



中华人民共和国金融行业标准

JR/T XXXXX—XXXX

期货公司监管数据采集规范 第2部分：资产管理业务

Specification for supervision data acquisition of futures companies—
Part 2: Asset management

(征求意见稿)

XXXX-XX-XX 发布

XXXX-XX-XX 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前 言 II

引 言 III

1 范围 1

2 规范性引用文件 1

3 术语和定义 1

4 数据类型 1

5 期货公司资产管理业务报表数据采集 1

 5.1 产品基本信息采集 1

 5.2 产品投资者信息采集 3

 5.3 产品运行情况信息采集 4

 5.4 产品债券投资明细信息采集 6

 5.5 产品嵌套投资信息采集 7

 5.6 产品穿透信息采集 8

 5.7 产品投资运作中发生关联交易明细信息采集 9

 5.8 机构基本信息采集 10

 5.9 机构资产管理业务收支明细信息采集 10

6 期货公司资产管理业务特殊事项报表数据采集 10

 6.1 非标准化债权类资产信息采集 10

 6.2 非标准化股权类资产信息采集 11

 6.3 非标准化期货和衍生品类资产信息采集 12

附 录 A（规范性） 行业分类附表 13

附 录 B（资料性） 债券分类附表 15

参 考 文 献 16

前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

本文件是JR/T 0293-2023《期货公司监管数据采集规范》的第2部分。JR/T 0293-2023已经发布了以下部分：

——第1部分：基本信息和经纪业务；

——第2部分：资产管理业务。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC 180/SC4）提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）归口。

本文件起草单位：中国期货市场监控中心有限责任公司、中国证券监督管理委员会科技监管司、中国证券监督管理委员会期货监管司、中证信息技术服务有限责任公司、中国证券监督管理委员会北京监管局、中国证券监督管理委员会上海监管局、中国证券监督管理委员会浙江监管局、中国证券监督管理委员会广东监管局、中国证券监督管理委员会深圳监管局、中国期货业协会、中信期货有限公司、国泰君安期货有限公司、中粮期货有限公司、银河期货有限公司、五矿期货有限公司、华泰期货有限公司、永安期货股份有限公司、浙商期货有限公司。

本文件主要起草人：XXX。

引 言

随着期货市场业务快速发展，监管部门对期货公司的数据采集需求不断增加，为规范、统一以期货公司为主体的监管数据的业务定义、采集和应用口径，提升期货公司监管数据采集和应用的标准化程度，提高监管数据采集的时效性和准确性，特制订本文件。本文件以行业法律法规、业务规则、制度及流程等为依据，按照JR/T 0176.1-2019中规定的行业数据模型方法论，结合期货公司监管综合信息系统采集数据的实践经验，总结数据特征与数据共性，形成具有通用性和可扩展性的期货公司监管数据采集行业标准。

《期货公司监管数据采集规范》金融行业标准分为2部分内容：

- 第1部分：基本信息和经纪业务。分别围绕期货公司基本信息、风险监管指标、财务监管报表主表和附表的数据采集情况，形成行业可参考的数据要素业务定义规范；
- 第2部分：资产管理业务。分别围绕期货公司资产管理产品、资产管理业务收支、投资非标准化资产的数据采集情况，形成具有通用性和可扩展性的期货公司监管数据采集行业标准。

期货公司监管数据采集规范 第2部分：资产管理业务

1 范围

本文件规定了期货公司资产管理业务相关的监管数据采集范围和数据要素业务口径。
本文件适用于以期货公司为主体的监管数据采集和应用。

2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB 32100—2015 法人和其他组织统一社会信用代码

3 术语和定义

GB/T 7408—2005界定的以及下列术语和定义适用于本文件。

3.1

日历日期 calendar date

由日历年、日历月以及其在日历月中的顺序数表示的特定日历日的标识。

[来源：GB/T 7408—2005，3.3]

4 数据类型

期货公司监管数据的数据类型包括字符型、数值型、日期型、枚举型、布尔型：

- a) 字符型：由中文和英文的文字、数字、符号组合形式体现的数据项；
- b) 数值型：以整数或小数形式体现的数据项，适用于各类以数量反映的信息，可参与计算；
- c) 日期型：以日历日期形式体现的数据项，格式：YYYY-MM-DD；
- d) 枚举型：由两个或两个以上的枚举值组成的数据项；
- e) 布尔型：技术角度常用的数据类型，通常用来判断条件是否成立。布尔型数据只有两个值，false（0）和true（1）。

5 期货公司资产管理业务报表数据采集

5.1 产品基本信息采集

产品基本信息采集的数据应符合表1的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表1 产品基本信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	产品编码	字符	产品编码应与基金业协会备案信息一致。
2	产品名称	字符	填写产品全称，与备案信息一致。
3	产品状态	枚举	枚举值包括：完成设立暂未通过备案/完成备案正常运作/本期内产品全部清算完毕/已终止尚未完成清算。
4	产品起始日期	日期	-
5	产品通过基金业协会备案日	日期	-

