、Z（郑州商品交易所场外交易平台）、D（大连商品交易所场外交易平台）和 O（其他）共五个选项。

（四）交易编码相关字段

13. 交易确认书编号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方签署的交易确认书的编号。成交文件中，若为平仓或到期终止交易，请填写该笔交易平仓或终止时对应的交易确认书编号。若报告主体在记录平仓或终止交易时未设置新的交易确认书编号，则填写开仓时的交易确认书编号。若报告主体上报数据时未获得交易确认书编号，则无需填写，待获取后在持仓文件中更新。

14. 成交编号

所在文件：仅成交文件

字段释义：指报告主体为每笔成交编制的唯一识别码，此编号应该在报告主体的所有历史成交中具有唯一性，且针对同一笔交易的不同生命周期，成交编号应不同，类似于每笔成交的“身

份证号”。也就是说，成交文件中，平仓或到期终止交易对应的成交编号应与该笔交易开仓时的成交编号不同。该字段用于统计成交笔数。

15.持仓编号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指报告主体为每笔持仓编制的唯一识别码，此编号应该在报告主体的所有持仓以及该笔持仓的生命期内具有唯一性，类似于每笔持仓的“身份证号”。也就是说，成交文件中，平仓或终止交易对应的持仓编号应与该笔交易开仓时的持仓编号保持一致。该字段用于统计持仓笔数。

16.UTI

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：全球唯一交易识别码（unique transaction identifier），指在交易主体和（或）在该交易发生的管理体系的认可下，分配给一笔金融交易的全球唯一字符串。

17.多腿编号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指一笔组合交易涉及多腿时，按照多腿数量从1开始依次编号。若交易仅包含1腿，多腿编号应为空。若组合交易的某一腿平仓，剩余腿的多腿编号仍要填写原有编号。同一笔组合的各腿对应的成交编码和持仓编码均应相同。

（五）时间相关字段

18.交易确认日期（开仓）

所在文件：仅持仓文件

字段释义：双方确认交易正式生成的时间。请注意与上报该笔交易开仓时的交易确认日期保持一致。例：某笔交易于3月1日达成，3月2日上传3月1日成交数据时报送了该笔交易，则该笔交易出现在持仓表时，“交易确认日期（开仓）”应始终为3月1日。

19.生效日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方确认的该场外衍生品交易合约生效日期，该日期在该交易生命期内不可以调整。成交文件中，若该笔交易为平仓或到期终止，请填写开仓时的生效日期，请勿填写为平仓或到期终止日期。

20.到期日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方确认的该场外衍生品交易合约失效日期，提前终止日期不影响到期日。

21.提前终止日期

所在文件：仅成交文件

字段释义：指交易的提前终止动作的发生日期，适用情形如下：

（1）双方协商提前终止，如“交易类型”为FU（完全解

约)或 PU(部分解约);

(2)符合双方签署的主协议、补充协议或交易确认书等规定的提前终止条款,如“交易类型细分”为 KED(敲出终止)、EED(提前行权)、DFED(违约终止)、FMED(不可抗力终止)。

22.日期归属地

所在文件:成交文件、持仓文件

字段释义:指生效日、到期日等估值相关参数(不含交易确认日期)参照哪个地区的日历,可选项包括 1(北京时间)、2(标的所在交易所时间)、9(其他)。

(六)产品及标的的基本信息相关字段

23.交易对手方 1 方向

所在文件:成交文件、持仓文件

字段释义:用于识别交易对手方 1(即风险管理公司)是买方还是卖方、浮动方还是固定方。根据工具类型不同,该字段的允许值不同,具体如下:

针对期权和远期交易:

B:买方

S:卖方

针对互换交易:

P: payer, 即付固定、收浮动方

R: receiver, 即收固定、付浮动方

若该笔交易为全部平仓、部分平仓或终止(即交易类型字

段填报 **FU**、**PU** 或 **ED**), 填报方向应与开仓 (即交易类型字段为 **NT**) 时方向一致。

24.工具类型

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指该笔交易所采用的工具种类, 包括四个可选项, 为 **SW**、**OP**、**FW**、**O**, 分别表示互换 (掉期)、期权、远期、其他, 共四类。

25.执行价格/远期价格取值方式

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指期权执行价、远期价格的取值方式, 包含以下 5 个选项:

- 1: 固定值;
- 2: 不涉及;
- 3: 观察期内标的收盘价的算术平均值;
- 4: 观察期内标的结算价的算术平均值;
- 5: 观察期内成交量加权平均价格 (**VWAP**);
- 6: 观察期内时间加权平均价格 (**TWAP**);
- 99: 其他。

其中, 对于执行价可变的亚式结构来说, 该字段应选择 3、4、5、6。对于小雪球/保本雪球 (二元) 等不涉及敲入的自动赎回结构来说, 该字段应选择 2。

26.标的个数

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易挂钩的标的个数。其中，对于在境内外交易所已上市的一篮子（价格）标的，如 ICE 新加坡柴油与布伦特原油裂解价差期货，应视为单标的，该字段应填 1。

27.多标的权重分配方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易挂钩多标的时，各标的权重的分配逻辑，包括 1（最优）、2（最差）、3（一篮子（价格））、4（一篮子（收益率））、5（彩虹）、99（其他），共 6 个选项。其中，“最优”指选取观察期内收益率表现最佳的单一标的的收益率；“最差”指选取观察期内收益率表现最劣的单一标的的收益率；“一篮子（价格）”指各标的的价格按照固定权重经简单运算形成新标的，如猪饲料价格、跨品种价差；“一篮子（收益率）”指各标的在观察期内的收益率按照固定权重经简单运算形成新标的；“彩虹”指按照观察期内标的的收益率表现从高到低排序依次给各标的的收益率分配权重，且分配的权重至少有 2 个非零值；“其他”指除上述以外的其他权重分配方式。

28.多标的权重

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指当多标的权重分配方式为 5（彩虹）时，各标的从高到低排序后对应的权重，用英文分号隔开，如 0.5;0.3;0.2。

29.资产类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的资产大类，包括六个可选项，为 IR、CO、CR、FX、EQ 和 O，分别表示利率、商品、信用、外汇、权益和其他。请按照上述的英文简称格式填报。

挂钩标的为公募基金的，基金合同明确约定利率债投资比例不低于非现金基金资产 80%的债券基金、债券型基金中基金（FOF）、同业存单基金、货币基金按利率类报送。股票基金、偏股混合型基金、股票型基金中基金（FOF）、偏股混合型基金中基金（FOF）、基金合同明确约定可转债（含可交债）投资比例不低于非现金基金资产 80%的债券基金、公开募集基础设施基金按权益类报送。其他债券基金按信用类报送。黄金及商品期货 ETF 按商品类报送。其他混合基金、其他基金中的基金（FOF）按其他类报送。

30.标的资产所属板块

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的板块，请参考《中国期货监控交易报告库（CFMMC-TR）数据报送接口说明》中的“5.场外标的资产分类表”，按照相应代码填写。表格中未列明的品种，请按照该品种实际所属板块填写，而不是上报为其他。

若多标的资产涉及多个品种，且这些品种均属同一个板块，填报该板块即可，无需分号分隔。例：多标的资产均为 Ferrous，填报 Ferrous 即可，无需填报为 Ferrous;Ferrous。

31.标的资产品种

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的品种，请参考《中国期货监控交易报告库（CFMMC-TR）数据报送接口说明》中的“5.场外标的资产分类表”，按照相应代码填写。填写时请注意：

（1）若标的资产为境内外的场内期货品种，请填写具体的品种代码，勿填写中文名称或合约代码，且在尾部填写交易所后缀（交易所后缀见《中国期货监控交易报告库（CFMMC-TR）数据报送接口说明》中的“4.交易所代码”）。例：大商所豆粕期货，需填写 M.DCE，而不是 M 或 M2605；新交所标胶 20 号，要填写 TF.SG，而不是 TF；LME 锡，要填写 SN.LME，而不是 SN。

（2）若标的资产为上海黄金交易所的 AU9999、AUTD、AGTD 等品种，请填写 AU9999.SGE、AUTD.SGE、AGTD.SGE 等，而不是 AU 或者 AG。

（3）若标的资产为现货品种，如螺纹钢现货、热轧卷板现货，勿填写 RB、HC，而要填写“螺纹钢现货”、“热轧卷板现货”。若标的资产为现货指数，请填写现货指数的具体名称，如“螺纹钢现货指数”。

（4）若标的资产为多标的，即涉及多个品种（指数除外，指数为单标的），请用**英文分号**分隔开不同品种。若标的资产为同一期货品种的跨月价差，填写该品种即可，无需分号分隔。若

标的资产为跨品种价差或同一品种的期现价差、内外盘价差，需用英文分号隔开两个品种。

例：标的资产对应合约为 RB2605.SHF-RB2610.SHF，标的资产品种应填写为 RB.SHF；

标的资产对应合约为 RB2605.SHF-HC2605.SHF，标的资产品种应填写为 RB.SHF;HC.SHF；

标的资产对应合约为 AU2606.SHF-AU9999.SGE，标的资产品种应填写 AU.SHF;AU9999.SGE；

标的资产对应合约为 PB 粉(PBF)青岛港、日照港均价-I2601.DCE，标的资产品种应填写铁矿石现货;I.DCE。

(5) 若标的资产为商品指数，请填写指数名称，按照单标的的规则填写，勿填写构成指数的各个品种，如大商所猪饲料成本指数，应填写“大商所猪饲料成本指数”，勿填写 C.DCE;M.DCE 或 $0.68C+0.2M$ 。

若标的资产不是大商所猪饲料成本指数，而是用玉米期货和豆粕期货加权平均合成的价格，比如 $0.68C+0.2M$ ，应将该标的视为多标的，需按照上述(4)多标的资产的相关要求填写。

32.标的资产对应合约

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的具体合约。填报时请注意：

(1) 若标的资产对应合约在场内期货合约，请填写合约全

称，且在合约尾部填写交易所后缀（交易所后缀见《中国期货监控交易报告库（CFMMC-TR）数据报送接口说明》中的“4.交易所代码”）。如：豆粕 2605 合约，请填写 M2605.DCE，勿填写 M2605 或 2605。

（2）若标的资产对应合约为境内沪深交易所上市产品，请填写交易所为该合约编制的编码，且在合约尾部填写交易所后缀。如平安银行股票为 000001.SZ，浦发银行股票为 600000.SH，而不是 000001、600000。

（3）若标的资产对应合约为多标的，即涉及多个合约（指数除外），且“多标的权重分配方式”为 3（一篮子（价格））或 4（一篮子（收益率）），要以 A-B、A+B、A+B-C 等形式来报送，如 RB2605.SHF-HC2605.SHF。若多个合约间的系数不是 1: 1，填写该字段时要加上系数，如 PP2605.DCE-3MA605.CZC。请注意填写该字段时，“+”“-”符号仅用于反映多标的之间的运算关系，其他情况下不能出现“+”“-”符号，比如 Mysteel 杭州 HRB400E 螺纹钢 Φ16-25MM 沙钢永钢中天均价，中间的“16-25”应该填写为“16_25”或“16~25”，而不是“16-25”。

（4）若“多标的权重分配方式”为 1（最优）、2（最差）、5（彩虹）或 99（其他），要以“&”符号连接各合约，如“A&B&C”。

（5）若标的资产是指数（商品指数或股指），请填写该指数对应的万得代码，按照单标的的规则填写，请勿遗漏交易所后缀。如大商所猪饲料成本指数，应填写 DCEPFCI.DCE，而不是

