**目录**

[1. 交易确认书字段 2](#_Toc10723829)

[2. 结算通知书补充字段 3](#_Toc10723830)

[3. 非年化交易字段 4](#_Toc10723831)

[1. 欧式 4](#_Toc10723832)

[2. 美式 5](#_Toc10723833)

[3. 二元 6](#_Toc10723834)

[4. 价差 7](#_Toc10723835)

[5. 单鲨 8](#_Toc10723836)

[6. 双鲨 9](#_Toc10723837)

[7. 三层 10](#_Toc10723838)

[8. 美式双触碰/不双触碰 11](#_Toc10723839)

[9. 二元凹式/二元凸式 12](#_Toc10723840)

[10. 鹰式 13](#_Toc10723841)

[11. 区间累积 14](#_Toc10723842)

[12. 四层 15](#_Toc10723843)

[13. 自定义 16](#_Toc10723844)

[14. 远期 17](#_Toc10723845)

[15. 亚式 18](#_Toc10723846)

[16. 跨式 19](#_Toc10723847)

[17. 雪球 20](#_Toc10723848)

[18. 凤凰 21](#_Toc10723849)

[19. 凤凰补充字段 22](#_Toc10723850)

[4. 年化交易补充字段 23](#_Toc10723851)

# 交易确认书字段

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 交易ID | ${tradeId} |  | ${salesName} |
| 交易日期 | ${tradeDate} | 标的物名称 | ${instrumentName} |
| 交易状态 | ${tradeStatus} |  | ${counterPartyAccountCode} |
| 交易员 | ${trader} |  | ${counterPartyAccountName} |
| 交易簿 | ${bookName} |  | ${counterPartyCode} |
| 备注 | ${comment} |  | ${counterPartyName} |
| 交易对手 | ${partyName} |  | ${lcmEventType} |
| 保证金 | ${margin} |  | ${positionAccountCode} |
|  | ${partyCode} |  | ${positionAccountName} |
|  | ${salesCode} | 期权类型 | ${productType} |
|  | ${salesCommission} |  |  |

# 结算通知书补充字段

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 标的结算价格 | ${underlyerPrice} | 剩余数量 | ${numOfOption} |
| 结算价格 | ${settleAmount} | 结算数量 | ${settlement} |
| 持仓数量 | ${notionalOldValue} |  |  |

# 非年化交易字段

## 欧式

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 | ${exerciseType} | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 | ${strike} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |

## 美式

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 | ${exerciseType} | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 | ${strike} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |

## 二元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 | ${exerciseType} | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 | ${strike} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 障碍管擦类型 | ${observationType} | 行权收益 | ${payment} |
| 补偿支付方式 | ${rebateType} | 行权收益类型 | ${paymentType} |

## 价差

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 | ${exerciseType} | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 低行权价 | ${highStrike} |  |  |
| 高行权价 | ${lowStrike} |  |  |

## 单鲨

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 | ${strike} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 障碍价 | ${barrier} | 敲出补偿 | ${knockDirection} |
| 障碍价类型 | ${barrierType} | 障碍观察类型 | ${observationType} |
| 敲出补偿 | ${rebate} | 障碍补偿类型 | ${rebateUnit} |
| 补偿支付方式 | ${rebateType} |  |  |

## 双鲨

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 |  |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 |  | 到期日 | ${expirationDate} |
| 低行权价 | ${highStrike} | 障碍价类型 | ${barrierType} |
| 高行权价 | ${lowStrike} | 高障碍价 | ${highBarrier} |
| 高参与率 | ${highParticipationRate} | 高敲出补偿价 | ${highRebate} |
| 低障碍价 | {lowBarrier} | 低参与率 | ${lowParticipationRate} |
| 低敲出补偿价 | ${lowRebate} | 障碍观察类型 | ${observationType} |
| 补偿支付方式 | ${rebateType} | 障碍补偿类型 | ${rebateUnit} |

## 三层

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 低行权价 | ${highStrike} | 高行权收益 | ${highPayment} |
| 高行权价 | ${lowStrike} | 低行权收益 | ${lowPayment} |
| 行权支付类型 | ${paymentType} |  |  |

## 美式双触碰/不双触碰

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 |  |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 高障碍价 | ${ highBarrier} | 行权收益 | ${payment} |
| 低障碍价 | ${ lowBarrier} | 障碍价类型 | ${barrierType} |
| 行权支付类型 | ${paymentType} | 补偿支付方式 | ${rebateType} |