	期		
6	产品预计终止日期	日期	依据合同约定填写。
7	产品实际终止日期	日期	-
8	产品类型 1	枚举	枚举值包括：固定收益类/权益类/期货和衍生品类/混合类。
9	产品类型 2	枚举	枚举值包括：单一/集合。
10	产品类型 3	枚举	枚举值包括：FOF/MOM/其它。
11	管理方式	枚举	枚举值包括：主动管理/被动管理。被动管理指受托机构根据委托人或其指定第三方机构的指示管理受托财产，在产品设立、管理、运用和处分受托财产中不承担积极管理职责的业务。
12	在管投资经理	字符	-
13	是否为结构化产品	布尔	-
14	是否使用程序化交易	布尔	-
15	期货和衍生品类产品投资策略	枚举	枚举值包括：1-趋势交易策略/2-套利策略/3-对冲策略/4-其他按照枚举值填写序号，如有多项请用英文分号分隔。
16	产品主要策略	字符	简洁明了概述所使用的主要策略。
17	产品运作方式	枚举	枚举值包括：开放式净值型/开放式非净值型/封闭式净值型/封闭式非净值型。
18	产品开放频率	枚举	枚举值包括：日/周/月/季度/半年/年/其他剔除封闭期影响，例：封闭期半年，之后每季度开放一次，则选季度。
19	未来 30 日内是否开放	布尔	未来 30 日为填报期最后一个工作日后的 30 个自然日，仅开放申购的请选择“否”。
20	未来 30 日内资金流出金额（不包含赎回款）	数值	是指未来 30 日内资产管理计划负债端现金流出，例如即将到期的债券正回购业务、两融业务等；也包括已承诺不可撤销的 30 日内须支付的投资金额。
21	上层嵌套层数	数值	整数。例：资产管理计划委托人为其他资管产品（该产品委托人中不存在除公募基金以外的其他资管产品），则本产品上层嵌套层数填写 1。
22	期货公司及其子公司自有资金参与份额	数值	单位：份，保留两位小数。
23	产品收益分配情况说明	字符	-
24	管理费率（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。按照产品合同约定填写，当“管理费”为“浮动管理费率”时填写产品合同约定的最高管理费率；为“固定管理费率”时填写产品合同约定的固定费率；为“固定管理费”时按照产品规模折算为比例填写。
25	业绩报酬提取比例（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。按照产品合同约定填写，业绩报酬提取比例若为浮动的，根据合同约定填写不同分段的收取比例，并用英文分号分隔。
26	业绩报酬本年累计提取次数	数值	-
27	管理费率 and 业绩报酬提取比例的详细说明	字符	管理费率或业绩报酬提取比例为浮动的，在此说明详细情况，不涉及该情况，则填无。
28	托管费率（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。
29	销售费率（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。
30	托管人全称	字符	未聘请托管机构的产品此项填无。
31	是否具备基金托管资质	布尔	-
32	份额登记机构全称	字符	如管理人自行办理份额登记，则填写本公司全称。
33	份额估值、核算机构全称	字符	如管理人自行办理份额估值、核算，则填写本公司全称。
34	是否聘请投资顾问	布尔	-
35	外部投资顾问全称	字符	如涉及多个投顾，需全部填写并用英文分号分隔。
36	固定投资顾问费用（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。按照合同约定填写，如涉及多个投顾，需全部填写并用英文分号隔开。
37	浮动投资顾问费用（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。按照合同约定填写，如涉及多个投顾或浮动比例，需全部填写并用英文分号隔开。
38	预警线	数值	合同中约定低于此线要求降低仓位或补仓。若设置多档按最高值填写，若按照“净值回撤比例”等其他形式约定的，根据报告期末实际值填写，未设置的填 0。
39	止损线	数值	合同中约定低于此线要求清仓。若按照“净值回撤比例”等其他形式

			约定的，根据报告期末实际值填写，未设置的填0。
40	第一大资产投资规模	数值	是指除银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债以外的第一大资产净值规模。按照“同一资产”认定标准进行计算。
41	主动投资的流动性受限资产 的市值规模	数值	是指主动投资由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产市值规模。
42	流通受限的股票	数值	是指标准化股权类资产中所有流通受限的股票市值，包含退市的股票。
43	七个工作日可变现资产规模	数值	包括在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等资产规模。
44	资产管理计划财产是否存在 被查封、冻结、扣划或者强制 执行的情形	布尔	—
45	资产管理计划财产被查封、冻 结、扣划或者强制执行的金额	数值	—
46	资产管理计划财产被查封、冻 结、扣划或者强制执行的原因	字符	—
47	资产管理计划财产被查封、冻 结、扣划或者强制执行的时间	日期	—
48	查封、冻结、扣划或者强制执 行资产管理计划财产的主体	字符	—
49	产品是否展期	布尔	本期内签订展期协议或变更合同期限的即视为展期。
50	展期类型	枚举	枚举值包括：正常展期/非正常展期 非正常展期是指由于风险事件导致的展期。
51	非正常展期原因	字符	—
52	是否已发生延期兑付事件	布尔	—
53	延期兑付所涉金额	数值	—
54	延期兑付情况说明	枚举	枚举值包括：股票停牌/投资标的违约/其他。
55	是否存在潜在兑付风险	布尔	是指产品还未发生延期兑付，但目前存在风险因素可能导致延期兑付或是无法兑付。
56	兑付风险情况说明	字符	—
57	本期末是否跌破预警线	布尔	—
58	跌破预警线原因	枚举	枚举值包括：1-市场波动/2-规模变动/3-操作风险/4-信用风险/5-其他 按照枚举值填写序号，如有多项请用英文分号分隔。
59	本期末是否跌破止损线	布尔	—
60	跌破止损线原因	枚举	枚举值包括：1-市场波动/2-规模变动/3-操作风险/4-信用风险/5-其他 按照枚举值填写序号，如有多项请用英文分号分隔。
61	后续处理	枚举	枚举值包括：无补仓继续运作/补仓/提前终止/改变风控条款。

