

证券期货业信息交换标准规划 (2022-2025)

全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会

参与人员名单

规划起草单位：

中国证监会科技监管局、中信建投证券股份有限公司、上海证券交易所、深圳证券交易所、大商所飞泰测试技术有限公司、中国金融期货交易所、中国证券登记结算有限责任公司、中国证券投资者保护基金有限责任公司、中国期货市场监控中心有限公司、中证信息技术服务有限公司、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会、深圳证券通信有限公司、中证股转科技有限公司、国泰君安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、博时基金管理有限公司、中融基金管理有限公司、上海东方证券资产管理有限公司、恒生电子股份有限公司、深圳市金证科技股份有限公司、中国标准化研究院

规划起草人员：

姚前、蒋东兴、肖钢、周云晖、路一、孟晋津、朱立、黄天寿、吴韶平、陈朝兰、郭欣、余峰、王永峰、王心怡、祝腾辉、石晶晶、孙宏伟、李向东、李睿、汤玥玥、李桂捷、李志能、王鹏飞、梁馨宁、宋璐璐、叶晶、贾淑芳、潘智斌、樊建、肖雅雯、刘炬、赵松鹤、盛庆、牟大恩、毛银杰、刘三高、王春艳、侯韩芳

目 录

1	总体目标.....	1
2	总体要求.....	1
3	基本原则.....	2
4	规划设计方法.....	2
5	问题与挑战.....	8
6	重点任务.....	9
6.1	交易管理.....	9
6.2	结算管理.....	9
6.3	行情、资讯管理.....	10
6.4	信息披露管理.....	10
6.5	监管报送.....	10
6.6	其他.....	10
7	任务计划.....	11
8	标准实施保障.....	13
9	规划组织保障.....	13
9.1	推进协同合作.....	13
9.2	加强能力建设.....	13
9.3	完善物资配备.....	13

为加快证券期货行业数字化转型，提高资本市场信息运转质量与效率，降低信息交互成本和风险，充分发挥标准化的协调统一和简化优化重要基础支撑作用，助推行业创新发展、规范管理、高效服务，特制定本规划。规划期限为 2022-2025 年。

1 总体目标

以《证券期货业科技发展“十四五”规划》为引领，以达成《证券期货业数据通信协议应用指南》(JR/T 0111-2014)中的数据通信协议演进目标为主要目标，基于行业数据模型、精简复用成熟的传输接口标准整体思路，建立涵盖行业全业务流程、结构清晰、科学合理的信息交换标准体系，组织开展一批基础关键亟需的标准化项目，推广一批切实可行标准得到有效实施，以确保行业内信息交换标准化建设水平得到有效提高。

完善信息交换标准体系。2022 年，以证券、期货、基金三大主要业务为切入点，健全涵盖交易、结算、信息披露、监管报送等交换数据内容的证券期货业机构内、机构间，以及与其他行业间有信息交换需求场景的信息交换标准体系。2022-2025 年，信息交换标准体系持续完善。