0.68C+0.2M; 沪深 300 指数, 应填写 000300.SH、399300.SZ。注意填报文本格式, 以免出现诸如“000300.SH”在报送后显示为“300.SH”等类似情况。

(6) 若标的资产不是大商所猪饲料成本指数, 而是用玉米期货和豆粕期货加权平均合成的价格, 应将该标的视为多标的, 需按照上述(3)多标的的相关要求填写, 即应按照 0.68C2609.DCE+0.2M2609.DCE 的形式填写。

(7) 若标的资产对应合约为现货或现货指数, 请填写详细的标的信息, 如 PB 粉 (PBF) 青岛港日照港均价。

33. 标的期初价格

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指该笔交易开仓时标的资产的期初价格。填报该字段时请注意:

(1) 若标的涉及多资产, 则请按照“标的资产对应合约”中的资产顺序, 用**英文分号**隔开多个资产的期初价格。若多资产标的中各资产系数不为 1, 填写该字段时无需考虑系数。

(2) 若“标的期初价格符号”为百分比, 标的期初价格请转化为小数填写, 例: LIBOR 标的期初价格为 1.5%, 在该字段要填写 0.015。

(3) 若标的期初价格货币为外币, 则需转化为该币种的多少元或人民币的多少元。涉及品种包括但不限于 CBOT 大豆期货、CBOT 豆油期货、CBOT 活牛期货、CBOT 堪麦期货、CBOT

小麦期货、CBOT 玉米期货、CME 育肥牛期货、ICE11 号糖期货、ICE 咖啡期货、ICE 棉花期货、新交所 20 号胶期货。例：CBOT 玉米期货的报价单位为“美分/蒲式耳”，填写该字段时需转化为“美元/蒲式耳”或“人民币元/蒲式耳”。

34.标的期初价格货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“标的期初价格”的币种单位。若标的为多资产且货币单位一致，填写该货币单位即可。若标的为多资产且货币单位不一致，则按照“标的资产对应合约”的资产顺序用英文分号隔开多个货币单位。

35.标的期初价格符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“标的期初价格”的表达方式，包括 1（货币金额）、2（百分比）、3（指数点）、4（其他）四个选项。货币金额指用货币进行标价，通常情况下当标的资产为商品类时，标的期初价格符号为货币金额，例：20 人民币或 20 美元。百分比通常出现在标的资产为利率、债券、波动率的情形中，例：LIBOR 标的期初价格为 1.5%，此时需要选择百分比。指数点通常出现在标的资产为沪深 300 指数、沪深 300 股指期货等股指类情形中，例：沪深 300 指数期初价格为 3700，此时需要选择指数点。

36.平仓或终止时的标的价格

所在文件：仅成交文件

字段释义：指该笔交易平仓或终止时的标的价格。填报时请注意：

（1）若标的为多资产，则请按照“标的资产对应合约”中的资产顺序，用英文分号隔开多个资产平仓或终止时的价格。若多资产标的中各资产系数不为 1，填写该字段时无需考虑系数。

（2）该字段对应的货币和价格符号与“标的期初价格”保持一致。

（七）期权产品基本信息相关字段

37. 期权行权时间类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以选择行权时间的类型，包括 EU（欧式）、US（美式）、BD（百慕大式）、O（其他）四个选项。欧式期权指期权买方仅可以在期权到期时选择是否行权。美式期权指期权买方可以在期权到期前（含到期当天）任何一天选择是否行权。百慕大期权指期权买方可以在到期日前所规定的一系列时间里选择是否行权。

38. 期权权利类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指买方可以选择买入或卖出的权利类型，包括 1（看跌）、2（看涨）、3（选择）、9（其他）四个选项。填报时请注意：

（1）香草组合期权的“期权权利类型”要按照拆分后每腿期

权的实际类型填报，勿将各腿统一报送为 9（其他）。

（2）当“期权产品结构”为自动赎回类时，此处请填写敲出状态时期权的“期权权利类型”。比如正向标准雪球，敲出障碍价大于等于标的期初价格，需填 2（看涨）。

（3）针对累计期权及其变种，累购需填 2（看涨），累沽需填 1（看跌）。

（4）选项 3（选择）指期权买方在约定时间可以选择期权权利类型是看涨还是看跌。

39.期权产品结构

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔期权交易的结构类型，包括以下五大类：

①. 香草及其组合：VA（香草）

②. 二元及其组合：DI（标准二元）、RA（区间累计）、DIV（二元变种（现有字段支持报送））、DIO（二元变种（现有字段不支持报送））

③. 障碍及其组合：SB（单障碍期权）、SBV（单障碍期权变种（现有字段支持报送））、SBO（单障碍期权变种（现有字段不支持报送））、AC（标准累计）、ACV（累计变种（现有字段支持报送））、ACO（累计变种（现有字段不支持报送））、AB（标准安全气囊）、ABV（安全气囊变种（现有字段支持报送））、ABO（安全气囊变种（现有字段不支持报送））

④. 自动赎回类：GSA（小雪球/保本雪球（二元、三元））、

SA (标准雪球)、SAV (雪球变种 (现有字段支持报送))、SAO (雪球变种 (现有字段不支持报送))、PA (标准凤凰)、PAV (凤凰变种 (现有字段支持报送))、PAO (凤凰变种 (现有字段不支持报送))

⑤. 其他类: O (其他)

各产品结构介绍如下:

(1) 香草期权 (VANILLA, 简称 VA): 也称普通期权, 指赋予期权买方在未来一定时间以事先约定的价格买入或卖出标的资产的权利。香草组合期权应按腿报送, 如两条腿组成的跨式期权, 要拆分为两腿香草期权来报送, 两腿期权的产品结构都上报为 VA (香草) 即可。

(2) 标准二元 (DIGITAL, 简称 DI): 包括欧式二元和美式二元, 仅有一个执行价格, 期权买方所获收益由标的资产价格高于或低于执行价格决定。

(3) 区间累计 (RANGE ACCURAL, 简称 RA): 通常设有不同价格区间, 每个区间均设低执行价、高执行价和行权收益。当观察日标的资产价格高于某一区间的低执行价, 且低于该区间的高执行价时, 期权买方按该区间的行权收益获得收益。合约到期时, 期权买方获得各观察日的累计收益。区间累计期权会涉及各类观察类型, 相关信息通过“观察类型”、“观察起始日”、“观察结束日”、“离散观察日”字段进行填写。目前, 针对区间累计期权只设计了最多四个区间, 若开展了四个以上区间的交易, “期

权产品结构”请填写 DIO（二元变种（现有字段不支持报送））。

（4）二元变种（现有字段支持报送，简称 DIV）：在标准二元期权基础上的变种结构，且现有接口支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送。目前支持的变种结构包括但不限于：

A. 多种观察频率，如每日观察等离散观察频率；

B. 多个执行价格（至多 3 个），如二元凸式、二元凹式、三层阶梯、四层阶梯。

以上变种结构相关信息都可以通过“观察类型”、“观察起始日（含）”、“观察结束日（含）”、“离散观察日”、“执行价格 1”、“执行价格 2”、“执行价格 3”、“行权收益 1”、“行权收益 2”、“行权收益 3”、“行权收益 4” 字段进行填写。

（5）二元变种（现有字段不支持报送，简称 DIO）：指现有接口无法支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送的二元变种结构。

（6）单障碍期权（SINGLE BARRIER，简称 SB）：指设置了一个敲入或敲出障碍价的到期观察或连续观察的香草期权，即当标的资产价格触及障碍价时，香草期权自动敲入或敲出。若敲出，一般期权买方可以获得补偿收益。请注意该产品类别不含安全气囊和标准累计期权。

（7）单障碍期权变种（现有字段支持报送，简称 SBV）：在单障碍期权基础上的变种结构，且现有接口支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送。目前支持的变种结构包括但不限

于:

- A. 两个障碍价, 如双鲨;
- B. 多种观察类型, 如每日观察的鲨鱼鳍。

以上变种结构相关信息都可以通过“观察类型”、“观察起始日(含)”、“观察结束日(含)”、“离散观察日”、“障碍价1”、“障碍价2”、“障碍价1触碰方向”、“障碍价2触碰方向”、“障碍价1类型”、“障碍价2类型”、“补偿收益1”、“补偿收益2”、“补偿收益货币”、“补偿收益符号”字段进行填写。

(8) 单障碍期权变种(现有字段不支持报送, 简称 SBO): 指现有接口无法支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送的单障碍期权变种结构。

(9) 标准累计期权 (ACCUMULATOR, 简称 AC): 一般指交易商与交易对手方达成一系列按周期观察并开展标的资产买卖的合约, 通常由标的资产价格波动情况决定买卖数量(一般有基础交易数量和多倍交易数量区分), 可进一步细分为累购期权和累沽期权。

以累购期权为例, 执行价通常比签约时的标的资产价格有折让, 同时设定一定的观察频率(通常为每日)。合约生效后, 当观察日的标的资产价格大于等于执行价, 投资者可以按照执行价买入指定数量的标的资产; 当观察日的标的资产价格低于执行价时, 投资者需买入指定倍数数量的资产, 直至合约完结。

(10) 累计变种(现有字段支持报送, 简称 ACV): 在标准

累计期权基础上的变种结构,且现有接口支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送。目前支持报送的变种结构按观察结果、敲出情况、敲入后情况 3 个维度总结为以下要素表:

观察结果	敲出终止/不终止	无敲出
未敲入未敲出	A.以执行价进行现金结算; B.以执行价进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换; C.以执行价建仓远期/互换; D.仅累计数量; E.固定收益赔付。	A.以执行价进行现金结算; B.以执行价进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换; C.以执行价建仓远期/互换; D.仅累计数量; E.固定收益赔付。
整体敲入/仅当前观察日敲入	A.以执行价进行现金结算; B.以执行价进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换; C.以执行价建仓远期/互换; D.仅累计数量; E.固定收益赔付。	A.以执行价进行现金结算; B.以执行价进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换; C.以执行价建仓远期/互换; D.仅累计数量; E.固定收益赔付。
敲出	A.以新执行价进行现金结算; B.以新执行价进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换; C.以新执行价建仓远期/互换; D.固定收益赔付。	不涉及

以上要素可组合出 450 种累计期权变种结构,除此以外还支持报送多种观察频率、末日型结构、保底累计天数的累计期权。这些变种结构相关信息都可以通过“障碍价 1”、“障碍价 1 类型”、“障碍价 2”、“障碍价 2 类型”、“行权收益 1”、“行权收益 2”、“补偿收益 1”、“执行价格 1”、“执行价格 2”、“AC-未敲入未敲出累计方式”、“AC-敲入累计方式”、“AC-敲出结算方式”、“结算价取值日”、“AC-额外买卖观察日”、“AC-敲入额外买卖数量”、“观察类型”、“观察起始日(含)”、“观察结束日(含)”、“离散观察日”、“AC-保护期起始日”、“AC-保护期终止日”字段进行

填写。

(11) 累计变种 (现有字段不支持报送, 简称 ACO): 指现有接口无法支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送的累计变种结构。

(12) 标准安全气囊 (AIRBAG, 简称 AB): 该期权结构的收益会因为是否发生敲入而不同。若发生过敲入, 期权买方的收益率等同于标的资产涨跌幅。若未发生敲入, 当标的价格不利于期权买方时, 期权买方不承担损失; 当标的价格有利于期权买方时, 期权买方的收益率等于约定的参与率*标的涨跌幅。