5.2 产品投资者信息采集

产品投资者信息采集的数据应符合表2的要求。对于数据类型为数值的的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表2 产品投资者信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	客户名称	字符	—
2	客户性质	枚举	枚举值包括：自然人/非金融企业/政府/社会保险基金/证券公司自有资金/期货公司自有资金/基金公司自有资金/银行自有资金/保险公司自有资金/信托公司自有资金/私募基金管理机构自有资金/证券公司公募基金/证券公司资产管理计划/期货公司资产管理计划/基金公司

			司公募基金/基金公司专户资产管理计划/银行公募理财产品/银行私募理财产品/保险公司资产管理产品/信托公司信托计划/金融资产投资公司资管产品/私募基金/QFII/其他（需加注） 注：上述特殊法人机构的自有资金均包含其特殊法人性质的子公司自有资金，期货公司风险管理子公司选择“期货公司自有资金”；特殊法人机构发行的资产管理产品均包含相应资管子公司发行的资产管理产品；银行理财产品包含银行理财子公司发行的理财产品。
3	身份证号/统一社会信用代码/产品编码	字符	统一社会信用代码与营业执照“统一社会信用代码”保持一致，按照GB 32100—2015 4.2 代码及说明描述的填写。
4	销售机构名称	字符	如管理人自销，则填写本公司全称。
5	所持份额级别	枚举	枚举值包括：优先级/劣后级/无。
6	持有份额数	数值	单位：份，保留两位小数。
7	是否为管理人关联方	布尔	—
8	关联方类型	枚举	枚举值包括：管理人的母公司/管理人的子公司/与管理人受同一母公司控制的其他企业/对管理人实施共同控制的投资方。 /对管理人施加重大影响的投资方/管理人的合营企业/管理人的联营企业/管理人的主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员/管理人或其母公司的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员/管理人主要投资者个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的其他企业。
9	是否为投资顾问关联方	布尔	—
10	是否为管理人或管理人关联方或投资顾问关联方发行的产品	布尔	—
11	是否为从业人员及其配偶	布尔	—
12	上层产品管理人全称	字符	—

5.3 产品运行情况信息采集

产品运行情况信息采集的数据应符合表3的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表3 产品运行情况信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	本期申购产品份额	数值	单位：份，保留两位小数。
2	本期赎回产品份额	数值	单位：份，保留两位小数。
3	本年单位净值增长率	数值	单位：%，保留两位小数。本年净值增长率=（期末累计净值-上年末累计净值）/上年末累计净值。本年指最近一年（即报告期末倒推一年，后同），若产品成立不足一年，则以产品成立至本期末为计算区间。
4	年化收益率	数值	单位：%，保留两位小数。年化收益率= $(1+\text{平均收益率})^n-1$ ，平均收益率为最近一年净值日增长率的平均值，n为最近一年交易日天数，若产品成立不足一年，则根据产品成立至本期末的实际交易日天数计算平均收益率并按照252个交易日年化。
5	收益波动率	数值	单位：%，保留两位小数。收益波动率= $\{\sum (X_i-X)^2 / (n-1)\}^{0.5}$ ，其中， X_i 表示第i个交易日的净值日增长率，X为最近一年净值日增长率的平均值，n为最近一年交易日天数，若产品成立不足一年，则按照产品成立至本期末的实际交易日天数计算。
6	最大回撤	数值	单位：%，保留两位小数。最大回撤= $\text{Min}\{(X_i-X_j)/X_j\} \times 100\%$ ， X_i 、 X_j 为该产品的自成立到本期末的所有单位净值， $i>j$ ，即 X_i 对应的净值日必须在 X_j 的后面。
7	夏普比率	数值	夏普比率=（年化收益率-无风险利率）/年化收益波动率。其中，无风险利率选取本期末一年期国债收益率。若产品成立不足一年，则以产品成立至本期末为计算区间。产品波动率为0时，该项填0。
8	存款和固定收益证券类资产合计	数值	—

