

# 团 体 标 准

T/ZQX 0001.1-2023

---

## 资产管理业务数据报告规范 第 1 部分：投资顾问业务信息

Specification of Assets Management business data

Part1: investment advisor information

2023 - 05 - 16 发布

2023 - 05 - 16 实施

---

中国期货业协会 发布

# 目 次

目 次.....	I
前 言.....	II
第1部分：投资顾问业务信息.....	1
1 目标及范围.....	1
2 术语和定义.....	1
2.1 投资顾问 investment advisor.....	1
3 投资顾问业务信息采集数据.....	1
3.1 基本说明.....	1
3.1.1 数据要素编号.....	1
3.1.2 数据要素来源.....	1
3.1.3 数据要素名称.....	1
3.1.4 数据类型.....	1
3.1.5 数据要素说明.....	1
3.2 数据结构.....	2
附录 采集数据样表及对应数据编号.....	4
参考文献.....	5

## 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。

本文件为T/ZQX 0001《资产管理业务数据报告规范》的第1部分。

本标准由中国期货业协会标准化委员会提出。

本标准起草单位：中国期货业协会。

本标准主要起草人：安青松，洪磊，冉丽，王智勇，王曦，孙湛林，张争妍，艾青。

# 第 1 部分：投资顾问业务信息

## 1 目标及范围

本文件确立了资产管理业务数据中有关投资顾问业务信息数据采集范围，给出了业务数据定义和口径说明。

本文件适用于期货经营机构为其他资产管理产品提供投资顾问服务的数据采集和应用。

## 2 术语和定义

### 2.1 投资顾问 investment advisor

指由资产管理产品管理人聘请的为产品提供投资建议和指导操作的具有专业资质的受金融监督管理部门监管的机构。

[来源：关于规范金融机构资产管理业务的指导意见]

## 3 投资顾问业务信息采集数据

### 3.1 基本说明

以下用于解释说明“3.2 数据结构”中数据表项的基本涵义

#### 3.1.1 数据要素编号

数据要素唯一编号，共六位（CCNNNN），前两位（CC）为数据所属业务代码，后四位（NNNN）为数值。资产管理业务代码为 AM（Assets Management）。

#### 3.1.2 数据要素来源

数据要素来源主要分为三种：

1. 基本采集数据（CJ）：通过采集得来的基本数据。
2. 系统自动填入数据（XT）：无需采集，根据其他数据计算而来或采集系统中已有的数据。
3. 空白数据（KB）：仅为标识，无需进行任何操作的数据

#### 3.1.3 数据要素名称

数据要素全称，与附录中“字段名称”相同。

#### 3.1.4 数据类型

数据类型主要分为两种：

1. 数值：表示数量、可以进行数值运算的数据类型。
2. 字符：不具备计算能力的文字数据类型。

#### 3.1.5 数据要素说明

包含数据要素含义及采集的相关要求。

## 3.2 数据结构

数据要素编号	数据要素来源	数据要素名称	数据类型	数据要素说明
AM0001	CJ	投顾产品编码	字符	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品的产品编码。
AM0002	CJ	投顾产品名称	字符	必填。 指由本公司作为投资顾问的产品的产品名称。
AM0003	CJ	投顾产品管理人名称	字符	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品的管理人名称（全称）。
AM0004	CJ	投顾产品管理人统一社会信用代码	字符	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品的管理人的统一社会信用代码。
AM0005	CJ	投顾产品管理人类型	字符	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品的管理人类型。 [单选] <ul style="list-style-type: none"> <li>• 银行及其理财子公司</li> <li>• 证券公司及其资管子公司</li> <li>• 期货公司及其资管子公司</li> <li>• 基金公司及其资管子公司</li> <li>• 私募基金管理人</li> <li>• 保险公司及其资管子公司</li> <li>• 信托公司</li> <li>• 其他</li> </ul>
AM0006	CJ	投顾产品产品类型	字符	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品的产品类型。 [单选] <ul style="list-style-type: none"> <li>• 固定收益类</li> <li>• 权益类</li> <li>• 期货和衍生品类（商品及金融衍生品类）</li> <li>• 混合类</li> </ul>
AM0007	CJ	投顾产品净资产	数值	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品的期末净资产。（单位：元）。
AM0008	CJ	投顾产品累计单位净值	数值	必填。 指由本公司作为投资顾问的资产管理产品剔除产品分红影响后的累计单位净值，一般为产品单位净值+(产品历史上所有分红派息的总额/产品总份额)。
AM0009	CJ	投顾产品期货及衍生	数值	必填。

