

客户估值汇总		
基本信息	客户代码	
	客户名称	
	估值日期	
	币种	
		汇总（CNY）
保证金信息	保证金占用	
	└ 期权保证金占用（选填）	
	└ 互换保证金占用（选填）	
	└ 远期保证金占用（选填）	
	可用资金	
持仓信息	存续名义本金	
	└ 期权存续名义本金	
	└ 互换存续名义本金	
	└ 远期存续名义本金	
合约净值信息	存续合约净值	
	└ 合约价值	
	└ 未到账股息（选填）	
	└ 未结算担保品返息（选填）	
	└ 未结算期权费（选填）	
	└ 其他（选填）	
净资产信息	客户净资产金额	

说明：

- 1、该表填人民币汇总金额。如涉及外币金额，则换算为人民币计价。单位均为人民币元。
- 2、本表“合约净值信息”中的所有字段，若为客户权益/客户收取则填正数，若为客户负债/客户支付则填负数。
- 3、本表仅给出估值必备要素，可根据需要补充其他信息。
- 4、本表中除标注“选填”的项目外均为必填项。当客户为私募基金、私募资管产品时，保证金占用相关字段均为必填项。

注释：

- 1、客户代码：指客户营业执照上的统一社会信用代码。若客户为境外法人，则填写该公司在注册地的商业登记号码。若客户为产品，请填写该产品对应管理人的统一社会信用代码。
- 2、保证金占用：指客户在该持仓上应缴的保证金金额，负数代表该持仓起到减免保证金的作用，或者该持仓客户需要向交易商收取的保证金。
- 3、可用资金：指客户可用于进行衍生品交易的资金额度。
- 4、存续名义本金：指存续合约名义本金（按照参考汇率换算为人民币后）加总，等于【存续合约明细】表对应“资产类型”、“工具类型”的“存续名义本金”合计。
- 5、存续合约净值包括：a）使用估值模型计算的存续合约整体的公允价值；b）已实现待结转到预付金（保证金）中的股息、返息、期权费等；c）其他项。存续合约净值=合约价值+未到账股息+未结算担保品返息+未结算期权费+其他。
- 6、合约价值：指使用估值模型计算的存续合约整体的公允价值。客户权益填正数，客户负债填负数。合约价值=“存续合约明细”表（R列【合约价值】×F列【参考汇率】）加总。
- 7、未到账股息：指尚未到账的分红派息金额。客户待收取填正数，客户待支付填负数。
- 8、未结算担保品返息=历史累计担保品返息金额-已结算担保品返息金额。客户待收取填正数，客户待支付填负数。
- 9、未结算期权费：指尚未支付的期权费用。客户待收取填正数，客户待支付填负数。
- 10、客户净资产金额：指客户权益汇总。

存续合约明细																											
合约开仓信息														合约持仓信息				期权其他信息				互换其他信息		远期其他信息			
交易确认书编号	多腿编号（选项）	工具类型	客户方向	计价货币	参考汇率	交易起始日	交易到期日	初始名义金额	标的代码	标的名称	资产类型	标的数量（吨/桶）	期初价格	是否展期	存续名义本金	保证金占用（吨/桶）	合约价值	估值日价格	期权类型	是否带嵌入结构	是否带敲出结构	行权价格	客户浮动方向	浮动收益	远期价格	浮动收益	

说明：
1、本表填的金额货币为默认计价货币，若计价货币为人民币的，参考汇率为1。
2、本表仅给出估值必备要素，可根据需要补充其他信息。
3、本表中除标注“选项”的项目外均为必填项。
4、标的为篮子组合的，对于互换和远期，一个标的填写一行；对于期权，标的代码以A+B、A-B、A+B+C、A&B&C等形式填写，若多个合约间的系数不是1：1，填写该字段时要加上系数。填写该字段时，“+”“-”“&”符号仅用于反映多标的之间的运算关系，其中，“&”代表对标的进行排序，如最优、最差、彩虹、其他。

