

## 期货保证金监控系统数据报送接口 (期货公司 4.3.2 版) 变更清单

序号	文件名	变更说明	原由
1	客户基本资料文件	变更“是否为二级代理商”字段名称为“是否为境外中介机构”，并取消该字段，但需留位	在该文件中新增“境外特殊参与者与境外中介机构标识”字段，统一进行标识
2	客户基本资料文件	变更“二级代理商编号”字段名称为“境外中介机构编号”，取消该字段，但需留位	在该文件中新增“境外特殊参与者与境外中介机构标识”字段，统一进行标识
3	客户基本资料文件	增加“境外特殊参与者与境外中介机构标识”字段	获取境外特殊参与者及境外中介机构信息
4	客户期货期权账户基本资金数据文件	变更“实有货币资金”字段名称为“实有人民币资金”	明确实有货币的种类
5	汇兑明细文件	明确“记账流水号”字段的取值方式	统一报送要求，满足监测监控需要
6	汇兑明细文件	修改“换汇业务种类”字段的枚举值： 删除 E1:交易所手续费换汇，M1:会员强制换汇，M2:会员手续费换汇；新增 C2:客户交割货款换汇	与实际业务保持一致，满足监测监控需要
7	汇兑明细文件	增加“银行统一标识”字段	获取换汇的银行信息

注：

1、《期货保证金监控系统数据报送接口（期货公司 4.3.2 版）》在《期货保证金监控系统数据报送接口（期货公司 4.3.1 版）》基础上，为满足境内特定品种期货交易业务的数据报送要求进行了调整变更。

2、以上清单仅对涉及业务调整的“字段”的变更进行了罗列；“数据类型”和“是否为空”的变更所涉内容较多，不宜逐一列举，具体调整参见接口文件。

3、针对业务规则的变化，4.3.2 版数据报送接口在说明性文字方面也进行了相应调整。

# 期货保证金监控系统数据报送接口

## （期货公司 4.3.2 版）

### 1、内容

(1) 每个期货公司每天需向期货保证金监控系统报送 19-28 个文本文件。

(2) 每个期货公司每天需报送：客户基本资料文件、客户编码文件、客户结算账户文件、客户期货期权账户基本资金数据文件、客户出入金记录文件、期货成交明细文件、期货持仓数据文件、其它分项资金数据文件、其它需要说明的信息或数据文件、期货平仓明细文件，期货持仓明细文件，非货币充抵明细文件，期货交割明细文件、期货待交割结算合约文件、期权成交明细文件、期权持仓数据文件、期权行权明细文件、期权平仓明细文件、期权持仓明细文件。

(3) 有汇兑和币种间充抵业务的公司需要报送：汇兑明细文件、货币充抵资金文件。

(4) 有单一客户综合类资产管理业务的公司需报送：单一客户综合类资产管理业务投资账户文件。

(5) 有资产管理业务委托托管机构进行托管的公司需报送：资产管理业务托管账户和资管结算账户文件。

(6) 资产管理业务通过本公司经纪业务通道外进行交易的公司需报送：资产管理非本公司经纪业务资金数据文件、资产管理非本公司经纪业务资金明细文件。

(7) 有股票期权业务的公司需报送：客户证券现货账户资金文件、客户证券现货成交明细文件、客户证券现货持仓文件。

《股票期权交易试点管理办法》中规定，期货公司应当将投资者股票期权交易的权利金、行权资金、以现金形式提交的保证金存放于期货保证金账户，期货公司开展与股票期权备兑开仓以及行权相关的证券现货经纪业务的，还应当在存管银行单独开立相关现货资金账户。因此，期货公司在为股票期权客户开立期货期权内部资金账号的同时还应单独开立证券现货内部资金账号，以达到期、现隔离的目的，且账户号码不得一样。其中客户的期货期权账户用于记录期货、商品期权、股票期权相关业务的资金、交易和持仓等，证券现货账户用于记录与证券现货业务相关的资金、交易和持仓等。

### 2、文件目录

- (1) 客户基本资料文件；
- (2) 客户编码文件；
- (3) 客户结算账户文件；

- (4) 客户期货期权账户基本资金数据文件；
- (5) 客户出入金记录文件；
- (6) 期货成交明细文件；
- (7) 期货持仓数据文件；
- (8) 其它分项资金数据文件；
- (9) 其它需要说明的信息或数据文件；
- (10) 期货平仓明细文件；
- (11) 期货持仓明细文件；
- (12) 非货币充抵明细文件；
- (13) 期货交割明细文件；
- (14) 期货待交割结算合约文件；
- (15) 汇兑明细文件；
- (16) 货币充抵资金文件；
- (17) 单一客户综合类资产管理业务投资账户文件；
- (18) 资产管理业务托管账户和资管结算账户文件；
- (19) 资产管理非本公司经纪业务资金数据文件；
- (20) 期权成交明细文件；
- (21) 期权持仓数据文件；
- (22) 期权行权明细文件；
- (23) 期权平仓明细文件；
- (24) 期权持仓明细文件；
- (25) 资产管理非本公司经纪业务资金明细文件；
- (26) 客户证券现货账户资金文件；
- (27) 客户证券现货成交明细文件；
- (28) 客户证券现货持仓文件。

### 3、格式

#### (1) 客户基本资料文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户基本资料文件名：

XXXXcustomer+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 公司的客户基本资料文件名为 0001customer20051008.txt。

期货公司每日必须报送所有开户客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）的基本资料，已开户客户的“开户和销户标志”

为 a ，而销户客户在其销户的当日报送销户信息，“开户和销户标志”为 d 。在客户基本资料文件中，每个客户一条记录。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者、境外中介机构，须报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的基本信息，不需要报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的基本资料。

客户包含资产管理计划，如果期货公司有资产管理计划，则资产管理计划的客户基本资料也在此文件中报送。其中，不做期货品种的综合类资产管理户也需要开立客户内部资金账户并报送。

如果期货公司有客户从事证券现货业务，无论其是否从事期货或商品期权业务，均需开立客户期货期权内部资金账户并报送。

期货公司报送资产管理账户的客户基本资料时，需要通过“客户类型”区分“单一客户”和“特定多个客户”资产管理账户，还需通过“是否为期货公司子公司经营的资产管理业务”区分该资产管理业务的经营机构是期货公司还是其专门从事资产管理业务的子公司。期货公司子公司的资产管理业务通过期货公司报送。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户名称	Char(400)	N	客户含一般客户、交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者和境外中介机构 特殊单位客户此处需填写特殊单位客户名称-分户管理资产名称
身份证	Char(50)	Y	境内个人客户的身份证号码 如果是单位客户、境外个人客户，此字段为空
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构视为客户处理：当客户为交易

			会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构时，取交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户
所在地	Char(100)	N	
通讯地址	Char(200)	N	
邮政编码	Char(20)	N	
联系电话	Char(60)	N	
开户和销户标志	Char(1)	N	a：已开户的客户； d：当日销户的客户 此字段填写期货期权资金账户的开户销户标志
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
客户类型	Char(1)	N	0：个人； 1：单位； 2：特殊单位； 3：单一客户纯期货资产管理计划； 4：单一客户综合类资产管理计划；

			5 :特定多个客户纯期货资产管理计划； 6 :特定多个客户综合类资产管理计划； 9 : 其它
客户期货期权内部资金账户开户日期	Date	N	客户开户并生效的实际日期（并非预开户的日期），格式：YYYY-MM-DD
组织机构代码证号	Char(40)	Y	境内单位客户的组织机构代码证号 如果是个人客户、境外单位客户，此字段为空
营业执照号	Char(60)	Y	境内单位客户的营业执照号 如果是个人客户、境外单位客户，此字段为空
开户代理人名称	Char(100)	Y	开户授权人的姓名 如果系统中暂时无此字段，可以为空
开户代理人身份证	Char(50)	Y	开户授权人的身份证号码 如果系统中暂时无此字段，可以为空
账户休眠状态	Char(1)	N	a : 活跃客户； d : 休眠客户 此字段填写期货期权资金账户的休眠状态
境外客户标识	Char(1)	N	1 : 国内客户； 2 : 港澳台客户；