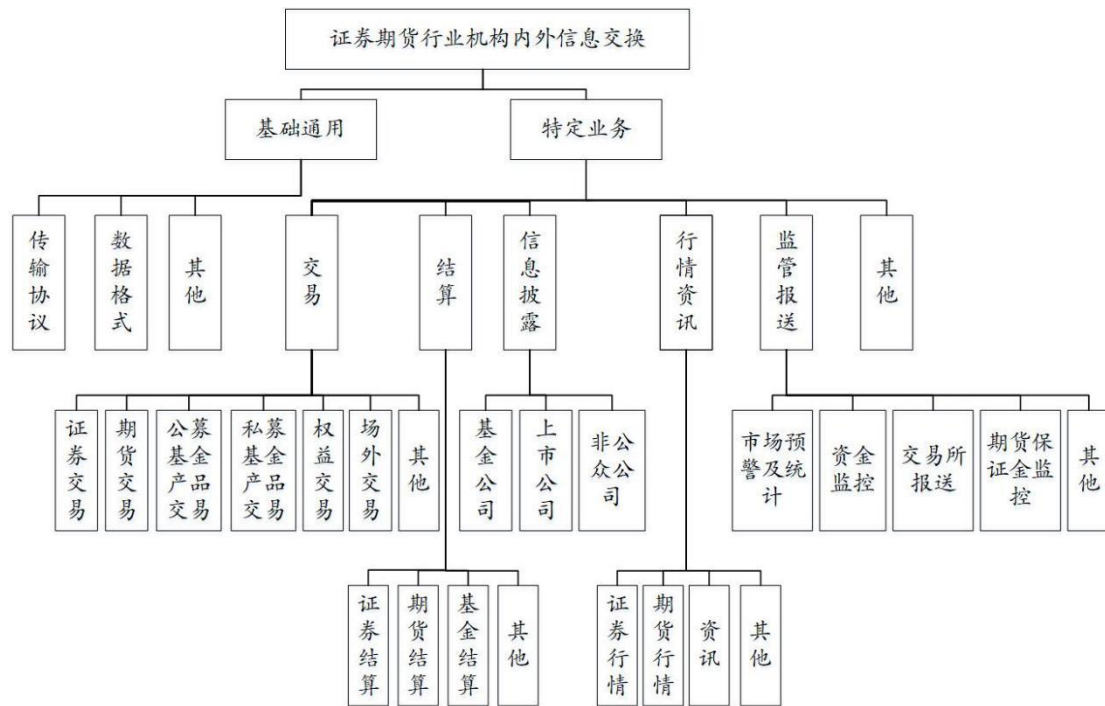


图 1 信息交换标准体系框架

夯实信息交换标准化基础。2022-2024 年，根据行业业务发展和数字化转型需要，组织制定信息交换领域需求度较高的国家标准或行业标准项目，及时修订不符合实际现状和需求的现有标准，推进标准在认证认可、检验检测等活动中的实施应用。到 2025 年，基本满足行业高速、安全且内外兼容性较高的信息交换标准化建设需求。

2 总体要求

本规划遵从国家信息安全相关法律法规标准要求，适用于指导证券期货业信息交换领域标准的制定与应用。

信息交换领域标准制定过程中，各相关实施单位、支持单位、服务单位、产品供应商、软件开发商、系统集成商等，应充分理解本规划，参照本规划制定的标准体系，结合行业标准化现状及标准实际应用情况，有计划地推进标准制定与应用工作。

3 基本原则

——科学规划，系统布局。基于行业信息交换领域发展实际，对行业顶层数据流进行分析，根据数据流走向，梳理总结机构间、机构内需要信息交互的业务场景、当前标准化工作基础以及现有法律法规、部门规章、行业自律规则等制定情况，结合证标委已开展相关课题研究进展，确定标准化工作的开展方向，重点推动研究课题产出高质量标准成果。

——需求导向，重点突破。以证券公司、期货公司、基金公司、中国结算、中证技术、以及交易场所等行业中介机构、核心机构、监管机构的实际需求为主要依据，结合多主体参与的、机构内系统间交互的业务场景，聚焦各机构信息交换共性、迫切的问题，分析需求的可行性与紧迫性，确定标准化工作的重点任务和长短期目标。

——开放兼容，持续发展。以数据字典、数据接口及传输接口完整定义数据通信协议为基本遵循，以精简复用传输接口标准、逐步完善数据接口标准为主体思路，在最大化兼容现有接口标准的基础上，既要填补空白，也要满足未来业务发展、协议演进、与国际接轨的需求。信息交换中涉及到的数据字典，应完全基于行业数据模型进行引用，扩展时不应与行业数据模型相矛盾。

——明确定位，实现落地。基于业务标准与技术标准在信息交换领域中所处两个不同的维度，基于完整的数据流向及业务处理流程经过多个不同的参与主体，在标准制定过程中要将其分离设计，区分每个标准的适用范围，尤其在标准立项阶段要重点明确关联标准的相互采纳关系，避免存在多个业务标准共同设计同一技术标准的可能。标准制定还应具备可落地实现能力，确保所制定标准具有广泛应用的价值。

