

场外证券业务数据备案格式指引

(第 2 号) - 衍生品业务

为便于场外衍生品业务填报主体的理解和填报，特制订本指引，对填报中涉及的填报口径问题和易于混淆的主要字段予以说明。

一、场外衍生品主协议

(一) 交易对手类别

1、填报要求：专业、非专业

2、填报说明：交易对手类别参照《证券期货投资者适当性管理办法》，涉及交易对手类型变更的情况应及时更新“交易对手方类型”信息。

(二) 非金融机构行业代码

1、填报要求：当交易对手类别选择非专业时，此项为必填项。

2、填报说明：非金融机构行业代码须参照 2017 年 6 月 30 日国家统计局发布的《国民经济行业分类》。

(三) 主协议编号（双方约定）

1、填报要求：双方均为报告义务人时，报送同一协议时应使用双方约定的相同的协议编号，应体现在上传的 PDF 文档中。

2、填报说明：补充协议编号为双方签订主协议时约定的协议编号。

二、场外衍生品补充协议

(一) 补充协议编号（双方约定）

1、填报要求：双方均为报告义务人时，报送同一协议时应使用

双方约定的相同的协议编号，应体现在上传的 PDF 文档中。

2、填报说明：补充协议编号为双方签订补充协议时约定的协议编号。错误示例：A 和 B 公司之间签订的补充协议，A 公司填报的补充协议编号为 a，B 公司填报的补充协议编号为 b，但事实上属于同一笔协议。

交易确认书编号（双方约定）同上。

三、交易确认书-期权

（一）期权方向

1、填报要求：看涨、看跌、双向

2、填报说明：行权收益与标的资产价格变动正相关时为看涨，负相关时为看跌，其他情况为双向。

（二）填报名称：期权结构类型

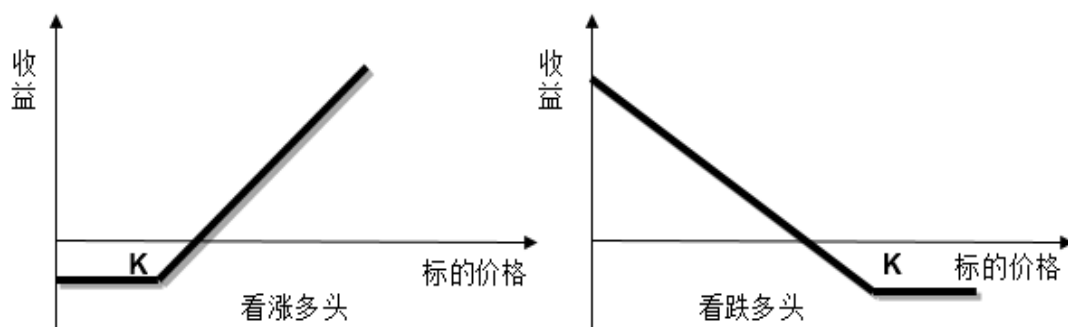
1、填报要求：香草、二元、价差、鲨鱼鳍、障碍、区间累计、自动看涨（Auto Callable）、其他