## 二元凹式/二元凸式

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 |  |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 |  |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 高障碍价 | ${ highBarrier} | 行权收益 | ${payment} |
| 低障碍价 | ${ lowBarrier} | 障碍价类型 | ${barrierType} |
| 行权支付类型 | ${paymentType} | 补偿支付方式 | ${rebateType} |

## 鹰式

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 |  |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 |  | 到期日 | ${expirationDate} |
| 参与率1 | ${participationRate1} | 参与率2 | ${participationRate2} |
| 行权价1 | ${strike1} | 行权价2 | ${strike2} |
| 行权价3 | ${strike3} | 行权价4 | ${strike4} |

## 区间累积

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 |  |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 高障碍价 | ${ highBarrier} | 行权收益 | ${payment} |
| 低障碍价 | ${ lowBarrier} | 障碍价类型 | ${barrierType} |
| 行权支付类型 | ${paymentType} | 观察日 | ${fixingObservations} |

## 四层

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 |  |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 行权价1 | ${strike1} | 行权收益 | ${payment1} |
| 行权价2 | ${strike2} | 行权收益 | ${payment2} |
| 行权价3 | ${strike3} | 行权收益 | ${payment3} |
| 行权支付类型 | ${paymentType} |  |  |

## 自定义

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 |  |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 备注 | ${comment} |  |  |

## 远期

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 |  |
| 行权价 | ${strike} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 |  | 到期日 | ${expirationDate} |

## 亚式

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 | ${optionType} |
| 行权价 | ${strike} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 观察日 | ${fixingObservations} |  | ${fixingWeights} |
| 观察频率 | ${observationStep} |  |  |

## 跨式

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 名义本金 | ${notionalAmount} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 行权价类型 | ${strikeType} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 行权方式 |  | 是否年化 | ${annualized} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 类型 |  |
| 行权价 |  | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 |  | 到期日 | ${expirationDate} |
| 高参与率 | ${highParticipationRate} | 高行权价 | ${highStrike} |
| 低参与率 | ${lowParticipationRate} | 低行权价 | ${lowStrike} |

## 雪球

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 是否年化 | ${annualized} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 名义本金 | ${notionalAmount} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |
| 到期未敲出收益类型 | ${autoCallPaymentType} | 障碍价 | ${barrier} |
| 收益/coupon(%) | ${couponPayment} | 障碍价类型 | ${barrierType} |
| 到期未敲出固定收益 | ${fixedPayment} | 敲出方向 | ${knockDirection} |
| 敲出汗观察频率 | ${knockout  ObservationStep} | 敲出/coupon观察日 | ${observationDates} |
| 逐步调整步长 | ${step} |  |  |

## 凤凰

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 是否年化 | ${annualized} | 权利金类型 | ${premiumType} |
| 合约乘数 | ${underlyerMultiplier} | 名义本金 | ${notionalAmount} |
| 起初价格 | ${initialSpot} | 标的物 | ${underlyerInstrumentId} |
| 名义本金类型 | ${notionalAmountType} | 实际期权费 | ${premium} |
| 结算方式 | ${specifiedPrice} | 起始日 | ${effectiveDate} |
| 结算日 | ${settlementDate} | 买卖方向 | ${direction} |
| 参与率 | ${participationRate} | 到期日 | ${expirationDate} |

## 凤凰补充字段

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 障碍价 | ${barrier} | 障碍价类型 | ${barrierType} |
| Coupon障碍 | ${couponBarrier} | Coupon收益 | ${couponPayment} |
| 观察日 | ${fixingObservations} | 敲出方向 | ${knockDirection} |
| 敲入障碍价 | ${knockInBarrier} | 敲入障碍价类型 | ${knockInBarrierType} |
| 敲日日期 | ${knockInDate} | 敲入观察频率 | ${knockInObservationStep} |
| 敲入类型 | ${knockInOptionType} | 敲入行权价 | ${knockInStrike} |
| 敲入行权价类型 | ${knockInStrikeType} | 敲出观察日频率 | ${knockOutObservationStep} |

# 年化交易补充字段

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易属性 | 文档内容替换 | 交易属性 | 文档内容替换 |
| 年度计息天数 | ${daysInYear} | 保底收益 | ${minimumPremium} |
| 合约期权费 | ${frontPremium} | 期限 | ${term} |