4 规划设计方法

——掌握行业现状。全面了解行业信息交换领域的管理制度、平台建设、机构运行以及标准制定情况，结合资本市场数字化转型和科技监管发展趋势，统筹考虑规划的适用性和前瞻性，明确规划的形成路径。

信息交换领域已制定发布的国家标准和行业标准共 17 项（见表 1），其中行业基础通用 2 项、证券业务 9 项、基金业务 2 项、期货业务 4 项，涵盖交易、结算、行情等，涉及机构内外和行业间信息交换。目前，制定的数据交换标准已基本满足交易、结算等主要业务的信息交换需求。

表 1 信息交换领域已发布标准

序号	标准编号	标准名称	标准层级	牵头单位	体系位置
1	GB/T 39595-2020	开放式基金业务数据交换协议	国家标准	中国结算	交易-基金交易
2	GB/T 39662-2020	基金行业数据集中备份接口规范	国家标准	中国结算、基金业协会	业务类别-其他
3	JR/T 0016—2014	期货交易数据交换协议	行业标准	证监会信息中心	交易-期货交易中心

序号	标准编号	标准名称	标准层级	牵头单位	体系位置
4	JR/T 0018—2004	证券登记结算业务数据交换协议	行业标准	中国结算	结算-证券结算/基金结算
5	JR/T 0022—2020	证券交易数据交换协议	行业标准	上交所	交易-证券交易行情资讯-证券行情
6	JR/T 0046.1—2020	证券期货业与银行间业务数据交换协议 第1部分：三方存管、银期转账和结售汇业务	行业标准	上交所	交易-证券交易结算-证券结算
7	JR/T 0087—2012	股指期货业务基金与期货数据交换接口	行业标准	投保基金公司	交易-期货交易
8	JR/T 0103—2014	证券交易数据交换编解码协议	行业标准	上交所	交易-证券交易行情资讯-证券行情
9	JR/T 0111—2014	证券期货业数据通信协议应用指南	行业标准	证监会信息中心	基础通用
10	JR/T 0160—2018	期货市场客户开户数据接口	行业标准	中国期货监控	交易-期货交易
11	JR/T 0163—2018	证券发行人行为信息内容格式	行业标准	深交所	交易-证券交易
12	JR/T 0182—2020	轻量级实时 STEP 消息传输协议	行业标准	上交所	基础通用
13	JR/T 0190—2020	资本市场场外产品信息数据接口	行业标准	证券业协会 中证报价	交易-场外交易
14	JR/T 0151—2016	期货公司柜台系统数据接口规范	行业标准	期货业协会 中金所	交易-场外交易
15	JR/T 0155.1—2018	证券期货业场外市场交易系统接口 第1部分：行情接口	行业标准	证券业协会 中证报价	交易-场外交易
16	JR/T 0155.2—2018	证券期货业场外市场交易系统接口 第2部分：订单接口	行业标准	证券业协会 中证报价	交易-场外交易
17	JR/T 0155.3—2018	证券期货业场外市场交易系统接口 第3部分：结算接口	行业标准	证券业协会 中证报价	交易-场外交易

——继承原有设计。本规划继承前期机构间、机构内接口标准设计方案思路和工作基础，以行业数据模型为基础，从数据和传输两个维度，对行业顶层数据流进行分析，归纳出“单对单”“多对单（单对多）”“多对多”市场主体交换的业务场景（见表2），结合当前标准建设情况（见表3），确定下一步标准制订的范围，其中“多对多”场景和正在制定的标准为下一步重点工作方向。