2、填报说明：

香草期权：分为看涨和看跌两种基本类型，看涨期权给期权持有者在将来以一定价格买入某种资产的权利，看跌期权给期权持有者在将来某个日期以一定价格卖出某种资产的权利；

示例图

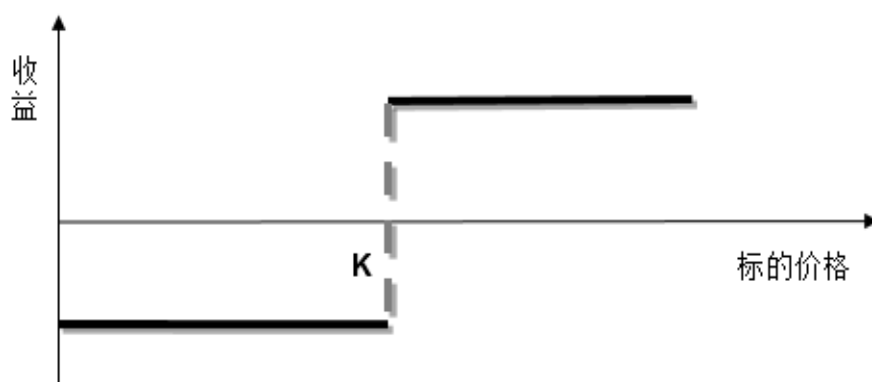
香草期权结构



二元期权：收益和风险是预先固定的，收益与否只由标的资产的价格是否满足预定条件决定的期权；

示例图

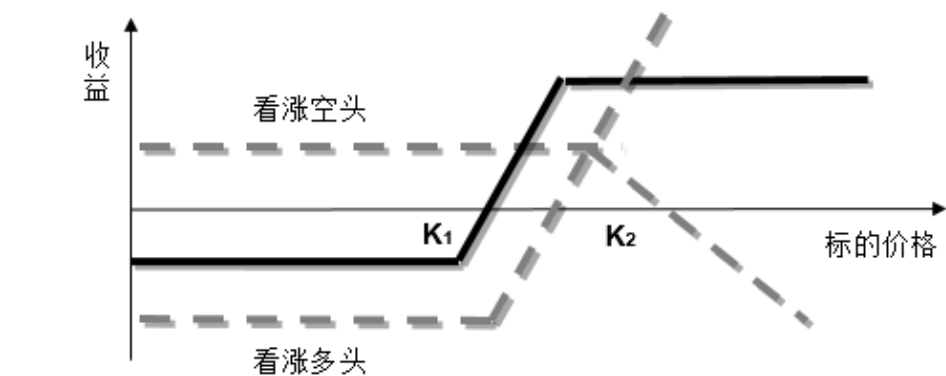
二元期权构造结构



价差期权：是指将相同类型的两个或者多个期权组合在一起的策略构成的期权；

示例图

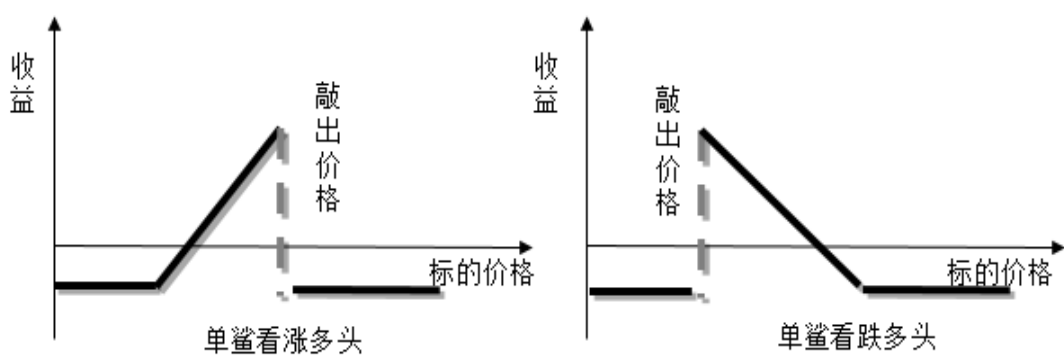
看涨期权构造的牛市价差结构



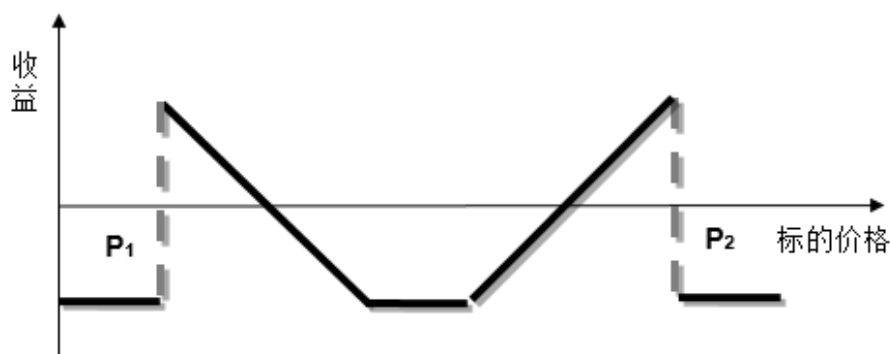
鲨鱼鳍: 是指事先设置好标的资产的价格区间, 如果合约到期时, 标的资产价格在该区间中, 这个期权就是一个普通的看涨或看跌期权; 一旦标的资产价格跳出了该价格区间, 该期权获得固定收益(含 0%); 分为单鲨期权和双鲨期权。