(13) 安全气囊变种 (现有字段支持报送, 简称 ABV): 在标准安全气囊期权基础上的变种结构, 且现有接口支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送。目前支持的变种结构包括但不限于:

- A. 未敲入时买方收益上有封顶的结构;
- B. 敲入后买方向上收益封顶或向下亏损封底;
- C. 敲入后的远期价格不等于期初价格;
- D. 敲入后小于远期价格和大于远期价格的收益对应不同的参与率;
- E. A、B、C、D 的组合。

以上变种结构相关信息可以通过“执行价格 1”、“执行价格 2”、“执行价格 3”、“执行价格 4”、“参与率 1”、“参与率 2”、“参与率 3”、“参与率 4”、“远期价格” 字段进行填写。

(14) 安全气囊变种 (现有字段不支持报送, 简称 ACO):
指现有接口无法支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送的安全气囊变种结构。

(15) 小雪球/保本雪球 (二元、三元) (简称 GSA): 为二元结构叠加自动赎回方式。保本雪球 (二元) 只有敲出价, 没有敲入价, 其收益率分两段: 敲出发生后获得敲出票息率, 否则获得红利票息率。保本雪球 (三元) 收益率分三段: 敲出发生后获得敲出票息率, 未敲入未敲出获得红利票息率, 敲入后未敲出获得最低票息率。

敲出票息率请填写在“SA&PA-Coupon 收益率”相关字段, 红利票息率请填写在“行权收益 2”相关字段, 最低票息率请填写在“行权收益 1”字段。

(16) 标准雪球 (SNOWBALL AUTOCALL, 简称 SA):
为结构化产品。该结构属于路径依赖的自动可赎回期权组合结构, 即标的资产价格波动决定了该结构是否终止、是否会触发一个新的合约以及得到多少收益。设有敲入障碍价和敲出障碍价, 当标的资产价格达到既定敲出障碍价时, 该结构自动终止, 买方按照 Coupon 收益率获得收益。当标的资产价格触及敲入障碍价且后续未触及敲出障碍价, 则合约自动触发新的香草期权, 并在到期时按照该结构买方卖出该香草期权结算收益。当标的资产价格既未触及敲出障碍价, 也未触及敲入障碍价时, 买方按照 Coupon 收益率或红利票息率获得收益。

(17) 雪球变种 (现有字段支持报送, 简称 SAV): 在标准雪球基础上的变种结构, 且现有接口支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送。目前支持的变种结构包括但不限于:

A. 保底雪球, 指敲入后雪球买方的亏损有封底, 即敲入后不是单腿香草期权, 而是价差香草组合;

B. 封闭期雪球, 指合约生效一段时间后再开始进行敲出观察;

C. 早利雪球、阶梯雪球、双降雪球等, 指敲出障碍价、敲出票息为非固定值;

D. 折价建仓雪球, 指敲入后雪球买方持有远期, 且不再观察敲出。

以上变种结构相关信息可以通过“执行价格 1”、“执行价格 2”、“观察类型”、“观察起始日 (含)”、“观察结束日 (含)”、“离散观察日”、“SA&PA-敲出观察日”、“SA&PA-敲出障碍价”、“SA&PA-Coupon 收益率”、“行权收益 2”、“SA-敲入后是否观察敲出”、“远期价格”相关字段进行填写。

(18) 雪球变种 (现有字段不支持报送, 简称 SAO): 指现有接口无法支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送的雪球变种结构。

(19) 标准凤凰 (PHOENIX AUTOCALL, 简称 PA): 为结构化产品。该结构属于自动可赎回期权组合结构, 即标的资产价格波动决定了该结构是否终止、是否会触发一个新的合约以及

得到多少收益。与雪球不同，凤凰通常设有三个障碍价，分别为敲入障碍价、敲出障碍价、Coupon 障碍价。当标的资产价格超过敲出障碍价时，凤凰自动终止，买方获得满足 Coupon 障碍价的收益。当标的资产价格触及敲入障碍价且合约到期时仍未敲出，合约自动触发新的香草期权，该结构买方按照卖出该香草期权结算收益且获得满足 Coupon 障碍价的收益。当标的资产价格既未触及敲出障碍价，也未触及敲入障碍价时，买方获得满足 Coupon 障碍价的收益。故 Coupon 障碍价仅用于决定买方在观察日能否获得收益。

(20) 凤凰变种（现有字段支持报送，简称 PAV）：在标准凤凰基础上的变种结构，且现有接口支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送。目前支持的变种结构除了雪球变种以外，还包括但不限于：

A. DCN（Dynamic Coupon Note），指仅在到期日进行敲入观察；

B. FCN（Fixed Coupon Note），指 Coupon 障碍价等于 0 的 DCN。

以上变种结构相关信息可以通过“观察类型”、“PA-Coupon 障碍价”字段进行填写。

(21) 凤凰变种（现有字段不支持报送，简称 PAO）：指现有接口无法支持把该结构估值相关的所有交易要素全部报送的凤凰变种结构。

(22) 其他 (OTHER, 简称 O): 指除上述结构以外的期权产品结构。

40.其他期权产品结构描述

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 当“期权产品结构”选择 O (其他) 时, 需对该期权产品的收益结构进行文字描述。

41.执行价格 1

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格。填报时请注意:

(1) 若“执行价格/障碍价”为“标的期初价格”的百分比, 有以下 2 种填报方式:

A. 填百分号前面的数值, 同时“执行价格/障碍价符号”填 5 (标的期初价格的百分比)。例: 标的期初价格为 1547 元, 执行价为标的期初价格的 117%, 则执行价格要填写 117。

B. 转换为绝对数额的形式, 计算结果四舍五入保留 4 位小数, 同时“执行价格/障碍价符号”填 1 (货币金额)。例: 标的期初价格为 1547 元, 执行价为标的期初价格的 117%, 则执行价格要填写 1809.9900。

(2) 若“执行价格/障碍价符号”为百分比, 执行价格请以小数填写, 例: LIBOR 标的期初价格为 1.5%, 在该字段要填写 0.015。

(3) 若标的期初价格货币为外币, 则需转化为该币种的多

少元或人民币的多少元。涉及品种包括但不限于 CBOT 大豆期货、CBOT 豆油期货、CBOT 活牛期货、CBOT 堪麦期货、CBOT 小麦期货、CBOT 玉米期货、CME 育肥牛期货、ICE11 号糖期货、ICE 咖啡期货、ICE 棉花期货、新交所 20 号胶期货。例：CBOT 玉米期货的报价单位为“美分/蒲式耳”，填写该字段时需转化为“美元/蒲式耳”或“人民币元/蒲式耳”。

(4) 当期权产品结构为自动赎回类时，此处填写敲入状态时期权的执行价格。

(5) 若交易涉及多个执行价格，且期权产品结构非安全气囊及其变种结构，请依次填写执行价格并确保“执行价格 1”<“执行价格 2”<“执行价格 3”<“执行价格 4”。

(6) 针对安全气囊及其变种结构，“执行价格 1”与“执行价格 2”分别对应未敲入的执行价格，且满足“执行价格 1”<“执行价格 2”；“执行价格 3”与“执行价格 4”分别对应敲入后的执行价格，且满足“执行价格 3”<“执行价格 4”。

42.参与率 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：若“工具类型”为“OP”，此处填报使用执行价格 1 计算收益时的参与率。填报注意事项同“参与率”。

43.执行价格 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格，填

报要求同“执行价格 1”。

44.参与率 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：若“工具类型”为“OP”，此处填报使用执行价格 2 计算收益时的参与率。填报注意事项同“参与率”。

45.执行价格 3

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格，填报要求同“执行价格 1”。

46.参与率 3

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：若“工具类型”为“OP”，此处填报使用执行价格 3 计算收益时的参与率。填报注意事项同“参与率”。

当“期权产品结构”为“敲入后小于远期价格和大于远期价格的收益对应不同的参与率”的安全气囊变种时，此处请填写敲入后小于远期价格的参与率。

47.执行价格 4

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格，填报要求同“执行价格 1”。

48.参与率 4

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：若“工具类型”为“OP”，此处填报使用执行价格 4 计算收益时的参与率。填报注意事项同“参与率”。

当“期权产品结构”为“敲入后小于远期价格和大于远期价格的收益对应不同的参与率”的安全气囊变种时，此处请填写敲入后大于远期价格的参与率。

49.执行价格/障碍价货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“执行价格”或“障碍价”的币种单位，仅适用于“执行价格/障碍价符号”为 1（货币金额）的情况。填报注意事项同“标的期初价格货币”。

50.执行价格/障碍价符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“执行价格”或“障碍价”的表达方式，可选项包括 1（货币金额）、2（百分比）、3（指数点）、4（其他）、5（标的期初价格的百分比）五个选项。其中，1、2、3、4 的定义同“标的期初价格符号”。

51.观察类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：包括 TERMINAL（到期观察）、DAIL（每日观察）、DISCRETE（离散观察（非每日观察））、CONTINUOUS（连续观察）四个可选项。**到期观察**指仅在到期日当天观察。**连续观察**指在交易生命期内实时观察，包括盘中交易时间。**每日观**

察指在观察期内每个交易日都进行观察。**离散观察（非每日观察）**指在交易生命期内选择部分时间点进行观察，如每月观察。涉及该字段的“期权产品结构”包括但不限于二元及其组合、障碍及其组合、自动赎回类（不含小雪球/保本雪球（二元））。其中，针对自动赎回类（不含小雪球/保本雪球（二元）），需填写敲入观察相关信息。

52.观察起始日（含）

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易确认的观察起始日，观察起始日包含在观察期内，即该日的观察结果影响收益计算。其中，针对自动赎回类（不含小雪球/保本雪球（二元）），需填写敲入观察相关信息。

53. 观察结束日（含）

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易确认的观察结束日，观察结束日包含在观察期内，即该日的观察结果影响收益计算。其中，针对自动赎回类（不含小雪球/保本雪球（二元）），需填写敲入观察相关信息。

54. 离散观察日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“观察类型”为离散观察（非每日观察）时，进行观察的日期列表。日期格式为 YYYY-MM-DD，日期之间用英文分号隔开。其中，针对自动赎回类（不含小雪球/保本雪球（二元）），需填写敲入观察相关信息。

55.敲出收益计算方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于带有敲出结构的期权，如单鲨期权、双鲨期权、连续观察的二元期权等，包括即期计算和到期计算两个选项。**即期计算**指计算收益时，期限按照合约生效日至敲出事件触发日期计算。**到期计算**指计算收益时，期限按照合约生效日至到期日计算。

56.保底收益

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方约定的期权买方在交易终止时一定可以获得的收益。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的保底收益，而不是乘以参与率之后的收益。

57.保底收益货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“保底收益”的币种单位，仅适用于“保底收益符号”为1（货币金额）的情况。

58.保底收益符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“保底收益”的表达方式，包括1（货币金额）、2（百分比）和3（百分比（绝对））三个可选项。**货币金额**指针对单位数量标的资产，期权买方可以获得的收益。**百分比（年化）**表示期权买方按照年化收益率获得收益。**百分比（绝对）**

表示期权买方按照绝对收益率获得收益。针对不同类型的“保底收益符号”，期权买方可获得的总保底收益计算如下：

若“保底收益符号”为 1（货币金额），总保底收益=未平仓实际名义数量*保底收益。

若“保底收益符号”为 2（百分比（年化）），总保底收益=未平仓实际名义金额*保底收益*期限调整因子¹。

若“保底收益符号”为 3（百分比（绝对）），总保底收益=未平仓实际名义金额*保底收益。

59.是否已敲入

所在文件：仅持仓文件

字段释义：用以标识该笔期权是否已经敲入。若已经敲入，请填写 Y（是），否则填报 N（否）。

（八）奇异期权相关字段

60.估值时已观察均值

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指对该笔亚式期权估值时所采用的价格均值，根据交易类型不同，相关填报要求也不同，具体如下：

