

场外证券业务报告系统 收益互换业务数据报送文件接口规范

版本 v1.0

中证机构间报价系统股份有限公司

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 | 10 |
| 3.1.5 | 报体格式 | 11 |
| 3.2 | 报送报体格式定义 | 12 |
| 3.2.1 | 主协议 | 12 |
| 3.2.2 | 主协议关联产品列表 | 15 |
| 3.2.3 | 补充协议 | 17 |
| 3.2.4 | 履约保证书 | 18 |
| 3.2.5 | 交易确认书 | 18 |
| 3.2.6 | 互换交易存续期管理 | 29 |
| 3.2.7 | 定期报告 | 32 |
| 3.2.8 | 重大事项报告 | 92 |
| 3.2.9 | 其他事项报告 | 93 |
| 4 | 附录 | 94 |
| 4.1 | 数据字典 | 94 |
| 4.1.1 | 接口标识 | 94 |
| 4.1.2 | 操作标识 | 94 |
| 4.1.3 | 响应码 | 94 |
| 4.1.4 | 定期报告填报说明 | 95 |

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，包括主协议、补充协议、交易确认书等。

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]_[报告类型代码]_[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. 报告类型代码：3 位字符，衍生品业务填写：YSP；
6. 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；
7. 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数，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_YSP_20200824_0001.zip

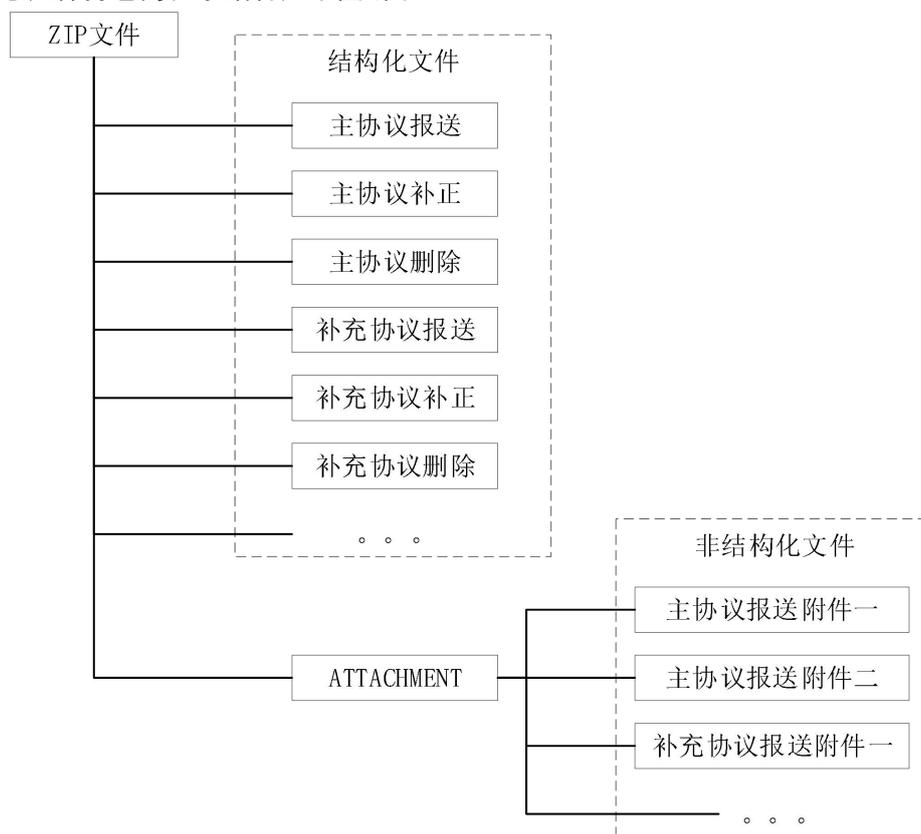
应答文件命名示例：

OTC_000899_131101_YSP_20200824_0001.zip

2.3 文件结构

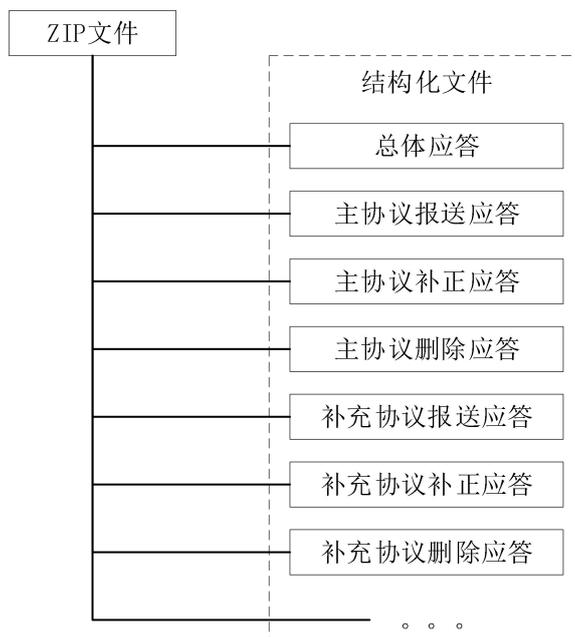
2.3.1 报送信息文件结构

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，一般情况下场外证券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]_[报告类型代码]_[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. 报告类型代码：3 位字符，衍生品业务填写：YSP；
5. 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；
6. 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_YSP_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]_[报告类型代码]_[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]_[报告类型代码]_[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. 报告类型代码：3 位字符，衍生品业务填写：YSP
5. 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；
6. 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；
7. 接口标识：5 位字符，具体见附录；
8. 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_YSP_20200824_0001_A1001_A.xml

结构化补正信息文件命名示例:

OTC_131101_000899_YSP_20200825_0001_A1001_U.xml

结构化应答文件命名示例:

OTC_131101_000899_YSP_20200824_0001_A1001_A_R.xml

OTC_131101_000899_YSP_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"?>
<Root>
  <Header>
    <Version>001</Version>
    <SenderCode>M80074</SenderCode>
    <ReceiverCode>000899</ReceiverCode>
    <ReportType>YSP</ReportType>
    <SendDate>2021-11-30</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A1001</BusiDataType>
    <OperationType>A</OperationType>
  </Header>
  <Body>
    <MasterAgrmt>
      <ExcelID>M800740008992021113000000001</ExcelID>
      <MasterAgrmtNo>htzq-zxy</MasterAgrmtNo>
      <SigningDate>2021-11-01</SigningDate>
      <MasterAgrmtVer>0</MasterAgrmtVer>
      <FillParty>1</FillParty>
      <CounterpartyName>证券股份有限公司</CounterpartyName>|
      <CounterpartyCode>91320000704041011J</CounterpartyCode>
      <ProCounterparty>1</ProCounterparty>
      <CounterpartyType>0</CounterpartyType>
      <CounterpartyRegdCptl>100000.00</CounterpartyRegdCptl>
      <MasterAgrmtAtt>证券主协议-新增.pdf</MasterAgrmtAtt>
      <CounterpartyInformationTuple>
        <Name>数据报送</Name>
        <Title>无</Title>
        <Telephone>29929999</Telephone>
        <Mobile>18272648588</Mobile>
        <Email>123@hundsun.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>M80074</ReceiverCode>
    <ReportType>YSP</ReportType>
    <SendDate>2021-11-30</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>M80074</ReceiverCode>
    <ReportType>YSP</ReportType>
    <SendDate>2021-11-30</SendDate>
    <FileNumber>0001</FileNumber>
    <BusiDataType>A1001</BusiDataType>
    <OperationType>R</OperationType>
    <RetCode>000000</RetCode>
    <RetMsg>接收成功</RetMsg>
  </Header>
  <Body>
    <MasterAgrmt>
      <ExcelID>M800740008992021113000000001</ExcelID>
      <RetCode>000000</RetCode>
      <RetMsg>接收成功</RetMsg>
      <BizID>Z21113000746001000002</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、报告类型代码、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. | ReportType | 报告类型代码 | C(3) | 是 | YSP | 衍生业务填写：YSP |

| | | | | | | |
|----|---------------|--------|-------|---|--|----------------------------|
| 5. | SendDate | 文件发送日期 | C(10) | 是 | | 校验规则： 必须是 YYYY-MM-DD |
| 6. | FileNumber | 文件序号 | C(4) | 是 | | 0000~9999 |
| 7. | BusiDataType | 接口标识 | C(5) | 是 | | 参见附录 |
| 8. | 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、报告类型代码、文件创建日期、文件序号、接口标识、操作标识、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. | ReportType | 报告类型代码 | C(3) | 是 | YSP | 衍生业务填写：YSP |
| 5. | SendDate | 文件发送日期 | C(10) | 是 | | 校验规则： 必须是 YYYY-MM-DD |
| 6. | FileNumber | 文件序号 | C(4) | 是 | | 0000~9999 |
| 7. | BusiDataType | 接口标识 | C(5) | 是 | | 参见附录 |
| 8. | OperationType | 操作标识 | C(1) | 是 | | 参见附录 |
| 9. | RetCode | 响应码 | C(6) | 是 | | 参见附录 |
| 10. | 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 | 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 | | | 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, 数据处理异常时为空。 |