			3：国外客户 4：在中国永久居留客户
国籍/地区	Char(3)	Y	国家的标准数字编码 如果是境内客户，此字段为空
境外个人客户有效身份证明文件号码	Char(50)	Y	境外个人客户的护照号、港澳永久性居民身份证、台湾居民来往大陆通行证或外国人永久居留证 如果是境内客户、境外单位客户，此字段为空
商业登记证号	Char(50)	Y	境外单位客户的商业登记证明文件号码 如果是境内客户、境外个人客户，此字段为空
是否为境外中介机构	Char(1)	Y	取消，但需留位
境外中介机构编号	Char(10)	Y	取消，但需留位
是否为期货公司子公司经营的资产管理业务	Char(1)	Y	Y：是；N：否 当期货公司的子公司为资产管理业务的经营机构时，该字段为 Y； 当期货公司为资产管理业务的经营机构时，该字段为 N； 如果非资产管理账户，此字段为空。
客户证券现货内部资金账户	Char(18)	Y	此字段填写证券现货资金账户 客户同时参与证券交易所股票期权交易的，期货公司需为客户单独开

			立证券现货内部资金账户，用于记录证券现货有关的资金和交易 如客户未参与证券业务（含备兑开仓、行权等与之相关的业务）的，此字段为空
客户证券现货内部资金账户开户日期	Date	Y	客户开户并生效的实际日期（并非预开户的日期），格式：YYYY-MM-DD 如客户未开立证券现货内部资金账户，此字段为空。
是否为做市商	Char(1)	Y	Y：是；N：否 参与期权做市业务的客户填报此字段
境外特殊参与与境外中介机构标识	Char(1)	Y	1：境外特殊经纪参与者； 2：境外特殊非经纪参与者； 3：境外中介机构 如果不是境外特殊参与者或境外中介机构，此字段为空

注：客户基本资料里面各主要字段（如：客户或交易会员名称，所在地，通讯地址，联系电话）如果内容出现半角@字符，一律替换为&at;

## （2）客户编码文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户编码文件名：

XXXXcuscode+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户编码文件名为 0001cuscode20051008.txt。

期货公司每日必须报送所有客户和其代理结算的境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的交易编码，已销户客户不再报送。此文件中的交易编码包含期货交易所的交易编码、证券交易所的衍生品合约账户号和证券交易所的证券账户号。在客户编码文件中，每个客户的记录数等于其开立的交易编

码、衍生品合约账户和证券账户的总数量。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其代理结算的交易会员的客户的交易编码。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，需要报送其代理结算的境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的交易编码，其中，境外特殊非经纪参与者的交易编码与境外特殊经纪参与者其下客户的交易编码信息，只需报送当日有交易或持仓的客户即可，客户内部资金账户均取境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构在期货公司的内部资金账户号码。

客户包含资产管理计划，如果期货公司有资产管理计划，则资产管理计划的交易编码也在此文件中报送。其中，综合类资产管理户如果没有交易编码可以不报送。

每条记录的字段和数据类型如下：

内容	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	期货期权业务：填写期货期权资金账户 证券现货业务：填写证券现货资金账户
交易所统一标识	Char(1)	N	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心； H：上海证券交易所； P：深圳证券交易所
交易编码	Char(13)	N	期货期权资金账户的交易编码 填写客户在期货交易所的交易编码和证券交易所的衍生品合约账户（即客户证券账户+888）

			证券现货资金账户的交易编码 填写客户在证券交易所的证券 账户
--	--	--	--------------------------------------

### (3) 客户结算账户文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户结算账户文件名：

XXXXcusaccount+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户期货结算账户文件名为 0001cusaccount20051008.txt。

期货公司每日必须报送所有开户客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）的期货结算账户，新增的客户期货结算账户信息其“新增或变更标志”为 a，已废除的客户期货结算账户在废除当日报送废除信息，“新增或变更标志”为 d。在客户期货结算账户文件中，每个客户的记录数等于现有和废除的期货结算账户数量，如果客户同时参与期货期权业务和证券现货业务且使用同一个结算账户，需分别通过期货期权内部资金账户和证券现货内部资金账户报送两条记录。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须要报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的账户信息；不需要报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的账户信息。

本文件中客户也包括期货公司的资产管理户和通过期货公司参与股票期权交易的客户。资产管理业务下，用于直接向期货保证金账户存取资金的银行账户也通过本文件填报：约定不进行托管的单一客户纯期货资产管理计划，填写客户资管结算账户；须委托托管机构进行托管的资产管理计划，填写直接向期货公司保证金账户存取资金的银行结算账户，即开立在期货保证金存管银行的期货资管托管账户，或开立在期货保证金存管银行的资金中转账户。开立在非期货保证金存管银行的期货资管托管账户需通过此中转账户向保证金账户存取资金。股票期权业务下用于直接向期货公司保证金账户存取资金的银行账户也通过本文件填报。

每条记录的字段和数据类型如下：

内容	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	期货期权业务：填写期货期权资金账户；

			<p>证券现货业务：填写证券现货资金账户。</p> <p>将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者、境外中介机构视为客户处理</p>
银行统一标识	Char(2)	N	<p>用 01、02 等标识</p> <p>01：工商银行；</p> <p>02：农业银行；</p> <p>03：中国银行；</p> <p>04：建设银行；</p> <p>05：交通银行；</p> <p>06：浦发银行；</p> <p>07：兴业银行；</p> <p>08：汇丰银行；</p> <p>09：光大银行；</p> <p>10：招商银行；</p> <p>11：中信银行；</p> <p>12：民生银行；</p> <p>13：平安银行；</p> <p>16：广发银行；</p> <p>99：其他银行</p>
银行账户	Char(32)	N	
新增或变更标志	Char(1)	N	a：现有；d：废除
银行账户的开户人名称	Char(400)	Y	该银行账户的开户人名称

银行账户的开户行	Char(400)	Y	开户银行具体网点(到支行)
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如:USD; CNY
账户类型	Char(1)	N	1: 经纪业务结算账户; 2: 约定不进行托管的单一客户纯期货资管计划的资管结算账户; 3: 期货资管托管账户; 4: 资管产品托管机构的资金中转账户

#### (4) 客户期货期权账户基本资金数据文件

期货公司(统一标识XXXX)的客户基本资金数据文件名:

XXXXcusfund+日期.txt

如报送日期为2005年10月8日、标识为0001期货公司的客户基本资金数据文件名为0001cusfund20051008.txt。

每家期货公司每天需报送一个相应文件名的客户(包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构)的基本资金数据文件,每个客户一条记录。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构,须报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的基本资金数据信息;不需要报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的基本资金数据。

经纪客户和期货类资管客户的资金数据,综合类资管客户投资期货部分的资金数据,以及股票期权经纪业务下不涉及证券现货部分的资金数据均须在此文件中报送。证券现货账户内的资金数据体现在文件(26)中,不在此文件中报送。

对于参与以人民币结算的境内特定品种期货业务的客户,本文件只需要报送人民币资金数据。客户的其他币种必须全部充抵为人民币,其他币种余额充抵的保证金在“货币充抵金额”文件中反映。

期货公司在为客户计算外币充抵人民币金额时采用的汇率和折扣率,必须与交易为会员计算外币充抵人民币金额时采用的汇率和折扣率保持一致。

每条记录的字段和数据类型如下:

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填报期货期权资金账户 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构视为客户处理 当客户为交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构时，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户
资金权益总额	Number(20,3)	N	当日客户（包括交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）权益
可用资金	Number(20,3)	N	逐日盯市下计算得出的可用资金 此外，在逐笔对冲下，将浮动盈亏算入可用资金后，其额度应该等同于在逐日盯市下计算得出的可用资金
需追加保证金	Number(20,3)	N	
风险度	Number(20,3)	N	去掉百分号，如 46 表示 46%
上日结存（逐日盯市）	Number(20,3)	N	
上日结存（逐笔对冲）	Number(20,3)	Y	

