

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

目录

1	目标	3
2	通信约定	3
2.1	文件格式	3
2.2	文件命名规范	3
2.3	文件结构	4
2.3.1	报送信息文件结构	4
2.3.2	应答文件结构	5
2.3.3	结构化文件命名规范	5
2.3.4	非结构化文件命名规范	6
2.4	文件传输约定	6
3	结构化文件规范	7
3.1	报文格式概述	7
3.1.1	字符集	7
3.1.2	关于 BOM	7
3.1.3	报文结构	7
3.1.4	报头格式	9
3.1.5	报体格式	10
3.2	报送报体格式定义	11
3.2.1	主协议	11
3.2.2	主协议关联产品列表	14
3.2.3	补充协议	16
3.2.4	履约保证书	17
3.2.5	交易确认书	18
3.2.6	交易终止协议	43
3.2.7	定期报告	49
3.2.8	重大事项报告	109
3.2.9	其他事项报告	110
4	附录	111
4.1	数据字典	111
4.1.1	接口标识	111
4.1.2	操作标识	111
4.1.3	响应码	111
4.1.4	定期报告填报说明	112

1 目标

为提升场外衍生品交易报告数据报送效率，规范报送义务人电子化接口报送，特制定本接口规范。

2 通信约定

2.1 文件格式

报送信息文件和应答文件均采用 ZIP 文件格式。ZIP 文件中包含结构化信息文件和非结构化信息文件。其中结构化信息文件内容为报送信息、应答信息等，文件格式为 XML 格式。每个 XML 文件为一类报送信息，如主协议首次报送为一类，主协议的补正信息为第二类，补充协议的首次报送为第三类等，分别放在不同的 XML 文件中；非结构化信息文件是结构化信息的补充材料，通过结构化信息中的内容关联，包括产品合同、募集说明书等。

2.2 文件命名规范

报送信息文件和应答文件命名规范相同，定义如下：

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号].zip

说明：

1. 文件名为 UTF-8 编码
2. 文件名中所有字母均大写，文件名中不带中括号“[”、“]”；
3. 文件创建人代码：6 位字符，使用场外证券业务报告系统为报送主体分配的编码；如果文件创建人是场外证券业务报告库系统，填 000899；
4. 文件接收人代码：6 位字符，使用场外证券业务报告系统为报送主体分配的编码；如果文件接收人是场外证券业务报告库系统，填 000899；
5. 数据日期：为当前机器时间，应采用北京标准时间（东八区时区），格式为 YYYYMMDD（如 20200824），报送机构应尽量减少本地机器时间和北京标准时间的偏差，应答文件的数据日期与报送信息文件的数据日期相同；
6. 文件序号：采用四位数字顺序编号，每日从 0001 开始顺序递增，最大支持 9999，作为数据日期下的报送批次序号，应答文件的文件序号与报送信息文件的文件序号相同。

报送文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001.zip

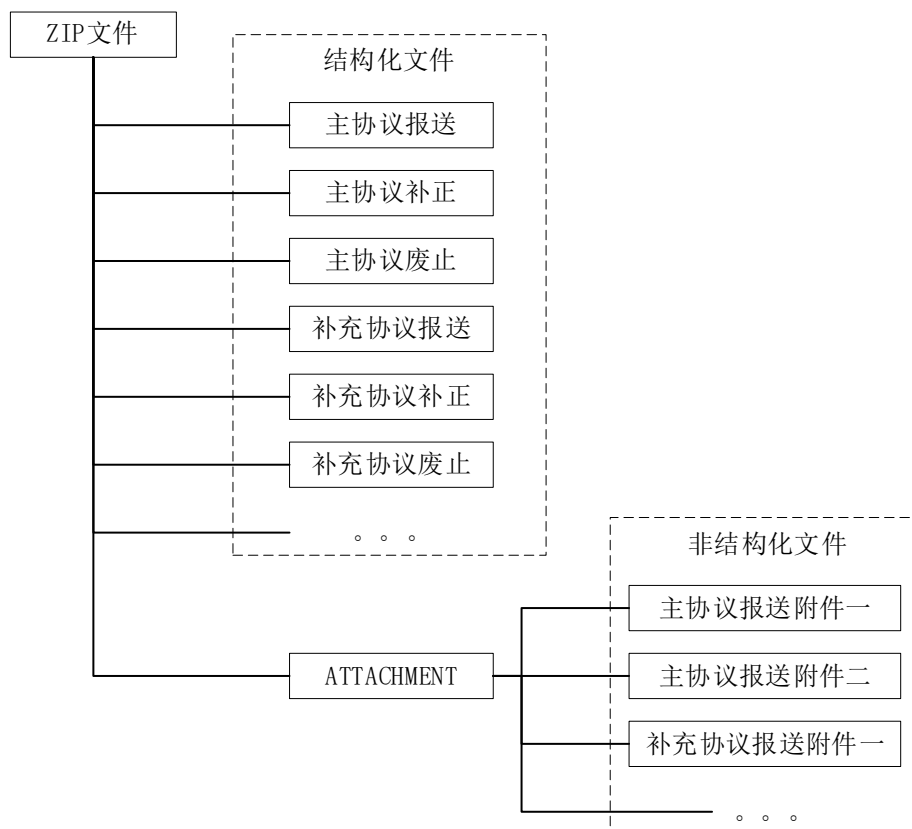
应答文件命名示例：

OTC_000899_131101_20200824_0001.zip

2.3 文件结构

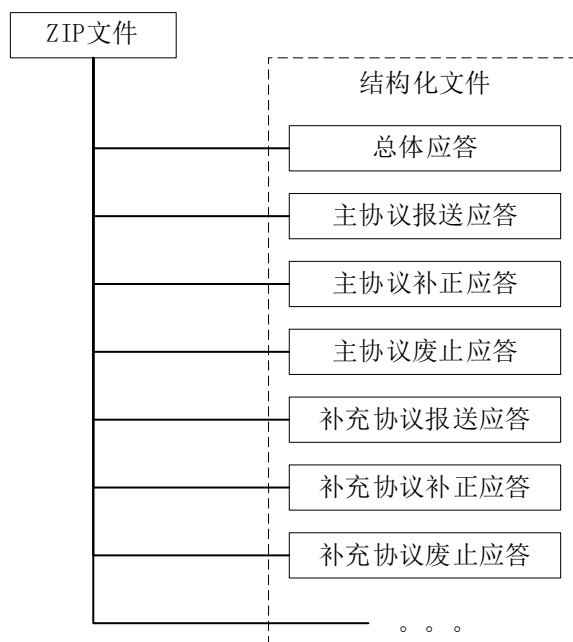
2.3.1 报送信息文件结构

报送信息文件为 ZIP 格式，ZIP 文件中可打包树形文件目录结构。根据业务需要，定义报送信息文件打包的目录结构如下图所示：



ZIP 文件打包的第一级目录包含所有的结构化内容文件以及非结构化文件目录 (ATTACHMENT)，其中每个结构化文件为一类报送信息（维度为接口类型加上操作类型，例如主协议补正为一类，含多条业务信息），同一类报送信息在 ZIP 文件中最多有一个。非结构化信息放在 ATTACHMENT 文件目录下，再没有子目录，文件名称不能重复。

2.3.2 应答文件结构



如上图所示，对应于每个报送主体的报送信息文件，一般情况下场外业务报告系统会发送类似目录结构的应答文件。其中，总体应答文件内容表示 ZIP 包的总体校验是否符合接口规范，例如批次号等字段校验是否通过等；对于报送的每个结构化内容文件，对应有一个结构化应答文件，每个结构化应答文件表述了对于结构化报送内容文件的总体处理结果，以及对应报送每条内容的处理结果。

如果总体应答文件内的响应码表示有错误，则表示对应的报送信息文件的格式有错误或处理出现异常。

2.3.3 结构化文件命名规范

2.3.3.1 总体应答文件

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号]_R.XML

1. 文件名中所有字母均为大写，UTF-8 编码；
2. 文件创建人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件创建人代码相同；
3. 文件接收人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件接收人代码相同；
4. 数据日期：8 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的数据日期相同；
5. 文件序号：4 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件序号相同；

总体应答结构化文件名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001_R.xml

2.3.3.2 报送信息文件和应答文件

结构化报送信息文件命名：

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号]_[接口标识]_[操作标识].XML

结构化应答文件命名：

OTC_[文件创建人代码]_[文件接收人代码]_[数据日期]_[文件序号]_[接口标识]_[操作标识]_R.XML

1. 文件名中所有字母均为大写，UTF-8 编码；
2. 文件创建人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件创建人代码相同；
3. 文件接收人代码：6 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件接收人代码相同；
4. 数据日期：8 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的数据日期相同；
5. 文件序号：4 位字符，与打包该文件的报送信息文件或应答文件中的文件序号相同；
6. 接口标识：5 位字符，具体见附录；
7. 操作标识：1 位字符，具体见附录；

结构化报送信息文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001_A1001_A.xml

结构化补正信息文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200825_0001_A1001_U.xml

结构化应答文件命名示例：

OTC_131101_000899_20200824_0001_A1001_A_R.xml

OTC_131101_000899_20200825_0001_A1001_U_R.xml

2.3.4 非结构化文件命名规范

ATTACHMENT 目录下包括若干非结构化数据文件，对于非结构化文件的命名不做约束，文件创建方可自行命名，但文件创建方应确保同一个 ATTACHMENT 目录下的非结构化文件无重名，且能与对应的结构化文件中的记录相关联。此外，由于非结构化文件名称可能含有中文或其它多字节文字，为提高兼容性，要求文件名统一采用 UTF-8 字符集。

2.4 文件传输约定

1. 报送主体需要按业务顺序发送报送文件，一个报送信息文件中的报送内容不能在有关联关系的另一个报送信息文件之前发送。举例说明：补充协议报送应该跟主协议报送在同一报送信息文件中，或者在主协议报送文件之后发送。
2. 报送主体发送不同批次的文件需要串行处理，需要确认前一文件发送成功后才能发送下一文件；
3. 场外证券业务报告系统仅处理符合文件命名规范的文件，对于不符合命名规范的文件不做应答；

4. 如果报送主体的报送信息文件存在格式校验等问题, 如 ZIP 包解压出现问题或当天批次号重复等, 场外证券业务报告系统将在应答文件中的总体应答结构化内容中返回错误码, 对于报送信息文件中的结构化信息不进行处理;
5. 报送主体生成结构化 XML 文件后, 必须使用 XML schema 校验通过后再发送; 文件接收方处理结构化文件内容之前, 必须先使用 XML schema 校验通过;
6. 场外证券业务报告系统对于报送信息文件内的结构化内容, 如果没有通过 XML schema 格式校验, 将返回通用错误信息, 该文件内所有信息将不被处理;
7. 场外证券业务报告系统对于报送信息文件内的结构化内容, 如果通过 XML schema 格式校验, 将逐条处理后一批返回, 其中包含每条的处理结果;

3 结构化文件规范

3.1 报文格式概述

3.1.1 字符集

采用 Unicode 字符集, UTF-8 编码方式。

3.1.2 关于 BOM

报文主体发送的报文不能带有 BOM header (EF BB BF) 三个字符。对于带有 BOM header 的报文, 报告系统将返回错误信息, 该文件内所有信息将不被处理。

3.1.3 报文结构

报文采用 XML 格式定义, 包括报头和报体, 报头 (Header 元素) 包含通信相关信息, 报体 (Body 元素) 包含业务信息, 根元素为 Root。主体结构示例如下:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Root>
<Header>
</Header>
<Body>
</Body>
</Root>
```

3.1.3.1 报送报文示例

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>
<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>131101</SenderCode>
    <ReceiverCode>000899</ReceiverCode>
    <SendDate>2020-08-25</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A1001</BusiDataType>
    <OperationType>A</OperationType>
  </Header>
  <Body>
    <MasterAgrmt>
      <ExecID>1311010008992020082500000001</ExecID>
      <MasterAgrmtNo>Z19042300100111000002</MasterAgrmtNo>
      <SigningDate>2020-08-25</SigningDate>
      <MasterAgrmtVer>0</MasterAgrmtVer>
      <FillParty>0</FillParty>
      <CounterpartyName>方圆天成资产管理（深圳）有限公司</CounterpartyName>
      <CounterpartyCode>914403003265274945</CounterpartyCode>
      <ProCounterparty>1</ProCounterparty>
      <CounterpartyType>11</CounterpartyType>
      <NFICode>asdfasdf</NFICode>
      <CounterpartyRegdCptl>400.00</CounterpartyRegdCptl>
      <MasterAgrmtRemark>remark</MasterAgrmtRemark>
      <MasterAgrmtAtt>主协议-01.pdf#62cdae60ff1140fbbfad1bee1bb7a015.pdf</MasterAgrmtAtt>
      <CounterpartyInformationTuple>
        <Name>张三</Name>
        <Title>高级业务经理</Title>
        <Telephone>010-87437546</Telephone>
        <Mobile>18721614098</Mobile>
        <Email>zhangsan@fund.com</Email>
      </CounterpartyInformationTuple>
      <CounterpartyIdentity>1</CounterpartyIdentity>
    </MasterAgrmt>
    <MasterAgrmt>
      <ExecID>1311010008992020082500000002</ExecID>
      <MasterAgrmtNo>Z19042300100111000033</MasterAgrmtNo>
      <SigningDate>2020-08-25</SigningDate>
      <MasterAgrmtVer>0</MasterAgrmtVer>
      <FillParty>0</FillParty>
      <CounterpartyName>方圆天成资产管理（深圳）有限公司</CounterpartyName>
      <CounterpartyCode>914403003265274945</CounterpartyCode>
      <ProCounterparty>1</ProCounterparty>
      <CounterpartyType>11</CounterpartyType>
      <NFICode>asdfasdf</NFICode>
      <CounterpartyRegdCptl>500.00</CounterpartyRegdCptl>
      <MasterAgrmtRemark>remark2</MasterAgrmtRemark>
      <MasterAgrmtAtt>主协议-02.pdf#651083de7e50479e85e602b4297dd71b.pdf</MasterAgrmtAtt>
      <CounterpartyInformationTuple>
        <Name>李四</Name>
        <Title>高级业务经理</Title>
        <Telephone>010-87437565</Telephone>
        <Mobile>18721610000</Mobile>
        <Email>lisi@fund.com</Email>
      </CounterpartyInformationTuple>
      <CounterpartyInformationTuple>
        <Name>王五</Name>
        <Title>高级业务经理</Title>
        <Telephone>010-87437663</Telephone>
        <Mobile>18721617653</Mobile>
        <Email>wangwu@fund.com</Email>
      </CounterpartyInformationTuple>
      <CounterpartyIdentity>1</CounterpartyIdentity>
    </MasterAgrmt>
  </Body>
</Root>