（1）若该亚式期权的执行价格为固定值，标的资产价格取观察期内的均值，则此处填写估值时采用的标的资产价格，该价格对应的货币和价格符号请与“标的期初价格”保持一致。

（2）若该亚式期权的执行价格取观察期内的均值，非固定

¹实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

值，则此处填写估值时采用的执行价格，该字段对应的货币和价格符号请填在“执行价格/障碍价货币”、“执行价格/障碍价符号”。

61.行权收益 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方约定的在特定条件下期权买方可以获得的行权收益。若交易涉及到“保底收益”，请在该字段填报加上保底收益之后的最终收益。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的行权收益，而不是乘以参与率之后的收益。

(1) 针对二元及其组合，请填写标的资产价格小于“执行价格 1”时期权买方可以获得的行权收益。

(2) 当“期权产品结构”为自动赎回类时，若敲入后为二元期权，比如保本雪球（三元），则此处请填写敲入状态时该自动赎回结构买方的“行权收益”，若买方盈利，则行权收益大于 0，若买方亏损，则行权收益小于 0。

62.行权收益 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合同约定的，当标的资产价格在“执行价格 1”与“执行价格 2”之间时，期权买方可以获得的行权收益，其他填报要求同“行权收益 1”。

当“期权产品结构”为自动赎回类中凤凰及其变种以外的结构时，即 GSA、SA、SAV、SAO，若持有到期未敲入也未敲出时，该结构买方获得收益率与敲出收益率不等，则此处请填写该

状态下该结构买方的收益，即红利票息。

63.行权收益 3

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约约定的，当标的资产价格在“执行价格 2”与“执行价格 3”之间时，期权买方可以获得的行权收益，其他填报要求同“行权收益 1”。

64.行权收益 4

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约约定的，当标的资产价格大于“执行价格 3”时，期权买方可以获得的行权收益，其他填报要求同“行权收益 1”。

65.行权收益货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“行权收益”的币种单位，仅适用于“行权收益符号”为 1（货币金额）的情况。

66.行权收益符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“行权收益”的表达方式，包括 1（货币金额）、2（百分比（年化））和 3（百分比（绝对））三个可选项。货币金额指针对单位数量标的资产，期权买方可以获得的收益。百分比（年化）表示期权买方按照年化收益率获得收益。百分比（绝对）表示期权买方按照绝对收益率获得收益。针对不同类

型的“行权收益符号”，期权买方可获得的总行权收益计算如下：

若“行权收益符号”为 1（货币金额），总行权收益=待行权的实际名义数量*行权收益。

若“行权收益符号”为 2（百分比（年化）），总行权收益=待行权的实际名义金额*行权收益*期限调整因子²。

若“行权收益符号”为 3（百分比（绝对）），总行权收益=待行权的实际名义金额*行权收益。

67.障碍价 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的第一个障碍价，当观察目标的资产价格触及该障碍价时，发生敲入或敲出事件。该字段对应的币种和价格符号请填在“执行价格/障碍价货币”、“执行价格/障碍价符号”。

68.障碍价 1 触碰方向

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以标识触碰“障碍价 1”的方向，包括 UP（向上）和 DOWN（向下）两个选项。向上指当观察目标的资产价格大于等于“障碍价 1”时触发敲入或敲出事件。向下指当观察目标的资产价格小于等于“障碍价 1”时触发敲入或敲出事件。

69.障碍价 1 类型

所在文件：成交文件、持仓文件

²实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

字段释义：用以表示“障碍价 1”的具体类型，包括 OUT（合约整体敲出）、IN（合约整体敲入）、REIN（剩余观察日敲入）、REOUT（剩余观察日敲出）、ONEIN（仅当前观察日敲入）和 ONEOUT（仅当前观察日敲出）六个选项。

合约整体敲出指触及障碍价格后该合约作废，按照总名义本金计算补偿收益。**合约整体敲入**指触及障碍价格后该合约才生效，按照敲入后的收益结构计算总名义本金对应的收益。**剩余观察日敲入**指累计期权触及障碍价格后，剩余观察日（含敲入当日）对应的数量按照发生敲入计算收益。**剩余观察日敲出**指累计期权触及障碍价格后，剩余观察日（含敲出当日）对应的数量按照发生敲出计算收益。**仅当前观察日敲入**指累计期权中触及障碍价格后仅当前观察日对应的数量发生敲入，不影响未观察的数量。**仅当前观察日敲出**指累计期权中触及障碍价格后仅当前观察日对应的数量发生敲出，不影响未观察的数量。

70.障碍价 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的第二个障碍价，填报要求同“障碍价 1”，且障碍价 1<障碍价 2。

71.障碍价 2 触碰方向

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以标识触碰“障碍价 2”的方向，可选项及解释同“障碍价 1 触碰方向”。

72.障碍价 2 类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以表示“障碍价 2”的具体类型，可选项及解释同“障碍价 1 类型”。

73.补偿收益 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的触碰“障碍价 1”的补偿金额，与“补偿收益符号”共同决定了期权敲出或未敲入时期权买方可以获得的收益。若交易涉及到“保底收益”，请在该字段填报加上保底收益之后的最终收益。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的补偿收益，而不是乘以参与率之后的收益。

74.补偿收益 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的触碰“障碍价 2”的补偿金额，与“补偿收益符号”共同决定了期权敲出或未敲入时期权买方可以获得的收益。填报要求同“补偿收益 1”。

75.补偿收益货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“敲出收益 1”和“敲出收益 2”的币种单位，仅适用于“敲出收益符号”为 1（货币金额）的情况。

76.补偿收益符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“补偿收益 1”和“补偿收益 2”的表达方式，包括 1（货币金额）、2（百分比（年化））和 3（百分比（绝对））三个可选项。货币金额指针对单位数量标的资产，期权买方可以获得的收益。百分比（年化）表示期权买方按照年化收益率获得收益。百分比（绝对）表示期权买方按照绝对收益率获得收益。针对不同类型的补偿收益符号，期权买方可获得的总补偿收益计算如下：

若“补偿收益符号”为 1（货币金额），总补偿收益=待补偿的实际名义数量*补偿收益。

若“补偿收益符号”为 2（百分比（年化）），总补偿收益=待补偿的实际名义金额*补偿收益*期限调整因子³。

若“补偿收益符号”为 3（百分比（绝对）），总补偿收益=待补偿的实际名义金额*补偿收益。

77.AC-未敲入未敲出累计方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于累计期权，指没发生敲入或敲出事件时的累计方式，包括以下 10 个选项：

- 1: 以执行价格 1 进行现金结算；
- 2: 以执行价格 1 进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换；
- 3: 以执行价格 1 建仓远期/互换；

³实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

- 4: 以执行价格 2 进行现金结算;
- 5: 以执行价格 2 进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换;
- 6: 以执行价格 2 建仓远期/互换;
- 7: 以行权收益 1 进行现金结算;
- 8: 以行权收益 2 进行现金结算;
- 9: 仅累计数量;
- 99: 其他。

其中，以执行价格进行现金结算指按香草期权收益结构进行现金结算。以行权收益进行现金结算指按固定收益结构进行现金结算。仅累计数量指最终收益需等累计期权在结算价取值日才能确定结算价。

78.AC-敲入累计方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于累计期权，指发生敲入事件时的累计方式，包括以下 10 个选项：

- 1: 以执行价格 1 进行现金结算;
- 2: 以执行价格 1 进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换;
- 3: 以执行价格 1 建仓远期/互换;
- 4: 以执行价格 2 进行现金结算;
- 5: 以执行价格 2 进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/

互换;

6: 以执行价格 2 建仓远期/互换;

7: 以行权收益 1 进行现金结算;

8: 以行权收益 2 进行现金结算;

9: 仅累计数量;

99: 其他。

其中, 以执行价格进行现金结算指按香草期权收益结构进行现金结算。以行权收益进行现金结算指按固定收益结构进行现金结算。仅累计数量指最终收益需等累计期权在结算价取值日才能确定结算价。

79.AC-敲出结算方式

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 适用于累计期权, 指发生敲出事件时的结算方式, 包括以下 8 个选项:

1: 以执行价格 1 进行现金结算;

2: 以执行价格 1 进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换;

3: 以执行价格 1 建仓远期/互换;

4: 以执行价格 2 进行现金结算;

5: 以执行价格 2 进行现金结算+以观察日收盘价建仓远期/互换;

6: 以执行价格 2 建仓远期/互换;

- 7: 以敲出障碍价对应的补偿收益进行现金结算;
99: 其他。

其中, 以执行价格进行现金结算指按香草期权收益结构进行现金结算。以敲出障碍价对应的补偿收益进行现金结算指按固定收益结构进行现金结算。若“障碍价 1/2 类型”是 OUT (合约整体敲出), 则结算数量为总名义数量; 若“障碍价 1/2 类型”是 REOUT (剩余观察日敲出), 则结算数量为剩余未观察 (含敲出当日) 数量; 若“障碍价 1/2 类型”是 ONEOUT (仅当前观察日敲出), 则结算数量为当日观察数量。

填报 77-79 字段时还需注意:

对于根据标的行情动态调整结算方式的交易, 成交表需报送一笔交易类型为 MD (修改)、交易类型细分为 O (其他) 的记录, 该记录的 77-79 字段填写调整后的信息, 同时调整日及以后的持仓表中对应持仓的 77-79 字段也需填报调整后的信息。

80.AC-单次观察数量

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 适用于累计期权, 指每次观察完若没发生敲入或敲出事件, 期权买方可以执行价买入或卖出标的资产的数量, 数量单位与“交易名义数量”保持一致。

81.AC-累计倍数

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 适用于累计期权, 指当敲入触发成倍累计条件时,

期权买方需要以执行价买入或卖出标的资产的倍数，通常大于 1。

82.AC-额外买卖观察日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于带末日型结构的累计期权，指在额外买卖观察日敲入时，除了常规的触发累计倍数的敲入买卖量以外，期权买方还需额外买卖一定数量的标的资产。日期格式为 YYYY-MM-DD，若有多个额外买卖观察日，日期之间需用英文分号隔开。

83.AC-敲入额外买卖数量

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于带末日型结构的累计期权，指在额外买卖观察日敲入时，除了常规的触发累计倍数的敲入买卖量以外，期权买方还需额外买卖的数量，数量单位与“交易名义数量”保持一致。

若有多个额外买卖观察日，需依次填写每个观察日对应的额外买卖数量，二者个数保持一致，数量之间用英文分号隔开。

84.AC-保护期起始日（含）

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于带熔断结构的累计期权，即保底累计期起始日，若在保底累计期内敲出，则敲出无效，到期日自动改为保护期终止日。因此，期权存续期至少等于保底累计期。

85.AC-保护期终止日（含）

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于带熔断结构的累计期权，即保底累计期终止日，若在保底累计期内敲出，则敲出无效，到期日自动改为保护期终止日。因此，期权存续期至少等于保底累计期。

