

《证券期货业业务域数据元规范 第4部分： 证券交易所》

编制说明

《证券期货业业务域数据元规范 第4部分：证券交易所》

标准起草组

二〇二四年九月

一、背景及意义

1. 背景

随着数字经济高速发展，数据在各行各业的重要性日益凸显。中央金融工作会议提出做好科技金融、数字金融等五篇大文章，对证券期货业数字化高质量发展提出了新要求。然而，当前不同系统或平台采用的数据标准尚未统一，行业机构间高效交换和共享数据面临诸多障碍。因此，建立数据标准成为证券期货业数字化发展的趋势和必然要求。

《证券期货业科技发展“十四五”规划》指出，要“大力推进资本市场基础数据标准和监管数据标准制定”。数据元作为组成数据实体的最小单位，针对数据要素的命名、定义、取值范围、数据类型等方面内容进行规范，其准确性和一致性对于保证数据质量、促进数据互通、提升数据应用效能、降低数据管理成本至关重要，建立数据元标准迫在眉睫。

前期，证监会已发布《证券期货业基础数据元规范第1部分：基础数据元》《证券期货业基础数据元规范第2部分：基础代码》两项数据元标准，规范了行业核心通用数据项的名称、业务含义、分类、数据类型及长度等属性，为行业数据元标准建设打下了坚实基础。为进一步支持细分业务领域的治理工作，证标委牵头择取成熟度高、迫切性强的六个业务域，启动了证券期货业业务域数据元规范的编制工作。本文《证券期货业业务域数据元规范 第4部分：证券交易所》（以下简称《证券交易所数据元标准》）为其中第4部分。

2. 目的和意义

《证券交易所数据元标准》依托上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所面向市场参与者的产品及服务内容，抽取了系统建设必要、关键的数据元进行标准化。证券交易所作为证券集中交易提供场所和设施，具有组织和监督证券交易的职能，开展《证券交易所数据元标准》编制工作，旨在为构建相关数据模型、信息模型、事件模型等提供基本参考，对于推动行业数字化转型、夯实应用系统数据基础、强化数据底座建设、提升机构间数据交互效率，促进实现“数据让监管更加智慧”的愿景具有重要意义。具体有以下几个方面：

一是提升数据质量，标准化的数据格式能够提升数据准确性和一致性，减少因数据不确定带来的误差和混乱，提升数据处理效能。**二是提高数据可交互性**，

证券交易所需要处理大量跨系统、跨平台数据，数据标准能够提升数据交互效率，打破数据孤岛现象，实现数据的共享与交流。三是**辅助决策分析**，信息对于金融工作具有重要意义，标准化的数据更有利于进行数据分析，帮助决策者做出更准确、更有依据的决策。四是**提供合规保障**，证券交易所作为金融行业关键基础设施，需要满足并监督行业执行法律法规和部门规章要求，例如上市公司申报文件符合信息披露相关规范，数据标准化有助于提升信息披露工作效率，开展合规检查。五是**推动行业发展**，数据标准的建立可以促进发展和创新，引领行业向更高效、更绿色、更可持续的方向发展。

二、任务来源

《证券交易所数据元标准》编制工作是在证券监督管理委员会科技监管司和全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（WG21 数据标准工作组）指导下开展。标准起草组牵头单位是上海证券交易所，参与单位包括深圳证券交易所、北京证券交易所、证监会科技监管局、中证数据有限责任公司。起草组成员包括证券交易所业务、技术和数据领域专家，具有广泛代表性，充分体现业务、技术与数据的深度融合。