```


3.1.3.2 总体应答报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>000899</SenderCode>
    <ReceiverCode>131101</ReceiverCode>
    <SendDate>2020-08-24</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
</Root>
```

3.1.3.3 应答报文示例

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>000899</SenderCode>
    <ReceiverCode>131101</ReceiverCode>
    <SendDate>2020-08-24</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A1001</BusiDataType>
    <OperationType>R</OperationType>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
  <Body>
    <MasterAgrmt>
      <ExecID>1311010008992020082500000001</ExecID>
      <RetCode>000000</RetCode>
      <RetMsg>接收成功</RetMsg>
      <BizID>Z2020082500000001</BizID>
    </MasterAgrmt>
    <MasterAgrmt>
      <ExecID>1311010008992020082500000002</ExecID>
      <RetCode>000000</RetCode>
      <RetMsg>接收成功</RetMsg>
      <BizID>Z2020082500000002</BizID>
    </MasterAgrmt>
  </Body>
</Root>
```

3.1.4 报头格式

3.1.4.1 请求报头格式

主要元素包括文件创建人代码、文件接收人代码、文件创建日期、文件序号、接口标识、操作标识。

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
----	-----	------	------	------	------	----

1.	Version	版本号	C(3)	是	001	
2.	SenderCode	文件创建人代码	C(6)	是		报告库分配
3.	ReceiverCode	文件接收人代码	C(6)	是		报告库分配
4.	SendDate	文件发送日期	C(10)	是		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD
5.	FileNumber	文件序号	C(4)	是		0001~9999
6.	BusiDataType	接口标识	C(5)	是		参见附录
7.	OperationType	操作标识	C(1)	是		参见附录

3.1.4.2 响应报头格式

主要元素包括文件创建人代码、文件接收人代码、文件创建日期、文件序号、接口标识（总体应答文件不含）、操作标识（总体应答文件不含）、响应码、响应描述。其中，文件创建日期、文件序号、接口标识、操作标识这几个字段和请求报头内容一致。

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1.	Version	版本号	C(3)	是	001	
2.	SenderCode	文件创建人代码	C(6)	是		报告库分配
3.	ReceiverCode	文件接收人代码	C(6)	是		报告库分配
4.	SendDate	文件发送日期	C(10)	是		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD
5.	FileNumber	文件序号	C(4)	是		0001~9999
6.	BusiDataType	接口标识	C(5)	是（总体应答文件不含）		参见附录
7.	OperationType	操作标识	C(1)	是（总体应答文件不含）		参见附录
8.	RetCode	响应码	C(6)	是		参见附录
9.	RetMsg	响应描述	C(1000)	是		

3.1.5 报体格式

报体主要包括业务元素列表，具体定义参见报送报体格式定义。

3.1.5.1 请求报体格式

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	ExceID	业务数据流水号	C(28)	是		文件创建人代码 (6 位) +文件接收人代码 (6 位) +报送日期 (8 位) +当日顺序编号 (8 位)
2	其他业务字段参见 5.2 报送报体格式定义下各业务信息明细信息					

3.1.5.2 响应报体格式

序号	元素名	元素描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1.	ExceID	业务数据流水号	C(28)	是		
2.	RetCode	响应码	C(6)	是		参见附录
3.	RetMsg	响应描述	C(1000)	是		
4.	BizID	报送数据业务编号	C(50)	否		报告库接口返回, 数据处理异常时空。

3.2 报送报体格式定义

3.2.1 主协议

包含在标签<MasterAgrmt>内

序号	源英文字段名	字段描述	数据类型	是否必填	代码取值	说明
1	MasterAgrmtID	主协议编号	C(32)	否		校验规则: 补正时必填;
2	MasterAgrmtNo	主协议编号 (双	C(100)	是		双方约定;

		方约定)				
3	SigningDate	签订时间	C (10)	是		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD;
4	MasterAgrmtVer	主协议版本	C (10)	是	SAC2013 版 0、 SAC2014 版 1、 NAFMII 2、 ISDA 3、自定义 4、 SAC(2018 年 12 月发布) 5、 SAC 信用保护合约专用版 6、 其他 99	
5	FillParty	填报方角色	C (2)	是	甲方 0、乙方 1	
6	CounterpartyName	交易对手方名称	C (200)	是		
7	CounterpartyCode	交易对手方组织机构代码	C (20)	是		校验规则: 1、必须为 8、9、10 或 18 位; 、2、当交易对手方类型是境外金融机构、境外非金融机构, 必填 00000000;
8	ProCounterparty	交易对手类别	C (200)	是	专业 1、非专业 0	
9	CounterpartyType	交易对手	C (20)	是	证券公司 0、基金公	

		方类型			司 1、期货公司 2、证券公司子公司 3、基金公司子公司 4、期货公司风险管理公司 5、商业银行 6、保险公司 7、保险子公司 8、信托公司 9、财务公司 10、私募基金(应以中国基金业协会备案为准) 11、其他金融机构 12、境内非金融机构 13、境外金融机构 14、境外非金融机构 15、商业银行子公司 16	
10	NFICode	非金融机构行业代码	C (20)	否		校验规则: 交易对手方类型为非金融机构时必须填;
11	CounterpartyRegdCptl	交易对手方注册资本(万元)	N (36, 2)	否		校验规则: 必须两位小数以内;
12	MasterAgrmtRemark	主协议备注	C (1024)	否		交易对手是否为国有或国有控股企

						业, 及其他需要说明事项;
13	MasterAgrmtAtt	主协议附件	A	是		校验规则: 只支持 PDF 格式;
14	CounterpartyInformationTuple	填报方业务代表明细	T			字段信息详见主协议【填报方业务代表明细】
15	CounterpartyIdentity	交易对手方身份	C (2)	是	产品管理人 1、自营 2	

主协议【填报方业务代表明细】

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	Name	填报方业务代姓名	C (200)	是		
2	Title	职务	C (200)	否		
3	Telephone	电话	C (200)	否		
4	Mobile	手机	C (11)	否		校验规则: 手机号;
5	Email	邮箱	C (200)	否		

3.2.2 主协议关联产品列表

包含在标签<MasterAgrmtProduct>内

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	MasterAgrmtNo	主协议编号 (双方约定)	C (100)	是		双方约定;
2	ProductNo	代签产品编号	C (32)	否		校验规则: 补正时必填;
3	ProductName	产品名称	C (100)	是		校验规则: 1、

						主协议交易对手方身份为产品管理人必填; 2、主协议交易对手方身份为自营禁止填值;
4	ManagerName	产品投资经理姓名	C (100)	是		校验规则: 1、主协议交易对手方身份为产品管理人必填; 2、主协议交易对手方身份为自营禁止填值;
5	InvestmentManagerContactNumber	投资经理联系电话	C (20)	是		校验规则: 1、主协议交易对手方身份为产品管理人必填; 2、主协议交易对手方身份为自营禁止填值;
6	TrusteeAgency	托管机构(如有)	C (200)	否		校验规则: 1、主协议交易对手方身份为自营禁止填值;
7	TheDateTable	入表日期	C (10)	是		校验规则: 1、必须是

					YYYY-MM-DD; 2、主协议交易对手方身份为产品管理人必填; 3、主协议交易对手方身份为自营禁止填值;
8	SuchProducts	代签产品附件	A	是	校验规则: 1、只支持PDF格式; 2、主协议交易对手方身份为产品管理人必填; 3、主协议交易对手方身份为自营禁止填值;

3.2.3 补充协议

包含在标签<SupAgrmt>内

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	MasterAgrmtNo	主协议编号 (双方约定)	C (100)	是		双方约定;
2	SupAgrmtID	补充议编号	C (32)	否		校验规则: 补正时必填;
3	SupAgrmtNo	补充协议编号 (双方约定)	C (100)	是		双方约定。

4	SupAgrmtType	补充协议类型	C (2)	是	首次 0、 变更 1	
5	SigningDate	签署时间	C (10)	是		校验规则： 必须是 YYYY-MM- DD;
6	SupAgrmtRemark	补充协议备注	C (1024)	否		上述所有字 段未能包含 的信息。
7	SupAgrmtAttTuple	补充协议附件	T	是		字段信息详 见补充协议 【补充协议 附件】

补充协议附件

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	SupAgrmtAtt	补充协议附件	A	是		校验规则： 只支持 PDF 格式；

3.2.4 履约保证书

包含在标签<PerformanceGuaranteeAgrmt>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	MasterAgrmtNo	主协议编号 (双方约定)	C (100)	是		
2	SupAgrmtNo	补充协议编号 (双方约定)	C (100)	是		
3	PerformanceGuaranteeAgrmtID	履约担保协议 编号	C(32)	否		校验规 则：补正 时必填；
4	PerformanceGuaranteeAgrmt	履约担保协议 (附件)	A	是		校验规 则：只支 持 PDF 格 式；

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
1	MasterAgrmtNo	主协议编号 (双方约定)	C(100)	是		双方约定;
2	SupAgrmtNo	补充协议编号 (双方约定)	C(100)	是		双方约定;
3	ConfirmationID	交易确认书编号	C(32)	否		校验规则: 补正时必须填;
4	ConfirmationNo	交易确认书编号 (双方约定)	C(100)	是		双方约定;
5	ConfirmationType	交易确认书类型	C(2)	是	首次 0、变更 1	校验规则: 首次提交时填0, 补正时填1
6	FillParty	填报方角色	C(2)	是	甲方 0、乙方 1	
7	OptionSeller	期权卖方	C(2)	是	填报方 01、交易对手方 02	
8	OptionDirection	期权方向	C(2)	是	看涨 0、看跌 1、双向 2	
9	OptionStructureType	期权结构类型	C(2)	是	香草 0、二元 1、价差 2、鲨鱼鳍 4、障碍	

					5、区间累计 6、自动看涨 (Auto Callable) 7、其他 99	
10	OptionStructure	期权结构	C(2000)	否		校验规则：“期权结构类型”选择为其他时，为必填；
11	ExerciseApproach	行权方式	C(2)	是	欧式 0、美式 1、百慕大 2、亚式 3	
12	StartDate	起始日	C(10)	是		交易条款开始执行的日期。校验规则：1、起始日不能大于到期日日期；2、必须是YYYY-MM-DD；
13	DueDate	到期日	C(10)	是		指定交易结束的日期。校验规则：1、到期日不能小于起始日日期；2、必须是

						YYYY-MM-DD; 3、补正时, 如果该交易还有未被废除的存续期记录(包括展期、终止数据), 到期日字段不能修改;
14	SettlementDate	结算日	C(10)	否		指定的进行结算金额收付的日期。校验规则: 必须是YYYY-MM-DD;
15	OptionPremium	期权费(非年化)%	C(6)	是		校验规则: 1、数值处于0至100之间且最多两位小数; 2、百分比处于0至100之间整数带%;
16	Currency	结算货币	C(2)	是	CNY 0、USD 1、	使用货币通用代码

					EUR 2、 HKD 3、 GBP 4	(大 写)
17	NotinalPrincipleAmt	名义本金 额 (人民 币)	N(36, 2)	是		控件提示: 单 位元, 小数点 后保留 两位。 校验规 则: 1、 必须两 位小 数; 2、 补正 时, 如 果该交 易还有 未被废 除的存 续期记 录 (包 括展 期、终 止数 据), 名义本 金额 (人民 币) 字 段不能 修改;
18	ClearingAgency	清算机构	C(2)	是	甲方 0、乙 方 1、报价 系统 3、中 债登 4、上 清所 5、其 他 99	
19	TradingPlace	交易场所	C(2)	是	柜台市场 0、报价系 统 1、银行 间市场 2、	

					其他交易场所 99	
20	BusinessModelType	业务模式类型	C(2)	是	传统型期权 1	
21	ConfirmationAttTuple	交易确认书附件	T		支持多附件	字段信息详见期权交易确认书【交易确认书附件】 校验规则：新增、补正时只能上传单附件，如果多个提示报送失败。
22	ConfirmationRemark	备注	C(1024)	否		填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息。
23	UndrlygAssetType	标的类型	C(2)	是	权益类 0、 大宗商品 1、利率 2、信用类 3、汇率 4、其他 99	
24	UndrlygAssetNo	标的个数	C(2)	是	单一标的 0、组合标的 1	
25	ProfitCalculationInfo	期权收益计算说明	C(1024)	是		
26	ProfitRemark	备注	C(1024)	否		填写上述字段或交易确认书

						中不能包含的信息。
27	UndrlygAssetTuple	标的详情	T		数组结构,支持新增多条	字段信息详见期权交易确认书【标的详情】
28	PerformanceGuaranteeType	履约担保类型	C(2)	是	否 0、部分担保 1、全额担保 2	
29	PerformanceCollProvider	履约担保品提供方	C(2)	否	甲方 0、乙方 1、第三方(需在履约担保备注中说明第三方相关情况) 2、交易双方 3	校验规则:当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必填;
30	PartyUseColl	担保品收取方是否可使用担保品	C(5)	否	是 true、否 false	校验规则:当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必填;
31	CollInstruction	担保品使用说明	C(1024)	否		校验规则:当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必填;
32	CalculateCollInterest	是否计算担保品价值产生利息	C(5)	否	是 true、否 false	校验规则:当履约保障类型

						选择部分担保或全额担保时必填;
33	PerformanceCollInitialRatio	履约担保品初始比率 (%)	N(5, 2)	否		校验规则: 1、当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必填; 2、请输入0到100之间的最多2位小数的数字。;
34	PerformanceCollAddtlRatio	履约担保品追保比率 (%)	N(5, 2)	否		校验规则: 1、当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必填; 2、请输入0到100之间的最多2位小数的数字。;
35	PerformanceCollOffsetRatio	履约担保品平仓比率 (%)	N(5, 2)	否		校验规则: 1、当履约

						保障类型选择部分担保或全额担保时必填; 2、请输入0到100之间的最多2位小数的数字。 备注: 强行平仓时比率
36	PerformanceGuaranteeRemark	备注	C(1024)	否		填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息
37	PerformanceGuaranteeAtt	履约保障书附件附件	A	否		校验规则: 只支持PDF格式;
38	PerformanceCollTuple	履约担保品详情	T		数组结构, 支持新增多条	字段信息详见期权交易确认书【履约担保品详情】
39	Remark	备注	C(1024)	否		填写上述字段或交易确认书中不能包含的

						信息填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息
40	ValidNotinalPrincipleAmt	有效名义本金 (人民币)	N(36, 2)	否		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;
41	ComplianceOpinion	合规意见书	A	否		校验规则: 只支持PDF格式;
42	ExercisePriceoNne	行权价格 1	N(36, 2)	否		校验规则: 保留两位小数;
43	ExercisePriceoTwo	行权价格 2	N(36, 2)	否		校验规则: 保留两位小数;
44	PtyAPdctName	甲方代签产品名称	C(200)	否		校验规则: 1、如甲方代签产品名称或甲方代签产

						品代码 填值， 则乙方 代签产 品名称 和乙方 代签产 品代码 禁止填 值；2、 甲方代 签产品 名称必 须在主 协议关 联产品 列表-产 品名称 中存在；
45	PtyAPdctCode	甲方代签 产品代码	C (20)	否		校验规 则：如 甲方代 签产品 名称或 甲方代 签产品 代码填 值，则 乙方代 签产品 名称和 乙方代 签产品 代码禁 止填 值；
46	PtyBPdctName	乙方代签 产品名称	C(200)	否		校验规 则：1、 如乙方 代签产 品名称 或乙方 代签产