86.AC-结算数量

所在文件：仅成交文件

字段释义：适用于累计期权，指发生部分平仓、平仓、到期或观察后所结算的标的资产数量，数量单位与“交易名义数量”保持一致。若涉及多倍累计，需填写结算的实际数量。

若部分平仓操作为按初始名义数量的一定比例对计入估值的已累数量和未观察数量同时进行部分平仓，则该字段以小数形式填写部分平仓比例，即 50% 的平仓比例需填写为 0.5。

87.AC-计入估值的已累数量

所在文件：仅持仓文件

字段释义：适用于累计期权，指观察后累计的，计入期权估值部分的标的资产数量，数量单位与“交易名义数量”保持一致。若涉及多倍累计，需填写计入估值的实际数量；若观察后进行现金结算并计入对手方的期末结存，则该字段应填 0。

88.SA&PA-敲入障碍价

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：当标的资产价格在敲入观察日触及该障碍价时，发生敲入事件。对于敲入障碍价可变的变种结构，需按时间顺序

从前到后依次填写，价格之间用**英文分号**隔开。对于不涉及敲入障碍价的变种结构，如小雪球/保本雪球(二元)，该字段为空。填报该字段时请注意字段对应的币种和价格符号填在“执行价格/障碍价货币”、“执行价格/障碍价符号”。

89.SA&PA-敲入后是否观察敲出

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指产品敲入后是否继续观察敲出。该字段用于识别“折价建仓雪球”等特殊结构，即敲入后不继续观察敲出。

90.SA&PA-敲出观察日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指观察是否敲出的日期列表。日期格式为YYYY-MM-DD，日期之间用**英文分号**隔开。

91.SA&PA-敲出障碍价

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：当标的资产价格在敲出观察日触及该障碍价时，发生敲出事件。若敲出障碍价在整个观察期内不固定，需依次填写每个敲出观察日对应的敲出障碍价，敲出障碍价个数应与敲出观察日个数保持一致，价格之间用**英文分号**隔开。填报该字段时请注意字段对应的币种和价格符号填在“执行价格/障碍价货币”、“执行价格/障碍价符号”。

92.SA&PA-Coupon 收益率

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指计算买方可以获得 Coupon 收益的收益率，若 Coupon 收益率在整个观察期内不固定，收益率之间应用英文分号隔开。其中，对于凤凰及其变种以外的自动赎回类结构，即 GSA、SA、SAV、SAO，需依次填写每个敲出观察日对应的 Coupon 收益率，收益率个数应与敲出观察日个数保持一致；对于凤凰及其变种结构，即 PA、PAV、PAO，需依次填写每个 Coupon 观察日对应的 Coupon 收益率，收益率个数应与 Coupon 观察日个数保持一致。

若交易涉及到“保底收益”，请在该字段填报加上保底收益之后的最终收益。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的 Coupon 收益率，而不是乘以参与率之后的收益。

93.SA&PA-Coupon 收益率符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“SA&PA-Coupon 收益率”的表达方式，包括 1（百分比（年化））和 2（百分比（绝对））两个可选项。百分比（年化）表示该结构买方按照年化收益率获得收益。百分比（绝对）表示该结构买方按照绝对收益率获得收益。针对不同类型的 Coupon 收益率符号，该结构买方可获得的总 Coupon 收益计算如下：

若“SA&PA-Coupon 收益率符号”为 1（百分比（年化）），总 Coupon 收益=待计息的实际名义金额*SA&PA-Coupon 收益率*

期限调整因子⁴。

若“SA&PA-Coupon 收益率符号”为 2（百分比（绝对）），总 Coupon 收益=待计息的实际名义金额*SA&PA-Coupon 收益率。

94.PA-Coupon 观察日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指观察是否获得 Coupon 的日期列表。日期格式为 YYYY-MM-DD，日期之间用英文分号隔开。

95.PA-Coupon 障碍价

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：当标的资产价格在 Coupon 观察日触及该障碍价时，期权买方可以获得 Coupon 收益。若 Coupon 障碍价在整个观察期内不固定，需依次填写每个 Coupon 观察日对应的 Coupon 障碍价，Coupon 障碍价个数应与 Coupon 观察日个数保持一致，价格之间用英文分号隔开。填报该字段时请注意字段对应的币种和价格符号填在“执行价格/障碍价货币”、“执行价格/障碍价符号”。

（九）远期交易相关字段

96.远期价格

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：开仓时双方约定的远期买卖标的资产的价格。其他填报注意事项同“执行价格 1”。

⁴实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

当“期权产品结构”为“敲入后的远期价格不等于期初价格”的安全气囊变种时，此处请填写敲入状态时远期的“远期价格”。

当“期权产品结构”为自动赎回类时，如折价建仓雪球，若敲入后为远期，则此处请填写敲入状态时远期的“远期价格”。

97.远期价格货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“远期价格”的币种单位，仅适用于“远期价格符号”为1（货币金额）的情况。

98.远期价格符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“远期价格”的表达方式，可选项及相应解释同“执行价格/障碍价符号”一致。

（十）互换交易相关字段

99.互换类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指互换的具体类型，包括 TRSLOS（收益互换-单方向）、TRSLAS（收益互换-多空）、IRS（利率互换）、CDS（信用违约互换）、CCS（货币互换）、FXSWAP（外汇互换）、O（其他）7个选项。

TRSLOS（收益互换-单方向）指单方向做多或做空的收益互换；TRSLAS（收益互换-多空）指该笔收益互换包含多腿，既有做多的标的也有做空的标的；IRS（利率互换）指交易双方

约定在未来的一定期限内,根据约定数量的名义本金和利率定期交换现金流;**CDS**(信用违约互换)指买方向卖方支付保护费用,当参考实体发生双方约定的信用事件时,卖方向买方支付一定金额的补偿;**CCS**(货币互换)指交易双方在约定期限内交换约定数量的两种货币本金,同时定期交换两种货币的利息;**FXSWAP**(外汇互换)指交易双方约定在一前一后两个不同的起息日进行方向相反的两次货币交换;**O**(其他)指其他非上述类型的互换。

100.固定收益

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 填写互换中约定的收固定、付浮动方所获得的固定收益。

101.固定收益货币

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指固定收益的币种单位,仅适用于“固定收益符号”为1(货币金额)的情况。

102.固定收益符号

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指“固定收益”的表达方式,包括1(货币金额)、2(百分比(年化))和3(百分比(绝对))三个可选项。**货币金额**指针对单位数量标的资产,R方(即付浮动、收固定方)可以获得的固定收益。**百分比(年化)**表示R方按照年化收益率获得固定收益。**百分比(绝对)**表示R方按照绝对收益率获得

固定收益。针对不同类型的固定收益符号，R方可获得的总固定收益计算如下：

若“固定收益符号”为 1（货币金额），总固定收益=未平仓实际名义数量*固定收益。

若“固定收益符号”为 2（百分比（年化）），总固定收益=未平仓实际名义金额*固定收益*期限调整因子⁵。

若“固定收益符号”为 3（百分比（绝对）），总固定收益=未平仓实际名义金额*固定收益。

103.浮动方向

是否必填：当“工具类型”为 SW（互换或掉期）时，必填

字段释义：指 R 方（收固定、付浮动方）的看涨、看跌方向。

104.支付周期

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：包括 DAIL（日度）、WEEK（周度）、MNTH（月度）、YEAR（年度）、TERM（到期支付）、O（其他）六个可选项，与“支付周期乘数”共同决定何时双方进行收益支付。例：交易双方约定每两月进行一次支付，则“支付周期”填报 MNTH，“支付周期乘数”填报 2。

105.支付周期乘数

所在文件：成交文件、持仓文件

⁵实际名义数量和实际名义金额均为考虑了参与率和年化系数后的实际值。
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

字段释义：与“支付周期”共同决定何时双方进行收益支付。若双方约定到期一次性支付，则无需填写该字段。

(十一) 名义金额、名义数量相关字段

106.初始名义金额

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：应等于“标的期初价格*初始名义数量”的绝对值，报送该字段时无需报送实际名义金额(实际名义金额指在初始名义金额基础上乘以参与率和年化系数后的结果)。

例：双方开展了标的为 AU2512，3个月到期的欧式看涨期权交易，行权价格 270，标的期初价格 268，参与率 50%，双方按名义金额 1340000 元确认成交，为年化名义金额，则应报送初始名义金额=1340000，无需报送 $1340000*50%*(3/12)=167500$ 。

107.交易名义金额

所在文件：仅成交文件

字段释义：交易名义金额等于交易名义数量*开仓时标的期初价格。若该笔交易为新开仓（即“交易类型”为 NT），则“交易名义金额”与“初始名义金额”相等，若该笔交易为平仓、终止或取消（操作类型为 FU、PU、ED、ER），则“交易名义金额”小于等于“初始名义金额”。其余填报规则与“初始名义金额”一致。

108.已平仓总名义金额

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指该交易累计已平仓的名义本金。其中，每次平

仓的名义本金=平仓名义数量*开仓时标的期初价格，请确保“初始名义金额”大于“已平仓总名义金额”。其余填报规则与“初始名义金额”一致。

字段 106-108 在填报还需注意以下几种情况：

(1) 计算名义金额时统一采用“标的期初价格”。涉及组合期权分腿报送的情况，填报名义金额时不考虑权重。

例：对于一个 2 腿组合期权，标的期初价格为 268、标的为 AU2512、数量为 5 手，一腿为买入方向、行权价格为 270 的欧式看涨期权，另一腿为卖出方向、行权价格为 275 的欧式看涨期权。填报上述交易时，请分成两条成交记录报送，腿 1 和腿 2 的初始名义金额均等于 $5*1000*268$ ，而不是 $5*1000*268/2$ 。

(2) 涉及多标的资产交易，上报时需要对应“标的资产对应合约”字段的资产顺序填写各资产的名义金额并用英文分号隔开。我们将采用各标的资产名义金额中的最大值计为该笔交易的名义金额。

例：对于标的为 PP2601-3*MA2601 的价差期权，组合的初始名义数量为 1000 吨，标的期初价格为 8000;2300，则“初始名义金额”为 $1000*8000;1000*3*2300$ ，即 8000000;6900000。

(3) 对于观察后需报送 POB (部分结算) 的累计期权，POB 成交记录中的“交易名义金额”应等于单次观察数量对应的名义金额，累计期权持仓记录中的“已平仓总名义金额”应等于已报送的 (含当日) POB 总名义金额。

(4) 对于观察后不即期结算，仅累计数量的累计期权，若对已累数量进行部分平仓，详见常见问题 Q20。

(5) 如计价货币非人民币，都要按照转换为人民币的金额进行上报，汇率填写在“外汇兑人民币期初汇率”字段。

(6) 请不要以带千分位符的格式进行填写。

109. 外汇兑人民币期初汇率

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：将开仓时外币名义金额以及权利金转换为人民币时所使用的汇率。请填写开仓时人民银行公布的人民币外汇即期报价。在同一笔交易的生命期内，该汇率是一个固定值，以保证该交易存续期内以人民币计价的名义金额和开仓权利金是一个定值。

110. 初始名义数量

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指开仓时交易确认书上约定的交易标的资产的数量。若无标明对应标的资产数量，则按照初始名义金额/标的期初价格计算。报送该字段时无需报送实际名义数量（实际名义数量指在初始名义数量基础上乘以参与率和年化系数后的结果）。

例：双方开展了标的为 AU2512，3 个月到期的欧式看涨期权交易，行权价格 270，标的期初价格 268，参与率为 50%，双方按名义金额 1340000 确认成交，为年化名义金额，则应报送初始名义数量 $=1340000/268=5000$ 克，无需报送实际初始名义数量