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 (双方约定) | C(100) | 是 | | 双方约定; |
| 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) 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 | CODS | 统一社会信用代码 | C (18) | 是 | | 当交易对手方类型是除了境外金融机构、境外非金融机构外的机构时，必填 |
| 8 | CounterpartyCode | 交易对手编码 | C (20) | 否 | | 应当符合标准规范 |
| 9 | LEI | LEI 码 | C (20) | 否 | | 当交易对手方类型是境外金融机构、境外非金融机构时，必填 |
| 10 | ProCounterparty | 交易对手类别 | C (200) | 是 | 专业 1、非专业 0 | 应当符合《投资者适当性管理办法》 |
| 11 | CounterpartyType | 交易对手方类型 | C (20) | 是 | 证券公司 0、基金公司 1、期货公司 2、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 | 其他金融机构为监管部门发牌的机构应当符合标准规范 |

| | | | | | | |
|----|----------------------|---------------|-----------|---|---|---|
| | | | | | 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（一般工商企业） 13、境外金融机构 14、境外非金融机构 15、商业银行子公司 16、证券公司资产管理子公司 17、证券公司其他子公司 18、政策性银行 19、外资银行 20、期货资产管理公司 21 | |
| 12 | 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；参照国家统计局发布的《国民经济行业分类》 |
| 13 | 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； |
| 14 | MasterAgrmtRemark | 主协议备注 | C (1024) | 否 | | 交易对手是否为国有或国有 |

| | | | | | | |
|----|------------------------------|-----------|-------|---|------------------|----------------------|
| | | 注 | | | | 控股企业，及其他需要说明事项； |
| 15 | MasterAgrmtAtt | 主协议附件 | A | 是 | | 校验规则：只支持 PDF 格式； |
| 16 | CounterpartyIdentity | 交易对手方身份 | C (2) | 是 | 产品管理人 1、自营 2 | |
| 17 | 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】 |

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：补正时必须填； |
| 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 | CounterpartyCode(Products) | 交易对手码(产品) | C(20) | 是 | | 应当符合标准规范 |
| 5 | 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; |
| 6 | 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; |
| 7 | 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; |
| 8 | 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； |
| 9 | 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 | 补充协议编号 | 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：补正时必须填； |
| 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 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； |

| | | | | | | |
|---|------------------|---------------|--------|---|----------------------------|--|
| | | 号(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 | SwapType | 互换交易类型 | C(2) | 是 | 客户多头 0、客户空头 1、多空组合 2、其他 99 | |
| 8 | 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; |
| 9 | DueDate | 到期日 | C(10) | 是 | | 交易双方在交易有效约定中指定该交易结束的日期。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； |
| 10 | SettlementDate | 结算日 | C(10) | 否 | | 交易双方在交易有效约定中指定的进行结算金额收付的日期。校验规则：必须是YYYY-MM-DD； |
| 11 | Currency | 结算货币 | C(2) | 是 | CNY 0、USD 1、EUR 2、HKD 3、GBP 4、JPY 5、其他 6 | 使用货币通用代码（大写） |
| 12 | NotinalPrincipleAmt | 名义本金额(人民币) | N(36,2) | 是 | 名义本金为标的期初价格乘以数量乘以乘数 | 多空组合填写多头名义本金与空头名义本金孰高 |
| 13 | 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 | |
| 14 | 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 | |
| 15 | TradingPlace(Other) | 交易场所(其他) | C(200) | 否 | | 交易场所选“99其他交易场所”时，必填 |
| 16 | UndrlygAssetType | 标的类型 | C(2) | 是 | 权益类 0、大宗商品 1、利率 | 对于多类别资产组合，单一资产类别占比大等于 |

| | | | | | | |
|----|-----------------------------|----------------|---------|---|--|---------------------------------|
| | | | | | 2、信用类 3、汇率 4、混合类 5、其他 99 | 80%的,分类为该类别,各资产类别占比均小于80%的,为混合类 |
| 17 | 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 |
| 18 | CostPaymentTuple | 费用端支付 | T | | | 字段信息详见互换交易确认书【费用端支付】 |
| 19 | 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 | |
| 20 | 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,全额担保时必填; |
| 21 | 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,全额担保时必填; |
| 22 | CollInstruction | 担保品使用说明 | C(1024) | 否 | | 检验规则:当担保品收取方是否可使用担保品选择“是”,必填; |
| 23 | CalculateCollInterest | 是否计算担保品价值产生利息 | C(5) | 否 | 是 true、否 false | 检验规则:履约担保类型为部分担保,全额担保时必填; |
| 24 | PerformanceCollInitialRatio | 履约担保品初 | N(5,2) | 否 | | 校验规则:1、当履约保障类型选择部分担保或全 |

| | | | | | | |
|----|----------------------------|---------------|---------|---|--------------|---|
| | | 始比率 (%) | | | | 额担保时必填; 2、大于等于 0 的数字, 最多 2 位小数, 该值为 100%时, 填写 100.00。 |
| 25 | 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、大于等于 0 的数字, 最多 2 位小数, 该值为 100%时, 填写 100.00。 |
| 26 | 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、大于等于 0 的数字, 最多 2 位小数, 该值为 100%时, 填写 100.00。 |
| 27 | MaintainGuaranteeRatio | 维持担保比率 (%) | N(5, 2) | 是 | | 担保品占名义本金比例, 大于等于 0 的数字, 最多 2 位小数。担保比例为 80.00%, 则填写 80.00。 |
| 28 | PerformanceGuaranteeAtt | 履约担保附件 | A | 否 | | 校验规则: 只支持 PDF 格式; |
| 29 | 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 |
| 30 | 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】, 检验规则: 履约担保类型为部分担保, 全额担保时必填; |

| | | | | | | |
|----|---------------------------|-------------|---------|---|----------------------|--|
| 31 | Remark | 备注 | C(1024) | 否 | | 上述所有字段没有涵盖且需要说明的信息 |
| 32 | ComplianceOpinion | 合规意见书 | A | 否 | | 校验规则：只支持 PDF 格式； |
| 33 | PtyAUndrlygAssetNo | 标的个数 | C(2) | 是 | 单一标的 0、多标的 1 | 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 |
| 34 | PtyAProfitCalculationInfo | 收益计算说明 | C(1024) | 是 | | 详细说明收益计算方式 |
| 35 | PtyAProfitRemark | 收益备注 | C(1024) | 否 | | 填写上述字段或交易确认书中不能包含的信息 |
| 36 | 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； |
| 37 | PytAPdctCode | 甲方交易对手码(产品) | 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； |
| 38 | 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; |
| 39 | PytBPdctCode | 乙方交易对手码(产品) | 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; |

(2) 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、授信 2、现金与授信 3、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 | | |
| 4 | Remarks | 备注 | C(1024) | 否 | | |

3.2.5.1.1 互换交易费用端支付

包含在标签<CostPayment>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 | PaymentMethod | 支付方式 | C(2) | 是 | 浮动利率 2、固定利率 3 | |
| 2 | Payer | 支付方 | C(2) | 是 | 甲方 0、乙方 1 | |
| 3 | PaymentFreq | 支付频率 | C(2) | 是 | 期初支付 0、期末支付 1、期间多次支付 2 | |
| 4 | FixedInterestRate | 固定利率 (%) | N(20,2) | 否 | | 当支付方式选择为固定利率时，必填。大于等于0的两位小数，如5.12。 |
| 5 | FloatInterestRate | 浮动利率类型 | C(2) | 否 | Shibor3M 0、FR007 1、ShiborON 2、人民币一年定期存款利率 3、Libor3M 4、Hibor3M 5、Libor1M 6、Hibor1M 7、其他 99 | 当支付方式选择为浮动利率时，必填。应当符合标准规范 |
| 6 | ReferenceofFloatingInterestRate | 浮动利率参考标的 | C(20) | 否 | | 当支付方式选择为浮动利率时，必填。 |
| 7 | BasePoint | 浮动基点 | C(20) | 否 | | 整数。当支付方式选择为浮动利率时，必填。如30，-30。 |

3.2.5.2 互换交易权益端支付

对于除多空组合外的收益互换，该列表只允许在新增合约时填写；对于多空组合收益互换，该列表需要在标的信息发生调整后1个交易日内补充调整信息。

包含在标签<SwapEquityPayment>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 | SwapEquityPayment | 权益端支付 | T | | | 字段信息详见互换交易确认书【权益端支付】 |
| 4 | OpenandClosingNO. | 调仓编号 | C(20) | 否 | | 首次随交易确认书上报不填；随存续期信息上报时，与存续期信息调仓编号相对应，同一笔交易确认书下应当保证唯一性 |