						品代码 填值, 则甲方 代签产 品名称 和甲方 代签产 品代码 禁止填 值; 2、 乙方代 签产品 名称必 须在主 协议关 联产品 列表-产 品名称 中存在;
47	PytBPdctCode	乙方代签 产品代码	C (20)	否		校验规 则: 如 乙方代 签产品 名称或 乙方代 签产品 代码填 值, 则 甲方代 签产品 名称和 甲方代 签产品 代码禁 止填 值;

1、期权交易确认书【标的详情】

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	UndrlygAssetDtldType	标的小类	C (2)	是	股票 0、股指 1、新三板挂牌股票 2、香港股票 3、香港股指 4、基金及基金专户 5、债券 6、黄金期货 7、国债期货 8、股指期货 9、其他期货 10、黄金现货 11、其他现货 12、境外期货 13、境外现货 14、境外股票 15、境外股指 16、汇率 17、Shibor 18、银行间回购定盘(Fixing Repo Rate) 19、其他利率 20、其他标的 99
2	UndrlygAssetName	挂钩标的名称	C (200)	是	
3	UndrlygAssetTradgPlc	标的交易场所	C (2)	是	上海证券交易所 01、深圳证券交易所 02、新三板 03、上海期货交易所 04、大连商品交易所 05、郑州商品期货交易所 06、中国金融期货交易所 07、外汇交易中心 08、上海黄金交易所 09、香港联合交易所 10、境外交易所 11、其他(注明具体场所) 99
4	UndrlygAssetCode	标的代码	C (32)	是	
5	UndrlygAssetAmt	标的数量	N(36,2)	否	校验规则: 必须两位小数以内;

2、期权交易确认书【履约担保品详情】

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	PerformanceCollType	履约担保品类型	C (2)	否	现金 0、担保证券 1、其他（需在履约担保备注栏进行说明） 99	
2	PerformanceCollRange	担保品担保范围	C (2)	否	仅本笔交易 0、本笔交易对应主协议框架下的所有交易（在附件中上传履约担保协议） 1、其他情况下多笔交易（在附件中上传履约担保协议） 2	
3	MultiConfirmationID	多笔担保交易确认书编号	C (1024)	否		

3、交易确认书附件

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	ConfirmationAtt	交易确认书附件	A	是		校验规则： 只支持 PDF 格式；

3.2.5.2 互换交易确认书

包含在标签<SwapConfirmation>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	MasterAgrmtNo	主协议编号	C (100)	是		双方约定；

		(双方约定)				
2	SupAgrmtNo	补充协议编号 (双方约定)	C (100)	是		双方约定;
3	ConfirmationID	交易确认书编号	C (32)	否		校验规则: 补正时必须填;
4	ConfirmationNo	交易确认书编号 (双方约定)	C (100)	是		双方约定;
5	ConfirmationType	交易确认书类型	C (2)	是	首次 0、 变更 1	校验规则: 首次提交时填 0, 补正时填 1
6	FillParty	填报方角色	C (2)	是	甲方 0、 乙方 1	
7	PtyAPaymentMethod	甲方支付现金流方式	C (2)	是	权益收益(多方) 0、 权益收益(空方) 1、 浮动利率收益 2、 固定利率收益 3	
8	PtyBPaymentMethod	乙方支付现金流方式	C (2)	是	权益收益(多方) 0、 权益收益(空方) 1、 浮动利率	

					收益 2、 固定利率 收益 3	
9	PtyAPaymentFreq	甲方 支付 频率	C (2)	是	期初支付 0、期末 支付 1、 期间多次 支付 2	
10	PtyBPaymentFreq	乙方 支付 频率	C (2)	是	期初支付 0、期末 支付 1、 期间多次 支付 2	
11	StartDate	起始 日	C(10)	是		校验规则： 1、起始日不 能大于到期 日日期；2、 必须是 YYYY-MM- DD；
12	DueDate	到期 日	C(10)	是		指定的进行 结算金额收 付的日期。 校验规则： 1、到期日不 能小于起始 日日期；2、 必须是 YYYY-MM- DD；3、补正 时，如果该 交易还有未 被废除的存 续期记录 (包括展 期、终止数 据)，到期 日字段不能 修改；
13	SettlementDate	结算 日	C(10)	否		校验规则： 必须是 YYYY-MM- DD；

14	Currency	结算货币	C(2)	是	CNY 0、 USD 1、 EUR 2、 HKD 3、 GBP 4	使用货币通用代码(大写)
15	NotinalPrincipleAmt	名义本金额(人民币)	N(36,2)	是		校验规则: 1、必须两位小数以内; 2、补正时,如果该交易还有未被废除的存续期记录(包括展期、终止数据),名义本金额(人民币)字段不能修改;
16	ClearingAgency	清算机构	C(2)	是	甲方 0、 乙方 1、 报价系统 3、中债登 4、上清所 5、 其他 99	
17	TradingPlace	交易场所	C(2)	是	柜台市场 0、 报价系统 1、 银行间市场 2、 其他交易场所 99	
18	UndrlygAssetType	标的类型	C(2)	是	权益类 0、 大宗商品 1、 利率 2、 信用类 3、 汇率 4、 其他 99	
19	ConfirmationRemark	基本信息备注	C(1024)	否		填写上述字段或交易确

						认书中不能包含的信息
20	PtyAtoPtyB	甲方支付 乙方	T			字段信息详见互换交易确认书【甲方支付乙方权益收益】
21	PtyBtoPtyA	乙方支付 甲方	T			字段信息详见互换交易确认书【乙方支付甲方权益收益】
22	PerformanceGuaranteeType	履约担保类型	C(2)	是	无履约担保 0、部分担保 1、全额担保 2	
23	PerformanceCollProvider	履约担保品提供方	C(2)	否	甲方 0、乙方 1、第三方（需在履约担保备注中说明第三方情况） 2、交易双方 3	检验规则：履约担保类型为部分担保，全额担保时必须填；
24	PartyUseColl	担保品收取方是否可使用担保品	C(5)	否	是 true、否 false	检验规则：履约担保类型为部分担保，全额担保时必须填；
25	CollInstruction	担保品使用说明	C(1024)	否		检验规则：履约担保类型为部分担保，全额担保时必须填；
26	CalculateCollInterest	是否计算担保品价值产	C(5)	否	是 true、否 false	检验规则：履约担保类型为部分担保，全额担保时必须填；

		生利息				
27	PerformanceCollInitialRatio	履约担保品初始比率 (%)	N(5, 2)	否		校验规则: 1、当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必须填; 2、请输入 0 到 100 之间的最多 2 位小数的数字。
28	PerformanceCollAddtlRatio	履约担保品追加比率 (%)	N(5, 2)	否		校验规则: 1、当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必须填; 2、请输入 0 到 100 之间的最多 2 位小数的数字。
29	PerformanceCollOffsetRatio	履约担保品平仓比率 (%)	N(5, 2)	否		校验规则: 1、当履约保障类型选择部分担保或全额担保时必须填; 2、请输入 0 到 100 之间的最多 2 位小数的数字。
30	PerformanceGuaranteeAtt	履约担保附件	A	否		校验规则: 只支持 PDF 格式;
31	PerformanceGuaranteeRemark	履约担保备注	C(1024)	否		填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息

32	PerformanceCollTuple	履约担保品	T		数组结构, 支持新增多条	字段信息详见互换交易确认书【履约担保品】
33	Remark	备注	C(1024)	否		上述所有字段没有涵盖且需要说明的信息
34	ConfirmationAttTuple	交易确认书附件	T		支持多附件	字段信息详见互换交易确认书【交易确认书附件】 校验规则: 新增、补正时只能上传单附件, 如果多个提示报送失败。
35	ComplianceOpinion	合规意见书	A	否		校验规则: 只支持 PDF 格式;
36	PtyAUndrlygAssetNo	标的个数	C(2)	是	单一标的 0、多标的 1	甲方支付乙方, 多标的时, 权益收益、浮动利率收益、固定利率收益信息需新增多个
37	PtyAProfitCalculationInfo	收益计算说明	C(1024)	是		甲方支付乙方, 详细说明收益计算方式
38	PtyAProfitRemark	收益备注	C(1024)	否		甲方支付乙方, 填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息
39	PtyBUndrlygAssetNo	标的个数	C(2)	否	单一标的 0、多标的 1	乙方支付甲方, 多标的时, 权益收益、浮动利

						率收益、固定利率收益信息需新增多个
40	PtyBProfitCalculationInfo	收益计算说明	C(1024)	否		乙方支付甲方, 详细说明收益计算方式
41	PtyBProfitRemark	收益备注	C(1024)	否		乙方支付甲方, 填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息
42	ReferenceARateBTuple	浮动利率收益	T		数组结构, 支持新增多条	字段信息详见【甲方支付乙方浮动利率收益】
43	ReferenceBRateBTuple	浮动利率收益	T		数组结构, 支持新增多条	字段信息详见【乙方支付甲方浮动利率收益】
44	FixedARateReturnBTuple	固定利率收益	T		数组结构, 支持新增多条	字段信息详见【甲方支付乙方固定利率收益】
45	FixedBRateReturnBTuple	固定利率收益	T		数组结构, 支持新增多条	字段信息详见【乙方支付甲方固定利率收益】
46	PtyAPdctName	甲方代签产品名称	C(200)	否		校验规则: 1、如甲方代签产品名称或甲方代签产品代码填值, 则乙方代签产品名称和乙方代签产品代码禁止填值; 2、甲方代签产品名称必须在主协议关联产品列

						表-产品名称中存在;
47	PytAPdctCode	甲方代签产品代码	C (20)	否		校验规则: 如甲方代签产品名称或甲方代签产品代码填值, 则乙方代签产品名称和乙方代签产品代码禁止填值;
48	PtyBPdctName	乙方代签产品名称	C(200)	否		校验规则: 1、如乙方代签产品名称或乙方代签产品代码填值, 则甲方代签产品名称和甲方代签产品代码禁止填值; 2、乙方代签产品名称必须在主协议关联产品列表-产品名称中存在;
49	PytBPdctCode	乙方代签产品代码	C (20)	否		校验规则: 如乙方代签产品名称或乙方代签产品代码填值, 则甲方代签产品名称和甲方代签产品代码禁止填值;

(1) 甲方支付乙方权益收益

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	PtyAUndrlygAssetDtldType	标的小类	C(2)	否	股票 0、股指 1、新三板挂牌股票 2、香港股票 3、香港股指 4、基金及基金专户 5、债券 6、黄金期货 7、国债期货 8、股指期货 9、其他期货 10、黄金现货 11、其他现货 12、境外期货 13、境外现货 14、境外股票 15、境外股指 16、汇率 17、其他标的 99	校验规则：甲方支付现金流方式为权益收益时必填；
2	PtyAUndrlygAssetName	标的名称	C(200)	否		
3	PtyAUndrlygAssetTradgPlc	标的交易场所	C(20)	否		
4	PtyAUndrlygAssetCode	标的代码	C(32)	否		
5	PtyAUndrlygAssetInitialPrice	标的期初价格	N(36,2)	否	校验规则：必须两位小数以内；	
6	PtyAUndrlygAssetAmt	标的数量	N(36,2)	否	校验规则：必须两位小数以内；	

(2) 乙方支付甲方权益收益

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	PtyBUndrlygAssetDtldType	标的小类	C(2)	否	股票 0、股指 1、新三板挂牌股票 2、香港股票 3、香港股指 4、基金及基金专户 5、债券 6、黄金期货 7、国债期货 8、股指期货 9、其他期货 10、黄金现货 11、其他现货 12、境外期货 13、境外现货 14、境外股票 15、境外股指 16、汇率 17、其他标的 99	校验规则：当乙方支付现金流方式为权益收益时必填；
2	PtyBUndrlygAssetName	标的名称	C(200)	否		
3	PtyBUndrlygAssetTradgPlc	标的交易场所	C(20)	否		
4	PtyBUndrlygAssetCode	标的代码	C(32)	否		
5	PtyBUndrlygAssetInitialPrice	标的期初价格	N(36,2)	否	校验规则：必须两位小数以内；	
6	PtyBUndrlygAssetAmt	标的数量	N(36,2)	否	校验规则：必须两位小数以内；	

(3) 甲方支付乙方浮动利率收益

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	PtyARefRateType	参考利率类型	C(2)	否	Shibor3M 0、FR007 1、Shibor0N 2、人民币一年定期存款利率 3、其他 99	校验规则：当甲方支付现金流方式为浮动利率收益时必填；
2	PtyARefRateName	参考利率名称	C(200)	否		校验规则：当甲

						方支付现金流方式为浮动利率收益时时必填;
--	--	--	--	--	--	----------------------

(4) 乙方支付甲方浮动利率收益

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	PtyBRefRateType	参考利率类型	C(2)	否	Shibor3M 0、FR007 1、ShiborON 2、人民币一年定期存款利率 3、其他 99	校验规则：当乙方支付现金流方式为浮动利率收益时时必填;
2	PtyBRefRateName	参考利率名称	C(200)	否		校验规则：当乙方支付现金流方式为浮动利率收益时时必填;

(5) 甲方支付乙方固定利率收益

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	PtyAAgreedInterestRate	约定利率 (%)	N(36,2)	否		校验规则： 1. 甲方支付现金流方式为固定利率收益时必须填； 2. 必须两位小数；

(6) 乙方支付甲方固定利率收益

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	PtyBAgreedInterestRate	约定利率 (%)	N(36,2)	否		校验规则： 1. 乙方支付现金流方式为固定利率收益时必须填； 2. 必须两位小数；

(7) 履约担保品

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	PerformanceCollType	履约担保品类型	C(2)	否	现金 0、证券 1、其他（需在履约担保备注栏进行说明） 99	
2	PerformanceCollRange	担保品担保范围	C(2)	否	仅本笔交易 0、本笔交易对应主协议框架下的所有交易（在附件中上传履约担保协议） 1、其他情况下多笔交易（在附件中上传履约担保协议） 2	
3	MultiConfirmationID	多笔担保交易确认书编号	C(1024)	否		

(8) 交易确认书附件

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	ConfirmationAtt	交易确认书附件	A	是	校验规则： 只支持 PDF 格式；
---	-----------------	---------	---	---	-------------------------

3.2.6 交易终止协议

3.2.6.1 期权交易存续期管理

包含在标签<OptionTermination>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	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则：补正时必须填；
2	ConfirmationNo	交易确认书编号 (双方约定)	C(100)	是		双方约定；
3	ExpirationDate	终止日期	C(10)	否		校验规则：1、当存续期操作类型，选择终止、违约终止时必须填；2、必须是YYYY-MM-DD；3、不存在展期数据：不得等于晚于原合约到期日；4、存在展期数据：不得等于晚于最新展期日；5、新

						增终止： 一个日期 只能存在 一条终止 数据；
4	DefaultingParty	违约方	C(2)	否	填报方 01、对手 方 02	校验规 则：存续 期操作类 型为违约 终止时必 填；
5	DefaultEvent	违约事件说明	C(1024)	否		校验规 则：存续 期操作类 型为违约 终止时必 填；
6	RenewalDate	展期日期	C(10)	否		校验规 则：1、存 续期操作 类型为展 期时必 填；2、必 须是 YYYY-MM- DD；3、不 存在展期 数据：不 得早于等 于原合约 到期日； 4、存在展 期数据： 不得早于 等于最新 展期日 期；5、新 增终止： 一个日期 只能存在 一条终止 数据；
7	DurationOperationType	存续期操作类型	C(2)	是	01 展 期, 02 终	