表 2 基于行业顶层数据流交互的标准化情况

数据输出方和接受方		数据流方向	业务类别	数据两端单位数量	现有标准
中国结算	证券交易场所	双向	交易数据	单对多	JR/T 0018—2004 证券登记结算业务数据交换协议
中国结算	中证金融	双向	交易数据	单对单	JR/T 0018—2004 证券登记结算业务数据交换协议 JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议
中介机构	证券交易场所	双向	交易数据	多对多	JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议 JR/T 0103—2014 证券交易数据交换编解码协议 JR/T 0182—2020 轻量级实时 STEP 消息传输协议
证券公司	中证金融	单向	交易数据	多对单	JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议 JR/T 0103—2014 证券交易数据交换编解码协议 JR/T 0182—2020 轻量级实时 STEP 消息传输协议
证券公司	中国结算	双向	交易数据	多对单	JR/T 0018—2004 证券登记结算业务数据交换协议
基金公司	中国结算	双向	交易数据	多对单	GB/T 39595-2020 开放式基金业务数据交换协议 JR/T 0018—2004 证券登记结算业务数据交换协议
期货公司	期货交易场所	双向	交易数据	多对单	JR/T 0016—2014 期货交易数据交换协议
证券交易场所	中金所	双向	交易数据	多对单	JR/T0087—2012 股指期货业务基金与期货数据交换接口
证券交易场所	中证金融	双向	交易数据	多对单	JR/T 0022—2020 证券交易数据交换协议 JR/T

数据输出方和接受方		数据流方向	业务类别	数据两端单位数量	现有标准
					0103—2014 证券交易数据交换编解码协议 JR/T 0182—2020 轻量级实时 STEP 消息传输协议
银行	证券交易场所	双向	交易数据	多对多	
银行	期货交易场所	双向	交易数据	多对多	
银行	中国结算	双向	交易数据	多对单	JR/T 0046.1—2020 证券期货业与银行间业务数据交换协议 第1部分：三方存管、银期转账和结售汇业务
银行(第三方存管银行)	证券公司	双向	交易数据	多对多	JR/T 0046.1—2020 证券期货业与银行间业务数据交换协议 第1部分：三方存管、银期转账和结售汇业务
托管银行	基金公司	双向	交易数据	多对多	
存管银行	期货公司	双向	交易数据	多对多	JR/T 0046.1—2020 证券期货业与银行间业务数据交换协议 第1部分：三方存管、银期转账和结售汇业务
期货公司	中国期货监控	双向	交易数据	多对单	
中国期货监控	期货交易场所	单向	交易数据	单对多	
中国结算	香港交联所	单向	交易数据	单对单	
上交所	香港交联所	单向	交易数据	单对单	
中国结算	发行人	单向	交易数据	单对多	JR/T 0163—2018 证券发行人行为信息内容格式
证券公司	期货公司	双向	交易数据	多对多	
期货公司	基金公司	双向	交易数据	多对多	
证券公司	基金公司	双向	交易数据	多对多	
人民银行、外管局、中债登、上清所、大宗商品	证券交易场所	双向	交易数据	多对多	

数据输出方和接受方		数据流方向	业务类别	数据两端单位数量	现有标准
市场、场外市场、黄金交易所、区域产权交易市场					
人民银行、外管局、中债登、上清所、大宗商品市场、场外市场、黄金交易所、区域产权交易市场	期货交易所	双向	交易数据	多对多	
人民银行、外管局、中债登、上清所、大宗商品市场、场外市场、黄金交易所、区域产权交易市场	中介机构	双向	交易数据	多对多	
投资人	中介机构	双向	交易数据	多对多	
中介机构	中国证监会	单向	监管数据	多对单	
证券交易场所、期货交易所	中国证监会	单向	监管数据	多对单	
核心及下属公司	中国证监会	单向	监管数据	多对单	
自律组织	中国证监会	双向	监管数据	多对单	
证券公司	投保基金公司	单向	监管数据	多对单	
中国结算	投保基金公司	单向	监管数据	单对单	
第三方存管银行	投保基金公司	单向	监管数据	多对单	
存管银行	中国期货监控	单向	监管数据	多对单	
期货交易所	中国期货监控	单向	监管数据	多对单	
期货公司	中国期货监控	单向	监管数据	多对单	
期货公司	期货业协会	双向	监管数据	多对单	
中国结算	中国期货监控	单向	监管数据	多对单	