当日结存 (逐日盯市)	Number(20,3)	N	
当日结存 (逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	
当日总盈亏 (逐日盯市)	Number(20,3)	N	逐日盯市下的当日总盈亏，计算方式为：客户当日持仓盈亏+平仓盈亏+交割配对盈亏+行权盈亏
当日总盈亏 (逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲下的平仓盈亏
浮动盈亏 (逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲方式计算的浮动盈亏
非货币充抵金额	Number(20,3)	N	期货公司提供给客户结算单上的质押金，如仓单、有价证券等的充抵金额，不包含货币充抵金额  股票期权业务开展证券充抵保证金业务后，证券充抵保证金金额报送在此字段。
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否  供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用：  当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y；  当期货公司为中金所交易结算

			会员或交易会员时,此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ; 例如 : USD ; CNY
实有人民币资金	Number(20,3)	N	人民币实有货币资金余额,不含非货币充抵金额和货币充抵金额
货币充抵金额	Number(20,3)	N	当日其他货币余额的冲抵金额 以美元充抵人民币为例,此项为当日美元余额充抵为人民币的金额 无币种间充抵业务的客户该字段值为零
其它货币质出金额	Number(20,3)	N	原油期货暂无此业务,此字段值为零。
货币质押保证金占用	Number(20,3)	N	原油期货暂无此业务,此字段值为零。
当日总权利金	Number(20,3)	N	期权业务(含股票期权业务和商品期权业务)的当日权利金收支余额 无期权业务的该字段为零。
冻结资金	Number(20,3)	Y	针对股票期权业务增加此字段,即有冻结资金款项产生时,填写此字段。

资金权益总额=实有人民币资金+ 非货币充抵金额 + 货币充抵金额

资金权益总额(以人民币作为基准货币计量的涵盖各外币资产的总权益)=上日资金权益总额+当日总盈亏(逐日盯市)+当日总权利金+出入金记录文件的全部出入金合计+其他分项资金数据文件的资金金额总和(除客户总盈亏和卖方交割保证金)

### (5) 客户出入金记录文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户出入金记录文件名：

XXXXfundchg+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户出入金记录文件名为 0001fundchg20051008.txt。

每家期货公司每天需报送一个相应文件名的客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）出入金记录文件，该期货公司所属的客户每发生一次出金或入金，就有一条记录。其中期货期权资金账户和证券现货资金账户下的出入金记录均在此文件中报送。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送与其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构之间的出入金记录信息，不需要报送其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的出入金记录。

此文件包含人民币及外币出入金（含期货资管客户的认购款和赎回款）以及换汇引起的人民币和外币的增减变动。每条记录的字段和数据类型如下：

内容	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	期货期权业务：填报期货期权资金账户，以及该账户下的出入金 证券现货业务：填报证券现货资金账户，以及该账户下的出入金 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构视为客户处理：当客户为交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构时，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户

出入金额	Number(20,3)	N	出金为负，入金为正
客户结算账户或交易会员保证金专用账户银行统一标识	Char(2)	Y	期货类资管客户的认购款和赎回款在本出入金文件中反映。非银期转账的出入金，该字段可为空
客户结算账户或交易会员保证金专用账户	Char(32)	Y	期货期权业务 :填报期货结算账户 证券现货业务 :填报证券现货结算账户 非银期转账的出入金 ,该字段可为空
期货公司保证金专用账户银行统一标识	Char(2)	Y	非银期转账的出入金 ,该字段可为空
期货公司保证金专用账户	Char(32)	Y	非银期转账的出入金 ,该字段可为空
备注	Char(40)	Y	出入金类型为“2 手工调整出入金”的记录需在在此填写原因
是否为交易会员	Char(1)	N	Y : 是 ; N : 否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用 : 当期货公司为中金所全面结算会员 ,且其下客户为交易会员时 ,该字段为 Y ; 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时 ,此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ;例如 :USD ; CNY

出入金类型	Char(1)	N	目前仅区分正常出入金和换汇产生的出入金 0：正常出入金（银行有记录）； 1：换汇产生的出入金 2：手工调整出入金（银行无记录）
出入金发生日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD 该笔出入金真实发生的日期

### （6）期货成交明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户期货成交明细文件名：

XXXXtrddata+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的期货客户成交明细文件名为 0001trddata20051008.txt。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）的期货成交明细文件。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期货成交记录。

此文件不含期权成交明细，可能包含很多条记录。对于行权获得的期货合约，如计入当日期货成交量，则需报送在该文件中。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者、境外中介机构视为客户处理 如果是交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的成交明细，这里填报交易会

			员、境外特殊经纪参与者或境外 中介机构的内部资金账户
成交流水号	Char(16)	N	交易所发布的成交序列号
品种合约	Char(30)	N	
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
成交量	Number(10)	N	单位：手
成交价	Number(20,3)	N	
成交额	Number(20,3)	N	
成交时间	Time	N	格式：hh:mm:ss 对于行权后获得的期货合约(仅考虑计入当日成交量的期货合约,如不计入当日成交量,则无需报送),如没有准确的成交时间,则统一报送某个与交易所一致的虚拟时点(如15:30:00等)
开平仓标志	Char(1)	N	O：开仓；L：平仓
投机套保标志	Char(1)	N	S：投机； H：套保； A：套利
平仓盈亏(逐日盯市)	Number(20,3)	N	如开仓,则此字段为0
平仓盈亏(逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲方式的平仓盈亏,如开仓,则字段为0;
手续费	Number(20,3)	N	
交易编码	Char(13)	N	该笔成交对应交易所的客户交易编码

交易所统一标识	Char(1)	N	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
报单号	Char(12)	Y	交易所成交单中的报单号
席位号	Char(15)	Y	完成该笔成交的席位号
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如 :USD; CNY
成交日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD， 该笔成交发生的日期

### (7) 期货持仓数据文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户期货持仓数据文件名：

XXXXholddata+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户期货持仓数据文件名为 0001holddata20051008.txt。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构)的期货持仓数据文件。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下交

易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期货持仓数据。

此文件不包含期权的持仓明细，但行权后获得的期货持仓须报送在该文件中。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户。 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者、境外中介机构视为客户处理 如果是交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的持仓明细，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
投机套保标志	Char(1)	N	S：投机； H：套保； A：套利 中金所仅用“S：投机”
持仓量	Number(10)	N	单位：手
交易保证金	Number(20,3)	N	
持仓盈亏(逐日盯市)	Number(20,3)	N	
持仓盈亏(逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲方式的持仓盈亏
持仓均价	Number(20,3)	Y	

昨结算价	Number(20,3)	Y	
今结算价	Number(20,3)	Y	
交易编码	Char(13)	N	该笔持仓对应交易所的客户交易编码
交易所统一标识	Char(1)	N	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ;例如 :USD; ;CNY
备兑标志	Char(1)	Y	1：Covered 备兑； 2：Uncovered 非备兑。 该字段适用有期权备兑业务的品种合约 如该品种合约不参与期权备兑业务，此字段可为空 郑商所的“备兑”仓须同时标识为“投机”仓

**(8) 客户其它分项资金数据文件**

期货公司（统一标识 XXXX）的客户其它分项资金数据文件名：

XXXXotherfund+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 的期货公司的客户其它分项资金数据文件名为 0001otherfund20051008.txt。

该数据文件提供分交易所分客户的其它分项资金数据，如非货币充抵资金、交割货款等。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外中介机构，须报送其客户，以及其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部分项资金数据。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户。 如果是交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部分项资金数据，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
交易所统一标识	Char(1)	Y	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心；H：上海证券交易所； P：深圳证券交易所 如果资金项目为交易手续费 A001，结算手续费 A017，手续费返还 A031，利息 A032 时，资金

			金额取客户在所有交易所的资金合计数，该交易所标识字段可以为空。其余资金项目必须分交易所报送，不能为空
资金项目编号	Char(4)	N	
资金金额	Number(20,3)	N	+表示客户收入，-表示支出
备注	Char(100)	Y	用于说明期货公司调整资金项目的理由
交易编码	Char(13)	N	该笔分项资金对应期货交易所的客户交易编码和证券交易所的客户证券账户及衍生品合约账户
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD；CNY