9	银行存款	数值	-
10	同业存单	数值	-
11	固定收益证券	数值	按照全价金额填写。
12	固定收益证券-银行间市场交易债券	数值	-
13	固定收益证券-上交所交易债券	数值	-
14	固定收益证券-深交所交易债券	数值	-
15	固定收益证券-其他交易场所交易债券	数值	-
16	债券逆回购融出资金余额(仅限交易所或银行间市场进行的债券回购交易)	数值	仅限交易所或银行间市场进行的债券回购交易
17	标准化股权类资产合计	数值	-
18	上交所主板股票	数值	-
19	上交所科创板股票	数值	-
20	深交所主板股票	数值	-
21	深交所创业板股票	数值	-
22	北交所股票	数值	-
23	沪股通	数值	-
24	深港通	数值	-
25	存托凭证	数值	-
26	其他股票	数值	-
27	上证 180、深证 100、沪深 300 成分股	数值	-
28	标准化期货和衍生品类资产合计	数值	-
29	期货持仓占用资金	数值	-
30	期货持仓占用资金-商品期货持仓占用资金	数值	-
31	期货持仓占用资金-金融期货持仓占用资金	数值	-
32	卖出场内期权持仓占用的保证金	数值	-
33	买入场内期权市值	数值	-
34	期货和衍生品的持仓合约价值	数值	以报告期末最后一个交易日结算价格计算。
35	公开募集证券投资基金合计	数值	-
36	货币基金	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
37	债券基金	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
38	股票基金	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
39	混合基金	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
40	权益类 ETF	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
41	商品基金(包括黄金 ETF)	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
42	其他公募基金	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
43	经认可的比照公募基金管理的资产管理产品	数值	份额在场内交易的,填写市值;份额为场外申购赎回的,按净值填列。
44	私募资产管理产品合计	数值	-
45	证券公司(含资管子公司)资产管理计划	数值	有合理净值的,按净值填列;无合理净值的,填列实际投资金额。
46	期货公司(含资管子公司)资产管理计划	数值	有合理净值的,按净值填列;无合理净值的,填列实际投资金额。
47	基金公司(含基金子公司)专户资产管理计划	数值	有合理净值的,按净值填列;无合理净值的,填列实际投资金额。
48	银行(含理财子公司)私募理	数值	有合理净值的,按净值填列;无合理净值的,填列实际投资金额。

	理财产品		
49	保险公司资管产品	数值	有合理净值的，按净值填列；无合理净值的，填列实际投资金额。
50	信托公司信托计划	数值	有合理净值的，按净值填列；无合理净值的，填列实际投资金额。
51	私募基金	数值	有合理净值的，按净值填列；无合理净值的，填列实际投资金额。
52	其他	数值	有合理净值的，按净值填列；无合理净值的，填列实际投资金额。
53	各类备付金及用于清算的款项合计	数值	—
54	应收股利合计	数值	—
55	应收利息合计	数值	—
56	其他资产（含境外金融产品）合计	数值	—
57	投资于其他资产的情况说明	字符	详细说明“其他资产（含境外金融产品）”的投资标的。
58	资产小计	数值	—
59	卖出场内期权市值	数值	—
60	债券正回购融入资金余额（仅限交易所或银行间市场进行的债券回购交易）	数值	仅限交易所或银行间的债券回购交易。
61	融资融券金额	数值	—
62	已计提但尚未支付的各项应付款项	数值	—
63	其他负债	数值	—
64	其他负债情况说明	字符	详细说明“其他负债”的融资方式。
65	负债小计	数值	—
66	产品净资产	数值	—
67	优先级份额净资产	数值	—
68	劣后级份额净资产	数值	—
69	实收基金	数值	—
70	产品累计单位净值	数值	—
71	未清算金额	数值	—
72	清算金额	数值	—

5.4 产品债券投资明细信息采集

产品债券投资明细信息采集的数据应符合表4的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表4 产品债券投资明细信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	债券类型	枚举	枚举值包括：国债/地方政府债/央行票据/政策性金融债/其他金融债/企业债/公司债/中期票据/短期融资券/定向工具/国际机构债/政府支持机构债/资产支持债券/可转债/可交换债/可分离转债存债/其他债券分类标准参见附表“债券分类标准”。
2	债券代码	字符	按照债券发行或上市公告中载明的债券代码填写，且需包含“.IB”“.SH”“.SZ”“.BJ”“.NQ”等后缀。跨市场债券选择任一交易市场的债券代码填写即可。
3	债券名称	字符	按照债券发行或上市公告中载明的债券简称填写。
4	债券发行人全称	字符	—
5	债券发行人性质	枚举	枚举值包括：中央国有企业/地方国有企业/集体企业/民营企业/外资企业/其他 若投资标的为国债或地方政府债，则选择“其他”。
6	债券发行人类型	枚举	枚举值包括：上市公司/新三板挂牌公司/其他 若投资标的为国债或地方政府债，则选择“其他”。
7	债券发行人所属地区	字符	按照实际情况填写至省级行政区或地级行政区。 若投资标的为国债，则填写“其他”。