$1340000 * 50% * (3/12) / 268 = 625$ 克。

111.交易名义数量

所在文件：仅成交文件

字段释义：指该笔交易对应的名义数量，等于交易名义金额/开仓时标的期初价格。其余填报规则与“初始名义数量”一致。

112.已平仓总名义数量

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指该合约累计已平仓的名义数量，等于已平仓总名义金额/开仓时标的期初价格。其余填报规则与“初始名义数量”一致。

字段 110-112 在填报还需注意以下几种情况：

（1）涉及组合期权分腿报送的情况，填报名义数量时不考虑权重。

例：对于一个 2 腿组合期权，标的期初价格为 268、标的为 AU2512、数量为 5 手，一腿为买入方向、行权价格为 270 的欧式看涨期权，另一腿为卖出方向、行权价格为 275 的欧式看涨期权。填报上述交易时，请分成两条成交记录报送，腿 1 和腿 2 的初始名义数量均为 5000 克，而不是 2500 克。

（2）涉及多标的资产交易，上报时需要对应“标的资产对应合约”字段的资产顺序填写各资产的名义数量并用**英文分号**隔开。若多资产标的的组合公式中某标的系数不为 1，则该标的资产的初始名义数量需要用组合的名义数量乘以系数的绝对值。举例：

对于标的为 PP2601-3*MA2601 的价差期权，组合的初始名义数量为 1000 吨，则“初始名义数量”填报 1000;3000。

(3) 若出现如大商所鸡蛋期货等数量单位与计价单位中的数量单位不一致的情况，名义数量需按照计价单位中的数量单位进行上报。例：交易标的为大商所鸡蛋期货，计价单位为元/500kg，数量为 10 吨，则在上报“初始名义数量”时要报为 20，“数量单位”上报为 500kg。

(4) 当数量单位选择“不适用”时，“初始名义数量”、“交易名义数量”、“已平仓总名义数量”应为空。

(5) 对于观察后需报送 POB(部分结算)的累计期权，POB 成交记录中的“交易名义数量”应等于单次观察数量，累计期权持仓记录中的“已平仓总名义数量”应等于已报送的(含当日) POB 总数量。

(6) 对于观察后不即期结算，仅累计数量的累计期权，若对已累数量进行部分平仓，详见常见问题 Q20。

113.数量单位

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：表示数量的计量单位，请参考《中国期货监控交易报告库(CFMMC-TR)数据报送接口说明》中的“6.数量单位代码”，按照相应代码填写。填报时请注意：

(1) 若交易标的资产为鸡蛋期货，“数量单位”要与报价单位中的数量保持一致，即数量单位填报为“500 千克”对应的代码。

(2) 若标的资产为指数等不涉及数量的标的, 或产品结构为彩虹期权等不涉及标的数量的情况, 数量单位填报为 NOAP (不适用)。

(3) 若标的资产数量单位为列表中未列明的单位, 数量单位填报为 OTHER (其他数量单位)。

114. 是否为年化名义金额

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 用以识别该笔交易的名义金额是否为年化的名义金额。请以 Y 或 N 填报, 若为年化交易请填写 Y, 若不是请填写 N, 勿以中文形式填报。请注意此处的是否年化是针对名义金额的, 不是针对收益率的年化, 对于带敲出的产品结构, 二者的显著区别在于计算收益时乘以的期限因子是否固定为 (到期日-生效日+1)/365。

例: 双方开展了一笔互换交易, 固定收益按照年化利率计算, 浮动收益按照标的期末价格较期初价格涨跌幅与名义数量乘积计算, 这种情况下年化是针对收益率, 是为了在计算收益时把年化收益率转化为绝对收益率, 所以**不是**年化名义金额。

例: 双发开展了一笔雪球交易, 敲出收益率为年化收益率, 这种情况下年化是针对收益率, 是为了在计算收益时把年化收益率转化为绝对收益率, 所以**不是**年化名义金额。

例: 双方开展了一笔看涨期权交易, 标的为 AU9999, 期限为 45 天, 标的期初价格为 360 元/克, 执行价格为 365 元/克,

名义数量为 5,000 千克, 名义金额为 18 亿元 ($360 \times 5,000 \times 1,000 / 100,000,000$), 到期时标的价格为 370 元/克。如果双方按照 $5,000 \times 1,000 \times (370 - 365) \times 45 / 365$ 计算行权收益, 即名义数量 5,000 千克、名义金额 18 亿元考虑了年化, 因此需要上报为年化名义金额; 如果双方按照 $5,000 \times 1,000 \times (370 - 365)$ 计算行权收益, 则非年化名义金额。

115. 参与率

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指实际参与收益计算的名义金额在交易确认书上的名义金额中的占比。一般情况下填报小于等于 1 的数, 请勿填为百分比形式。如参与率为 25%, 要填写 0.25, 而不是 25 或 25%。如不涉及参与率概念, 填报 1 即可。

例: 交易双方开展了标的为 AU2412、3 个月到期的欧式看涨期权, 参与率为 50%, 初始名义金额为 134 万元, 非年化交易, 则实际名义金额为 $134 \text{ 万元} \times 50\% = 67 \text{ 万元}$ 。

(十二) 估值相关字段

116. 合约估值时标的价格

所在文件: 仅持仓文件

字段释义: 指当日对该笔交易进行估值时采用的标的资产最新价格, 请注意不是该笔交易开仓时的价格。若标的涉及多个资产, 则通过英文分号将各个标的资产价格分隔开, 并按照“标的资产对应合约”字段的资产顺序填写。该字段对应的货币和价

格符号与“标的期初价格”保持一致。期权、远期、互换等各类交易均需报送该字段。

117. 合约价值

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指未完成合同的现值，即出售当前持仓合约需收取的价格。请勿填写单价，且考虑买卖方向，填报交易对手方 1（即风险管理公司）角度的合约价值。也就是说，假设对当前持仓进行平仓，如果交易对手方 1 需要向交易对手方 2 支付，则合约价值为负，反之，交易对手方 2 需要向交易对手方 1 支付，则合约价值为正。若合约价值涉及外币估值，请用估值时的汇率转化为人民币。

例：风险管理公司卖出一笔期权，该期权最新估值为 10 元/吨，初始名义数量为 100 吨，非年化，未有过平仓，则该字段要填写总估值-1000，而不是 10 或 1000。

118. 估值方法

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指报告方用于估值的依据和方法，包括 M（按市值计价）、O（按模型计价）、C（中央对手方估值）三个选项。按市值计价指估值所用参数全部来自活跃市场（如场内市场），参数取值较为公允。按模型计价指估值所用参数至少有一个是不可观测的，通常取自模型或经验判断。中央对手方估值指估值结果由第三方中央对手方计算。

119.浮动盈亏

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指该持仓的逐笔浮动盈亏，负数代表浮动亏损，正数代表浮动盈利。请注意按交易对手方 1（即风险管理公司）角度带方向填写。若涉及外币，请按最新汇率折算为人民币进行填写。

120.保证金占用

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指填报方计算的交易对手方 2 在该持仓上应缴的保证金金额，负数代表该持仓起到减免保证金的作用，或者该持仓需要收取交易对手方 1 的保证金。

121.是否为组合保证金

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指该持仓的保证金是按组合计算的还是按单笔计算的。

122.组合标识

所在文件：仅持仓文件

字段释义：由填报方自行创建，当使用组合保证金时，同一天持仓表中组合标识相同的持仓会被识别为同一个组合。组合可使用数字编号、字母编号、中英文名称等进行标识。

对于组合保证金中无法拆分至单笔持仓的部分，如基差风险定价，可按报送主体认可的簿记逻辑计入该组合中某一笔或某几

笔持仓的保证金占用,使得该组合中所有持仓的保证金占用加总后等于该组合最终应收的组合保证金。

123.估值波动率

所在文件: 仅持仓文件

字段释义: 指期权估值时使用的隐含波动率,若标的包含多个资产,则对应“标的资产对应合约”的资产顺序填写各资产的估值波动率,并以英文分号隔开。

124.一年有效天数

所在文件: 仅持仓文件

字段释义: 描述估值波动率的测度,即估值时是采用日历日波动率还是交易日波动率。若一年有效天数为 365 (日历日),则在其他因素不变的情况下,期权的价格每天都有衰退。若一年有效天数为 245 (交易日),则在其他因素不变的情况下,期权的价格每过一个交易日才会衰退。

125.无风险利率

所在文件: 仅持仓文件

字段释义: 指合约估值时所用的年化无风险利率。例: 无风险利率为 4%,这里的 r 要填报 0.04,而不是 4 或 4%。

126.股息

所在文件: 仅持仓文件

字段释义: 指合约估值时所用的该标的资产的年化股息。例: 股息为 4%,这里的 q 要填报 0.04,而不是 4 或 4%。

127.Delta

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表标的上涨一个报价单位时，持仓合约总价值的变动相当于多少数量标的资产的变动。数学公式为： $\Delta = \partial c / \partial S$ ， c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价）， S 是标的合约价格。期权、远期、互换等各类交易均需报送该字段。

128.Gamma

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表标的上涨一个报价单位时， Δ 的变动量。数学公式为： $\Gamma = \partial \Delta / \partial S$ 。其中， S 为标的合约价格。

129.Vega

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表估值时的隐含波动率增加 1 个百分点时，比如由 20% 增加到 21%，期权合约总价值的变动量。计算公式为： $(\partial c / \partial \sigma) * 0.01$ ， c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价）， σ 是期权合约隐含波动率的绝对值。

130.Theta

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表时间衰退 1 个有效日期时，比如剩余期限由 30 天减少到 29 天，期权合约总价值的变动量。计算公式为： $(\partial c / \partial t) / \text{一年有效天数}$ ， c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价）， t 是年化的时间。

131.Rho

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表无风险利率增加 1 个百分点时，比如由 2% 增加到 3%，期权合约总价值的变动量。计算公式为： $(\partial c/\partial r)*0.01$ ， c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价）， r 是年化无风险利率的绝对值。

132.RhoQ

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表股息增加 1 个百分点时，比如由 2% 增加到 3%，期权合约总价值的变动量。计算公式为： $(\partial c/\partial q)*0.01$ ， c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价）， q 是年化股息的绝对值。

133.Delta cash

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指 Δ *合约估值时标的价格，如涉及外币，需要用估值时的汇率转化为人民币。针对成交文件，仅当该笔交易为当日新开仓交易（即交易类型为 NT）时填写。

134.Gamma cash

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指 Γ *合约估值时标的价格，如涉及外币，需要用估值时的汇率转化为人民币。

填报 123、126、127-134 字段时还需注意：

(1) 希腊字母的计算都是交易对手方 1(即风险管理公司) 角度, 勿填报为交易对手方 2 的角度。请不要填报为单位数量的希腊字母值, 而应该是单位数量的希腊字母值*未平仓实际名义数量(例 1、例 2)。

例 1: 交易对手方 1 买入标的为 RB2601 的看涨期权, 未平仓名义数量为 1000 吨。通过模型计算, 单位数量 Delta 为 0.35、单位数量 Gamma 为 0.03。此处 Delta 字段应填报为 350 (0.35*1000), 意味着此时交易对手方 1 若在场内卖出 350 吨, 即 35 手 RB2601, 会实现 delta 中性, 勿填报 35 或 0.35。Gamma 字段应填报为 30 (0.03*1000)。

例 2: 交易对手方 1 买入 500 吨标的为 JD2601 的看涨期权, 该品种报价单位为元/500 千克, 相应数量单位应为 500 千克。若该合约未平仓名义数量为 500 吨, 未平仓名义数量应填报 1000 (500000/500)。通过模型计算, 单位数量 Delta 为 0.35, 则 Delta 字段应填报为 350 (0.35*1000)。