权益端支付

| | | | | | | |
|---|---------------------|----------|-------|---|--|------------------------|
| 1 | PaymentMethod | 支付方式 | C(2) | 是 | 权益收益(多头) 0、权益收益(空头) 1、浮动利率收益 2、权益收益多空组合 4 | 当互换类型选择多空组合时,选权益收益多空组合 |
| 2 | Payer | 支付方 | C(2) | 是 | 甲方 0、乙方 1 | |
| 3 | PaymentFreq | 支付频率 | C(2) | 是 | 期初支付 0、期末支付 1、期间多次支付 2 | |
| 4 | OpenandClosingDate | 标的开/平仓日期 | C(10) | 是 | YYYY-MM-DD | |
| 5 | UndrlyAssetDtldType | 标的子类 | 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 | 应当符合标准规范 |

| | | | | | | |
|----|----------------------|-------------------|-------------|---|---|---|
| | | | | | 股指 16、 汇率 17、 利率 18、 其他标的 99 | |
| 6 | UndrlygAssetCode | 挂钩标的 的编码 | C(50) | 是 | | 标的代码或 符合标准规 范要求的编 码 |
| 7 | UndrlygAssetName | 标的名称 | C(50) | 是 | | |
| 8 | UndrlygAssetTradgPlc | 标的交易 场所 | C(50) | 是 | | |
| 9 | UndrlygAssetPrice | 标的价格 | N(36,4) | 是 | 四位小数 | |
| 10 | UndrlygAssetPosition | 开平仓 | C(50) | 是 | 开多仓 0、 开空仓 1、 平多仓 2、 平空仓 3 | 支付方式为 权益收益(多 头) 0、权益 收益(空 头) 1、浮动 利率收益 2 时,只能填写 开多仓 0、开 空仓 1。 |
| 11 | UndrlygAssetAmt | 标的数量 | N(36,6) | 是 | 六位小数 | 大于0 |
| 12 | ContractMultiplier | 合约乘 数 | N(36) | 是 | 整数 | |
| 13 | LNotinalPrincipleAmt | 多头名 义本金 (元) | N(36,6) | 否 | 标的数量* 合约乘数* 标的价格 | 互换交易类 型为多空组 合 2,必填。 |
| 14 | SNotinalPrincipleAmt | 空头名 义本金 (元) | N(36,6) | 否 | -标的数量 *合约乘数 *标的价格 | 互换交易类 型为多空组 合 2,必填。 |

3.2.5.3 交易确认书附件

包含在标签<ConfirmationAtt>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 | 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 | ConfirmationFiles | 交易确认书附件 | A | 是 | | 校验规则：只支持 PDF 格式； |

3.2.6 互换交易存续期管理

包含在标签<SwapDurationManagement>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 | OpenandClosingNO. | 调仓编号 | C(20) | 否 | | 调仓 4时，必填，与权益端调仓编号相对应，同一笔交易确认书下应当保证唯一性 |
| 3 | ConfirmationNo | 交易确认书编号 (双方约定) | C(100) | 是 | | 双方约定； |
| 4 | DurationOperationType | 存续期操作类型 | C(2) | 是 | 展期 1、终止 2、违约终止 3、调仓 4 | 互换交易类型为多空组合 2，可选调仓 4。 |
| 5 | DurationOperationDate | 操作发生日期 | C(10) | 是 | YYYY-MM-DD | 分别为确定进行展期日期、合约终止日期、交易发生违约日期、多空组合收益互换发生标的调仓日期。 |
| 6 | RenewalDate | 展期后到期日 | C(10) | 否 | YYYY-MM-DD | 操作类型为展期 1，必填。不存在展期操作数据，不得早于原合约到 |

| | | | | | | |
|----|--------------------|-----------|---------|---|-----------|--|
| | | | | | | 期日；存在展期操作数据，不得早于最近一次展期数据的“展期后到期日”。 |
| 7 | DefaultingParty | 违约方 | C(2) | 否 | 甲方 0、乙方 1 | 操作类型为违约终止 3，必填。 |
| 8 | DefaultEvent | 违约事件说明 | C(1024) | 否 | | 操作类型为违约终止 3，必填。 |
| 9 | ChangeAmount | 名义本金变动(元) | N(36,2) | 否 | 两位小数 | 首次存续期操作，为较名义本金的增减情况，存在存续期操作的，为较最近一次存量名义本金的增减情况，增加为正数，减少为负数。其中，操作类型为2-4时必填，为终止 2、违约终止 3只能减少；操作类型为调仓 4，可增可减。 |
| 10 | Balance | 存量名义本金(元) | N(36,2) | 否 | | 对于非多空收益互换，名义本金/最近一次存量名义本金+本次名义本金变动=本次存量名义本金；对于多空组合收益互换，存量名义本金为存量多头名义本金和空头名义本金孰大者。 |
| 11 | AmountPaidThisTime | 本次支付金额 | N(36,2) | 否 | 两位小数 | 操作类型为 |

| | | | | | | |
|----|---------------------------|----------|---------|---|--|--|
| | | (元) | | | | 2-4 时必填。 支付为正，收取为负。 |
| 12 | MarginRatio | 保证金比例(%) | N(36,2) | 是 | | 为保证金占存量名义本金比例，其中多空组合收益互换存量名义本金为存量多头名义本金和空头名义本金孰大者。 |
| 13 | CurrentPositionDetails | 合约持仓明细 | T | 是 | | 详见【合约持仓明细】，操作类型为终止 2、违约终止 3、调仓 4时，必填。 |
| 14 | SwapDurationManagementAtt | 存续期信息附件 | A | 否 | | 校验规则：只支持 PDF 格式； |

(1)合约持仓明细

| 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 | UndrlygAssetCode | 挂钩标的编码 | C(200) | 是 | | 标的代码或符合标准规范的编码 |
| 2 | 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、 | 应当符合标准规范 |

| | | | | | | |
|---|----------------------|---------|---------|---|---|---|
| | | | | | 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、 利率 18、 其他标的 99 | |
| 3 | UndrlygAssetName | 标的名称 | C(200) | 是 | | |
| 4 | UndrlygAssetTradgPlc | 标的交易场所 | C(200) | 是 | | |
| 5 | UndrlygAssetPrice | 标的价格 | N(36,4) | 是 | 四位小数 | |
| 6 | InvestorPosition | 客户持仓方向 | C(2) | 是 | 客户多头 0、客户空 头 1 | |
| 7 | UndrlygAssetAmt | 标的数量 | N(36,6) | 是 | 六位小数 | |
| 8 | ContractMultiplier | 合约乘数 | N(36) | 是 | 整数 | |
| 9 | NotinalPrincipleAmt | 名义本金(元) | N(36,6) | 是 | | 两位小数。 Σ 标的持仓数量 合约乘数* 期初价格 |

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 | MainAgreement AddedThisMonth | 主协议本月 新增 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 5 | MainAgreement AccumulatedThisYear | 主协议本年 累计 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 6 | MainAgreement ValidatedAtEndOfThisMonth | 主协议截至 月末存续协 议数量 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 7 | SupplementalA greementAdded ThisMonth | 补充协议本 月新增 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 8 | SupplementalA greementAccum ulatedThisYear | 补充协议本 年累计 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 9 | SupplementalA greementValid atedAtTheEndOfT hisMonth | 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 | PerformanceGu aranteeAgreem entAddedThisM onth | 履约担保协 议本月新增 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 11 | PerformanceGu aranteeAgreem entAccumulate dThisYear | 履约担保协 议本年累计 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 12 | PerformanceGu aranteeAgreem entValidatedAtE ndOfThisMonth | 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 | TransactionCo nfirmationAdd edThisMonth | 交易确认书 本月新增 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 14 | TransactionCo nfirmationBoo kAccumulatedT hisYear | 交易确认书 本年累计 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 15 | TransactionCo nfirmationVal | 交易确认书 截至月末存 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|--------------------------------------|-----------|---|--|---------------|
| | idedAtEndOfThisMonth | 续协议数量 | | | | |
| 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 | IncomeSwapHas | 收益互换已 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|--|------------------------------|-----------------|---|--|-------------------|
| | SignedLegalPersonNumber | 签约法人 (家) | | | | |
| 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 | OTCOptionsWithinIndividualStocksLateLastMonthDurationScale | 场外期权境 内个股上月 末存续期规 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 末存续期规 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 末存续期规 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 | RevenueExchange | 收益互换境 | N | 是 | | 校验规则: 保留四位小 |

| | | | | | | |
|----|---|-----------------|-------------|---|--|---------------|
| | geDomesticIndividualStocksLastMonthDurationScale | 内个股上月末存续规模 | (36,4) | | | 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 | RevenueExchangeDomesticIndividualStocksTheNewSizeOfTheIncreaseInT | 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; |

| | | | | | | |
|----|---|----------------|-------------|---|--|---------------|
| | hisMonth | | | | | |
| 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; |

| | | | | | | |
|----|---|------------------|-------------|---|--|--------------|
| | tionScale | | | | | |
| 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； |