其中，各项资金的资金项目编号统一定义如下：

客户总盈亏 ( 持仓盈亏+平仓盈亏+交割配对盈亏+行权盈亏 )	A000
交易手续费 ( 含股票期权业务的“清算经手费”和“权利金结算费” )	A001
交割货款 ( 含股票期权业务的“清算行权交收资金” )	A002
交割手续费 ( 含股票期权业务的“清算行权过户费” )	A003

非货币充抵变动额( 今日非货币充抵余额 -上日非货币充抵余额 ) 证券充抵保证金业务开展后 , 证券充抵保证金的变动额也报送在此字段。	A004
非货币充抵手续费	A005
期转现手续费	A006
仓储费/仓租费	A007
交割配对盈亏 ( 逐日盯市 )	A008
仓单升贴水	A009
仓单转让手续费	A010
交割定金/定金	A011
定金罚没	A012
交割违约罚款	A013
仓单抵押手续费	A014
强平盈利罚没	A015
冻结款	A016
结算手续费	A017
仓单转让货款	A018
卖方交割保证金 ( 交易所以扣划席位资金的方式收取卖方保证金时 ,填报此字段 )	A019
买方交割补偿金	A020
卖方交割补偿金	A021
过户费 ( 国债 )	A022
转托管费	A023
行权手续费 ( 含股票期权业务的“清算行权结算费”以及商品期权行权产生的所有费用 )	A024
货币充抵变动额 ( 今日货币充抵余额 - 上日货币充抵余额 )	A026
资产管理业绩报酬或管理费	A027
中金所申报费	A030
手续费返还	A031
利息	A032
其他与客户有关资金	A999

需要说明的是，这里列出的资金项目比较多，有的项目几家交易所都有，有的项目可能只有某家交易所才有。为了灵活起见，设计了这种报送格式，而没有设计成固定项目的报送格式。特别注意，上述资金项目除客户总盈亏 A000、交易手续费 A001、交割手续费 A003、结算手续费 A017、行权手续费 A024、资产管理业绩报酬或管理费 A027、手续费返还 A031、利息 A032 之外，均来自交易所每日资金变动文件，期货公司须每日从交易所下载每日资金变动文件，将其导入会员结算系统，会员结算系统根据该文件的数据，自动调整客户权益，并根据该文件数据，记录客户权益的各类明细变动项目。以保证上述资金项目除了交易手续费 A001、交割手续费 A003、结算手续费 A017、行权手续费 A024、资产管理业绩报酬或管理费 A027 之外，其它必须与交易所在时间和金额上保持一致。如果因特殊情况期货公司需要调整的，需在“备注”中作专项说明。如果交易所提供给会员的结算文件中没有提供详细的分项资金数据，期货公司在报送时可以列在“其他”资金项目中。此外，如某些资金项目是分多笔发生的，需要分笔列出，不得合计。

增加 A027“资产管理业绩报酬或管理费”项目，用于列示有资产管理业务的期货公司根据与客户签订的资产管理合同向客户收取的业绩报酬或管理费。

股票期权业务中不涉及证券现货部分的费用，填报方式如下：（1）“权利金结算费”和“清算经手费”填报在 A001 交易手续费字段；（2）“清算行权交收资金”填报在 A002 交割货款字段；（3）“清算行权过户费”填报在 A003 交割手续费字段；（4）“清算行权结算费”填报在 A024 行权手续费字段。

商品期权业务中，交易手续费、行权手续费等具体项目的安置，需视各家交易所的规则区别对待，并与其保持一致。

### （9）其它需要说明的信息或数据文件

期货公司（统一标识 XXXX）其它需要说明的信息或数据文件名：

XXXXotherinfo+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 的期货公司的其它需要说明的信息或数据文件名为 0001otherinfo20051008.txt。

此文件用于说明成交持仓盈亏等交易数据与交易所不符的，出入金与银行记录不符的，以及其它期货公司需要说明的信息。如当日有错单和资金在途情况发生，期货公司须对该情况作详细说明，且必须写明客户（或交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）的内部资金账户。如果是关于整个期货公司的说明，客户内部资金账户栏位留空。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD

客户内部资金账户	Char(18)	Y	<p>此字段填写期货期权资金账户</p> <p>如果是关于某客户或交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的说明，必须写明该客户、交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户</p> <p>如是关于期货公司的说明，该栏位留空</p>
事由	Char(2)	N	<p>CD：错单；</p> <p>ZT：资金在途；</p> <p>QT：其它</p>
描述	Text	N	<p>有关期货公司、客户、交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的所涉事项的具体描述</p> <p>描述内容中不得出现回车换行符,如果有,转义为 [ent] 后再报送</p>
是否为交易会员	Char(1)	N	<p>Y：是；N：否</p> <p>供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使</p>

			用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
--	--	--	---

### (10) 期货平仓明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户期货平仓明细文件名：

XXXXliquiddetails+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户期货平仓明细文件名为 0001liquiddetails20051008.txt。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户期货平仓明细文件，该文件数据供投资者查询服务系统使用。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其下交易会员的期货平仓明细。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期货平仓明细。

此文件不包含期权和证券现货的平仓明细。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的期货平仓明细数据，这里填报境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	

成交流水号	Char(16)	N	交易所发布的成交序列号
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
成交价	Number(20,3)	N	平仓时的成交价
开仓价	Number(20,3)	N	开仓时的成交价
成交量	Number(10)	N	平仓手数，单位：手
昨结算价	Number(20,3)	N	
今结算价	Number(20,3)	N	
平仓盈亏(逐日盯市)	Number(20,3)	N	
平仓盈亏(逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲方式的平仓盈亏
原成交流水号	Char(16)	Y	交易所在客户开仓时发布的成交序列号
交易编码	Char(13)	N	该笔平仓对应交易所的客户交易编码
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ;例如 :USD ; CNY
成交日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD 该笔成交发生的日期

### (11) 期货持仓明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户期货持仓明细文件名：

XXXXholddetails+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 的期货公司的客户期货持仓明细文件名为 0001holddetails20051008.txt。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户期货持仓明细文件，该文件数据供投资者查询服务系统使用。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其下交易会员的期货持仓明细。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外

中介机构的客户的全部期货持仓明细。

此文件不包含期权和证券现货的持仓明细。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的期货平仓明细数据，这里填报境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	
成交流水号	Char(16)	N	交易所发布的成交序列号
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
投机套保标志	Char(1)	N	S：投机； H：套保； A：套利
持仓量	Number(10)	N	单位：手
开仓价	Number(20,3)	N	
昨结算价	Number(20,3)	N	
今结算价	Number(20,3)	N	
持仓盈亏(逐日盯市)	Number(20,3)	N	
持仓盈亏(逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲方式的持仓盈亏
交易编码	Char(10)	N	该笔持仓对应交易所的客户交易编码

交易保证金	Number(20,3)	N	该笔持仓占用的交易保证金
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如:USD; CNY
成交日期	Date	Y	格式 : YYYY-MM-DD
备兑标志	Char(1)	Y	1 : Covered 备兑 ; 2 : Uncovered 非备兑。该字段适用有期权备兑业务的品种合约 如该品种合约不参与期权备兑业务 , 此字段可为空 郑商所的“备兑”仓须同时标识为“投机”仓

### (12) 非货币充抵明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户非货币充抵明细文件名：

XXXXmortgagedetails+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 公司的客户非货币充抵明细文件名为 0001mortgagedetails20051008.txt。

在充入或充出发生当日报送该笔充抵明细，充入时充抵金额为正，充出时为负。充抵金额为发生额。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户非货币充抵明细文件，该文件数据供投资者查询服务系统使用。该文件中的充抵品涵盖各期货交易所允许的商品、有价证券等充抵品品种；外币与人民币之间的充抵明细不体现在该文件中。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其下交易会员的非货币充抵明细。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部非货币充抵明细。