					止, 03 违 约终止	
8	TerminationAmount	本次终止金额	N(36, 2)	否		校验规则: 1、当存续期操作类型, 选择终止、违约终止时必填; 2、保留两位小数; 3、选展期时, 该字段不能填, 否则报送失败。 4.大于0且小于等于上次余额;
9	Balance	余额	N(36, 2)	是		校验规则: 1、保留两位小数; 2、值等于该交易上次余额-本次终止金额;
10	AmountPaidThisTime	本次支付金额	N(36, 2)	否		校验规则: 1、当存续期操作类型, 选择终止、违约终止时必填; 2、保留两位小数; ; 3、选展期时, 该字段不能填, 否则报送失败

3.2.6.2 互换交易存续期管理

包含在标签<SwapTermination>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	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则：补正时必填；
2	ConfirmationNo	交易确认书编号 (双方约定)	C(100)	是		双方约定；
3	ExpirationDate	终止日期	C(10)	否		校验规则：1、当存续期操作类型，选择终止、违约终止时必填；2、必须是YYYY-MM-DD；3、不存在展期数据：不得等于晚于原合约到期日；4、存在展期数据：不得等于晚于最新展期日期；5、新增终止：一个日期只能存在一条终止数据；
4	DefaultingParty	违约方	C(2)	否	填报方 01、对手方 02	校验规则：存续期操作类

						型为违约终止时必填;
5	DefaultEvent	违约事件说明	C(1024)	否		校验规则: 存续期操作类型为违约终止时必填;
6	RenewalDate	展期日期	C(10)	否		校验规则: 1、存续期操作类型为展期时必填; 2、必须是YYYY-MM-DD; 3、不存在展期数据: 不得早于等于原合约到期日; 4、存在展期数据: 不得早于等于最新展期日期; 5、新增终止: 一个日期只能存在一条终止数据;
7	DurationOperationType	存续期操作类型	C(2)	是	01 展期, 02 终止, 03 违约终止	
8	TerminationAmount	本次终止金额	N(36, 2)	否		校验规则: 1、当存续期操作类型, 选择终止、违约

						终止时必须填; 2、保留两位小数; 3、当存续期操作类型, 选择展期时, 该字段必不填; 4、大于0且小于等于上次余额;
9	Balance	余额	N(36, 2)	是		校验规则: 1、保留两位小数; 2、值等于该交易上次余额-本次终止金额;
10	AmountPaidThisTime	本次支付金额	N(36, 2)	否		校验规则: 1、当存续期操作类型, 选择终止、违约终止时必须填; 2、保留两位小数; 3、当存续期操作类型, 选择展期时, 该字段必不填;

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
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	Month	月份	N(2)	是		校验规则: 必须是 1-12 之间的整数;
4	MainAgreementAddedThisMonth	主协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
5	MainAgreementAccumulatedThisYear	主协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
6	MainAgreementValidatedAtEndOfThisMonth	主协议截至月末存续协议数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
7	SupplementalAgreementAddedThisMonth	补充协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
8	SupplementalAgreementAccumulatedThisYear	补充协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
9	SupplementalAgreementValidatedAtTheEndOfThisMonth	补充协议截至月末存续协议数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
10	PerformanceGuaranteeAgreementAddedThisMonth	履约担保协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;

11	PerformanceGuaranteeAgreementAccumulatedThisYear	履约担保协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
12	PerformanceGuaranteeAgreementValidatedAtEndOfThisMonth	履约担保协议截至月末存续协议数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
13	TransactionConfirmationAddedThisMonth	交易确认书本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
14	TransactionConfirmationBookAccumulatedThisYear	交易确认书本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
15	TransactionConfirmationValidatedAtEndOfThisMonth	交易确认书截至月末存续协议数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
16	ToCarryOutSelfEquitySecuritiesAndOTCDerivativesScaleStockOptionBusinessCorrespondence	开展场外个股期权业务对应的自营权益类证券及衍生品规模 (元)	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
17	NetCapitalAtEndOfTheMonth	本月末净资本 (元)	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
18	ToCarryOutSelfEquitySecuritiesAndOTCDerivativesScaleStockOptionsBusinessAccountedForTheProportionOfTheCorrespondingNetCapital	开展场外个股期权业务对应的自营权益类证券及衍生品规模占净资本比例 (%)	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
19	OTCOptionHasSignedByLegalPerson	场外期权已签约法人 (家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;

20	OTCOptionsHaveContractedProducts	场外期权已签约产品(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
21	OTCOptionsForTheMonthOfTheNewAddLegalPerson	场外期权当月新增法人(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
22	OTCOptionsForTheMonthOfTheNewAddProduct	场外期权当月新增产品(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
23	OTCOptionsLegalPersonInDurationForThisMonth	场外期权当月末存续法人(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
24	OTCOptionsProductsInDurationForThisMonth	场外期权当月末存续产品(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
25	IncomeSwapHasSignedLegalPersonNumber	收益互换已签约法人(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
26	IncomeSwapHasSignedProductNumber	收益互换已签约产品(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
27	IncomeSwapForTheMonthOfTheNewAddLegalPerson	收益互换当月新增法人(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
28	IncomeSwapForTheMonthOfTheNewAddProduct	收益互换当月新增产品(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
29	IncomeSwapLegalPersonInDurationForThisMonth	收益互换当月末存续法人(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
30	IncomeSwapProductsInDurationForThisMonth	收益互换当月末存续产品(家)	N (20)	是		校验规则: 正整数;
31	OTCStockIndexOptionsWithinTheLastMonthTheExistenceOfScale	场外期权境内股指上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;

32	OTCOptionsWithinIndividualStocksLastMonthDurationScale	场外期权境内个股上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
33	OTCOptionsCommoditiesLastMonthDurationScale	场外期权大宗商品上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
34	OTCOptionsOtherSubjectLastMonthDurationScale	场外期权其他标的上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
35	RevenueExchangeDomesticStockIndexLastMonthDurationScale	收益互换境内股指上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
36	RevenueExchangeDomesticIndividualStocksLastMonthDurationScale	收益互换境内个股上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
37	RevenueExchangeCommoditiesLastMonthDurationScale	收益互换大宗商品上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
38	RevenueExchangeOtherSubjectLastMonthDurationScale	收益互换其他标的上月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
39	TotalOfLastMonthDurationScale	上月末存续规模合计	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
40	OTCOptionsWithinTheIndexThisMonthOfTheNewScale	场外期权境内股指本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
41	OTCOptionsToAddScaleDomesticStocksInThisMonth	场外期权境内个股本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；

42	OTCOptionsCommoditiesTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	场外期权大宗商品本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
43	OTCOptionsOtherSubjectTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	场外期权其他标的本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
44	RevenueExchangeDomesticStockIndexTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	收益互换境内股指本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
45	RevenueExchangeDomesticIndividualStocksTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	收益互换境内个股本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
46	RevenueExchangeCommoditiesTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	收益互换大宗商品本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
47	RevenueExchangeOtherSubjectTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	收益互换其他标的本月新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
48	TotalOfTheNewSizeOfTheIncreaseInThisMonth	本月新增规模合计	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
49	OTCOptionsTerminateScaleDomesticStockIndexThisMonth	场外期权境内股指本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
50	OTCOptionsTerminateScaleDomesticStocksInThisMonth	场外期权境内个股本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；

51	OTCOptionsCommoditiesTerminationOfTheScaleOfThisMonth	场外期权大宗商品本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
52	OTCOptionsOtherSubjectTerminationOfTheScaleOfThisMonth	场外期权其他标的本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
53	RevenueExchangeDomesticStockIndexTerminationOfTheScaleOfThisMonth	收益互换境内股指本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
54	RevenueExchangeDomesticIndividualStocksTerminationOfTheScaleOfThisMonth	收益互换境内个股本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
55	RevenueExchangeCommoditiesTerminationOfTheScaleOfThisMonth	收益互换大宗商品本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
56	RevenueExchangeOtherSubjectTerminationOfTheScaleOfThisMonth	收益互换其他标的本月终止规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
57	TotalOfTerminationOfTheScaleOfThisMonth	本月终止规模合计	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
58	OTCStockIndexOptionsWithinThisMonthOfTheExistenceOfScale	场外期权境内股指本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
59	OTCOptionsWithinIndividualStocksInThisMonthDurationScale	场外期权境内个股本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;

60	OTCOptionsCommoditiesInThisMonthDurationScale	场外期权大宗商品本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
61	OTCOptionsOtherSubjectThisMonthDurationScale	场外期权其他标的本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
62	RevenueExchangeDomesticStockIndexThisMonthDurationScale	收益互换境内股指本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
63	RevenueExchangeDomesticIndividualStocksThisMonthDurationScale	收益互换境内个股本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
64	RevenueExchangeCommoditiesThisMonthDurationScale	收益互换大宗商品本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
65	RevenueExchangeOtherSubjectThisMonthDurationScale	收益互换其他标的本月末存续规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
66	TotalOfThisMonthDurationScale	本月末存续规模合计	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
67	OTCOptionsStockIndexThisYearCumulativeScaleOfNewTerritory	场外期权境内股指本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
68	OTCOptionsStockThisYearCumulativeScaleOfNewTerritory	场外期权境内个股本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
69	OTCOptionsCommoditiesThisYearCumulativeScaleOfNewTerritory	场外期权大宗商品本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；

70	OTCOptionsOtherSubjectThisYearCumulativeScaleOfNewTerritory	场外期权其他标的本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
71	IncomeSwapDomesticStockIndexHasAddedNewScaleInThisYear	收益互换境内股指本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
72	IncomeSwapDomesticStockHasAddedNewScaleInThisYear	收益互换境内个股本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
73	IncomeSwapCommoditiesIndexHasAddedNewScaleInThisYear	收益互换大宗商品本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
74	IncomeSwapOtherSubjectIndexHasAddedNewScaleInThisYear	收益互换其他标的本年累计新增规模	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
75	TotalNewScaleInThisYear	本年累计新增规模合计	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
76	OTCOptionsStockIndexAtTheEndOfLastMonth	场外期权境内股指上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
77	OTCOptionsStockAtTheEndOfLastMonth	场外期权境内个股上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
78	OTCOptionsCommoditiesAtTheEndOfLastMonth	场外期权大宗商品上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
79	OTCOptionsOtherSubjectAtTheEndOfLastMonth	场外期权其他标的上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

80	IncomeExchangeDomesticStockIndexNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfLastMonth	收益互换境内股指上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
81	IncomeExchangeDomesticStockNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfLastMonth	收益互换境内个股上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
82	IncomeExchangeCommoditiesNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfLastMonth	收益互换大宗商品上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
83	IncomeExchangeOtherSubjectNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfLastMonth	收益互换其他标的上月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
84	TotalNumberOfContractsAtTheEndOfLastMonth	上月末存续合约笔数规模合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
85	OTCOptionsStockIndexThisMonthNewDomesticContractNumber	场外期权境内股指本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
86	OTCOptionsStockThisMonthNewDomesticContractNumber	场外期权境内个股本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
87	OTCOptionsCommoditiesThisMonthNewDomesticContractNumber	场外期权大宗商品本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

88	OTCOptionsOtherSubjectThisMonthNewDomesticContractNumber	场外期权其他标的本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
89	IncomeSwapDomesticStockIndexNewContractInThisMonth	收益互换境内股指本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
90	IncomeSwapDomesticStockNewContractInThisMonth	收益互换境内个股本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
91	IncomeSwapCommoditiesNewContractInThisMonth	收益互换大宗商品本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
92	IncomeSwapOtherSubjectNewContractInThisMonth	收益互换其他标的本月新增合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
93	TotalNumberOfNewContractsInThisMonth	本月新增合约笔数规模合计	N (20)	是		校验规则：正整数；
94	OTCOptionsThisMonthToTerminateTheContractWithinTheTerritoryOfTheStockIndexNumber	场外期权境内股指本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
95	OTCOptionsThisMonthToTerminateTheContractWithinTheTerritoryOfTheStockNumber	场外期权境内个股本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；
96	OTCOptionsThisMonthToTerminateTheContractWithinTheTerritoryOfTheCommoditiesNumber	场外期权大宗商品本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则：正整数；

97	OTCOptionsThisMonthToTerminateTheContractWithinTheTerritoryOfTheOtherSubjectNumber	场外期权其他标的本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
98	IncomeSwapDomesticStockIndexTerminatesTheNumberOfContractsThisMonth	收益互换境内股指本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
99	IncomeSwapDomesticStockTerminatesTheNumberOfContractsThisMonth	收益互换境内个股本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
100	IncomeSwapCommoditiesTerminatesTheNumberOfContractsThisMonth	收益互换大宗商品本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
101	IncomeSwapOtherSubjectTerminatesTheNumberOfContractsThisMonth	收益互换其他标的本月终止合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
102	TotalNumberOfContractsTerminatedThisMonth	本月终止合约笔数规模合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
103	OTCDomesticStockIndexNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	场外期权境内股指本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
104	OTCDomesticStockNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	场外期权境内个股本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

105	OTCCommoditiesNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	场外期权大宗商品本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
106	OTCOtherSubjectNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	场外期权其他标的本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
107	IncomeExchangeDomesticStockIndexNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	收益互换境内股指本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
108	IncomeExchangeDomesticStockNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	收益互换境内个股本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
109	IncomeExchangeCommoditiesNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	收益互换大宗商品本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
110	IncomeExchangeOtherSubjectNumberOfRemainingContractsAtTheEndOfThisMonth	收益互换其他标的本月末存续合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
111	TotalNumberOfContractsAtTheEndOfThisMonth	本月末存续合约笔数规模合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
112	OTCOptionsStockIndexCumulativeDomesticNewContractNumberInThisYear	场外期权境内股指本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