8	债券发行人所属行业	字符	填写投资行业二级行业名称，行业名称见“行业分类附表”。若投资标的为国债或地方政府债，则选择“其他”。
9	是否为城投债	布尔	—
10	债券发行日期	日期	—
11	债券最终到期日期	日期	—
12	债项评级	字符	按最新债项评级填写，如无请填写“无”
13	主体评级	字符	资产支持债券的主体评级为原始权益人的主体评级
14	债券久期	数字	使用修正久期，以估值价格计算，保留四位小数。浮息债久期取0.5000。
15	市值金额	数值	按照全价金额填写。
16	成本金额	数值	按照成本填写。
17	票面利率（%）	数值	单位：%；保留两位小数。按照年度利率填写。
18	债券状态	枚举	枚举值包括：正常存续/实质违约/展期/触发交叉违约条款。
19	持有债券的发行主体是否出现重大负面情况	布尔	—
20	债券首次发生违约时间	日期	是指违约债券首次未能偿还本息时间。
21	担保机构名称	字符	填写担保机构全称，不涉及则填“无”，若资产支持证券无担保机构、则填写差额支付承诺人。
22	债券担保情况说明	字符	对担保机构和担保方式进行补充说明，如“某某经济发展集团总公司为本期债券提供不可撤销连带责任担保，担保人评级 AA 级”，如无担保的债券，填写“无担保”。
23	债券违约对产品产生的影响	字符	详细描述债券违约后，债券违约对资管产品净值产生的影响，投资者反应，公司采取何种应对措施。不涉及则填“无”。

5.5 产品嵌套投资信息采集

产品嵌套投资信息采集的数据应符合表5的要求。对于数据类型为数值的的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表 5 产品嵌套投资信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	下层产品基本信息-下层产品的编码	字符	—
2	下层产品基本信息-下层产品的名称	字符	—
3	下层产品基本信息-下层产品的管理人全称	字符	—
4	下层产品基本信息-下层产品是否为结构化产品	布尔	—
5	下层产品基本信息-下层产品未来 30 日是否开放	布尔	—
6	下层产品基本信息-下层产品分级比例	数值	优先级份额/劣后级份额，中间级份额计入优先级份额。
7	下层产品基本信息-投向是否为下层产品的劣后级	布尔	—
8	下层产品投资情况-银行存款	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的银行存款
9	下层产品投资情况-同业存单	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资同业存单
10	下层产品投资情况-固定收益证券	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的固定收益证券
11	下层产品投资情况-债券逆回购融出资金余额(仅限交易所或银行间市场进行的债券回购交易)	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的债券逆回购融出资金余额
12	下层产品投资情况-标准化股权	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的标准化股权

13	下层产品投资情况-标准化期货和衍生品持仓占用资金	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的标准化期货和衍生品持仓占用资金
14	下层产品投资情况-公开募集证券投资基金	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的公开募集证券投资基金
15	下层产品投资情况-私募资产管理产品	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的私募资产管理产品
16	下层产品投资情况-非标准化债权	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的非标准化债权
17	下层产品投资情况-非标准化股权	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的非标准化股权
18	下层产品投资情况-非标准化期货和衍生品持仓占用资金	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的非标准化期货和衍生品持仓占用资金
19	下层产品投资情况-各类备付金及用于清算的款项	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的现金及备付金金额
20	下层产品投资情况-其他（必须在备注中详述）	数值	持有下层产品份额占比*下层产品投资的其他资产
21	下层产品投资情况-资产小计	数值	
22	下层产品投资情况-产品净资产	数值	持有下层产品份额*下层产品单位净值

5.6 产品穿透信息采集

产品穿透信息采集的数据应符合表6的要求。对于数据类型为数值的数，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表 6 产品穿透信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	资金最终来源规模-自然人	数值	资产管理计划接受其他资产管理产品参与的，需要向上穿透资金来源。某一类型资金来源按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金来源中该类型规模与上层产品该类型资金来源规模合并计算。
2	资金最终来源规模-一般法人	数值	资产管理计划接受其他资产管理产品参与的，需要向上穿透资金来源。某一类型资金来源按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金来源中该类型规模与上层产品该类型资金来源规模合并计算。
3	资金最终来源规模-持牌金融机构自有资金	数值	资产管理计划接受其他资产管理产品参与的，需要向上穿透资金来源。某一类型资金来源按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金来源中该类型规模与上层产品该类型资金来源规模合并计算。
4	资金最终来源规模-私募基金管理机构自有资金	数值	资产管理计划接受其他资产管理产品参与的，需要向上穿透资金来源。某一类型资金来源按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金来源中该类型规模与上层产品该类型资金来源规模合并计算。
5	资金最终来源规模-公募基金	数值	资产管理计划接受其他资产管理产品参与的，需要向上穿透资金来源。某一类型资金来源按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金来源中该类型规模与上层产品该类型资金来源规模合并计算。
6	资金最终来源规模-其他（在备注中详述）	数值	资产管理计划接受其他资产管理产品参与的，需要向上穿透资金来源。某一类型资金来源按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金来源中该类型规模与上层产品该类型资金来源规模合并计算。
7	资金最终投向规模-银行存款	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
8	资金最终投向规模-同业存单	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
9	资金最终投向规模-固定收益证券	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
10	资金最终投向规模-债券逆回购融出资金余额（仅限交易所	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。