| | r | | | | | |
|----|---|-------------------|-----------------|---|--|---------------|
| 75 | TotalNewScale InThisYear | 本年累计新增规模规模合计 | 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 | OTCOptionsThisMonthToTermi | 场外期权境内股指本月 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|-----|--|------------------|-------|---|--|------------|
| | nateTheContractWithinTheTerritoryOfTheStockIndexNumber | 终止合约笔数 | | | | |
| 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 | IncomeSwapOtherSubjectTerminatesTheNumb | 收益互换其他标的本月终止合约笔 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|-----|---|-------------------------------|-------|---|--|------------|
| | erOfContracts ThisMonth | 数 | | | | |
| 102 | TotalNumberOf ContractsTerm inatedThisMon th | 本月终止合 约笔数规模 合计 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 103 | OTCDomesticSt ockIndexNumbe rOfRemainingC ontractsAtThe EndOfThisMont h | 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 | OTCDomesticSt ockNumberOfRe mainingContra ctsAtTheEndOf ThisMonth | 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 | OTCCommoditie sNumberOfRema iningContract sAtTheEndOfTh isMonth | 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 | OTCOtherSubje ctNumberOfRem ainingContract sAtTheEndOfT hisMonth | 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 | IncomeExchang eDomesticStoc kIndexNumberO fRemainingCon tractsAtTheEn dOfThisMonth | 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 | IncomeExchang eDomesticStoc kNumberOfRema iningContract sAtTheEndOfTh isMonth | 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 | IncomeExchang eCommoditiesN umberOfRemain ingContractsA tTheEndOfThis | 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; |

| | | | | | | |
|-----|---|--------------------|-------|---|--|------------|
| | Month | | | | | |
| 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 | TotalNominalPrincipalAmountOfSwapThisMonth | 本月末收益互换存量名义本金总额 | N(36,2) | 是 | | 校验规则：保留两位小数； |
| 122 | TotalNominalPrincipalAmountOfSwapLastMonth | 上月末收益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 | 本月末收益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 | 上月末收益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 | 本月末收益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 | 上月末收益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 | 本月末收益互换证券担保物价值 | N(36,2) | 是 | | 校验规则：保留两位小数； |
| 128 | SwapSecuritiesCollateralValue | 上月末收益互换证券担 | N(36,2) | 是 | | 校验规则：保留两位小数； |

| | | | | | | |
|-----|---|---------------------|-----------|---|--|---------------|
| | lueLastMonthThisMonth | 保物价值 | 2) | | | |
| 129 | ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessThisMonthFull | 本月末收益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 | 上月末收益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 | ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessThisMonthNet | 本月末收益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; |
| 132 | ProportionOfTheOverallPerformanceOfTheSwapBusinessLastMonthNet | 上月末收益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 | 本月末收益互换本月违约客户数 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 134 | SwapNumberOfDefaultCustomersAtThisMonthLastMonth | 上月末收益互换本月违约客户数 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 135 | SwapDefaultTransactionNumberAtThisMonthThisMonth | 本月末收益互换本月违约交易数 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 136 | SwapDefaultTransactionNumberAtThisMonthLastMonth | 上月末收益互换本月违约交易数 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 137 | TotalSwapDefaultCustomerNumberInThisYearThisMonth | 本月末收益互换本年累计违约客户数 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 138 | TotalSwapDefaultCustomerNu | 上月末收益互换本年累 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|-----|--|------------------------------|-----------------|---|--|------------------|
| | mberInThisYearLastMonth | 计违约客户 数 | | | | |
| 139 | SwapNumberOfDefaultCustomersInThisYearThisMonth | 本月末收益 互换本年累 计违约交易 数 | N(20) | 是 | | 校验规则：正整数； |
| 140 | SwapNumberOfDefaultCustomersInThisYearLastMonth | 上月末收益 互换本年累 计违约交易 数 | N(20) | 是 | | 校验规则：正整数； |
| 141 | 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； |
| 142 | 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； |
| 143 | CashBalanceAtEndOfThisMonth | 本月末持有 现金余额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则：保留两位小 数； |
| 144 | CashBalanceAtEndOfLastMonth | 上月末持有 现金余额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则：保留两位小 数； |
| 145 | HoldStockMarketValueAtEndOfThisMonth | 本月末持有 股票市值 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则：保留两位小 数； |
| 146 | HoldStockMarketValueAtEndOfLastMonth | 上月末持有 股票市值 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则：保留两位小 数； |
| 147 | HoldMarketValueOfBondsAtTheEndOfThisMonth | 本月末持有 债券市值 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则：保留两位小 数； |
| 148 | HoldMarketValueOfBondsAtTheEndOfLastMonth | 上月末持有 债券市值 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则：保留两位小 数； |
| 149 | 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； |

| | | | | | | |
|-----|--|------------------|--------------|---|--|----------------------------|
| 150 | 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; |
| 151 | OwnedBankFinanceAtTheEndOfThisMonth | 本月末持有银行理财 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 152 | OwnedBankFinanceAtTheEndOfLastMonth | 上月末持有银行理财 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 153 | HoldTrustProductAtTheEndOfThisMonth | 本月末持有信托产品 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 154 | HoldTrustProductAtTheEndOfLastMonth | 上月末持有信托产品 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 155 | InsuranceProductsAreHeldAtTheEndOfThisMonth | 本月末持有保险产品 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 156 | InsuranceProductsAreHeldAtTheEndOfLastMonth | 上月末持有保险产品 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 157 | HoldOtherProductsAtTheEndOfThisMonth | 本月末持有其他产品 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 158 | HoldOtherProductsAtTheEndOfLastMonth | 上月末持有其他产品 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 159 | SettledSwapItemsAtThisMonth | 收益互换本月了结笔数 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数, 长度介于 0 和 20 之间; |
| 160 | SettledSwapTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth | 收益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; |
| 161 | SwapIncomeCashFlow | 收益互换收入现金流 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 162 | SwapExpensesCashFlow | 收益互换支出现金流 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |

| | | | | | | |
|-----|--|----------------------|--------------|---|--|----------------------------|
| 163 | CashFlowCorrespondingToNetIncomeOnSwapMargin | 收益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; |
| 164 | SwapHedgeCost | 收益互换对冲成本 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 165 | SettledOptionItemsAtThisMonth | 场外期权本月了结笔数 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数, 长度介于 0 和 20 之间; |
| 166 | SettledOptionTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth | 场外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; |
| 167 | OptionPremiumIncome | 场外期权权利金收入 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 168 | OptionHedgeCost | 场外期权对冲成本 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 169 | BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisMonth | 互换合约端损益本月发生额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 170 | BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisMonth | 期权合约端损益本月发生额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 171 | BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisYear | 互换合约端损益本年累计额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 172 | BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisYear | 期权合约端损益本年累计额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 173 | BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth | 互换对冲端损益本月发生额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 174 | BalanceOfOptionChangedGain | 期权对冲端损益本月发 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |

| | | | | | | |
|-----|---|--------------------|--------------|---|--|-----------------|
| | sAndLossesInFairValueAtThisMonth | 生额 | 2) | | | |
| 175 | BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear | 互换对冲端损益本年累计额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 176 | BalanceOfOptionChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear | 期权对冲端损益本年累计额 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |
| 177 | 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; |
| 178 | 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; |
| 179 | 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; |
| 180 | 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; |
| 181 | IncreaseBusinessDetailsThisMonthTuple | 本月新增业务明细 | T | | | 字段信息详见本月新增业务明细 |
| 182 | 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 |
| 183 | TargetCaseAndHedgeTuple | 标的情况与对冲 | T | | | 字段信息详见标的情况与对冲 |
| 184 | MarginofSubsistSwap | 收益互换整体业务存量对应保证金(元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 185 | HedgedMarketValue of | 收益互换整体业务对冲 | N (36, 2) | 是 | | |

| | | | | | | |
|-----|---|---|-----------------|---|--|--|
| | Swap | 持仓市值 (元) | 2) | | | |
| 186 | LeverageRatio ofSwap | 收益互换整 体业务杠杆 率 | N (5, 2) | 是 | | |
| 187 | Marginof SubsistStock IndexSwap | 收益互换股 指标的存量 对应保证金 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 188 | HedgedMarketV alueofStock IndexSwap | 收益互换股 指标的对冲 持仓市值 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 189 | LeverageRatio ofStockIndex Swap | 收益互换股 指标的杠杆 率 | N (5, 2) | 是 | | |
| 190 | MarginofSubsi stStockSwap | 收益互换个 股标的存量 对应保证金 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 191 | HedgedMarket ValueofStockS wap | 收益互换个 股标的对冲 持仓市值 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 192 | LeverageRatio ofStockSwap | 收益互换个 股标的杠杆 率 | N (5, 2) | 是 | | |
| 193 | Marginand Premiumof SubsistOption | 场外期权整 体业务存量 对应保证金 (元)+期权 费(元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 194 | HedgedMarketV alueofOption | 场外期权整 体业务对冲 持仓市值 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 195 | LeverageRatio ofOption | 场外期权整 体业务杠杆 率 | N (5, 2) | 是 | | |
| 196 | Marginand Premiumof SubsistStock IndexOption | 场外期权股 指标的存量 对应保证金 (元)+期权 费(元) | N (36, 2) | 是 | | |

| | | | | | | |
|-----|--|---|-----------------|---|--|--|
| 197 | HedgedMarket ValueofStock IndexOption | 场外期权股 指标的对冲 持仓市值 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 198 | LeverageRatio ofStockIndex Option | 场外期权股 指标的杠杆 率 | N (5,2) | 是 | | |
| 199 | Marginand Premiumof SubsistStock Option | 场外期权个 股标的存量 对应保证金 (元)+期权 费(元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 200 | HedgedMarket ValueofStock Option | 场外期权个 股标的对冲 持仓市值 (元) | N (36, 2) | 是 | | |
| 201 | LeverageRatio ofStockOption | 场外期权个 股标的杠杆 率 | N (5,2) | 是 | | |