113	OTCOptionsStockCumulativeDomesticNewContractNumberInThisYear	场外期权境内个股本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
114	OTCOptionsCommoditiesCumulativeDomesticNewContractNumberInThisYear	场外期权大宗商品本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
115	OTCOptionsOtherSubjectCumulativeDomesticNewContractNumberInThisYear	场外期权其他标的本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
116	IncomeSwapDomesticStockIndexCumulativeNumberOfNewContractsInThisYear	收益互换境内股指本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
117	IncomeSwapDomesticStockCumulativeNumberOfNewContractsInThisYear	收益互换境内个股本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
118	IncomeSwapCommoditiesCumulativeNumberOfNewContractsInThisYear	收益互换大宗商品本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
119	IncomeSwapOtherSubjectCumulativeNumberOfNewContractsInThisYear	收益互换其他标的本年累计新增合约笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
120	TotalNumberOfNewContractsInThisYear	本年累计新增合约笔数规模合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
121	TotalNominalPrincipalAmount	本月末互换存量名义本金总额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;

	tOfSwapThisMonth					
122	TotalNominalPrincipalAmountOfSwapLastMonth	上月末互换存量名义本金总额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
123	TheValueOfTheStockSwapInTheCorrespondingPerformanceGuaranteeThisMonth	本月末互换存量交易对应履约担保品价值	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
124	TheValueOfTheStockSwapInTheCorrespondingPerformanceGuaranteeLastMonth	上月末互换存量交易对应履约担保品价值	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
125	SwapCashCollateralValueThisMonth	本月末互换现金担保物价值	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
126	SwapCashCollateralValueLastMonth	上月末互换现金担保物价值	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
127	SwapSecuritiesCollateralValueThisMonth	本月末互换证券担保物价值	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
128	SwapSecuritiesCollateralValueLastMonthThisMonth	上月末互换证券担保物价值	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
129	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessThisMonthFull	本月末互换业务整体履约担保比例全额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
130	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessLastMonthFull	上月末互换业务整体履约担保比例全额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
131	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheS	本月末互换业务整体履	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;

	wapBusinessThisMonthNet	约担保比例净额				
132	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessLastMonthNet	上月末互换业务整体履约担保比例净额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
133	SwapNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthThisMonth	本月末互换本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
134	SwapNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthLastMonth	上月末互换本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
135	SwapDefaultTransactionNumberAtThisMonthThisMonth	本月末互换本月违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
136	SwapDefaultTransactionNumberAtThisMonthLastMonth	上月末互换本月违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
137	TotalSwapDefaultCustomerNumberInThisYearThisMonth	本月末互换本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
138	TotalSwapDefaultCustomerNumberInThisYearLastMonth	上月末互换本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
139	SwapNumberOfDefaultCustomersInThisYearThisMonth	本月末互换本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
140	SwapNumberOfDefaultCustomersInThisYearLastMonth	上月末互换本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
141	TotalNominalPrincipalAmountOfForwardThisMonth	本月末远期存量名义本金总额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;

142	TotalNominalPrincipalAmountOfForwardLastMonth	上月末远期存量名义本金总额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
143	TheValueOfTheStockForwardCorrespondingPerformanceGuaranteeThisMonth	本月末远期存量交易对应履约担保品价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
144	TheValueOfTheStockForwardCorrespondingPerformanceGuaranteeLastMonth	上月末远期存量交易对应履约担保品价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
145	ForwardCashCollateralValueThisMonth	本月末远期现金担保物价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
146	ForwardCashCollateralValueLastMonth	上月末远期现金担保物价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
147	ForwardSecuritiesCollateralValueThisMonth	本月末远期证券担保物价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
148	ForwardSecuritiesCollateralValueLastMonth	上月末远期证券担保物价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
149	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessThisMonthFull	本月末远期业务整体履约担保比例全额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
150	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessLastMonthFull	上月末远期业务整体履约担保比例全额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;

151	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessThisMonthNet	本月末远期业务整体履约担保比例净额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
152	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessLastMonthNet	上月末远期业务整体履约担保比例净额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
153	ForwardNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthThisMonth	本月末远期本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
154	ForwardNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthLastMonth	上月末远期本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
155	ForwardTransactionNumberAtThisMonthThisMonth	本月末远期本月交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
156	ForwardTransactionNumberAtThisMonthLastMonth	上月末远期本月交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
157	TotalForwardDefaultCustomerNumberInThisYearThisMonth	本月末远期本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
158	TotalForwardDefaultCustomerNumberInThisYearLastMonth	上月末远期本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
159	ForwardNumberOfDefaultCustomersInThisYearThisMonth	本月末远期本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
160	ForwardNumberOfDefaultCustomersInThisYearLastMonth	上月末远期本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

161	StockTradingCorrespondsToValueOfCollateralAtEndOfThisMonth	本月末存量交易对应履约担保品价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
162	StockTradingCorrespondsToValueOfCollateralAtEndOfLastMonth	上月末存量交易对应履约担保品价值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
163	CashBalanceAtEndOfThisMonth	本月末持有现金余额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
164	CashBalanceAtEndOfLastMonth	上月末持有现金余额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
165	HoldStockMarketValueAtEndOfThisMonth	本月末持有股票市值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
166	HoldStockMarketValueAtEndOfLastMonth	上月末持有股票市值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
167	HoldMarketValueOfBondsAtTheEndOfThisMonth	本月末持有债券市值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
168	HoldMarketValueOfBondsAtTheEndOfLastMonth	上月末持有债券市值	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
169	OwnedAssetManagementProductsAtTheEndOfThisMonth	本月末持有证券公司资产管理产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
170	OwnedAssetManagementProductsAtTheEndOfLastMonth	上月末持有证券公司资产管理产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
171	OwnedBankFinanceAtTheEndOfThisMonth	本月末持有银行理财	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
172	OwnedBankFinanceAtTheEndOfLastMonth	上月末持有银行理财	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;

173	HoldTrustProductAtTheEndOfThisMonth	本月末持有信托产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
174	HoldTrustProductAtTheEndOfLastMonth	上月末持有信托产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
175	InsuranceProductsAreHeldAtTheEndOfThisMonth	本月末持有保险产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
176	InsuranceProductsAreHeldAtTheEndOfLastMonth	上月末持有保险产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
177	HoldOtherProductsAtTheEndOfThisMonth	本月末持有其他产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
178	HoldOtherProductsAtTheEndOfLastMonth	上月末持有其他产品	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
179	SettledSwapItemsAtThisMonth	互换本月了结笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数, 长度介于 0 和 20 之间;
180	SettledSwapTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth	互换本月了结交易涉及名义本金	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
181	SwapIncomeCashFlow	互换收入现金流	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
182	SwapExpensesCashFlow	互换支出现金流	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
183	CashFlowCorrespondingToNetIncomeOnSwapMargin	互换使用保证金形成的净收益对应现金流	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
184	SwapHedgeCost	互换对冲成本	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
185	SettledOptionItemsAtThisMonth	期权本月了结笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数, 长度介于 0 和 20 之间;

186	SettledOptionTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth	期权本月了结交易涉及名义本金	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
187	OptionPremiumIncome	期权权利金收入	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
188	OptionHedgeCost	期权对冲成本	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
189	SettledForwardItemsAtThisMonth	远期本月了结笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
190	SettledForwardTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth	远期本月了结交易涉及名义本金	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
191	ForwardIncomeCashFlow	远期收入现金流	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
192	ForwardExpensesCashFlow	远期支出现金流	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
193	ForwardHedgeCost	远期对冲成本	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
194	BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisMonth	互换已实现损益本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
195	BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisMonth	期权已实现损益本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
196	BalanceOfForwardRealizedGainsAndLossesAtThisMonth	远期已实现损益本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
197	BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisYear	互换已实现损益本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;

198	BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisYear	期权已实现损益本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
199	BalanceOfForwardRealizedGainsAndLossesAtThisYear	远期已实现损益本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
200	BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth	互换公允价值变动损益本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
201	BalanceOfOptionChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth	期权公允价值变动损益本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
202	BalanceOfForwardChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth	远期公允价值变动损益本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
203	BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear	互换公允价值变动损益本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
204	BalanceOfOptionChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear	期权公允价值变动损益本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
205	BalanceOfForwardChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear	远期公允价值变动损益本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；
206	BalanceOfSwapTotalGainsAndLossesAtThisMonth	互换损益合计本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则：保留两位小数；

207	BalanceOfOptionTotalGainsAndLossesAtThisMonth	期权损益合计本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
208	BalanceOfForwardTotalGainsAndLossesAtThisMonth	远期损益合计本月发生额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
209	BalanceOfSwapTotalGainsAndLossesAtThisYear	互换损益合计本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
210	BalanceOfOptionTotalGainsAndLossesAtThisYear	期权损益合计本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
211	BalanceOfForwardTotalGainsAndLossesAtThisYear	远期损益合计本年累计额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
212	IncreaseBusinessDetailsThisMonthTuple	本月新增业务明细	T			字段信息详见本月新增业务明细
213	InventoryBusinessDetailsAtTheEndOfThisMonth	本月末存量业务明细	T			字段信息详见本月末存量业务明细
214	TargetCaseAndHedgeTuple	标的情况与对冲	T			字段信息详见标的情况与对冲

(1) 本月新增业务明细

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	SecurityCompany	证券公司名称	C (100)	否		
2	CounterpartyName	交易对手名称	C (100)	否		
3	CounterpartyProductName	交易对手产品名称	C (100)	否		

4	TransactionConfirmationNumber	交易确认书编号双方约定)	C (100)	否		
5	TradeConfirmationsType	交易确认书类型	C (2)	否	首次 01、变更 02	
6	BusinessType	业务类型	C (2)	否	互换 01、期权 02、远期 03	校验规则: 选择“期权”时, “期权费(非年化), 期权标的小类(场外期权填写), 期权类型”三项必填, 选择“互换”时, “收益互换标的小类(收益互换填写)”必填;
7	NotionalPrincipalAmount	名义本金金额(亿元)	N (19, 4)	否		校验规则: 保留4位小数, 同时总的字符长度不能超过20, 即整数位最多可为15位;
8	TotalAmountOfNominalPrincipalAmount	有效名义本金	N (19, 4)	否		校验规则: 保留4位小数, 同时总的字符长度不能超过20, 即整数位最多可为15位;
9	StartingDay	起始日(T日)	C (10)	否		校验规则: 必须是YYYY-MM-DD; 起始日不能大于到期日
10	DueDate	到期日	C (10)	否		校验规则: 必须是YYYY-MM-DD; 到期日不能小于起始日
11	InvestmentTargetType	标的类型	C (2)	否	权益类 01、大宗商品 02、利率 03、信用类 04、汇率 05、其他 99	
12	OptionObjectSecondClass	期权标的小类(场)	C (2)	否	股票 01、股指 02、新三板挂牌	校验规则: 如业务类型为期

		外期权填写)			股票 03、香港股票 04、香港股指 05、基金及基金专户 06、债券 07、黄金期货 08、国债期货 09、股指期货 10、其他期货 11、黄金现货 12、其他现货 13、境外期货 14、境外现货 15、境外股票 16、境外股指 17、汇率 18、Shibor 19、银行间回购定盘 (Fixing Repo Rate) 20、其他利率 21、其他标的 99	权, 需填写本字段;
1 3	ReturnSwapObject SecondClass	收益互换标的小类 (收益互换填写)	C (2)	否	股票 01、股指 02、新三板挂牌股票 03、香港股票 04、香港股指 05、基金及基金专户 06、债券 07、黄金期货 08、国债期货 09、股指期货 10、其他期货 11、黄金现货 12、其他现货 13、境外期货 14、境外现货 15、境外股票 16、境外股指 17、汇率 18、其他标的 99	校验规则: 如业务类型为互换, 需填写本字段;
1 4	NonAnnualOptionFee	期权费 (非年	N (5, 2)	否		校验规则: 1、如业务类型为期权, 需填写

		化) (%)				本字段, 该字段为期权费占名义本金的百分比; 2、数值处于 0 至 100 之间, 保留两位小数;
1 5	OptionType	期权类型 (期权填写)	C (2)	否	香草 01、障碍 02、二元 03、区间累计 04、价差 05、单鲨 06、双鲨 07、其他 08	校验规则: 如业务类型为期权, 需填写本字段;

(2) 本月末存量业务明细

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	NameOfSecuritiesCompany	证券公司名称	C (100)	否		
2	CounterpartyName	交易对手名称	C (100)	否		
3	CounterpartyProductName	交易对手产品名称	C (100)	否		
4	TransactionConfirmationNumber	交易确认书编号 (双方约定)	C (100)	否		
5	TypeOfTransactionConfirmation	交易确认书类型	C (2)	否	首次 01、变更 02	
6	BusinessType	业务类型	C (2)	否	互换 01、期权 02、远期 03	校验规则: 选择“期权”时, “期权费(非年化), 期权标的小类(场外期权填写), 期权类型”三项必填, 选择“互换”时, “收益互换标的小类(收

						益互换填写) ” 必填;
7	NotionalPrincipalAmount	名义本金 金额 (亿 元)	N (19,4)	否		校验规则: 保 留 4 位小数, 同 时总的字符长 度不能超过 20, 即整数位最多 可为 15 位;
8	TotalAmountOfNominalPrincipalAmount	有效名义 本金	N (19,4)	否		校验规则: 保 留 4 位小数, 同 时总的字符长 度不能超过 20, 即整数位最多 可为 15 位;
9	StartingDay	起始日 (T 日)	C (10)	否		校验规则: 必 须是 YYYY-MM- DD; 起始日不 能大于到期日
10	DueDate	到期日	C (10)	否		校验规则: 必 须是 YYYY-MM- DD; 到期日不 能小于起始日
11	SumInvestmentTargetType	标的类型	C (2)	否	权益类 01、大宗 商品 02、利率 03、信用类 04、汇率 05、 其他 99	
12	OptionSumInvestmentTargetType	期权标 的小类 (场 外期权填 写)	C (2)	否	股票 01、股指 02、新三板挂牌 股票 03、香港股 票 04、香港股指 05、基金及基金 专户 06、债券 07、黄金期货 08、国债期货 09、股指期货 10、其他期货 11、黄金现货 12、其他现货 13、境外期货 14、境外现货 15、境外股票 16、	校验规则: 如 业务类型为期 权, 需填写本 字段;

					境外股指 17、汇率 18、Shibor 19、银行间回购定盘 (Fixing Repo Rate) 20、其他利率 21、其他标的 99	
1 3	ExchangeSumInvestmentTargetType	收益互换标的小类 (收益互换填写)	C (2)	否	股票 01、股指 02、新三板挂牌股票 03、香港股票 04、香港股指 05、基金及基金专户 06、债券 07、黄金期货 08、国债期货 09、股指期货 10、其他期货 11、黄金现货 12、其他现货 13、境外期货 14、境外现货 15、境外股票 16、境外股指 17、汇率 18、其他标的 99	校验规则：如业务类型为互换，需填写本字段；
1 4	OptionFee	期权费 (非年化) (%)	N (5, 2)	否		校验规则：1、如业务类型为期权，需填写本字段，该字段为期权费占名义本金的百分比；2、数值处于0至100之间，保留两位小数；
1 5	OptionType	期权类型	C (2)	否	香草 01、障碍 02、二元 03、区间累计 04、价差 05、单鲨 06、双鲨 07、其他 08	校验规则：如业务类型为期权，需填写本字段；

(3) 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
1	SecurityCompany	证券公司	C (100)	否		
2	BusinessType	业务类型	C (2)	否	互换 01、期权 02、 远期 03	
3	SumInvestmentTargetType	标的分类	C (2)	否	股票 01、基金及基金专户 02、股指期货 03、大宗商品 04、其他 99	
4	SumInvestmentTargetName	标的名称/ 品种名称	C (100)	否		大宗商品仅需填写品种名称, 不需具体到合约;
5	BuyingImpulseVolume	买入对冲交易量 (元)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;
6	SellingImpulseVolume	卖出对冲交易量 (元)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;
7	ImpulseVolume	对冲交易量 (元) (买入+卖出)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;
8	PositionAtTheEndOfThisMonth	本月末持仓规模/ 合约价值 (元)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;
9	TheNumberOfPositionsHeldAtTheEndOfThisMonth	本月末持仓数量 (股/手)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;
10	AveragePriceAtTheEndOfTheMonth	本月末持仓平均价格 (元)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;
11	MarketValueOfTheLastTradingDayOfTheMonth	当月最后一交易日的市值 (元)	N (19,4)	否		校验规则: 长度介于0和20之间;