	或银行间市场进行的债券回购交易)		向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
11	资金最终投向规模-标准化股权	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
12	资金最终投向规模-标准化期货和衍生品持仓占用资金	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
13	资金最终投向规模-公开募集证券投资基金	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
14	资金最终投向规模-非标准化债权	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
15	资金最终投向规模-非标准化股权	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
16	资金最终投向规模-非标准化期货和衍生品持仓占用资金	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
17	资金最终投向规模-各类备付金及用于清算的款项	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
18	资金最终投向规模-其他（必须在备注中详述）	数值	资产管理计划投资于其他资产管理产品的，需要向下穿透资金投向。某一类型资金投向按照产品整体口径计算，即将资产管理计划直接资金投向中该类型规模与下层产品该类型资金投向规模合并计算。
19	备注（其他情况说明）	字符	

5.7 产品投资运作中发生关联交易明细信息采集

产品投资运作中发生关联交易明细信息采集的数据应符合表7的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表7 产品穿透信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	产品投资运作中发生交易所涉及的关联方名称	字符	—
2	关联关系类型	枚举	枚举值包括：管理人的母公司/管理人的子公司/与管理人受同一母公司控制的其他企业/对管理人实施共同控制的投资方/对管理人施加重大影响的投资方/管理人的合营企业/管理人的联营企业/管理人的主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员/管理人或其母公司的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员/管理人主要投资者个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的其他企业/管理人或管理人关联方发行的资产管理计划、信托计划、理财产品和基金/托管人及其控股股东、实际控制人或其他关联方发行或承销的证券”。
3	关联方身份证号/统一社会信用代码/产品编码	字符	统一社会信用代码与营业执照“统一社会信用代码”保持一致，按照GB 32100—2015 4.2 代码及说明描述的。
4	关联交易标的资产类型	枚举	枚举值包括：股票/债券/公募基金/资管产品/其他。
5	初始投资金额	数值	—
6	持有标的资产市值	数值	—
7	持有标的资产市值占比（%）	数值	单位：% ，保留两位小数。关联交易标的资产市值/产品净资产。
8	关联交易情况说明	字符	详细描述关联交易情况，包括但不限于交易对手、交易内容、交易金额等。

注：投资运作中关联交易的认定范围包括：①交易对手为关联方的；②交易标的发行人为关联方的，如买入关联方发行的股票、债券等；③交易对手的发行人为关联方的，即交易对手为关联方发行的资产管理产品。

5.8 机构基本信息采集

机构基本信息采集的数据应符合表8的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为人，整数。

表 8 机构基本信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	公司全称	字符	—
2	开始开展资管业务时间	日期	是指首次开展资产管理业务的时间，如业务中断后恢复，仍应填写首次开展资产管理业务的时间。
3	是否通过资管子公司开展业务	布尔	—
4	资管子公司名称	字符	—
5	资产管理业务实际办公地址	字符	—
6	资管业务条线人员数量	数值	—
7	投资经理人员数量	数值	—
8	运营岗人员数量	数值	—
9	交易执行岗人员数量	数值	—
10	信息披露人员数量	数值	—
11	风险控制人员数量	数值	—
12	其他人员数量	数值	—
13	备注（其他人员岗位说明）	字符	若同一人兼任不同岗位，请在此备注栏中详细说明。

5.9 机构资产管理业务收支明细信息采集

机构资产管理业务收支明细信息采集的数据应符合表9的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表 9 机构资产管理业务收支明细信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	管理费	数值	—
2	管理费-业绩报酬	数值	—
3	其他收入	数值	—
4	收入小计	数值	—
5	人员薪资福利	数值	—
6	软硬件设备支出与维护费用	数值	—
7	投资顾问费用	数值	—
8	销售费用	数值	—
9	其他费用	数值	—
10	支出小计	数值	—
11	资产管理业务净收入	数值	—
注：本表按照权责发生制填写。			

6 期货公司资产管理业务特殊事项报表数据采集

6.1 非标准化债权类资产信息采集

非标准化债权类资产信息采集的数据应符合表10的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表 10 非标准化债权类资产信息

序号	数据名称	数据说明	数据类型
1	基本信息-中间产品的管理人类型	枚举	枚举值包括：信托公司/证券公司及其资管子公司/证券公司私募投资基金子公司基金子公司/证券类私募基金管理人/股权和创投类私