数据输出方和接受方		数据流方向	业务类别	数据两端单位数量	现有标准
服务机构	中国证监会	单向	监管数据	多对单	
基金公司	基金业协会、中证数据	单向	信息披露数据	多对单	
非公众公司	全国股转	单向	信息披露数据	多对单	
上市公司、拟上市公司	上交所、深交所、北交所	单向	信息披露数据	多对多	
服务机构	核心及下属机构	单向	其他数据	多对多	
服务机构	中介机构	单向	其他数据	多对多	
服务机构	发行人	单向	其他数据	多对多	
其他机构	中国证监会	单向	其他数据	多对单	

表 3 信息交换领域在建标准列表

序号	标准名称	层级	类型	牵头单位	状态	
1	证券期货业机构内部接口 资产管理投资交易	行业标准	制定	博时基金	在建	报批
2	证券期货业机构内部接口 资产管理估值核算	行业标准	制定	嘉实基金	在建	报批
3	证券期货业机构内部接口 证券交易	行业标准	制定	国泰君安证券	在建	报批
4	证券期货业机构内部接口 账户管理	行业标准	制定	东方证券	在建	报批
5	证券期货业机构内部接口 资讯数据	行业标准	制定	东方证券	在建	审查
6	场外通用传输接口	行业标准	制定	深证通	在建	报批
7	证券期货业场外业务资金服务接口	行业标准	制定	证券业协会 中证报价	在建	报批
8	证券市场交易结算资金监控数据接口 第 1 部分：证券公司	行业标准	制定	投保基金公司	在建	审查
9	证券市场交易结算资金监控数据接口 第 2 部分：商业银行	行业标准	制定	投保基金公司	在建	审查

序号	标准名称	层级	类型	牵头单位	状态	
10	证券基金经营机构即时通信接口规范	行业标准	制定	机构部、深证通、上交所技术公司	在建	起草

——充分调研需求。以《证券期货业数据分类分级指引》（JR/T 0158-2018）确定的业务分类为主线，开展线上基础调研和线下深度访谈两轮调研工作，了解中证信息技术服务有限公司、深圳证券交易所、上海证券交易所、广发证券股份有限公司、深圳证券通信有限公司等 22 家机构对于不同业务与外部其他机构信息交换过程中标准情况使用、存在的主要问题、下一步标准建设想法，总结形成行业共性标准化需求，纳入重点工作方向。