3.2.7.2 NAFMII 模板

包含在标签<PeriodicReportNAFMII>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	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	Month	月份	N(2)	是		校验规则：必须是1-12之间的整数；
4	MainAgreementLastMonthAccumulatedThisYear	主协议上月末本年累计	N (20)	是		校验规则：正整数；
5	MainAgreementAddedThisMonth	主协议本月新增	N (20)	是		校验规则：正整数；
6	MainAgreementAccumulatedThisYear	主协议本年累计	N (20)	是		校验规则：正整数；
7	MainAgreementValidatedAtEndOfThisMonth	主协议本月末有效	N (20)	是		校验规则：正整数；
8	SupplementalAgreementLastMonthAccumulatedThisYear	补充协议上月末本年累计	N (20)	是		校验规则：正整数；
9	SupplementalAgreementAddedThisMonth	补充协议本月新增	N (20)	是		校验规则：正整数；
10	SupplementalAgreementAccumulatedThisYear	补充协议本年累计	N (20)	是		校验规则：正整数；
11	SupplementalAgreementValidatedAtTheEndOfThisMonth	补充协议本月末有效	N (20)	是		校验规则：正整数；
12	PerformanceGuaranteeAgreementL	履约担保协议上月末本年累计	N (20)	是		校验规则：正整数；

	astMonthAccumulatedThisYear					
13	PerformanceGuaranteeAgreementAddedThisMonth	履约担保协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
14	PerformanceGuaranteeAgreementAccumulatedThisYear	履约担保协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
15	PerformanceGuaranteeAgreementValidatedAtEndOfThisMonth	履约担保协议本月末有效	N (20)	是		校验规则: 正整数;
16	TransactionConfirmationLastMonthAccumulatedThisYear	交易确认书上月末本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
17	TransactionConfirmationAddedThisMonth	交易确认书本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
18	TransactionConfirmationBookAccumulatedThisYear	交易确认书本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
19	TransactionConfirmationValidatedAtEndOfThisMonth	交易确认书本月末有效	N (20)	是		校验规则: 正整数;
20	NominalPrincipalInterestRateTradedAtTheBeginningOfThisMonth	名义本金利率本月初存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
21	NominalPrincipalRateIncreasesThisMonth	名义本金利率本月新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
22	NominalPrincipalRateIsSettledThisMonth	名义本金利率本月了结交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
23	NominalPrincipalRateRemainsTradedAtTheEndOfThisMonth	名义本金利率本月末存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;

24	NominalPrincipalRateAsOfTheEndOfThisMonthToAddTransactions	名义本金利率截至本月末年度新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
25	ContractsInterestRateTradedAtTheBeginningOfThisMonth	合约笔数利率本月初存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
26	NumberOfContractedInterestRatesThisMonthToAddTransactions	合约笔数利率本月新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
27	AmountOfInterestInTheContractIsSettledThisMonth	合约笔数利率本月了结交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
28	ContractInterestRatesRemainTradedAtTheEndOfThisMonth	合约笔数利率本月末存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
29	ContractsInterestRateAsOfTheEndOfThisMonthAddNewTransactions	合约笔数利率截至本月末年度新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
30	NominalPrincipalGoldTradedAtTheBeginningOfThisMonth	名义本金黄金本月初存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
31	NominalGoldThisMonthToAddTransactions	名义本金黄金本月新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
32	TheNominalGoldIsTradingThisMonth	名义本金黄金本月了结交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
33	NominalPrincipalGoldIsTradedAtTheEndOfThisMonth	名义本金黄金本月末存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
34	NominalPrincipalGoldAsOfTheEndOfThisYearTheNewTransaction	名义本金黄金截至本月末年度新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;

35	TheNumberOfContractsForGoldIsTradedAtTheBeginningOfThisMonth	合约笔数黄金 本月初存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
36	TheNumberOfContractsGoldThisMonthToAddTransactions	合约笔数黄金 本月新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
37	TheNumberOfContractsIsGoldThisMonth	合约笔数黄金 本月了结交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
38	TheNumberOfContractsIsGoldAtTheEndOfThisMonth	合约笔数黄金 本月末存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
39	TheNumberOfContractsForTheGoldAsOfTheEndOfThisYearTheNewTransaction	合约笔数黄金 截至本月末年度新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
40	NominalPrincipalForeignExchangeTradedAtTheBeginningOfThisMonth	名义本金外汇 本月初存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位 小数;
41	NominalPrincipalForeignExchangeThisMonthToAddTransactions	名义本金外汇 本月新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位 小数;
42	TheNominalPrincipalForeignExchangeSettledThisMonth	名义本金外汇 本月了结交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位 小数;
43	NominalPrincipalForeignExchangeTradedAtTheEndOfThisMonth	名义本金外汇 本月末存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位 小数;
44	NominalPrincipalForeignExchangeAsOfTheEndOfThisYearTheNewTransaction	名义本金外汇 截至本月末年度新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位 小数;
45	ContractsForeignExchangeIsTraded	合约笔数外汇 本月初存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;

	edAtTheBeginningOfThisMonth					
46	ContractNumberForeignExchangeThisMonthNewTransaction	合约笔数外汇本月新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
47	TheNumberOfContractsForForeignExchangeTransactionsThisMonth	合约笔数外汇本月了结交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
48	ContractsForeignExchangeIsTradedAtTheEndOfThisMonth	合约笔数外汇本月末存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
49	NumberOfContractsForeignExchangeAsOfTheEndOfThisMonthTheNewTransaction	合约笔数外汇截至本月末年度新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
50	TheNameOfThePrincipalOtherTransactionsHeldEarlierThisMonth	名义本金其他本月初存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
51	NominalPrincipalOtherNewTransactionsThisMonth	名义本金其他本月新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
52	TheNameOfThePrincipalOtherTransactionsThisMonth	名义本金其他本月了结交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
53	NominalPrincipalOtherTransactionsRemainAtTheEndOfThisMonth	名义本金其他本月末存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
54	NominalPrincipalOtherTransactionsUpToTheEndOfThisMonth	名义本金其他截至本月末年度新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
55	TheNumberOfContractsIsTheBeginningOfThisMonth	合约笔数其他本月初存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
56	ContractNumberOtherNewTransactionsThisMonth	合约笔数其他本月新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;

57	TheNumberOfContractsOtherTransactionsThisMonth	合约笔数其他本月了结交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
58	ContractsOthersRemainTradedAtTheEndOfThisMonth	合约笔数其他本月末存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
59	NumberOfContractsOtherTransactionsAsOfTheEndOfThisMonth	合约笔数其他截至本月末年度新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
60	TheNominalPrincipalIsTradedAtTheBeginningOfThisMonth	名义本金合计本月初存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
61	NominalPrincipalTotalNewTransactionsThisMonth	名义本金合计本月新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
62	NominalPrincipalTotalSettledThisMonth	名义本金合计本月了结交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
63	TheNominalPrincipalIsTradedAtTheEndOfThisMonth	名义本金合计本月末存续交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
64	NominalPrincipalTotalNewTransactionAsOfTheEndOfThisMonth	名义本金合计截至本月末年度新增交易	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
65	TheTotalNumberOfContractsIsTradedAtTheBeginningOfThisMonth	合约笔数合计本月初存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
66	TheTotalNumberOfContractsIsAddedThisMonth	合约笔数合计本月新增交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
67	TheTotalNumberOfContractsIsSettledThisMonth	合约笔数合计本月了结交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;
68	TheTotalNumberOfContractsIsTradedAtTheEndOfThisMonth	合约笔数合计本月末存续交易	N (20)	是		校验规则: 正整数;

69	TheTotalNumberOfContractsAsOfTheEndOfThisYearAddTheNewTransaction	合约笔数合计截至本月末年度新增交易	N (20)	是		校验规则：正整数；
70	InterestRateSwapDetails	利率互换明细	T			字段信息详见利率互换明细
71	ScheduleOfOtherTransactions	其他交易明细表	T			字段信息详见其他交易明细表

(1) 利率互换明细

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	TransactionDate	交易日期	C (10)	否		校验规则：必须是 YYYY-MM-DD；
2	FillInTheNameOfTheOrganization	填报机构名称	C (100)	否		
3	FillInTheNameOfTheAgency	填报机构代签产品名称	C (100)	否		
4	NameOfCounterparty	交易对手方名称	C (100)	否		
5	CounterpartyAllo-graphProduct	交易对手方代签产品名称	C (100)	否		
6	CounterpartyType	交易对手方类型	C (2)	否	证券公司 01、基金公司 02、期货公司 03、证券公司子公司 04、基金公司子公司 05、期货子公司 06、商业银行 07、保险公司 08、保险	

					子公司 09、信托公司 10、 财务公司 11、私募基金 12、 其他金融机构 13、非 金融机构 14、境外 金融机构 15、境外 非金融机构 16、其他 99	
7	CounterpartyIsProfessionalInstitutionsOrNot	交易对手是否专业机构	C (2)	否	是 01、否 02	
8	FixedInterestPaymentParty	固定利息支付方	C (100)	否		
9	FloatingInterestPaymentParty	浮动利息支付方	C (100)	否		
10	NotionalPrincipalAmount	名义本金金额	N (19, 4)	否		校验规则：保留4位小数,同时总的字符长度不能超过20,即整数位最多可为15位;
11	ContractPeriod	合约期限	C (40)	否		
12	DaValueDate	起息日	C (10)	否		校验规则：必须是YYYY-MM-DD;起息日不能大于到期日
13	DueDate	到期日	C (10)	否		校验规则：必须是YYYY-MM-DD;到期日不能小于起息日
14	FixedRate	固定利率	N (20, 2)	否		校验规则：保留2位小数,同时总的字符长度不能超过20,即整

						数位最多可为18位;
15	FixedRatePaymentCycle	固定利率支付周期	C (1000)	否		
16	FixedInterestRateBasis	固定利率计息基准	C (1000)	否		
17	ReferenceRateName	参考利率名称	C (1000)	否		
18	Spreads	利差	C (1000)	否		
19	FloatingRatePaymentCycle	浮动利率支付周期	C (1000)	否		
20	ResetTheFrequency	重置频率	C (1000)	否		
21	FloatingInterestRateBasis	浮动利率计息基准	C (1000)	否		
22	FirstInterestPaymentDay	首次利息支付日	C (10)	否		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD;

(2) 其他交易明细表

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	TradingDate	交易日期	C (10)	否		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD;
2	FillInTheNameOfTheOrganization	填报机构名称	C (100)	否		
3	FillInTheNameOfTheAgency	填报机构代签产品名称	C (100)	否		
4	NameOfCounterparty	交易对手方名称	C (100)	否		

5	CounterpartyAllo graphProduct	交易对手方代 签产品名称	C (100)	否		
6	BusinessType	交易类型	C (2)	否	互换 01、 期权 02、 远期 03、 掉期 04	
7	CounterpartyType	交易对手方类 型	C (2)	否	证券公司 01、基金 公司 02、 期货公司 03、证券 公司子公司 04、基金 公司子公司 05、期货 子公司 06、商业 银行 07、 保险公司 08、保险 子公司 09、信托 公司 10、 财务公司 11、私募 基金 12、 其他金融机 构 13、非 金融机构 14、境外 金融机构 15、境外 非金融机构 16、其他 99	
8	CounterpartyIsPr ofessionalInsti tutionsOrNot	交易对手是否 专业机构	C (2)	否	是 01、否 02	
9	NotionalPrincipa lAmount	名义本金金额	N (19, 4)	否		校验规则：保留 4位小数,同时 总的字符长度不 能超过20,即整

						数位最多可为15位;
10	InvestmentTargetType	标的类型	C (2)	否	权益类 01、大宗商品 02、黄金现货 03、黄金期货 04、利率类 05、其他 06	
11	InvestmentTarget	标的名称	C (100)	否		校验规则: 字符长度介于0到100;
12	ContractStartDate	合约起始日	C (10)	否		校验规则: 必须是YYYY-MM-DD; 合约起始日不能大于合约到期日
13	ContractExpirationDate	合约到期日	C (10)	否		校验规则: 必须是YYYY-MM-DD; 合约到期日不能小于合约起始日

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
1	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则: 补正时必填;
2	Year	年份	N(4)	是		校验规则: 必须是4位整数;
3	Month	月份	N(2)	是		校验规则: 必须是1-12之间的整数;
4	MainAgreementLastMonthAccumulatedThisYear	主协议上月末本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;

5	MainAgreementAddedThisMonth	主协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
6	MainAgreementAccumulatedThisYear	主协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
7	MainAgreementValidatedAtEndOfThisMonth	主协议本月未有效	N (20)	是		校验规则: 正整数;
8	SupplementalAgreementLastMonthAccumulatedThisYear	补充协议上月末本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
9	SupplementalAgreementAddedThisMonth	补充协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
10	SupplementalAgreementAccumulatedThisYear	补充协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
11	SupplementalAgreementValidatedAtTheEndOfThisMonth	补充协议本月未有效	N (20)	是		校验规则: 正整数;
12	PerformanceGuaranteeAgreementLastMonthAccumulatedThisYear	履约担保协议上月末本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
13	PerformanceGuaranteeAgreementAddedThisMonth	履约担保协议本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
14	PerformanceGuaranteeAgreementAccumulatedThisYear	履约担保协议本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
15	PerformanceGuaranteeAgreementValidatedAtEndOfThisMonth	履约担保协议本月未有效	N (20)	是		校验规则: 正整数;
16	TransactionConfirmationLastMonthAccumulatedThisYear	交易确认书上月末本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;

17	TransactionConfirmationAddedThisMonth	交易确认书 本月新增	N (20)	是		校验规则: 正整数;
18	TransactionConfirmationBookAccumulatedThisYear	交易确认书 本年累计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
19	TransactionValidatedAtEndOfThisMonth	交易确认书 本月末有效	N (20)	是		校验规则: 正整数;
20	SWAPNominalCapitalStockAtBeginning	互换类名义 本金期初存 量	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;
21	SWAPIncreasedOriginalTransactionNominalCapitalAtThisMonth	互换类本月 新增初始交 易名义本金	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;
22	SWAPNotionalPrincipalAmountAllowedToBeTerminatedAtThisMonth	互换类本月 终止交易名 义本金	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;
23	SWAPNominalCapitalStockAtEnding	互换类名义 本金期末存 量	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;
24	SwapCategoryNominalPrincipalThisYearCumulativeInitialTransaction	互换类名义 本金本年累 计新增初始 交易	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;
25	OptionOfNotionalPrincipalStockAtBeginning	期权类名义 本金期初存 量	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;
26	OptionIncreasedOriginalTransactionNominalCapitalAtThisMonth	期权类本月 新增初始交 易名义本金	N (36 , 4)	是		校验规则: 保留四位小 数;