证券交易所的充抵业务的填报方式待相关规则颁布后另行确定。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	充入或充出发生日，格式： YYYY-MM-DD

客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的非货币充抵明细数据,这里填报境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
充抵品名称	Char(6)	N	商品填写品种代码,如:cu,ru,al等 国债填写6位国债代码
充抵手数	Number(10)	N	仓单单位:手 国债单位:张
充抵价格	Number(20,3)	N	仓单:每吨的折后价格 国债:每百元面值的折后价格
充抵金额	Number(20,3)	N	充入为正,充出为负
币种	Char(3)	N	按照ISO 4217; 例如:USD; CNY

### (13) 期货交割明细文件

期货公司(统一标识XXXX)的客户期货交割明细文件名:

XXXXdelivdetails+日期.txt

如报送日期为2005年10月8日、标识为0001的期货公司的客户期货交割明细文件名为0001delivdetails20051008.txt。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户期货交割明细文件,该文件数据供投资者查询服务系统使用。

如果期货公司为中金所全面结算会员,不需要报送其下交易会员的期货交割明细。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构,须报送其客户和境外特殊非经纪参与者,以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的期货交割明细。

每条记录的字段和数据类型如下:

字段	数据类型	是否可为空	备注
----	------	-------	----

日期	Date	N	交割日，格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外 中介机构的客户的期货交割明细数 据，这里填报境外特殊经纪参与者 或境外中介机构内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	交割合约号
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
成交均价	Number(20,3)	N	分客户、分品种合约、分买卖方向 的开仓成交均价
成交金额	Number(20,3)	N	总额
交割结算价	Number(20,3)	N	
交割货款	Number(20,3)	N	
交割手数	Number(10)	N	单位：手
交割手续费	Number(20,3)	N	
交割配对盈亏	Number(20,3)	N	取消，但需留位
交易编码	Char(13)	N	该笔交割对应交易所的客户交易编 码
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD；CNY

#### (14) 期货待交割结算合约文件

公司（统一标识 XXXX）的客户期货待交割结算合约文件名：

XXXXdelivcontractdata+日期.txt

如报送日期为 2005 年 10 月 8 日、标识为 0001 公司的客户期货待交割结算合约  
文件名为 0001delivcontractdata20051008.txt。

期货公司每天需报送一个相应文件名的客户期货待交割结算文件，该文件须分客  
户、分品种合约、分买卖方向。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其下交易会员的期货待交割数  
据。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的期货待交割数据。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的期货待交割结算数据，这里填报境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	
成交流水号	Char(16)	Y	取消，但需留位
买卖标志	Char(1)	N	B：买入交割； S：卖出交割
待交割持仓量	Number(10)	N	单位：手
交割保证金	Number(20,3)	N	单位：元
开仓价	Number(20,3)	Y	取消，但需留位
交割结算价	Number(20,3)	N	
交易编码	Char(13)	N	该笔待交割持仓对应交易所的客户交易编码
交易所统一标识	Char(1)	N	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心

是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD；； CNY

### (15) 汇兑明细文件

公司（统一标识 XXXX）的客户汇兑明细文件名规定如下：

XXXXexchangedetails + 日期.txt

如结算日期为 2012 年 01 月 04 日、标识为 0001 公司的客户汇兑明细文件名为 0001exchangedetails20120104.txt。

有汇兑业务的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户汇兑明细文件，该公司所属的客户每发生一次汇兑，就有一条记录。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其下境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的汇兑明细，不需要报送其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的汇兑明细。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的汇兑明细数据，这里填报境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
汇兑日期	Date	N	汇兑实际发生日期，格式：YYYY-MM-DD

外币币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ; 例如 : USD ;
外币金额	Number(20,3)	N	以正数表示
本币币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ; 例如 : CNY
本币金额	Number(20,3)	N	以正数表示
当笔兑换汇率	Number(10,4)	N	
交易时间	Time	N	hh:mm:ss
记账流水号	Char(30)	N	银行发布的已成功换汇的记账流水号
换汇方向	Char(1)	N	0:结汇 ; 1 : 售汇
外币账号	Char(32)	N	
外币账户名称	Char(60)	N	
本币账号	Char(32)	N	
本币账户名称	Char(60)	N	
换汇业务种类	Char(2)	N	C1 : 客户盈亏换汇 ; C2 : 客户交割货款换汇
备注	Char(70)	Y	
银行统一标识	Char(2)	N	用 01、02 等标识 01 : 工商银行 ; 02 : 农业银行 ; 03 : 中国银行 ; 04 : 建设银行 ; 05 : 交通银行 ; 06 : 浦发银行 ; 07 : 兴业银行 ; 08 : 汇丰银行 ; 09 : 光大银行 ; 10 : 招商银行 ;

			11：中信银行； 12：民生银行； 13：平安银行； 16：广发银行； 99：其他银行
--	--	--	---

### (16) 货币充抵资金文件

公司（统一标识 XXXX）的货币充抵资金文件名规定如下：

XXXXcurrencymortgage+日期.txt

如结算日期为 2012 年 01 月 04 日、标识为 0001 公司的货币充抵资金文件名为 0001currencymortgage20120104.txt。

有币种间充抵业务的期货公司每天需报送一个相应文件名的货币充抵资金文件，每位客户每类原币种一条记录。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其下境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构的货币充抵资金，不需要报送其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的充抵资金。

期货公司为客户计算外币充抵金额时采用的汇率和折扣率须与交易所为会员计算充抵金额时采用的汇率和折扣率保持一致。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填写期货期权资金账户 如果是境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的货币充抵资金数据，这里填报境外特殊经纪参与者或境外中介机构内部资金账户
原币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD 例如用美元充抵人民币，则此项为 USD
原币种余额	Number(20,3)	N	例如，当日客户在期货公司的美元余额为 10 万美元，则此项为

			100000.00
充抵目标币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如： CNY 例如用美元充抵人民币，则此项为 CNY
充抵金额	Number(20,3)	N	充抵为目标币种的金额 如用美元充抵人民币： 充抵金额=美元今日余额×充抵汇率×充抵折扣率 此字段的数值应与客户基本资金数据文件中的“货币充抵金额”字段的数值相同
充抵汇率	Number(10,4)	N	人民银行公布的上一日外汇中间价
充抵折扣率	Number(16,8)	N	
备注	Text	Y	

### (17) 单一客户综合类资产管理业务投资账户文件

期货公司（统一标识 XXXX）的综合类资产管理业务投资账户文件名：

XXXXamaccounts+日期.txt

如报送日期为 2012 年 11 月 22 日、标识为 0001 期货公司的综合类资产管理业务投资账户文件名为 0001amaccounts20121122.txt。

期货公司的单一客户资产管理业务如果投资非本公司经纪业务，则自开立非期货类投资账户之日起五个工作日内报送该文件。如果只投资本公司经纪业务，则可以不报送此文件。

此文件中要求的“客户内部资金账户”字段，需填写单一客户综合类资产管理客户的期货期权资金账户。

每条记录的字段和数据类型如下：

内容	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	资产管理户的期货期权内部资金账户

机构名称	Char(400)	N	资产管理投资产品所在的机构，写明到分支机构
机构类型	Char(4)	N	具体定义详见机构类型定义表
投资账户	Char(22)	Y	例如，证券公司的内部资金账户等。 如无投资账户，此项可为空。
备注	Char(40)	Y	如机构类型为其他，以及有超出以上账户的其他投资，在此说明。

其中，机构类型统一定义如下：

银行	C001
证券公司	C002
基金公司	C003
保险公司	C004
信托公司	C005
其它	C999

### (18) 资产管理业务托管账户和资管结算账户文件

期货公司（统一标识 XXXX）的资产管理业务的托管账户和一对一综合类资管业务的结算账户文件名：

XXXXamcustodyaccount+日期.txt

如报送日期为 2012 年 11 月 22 日、标识为 0001 期货公司的资产管理业务托管账户和资管结算账户文件名为 0001amcustodyaccount20121122.txt。