三、工作简况

1. 预研

（1）2023 年 9 月至 2024 年 10 月，搭建业务主题分类框架，摸排现有数据资源情况，梳理制度规范，选择重点数据元纳入编制范围。

（3）2023 年 11 月至 2024 年 3 月，逐项编写数据元属性，起草单位间进行多轮讨论，针对差异达成共识，初步形成工作讨论稿。

2. 立项

（1）2024 年 4 月，编写标准立项建议书，向证标委正式提交立项申请，启动立项审查征求意见工作。

（2）2024 年 5 月至 6 月，处理立项征求意见。针对 5 家单位反馈的 11 项意见建议与相关方进行沟通，最终采纳 7 条、部分采纳 1 条、未采纳 3 条，针对部分采纳及未采纳意见与提出单位达成一致。

(3) 2024 年 7 月，证标委秘书处下发《证券期货业业务域数据元规范 第 4 部分：证券交易所》行业标准立项计划的通知（证标委秘发〔2024〕115 号），项目计划编号 P2024005。

3. 起草

(1) 2024 年 7 月至 2024 年 8 月，成立《证券交易所数据元标准》编制工作组（以下简称工作组）。

(2) 2024 年 8 月至 2024 年 9 月，根据行业标准制定要求，重点针对跨业务域数据元标准间数据元属性和词根不统一的问题进行讨论，基于工作讨论稿开展多轮制修订，完成征求意见稿编写。

4. 征求意见

2024 年 9 月，向证标委秘书处提交《证券交易所数据元标准》征求意见稿及相关材料。

三、编制主要内容

《证券交易所数据元标准》涉及证券交易所业务域数据元制定。数据元是由一组属性规定其定义、标识、表示和允许值的数据单元，是描述数据的最基本单元。文件选取了上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所业务特征明显、具有广泛适用性的一组数据元集合，按照体系化、规范化的数据元框架定义要求，通过溯源权威法规、细化技术属性、完善约束规则等步骤，形成一套业务分类清晰、名称定义准确、关联关系完善的数据元标准，为证券交易所业务相关数据建设和应用工作提供指导和参考。

《证券交易所数据元标准》共包含 14 张数据元列表、286 项数据元。每项数据元除外业务条线分类外，具有 10 项数据元属性，具体为数据元编号、中文名称、英文名称、业务含义、数据类型及长度、制定依据、度量单位、代码编号、相关数据元和关系类型。其中数据元编号、代码编号规定了数据元的标识；中文名称、英文名称、业务含义和制定依据规定了数据元的定义，枚举型数据元的代码在附录中进行了进一步定义和说明；数据类型及长度规定了数据元的表示和技术要求；相关数据元和关系类型规定了数据元与已发布的《证券期货业基础数据

元规范第1部分：基础数据元》中相关数据元的关联关系。

四、主要试验（或验证）分析

无

五、与有关的现行法律、法规和国家标准的关系

自2009年原国家质量监督检验检疫总局及国标委共同发布GB/T 18391《信息技术 元数据注册系统（MDR）》以来，各行业分别开展了行业基础数据元标准编制工作。2019年，银行业和保险业相继推出《银行间市场基础数据元》《保险基础数据元目录》行业基础数据元标准。近两年，为满足业务高质量发展的需求，各行业在原基础数据元标准的基础上进一步精细化，相继推出具体业务领域的数据元标准。2021年保险业推出行业标准《财产保险业务要素数据规范》《人身保险业务要素数据规范》。目前，证券期货行业基础数据元标准编制工作已基本完成，证券交易所业务域数据元在此基础上，参照业务流程和规章制度，统筹分析我国证券交易所业务数据资源，具备标准研制的工作基础。

六、重大分歧意见的处理经过和依据

在本文件的编制过程中，工作组成员对标准的内容进行了充分的研究和探讨，在编制过程中未出现重大分歧意见。

七、贯彻标准的要求和建议措施

本标准主要适用于监管机构（会内部门及派出机构），核心机构（会管单位及各协会），经营机构（证券公司、基金公司、期货公司等），服务机构（会计师事务所、律师事务所、资产评估机构等服务机构，以及各类证券期货业技术、服务、实施厂商等）。

八、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。

九、废止有关现行标准的建议

无。

十、其它说明事项

无。