27	OptionNotionalPrincipalAmountAllowedToBeTerminatedAtThisMonth	期权类本月终止交易名义本金	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
28	OptionOfNotionalPrincipalStockAtEnding	期权类名义本金期末存量	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
29	NominalPrincipalOfOptionClassHasBeenAddedToInitialTransaction	期权类名义本金本年累计新增初始交易	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
30	ForwardOfNotionalPrincipalStockAtBeginning	远期类名义本金期初存量	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
31	ForwardIncreasedOriginalTransactionNominalCapitalAtThisMonth	远期类本月新增初始交易名义本金	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
32	ForwardNotionalPrincipalAmountAllowedToBeTerminatedAtThisMonth	远期类本月终止交易名义本金	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
33	ForwardOfNotionalPrincipalStockAtEnding	远期类名义本金期末存量	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
34	LongtermNominalPrincipalOfYearHasBeenAddedToInitialTransaction	远期类名义本金本年累计新增初始交易	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
35	StockOfSwapContractsAtBeginning	互换类合约数量期初存量	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
36	NumberOfNewSwapInitialTrading	互换类本月新增初始交易合约数量	N (36)	是		校验规则: 保留四位小数;

	gContractsAtThisMonth		, 4)			
37	NumberOfSwapContractsToTerminateAtThisMonth	互换类本月终止交易合约数量	N (36), 4	是		校验规则: 保留四位小数;
38	StockOfSwapContractsAtEnding	互换类合约数量期末存量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
39	NumberOfSwapContractsIncreasedByThisYear	互换类合约数量本年累计新增初始交易	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
40	StockOfOptionContractsAtBeginning	期权类合约数量期初存量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
41	NumberOfNewOptionInitialTradingContractsAtThisMonth	期权类本月新增初始交易合约数量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
42	NumberOfOptionContractsToTerminateAtThisMonth	期权类本月终止交易合约数量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
43	StockOfOptionContractsAtEnding	期权类合约数量期末存量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
44	NumberOfOptionContractsHasIncreasedInitialTransaction	期权类合约数量本年累计新增初始交易	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
45	StockOfForwardContractsAtBeginning	远期类合约数量期初存量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
46	NumberOfNewForwardInitialTradingContractsAtThisMonth	远期类本月新增初始交易合约数量	N (36), 4)	是		校验规则: 保留四位小数;

47	NumberOfForwardContractsToTerminateAtThisMonth	远期类本月终止交易合约数量	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
48	StockOfForwardContractsAtEnding	远期类合约数量期末存量	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
49	NumberOfForwardContractsHasIncreasedInitialTransaction	远期类合约数量本年累计新增初始交易	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
50	SwapSignedWithTheCustomerThisMonth	本月末互换已签约客户	N (20)	是		校验规则: 正整数;
51	NumberOfSwapTradingAccountsAtThisPeriodThisMonth	本月末互换当期参与交易的账户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
52	NumberOfSwapTradingClientStockThisMonth	本月末互换存量交易客户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
53	SwapSignedWithTheCustomerLastMonth	上月末互换已签约客户	N (20)	是		校验规则: 正整数;
54	NumberOfSwapTradingAccountsLastMonth	上月末互换当期参与交易的账户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
55	NumberOfSwapTradingClientStockLastMonth	上月末互换存量交易客户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
56	OptionSignedWithTheCustomerThisMonth	本月末期权已签约客户	N (20)	是		校验规则: 正整数;
57	NumberOfOptionTradingAccountsThisMonth	本月末期权当期参与交易的账户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
58	NumberOfOptionTradingClientStockThisMonth	本月末期权存量交易客户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;

59	OptionSignedWithTheCustomerLastMonth	上月末期权已签约客户	N (20)	是		校验规则: 正整数;
60	NumberOfOptionTradingAccountsLastMonth	上月末期权当期参与交易的账户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
61	NumberOfOptionTradingClientStockLastMonth	上月末期权存量交易客户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
62	ForwardSignedWithTheCustomerThisMonth	本月末远期已签约客户	N (20)	是		校验规则: 正整数;
63	NumberOfForwardTradingAccountsThisMonth	本月末远期当期参与交易的账户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
64	NumberOfForwardTradingClientStockThisMonth	本月末远期存量交易客户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
65	ForwardSignedWithTheCustomerLastMonth	上月末远期已签约客户	N (20)	是		校验规则: 正整数;
66	NumberOfForwardTradingAccountsLastMonth	上月末远期当期参与交易的账户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
67	NumberOfForwardTradingClientStockLastMonth	上月末远期存量交易客户数量	N (20)	是		校验规则: 正整数;
68	SignedTotalCustomer	已签约客户合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
69	TotalNumberOfTradingAccountsAtThisPeriod	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	存量交易客户数量合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
71	SignedTotalCustomerLastMonth	上月末已签约客户合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;

72	TotalNumberOfTradingAccountsAtThisPeriodLastMonth	上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;
73	TotalNumberOfTradingClientAccountsLastMonth	上月末存量交易客户数量合计	N (20)	是		校验规则: 正整数;
74	TotalNominalPrincipalAmountOfSwapThisMonth	本月末互换存量名义本金总额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
75	TotalNominalPrincipalAmountOfSwapLastMonth	上月末互换存量名义本金总额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
76	TheValueOfTheStockSwapInTheCorrespondingPerformanceGuaranteeThisMonth	本月末互换存量交易对应履约担保品价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
77	TheValueOfTheStockSwapInTheCorrespondingPerformanceGuaranteeLastMonth	上月末互换存量交易对应履约担保品价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
78	SwapCashCollateralValueThisMonth	本月末互换现金担保物价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
79	SwapCashCollateralValueLastMonth	上月末互换现金担保物价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
80	SwapSecuritiesCollateralValueThisMonth	本月末互换证券担保物价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
81	SwapSecuritiesCollateralValueLastMonthThisMonth	上月末互换证券担保物价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
82	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessThisMonthFull	本月末互换业务整体履约担保比例全额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;

83	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessLastMonthFull	上月末互换业务整体履约担保比例全额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
84	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessThisMonthNet	本月末互换业务整体履约担保比例净额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
85	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessLastMonthNet	上月末互换业务整体履约担保比例净额	N (36, 2)	是		校验规则: 保留两位小数;
86	SwapNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthThisMonth	本月末互换本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
87	SwapNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthLastMonth	上月末互换本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
88	SwapDefaultTransactionNumberAtThisMonthThisMonth	本月末互换本月违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
89	SwapDefaultTransactionNumberAtThisMonthLastMonth	上月末互换本月违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
90	TotalSwapDefaultCustomerNumberInThisYearThisMonth	本月末互换本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
91	TotalSwapDefaultCustomerNumberInThisYearLastMonth	上月末互换本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
92	SwapNumberOfDefaultCustomersInThisYearThisMonth	本月末互换本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

93	SwapNumberOfDefaultCustomersInThisYearLastMonth	上月末互换 本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则：正整数；
94	TotalNominalPrincipalAmountOfForwardThisMonth	本月末远期 存量名义本金总额	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
95	TotalNominalPrincipalAmountOfForwardLastMonth	上月末远期 存量名义本金总额	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
96	TheValueOfTheStockForwardCorrespondingPerformanceGuaranteeThisMonth	本月末远期 存量交易对应履约担保品价值	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
97	TheValueOfTheStockForwardCorrespondingPerformanceGuaranteeLastMonth	上月末远期 存量交易对应履约担保品价值	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
98	ForwardCashCollateralValueThisMonth	本月末远期 现金担保物价值	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
99	ForwardCashCollateralValueLastMonth	上月末远期 现金担保物价值	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
100	ForwardSecuritiesCollateralValueThisMonth	本月末远期 证券担保物价值	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
101	ForwardSecuritiesCollateralValueLastMonth	上月末远期 证券担保物价值	N (36,4)	是		校验规则：保留四位小数；
102	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessThisMonthFull	本月末远期 业务整体履约担保比例 全额	N (36,2)	是		校验规则：保留两位小数；
103	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessLastMonthFull	上月末远期 业务整体履约担保比例 全额	N (36,2)	是		校验规则：保留两位小数；

104	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessThisMonthNet	本月末远期业务整体履约担保比例净额	N (36,2)	是		校验规则: 保留两位小数;
105	ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheForwardBusinessLastMonthNet	上月末远期业务整体履约担保比例净额	N (36),2	是		校验规则: 保留两位小数;
106	ForwardNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthThisMonth	本月末远期本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
107	ForwardNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthLastMonth	上月末远期本月违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
108	ForwardTransactionNumberAtThisMonthThisMonth	本月末远期本月交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
109	ForwardTransactionNumberAtThisMonthLastMonth	上月末远期本月交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
110	TotalForwardDefaultCustomerNumberInThisYearThisMonth	本月末远期本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
111	TotalForwardDefaultCustomerNumberInThisYearLastMonth	上月末远期本年累计违约客户数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
112	ForwardNumberOfDefaultCustomersInThisYearThisMonth	本月末远期本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
113	ForwardNumberOfDefaultCustomersInThisYearLastMonth	上月末远期本年累计违约交易数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

114	StockTradingCorrespondsToValueOfCollateralAtEndOfThisMonth	本月末存量交易对应履约担保品价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
115	StockTradingCorrespondsToValueOfCollateralAtEndOfLastMonth	上月末存量交易对应履约担保品价值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
116	CashBalanceAtEndOfThisMonth	本月末持有现金余额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
117	CashBalanceAtEndOfLastMonth	上月末持有现金余额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
118	HoldStockMarketValueAtEndOfThisMonth	本月末持有股票市值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
119	HoldStockMarketValueAtEndOfLastMonth	上月末持有股票市值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
120	HoldMarketValueOfBondsAtTheEndOfThisMonth	本月末持有债券市值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
121	HoldMarketValueOfBondsAtTheEndOfLastMonth	上月末持有债券市值	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
122	OwnedAssetManagementProductsAtTheEndOfThisMonth	本月末持有证券公司资产管理产品	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
123	OwnedAssetManagementProductsAtTheEndOfLastMonth	上月末持有证券公司资产管理产品	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
124	OwnedBankFinanceAtTheEndOfThisMonth	本月末持有银行理财	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
125	OwnedBankFinanceAtTheEndOfLastMonth	上月末持有银行理财	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;

126	HoldTrustProductAtTheEndOfThisMonth	本月末持有信托产品	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
127	HoldTrustProductAtTheEndOfLastMonth	上月末持有信托产品	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
128	InsuranceProductsAreHeldAtTheEndOfThisMonth	本月末持有保险产品	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
129	InsuranceProductsAreHeldAtTheEndOfLastMonth	上月末持有保险产品	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
130	HoldOtherProductsAtTheEndOfThisMonth	本月末持有其他产品	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
131	HoldOtherProductsAtTheEndOfLastMonth	上月末持有其他产品	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
132	SettledSwapItemsAtThisMonth	互换本月了结笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
133	SettledSwapTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth	互换本月了结交易涉及名义本金	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
134	SwapIncomeCashFlow	互换收入现金流	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
135	SwapExpensesCashFlow	互换支出现金流	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
136	CashFlowCorrespondingToNetIncomeOnSwapMargin	互换使用保证金形成的净收益对应现金流	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
137	SwapHedgeCost	互换对冲成本	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
138	SettledOptionItemsAtThisMonth	期权本月了结笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;

139	SettledOptionTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth	期权本月了结交易涉及名义本金	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
140	OptionPremiumIncome	期权权利金收入	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
141	OptionHedgeCost	期权对冲成本	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
142	SettledForwardItemsAtThisMonth	远期本月了结笔数	N (20)	是		校验规则: 正整数;
143	SettledForwardTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth	远期本月了结交易涉及名义本金	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
144	ForwardIncomeCashFlow	远期收入现金流	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
145	ForwardExpenseCashFlow	远期支出现金流	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
146	ForwardHedgeCost	远期对冲成本	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
147	BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisMonth	互换已实现损益本月发生额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
148	BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisMonth	期权已实现损益本月发生额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
149	BalanceOfForwardRealizedGainsAndLossesAtThisMonth	远期已实现损益本月发生额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
150	BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisYear	互换已实现损益本年累计额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;

151	BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisYear	期权已实现损益本年累计额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
152	BalanceOfForwardRealizedGainsAndLossesAtThisYear	远期已实现损益本年累计额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
153	BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth	互换公允价值变动损益本月发生额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
154	BalanceOfOptionChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth	期权公允价值变动损益本月发生额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
155	BalanceOfForwardChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth	远期公允价值变动损益本月发生额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
156	BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear	互换公允价值变动损益本年累计额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
157	BalanceOfOptionChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear	期权公允价值变动损益本年累计额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
158	BalanceOfForwardChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear	远期公允价值变动损益本年累计额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
159	BalanceOfSwapTotalGainsAndLossesAtThisMonth	互换损益合计本月发生额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;
160	BalanceOfOptionTotalGainsAndLossesAtThisMonth	期权损益合计本月发生额	N (36, 4)	是		校验规则: 保留四位小数;

161	BalanceOfForwardTotalGainsAndLossesAtThisMonth	远期损益合计本月发生额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
162	BalanceOfSwapTotalGainsAndLossesAtThisYear	互换损益合计本年累计额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
163	BalanceOfOptionTotalGainsAndLossesAtThisYear	期权损益合计本年累计额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
164	BalanceOfForwardTotalGainsAndLossesAtThisYear	远期损益合计本年累计额	N (36,4)	是		校验规则: 保留四位小数;
165	IncreaseBusinessDetailsThisMonthTuple	本月新增业务明细	T			字段信息详见本月新增业务明细
166	TargetCaseAndHedgeTuple	标的情况与对冲	T			字段信息详见本月新增业务明细

(1) 本月新增业务明细

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	SecurityCompany	证券公司名称	C (100)	否		
2	CounterpartyName	交易对手名称	C (100)	否		
3	TransactionConfirmationNumber	交易确认书编号	C (100)	否		
4	TradeConfirmationType	交易确认书类型	C (2)	否	首次 01、 补充 02、 变更 03	
5	BusinessType	业务类型	C (2)	否	互换 01、 期权 02、 远期 03	
6	NotionalPrincipalAmount	名义本金金额 (亿元)	N (20,2)	否		校验规则: 保留 2 位小数, 同时总的字符长

						度不能超过 20, 即整数位最多可为 18 位;
7	StartingDay	起始日	C (10)	否		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD; 起始日不能大于到期日
8	DueDate	到期日	C (10)	否		校验规则: 必须是 YYYY-MM-DD; 到期日不能小于起始日
9	TradingPlaces	交易场所	C (2)	否	柜台市场 01、报价系统 02、银行间市场 03、其他交易场所 99	
10	InvestmentTargetType	标的类型	C (2)	否	权益类(境内) 01、权益类(境外) 02、大宗商品 03、利率 04、信用类 05、汇率 06、其他 99	

(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
1	SecurityCompany	证券公司名称	C (10)	否		
2	SecurityCompanyCode	证券公司代码	C (10)	否		
3	CounterpartyName	交易对手名称	C (10)	否		

