

---

# FIONA FXOPTION (QUOTE) semi auto process 說明書

---



# 1.流程說明

## WEB CustomerInput Table

基本 選項 索引 外鍵 Partitions CREATE 代碼 ALTER 代碼

名稱: CustomerInput

注釋:

分段: 添加 刪除 向上 向下

#	名稱	數據類型	長度/設置	無符號的	允許NULL	填零	默認
1	CustomerInputID	INT	32	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
2	BankName	VARCHAR	50	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
3	TradeID	VARCHAR	20	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
4	TermCcy	VARCHAR	6	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
5	Product	VARCHAR	20	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
6	TradeDate	DATE		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
7	FixingFrequency	VARCHAR	20	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
8	Notional	DOUBLE	21,6	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
9	Legs	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
10	Leverage	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
11	StrikeRight	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	無默認值
12	StrikeRisk	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
13	KnockInBarrier	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
14	KnockOutType	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
15	Target	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
16	LastPayOutType	VARCHAR	20	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
17	CapLoss	DOUBLE	21,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
18	UpfrontFee	DOUBLE	21,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
19	Spot	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
20	BankSpreadSpot	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
21	BankSpreadSwapPoint	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL
22	BankSpreadOption	DOUBLE	16,6	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	NULL

客戶輸入資料表：  
dataschema

## Greg關鍵價位(3)\_0325 to find 選擇權關鍵價位K及KO py檔

功能說明：

```

jupyter greg2MARS0.3.1 Last Checkpoint: 1 分鐘前 (autosaved)
File Edit View Insert Cell Kernel Widgets Help Trusted Python 3
In [ ]: 1 #!/usr/bin/env python
2 # coding: utf-8
3
4 #=== create by vincent ===
5 # to do
6 # 20190330 0.3.2 should change filePath and fileName
7
8 #==== version chnage history ===== |
9 # 20190329 0.3.1 add loadHisPrice()
10 # 20190328 0.3 change openpyxl to xlwing for realtime update
11 # import xlrd, xlwt
12 # import xlswriter
13 # import openpyxl as ol
14 #=====
15 import os
16 import sys
17 import time
18 import datetime
19 import numpy as np
20 import pandas as pd
21 import xlwings as xw

```

備註:需短暫文字輸入  
操作,請參考說明

## 產生上傳 BBG MARS 所需CSV檔

填寫注意事項:

自動化作業,額外補充

=="交易日期" 欄位=="

不影響評價,若交割日期或其他欄位遇假日亦不影響評價價格,但日期相關不可顛倒,如:到期日小於評價日.

=="Barrier Monitoring" 欄位=="

"Continuous":American Style Barrier(預設);

"Terminal":European barrier(不須預設)

=="評價時區"&"評價時間"欄位=="

不直接影響評價結果,若需要可直接設定於CSV檔案內或直接更改BBG內部設定(TZDF)

## BBG上傳畫面(手動上傳CSV操作)

1-BLOOMBERG

CANCEL HELP SEARCH NEWS QUOTE QUOTE MSG MENU PRINT PG BAI PG FW

< Euro Spot Curncy NlWZR 相關功能 目錄 Message

MARS

功能 <向上滑動>以隱藏 自動完成意見回饋

MARS	多重資產風險系統
MARS BCOL	多重資產風險系統: 擔保品管理
MARS CREDIT	多重資產風險系統: 信用
MARS EMIR	多重資產風險系統: EMIR評價報告
MARS FX	多重資產風險系統: 外匯
MARS HEFF	多重資產風險系統: 避險會計
更多功能...	

證券

MARS Corp	Mars Inc
MARS LN Equity	Marston's PLC (London)
PORTFOLIO: MARS UPLOAD DEFAULT	MARS UPLOAD DEFAULT
MARS US Equity	Marsh Supermarkets Co LLC (U.S.)
MARSPE Corp	瑪莎百貨集團 (多重符合)
MARSLN Corp	馬斯頓發行人公開有限公司 (多重符合)
更多證券...	

搜尋

SEARCH MARSH & MCLENNAN SEDOL	Marsh & McLennan Cos Inc (U.S.) : Sedol1 Number
SEARCH MARSH & MCLENNAN PE EST	Marsh & McLennan Cos Inc (U.S.) : BEst P/E Ratio
搜尋 'MARS'...	

Privacy

300) 編輯看板 301) 展開看板

407 CHD 14:53 China Daily: First video call on Shanghai's 5G network

406 PTI 14:53 NPP worker killed in Arunachal Pradesh

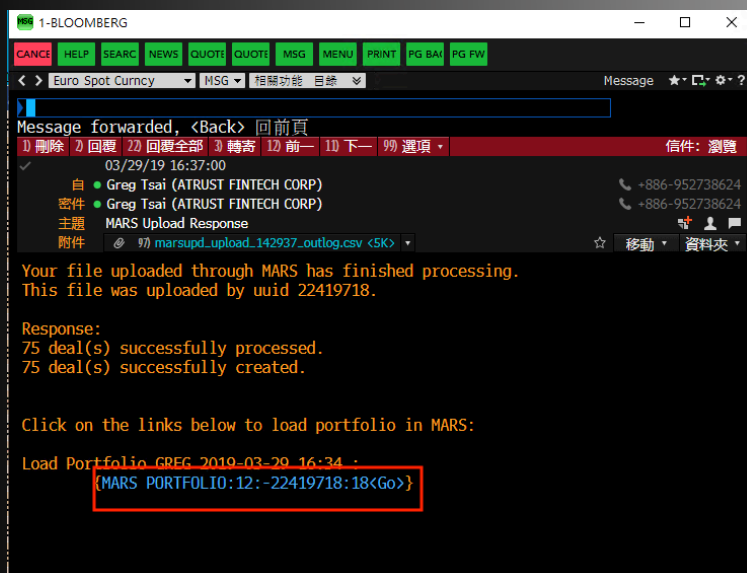
405 NS6 14:53 自由時報: 新北春遊補助每人500元 4/1開跑 新北文化場館同步加碼優惠

Suggested Functions USER Optimize your workflow on Bloomberg BHL Expand your Bloomberg knowledge

備註說明:

download步驟為自動化程序

1. email接收設定->擷取上傳並計算後的profolio ID ;email forward to [virkwok023@gmail.com](mailto:virkwok023@gmail.com) done, will programing scrapy id in content.



2. 打開excel 設定參數擷取計算後部位market value().  
"=BDS("U22419718-18 Client","Portfolio\_members")" 或  
blpapi(python模組,待查功能運用)
3. 比對75組策略後產生價格矩陣,塞回資料庫(table 客戶明細),注意事項:北次上傳檔案組數不可超過100組.

## 2.所需資料

- CustomerInPut Table(DataBase)
- Fiona0.3.xlsm(關鍵價位市場價位參數價格表)
- upload CSV
- Big email address setting
- download CSV

## 3.程式碼檔案路徑名稱