期货公司开展资产管理业务委托托管机构进行托管的，自公司收到客户资金之日起报送该文件。

每条记录的字段和数据类型如下：

内容	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	资产管理户的期货期权资金账户

托管机构名称	Char(400)	N	写明到分支机构
托管账户	Char(32)	Y	期货公司在托管机构开立的托管账户。
托管账户户名	Char(400)	Y	
结算机构名称	Char(400)	Y	写明到分支机构
客户资管结算账户	Char(32)	Y	只需报送需要托管的单一客户资管计划的客户资管结算账户，特定多个客户资管计划的该字段为空。
币种	Char(3)	Y	按照 ISO 4217；例如：USD；CNY
备注	Char(40)	Y	用于区分“单一客户”及“特定多个客户” 如客户类型为特定多个客户资产管理计划，此字段标注“特定多个客户”，单一客户资产管理计划无需标注

### (19) 资产管理非本公司经纪业务资金数据文件

期货公司（统一标识 XXXX）的资产管理非本公司经纪业务资金数据文件名：  
XXXXamassets+日期.txt

如报送日期为 2012 年 11 月 22 日、标识为 0001 期货公司的资产管理非期货类资金数据文件名为 0001amassets20121122.txt。

本文件报送期货公司资产管理业务中非本公司经纪业务的资金数据（即本公司期货、期权、证券现货等经纪业务通道之外的所有业务合计的资金数据）。

期货公司如有资产管理业务且通过本公司经纪业务通道外进行交易的，每天需报送一个相应文件名的资产管理非本公司经纪业务资金数据文件。如果只通过本公司经纪业务通道进行交易，则可以不报送此文件。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
----	------	-------	----

日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	资产管理户的期货期权资金账户
当日盈亏	Number(20,3)	N	所有非期货类投资品种的当日盈亏总和,综合资管账户的期货交易盈亏不包含在内,通过原有期货保证金安全存管数据文件报送
净值总额	Number(20,3)	N	所有非期货类投资品种的净值总额总和
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如:USD; CNY
备注	Char(40)	Y	用于区分“单一客户”及“特定多个客户” 如客户类型为特定多个客户综合类资产管理户,此字段标注“特定多个客户”,单一客户综合类资产管理户无需标注

## (20) 期权成交明细文件

期货公司(统一标识XXXX)的客户期权成交明细数据文件名:

XXXXopttrddata+日期.txt

如报送日期为2014年10月8日、标识为0001期货公司的客户期权成交明细数据文件名为0001opttrddata20141008.txt。

开展期权业务(含股票期权业务)的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户(包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构)的期权成交明细数据文件。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构,须报送其客户和境外特殊非经纪参与者,以及其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期权成交明细记录。

每条记录的字段和数据类型如下:

字段	数据类型	是否可为空	备注
----	------	-------	----

日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填报期货期权资金账户 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者、境外中介机构视为客户处理 如果是交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户期权成交明细，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户
成交流水号	Char(16)	N	
品种合约	Char(30)	N	商品期权合约代码，如“M1311-C-2900”等； 股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
成交量	Number(10)	N	单位： 其中商品期权以“手”为单位； 股票期权以“张”为单位；
权利金单价	Number(20,9)	N	
权利金	Number(20,3)	N	成交量×合约单位×权利金单价 以正数表示

成交时间	Time	N	格式：hh:mm:ss
开平仓标志	Char(1)	N	O：开仓；L：平仓
投机套保标志	Char(1)	Y	S：投机； H：套保； A：套利 中金所仅用“S：投机” 股票期权业务下，此字段为空
手续费	Number(20,3)	N	期货交易所和证券交易所的交易手续费均在此字段填报 其中股票期权业务的交易手续费填报清算手续费和权利金结算费的合计金额。
期权类型	Char(1)	N	C：看涨期权 P：看跌期权
执行价	Number(20,9)	N	
标的品种	Char(6)	N	商品期权：填写标的品种的大写英文字母 股票期权：填写标的品种的证券代码
标的合约	Char(30)	N	商品期权：合约中的品种用大写英文字母表示； 股票期权：填写标的合约中的证券的中文简称
交易编码	Char(13)	N	商品期权时，该笔成交对应期货交易所的客户交易编码

			股票期权时，该笔成交对应 证券交易所的衍生品合约账 户（即客户证券账户+“888”）
交易所统一标识	Char(1)	N	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心； H：上海证券交易所； P：深圳证券交易所
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员 下的交易会员和一般客户使 用： 当期货公司为中金所全面结 算会员，且其下客户为交易 会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结 算会员或交易会员时，此处 均为 N
报单号	Char(12)	Y	交易所成交单中的报单号
席位号	Char(15)	Y	完成该笔成交的席位号
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217：例如：USD： CNY
成交日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD， 该笔成交发生的日期

备兑标志	Char(1)	Y	1 : Covered 备兑 ; 2 : Uncovered 非备兑 该字段适用有期权备兑业务的品种合约 如该品种合约不参与期权备兑业务 , 此字段可为空
------	---------	---	--

### (21) 期权持仓数据文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户期权持仓数据文件名：

XXXXoptholddata+日期.txt

如报送日期为 2014 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户期权持仓数据文件名为 0001optholddata20141008.txt。

有期权业务（含股票期权业务）的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）的期权持仓数据文件。

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外非特殊经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户境外特殊非经纪参与者，以及其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的期权持仓数据。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填报客户期货期权资金账户 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构视为客户处理 如果是交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户持仓明细，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的

			内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	商品期权合约代码，如“M1311-C-2900”等； 股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
投机套保标志	Char(1)	Y	S：投机； H：套保； A：套利 股票期权业务下，此字段为空。
持仓量	Number(16)	N	商品期权以“手”为单位； 股票期权以“张”为单位
交易保证金	Number(20,3)	N	期权卖方交易保证金 股票期权业务时，对应“应交维持保证金金额”
持仓盈亏(逐日盯市)	Number(20,3)	Y	
持仓盈亏(逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	
持仓均价	Number(20,9)	Y	
昨结算价	Number(20,9)	Y	
今结算价	Number(20,9)	Y	
交易编码	Char(13)	N	商品期权：该笔持仓对应期货交易所的客户交易编码 股票期权：该笔持仓对应证券交易所的衍生品合约账户(即客户证券

			账户+“888” )
交易所统一标识	Char(1)	N	S : 上海期货交易所 ; Z : 郑州商品交易所 ; D : 大连商品交易所 ; J : 中国金融期货交易所 ; N : 上海国际能源交易中心 ; H : 上海证券交易所 ; P : 深圳证券交易所
是否为交易会员	Char(1)	N	Y : 是 ; N : 否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用 : 当期货公司为中金所全面结算会员 , 且其下客户为交易会员时 , 该字段为 Y ; 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时 , 此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217 ; 例如 : USD ; CNY
期权类型	Char(1)	N	C : 看涨期权 P : 看跌期权
执行价	Number(20,9)	N	
标的品种	Char(6)	N	商品期权 : 填写标的品种的大写英文字母 股票期权 : 填写标的品种的证券代码。
标的合约	Char(30)	N	商品期权 : 合约中的品种用大写英文字母表示 ;

			股票期权 填写标的合约中的证券的中文简称。
备兑标志	Char(1)	Y	1 : Covered 备兑 ; 2 : Uncovered 非备兑。 该字段适用有期权备兑业务的品种合约。 如该品种合约不参与期权备兑业务，此字段可为空 郑商所的“备兑”仓须同时标识为“投机”仓

## (22) 期权行权明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户商品期权和股票期权行权数据明细文件名：  
XXXXoptexerdata+日期.txt

如报送日期为 2014 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户期权行权明细数据文件名为 0001optexerdata20141008.txt，此文件包含商品期权和股票期权执行或履约明细。

开展期权业务(含股票期权业务)的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户（包括其下交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构）的期权行权明细数据文件，

如果期货公司为中金所全面结算会员或其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期权行权明细记录。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填报客户期货期权资金账户 将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者