(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 | 报送机构 名称(全 称) | C(100) | 否 | | |
| 2 | CounterpartyName | 交易对手 名称(全 称) | C(100) | 否 | | |
| 3 | CounterpartyProd uctName | 交易对手 产品名称 (如有) | C(100) | 否 | | |
| 4 | TransactionConf irmationNumber | 交易确认 书编号(报 告库编号) | C(100) | 否 | | |
| 5 | BusinessType | 业务类型 | C(2) | 否 | 11: 收益互换(客 户多头) 12: 收益互换(客 户空头) 13: 多空组合收益 互换 14: 其他收益互换 | 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 |

| | | | | | | |
|----|--|---------------------------|-------------|---|--|---|
| | | | | | 02: 场外期权 | "互换"时,"收益互换标的小类(收益互换填写)"必填; |
| 6 | NotionalPrincipalAmount/ LNotionalPrincipalAmount | 名义本金金额(亿元)/多头名义本金(多空组合填写) | 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; |
| 7 | SNotionalPrincipalAmount | 空头名义本金(亿元)(多空组合填写) | N (19,4) | 否 | | 多空组合收益互换填写保留四位小数 |
| 8 | StartDate | 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 |
| 9 | 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 |
| 10 | 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 | |
| 11 | UndrlyAssetName | 标的名称 | C(200) | | | |
| 12 | UndrlyAssetCode | 标的编码 | C(20) | | | |
| 13 | UndrlyAssetTradingPlc | 标的交易场所 | C(20) | | | |
| 14 | OptionObjectSecondClass | 场外期权标的小类(场外期权填写) | C(2) | 否 | 股票 01、股指 02、北交所/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 | 校验规则:如业务类型为期权,需填写本字段; |

| | | | | | | |
|----|---------------------------------|---------------------------------|----------|---|---|--|
| | | | | | 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 | |
| 15 | 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、北交所/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； |
| 16 | NonAnnualOptionFee | 期权费（非 年化）（%） （场外期 权填写） | 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；例 如，期权费为名 义本金 20%，填 写 20。 |
| 17 | OptionType | 期权类型 （场外期 | C (2) | 否 | 场外期权填写 香草 0、二元 1、 | 校验规则：如业 务类型为期权， |

| | | | | | | |
|--|--|------|--|--|--|---------|
| | | 权填写) | | | 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 | 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 | NameOfSecurities Company | 报送机构 名称 (全 称) | C (100) | 否 | | |
| 2 | CounterpartyName | 交易对手 名称 (全 称) | C (100) | 否 | | |
| 3 | CounterpartyProd uctName | 交易对手 产品名称 | C (100) | 否 | | |
| 4 | TransactionConfir mationNumber | 交易确认 书编号 (报 告库编号) | C (100) | 否 | | |
| 5 | BusinessType | 业务类型 | C (2) | 否 | 11: 收益互换 (客 户多头) 12: 收益互换 (客 户空头) 13: 多空组合收益 互换 14: 其他收益互换 02: 场外期权 | 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; |
| 6 | NotionalPrincipa lAmount/ LNotionalPrincip alAmount | 名义本金 金额 (亿 元) /多头 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; |
| 7 | SNotionalPrincip alAmount | 空头名义 本金 (亿 元) (多空 组合填写) | N (19,4) | 否 | | 多空组合收益 互换填写 保留四位小数 |
| 8 | StartDay | 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 |
| 9 | 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 |
| 10 | 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 | |
| 11 | UndrlygAssetName | 标的名称 | | | | |
| 12 | UndrlygAssetCode | 标的编码 | | | | |
| 13 | UndrlygAssetTradingPlc | 标的交易场所 | | | | |
| 14 | OptionSumInvestmentTargetType | 场外期权标的小类 (场外期权填写) | C (2) | 否 | 股票 01、股指 02、北交所/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、Shibor 19、银行间回购定盘(Fixing Repo Rate) 20、其他利率 21、其他标的 99 | 校验规则：如业务类型为期权，需填写本字段； |
| 15 | ExchangeSumInvestmentTargetType | 收益互换标的小类 (收益互换填写) | C (2) | 否 | 股票 01、股指 02、北交所/新三板挂牌股票 03、香港股票 04、香港股指 05、基金 | 校验规则：如业务类型为互换，需填写本字段； |

| | | | | | | |
|----|--------------------------|---------------------------------|------------------|---|--|--|
| | | | | | 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 | |
| 16 | OptionFee | 期权费（非 年化）（%） （场外期 权填写） | 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； |
| 17 | OptionType | 期权类型 （场外期 权填写） | C (2) | 否 | 场外期权填写 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 | 校验规则：如业 务类型为期权， 需填写本字段； |
| 18 | MaintainMarginRat ion | 本月末维 持保证金 比例（%） | N (20, 2) | 否 | | 指月末维持保 证金加浮动盈 亏占合约存续 名义本金的比 例；对于多空互 换，指维持保证 金加浮动盈亏 占多头名义本 金和空头名义 本金孰高的比 例。例如维持保 证金比例为 50%，填写 50.00。 |

| | | | | | | |
|----|----------------------------|------------|--------------|---|--|-----------------------|
| 19 | CorrelationCoefficient | 标的相关系数 | N (20, 2) | 否 | | 多空组合收益互换填写 |
| 20 | LongPositionContractValue | 多头合约价值 (元) | N (36, 4) | 否 | | 客户多头、多空组合收益互换填写。4 位小数 |
| 21 | ShortPositionContractValue | 空头合约价值 (元) | N (36, 4) | 否 | | 客户空头、多空组合收益互换填写。4 位小数 |

(3) 标的情况与对冲

| | 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 | |
| 3 | SumInvestmentTargetType | 标的分类 | C (2) | 否 | 01: 境内个股 02: 基金及基金专户 03: 境内股指期货 04: 大宗商品 05: 香港股票 06: 香港股指 99: 其他 | |
| 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 | | 标的编码 | C (20) | | | |
| 6 | 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; |
| 7 | 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; |
| 8 | 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; |
| 9 | 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; |

| | | | | | | |
|----|---|---------------|----------|---|--|-------------------------------|
| 10 | 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; 权益类填写股数 |
| 11 | 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; |

3.2.7.2 NAFMII 模板

包含在标签<PeriodicReportNAFMII>内

| 1 | 字段标识 | 字段中文名 | 字段类型 | 是否必填 | 代码取值 | 说明 |
|----|---|-------------|--------|------|------|-----------------------|
| 2 | BizID | 业务编号 | C (50) | 否 | | 校验规则: 补正时必须填; |
| 3 | Year | 年份 | N(4) | 是 | | 校验规则: 必须是 4 位整数; |
| 4 | Month | 月份 | N(2) | 是 | | 校验规则: 必须是 1-12 之间的整数; |
| 5 | MainAgreementLastMonthAccumulatedThisYear | 主协议上月末本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 6 | MainAgreementAddedThisMonth | 主协议本月新增 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 7 | MainAgreementAccumulatedThisYear | 主协议本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 8 | MainAgreementValidatedAtEndOfThisMonth | 主协议本月末有效 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 9 | SupplementalAgreementLastMonthAccumulatedThisYear | 补充协议上月末本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 10 | SupplementalAgreementAddedThisMonth | 补充协议本月新增 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 11 | SupplementalAgreementAccumulatedThisYear | 补充协议本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|---------------|-----------|---|--|---------------|
| 12 | SupplementalAgreementValidatedAtTheEndOfThisMonth | 补充协议本月末有效 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 13 | PerformanceGuaranteeAgreementLastMonthAccumulatedThisYear | 履约担保协议上月末本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 14 | PerformanceGuaranteeAgreementAddedThisMonth | 履约担保协议本月新增 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 15 | PerformanceGuaranteeAgreementAccumulatedThisYear | 履约担保协议本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 16 | PerformanceGuaranteeAgreementValidatedAtEndOfThisMonth | 履约担保协议本月末有效 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 17 | TransactionConfirmationLastMonthAccumulatedThisYear | 交易确认书上月末本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 18 | TransactionConfirmationAddedThisMonth | 交易确认书本月新增 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 19 | TransactionConfirmationBookAccumulatedThisYear | 交易确认书本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 20 | TransactionConfirmationValidatedAtEndOfThisMonth | 交易确认书本月末有效 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 21 | 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; |
| 22 | 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; |
| 23 | 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; |