注释：
1、交易确认书编号：指双方签署的交易确认书的编号。
2、多腿编号：一笔组合交易涉及多腿时，按照多腿数量从1开始依次编号。
3、工具类型包括期权、互换、远期和其他。
4、客户方向：对于期权和远期交易，B：买方；S：卖方；对于互换交易，P：payer，即付固定、收浮动方；R：receiver，即收固定、付浮动方。
5、参考汇率：指计价货币兑换为人民币的汇率。
6、初始名义金额：指存续合约的初始名义金额，交易双方在合约中约定的名义金额。
7、标的代码按以下方式填写：挂钩标的为交易所场内交易标的时，按照交易所代码完整填列，不得省略或修改；挂钩标的为非交易所场内交易标的时，按照行业惯例完整填列。
8、资产类型包括商品类、权益类、利率类、外汇类、信用类、其他。
9、期初价格：指标的期初价。
10、是否展期：指估值日当日该合约是否展期。
11、存续名义本金：指存续合约的存续名义本金。
12、保证金占用：指客户在该持仓上应缴的保证金金额，负数代表该持仓起到减免保证金的作用，或者该持仓客户需要向交易商收取的保证金，当客户为私募基金时，私募基金产品，保证金占用字段为必填项。
13、估值日价格：指标的估值日采用的估值价格，以计价货币填写。
14、期权类型包括“带看跌期权”、“二元及其组合”、“障碍及其组合”、“自动赎回类”、“其他”。
15、行权价格：以计价货币填写。行权价格存在多个的情况下分号分隔。
16、客户浮动方向：指收固定、付浮动方的看涨、看跌方向。
17、远期价格：指开仓时双方约定的远期买卖标的资产的价格。

结算明细														
交易确认书编号	交易起始日	结算日	计价货币	参考汇率	结算名义本金	标的代码	标的名称	工具类型	产品结构	客户方向	客户浮动方向方向（选填）	结算类型	结算期权费 （选填）	结算金额 （人民币）

说明：
1、本表F、N列填的金额货币为默认计价货币，若计价货币为人民币的，参考汇率为1。
2、本表仅给出估值必备要素，可根据需要补充其他信息。
3、本表中除标注“选填”的项目外均为必填项。当“工具类型”为“期权”时，结算期权费字段为必填项。当“工具类型”为“互换”时，客户浮动方向字段为必填项。
4、标的为篮子组合的，对于互换和远期，一个标的填写一行；对于期权，标的代码以A+B、A-B、A+B-C、A&B&C等形式填写，若多个合约的系数不是1：1，填写该字段时要加上系数。填写该字段时，“+”“-”“&”符号仅用于反映多标的之间的运算关系，其中，“&”代表对标的进行排序，如最优、最差、彩虹、其他。

注释：
1、参考汇率：指计价货币转换为人民币的汇率。
2、结算名义本金：指开仓、平仓或了结的合约名义本金额。以计价货币填写。
3、工具类型包括期权、互换、远期和其他。
4、产品结构：指期权和互换的细分结构。对于期权，产品结构包括“香草及其组合”、“二元及其组合”、“障碍及其组合”、“自动赎回类”、“其他”。
5、客户方向：对于期权和远期交易，B:买方；S:卖方；对于互换交易，P: payer，即付固定、收浮动方；R: receiver，即收固定、付浮动方。
6、客户浮动方向：指收固定、付浮动方的看涨、看跌方向。
7、结算类型包括“开仓”“部分平仓”“全部平仓”“终止”。
8、结算期权费：指对应开仓、平仓了结部分的应付期权费。客户应收期权费填正数，客户应付期权费填负数。
9、结算金额：指该笔结算对应的应付金额。客户应收填正数，客户应付填负数。

资金变动明细							
日期	客户名称	对应交易确认书编号（选填）	资金变动类型	币种	金额（计价货币）	金额（人民币）	备注
			出入金				
			开仓期权费收支				
			了结收支				
			期间收益结算				
			固定收益结算				
			分红派息收益				
			其他调整				

说明：

- 1、本表仅给出估值必备要素，可根据需要补充其他信息。
- 2、本表中除标注“选填”的项目外均为必填项。
- 3、对于现金结算后即完成出入金的资金流水，需要填写两条资金流水：一条是合约本身结算损益或者期间收益支付、造成资金变动的资金流水，一条是交易双方银行转账支付进行出入金的资金流水。
- 4、本表仅在发生对应的资金变动类型时填写，未发生时不填写。

注释：

- 1、出入金：客户出入金净值，客户向交易商打款为入金，反之为出金，因此正数代表净入金，负数代表净出金。
- 2、开仓期权费收支：开仓时客户支付合约期权费至交易商，或者交易商支付合约期权费至客户。客户收取填正数，客户支付填负数。
- 3、了结收支：指合约了结收支。客户收取填正数，客户支付填负数。
- 4、期间收益结算：适用于雪球等结构期间收益结算。客户收取填正数，客户支付填负数。
- 5、固定收益结算：指合约结算固定收益。客户收取填正数，客户支付填负数。
- 6、分红派息收益：指标的分红派息款项。客户收取填正数，客户支付填负数。