(2) Greeks 代表当前持仓的实际风险敞口, 即是已经乘以参与率和年化系数的实际值。

(3) 针对 Delta、Gamma 和 Vega, 当交易涉及多个标的资产, 根据公司实际定价模型进行填报。若公司将资产组合看作一个新的标的, 则估值波动率、Delta、Gamma、Vega、Delta cash、Gamma cash 分别只有一个值。若公司把各个资产分开处理, 则每个资产都有对应的估值波动率、Delta、Gamma、Vega、Delta

cash、Gamma cash，需要将多个希腊字母值用英文分号隔开，并按照“标的资产对应合约”中的资产顺序填写（例 3）。

例 3：交易对手方 1 买入挂钩标的为 RB2601.SHF-HC2601.SHF 期权，组合未平仓数量为 1000 份，每份组合包括 1 吨螺纹钢、1 吨热轧卷板。通过模型计算，RB2601 对应的单位数量 Delta 为 0.5，HC2601 对应的单位数量 Delta 为 0.3，则在 Delta 字段需填报为 500;300。

（4）针对挂钩多标的资产的交易，若报告主体把各个标的资产分开处理，即每个标的都有对应的 Gamma，在填报 Gamma 时还需要在各标的 Gamma 数值后增加 Cross Gamma 数值，用英文分号隔开，Gamma cash 无需增加。若交易挂钩三个标的资产，Cross Gamma 报送顺序按照标的资产对应合约中第一个标的资产和第二个标的资产的 Cross Gamma、第一个标的资产和第三个标的资产的 Cross Gamma、第二个标的资产和第三个标的资产的 Cross Gamma 报送（例 4）。

以挂钩两个标的资产为例，Cross Gamma 计算公式如下：

$$\text{Cross Gamma}(S_1, S_2) = \frac{\partial^2(C)}{\partial S_1 \partial S_2}$$

其中，C 为期权合约价值（注意为合约总价值，不是合约单价）， S_1 为第一个标的资产的价格， S_2 为第二个标的资产的价格。

如果采用简单差分法计算 Cross Gamma，计算公式如下：

$$\text{Cross Gamma}(S_1, S_2) =$$

$$\frac{C(S_1 + \Delta S_1, S_2 + \Delta S_2) + C(S_1 - \Delta S_1, S_2 - \Delta S_2) - C(S_1 - \Delta S_1, S_2 + \Delta S_2) - C(S_1 + \Delta S_1, S_2 - \Delta S_2)}{4 \Delta S_1 * \Delta S_2}$$

其中，C 是期权合约价值（注意为合约总价值，不是合约单价），S₁ 为第一个标的资产的价格，S₂ 为第二个标的资产的价格，Δ S₁、Δ S₂ 分别是相应标的资产的震荡幅度。

例 4：某笔交易挂钩标的为 2*JD2601.DCE-0.45*M2601.DCE-1.3*C2601.DCE，组合未平仓数量为 1000 份，每份组合包括 2*500KG 鸡蛋、0.45 吨豆粕、1.3 吨玉米。通过模型计算，JD2601 对应的单位数量 Gamma 为 0.5，M2601 对应的单位数量 Gamma 为 0.3，C2601 对应的单位数量 Gamma 为 0.2，JD2601 和 M2601 的 Cross Gamma 为 0.1，JD2601 和 C2601 的 Cross Gamma 为 0.2，M2601 和 C2601 的 Cross Gamma 为 0.3，则 Gamma 字段应填写 500;300;200;100;200;300。

（5）针对股息和 RhoQ，若单标的不同期限对应不同股息，则按期限长短从短期到长期依次填写，RhoQ 按股息填报顺序依次对应填写，用英文分号隔开。当交易涉及多个标的资产，则根据公司实际定价模型参照上述（3）进行填报。

（十三）结算相关字段

135.观察价格取值方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易发生观察事件时的取值逻辑，包含以下 6 个选项：

1：观察日标的收盘价；

- 2: 观察日标的结算价;
- 3: 观察日标的最高价;
- 4: 观察日标的最低价;
- 5: 观察期内标的盘中连续价格;
- 99: 其他。

若该笔交易挂钩多标的,则该字段指的是单个标的的观察价格取值方式,而非经多标的间运算后的价格计算方式。

若该笔交易为全部平仓、部分平仓或终止(即交易类型字段填报 FU、PU 或 ED),观察价格取值方式应与开仓(即交易类型字段为 NT)时一致。

136. 结算价取值方式

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指该笔交易到期时结算价的取值逻辑,包含以下 10 个选项:

- 1: 结算价取值日标的收盘价;
- 2: 结算价取值日标的结算价;
- 3: 结算价取值日成交量加权平均价格 (VWAP);
- 4: 结算价取值日时间加权平均价格 (TWAP);
- 5: 观察期内标的收盘价的算术平均值;
- 6: 观察期内标的结算价的算术平均值;
- 7: 观察期内 MIN/MAX(标的收盘价,执行价)的算术平均值;
- 8: 观察期内 MIN/MAX(标的结算价,执行价)的算术平均值;

9: 交易商实际对冲价格;

99: 其他。

其中, 5 和 6 适用于普通亚式期权, 7 和 8 适用于增强亚式期权。**普通亚式期权**指以一定频率(比如逐日)观察标的资产的价格, 取观察期内标的资产均价做收益计算。**增强亚式期权**指每次观察时取标的资产价格或行权价进行后续的均价计算, 使得计算的收益有利于期权买方。

若该笔交易挂钩多标的, 则该字段指的是单个标的的结算价取值方式, 而非经多标的间运算后的价格计算方式。

若该笔交易为全部平仓、部分平仓或终止(即交易类型字段填报 FU、PU 或 ED), 结算价取值方式应与开仓(即交易类型字段为 NT)时一致。

137. 结算价取值日

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指取结算价的日期, 通常为到期日当天。若涉及多个日期, 日期之间用英文分号隔开。例如累计期权, 当“AC-未敲入未敲出累计方式”或“AC-敲入累计方式”为 9 (仅累计数量) 且不同观察日区间对应不同结算价时, 第一段结算区间指观察起始日(含)到第一个结算价取值日(含)之间的观察日, 对应使用第一个结算价取值日的结算价取值; 第二段结算区间指第一个结算价取值日(不含)到第二个结算价取值日(含)之间的观察日, 对应使用第二个结算价取值日的结算价取值; 以此类

推。

138.收益划转时间

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：记录带观察的结构，如累计、雪球、凤凰、互换，每次观察后产生的收益何时划转，包含 1（观察后即期支付）、2（合约到期后支付）、99（其他）三个选项。

139.结算方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方达成一致的结算方式，包括 C（现金）、P（实物）、E（待选择）、O（其他）四个选项。其中，E（待选择）指期权行权时可选择结算方式为现金或实物。

140.最后结算日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方约定的实际执行结算的最晚日期。

141.开仓收支或结算收益

所在文件：仅成交文件

字段释义：若该笔成交为期权交易，请填写开仓权利金总额、平仓期权费总额或行权收益总额。若该笔交易为远期或互换，请在开仓时填写涉及的开仓收支（如有），在交易平仓或终止时填写结算收益。请注意按交易对手方 1（即风险管理公司）角度带方向填写，负数代表支出，正数代表收入。若涉及外币，请按最新汇率折算为人民币进行填写。

142. 实现盈亏

所在文件：仅成交文件

字段释义：指该头寸完结或观察后所实现的逐笔盈亏，即部分平仓盈亏、平仓盈亏、到期结算盈亏、观察实现盈亏及其涉及的手续费收支，负数代表亏损，正数代表盈利。请注意按交易对手方 1（即风险管理公司）角度带方向填写。若涉及外币，请按最新汇率折算为人民币进行填写。

三、实际名义金额计算说明

交易报告库的数据统计均按以下规则计算实际名义金额：

单标的实际成交名义金额=交易名义金额*参与率*年化系数；

单标的实际持仓名义金额=(初始名义金额-已平仓总名义金额)*参与率*年化系数；

多标的实际成交名义金额=MAX(标的 1 交易名义金额, 标的 2 交易名义金额, ... 标的 n 交易名义金额)*参与率*年化系数；

多标的实际持仓名义金额=MAX[(标的 1 初始名义金额-标的 1 已平仓总名义金额), (标的 2 初始名义金额-标的 2 已平仓总名义金额), ..., (标的 n 初始名义金额-标的 n 已平仓总名义金额)]*参与率*年化系数；

其中，若“是否为年化名义金额”字段为 Y（是），则年化系数=(到期日-生效日+1)/365；若“是否为年化名义金额”字段为 N（否），则年化系数=1。

对于分腿报送的交易，该笔交易的名义金额等于所有腿名义金额之和，即不设置权重，由各腿名义金额直接相加得到。

四、常见问题及解答

Q1.已完成场外衍生品业务备案，尚未开展交易，如何报送数据？

解答：所有完成场外衍生品业务备案的公司均需报送数据，若无交易数据或客户资金数据，需要空白报送。空白报送指把成交文件、持仓文件、资金文件的空白模板按要求命名好后上传。

Q2.被暂停新增场外衍生品业务，如何报送数据？

解答：若公司被暂停新增场外衍生品业务时仍有存续业务，则公司仍要每日报送数据。待存续业务全部完结后，公司应主动向我中心申请关闭用户，用户关闭之后公司无需报送数据，用户关闭之前仍要报送数据。

Q3.风险管理公司现货团队开展的场外衍生品交易是否报送？

解答：若该风险管理公司已完成场外衍生品业务备案，其现货团队与公司自身场外衍生品团队开展的场外衍生品交易应当报送，其现货团队与其他公司场外衍生品团队开展的业务无需报送。若该风险管理公司未完成场外衍生品业务备案，而是作为买方与其他场外交易商开展交易，无需报送。

Q4.文件命名有何要求？

解答：请务必按照如下规则命名：

成交文件：otctrddata+交易确认日期

持仓文件：otcposdata+持仓日期

资金文件：funddata+结算日期

主协议、补充协议、履约担保协议：交易对手方 2 名称+签署日期+主/补/履

交易确认书：1.交易对手方 2 名称+XX 主交易确认书+签署日期

2.交易确认书编号+交易确认日期

若一个对手方涉及多个主交易确认书，则 XX 处需填写主交易确认书的分类关键词。比如按期权结构分类，则填写期权结构名称。

一般情况下，交易确认日期、持仓日期、结算日期应为同一天。例：2022 年 8 月 4 号报送 8 月 3 号的数据，成交文件、持仓文件、资金文件、交易确认书文件名中的日期都应该为 20220803，而不是 20220804。

上述“+”号只表示不同类别信息的连接，实际命名时无需有“+”号。

Q5.对于在境内证券或期货交易所交易日以外的自然日达成的交易，交易确认日期按哪天报送？

解答：提前或后延至最近的境内交易日。

Q6.若发现历史报送数据出现错误怎么办？

解答：若为成交文件历史数据出现错误，需要报告主体把错误那天的正确数据重新上传，重新上传的表格中包括那天的全部数据，而不是仅包括错误数据。

若为持仓文件历史数据出现错误，需要报告主体联系我中心一事一议讨论如何修正历史数据。

若为资金文件中影响期末结存计算的字段历史数据出现错误，报告主体可在待报送的资金文件中通过“资金调整项”字段对期末结存进行修正，无需重新上传历史文件；若为资金文件中其余字段历史数据出现错误，报告主体需联系我中心一事一议讨论如何修正历史数据。

