

《期货公司监管数据采集规范 第2部分： 资产管理业务》

编制说明

《期货公司监管数据采集规范 第2部分：资产管理业务》

起草工作组

二〇二四年六月

一、背景及意义

近年来，随着期货市场快速发展，监管机构对期货公司的数据采集需求不断增加。2022 年，在证监会期货监管司的指导下，“五位一体”各方通力合作建成期货公司监管综合信息系统（以下简称“新一代 FISS 系统”），集中采集期货公司基本信息、财务状况、业务开展情况等各类数据，为“五位一体”各方加强期货公司行政监管、监测监控、自律监管和行业信息公示提供了重要的信息来源。中国期货市场监控中心有限责任公司（以下简称“中国期货监控”）依托新一代 FISS 系统数据采集接口，立项期货公司监管数据采集规范系列行业标准，2023 年 7 月，《期货公司监管数据采集规范 第 1 部分：基本信息和经纪业务》（JR/T 0293—2023）金融行业标准已正式发布。

自 2018 年 10 月证监会资管新规发布以来，期货公司资产管理业务在深化整改的同时积极谋求转型发展，业务格局发生显著变化。2023 年 1 月，证监会发布了新修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，期货公司资产管理业务发展迎来新机遇。目前期货资管行业尚未形成监管数据业务定义、口径约束的统一标准。随着数据挖掘、关联分析等新兴科技手段的广泛应用，监管的科技化、智能化需要提高数据标准化程度、提升数据治理水平。明确期货公司资产管理业务数据报送和采集标准，有利于提高数据采集的时效性和准确性，通过数据标准化让监管更加智慧。

二、工作简况

1. 任务来源

本文件由中国期货监控发起和牵头组织实施，证标委批准立项后实施制定。在证监会科技监管司、证监会期货监管司、中证信息技术的指导下，中国期货监控牵头编写标准立项建议书及相关请示材料，成立标准起草工作组、制定工作方案，组织中信期货、国泰君安期货、中粮期货、银河期货、五矿期货、华泰期货、永安期货、浙商期货 8 家行业机构共同起草了《期货公司监管数据采集规范 第 2 部分：资产管理业务》（初稿），邀请北京证监局、上海证监局、浙江证监局、广东证监局、深圳证监局、中国期货业协会选派业务专家加入起草工作组，结合

一线监管经验和数据应用需求，对初稿中的数据要素的定义、口径等进行交叉复核和意见研讨。经过起草工作组内部多轮意见征求和修订，最终呈现了本文件。

2. 主要工作过程

（一）项目启动。

2023年6月，项目启动，开展标准项目启动的必要性和可行性研究，编写标准立项建议书及相关请示材料。

（二）标准立项下达。

2023年10月，收到《关于下达〈期货公司监管数据采集规范 第2部分：资产管理业务〉金融行业标准立项计划的通知》（证标委秘发〔2023〕189号），本项目经证监会批准立项。项目编号：P2023004，项目建议名称：期货公司监管数据采集规范 第2部分：资产管理业务，项目申报单位：中国期货市场监控中心有限责任公司。

（三）成立标准编制工作组。

2023年11月，邀请北京证监局、上海证监局、浙江证监局、广东证监局、深圳证监局、中国期货业协会、中信期货、国泰君安期货、中粮期货、银河期货、五矿期货、华泰期货、永安期货、浙商期货派员成立标准编制工作组（以下简称工作组），对标准框架及后续工作规划进行讨论。

（四）形成征求意见稿。

2023年12月-2024年6月，制定起草工作方案，邀请行业专家共同参与草稿编写，召开会议对数据要素及数据要素的定义、口径等进行讨论，初步完成工作组讨论稿草案，并征求工作组成员单位意见建议，经组内讨论复核后形成征求意见稿，并提交证标委秘书处。

三、编制主要内容

《期货公司监管数据采集规范 第2部分：资产管理业务》以行业法律法规、规范性文件、业务规则及制度等为依据，结合期货公司监管综合信息系统采集数据的实践经验，梳理汇总监管部门集中关注的与期货公司资产管理业务开展情况相关的监管数据要素。通过规范数据要素的业务定义，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》主要涵盖了范围、规范性引用文件、术语和定义、数据类型、期货公司资产管理业务报表数据采集、期货公司资产管理业务特殊事项报表数据采集、期货公司资产管理业务报表附表七大部分。期货公司资产管理业务报表和特殊事项报表数据采集共12张数据表286个数据项，主要以期货公司资产管理计划基本信息、资金来源信息、产品运行情况、投资标的信息；期货公司资产管理业务机构信息和收支情况相关数据要素，形成行业可参考的数据要素业务定义规范。

四、主要试验（或验证）分析

新一代FISS系统是期货经营机构监管数据的集中平台，在提高期货公司监管效能、加强期货公司监管数据交互和共享方面发挥了重要作用。本文件结合新一代FISS系统10年来的监管数据采集经验，根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》和《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，提炼期货公司资产管理业务开展过程中业务定义相对明确、采集经验相对成熟的数据要素，梳理总结数据要素的业务定义、数据类型，形成行业普遍认可和正在应用的监管数据采集标准。

五、与现行法律、法规、政策及其他标准的关系

本文件遵守中华人民共和国现行的法律、法规，并且符合GB/T 1.1《标准化工作导则》标准的要求。

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。

本文件规范性引用文件如下：

GB 32100—2015 法人和其他组织统一社会信用代码

《中国人民银行 中国银行保险监督管理委员会 中国证券监督管理委员会 国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号）

《中国人民银行 中国银行保险监督管理委员会 中国证券监督管理委员会

国家外汇管理局关于印发〈金融机构资产管理产品统计制度〉和〈金融机构资产管理产品统计模板〉的通知》（银发〔2018〕299号）

《证券期货市场统计管理办法》（证监会令第60号）

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）

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）

六、与行业数据模型的关系

本文件为期货行业的业务语义规范性标准，明确期货公司资产管理业务监管数据的业务定义。引用行业数据模型（SDOM）方法论和行业标准（证监会公告〔2019〕24号），在行业整体业务架构体系下，开展期货公司资产管理业务定义梳理工作。

七、重大分歧意见的处理经过和依据

在编写过程中，起草工作组成员对数据采集要素进行了充分研究和讨论，并多次征求组内专家意见，在编制过程中并未出现重大分歧意见。

八、贯彻标准的要求和建议措施

建议在行业内发布，以推荐性标准供行业期货公司和监管部门参考。新一代FISS系统已按照本标准向行业采集期货公司资产管理业务相关数据，并对其中数据进行统计应用展示。

九、行业标准属性的建议

鉴于本文件的内容未涉及强制性标准或强制性条文的内容及要求，因此建议本文件作为推荐性行业标准。

十、废止有关现行标准的建议

无。

十一、其它说明事项

本标准主要适用于证监会期货监管司、各证监局、各期货交易所、中国期货业协会、中国期货监控及其他使用期货公司监管采集数据进行统计分析的监管单位。