示例图

单鲨期权的看涨和看跌多头结构



双鲨鱼期权多头结构



障碍：除香草、二元、价差、鲨鱼鳍、区间累计、自动看涨（Auto Callable）、其他期权以外，并设有障碍条件的期权，填报为障碍期权；

区间累计：将合约标的价格的范围分为若干个区间，每个观察日观察该标的价格所属区间，即可锁定当日年化收益，为一系列二元期权的收益叠加；

自动看涨（auto callable）：期权中会有一个既定的敲出障碍价，有固定观察日。当标的物价格在观察日中达到了既定的敲出障碍价时，该期权自动终止合约，投资者获得有效天数对应的收益率。若合约到期时，标的物价格未触及敲出障碍价，则获得合约中事先约定的固定收益或合同约定的一个期权结构（雪球型）。凤凰型在上面基础上加上一个敲入价格，即自动获得一个股票多头。

（三）起始日（T日）

- 1、填报要求：格式为 YYYYMMDD
- 2、填报说明：指交易的具体条款开始执行的日期。

（四）到期日

1、填报要求：格式为 YYYYMMDD

2、填报说明：指交易双方在交易有效约定中指定该交易结束的日期。

（五）期权费（非年化）%

1、填报要求：数值处于 0 至 100 之间

2、填报说明（例）：期权费（非年化）%=实际支付期权费/名义本金（期权费占名义本金的百分比）。如：期权费绝对金额占期权名义本金 10%，该字段填写应为“10”。

（六）名义本金与有效名义本金

1、填报要求：名义本金、有效名义本金

2、填报说明：

如合同中未单独约定年化系数与参与率，有效名义本金与名义本金一致；如合同中约定年化系数或参与率，有效名义本金=名义本金*年化系数*参与率；如合同中存在多个参与率，有效名义本金应依据不同参与率分别计算，最终以孰大为准。

实际行权收益：实际行权收益=行权收益率*（名义本金*参与率*年化系数）=行权收益率*有效名义本金

名义本金：指交易双方在协议中所确定的合约规模，用来计算实际结算金额的货币本金。名义本金双方并不进行实际的资金借贷和转移，是双方用以计算盈亏的本金数额。

有效名义本金：指经过年化系数及参与率调整后的名义本金。

参与率：反应的实际回报与行权收益的关系，即按照一定系数参

与行权收益程度，通常为 100%。

年化系数：是指把当前绝对收益率还原成年化收益率的系数，年化系数等于实际期限/365。

（七）标的类型、标的小类、标的交易场所

1、填报要求：

标的类型：权益类、大宗商品、利率、信用类、汇率、其他

标的小类：股票、股指、新三板挂牌股票、香港股票、香港股指、基金及基金专户、债券、黄金期货、国债期货、股指期货、其他期货、黄金现货、其他现货、境外期货、境外现货、境外股票、境外股指、汇率、Shibor、银行间回购定盘（Fixing Repo Rate）、其他利率、其他标的

标的交易场所：上海证券交易所、深圳证券交易所、新三板、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、外汇交易中心、上海黄金交易所、香港联合交易所、其他

2、填报说明：

标的大类	标的小类	交易场所
01: 权益类	01: 股票（境内）	01: 上海证券交易所、02: 深圳证券交易所
	02: 股指（境内）	01: 上海证券交易所、02: 深圳证券交易所
	03: 新三板挂牌股票	03: 新三板
	04: 香港股票	10: 香港联合交易所
	05: 香港股指	10: 香港联合交易所
	06: 基金及基金专户(境内)	01: 上海证券交易所、02: 深圳证券交易所、99: 其他
	10: 股指期货	07: 中国金融期货交易所
	16: 境外股票	11: 境外交易所
	17: 境外股指	11: 境外交易所
	99: 其他标的	99: 其他