			募基金管理人/其他类私募基金管理人/其他/无中间产品。 “中间产品”为资产管理计划投资非标准化债权类资产的投资渠道。
2	基本信息-标的资产状态	枚举	枚举值包括：运行正常/存在潜在风险/发生延期兑付利息/发生延期兑付本金/发生延期兑付本息。
3	融资主体基本情况-融资主体名称	字符	-
4	融资主体基本情况-统一社会信用代码	字符	与营业执照“统一社会信用代码”保持一致，按照 GB 32100—2015 4.2 代码及说明描述的填写。
5	融资主体基本情况-企业性质	枚举	枚举值包括：国有控股/民营。
6	融资主体基本情况-行业类别	字符	填写投资行业二级行业名称，投资行业名称详见“行业分类附表”。
7	融资主体基本情况-主营业务	字符	-
8	融资主体基本情况-是否为地方政府融资平台	布尔	-
9	融资主体基本情况-涉及地方政府（如：XX 省 XX 市 XX 县 XX 乡/镇）	字符	-
10	融资项目详细信息-项目所在省市	字符	若融资资金未投向具体项目，则填写融资主体注册地所在省市。
11	融资项目详细信息-项目所在区县	字符	若融资资金未投向具体项目，则填写融资主体注册地所在区县。
12	融资项目详细信息-融资余额	数值	是指融资项目本期末账面价值。本项按资产管理计划估值表对债权投资的计量要求填写。如果资产管理计划合同等相关文件规定本项目按成本计量，则本项填写按成本计量的值；如果相关文件规定本项按公允价值计量，则本项填写按公允价值计量的值。
13	融资项目详细信息-融资本金	数值	是指截至本期末，投资的本金规模。
14	融资项目详细信息-融资利率（%）	数值	是指年化融资利率。存在同一融资主体多笔分期融资时，填写加权平均融资利率。单位：% ，保留两位小数。
15	融资项目详细信息-融资用途	字符	-
16	融资项目详细信息-债权到期日	日期	-
17	融资项目详细信息-融资起始日	日期	-
18	融资项目详细信息-融资到期日	日期	-
19	融资项目详细信息-增信措施	枚举	枚举值包括：1-抵押/2-质押/3-保证/4 一无 按照枚举值填写序号，如涉及多项请用英文分号分隔。
20	融资项目详细信息-抵质押物类型	枚举	枚举值包括：1-土地及地上附着物/2-上市公司股票质押/3-非上市公司股权质押/4-其他有价证券（如债券、存单等）质押/5-其他；6 一无 按照枚举值填写序号，如涉及多项请用英文分号分隔。
21	融资项目详细信息-抵押权是否为第一顺位	枚举	枚举值包括：是/否/不涉及
22	融资项目详细信息-质押权是否为第一顺位	枚举	枚举值包括：是/否/不涉及
23	融资项目详细信息-保证人名称（全称）	字符	如涉及多个保证人，请依次填写，用英文分号分隔。如不涉及请填写“无”。
24	融资项目详细信息-保证人统一社会信用代码/身份证号	字符	如涉及多个保证人，请依次填写，用英文分号分隔。顺序与保证人名称顺序一致。如不涉及请填写“无”。 统一社会信用代码与营业执照“统一社会信用代码”保持一致，按照 GB 32100—2015 4.2 代码及说明描述的填写。

6.2 非标准化股权类资产信息采集

非标准化股权类资产信息采集的数据应符合表11的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表 11 非标准化股权类资产信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	基本信息-投资余额	数值	是指投资项目本期末账面价值。本项按资产管理计划估值表对股权投资的投资的计量要求填写。如果资产管理计划合同等相关文件规定本项目按成本计量，则本项填写按成本计量的值；如果相关文件规定本项按公允价值计量，则本项填写按公允价值计量的值。
2	基本信息-投资本金	数值	是指截至本期末，投资的本金规模。
3	基本信息-占被投资单位股权比重（%）	数值	按股本或实收资本计算。单位：% ，保留两位小数。
4	基本信息-中间产品的管理人类型	枚举	枚举值包括：信托公司/证券公司及其资管子公司/证券公司私募投资基金子公司/基金子公司/证券类私募基金管理人/股权和创投类私募基金管理人/其他类私募基金管理人/其他/无中间产品 “中间产品”为资产管理计划投资非标准化股权类资产的投资渠道。
5	融资主体基本情况-融资主体名称	字符	—
6	融资主体基本情况-统一社会信用代码	字符	与营业执照“统一社会信用代码”保持一致，按照 GB 32100—2015 4.2 代码及说明描述的填写。
7	融资主体基本情况-是否为管理人关联方	布尔	—
8	融资主体基本情况-是否为地方政府融资平台	布尔	—
9	融资主体基本情况-企业性质	枚举	枚举值包括：国有控股/民营
10	融资主体基本情况-行业类别	字符	填写投资行业二级行业名称，投资行业名称详见“行业分类附表”。
11	融资主体基本情况-主营业务	字符	—
12	融资主体基本情况-投资起始日	日期	—
13	融资主体基本情况-股权退出日	日期	—
14	融资主体基本情况-股权退出方式	枚举	枚举值包括：1-境内上市/2-境外上市/3-新三板挂牌/4-协议转让/5-整体收购/6-企业回购/7-其他 按照枚举值填写序号，如涉及多项请用英文分号分隔。

6.3 非标准化期货和衍生品类资产信息采集

非标准化期货和衍生品类资产信息采集的数据应符合表12的要求。对于数据类型为数值的数据，如无特殊说明，单位为元，保留两位小数。

表 12 非标准化期货和衍生品类资产信息

序号	数据名称	数据类型	数据说明
1	投资金额	数值	—
2	交易对手方名称	字符	—
3	交易对手方类型	枚举	枚举值包括：产业客户/其他机构。
4	业务类型	枚举	枚举值包括：互换/期权/远期。
5	标的类型	枚举	枚举值包括：商品/个股/指数/其他。
6	存量名义本金	数值	—
7	履约保障品价值	数值	—

