

场外证券业务报告系统

衍生品业务数据报送文件接口规范

补充修订 V1.1

一、修订内容概述

（一）[3.2.5.1 期权交易确认书]章节

- 1、有效名义本金（人民币）（序号：40），该字段调整为必填项。
- 2、行权价格 1（序号：42），该字段调整为必填项，字段标识调整为“ExercisePriceOne”。
- 3、行权价格 2（序号：43），该字段标识调整为“ExercisePriceTwo”。

（二）[3.2.7.1 SAC 模板]章节

- 1、本月末远期本月交易数（序号：155），名称需要更正为“本月末远期本月违约交易数”。
- 2、上月末远期本月交易数（序号：156），名称需要更正为“上月末远期本月违约交易数”。

（三）[3.2.7.3 ISDA 模板]章节

- 1、对冲操作_持仓数量（序号：22），接口规范校验规则：保留整数。
- 2、已签约客户合计（序号：68），名称需要更正为“本月末已签约客户合计”。
- 3、当期参与交易的账户数量合计（序号：69），名称需要更正为“本月末当期参与交易的账户数量合计”。
- 4、存量交易客户数量合计（序号：70），名称需要更正为“本月末存量交易客户数量合计”。
- 5、本月末远期本月交易数（序号：108），名称需要更正为“本月末远期本月违约交易数”。
- 6、上月末远期本月交易数（序号：109），名称需要更正为“上月末远期本月违约交易数”。

（四）新增季报接口

- 1、新增季报接口，附件为必填项。

（五）新增双方约定编号数据处理接口

- 1、新增双方约定编号数据处理接口，供证券公司批量修改主协议、补充协议、交易确认书（期权、互换）双方约定编号重复数据。

二、修订内容详情

3 结构化文件规范

3.2 报送报体格式定义

3.2.5 交易确认书

3.2.5.1 期权交易确认书

包含在标签<OptionConfirmation>内

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
40	ValidNotinalPrincipleAmt	有效名义本金 (人民币)	N(36, 2)	是		有效名义本金是指期权参与率为100%且剔除了年化系数影响之后的名义本金。 校验规则：保留两位小数；
42	ExercisePriceOne	行权价格 1	N(36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
43	ExercisePriceTwo	行权价格 2	N(36, 2)	否		校验规则：保留两位小数；

3.2.7 定期报告

3.2.7.1 SAC 模板

包含在标签<PeriodicReportSAC>内

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
155	ForwardTransactionNumberAtThisMonthThisMonth	本月末远期本月违约交易数	N(20)	是		校验规则：正整数；
156	ForwardTransactionNumberAt	上月末远期本月违约交	N(20)	是		校验规则：正整数；

	ThisMonthLast Month	易数				
--	------------------------	----	--	--	--	--

3.2.7.3 ISDA 模板

包含在标签<PeriodicReportISDA>内

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
68	SignedTotalCustomer	本月末已签约客户合计	N(20)	是		校验规则：正整数；
69	TotalNumberOfTradingAccountsAtThisPeriod	本月末当期参与交易的账户数量合计	N(20)	是		校验规则：正整数；
70	TotalNumberOfTradingClientAccounts	本月末存量交易客户数量合计	N(20)	是		校验规则：正整数；
108	ForwardTransactionNumberAtThisMonthThisMonth	本月末远期本月违约交易数	N(20)	是		校验规则：正整数；
109	ForwardTransactionNumberAtThisMonthLastMonth	上月末远期本月违约交易数	N(20)	是		校验规则：正整数；

(2) 标的情况与对冲

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
2 2	PositionQuantity	对冲操作_持仓数量	N(20)	否		校验规则：整数

3.2.7.4 季报

包含在标签<PeriodicReportQuarter>内

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
----	------	-------	------	------	------	----

				填		
1	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则：补正时必须填；
2	Year	年份	N(4)	是		校验规则：必须是4位整数；
3	Quarter	季度	N(2)	是		校验规则：必须是01-04之间；
4	DerivativesQuarterlyReportAnnexTuple	季报报告文件	T	是	多附件	字段信息详见【季报报告文件】

季报报告文件

序号	源英文字段名	字段描述	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	DerivativesQuarterlyReportAnnex	季报报告文件	A	是		校验规则：只支持PDF格式；

3.2.10 双方约定编号数据处理

包含在标签< ContractNumberProcess >内

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	MasterAgrmtTuple	主协议类型	T	否		
2	SupAgrmtTuple	补充协议类型	T	否		
3	OptionConfirmationTuple	期权交易确认书类型	T	否		
4	SwapConfirmationTuple	互换交易确认书类型	T	否		

双方约定编号数据处理【主协议类型】

序号	源英文字段名	字段描述	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	MasterAgrmtID	主协议编号	C (32)	是		报告库自动生成
2	MasterAgrmtNo	主协议编号（双方约定）	C (100)	是		校验规则：主协议编号（双方约定）同一家机构下不能重复；

双方约定编号数据处理【补充协议类型】

序号	源英文字段名	字段描述	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	SupAgrmtID	补充协议编号	C (32)	是		报告库自动生成
2	SupAgrmtNo	补充协议编号 (双方约定)	C (100)	是		校验规则：补充协议编号（双方约定）同一家机构下不能重复；

双方约定编号数据处理【期权交易确认书类型】

序号	源英文字段名	字段描述	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	ConfirmationID	交易确认书编号	C (32)	是		报告库自动生成
2	ConfirmationNo	交易确认书编号 (双方约定)	C (100)	是		校验规则：交易确认书编号（双方约定）同一家机构下不能重复（校验时不区分期权和互换类型）；

双方约定编号数据处理【互换交易确认书类型】

序号	源英文字段名	字段描述	字段类型	是否必填	代码取值	说明
1	ConfirmationID	交易确认书编号	C (32)	是		报告库自动生成
2	ConfirmationNo	交易确认书编号 (双方约定)	C (100)	是		校验规则：交易确认书编号（双方约定）同一家机构下不能重复（校验时不区分期权和互换类型）；

4 附录

4.1 数据字典

4.1.1 接口标识

序号	接口标识	含义
14.	A1014	定期报告-季报
15.	A1015	双方约定编号数据处理