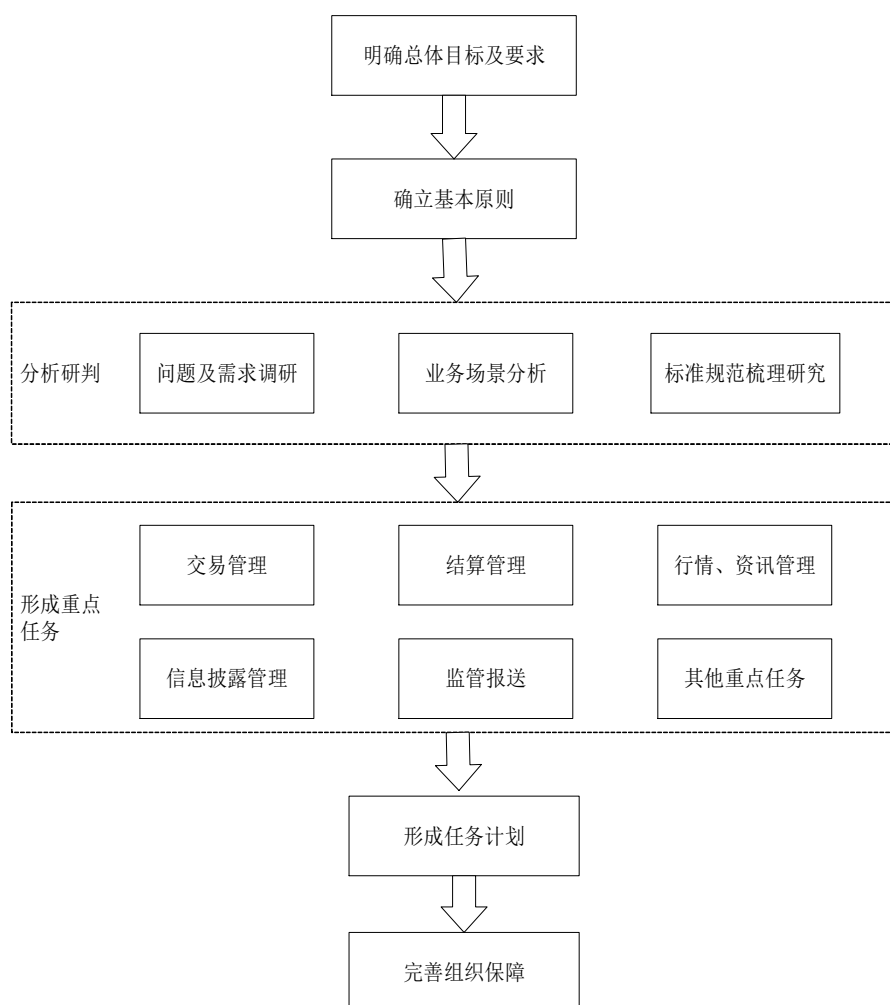


图 2 规划形成过程

5 问题与挑战

根据不同维度的信息交换领域标准化工作现状和行业数据交换需求，可以看到，虽然目前现行国家标准、行业标准已基本满足交易、结算等主要业务的信息交换需求，但是，本领域标准化工作仍存在以下三方面的问题：

一是部分“多对多”市场主体交换的业务场景仍缺少相应标准，例如托管银行和基金公

司，场外市场主体间等的双向交易数据，没有统一的交换标准；二是私募基金、资产托管业务交易结算缺少标准，如下图 3；三是由于现有标准的滞后性以及系统修改成本高等原因，存在标准落地实施不理想的情况。