			或境外中介机构视为客户处理 如果是交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户期权行权明细，这里填报交易会员、境外特殊经纪参与者或境外中介机构的内部资金账户
品种合约	Char(30)	N	商品期权合约代码，如“M1311-C-2900”等； 股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”
执行日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
执行时间	Time	Y	格式：hh:mm:ss 如没有准确的行权时间，则统一报送某个与交易所一致的虚拟时点（如 15:30:00 等）
流水号	Char(16)	N	商品期权：交易所发布的成交序列号 股票期权：经过有效性验证确认后的行权编号
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
投机套保标志	Char(1)	Y	S：投机； H：套保； A：套利 中金所仅用“S：投机”

			股票期权业务下，此字段为空
执行手数	Number(10)	N	商品期权：以“手”为单位 股票期权：以“张”为单位
执行价	Number(20,9)	N	
行权盈亏	Number(20,3)	Y	商品期权：期权现金交割业务形成的盈亏金额，无此业务的交易所该字段为零 股票期权业务下，此字段为空
手续费	Number(20,3)	N	商品期权的行权手续费和股票期权的行权结算费均填报在此字段。
期权类型	Char(1)	N	C：看涨期权 P：看跌期权
标的品种	Char(6)	N	商品期权：填写标的品种的大写英文字母 股票期权：填写标的品种的证券代码。
标的合约	Char(30)	N	商品期权：合约中的品种用大写英文字母表示； 股票期权：填写标的合约中的证券的中文简称。
交易编码	Char(13)	N	商品期权：该笔成交对应期货交易所的客户交易编码 股票期权：该笔成交对应的证券交易所的衍生品合约账户（即客户证券账户号+“888”）

交易所统一标识	Char(1)	N	S：上海期货交易所； Z：郑州商品交易所； D：大连商品交易所； J：中国金融期货交易所； N：上海国际能源交易中心； H：上海证券交易所； P：深圳证券交易所
是否为交易会员	Char(1)	N	Y：是；N：否 供区分中金所全面结算会员下的交易会员和一般客户使用： 当期货公司为中金所全面结算会员，且其下客户为交易会员时，该字段为 Y； 当期货公司为中金所交易结算会员或交易会员时，此处均为 N
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD； CNY
行权锁定保证金	Number(20,3)	Y	股票期权行权、并产生锁定保证金时，填报此字段
冻结资金	Number(20,3)	Y	股票期权业务时，如有冻结资金款项，需填报此字段

### (23) 期权平仓明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户商品期权和股票期权平仓明细文件名：  
XXXXOptliquiddetails+日期.txt

如报送日期为 2014 年 10 月 8 日、标识为 0001 期货公司的客户商品期权和股票期权平仓明细文件名为 0001optliquiddetails20141008.txt。

开展期权业务（含股票期权业务）的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户期权平仓数据文件，该文件数据供投资者查询服务系统使用。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其下交易会员的期权平仓明细。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期权平仓明细。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填报客户期货期权资金账户。
品种合约	Char(30)	N	商品期权合约代码，如“M1311-C-2900”等； 股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”
成交流水号	Char(16)	N	
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
成交价	Number(20,9)	N	平仓时的权利金成交价
开仓价	Number(20,9)	N	开仓时的权利金成交价
成交量	Number(10)	N	平仓数量 商品期权以“手”为单位 股票期权以“张”为单位
昨结算价	Number(20,9)	N	
今结算价	Number(20,9)	N	
权利金	Number(20,3)	N	平仓时的权利金总额 以正数表示
开仓权利金	Number(20,3)	Y	开仓时的权利金总额

			以正数表示
原成交流水号	Char(16)	Y	
交易编码	Char(13)	N	商品期权 :该笔平仓对应期货交易所的客户交易编码 ; 股票期权 :该笔平仓对应证券交易所的衍生品合约账户( 即客户证券账户+888 )。
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如:USD; CNY
成交日期	Date	N	格式 : YYYY-MM-DD 该笔成交发生的日期
备兑标志	Char(1)	Y	1 : Covered 备兑 ; 2 : Uncovered 非备兑。 该字段适用有期权备兑业务的品种合约 如该品种合约不参与期权备兑业务 , 此字段可为空

#### (24) 期权持仓明细文件

期货公司（统一标识 XXXX）的客户商品期权和股票期权持仓明细文件名：  
XXXXOpholddetails+日期.txt

如报送日期为 2014 年 10 月 8 日、标识为 0001 的期货公司的客户商品期权和股票期权持仓明细文件名为 0001opholddetails20141008.txt。

开展期权业务（含股票期权业务）的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户期权持仓明细文件，该文件数据供投资者查询服务系统使用。

如果期货公司为中金所全面结算会员，不需要报送其下交易会员的期权持仓明细。

如果期货公司其下具有境外特殊经纪参与者、境外特殊非经纪参与者或境外中介机构，须报送其客户和境外特殊非经纪参与者，以及其下境外特殊经纪参与者或境外中介机构的客户的全部期权持仓明细。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	此字段填报客户期货期权资金账户。
品种合约	Char(30)	N	商品期权合约代码，如“M1311-C-2900”等； 股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”
成交流水号	Char(16)	Y	股票期权业务下，此字段可为空
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
投机套保标志	Char(1)	Y	S：投机； H：套保； A：套利 股票期权业务下，此字段为空
持仓量	Number(10)	N	商品期权以“手”为单位 股票期权以“张”为单位
开仓价	Number(20,9)	N	
昨结算价	Number(20,9)	N	
今结算价	Number(20,9)	N	
持仓盈亏(逐日盯市)	Number(20,3)	N	
持仓盈亏(逐笔对冲)	Number(20,3)	Y	逐笔对冲方式的持仓盈亏
交易编码	Char(13)	N	商品期权：该笔持仓对应期货交易所的客户交易编码 股票期权：该笔持仓对应证

			券交易所的衍生品合约账户 ( 即客户证券账户+888 )
交易保证金	Number(20,3)	N	商品期权 : 期权卖方交易保证金金额 ; 股票期权 : 期权卖方应交维持保证金金额
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如:USD; CNY
成交日期	Date	Y	格式 : YYYY-MM-DD
备兑标志	Char(1)	Y	1 : Covered 备兑 ; 2 : Uncovered 非备兑。 该字段适用有期权备兑业务的品种合约 如该品种合约不参与期权备兑业务 , 此字段可为空 郑商所的“备兑”仓须同时标识为“投机”仓

#### (25) 资产管理非本公司经纪业务资金明细文件

期货公司 ( 统一标识 XXXX ) 的资产管理非本公司经纪业务资金明细文件名:  
XXXXamassetsdetails+日期.txt

如报送日期为 2012 年 11 月 22 日、标识为 0001 期货公司的资产管理非本公司经纪业务资金明细文件名为 0001amassetsdetails20121122.txt。

本文件报送期货公司资产管理业务中非本公司经纪业务的资金明细 ( 即本公司期货、期权、证券现货等经纪业务通道之外的所有业务的资金明细 )。

期货公司如有资产管理业务且通过本公司经纪业务通道外进行交易的, 每天需报送一个相应文件名的资产管理非本公司经纪业务资金明细文件, 其中“当日盈亏”及“当日净值”应填写分“投资标的类型”的盈亏及净值。如果只投资期货, 则可以不报送此文件。

每条记录的字段和数据类型如下:

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账户	Char(18)	N	资产管理计划的内部资金账户
投资标的类型	Char(4)	N	具体定义详见投资标的类型表
当日盈亏	Number(20,3)	N	所有非本公司经纪业务分投资标的类型的当日盈亏，通过本公司经纪业务进行交易的盈亏不包含在内，通过本数据报送要求的其他文件报送
当日净值	Number(20,3)	N	所有非本公司经纪业务分投资标的类型的净值金额
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217; 例如:USD; CNY
是否为特定多个客户资产管理计划	Char(1)	N	Y：是；N：否 当账户为特定多个客户资产管理计划时，该字段为 Y； 当账户为单一客户综合类资产管理户时，该字段为 N；
备注	Char(40)	Y	
产品编码	Char(12)	Y	资产管理计划在基金业协会备案的产品编码，备案制实施前的单一客户资产管理计划该字段可为空。