4	CounterpartyAllo graphProduct	交易对手方 代签产品名 称	C (10 0)	否		
5	BusinessType	业务类型	C (2)	否	互换 01、 期权 02、 远期 03	
6	DataTypeForBusin essType	数据类型	C (2)	是	本月新增 业务 01、 截至上月 底尚未完 全终止业 务 02	
7	TradingPlaces	交易场所	C (2)	否	柜台市场 01、报价 系统 02、 银行间市 场 03、其 他交易场 所 99	
8	TransactionConfir mationNumber	交易确认书 编号	C (20 0)	否		
9	InitialNotionalP rincipalAmount	初始名义本 金 (元)	N (20 ,2)	否		校验规则: 保留 2 位 小数, 同时总的字符长 度不能超过 20, 即整数 位最多可为 18 位;
1 0	InvestmentTarget Type	标的类型	C (2)	否	上海主板 股票 00、 深圳主板 股票 01、 深圳中小 板股票 02、创业 板股票 03、新三 板挂牌股 票 04、港 股股票 05、北美 市场股票 06、欧洲 市场股票 07、其他 境外股票	

				08、Shibor 09、银行间回购定盘利率 (FixingRepoRate) 10、其他利率 11、期货 12、基金及基金专户 13、地方性交易所挂牌交易产品 14、沪深300 指数 15、中证100 指数 16、中证200 指数 17、中证500 指数 18、中证700 指数 19、上证180 指数 20、上证50 指数 21、上证380 指数 22、超大盘指数 23、上证中盘指数 24、深证成份指数 25、中小板指数 26、创业板指数 27、深证100 指数	
--	--	--	--	---	--

					28、深证300 指数 29、中创500 指数 30、其他指数 31、汇率 32、贵金属 33、大宗商品 34、可转债 35、期权 36、其他衍生品 37、其他标的 99	
1 1	InvestmentTarget	标的名称	C (10 0)	否		
1 2	UnderlyingCode	标的代码	C (10 0)	否		
1 3	NumberOfTargets	标的数量	N(36)	否		校验规则：正整数；
1 4	StartingDay	起始日	C (10)	否		校验规则：必须是YYYY-MM-DD；起始日不能大于到期日
1 5	DueDate	到期日	C (10)	否		校验规则：必须是YYYY-MM-DD；到期日不能小于起始日
1 6	NumberOfSharesInCirculation	流通股数量	N (20)	否		校验规则：正整数
1 7	OutstandingSharesAccountingForStock	流通股占比	N (20 ,2)	否		校验规则：保留 2 位小数,同时总的字符长度不能超过 20,即整数位最多可为 18 位;
1 8	SubjectType	对冲操作_标的类型	C (2)	否	上海主板股票 00、深圳主板股票 01、深圳中小	

				板股票 02、创业板股票 03、新三板挂牌股票 04、港股股票 05、北美市场股票 06、欧洲市场股票 07、其他境外股票 08、Shibor 09、银行间回购定盘利率 (FixingRate) 10、其他利率 11、期货 12、基金及基金专户 13、地方性交易所挂牌交易产品 14、沪深300 指数 15、中证100 指数 16、中证200 指数 17、中证500 指数 18、中证700 指数 19、上证180 指数 20、上证50 指数 21、上证	
--	--	--	--	--	--

					380 指数 22、超大 盘指数 23、上证 中盘指数 24、深证 成份指数 25、中小 板指数 26、创业 板指数 27、深证 100 指数 28、深证 300 指数 29、中创 500 指数 30、其他 指数 31、 汇率 32、 贵金属 33、大宗 商品 34、 可转债 35、期权 36、其他 衍生品 37、其他 标的 99
1 9	TargetTradingPl ces	对冲操作_ 标的的交易场 所	C (2)	否	上海证券 交易所 01、深圳 证券交易 所 02、新 三板 03、 上海期货 交易所 04、大连 商品交易 所 05、郑 州商品期 货交易所 06、中国 金融期货

					交易所 07、外汇 交易中心 08、其他 (注明具 体场所) 99	
20	UnderlyingName	对冲操作_ 挂钩标的名称	C (100)	否		
21	InvestmentTarget Code	对冲操作_ 标的代码	C (100)	否		
22	PositionQuantity	对冲操作_ 持仓数量	N (20, 2)	否		校验规则: 保留 2 位 小数
23	HedgeRatio	对冲操作_ 头寸对冲比例	N (20, 2)	否		校验规则: 保留 2 位 小数, 同时总的字符长度 不能超过 20, 即整数 位最多可为 18 位;
24	NumberOfOutstand ingSharesOfStock Target	对冲操作_ 股票类标的 流通股数量	N (20)	否		校验规则: 正整数
25	OutstandingShare sOfInvestmentTar get	对冲操作_ 标的流通股 数	N (20, 2)	否		校验规则: 保留 2 位 小数, 同时总的字符长度 不能超过 20, 即整数 位最多可为 18 位;

3.2.8 重大事项报告

包含在标签<EventReport>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	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则: 补正时 必填;
2	EventReportTuple	重大事项报 告文件	T		多附件	字段信息详见【重 大事项报告文件】
3	DetailedDescription	详细说明	C (1024)	是		

重大事项报告文件

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	EventReport	重大事项报告文件	A	是		校验规则： 只支持 PDF 格式；

3.2.9 其他事项报告

包含在标签<OtherReport>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	BizID	业务编号	C (50)	否		校验规则：补正时 必填；
2	OtherReportFileTuple	其他报告文件	T		多附件	字段信息详见 【其他报告文件】
3	DetailedDescription	详细说明	C (1024)	是		

其他报告文件

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	OtherReportFile	其他报告文件	A	是		校验规则： 只支持 PDF 格式；

4 附录

4.1 数据字典

4.1.1 接口标识

序号	接口标识	含义
1.	A1001	主协议
2.	A1002	主协议产品列表
3.	A1003	补充协议
4.	A1004	期权交易确认书
5.	A1005	互换交易确认书
6.	A1006	互换终止
7.	A1007	期权终止
8.	A1008	履约担保
9.	A1009	重大事项报告
10.	A1010	其他事项报告
11.	A1011	定期报告-SAC 模板
12.	A1012	定期报告-NAFMII 模板
13.	A1013	定期报告-ISDA 模板

4.1.2 操作标识

序号	操作标识	含义
1.	A	报送信息文件
2.	U	报送信息补正文件
3.	D	报送信息废止文件

4.1.3 响应码

序号	响应码	含义
1.	000000	报送信息文件或该条记录接收成功
2.	000001	XML Schema 校验错误
3.	000002	其它失败，具体参见响应信息的内容

4.1.4 定期报告填报说明

4.1.4.1 SAC 模板

填报说明

(1)、签署协议统计固定表格:

协议类别	本月新增	本年累计	截至月末存续协议数量
主协议	4	5	6
补充协议	7	8	9
履约保障协议	10	11	12
交易确认书	13	14	15

(2)、场外个股期权业务规模情况固定表格:

类别	开展场外个股期权业务对应的自营权益类证券及衍生品规模 (元)	本月末净资产 (元)	开展场外个股期权业务对应的自营权益类证券及衍生品规模占净资产比例 (%)
金额或比例	16	17	18

(3)、交易对手情况表 (交易确认书) 固定表格:

业务类别	已签约法人 (家)	已签约产品 (家)	当月新增法人 (家)	当月新增产品 (家)	当月末存续法人 (家)	当月末存续产品 (家)
场外期权	19	20	21	22	23	24
收益互换	25	26	27	28	29	30

(4)、场外衍生品规模及标的情况固定表格:

	场外期权				收益互换				合计
	境内股指	境内个股	大宗商品	其他标的	境内股指	境内个股	大宗商品	其他标的	
上月末存续规模 (亿元)	31	32	33	34	35	36	37	38	39
本月新增规模 (亿元)	40	41	42	43	44	45	46	47	48
本月终止规模 (亿元)	49	50	51	52	53	54	55	56	57
本月末存续规	58	59	60	61	62	63	64	65	66

模 (亿元)									
本年累计新增规模 (亿元)	67	68	69	70	71	72	73	74	75
上月末存续合约笔数 (笔)	76	77	78	79	80	81	82	83	84
本月新增合约笔数 (笔)	85	86	87	88	89	90	91	92	93
本月终止合约笔数 (笔)	94	95	96	97	98	99	100	101	102
本月末存续合约笔数 (笔)	103	104	105	106	107	108	109	110	111
本年累计新增合约笔数 (笔)	112	113	114	115	116	117	118	119	120

(5)、互换类交易的履约担保品收取情况固定表格:

项目	本月末	上月末
存量名义本金总额 (亿元)	121	122
存量交易对应履约担保品价值 (亿元)	123	124
现金担保物价值 (亿元)	125	126
证券担保物价值 (亿元)	127	128
业务整体履约担保比例 (全额)	129	130
业务整体履约担保比例 (净额)	131	132
本月违约客户数	133	134
本月违约交易数 (笔)	135	136
本年累计违约客户数	137	138
本年累计违约交易数 (笔)	139	140

(6)、远期类交易的履约担保品收取情况固定表格:

项目	本月末	上月末
存量名义本金总额 (亿元)	141	142
存量交易对应履约担保品价值 (亿元)	143	144
现金担保物价值 (亿元)	145	146
证券担保物价值 (亿元)	147	148
业务整体履约担保比例 (全额)	149	150
业务整体履约担保比例 (净额)	151	152
本月违约客户数	153	154
本月违约交易数 (笔)	155	156
本年累计违约客户数	157	158
本年累计违约交易数 (笔)	159	160

(7)、收取履约担保品的使用情况固定表格:

项目	本月末	上月末
存量交易对应履约担保品价值 (亿元)	161	162
其中: 持有现金余额 (亿元)	163	164
持有股票市值 (亿元)	165	166
持有债券市值 (亿元)	167	168
持有证券公司资产管理产品 (亿元)	169	170
持有银行理财 (亿元)	171	172
持有信托产品 (亿元)	173	174
持有保险产品 (亿元)	175	176
其他 (亿元)	177	178

(8)、本月了结交易盈亏情况统计固定表格:

项目	科目	单位: 笔或亿元
互 换	本月了结笔数	179
	本月了结交易涉及名义本金	180
	收入现金流	181
	支出现金流	182
	使用保证金形成的净收益对应现金流	183
	对冲成本	184
期 权	本月了结笔数	185
	本月了结交易涉及名义本金	186
	权利金收入	187
	对冲成本	188
远 期	本月了结笔数	189
	本月了结交易涉及名义本金	190
	收入现金流 (或交割日公允价值)	191

	支出现金流（或交割日公允价值）	192
	对冲成本	193

(9)、本月会计损益统计固定表格:

项目	本月发生额（亿元）			本年累计额（亿元）		
	互换	期权	远期	互换	期权	远期
已实现损益	194	195	196	197	198	199
公允价值变动损益	200	201	202	203	204	205
损益合计	206	207	208	209	210	211

4.1.4.2 NAFMII 模板

填报说明

(1)、签署协议统计固定表格:

协议类别	上月末本年累计	本月新增	本年累计	本月末有效
主协议	4	5	6	7
补充协议	8	9	10	11
履约保障协议	12	13	14	15
交易确认书	16	17	18	19

(2)、业务规模统计固定表格:

标的类型	名义本金（亿元）（小数点后两位小数）					合约笔数（笔）				
	本月初存续交易	本月新增交易	本月了结交易	本月末存续交易	截至本年末年度新增交易	本月初存续交易	本月新增交易	本月了结交易	本月末存续交易	截至本年末年度新增交易
利率	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29
黄金	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39
外汇	40	41	42	43	44	45	46	47	48	49
其他	50	51	52	53	54	55	56	57	58	59
合计	60	61	62	63	64	65	66	67	68	69

4.1.4.3 ISDA 模板

填报说明

(1)、签署协议统计固定表格:

协议类别	上月末本年累 计	本月新增	本年累计	本月末有效
主协议	4	5	6	7
补充协议	8	9	10	11
履约保障协议	12	13	14	15
交易确认书	16	17	18	19

(2)、规模统计表固定表格:

项目		上月末存 量	本月新增 初始交易	本月终止 交易	本月末存 量	本年累计 新增初始 交易
名义本金 (亿元)	互换类	20	21	22	23	24
	期权类	25	26	27	28	29
	远期类	30	31	32	33	34
合约数量 (笔)	互换类	35	36	37	38	39
	期权类	40	41	42	43	44
	远期类	45	46	47	48	49

(3)、客户情况表固定表格:

项目		已签约客户(户)	当期参与交易的 账户数量(户)	存量交易客户数 量(户)
互换	本月末	50	51	52
	上月末	53	54	55
期权	本月末	56	57	58
	上月末	59	60	61
远期	本月末	62	63	64
	上月末	65	66	67
合计	本月末	68	69	70
	上月末	71	72	73

(4)、互换类交易的履约担保品收取情况固定表格:

项目	本月末	上月末
存量名义本金总额(亿元)	74	75
存量交易对应履约担保品价 值(亿元)	76	77
现金担保物价值(亿元)	78	79
证券担保物价值(亿元)	80	81
业务整体履约担保比例(全 额)	82	83
业务整体履约担保比例(净 额)	84	85
本月违约客户数	86	87
本月违约交易数(笔)	88	89
本年累计违约客户数	90	91
本年累计违约交易数(笔)	92	93

(5)、远期类交易的履约担保品收取情况固定表格:

项目	本月末	上月末
存量名义本金总额 (亿元)	94	95
存量交易对应履约担保品价值 (亿元)	96	97
现金担保物价值 (亿元)	98	99
证券担保物价值 (亿元)	100	101
业务整体履约担保比例 (全额)	102	103
业务整体履约担保比例 (净额)	104	105
本月违约客户数	106	107
本月违约交易数 (笔)	108	109
本年累计违约客户数	110	111
本年累计违约交易数 (笔)	112	113

(6)、收取履约担保品的使用情况固定表格:

项目	本月末	上月末
存量交易对应履约担保品价值 (亿元)	114	115
其中: 持有现金余额 (亿元)	116	117
持有股票市值 (亿元)	118	119
持有债券市值 (亿元)	120	121
持有证券公司资产管理产品 (亿元)	122	123
持有银行理财 (亿元)	124	125
持有信托产品 (亿元)	126	127
持有保险产品 (亿元)	128	129
其他 (亿元)	130	131

(7)、本月了结交易盈亏情况统计固定表格:

项目	科目	单位: 笔或亿元
互换	本月了结笔数	132
	本月了结交易涉及名义本金	133
	收入现金流	134
	支出现金流	135
	使用保证金形成的净收益对应现金流	136
	对冲成本	137
期权	本月了结笔数	138
	本月了结交易涉及名义本金	139
	权利金收入	140
	对冲成本	141
远期	本月了结笔数	142
	本月了结交易涉及名义本金	143

	收入现金流（或交割日公允价值）	144
	支出现金流（或交割日公允价值）	145
	对冲成本	146

(8)、本月会计损益统计固定表格:

项目	本月发生额（亿元）			本年累计额（亿元）		
	互换	期权	远期	互换	期权	远期
已实现损益	147	148	149	150	151	152
公允价值变动损益	153	154	155	156	157	158
损益合计	159	160	161	162	163	164