02: 大宗商品	08: 黄金期货（境内）	04: 上海期货交易所
	11: 其他期货（境内）	05: 大连商品交易所、06: 郑州商品交易所
	12: 黄金现货（境内）	09: 上海黄金交易所
	13: 其他现货（境内）	99: 其他
	14: 境外期货	99: 其他
	15: 境外现货	99: 其他
03: 利率	19 :Shibor	08: 外汇交易中心、99: 其他
	20: 银行间回购定盘（Fixing Repo Rate）	08: 外汇交易中心、99: 其他
	21: 其他利率（利率基差等）	08: 外汇交易中心、99: 其他
	09: 国债期货（境内）	07: 中国金融期货交易所
04: 信用类	99: 其他标的	99: 其他
05: 汇率	18: 汇率	08: 外汇交易中心、99: 其他
99: 其他	99: 其他标的	99: 其他
	07: 债券	01: 上海证券交易所、02: 深圳证券交易所、99: 其他

（八）标的名称、标的代码

1、填报要求：与交易所使用的标的简称、标的代码保持一致。

2、填报说明：示例：沪深 300 指数的名称为沪深 300，代码为 000300 或 399300

标的类型	标的子类	标的交易场所	标的名称
	01: 股票	01: 上海证券交易所	示例：平安银行
		02: 深圳证券交易所	注意：请勿添加 SH、SZ 等后缀
	02: 股指	99: 其他	示例：沪深 300 注意：（1）请勿添加 SH、SZ、OC 等后缀（2）IF、IC、IH 等股指期货应填报为“股指期货”
	03: 新三板挂牌股票	03: 新三板	示例：合全药业 注意：请勿添加 OC、oc 等后缀
	04: 香港股票	10: 香港联合交易所	示例：腾讯控股 注意：请勿添加 HK、hk 等后缀

权 益 类	05: 香港股指	10: 香港联合交易所	示例: 恒生指数 注意: 请勿添加 HK、hk 等后缀
	06: 基金及基金专户	01: 上海证券交易所	示例: 招商中证白酒
		02: 深圳证券交易所	注意: (1) 请勿添加 OF 等后缀
		99: 其他	(2) 基金专户等未上市交易产品, 请填写在基金业协会备案的产品全称与产品代码
	10: 股指期货	07: 中国金融期货交易所	示例: (1) 沪深 300 股指期货 (2) 上证 50 股指期货 (3) 中证 500 股指期货 注意: (1) 请勿将“IC1904”等代码填写为名称(2)请勿添加 CFE 等后缀
	16: 境外股票	11: 境外交易所	示例: (1) ALPHABET (2) 阿里巴巴 注意: (1) 请勿填写交易所简称后缀(2)请勿将标的代码作为标的名称(3)有中文全称的应填写中文全称, 没有中文全称的应该填写在交易所交易时的全称
	17: 境外股指	11: 境外交易所	示例: 标普 500 注意: (1) 请勿填写交易所简称后缀(2)请勿将标的代码作为标的名称(3)有中文全称的应填写中文全称, 没有中文全称的应该填写在交易所交易时的全称

(九) 标的数量

- 1、填报要求: 只限挂钩标的为股票填写。
- 2、填报说明: 标的数量应为挂钩股票的股数。

（十）行权价格 1、行权价格 2

1、填报要求：

行权价格 1：格式为占期初价格的百分比。有多个行权价，请填写与初始价格偏离度较小的行权价，二元期权等可填写障碍价格。

行权价格 2：格式为占期初价格的百分比。如期权有行权价，则为必填；有多个行权价，请填写与初始价格偏离度较大的行权价。

2、填报说明：以价差为例，行权价 1 为 K_1 ，行权价 2 为 K_2 。

示例图

价差结构