| | | | | | | |
|----|--|-----------------------|--------------|---|--|---------------|
| 24 | 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; |
| 25 | 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; |
| 26 | ContractsInterestRateTradedAtTheBeginningOfThisMonth | 合约笔数利率 本月初存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 27 | NumberOfContractedInterestRatesThisMonthToAddTransactions | 合约笔数利率 本月新增交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 28 | AmountOfInterestInTheContractsSettledThisMonth | 合约笔数利率 本月了结交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 29 | ContractInterestRatesRemainTradedAtTheEndOfThisMonth | 合约笔数利率 本月末存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 30 | 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; |
| 31 | 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; |
| 32 | 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; |
| 33 | 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; |
| 34 | 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; |
| 35 | NominalPrincipalGoldAsOfTheEnd | 名义本金黄金 截至本月末年 | N (36, 2) | 是 | | 校验规则: 保留两位小数; |

| | | | | | | |
|----|--|-------------------|-----------|---|--|---------------|
| | OfThisYearTheNewTransaction | 度新增交易 |) | | | |
| 36 | TheNumberOfContractsForGoldIsTradedAtTheBeginningOfThisMonth | 合约笔数黄金本月初存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 37 | TheNumberOfContractsGoldThisMonthToAddTransactions | 合约笔数黄金本月新增交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 38 | TheNumberOfContractsIsGoldThisMonth | 合约笔数黄金本月了结交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 39 | TheNumberOfContractsIsGoldAtTheEndOfThisMonth | 合约笔数黄金本月末存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 40 | 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; |
| 41 | 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; |
| 42 | 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; |
| 43 | 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; |
| 44 | 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; |
| 45 | 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; |
| 46 | ContractsForeign | 合约笔数外汇 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|--|-------------------|-----------|---|--|---------------|
| | nExchangeIsTradedAtTheBeginningOfThisMonth | 本月初存续交易 | | | | |
| 47 | ContractNumberForeignExchangeThisMonthNewTransaction | 合约笔数外汇本月新增交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 48 | TheNumberOfContractsForForeignExchangeTransactionsThisMonth | 合约笔数外汇本月了结交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 49 | ContractsForeignExchangeIsTradedAtTheEndOfThisMonth | 合约笔数外汇本月末存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 50 | 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; |
| 51 | 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; |
| 52 | 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; |
| 53 | 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; |
| 54 | 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; |
| 55 | 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; |
| 56 | TheNumberOfContractsIsTheBeginningOfThisMonth | 合约笔数其他本月初存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 57 | ContractNumberOtherNewTransact | 合约笔数其他本月新增交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|--|-------------------|-----------|---|--|---------------|
| | ionsThisMonth | | | | | |
| 58 | TheNumberOfContractsOtherTransactionsThisMonth | 合约笔数其他本月了结交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 59 | ContractsOthersRemainTradedAtTheEndOfThisMonth | 合约笔数其他本月末存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 60 | 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; |
| 61 | 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; |
| 62 | 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; |
| 63 | 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; |
| 64 | 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; |
| 65 | 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; |
| 66 | TheTotalNumberOfContractsIsTradedAtTheBeginningOfThisMonth | 合约笔数合计本月初存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 67 | TheTotalNumberOfContractsIsAddedThisMonth | 合约笔数合计本月新增交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 68 | TheTotalNumberOfContractsIsSettledThisMonth | 合约笔数合计本月了结交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 69 | TheTotalNumberOfContractsIsTradedAtTheEndOfThisMonth | 合约笔数合计本月末存续交易 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|-------------------|--------|---|--|---------------|
| | isMonth | | | | | |
| 70 | 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； |
| 71 | InterestRateSwapDetails | 利率互换明细 | T | | | 字段信息详见利率互换明细 |
| 72 | InterestRateOptionDetails | 利率期权明细表 | T | | | 字段信息详见利率期权明细 |
| 73 | 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 | CounterpartyAllocationProduct | 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 0、基金公司 1、期货公司 2、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(一般工商企业) 13、境外金融机构 14、境外非金融机构 15、商业银行子公司 16、证券公司资产管理子公司 17、证券公司其他子公司 18、政策性银行 19、外资银行 20、期货资产管理公司 21 | |
| 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) 利率期权明细表

| 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 | 期权卖方 | C (2) | 否 | | |
| 7 | OptionType | 期权类型 | C (2) | 否 | 互换 01、期 权 02、远期 03、掉期 04 | |
| 8 | OptionPosition | 期权方向 | C (2) | 否 | 01: 互换看涨 02: 互换看跌 03: 利率上限 04: 利率下限 | |
| 9 | CounterpartyType | 交易对手方类 型 | C (2) | 否 | 证券公司 0、 基金公司 1、 期货公司 2、 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(一般工 商企业) 13、 境外金融机 构 14、境外 非金融机构 15、商业银 行子公司 16、证券公 司资产管理 子公司 17、 证券公司其 他子公司 18、政策性 银行 19、外 | |

| | | | | | | |
|----|---|------------|-----------|---|--|--|
| | | | | | 资银行 20、 期货资产管理公司 21 | |
| 10 | CounterpartyIsProfessionalInstitutionsOrNot | 交易对手是否专业机构 | C (2) | 否 | 是 01、否 02 | |
| 11 | NotionalPrincipalAmount | 名义本金 (亿元) | N (20, 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; |
| 12 | ExcerciseInterestRate | 行权利率 (%) | N (20, 2) | 否 | | |
| 13 | InvestmentTarget | 标的名称 | C (2) | 否 | 01: lpr1y 02: lpr5y 03: lpr1y_irs 04:lpr5y_irs 05: 其他 | |
| 14 | DeliveryType | 交割方式 | C(2) | 否 | 01: 实物交割 02: 现金交割 | |
| 15 | StartDate | 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 |
| 16 | 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) 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 0、 基金公司 1、 期货公司 2、 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(一般工 商企业) 13、 境外金融机 构 14、境外 非金融机构 15、商业银 行子公司 16、证券公 司资产管理 子公司 17、 证券公司其 他子公司 18、政策性 银行 19、外 资银行 20、 期货资产管 理公司 21 | |

| | | | | | | |
|----|---|------------|-----------|---|---|---|
| 8 | CounterpartyIsProfessionalInstitutionsOrNot | 交易对手是否专业机构 | C (2) | 否 | 是 01、否 02 | |
| 9 | 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; |
| 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 | StartDate | 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 | MainAgreementLastMonthAccumu | 主协议上月末本年累计 | N (20) | 是 | | 校验规则：正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|---------------|-------|---|--|------------|
| | latedThisYear | | | | | |
| 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 | 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 | TransactionConfirmedAtEndOfThisMonth | 交易确认书 本月末有效 | N(20) | 是 | | 校验规则：正整数； |
| 20 | SWAPNominalCapitalStockAtBeginning | 收益互换类 名义本金期 初存量 | N(36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |
| 21 | SWAPIncreasedOriginalTransactionNominalCapitalAtThisMonth | 收益互换类 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 | 收益互换类 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 | 收益互换类 名义本金期 末存量 | N(36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |
| 24 | SwapCategoryNominalPrincipalThisYearCumulativeInitialTransaction | 收益互换类 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 | 场外期权类 名义本金期 初存量 | N(36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |
| 26 | OptionIncreasedOriginalTransactionNominalCapitalAtThisMonth | 场外期权类 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 | OptionNotionalPrincipalAmountAllowedToBeTerminatedAtThis | 场外期权类 本月终止交 易名义本金 | N(36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |

| | | | | | |
|----|--|---------------------|---------|---|---------------|
| | Month | | | | |
| 28 | OptionOfNotionalPrincipalStockAtEnding | 场外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 | 场外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 | 收益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 | NumberOfNewSwapInitialTradingContractsAtThisMonth | 收益互换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; |
| 37 | NumberOfSwapContractsToTerminateAtThisMonth | 收益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 | 收益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 | 收益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 | 场外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 | 场外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 | 场外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 | 场外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 | 场外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 | 本月末收益互换已签约客户 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 51 | NumberOfSwapTr | 本月末收益 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|--------------------|-------|---|--|------------|
| | adingAccountsAtThisPeriodThisMonth | 互换当期参与交易的账户数量 | | | | |
| 52 | NumberOfSwapTradingClientStockThisMonth | 本月末收益互换存量交易客户数量 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 53 | SwapSignedWithTheCustomerLastMonth | 上月末收益互换已签约客户 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 54 | NumberOfSwapTradingAccountsLastMonth | 上月末收益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 | 上月末收益互换存量交易客户数量 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 56 | OptionSignedWithTheCustomerThisMonth | 本月末场外期权已签约客户 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 57 | NumberOfOptionTradingAccountsThisMonth | 本月末场外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 | 本月末场外期权存量交易客户数量 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 59 | OptionSignedWithTheCustomerLastMonth | 上月末场外期权已签约客户 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 60 | NumberOfOptionTradingAccountsLastMonth | 上月末场外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 | 上月末场外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 | NumberOfForward | 本月末远期 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|--------------------|-----------|---|--|---------------|
| | dTradingClientStockThisMonth | 存量交易客户数量 | | | | |
| 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 | TheValueOfTheStockSwapInTheCorrespondingPe | 上月末互换存量交易对应履约担保 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |

| | | | | | | |
|----|---|-------------------|-----------|---|--|---------------|
| | rformanceGuaranteeLastMonth | 品价值 | | | | |
| 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 | SwapDefaultTra | 本月末互换 | N (20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |

| | | | | | | |
|----|---|--------------------------------|-----------------|---|--|-------------------|
| | nsactionNumber AtThisMonthThis Month | 本月违约交 易数 | | | | |
| 89 | SwapDefaultTra nsactionNumber AtThisMonthLas tMonth | 上月末互换 本月违约交 易数 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 90 | TotalSwapDefau ltCustomerNumb erInThisYearTh isMonth | 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 | TotalSwapDefau ltCustomerNumb erInThisYearLa stMonth | 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 | SwapNumberOfDe faultCustomers InThisYearThis Month | 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 | SwapNumberOfDe faultCustomers InThisYearLast Month | 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 | TotalNominalPr incipalAmountO fForwardThisMo nth | 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 | TotalNominalPr incipalAmountO fForwardLastMo nth | 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 | TheValueOfTheS tockForwardCor respondingPerf ormanceGuarant eeThisMonth | 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 | TheValueOfTheS tockForwardCor respondingPerf ormanceGuarant eeLastMonth | 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 | ForwardCashCol lateralValueTh isMonth | 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; |

| | | | | | | |
|-----|--|----------------------|--------------|---|--|--------------|
| | th | | | | | |
| 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 | HoldMarketValueOfBondsAtTheE | 上月末持有 债券市值 | N (36, | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |

| | | | | | | |
|-----|--|-----------------|-------------|---|--|---------------|
| | ndOfLastMonth | | 4) | | | |
| 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; |

| | | | | | | |
|-----|--|--------------------|-----------------|---|--|---------------|
| | | | 4) | | | |
| 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 | 场外期权本月了结笔数 | N(20) | 是 | | 校验规则: 正整数; |
| 139 | SettledOptionTransactionInvolvesNotionalPrincipalAtThisMonth | 场外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 | 场外期权权利金收入 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |
| 141 | OptionHedgeCost | 场外期权对冲成本 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |
| 147 | BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisMonth | 互换合约端损益本月发生额 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |
| 148 | BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisMonth | 期权合约端损益本月发生额 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |
| 149 | BalanceOfSwapRealizedGainsAndLossesAtThisYear | 互换合约端损益本年累计额 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |
| 150 | BalanceOfOptionRealizedGainsAndLossesAtThisYear | 期权合约端损益本年累计额 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |
| 151 | BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairVa | 互换对冲端损益本月发生额 | N (36, 4) | 是 | | 校验规则: 保留四位小数; |

| | | | | | | |
|-----|--|--------------|-------------|---|--|-----------------|
| | lueAtThisMonth | | | | | |
| 152 | BalanceOfOptionChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisMonth | 期权对冲端损益本月发生额 | N (36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |
| 153 | BalanceOfSwapChangedGainsAndLossesInFairValueAtThisYear | 互换对冲端损益本年累计额 | N (36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |
| 154 | BalanceOfOptionTotalGainsAndLossesInFairValueAtThisYear | 期权对冲端损益本年累计额 | N (36,4) | 是 | | 校验规则：保留四位小数； |
| 155 | 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； |
| 156 | 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； |
| 157 | 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； |
| 158 | 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； |
| 159 | IncreaseBusinessDetailsThisMonthTuple | 本月新增业务明细 | T | | | 字段信息详见本月新增业务明细 |
| 160 | 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 |
| 161 | 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 | 代码取值 | 说明 |
|----|------|-------|------|-----|------|----|
|----|------|-------|------|-----|------|----|

| | | | | 填 | | |
|----|--|----------------------|--------------|---|--|---|
| 1 | SecurityCompany | 报送机构名称 (全称) | C (100) | 否 | | |
| 2 | CounterpartyName | 交易对手名称 (全称) | C (100) | 否 | | |
| 3 | CounterpartyProductName | 交易对手产品名称 (如有) | C (100) | 否 | | |
| 4 | TransactionConfirmationNumber | 交易确认书编号 (报告库编号) | C (100) | 否 | | |
| 5 | BusinessType | 业务类型 | C (2) | 否 | 11: 收益互换 (客户多头) 12: 收益互换 (客户空头) 13: 多空组合收益互换 14: 其他收益互换 02: 场外期权 | |
| 6 | NotionalPrincipalAmount/ LNotionalPrincipalAmount | 名义本金金额 (亿元) / 多头名义本金 | 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 | SNotionalPrincipalAmount | 空头名义本金 (亿元) (多空组合填写) | N (20, 2) | 否 | | |
| 8 | StartDay | 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 |
| 9 | 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 |
| 10 | InvestmentTargetType | 标的类型 | C (2) | 否 | 权益类 0、 大宗商品 1、利率 | |

| | | | | | |
|----|-------------------------|----------------|----------------|--|--|
| | | | | | 2、信用类 3、汇率 4、混合类 5、其他 99 |
| 11 | UndrlyAssetName | 标的名称 | C (200) | | |
| 12 | UndrlyAssetCode | 标的编码 | C(20) | | |
| 13 | OptionObjectSecondClass | 期权标的小类(场外期权填写) | C(2) | | 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 |
| 14 | SwapObjectSecond | 收益互换标 | C(2) | | 股票 0、股 |

| | | | | | | |
|----|--------------------|----------------------|----------|--|---|--|
| | Class | 的小类(收益互换填写) | | | 指 1、北交所/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 | |
| 15 | NonAnnualOptionFee | 期权费(非年化)(%) (场外期权填写) | N(20, 2) | | 如为期权, 需填写本字段, 该字段为期权费占名义本金的百分比。数值处于0至100之间。例如, 期权费为名义本金20%, 填写20。 | |
| 16 | OptionType | 期权类型(场外期权填写) | C(2) | | 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 | |
|--|--|--|--|--|---|--|

(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 | SecurityCompany | 报送机构名称 (全称) | C (100) | 否 | | |
| 2 | CounterpartyName | 交易对手名称 (全称) | C (100) | 否 | | |
| 3 | CounterpartyProductName | 交易对手产品名称 (如有) | C (100) | 否 | | |
| 4 | TransactionConfirmationNumber | 交易确认书编号 (报告库编号) | C (100) | 否 | | |
| 5 | BusinessType | 业务类型 | C (2) | 否 | 11: 收益互换 (客户多头) 12: 收益互换 (客户空头) 13: 多空组合收益互换 14: 其他收益互换 02: 场外期权 | |
| 6 | NotionalPrincipalAmount/ LNotionalPrincipalAmount | 名义本金金额 (亿元) / 多头名义本金 | 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 | SNotionalPrincipalAmount | 空头名义本金 (亿元) (多空组合填写) | N (20, 2) | 否 | | |
| 8 | StartDay | 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 |
| 9 | 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 |
| 10 | InvestmentTargetType | 标的类型 | C(2) | 否 | 权益类 0、大宗商品 1、利率 2、信用类 3、汇率 4、混合类 5、其他 99 | |
| 11 | UndrlyAssetName | 标的名称 | C(200) | | | |
| 12 | UndrlyAssetCode | 标的编码 | C(20) | | | |
| 13 | OptionObjectSecondClass | 期权标的小类(场外期权填写) | C(2) | | 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 | |
| 14 | SwapObjectSecondClass | 收益互换标的小类(收益互换填写) | C (2) | 股票 0、股指 1、上交所/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 | |
| 15 | NonAnnualOptionFee | 期权费(非年化)(%) (场外期权填写) | N(20, 2) | 如为期权, 需填写本字段, 该字段为期权费占名义本金的百分比。数值处于0至 | |

| | | | | | | |
|----|--------------------------------|-----------------------|-----------------|---|--|--|
| | | | | | 100 之间。 例如，期权 费为名义 本金 20%， 填写 20。 | |
| 16 | OptionType | 期权类型(场 外期权填写) | C (2) | | 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 | |
| 17 | MaintainMarginRat ion | 本月末维持 保证金比例 (%) | N (20, 2) | 否 | | 指月末维持保证金加浮 动盈亏占合约存续名义 本金的比例；对于多空互 换，指维持保证金加浮动 盈亏占多头名义本金和 空头名义本金孰高的比 例。例如维持保证金比例 为 50%，填写 50.00。 |
| 18 | CorrelationCoeffici ent | 标的相关系 数 | N (20, 2) | 否 | | 多空组合收益互换填写 |
| 19 | LongPositionCont ractValue | 多头合约价 值 (元) | N (36, 4) | 否 | | 客户多头、多空组合收益 互换填写。4 位小数 |
| 20 | ShortPositionCon tractValue | 空头合约价 值 (元) | N (36, 4) | 否 | | 客户空头、多空组合收益 互换填写。4 位小数 |