其中，投资标的类型统一定义如下：

股票与权证	D001
股票期权	D002
固定收益类证券	D003
公开募集证券投资基金	D004
现金	D005

其它	D999

需要说明如下内容：

1、净值、盈亏均为上一交易日结算后数据，以元为单位。当日盈亏均为与前一交易日比较后的盈亏，无需扣除手续费、管理费等费用。

2、股票期权当日净值的报送口径为：卖出期权持仓占用保证金+买入期权市值-卖出期权市值。

3、固定收益类证券包括国债、央行票据、短期融资券、资产支持证券、债券逆回购及其他固定收益证券。

4、现金为该产品募集的全部资金中投资于非期货类市场但尚未被交易占用的部分，包括各类备付金及用于清算的款项。

### (26) 客户证券现货资金文件；

期货公司（统一标识 XXXX）的客户证券现货资金文件名：

XXXXsefund+日期.txt

如报送日期为 2014 年 10 月 8 日、标识为 0001 的期货公司的客户证券现货资金文件名为 0001sefund20141008.txt。

开展股票期权业务的期货公司每天需报送一个相应文件名的客户证券现货资金文件，每个客户一条记录。

期货公司经纪客户和资管客户涉及股票期权相关现货的资金数据均须在此报送。

每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户证券现货内部资金账号	Char(18)	N	期货公司开展与股票期权备兑开仓以及行权相关证券经纪业务时，为客户单独开立的证券现货资金账户。
当日资金余额	Number(20,3)	N	证券现货账户内，未被占用的可用资金总额以及冻结资金等全部资金金额合计。 可用资金余额为负，表示客户资金不足。
当日可用资金	Number(20,3)	N	证券现货账户内当日可用资

			金余额，可用资金余额为负，表示客户资金不足。
买券金额合计	Number(20,3)	N	当日客户证券账户内，用于买券的资金合计，以正数表示。
卖券金额合计	Number(20,3)	N	当日客户证券现货账户内，卖券所得资金合计，以正数表示。
出金合计	Number(20,3)	N	当日客户证券现货账户内的出金合计，以负数表示。
入金合计	Number(20,3)	N	当日客户证券现货账户内的入金合计，以正数表示。
上日资金余额	Number(20,3)	N	客户证券现货账户内上日资金余额
股票市值	Number(20,3)	N	客户所持股票现货的市值。
总资产	Number(20,3)	N	总资产=股票市值+当日资金余额
印花税	Number(20,3)	N	以正数表示
经手费	Number(20,3)	N	以正数表示
过户费	Number(20,3)	N	以正数表示
证管费	Number(20,3)	N	以正数表示
手续费	Number(20,3)	N	以正数表示
其他费用	Number(20,3)	N	以正数表示
利息	Number(20,3)	N	以正数表示
实际收付	Number(20,3)	N	实际收付为正数时以正数表

			示，实际收付为负数时，以负数表示。
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD；CNY
备注	Char(40)	Y	

其中，出金合计应= $\sum$ （5）客户出入金记录文件证券现货账户中的出金记录；

入金合计= $\sum$ （5）客户出入金记录文件证券现货账户中的入金记录。

总资产=股票市值+当日资金余额

当日资金余额=上日资金余额-买券金额合计+卖券金额合计+出金合计+入金合计-印花税-经手费-过户费-证管费-手续费-其他费用+利息

当日资金资金余额=上日资金余额+实际收付

### （27）客户证券现货成交明细文件

期货公司报送客户证券现货成交明细文件的文件名规定如下：

报送单位代码+setrddata+日期.txt

该文件提供客户的交易产生的证券现货成交明细及非交易有资金变动的成交明细，可能包含很多条记录。每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户证券现货内部资金账户	Char(18)	N	
客户证券账户	Char(13)	N	发生股票变动的证券账户
交易所统一标识	Char(2)	N	H：上海证券交易所； P：深圳证券交易所
成交流水号	Char(16)	Y	成交编号
证券代码	Char(6)	N	
证券的中文简称	Char(30)	N	

证券类别	Char(2)	Y	GZ：固定收益类 JJ：基金 PT：无限售流通股 PG：配股 PS：配售股 PZ：权证 GJ：国家股 GF：国有法人股 JN：境内法人股 JW：境外法人股 SF：社会法人股 XL：限售流通股 YX：优先法人股 ZG：职工股
流通类型	Char(1)	Y	0：无限售流通 N：限售或非流通 F：限售或非流通 J：限售或非流通 Q：限售或非流通 Z：限售或非流通 1-9：权益次数 A：限售或非流通 B：限售或非流通 C：限售或非流通
权益类别	Char(2)	Y	DF：兑付

			DX：兑息 HL：红利 P：配股 S：送股 Z：转配
挂牌年份	Char(4)	Y	
变动类型	Char(3)	N	00A：交易过户 00B：非交易过户 00C：证券冻结 00D：证券解冻 00E：挂失转户 00F：股份托管 00G：上市流通 00H：卖空 00I：受限证券卖出 00J：权益登记 00K：权益挂牌/权益划付 00L：摘牌 00O：红利补领 00T：其它 00U：指定交易/撤销指定交易 00V：权益补划付 00W：配股申领 00X：账户转户 00Z：手工调整

			000：延迟交付/完成交付 001：恢复交收 002：处置/返还
买卖标志	Char(1)	N	B：买；S：卖
成交日期	Char(10)	N	格式：YYYY-MM-DD 该笔成交发生的日期
成交时间	Time	N	格式：hh:mm:ss 该笔成交发生的时间
成交数量	Number(16)	N	单位：股 以正数表示。
成交价格	Number(20,9)	N	
清算金额	Number(20,3)	N	买券为负，卖券为正
印花税	Number(20,3)	N	以正数表示
经手费	Number(20,3)	N	以正数表示
过户费	Number(20,3)	N	以正数表示
证管费	Number(20,3)	N	以正数表示
手续费	Number(20,3)	N	以正数表示
其他费用	Number(20,3)	N	以正数表示
币种	Char(3)	N	按照 ISO 4217；例如：USD； CNY

### (28) 客户现货持仓明细文件

期货公司报送客户现货持仓明细文件的文件名规定如下：

报送单位代码+seposdata+日期.txt

该文件提供客户的证券现货持仓明细，可能包含很多条记录。每条记录的字段和数据类型如下：

字段	数据类型	是否可为空	备注
----	------	-------	----

日期	Date	N	格式：YYYY-MM-DD
客户内部资金账号 ( 证券现货账户 )	Char(18)	N	
客户证券账户	Char(13)	N	证券账号
交易所统一标识	Char(2)	N	H：上海证券交易所； P：深圳证券交易所
证券代码	Char(6)	N	证券代码
证券的中文简称	Char(30)	N	
证券类别	Char(2)	Y	GZ：固定收益类 JJ：基金 PT：无限售流通股 PG：配股 PS：配售股 PZ：权证 GJ：国家股 GF：国有法人股 JN：境内法人股 JW：境外法人股 SF：社会法人股 XL：限售流通股 YX：优先法人股 ZG：职工股

流通类型	Char(1)	Y	0：无限售流通 N：限售或非流通 F：限售或非流通 J：限售或非流通 Q：限售或非流通 Z：限售或非流通 1-9：权益次数 A：限售或非流通 B：限售或非流通 C：限售或非流通
权益类别	Char(2)	Y	DF：兑付 DX：兑息 HL：红利 P：配股 S：送股 Z：转配
挂牌年份	Char(4)	Y	
当日持仓量	Number(16)	N	全部持有证券数量 单位：股
持仓可用量	Number(16)	N	当日持仓量中，未被冻结的券的数量。
持仓成本价	Number(20,3)	N	证券现货持仓成本
持仓最新价	Number(20,3)	N	
持仓浮动盈亏	Number(20,3)	N	

市值	Number(20,3)	N	所持股票按最新价计算的市值。
----	--------------	---	----------------