附 录 A
(规范性)
行业分类附表

关于债券、非标债权和非标股权发行人所属行业的行业名称，按照表A.1分类。

表 A.1 行业分类附表

一级行业		二级行业		三级行业	
行业代码	行业名称	行业代码	行业名称	行业代码	行业名称
10	能源	1010	能源Ⅱ	101010	能源设备与服务
				101020	石油、天然气与供消费用燃料
15	材料	1510	材料Ⅱ	151010	化工
				151020	建材Ⅲ
				151030	容器与包装
				151040	金属、非金属与采矿
				151050	纸与林木产品
20	工业	2010	资本货物	201010	航空航天与国防Ⅲ
				201020	建筑产品Ⅲ
				201030	建筑与工程Ⅲ
				201040	电气设备
				201050	综合类Ⅲ
				201060	机械
				201070	贸易公司与工业品经销商Ⅲ
		2020	商业和专业服务	202010	商业服务与用品
				202020	专业服务
		2030	运输	203010	航空货运与物流Ⅲ
				203020	航空Ⅲ
				203030	海运Ⅲ
				203040	公路与铁路运输
				203050	交通基础设施
25	可选消费	2510	汽车与汽车零部件	251010	汽车零配件
				251020	汽车
		2520	耐用消费品与服装	252010	家庭耐用消费品
				252020	休闲设备与用品
				252030	纺织品、服装与奢侈品
		2530	消费者服务Ⅱ	253010	酒店、餐馆与休闲Ⅲ
				253020	综合消费者服务Ⅲ
		2540	媒体Ⅱ	254010	媒体Ⅲ
		2550	零售业	255010	消费品经销商Ⅲ
				255020	互联网与售货目录零售
255030	多元化零售				
255040	专营零售				
30	日常消费	3010	食品与主要用品零售Ⅱ	301010	食品与主要用品零售Ⅲ
		3020	食品、饮料与烟草	302010	饮料
				302020	食品
				302030	烟草Ⅲ
		3030	家庭与个人用品	303010	家庭用品Ⅲ
303020	个人用品Ⅲ				
35	医疗保健	3510	医疗保健设备与服务	351010	医疗保健设备与用品
				351020	医疗保健提供商与服务

		3520	制药、生物科技与生命科学	351030	医疗保健技术III
				352010	生物科技III
				352020	制药
				352030	生命科学工具和服务III
40	金融	4010	银行	401010	商业银行
				401020	互助储蓄银行与抵押信贷III
		4020	多元金融	402010	多元金融服务
				402020	消费信贷III
				402030	资本市场
				402040	抵押房地产投资信托(REITs)
		4030	保险 II	403010	保险III
		4040	房地产	404020	房地产投资信托
				404030	房地产管理与开发
45	信息技术	4510	软件与服务	451010	互联网软件与服务III
				451020	信息技术服务
				451030	软件
		4520	技术硬件与设备	452010	通信设备III
				452020	电脑与外围设备
				452030	电子设备、仪器和元件
				452040	办公电子设备III
		4530	半导体与半导体生产设备	453010	半导体产品与半导体设备
50	电信服务	5010	电信服务 II	501010	多元电信服务
				501020	无线电信业务III
55	公用事业	5510	公用事业 II	551010	电力III
				551020	燃气III
				551030	复合型公用事业III
				551040	水务III
				551050	独立电力生产商与能源贸易商III
60	房地产	6010	房地产 II	601010	股权房地产投资信托(REITs)
				601020	房地产管理和开发

附 录 B
(资料性)
债券分类附表

产品债券投资明细信息采集表中，针对不同类型的债券，按照表B.1分类。

表 B.1 债券分类附表

债券序号	债券一级分类	债券二级分类
1	国债	—
2	地方政府债	—
3	央行票据	—
4	政策性金融债	—
5	其他金融债	商业银行债、商业银行次级债、保险公司债、证券公司债、证券公司短期融资券、其他金融机构债
6	企业债	一般企业债、集合企业债、NPB
7	公司债	一般公司债
8	中期票据	—
9	短期融资券	一般短期融资券、超短期融资债券
10	定向工具	PPN
11	国际机构债	—
12	政府支持机构债	—
13	资产支持债券	资产支持证券 ABS、资产支持票据 ABN、项目收益票据 PRN
14	可转债	—
15	可交换债	—
16	可分离转债存债	—
17	其他	—

参 考 文 献

- [1] JR/T 0176.1-2019 证券期货业数据模型 第1部分：抽象模型设计方法
 - [2] 全国人民代表大会常务委员会. 中华人民共和国公司法（主席令第15号）, 2018年10月26日
 - [3] 全国人民代表大会常务委员会. 中华人民共和国期货和衍生品法, 2022年8月1日
 - [4] 国务院. 期货交易管理条例（国务院令第676号）, 2017年3月1日
 - [5] 中华人民共和国财政部. 《企业会计准则第36号-关联方披露》（财会〔2006〕3号）, 2006年3月9日
 - [6] 中国证券监督管理委员会. 证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法(证监会令第203号), 2023 年1月12日
 - [7] 中国证券监督管理委员会. 证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定（证监会公告〔2023〕2号）, 2023年1月12日
 - [8] 中国证券投资基金业协会, 中国基金估值标准2018, 2018年9月
 - [9] 中华人民共和国财政部. 企业会计准则应用指南2019年版, 2019年1月
-