若为某个或某几个补充协议、交易确认书出现错误，只需要报告主体把改正的补充协议、交易确认书重新上传，无需把当天所有的补充协议或交易确认书重新上传。

我们会对公司上传中的漏报、错报情况进行监测，请认真对待数据报送工作，准确、及时、完整的完成数据上报。

Q7.若双方约定之前报送的某笔交易取消或修改怎么报送？

解答：如果是双方约定之前报送的某笔交易取消，在报送成交表时，需要在“交易类型”字段填写“ER”，其余字段与原报送信息保持一致，在报送持仓表时，去掉该笔取消的交易即可。如果是双方约定之前报送的某笔交易修改，在报送成交文件时，需要在“交易类型”字段填写“MD”，其余字段填写修改后的

正确信息，在报送持仓文件时，按照最新的情况填写即可，无需追溯修改之前日期的持仓表。

Q8.若出现新开仓交易时的个别交易要素与后来收到的交易确认书里的内容不一致的情况，如何填报？

解答:(1)若双方确认是交易确认书上的交易要素填写有误，需要重新出具交易确认书。

(2)若双方确认以交易确认书上的信息为准，则需要成交文件的“交易类型”字段填写“MD”，其余字段填写修改后的正确信息（即交易确认书上的信息），持仓文件按照最新的情况填写即可。

例：8月1日，双方新开仓一笔交易，名义金额为100万，8月2日上午，子公司将该笔交易分别上报在成交文件和持仓文件中，成交文件中该交易的“交易类型”为“NT”，名义金额为100万，8月3日，子公司收到交易确认书后，双方确认名义金额调整为101万，则8月4日，子公司在上报8月3日数据时，需要在成交文件中继续上报该笔交易，“交易类型”上报为“MD”，同时成交文件和持仓文件的名义金额都改为101万元。

Q9.涉及多腿的香草期权、奇异期权如何报送？

解答:(1)针对香草组合期权，按“一腿报送一行”上报。

(2)针对“期权产品结构”字段列明的奇异结构（二元及其组合、障碍及其组合、自动赎回类），按“一笔报送一行”上报。

(3) 针对“期权产品结构”字段未列明的奇异结构，原则上按“一笔报送一行”上报。

Q10.如果期权产品结构为 O（其他），如何填报？

解答：该期权产品结构的特有字段无需填报，但是期权产品基本信息字段，名义金额、名义数量等相关字段应该准确填报。

Q11.如果标的资产为多资产，填报时需要注意什么？

解答：(1) 股指、商品指数（例如大商所发布的猪饲料成本指数、蛋鸡养殖利润指数等）为单资产，不是多资产；

(2) “标的资产对应合约”字段应清晰表示各标的资产的运算关系，而不是用英文分号隔开各个合约：

正确示例：RB2209.SHF-HC2209.SHF；

错误示例：RB2209.SHF;HC2209.SHF

(3) “标的资产对应合约”中的“+”、“-”、“&”符号为多资产的标识符，因此仅当且仅当标的资产为多标的时，才可以出现“+”、“-”、“&”符号：

正确示例：Mysteel 北京 HRB400E 螺纹钢 Φ18_22mm 敬业

错误示例：Mysteel 北京 HRB400E 螺纹钢 Φ18-22mm 敬业

(4) 以下字段涉及到多资产时，需要用英文分号隔开各个标的的数额，且按照“标的资产对应合约”中的资产顺序填写：

成交表：“标的资产品种”“标的期初价格”“标的期初价格货币”“平仓或终止时的标的价格”“初始名义数量”“交易名义数量”“初始名义金额”“交易名义金额”“Delta Cash”字段；

持仓表：“标的资产品种”“标的期初价格”“标的期初价格货币”“初始名义数量”“已平仓总名义数量”“初始名义金额”“已平仓总名义金额”“合约估值时标的价格”“估值波动率”“Delta”“Gamma”“Vega”“Delta Cash”“Gamma Cash”。若公司将多标的视为单标的估值，则“估值波动率”“Delta”“Gamma”“Vega”“Delta Cash”“Gamma Cash”无需用英文分号分割。

Q12.成交文件和持仓文件中哪些字段填报时需要考虑买卖方向？填报哪一方的方向？

解答：成交文件中的“开仓收支或结算收益”“实现盈亏”“Delta Cash”，持仓文件中的“合约价值”“浮动盈亏”“Delta”“Gamma”“Vega”“Theta”“Rho”“Delta Cash”“Gamma Cash”在填报时需要考虑买卖方向，按照交易对手方 1（即风险管理公司）的方向填写。

请注意填报名义金额、名义数量相关字段时无需考虑方向。

Q13.资金文件中“当日出入金”是站在哪个账户角度的出入金？

解答：是站在客户（即交易对手方 2）在风险管理公司的交易账户角度，比如客户购买了一笔期权，向风险管理公司转账一笔期权费 1000 元，同时当天风险管理公司转账一笔结算款给客户，金额为 500 元，则“当日出入金”为：入金（1000 元）- 出金（500 元）= 500 元。

Q14.商品 ETF 属于商品类还是权益类？

解答：属于商品类，填报时“资产类型”填 CO，“标的资产所属板块”填 COETF。请注意，只有基金最终投向商品期货、现货等才是商品 ETF，比如 512400.SH（有色金属 ETF）投向是有色行业的公司股票，不属于商品 ETF。

Q15.同一交易确认书包含多笔交易，是否需要多次上传该交易确认书？

解答：上传一次即可，上传文件名中的“交易确认书编号”应与成交表、持仓表中的“交易确认书编号”保持一致。

Q16.公司与客户平仓时未签署平仓交易确认书，而是出具清算报告，清算报告是否要上传？

解答：需要，清算报告视同为平仓交易确认书。

Q17.公司与客户签署交易确认书时只加盖单章，公司并无必须加盖双章的相关规定，是否只上传加盖单章的交易确认书？

解答：这种情况下只需要上传加盖单章的交易确认书即可。

Q18.客户端安装完成后需要配置什么？

解答：安装完成后，点击登陆界面的设置（齿轮）图标，新增并启用（绿色）以下服务地址，<https://41.16.130.39:20001/>，注意是 https、不是 http，并将默认服务地址关闭（红色）。

Q19.收不到验证码怎么办？

解答：验证码分两种，一是系统登陆界面的图片验证码，若收不到该验证码，说明公司终端与系统服务器间的网络不通

(telnet 41.16.130.39 20001)，请公司负责网络的同事进行调试；二是手机短信验证码，若收不到该验证码，或与移动、联通、电信等通信服务商有关系，建议尝试更换另一种通信服务商，或等一段时间再次尝试，一般情况下，过段时间服务会恢复正常。

Q20.挂钩外盘标的的交易由于获取某些交易要素时间晚，无法在 T+1 日 14 点前完成报送怎么办？

解答：T 日成交的外盘标的的交易，若无法在 T+1 日 14 点前完成报送，可在 T+2 日 14 点前报送的 T+1 日结构化数据表中完成报送。但需注意，该交易在成交表、持仓表、资金表的报送时间应保持一致，即若某笔新开仓交易报送在了 T+1 日的成交表中，则 T+1 日的持仓表中才会首次出现该笔交易，其引起的客户资金变化应体现在 T+1 日的资金表中。

Q21.累计期权新开仓和观察后如何报送成交、持仓？

解答：对于成交表，首先，累计期权开仓时报一笔 NT。然后，分为以下 4 种情形：

1. 若观察后仅累计数量不结算收益，则观察当日无需报送成交记录。

2. 若某次观察后的收益全部按现金结算，且结算收益计入累计期权的持仓市值中，则观察当日无需报送成交记录。

3. 若某次观察后的收益全部按现金结算，且结算收益计入客户的期末结存中，那么：如果观察后累计期权未终止，则观察当日报送一笔“交易类型”为 OB（已观察）、“交易类型细分”

为 **POB**（部分结算）的成交记录；如果观察后累计期权终止，则观察当日报送一笔“交易类型”为 **ED**（终止）的成交记录。该记录的“持仓编号”应与相对应的累计期权保持一致。该记录的“开仓收支或结算收益”的绝对值应等于本次观察计入期末结存中的结算收益，“实现盈亏”应等于本次观察的结算收益与所对应的开仓权利金的差。

4. 若某次观察后涉及建仓远期/互换，则除了报送一笔 **POB**（观察后累计期权未终止）或 **ED**（观察后累计期权终止）成交记录以外，还需要报送一笔“交易类型”为 **OB**（已观察）、“交易类型细分”为 **FWOB**（新生成远期/互换）、“工具类型”为 **FW**（远期）或 **SW**（互换）的成交记录。其中，对于 **POB** 记录，若涉及观察后产生现金收益并计入客户的期末结存，则该 **POB** 记录的“开仓收支或结算收益”和“实现盈亏”参照上面情景 3 进行计算，否则该 **POB** 记录的“开仓收支或结算收益”和“实现盈亏”均等于 0。**FWOB** 记录的“交易确认书编号”、“成交编号”、“持仓编号”为新生成的远期/互换相对应的编号，若未新签署远期/互换交易确认书，则填写累计期权涉及该操作的相关文书。**注意该 FWOB 记录不要报为 NT。**

对于持仓表，累计期权的持仓名义金额和数量将按以下公式计算：期初名义金额/数量-报送为 **POB** 的名义金额/数量。另外，观察后新生成的远期/互换应报送实际持仓的名义金额和数量。对于“浮动盈亏”字段，若涉及观察后产生现金收益并计入客户

的期末结存，或观察后仅通过建仓远期/互换来结算，则计算累计期权持仓的浮动盈亏时，应用期权估值与剩余未观察部分所对应的开仓权利金做差。

以上填报规则可总结为下表：

是否报 POB	结算方式	现金收益 计在哪里	开仓收支或 结算收益绝 对值	实现盈亏绝 对值	浮动盈亏绝对值	
不报 POB	仅累计数量	-	-	-	累计期权估值-开 仓权利金	
		累计期权 估值				
报 POB	仅现金结算	期末结存	本次观察的 现金收益	本次观察的 现金收益- 所对应的开 仓权利金	累计期权估值-未 观察部分对应 的开仓权利金	
	仅建仓远期	-	0	0	累计期权估值-未 观察部分对应 的开仓权利金	
	建仓远期+ 现金结算		累计期权 估值	0	0	累计期权估值-开 仓权利金
		期末结存	本次观察的 现金收益	本次观察的 现金收益- 所对应的开 仓权利金	累计期权估值-未 观察部分对应 的开仓权利金	

Q22.对于观察后不即期结算，仅累计数量的累计期权，若对已累数量进行部分平仓，如何报送交易名义金额和数量？

解答：对于成交表，报送一笔PU，“AC-结算数量”需填实际平仓数量。对于持仓表，“AC-计入估值的已累数量”需填未平仓的实际剩余已累数量。

由于累计期权的名义金额/数量是用单次观察数量估算的，而实际观察中可能触及累计倍数，所以，为了防止已平仓总名义

金额/数量大于累计期权的总名义金额/数量，需按以下公式折算填写成交、持仓表的名义金额相关字段：

交易名义数量=实际平仓数量/累计倍数；

交易名义金额=交易名义数量*标的期初价格；

已平仓总名义数量=实际已平仓总数量/累计倍数；

已平仓总名义金额=已平仓总名义数量*标的期初价格。