		品投资规模		指由本公司作为投资顾问的资管产品，期末投向期货及衍生品的总规模，指场内和场外的总规模。以持仓占用保证金及期权费计算(单位：元)，不穿透计算。 数值大于等于数据编号 AM0010 与 AM0011 数值的和。
AM0010	CJ	投顾产品商品期货期权投资规模	数值	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品，期末投向商品类期货、商品类期权的总规模，指交易所交易的期货和期权。以持仓占用保证金及期权费计算（单位：元），不穿透计算。 数值一般小于 AM0007 的数值。
AM0011	CJ	投顾产品金融期货期权投资规模	数值	必填。 指由本公司作为投资顾问的资管产品，期末投向金融类期货、金融类期权的总规模，指交易所交易的期货和期权。以持仓占用保证金及期权费计算（单位：元），不穿透计算。 数值一般小于 AM0007 的数值。
AM0012	CJ	投资顾问收入	数值	必填。 由本公司给其他产品担任投资顾问所获得的收入总额，指本月所获收入（单位：元）。

## 附录 采集数据样表及对应数据编号

字段名称	字段解释	产品 X	对应数据编号
投顾产品编码	指由本公司作为投资顾问的资管产品的产品编码。		AM0001
投顾产品名称	指由本公司作为投资顾问的产品的产品名称		AM0002
投顾产品管理人名称	指由本公司作为投资顾问的资管产品的管理人名称（全称）		AM0003
投顾产品管理人统一社会信用代码	指由本公司作为投资顾问的资管产品的管理人的统一社会信用代码。		AM0004
投顾产品管理人类型	指由本公司作为投资顾问的资管产品的管理人类型		AM0005
投顾产品产品类型	指由本公司作为投资顾问的资管产品的产品类型。		AM0006
投顾产品净资产	指由本公司作为投资顾问的资管产品的期末净资产（单位：元）。		AM0007
投顾产品累计单位净值	指由本公司作为投资顾问的资产管理产品剔除产品分红影响后的累计单位净值，一般为产品单位净值+(产品历史上所有分红派息的总额/产品总份额)。		AM0008
投顾产品期货及衍生品投资规模	指由本公司作为投资顾问的资管产品，期末投向期货及衍生品的总规模，指场内和场外的总规模。以持仓占用保证金计算（单位：元），不穿透计算。		AM0009
投顾产品商品期货期权投资规模	指由本公司作为投资顾问的资管产品，期末投向商品类期货、商品类期权的总规模，指交易所交易的期货和期权。以持仓占用保证金计算（单位：元），不穿透计算。		AM0010
投顾产品金融期货期权投资规模	指由本公司作为投资顾问的资管产品，期末投向金融类期货、金融类期权的总规模，指交易所交易的期货和期权。以持仓占用保证金计算（单位：元），不穿透计算。		AM0011
投资顾问收入	由本公司给其他产品担任投资顾问所获得的收入，指本月所获收入（单位：元），按实收金额填写。其中，本月无实收金额的填0。		AM0012

### 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] GB/T 18142-2017 信息技术 数据元素值表示 格式记法（ISO/IEC 14957:2010）
- [3] 人民银行，银保监会，证监会，外汇局. 关于规范金融机构资产管理业务的指导意见(银发[2018]106号)，2018年4月27日
- [4] 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
- [5] 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