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。对于“选填”项目，如不予填报，可自行选择是否向客户提供。

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（【合约价值】×【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	持仓编号	多腿编号（选填）	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（选填）	期初价格	开仓费用	是否展期	存续名义本金	保证金占用（选填）	合约价值	估值日价格	期权类型	是否带敲入结构	是否带敲出结构	行权价格	客户互换方向	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“选填”的项目外均为必填项。对于“选填”项目，如不予填报，可自行选择是否向客户提供。
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。若交易仅包含1腿，多腿编号应为空。
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：指计价货币转换为人民币的汇率。
6、初始名义金额=初始名义数量*标的期初价格。如计价货币涉及外币，初始名义金额应填列折算后的人民币金额。
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：指标的期初价格。
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=初始名义金额-结算名义金额。
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、私募资管产品时，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“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”。
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，并按行权价由低到高顺序排列。
16、客户互换方向：指客户的看涨、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	成交编号	持仓编号	多腿编号（选填）	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	客户互换方向（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I、Q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，客户互换方向字段为必填项。对于“选填”项目，如不予填报，可自行选择是否向客户提供。
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。若交易仅包含1腿，多腿编号应为空。
3、参考汇率：指计价货币转换为人民币的汇率。
4、结算名义本金：指平仓或了结的合约名义本金额。结算名义本金=结算名义数量*标的期初价格。如计价货币涉及外币，结算名义本金应填列折算后的人民币金额
5、工具类型包括期权、互换、远期和其他。
6、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”。
7、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。
8、客户互换方向：当“工具类型”为互换时，客户的看涨、看跌方向。
9、结算类型包括“完全解约”“部分解约”“由观察事件导致的部分结算”“到期终止”“敲出终止”“提前行权”“违约终止”“不可抗力终止”“其他”。
10、结算期权费：指对应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。
11、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（选填）
			出入金				
			开仓费用收支				
			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。对于“选填”项目，如不予填报，可自行选择是否向客户提供。
3、对于现金结算后即完成出入金的资金流水，需填写两条资金流水：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、开仓费用收支：开仓时客户支付合约开仓费用至交易商，或者交易商支付合约开仓费用至客户。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：指涉及的固定收益。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。