(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 | |

| | | | | | | |
|----|---|-------------------|----------|---|---|-------------------------|
| 3 | InvestmentTargetType | 标的分类 | C (2) | 否 | 01: 境内个股 02: 基金及基金专户 03: 境内股指期货 04: 大宗商品 05: 香港股票 06: 香港股指 99: 其他 | |
| 4 | InvestmentTarget | 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 | UnderlyingCode | 标的代码 | C (100) | 否 | | |
| 6 | BuyingImpulseVolume | 买入对冲交易量 (元) | N(36, 4) | 否 | | 股指期货和大宗商品买入对冲包括开多仓和平空仓。 |
| 7 | SellingImpulseVolume | 卖出对冲交易量 (元) | N(36, 4) | | | 股指期货和大宗商品卖出对冲包括开空仓和平多仓。 |
| 8 | ImpulseVolume | 对冲交易量 (元) (买入+卖出) | N(36, 4) | | | |
| 9 | PositionAtTheEndOfThisMonth | 本月末持仓规模/合约价值 (元) | N(36, 4) | | | |
| 10 | TheNumberOfPositionsHeldAtTheEndOfThisMonth | 本月末持仓数量 (股/手) | N(20) | | | 权益类填写股数 |
| 11 | AveragePriceAtTheEndOfTheMonth | 本月末持仓平均价格 (元) | N(36, 4) | | | |

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 | 代码取值 | 说明 |
|----|------|-------|------|----|------|----|
|----|------|-------|------|----|------|----|

| | | | | 必填 | | |
|---|---------------------|----------|----------|----|-----|------------------|
| 1 | BizID | 业务编号 | C (50) | 否 | | 校验规则: 补正时必须填; |
| 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: 格式必须为 PDF, WORD, EXCEL; |

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: 补正时必须填; |
| 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: 格式必须为 PDF, WORD, EXCEL; |

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 |
| 14. | A1014 | 定期报告-季报 |
| 15. | A1015 | 双方约定编号数据处理 |
| 16. | A1016 | 权益端支付 |
| 17. | A1017 | 交易确认书附件 |

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 | 报送信息作废文件 |

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. | | |

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 | | | |
| 补充协议 | | | |
| 履约保障协议 | | | |
| 交易确认书 | | | |

(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) | 本月末净资本 (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本比例 (%) |
|-------|--------------------------------|------------|--------------------------------------|
| 金额或比例 | | | |

(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 | | | | | | |
| 收益互换 | | | | | | |

(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) | | | | | | | | | |
| 本月新增规模 (亿元) | | | | | | | | | |
| 本月终止规模 (亿元) | | | | | | | | | |
| 本月末 | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 存续规模 (亿元) | | | | | | | | | |
| 本年累计新增规模 (亿元) | | | | | | | | | |
| 上月末存续合约笔数 (笔) | | | | | | | | | |
| 本月新增合约笔数 (笔) | | | | | | | | | |
| 本月终止合约笔数 (笔) | | | | | | | | | |
| 本月末存续合约笔数 (笔) | | | | | | | | | |
| 本年累计新增合约笔数 (笔) | | | | | | | | | |

(5) 杠杆水平

| | 存量对应保证金 (元) +期权费 (元) | 对冲持仓市值 (元) | 杠杆率 |
|----------|-------------------------|------------|-----|
| 收益互换整体业务 | | | |
| 收益互换股指标的 | | | |
| 收益互换个股标的 | | | |
| 场外期权整体业务 | | | |
| 场外期权股指标的 | | | |
| 场外期权个股标的 | | | |
| 收益互换整体业务 | | | |

(6) 、收益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) | | |
| 存量交易对应履约担保品价值 (亿元) | | |
| 现金担保物价值 (亿元) | | |
| 证券担保物价值 (亿元) | | |
| 业务整体履约担保比例 (全额) | | |
| 业务整体履约担保比例 (净额) | | |
| 本月违约客户数 | | |
| 本月违约交易数 (笔) | | |
| 本年累计违约客户数 | | |
| 本年累计违约交易数 (笔) | | |

(7)、场外期权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) | | |
| 存量交易对应履约担保品价值 (亿元) | | |
| 现金担保物价值 (亿元) | | |
| 证券担保物价值 (亿元) | | |
| 业务整体履约担保比例 (全额) | | |
| 业务整体履约担保比例 (净额) | | |
| 本月违约客户数 | | |
| 本月违约交易数 (笔) | | |
| 本年累计违约客户数 | | |
| 本年累计违约交易数 (笔) | | |

(8)、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) | | |
| 其中: 持有现金余额 (亿元) | | |
| 持有股票市值 (亿元) | | |
| 持有债券市值 (亿元) | | |
| 持有证券公司资产管理产品 (亿元) | | |
| 持有银行理财 (亿元) | | |
| 持有信托产品 (亿元) | | |
| 持有保险产品 (亿元) | | |
| 其他 (亿元) | | |

(9)、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 |
|----|----|----------|
|----|----|----------|

| | | |
|------|------------------|--|
| 收益互换 | 本月了结笔数 | |
| | 本月了结交易涉及名义本金 | |
| | 收入现金流 | |
| | 支出现金流 | |
| | 使用保证金形成的净收益对应现金流 | |
| | 对冲成本 | |
| 场外期权 | 本月了结笔数 | |
| | 本月了结交易涉及名义本金 | |
| | 权利金收入 | |
| | 对冲成本 | |

(10)、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 | 互换 | 期权 |
| 合约端损益 | | | | |
| 对冲端损益 | | | | |
| 损益合计 | | | | |

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 | | | | |
| 补充协议 | | | | |
| 履约保障协议 | | | | |
| 交易确认书 | | | | |

(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 月末 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 月末 年度新 增交易 |
| 利率 | | | | | | | | | | |
| 黄金 | | | | | | | | | | |
| 外汇 | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | |
| 合计 | | | | | | | | | | |

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 | | | | |
| 补充协议 | | | | |
| 履约保障协议 | | | | |
| 交易确认书 | | | | |

(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) | 收益互换类 | | | | | |
| | 场外期权类 | | | | | |
| | 远期类 | | | | | |
| 合约数量 (笔) | 收益互换类 | | | | | |
| | 场外期权类 | | | | | |
| | 远期类 | | | | | |

(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) |
|------|-----|----------|----------------|-------------|
| 收益互换 | 本月末 | | | |
| | 上月末 | | | |
| 场外期权 | 本月末 | | | |
| | 上月末 | | | |
| 远期 | 本月末 | | | |
| | 上月末 | | | |
| 合计 | 本月末 | | | |
| | 上月末 | | | |

(4)、收益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) | | |
| 存量交易对应履约担保品价值(亿元) | | |
| 现金担保物价值(亿元) | | |

| | | |
|----------------|--|--|
| 证券担保物价值（亿元） | | |
| 业务整体履约担保比例（全额） | | |
| 业务整体履约担保比例（净额） | | |
| 本月违约客户数 | | |
| 本月违约交易数（笔） | | |
| 本年累计违约客户数 | | |
| 本年累计违约交易数（笔） | | |

(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） | | |
| 存量交易对应履约担保品价值（亿元） | | |
| 现金担保物价值（亿元） | | |
| 证券担保物价值（亿元） | | |
| 业务整体履约担保比例（全额） | | |
| 业务整体履约担保比例（净额） | | |
| 本月违约客户数 | | |
| 本月违约交易数（笔） | | |
| 本年累计违约客户数 | | |
| 本年累计违约交易数（笔） | | |

(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） | | |
| 其中：持有现金余额（亿元） | | |
| 持有股票市值（亿元） | | |
| 持有债券市值（亿元） | | |
| 持有证券公司资产管理产品（亿元） | | |
| 持有银行理财（亿元） | | |
| 持有信托产品（亿元） | | |
| 持有保险产品（亿元） | | |
| 其他（亿元） | | |

(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 |
|------|--------------|---------|
| 收益互换 | 本月了结笔数 | |
| | 本月了结交易涉及名义本金 | |
| | 收入现金流 | |
| | 支出现金流 | |

| | | |
|------|----------------------|--|
| | 使用保证金形成的净收益对 应现金流 | |
| | 对冲成本 | |
| 场外期权 | 本月了结笔数 | |
| | 本月了结交易涉及名义本金 | |
| | 权利金收入 | |
| | 对冲成本 | |

(8)、本月会计损益统计固定表格:

| 项目 | 本月发生额 (万元) | | 本年累计额 (万元) | |
|-------|------------|----|------------|----|
| | 互换 | 期权 | 互换 | 期权 |
| 合约端损益 | | | | |
| 对冲端损益 | | | | |
| 损益合计 | | | | |