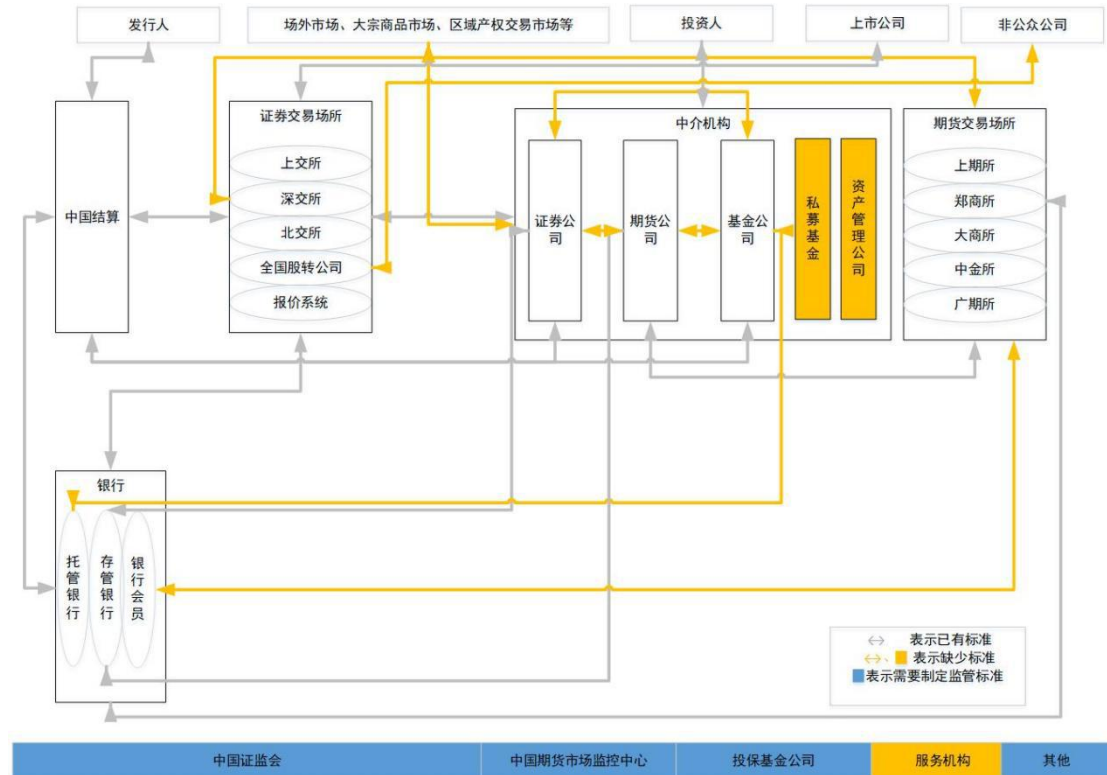


图 3 基于行业顶层数据流的信息交换标准现状与需求示意图

6 重点任务

6.1 交易管理

围绕基金业务等场外交易需求，制定场外数据接口规范。推动现有证券期货业与银行业业务数据交换标准在银行业的有效实施。

专栏 1	交易管理标准化专项
1. 制定场外通用传输接口标准，规范场外数据交换传输接口通信，适用于涉及证券期货行业场外业务的数据传输服务以及应用，可供场外业务数据传输应用参考。	

6.2 结算管理

围绕证券、期货、私募基金等交易管理业务涉及的委托成交、银证转账、银期转账等需求，制定相关数据交换标准。

专栏 2	结算管理标准化专项
1. 制定资产托管业务数据交换协议，规范交易明细单、净值揭示文件等数据内容、格式等，用于证券公司、期货公司之间，证券公司与托管银行间交换报价、对账数据、估值核算等数据。	
2. 制定私募 FOF 基金数据交换协议，规定数据交换协议的体系结构、报文格式、数	

据字典、运作机制等内容。

6.3 行情、资讯管理

针对市场公告、新闻等资讯信息数据结构化程度不高、采集机制缺乏、数据不完整、字段信息及分类不统一，从而影响信息及时获取转化利用的现状，推动制定资讯信息数据采集及接口交换标准。

专栏 3	行情、资讯管理标准化专项
<ol style="list-style-type: none">1. 制定机构间资讯信息数据接口标准，规范资讯信息的数据结构化要求、信息分类、消息结构、会话传输等内容。提高资讯信息获取的准确性、全面性及及时性。2. 制定机构内资讯数据交换标准，规范机构各业务系统之间资讯数据的提供和获取。3. 制定高速行情数据传输标准，满足更加高速的行情获取与高频交易需求。4. 推动非结构化资讯数据处理交换标准制定，提高非结构化数据的快速安全交换效率。	

6.4 信息披露管理

围绕基金公司、非公众公司以及企业上市过程中底稿、过程信息披露的需求，开展制定信息披露过程中的数据交换标准。

专栏 4	信息披露发行标准化专项
<ol style="list-style-type: none">1. 制定基金公司信息披露、非公众公司信息披露数据接口标准。2. 参与修订上市公司信息披露电子化规范标准。	

6.5 监管报送

围绕证券期货业同一监测监控信息向不同监管机构报送需求，推动制定统一数据统计方法、报送报表、数据格式、交换接口等标准。

专栏 5	监管报送标准化专项
<ol style="list-style-type: none">1. 制定交易所市场报送数据接口标准。2. 制定期货保证金监控数据接口标准。3. 制定期货运行监测监控数据接口标准。4. 制定资金监控数据接口标准。5. 制定机构和从业人员信息报送数据交换标准。6. 制定市场预警及统计数据报送数据交换标准。	

6.6 其他

围绕行业内相关机构内部信息交换的共性热点问题，促进由内而外信息畅通交互的可行性，推动制定机构内部信息模块间的交换接口标准。

专栏 6	机构内部标准化专项
<ol style="list-style-type: none">1. 制定证券期货业机构内部接口的资产管理投资交易、资产管理估值核算、证券交易、账户管理、资讯数据接口标准。	

围绕保障投资者利益，保护投资者数据资产的需求，完善证券、期货、基金投资者权益相关数据集中备份接口规范。

专栏 7	投资者权益保护标准化专项
1. 制定证券、期货投资者权益相关数据集中备份数据接口规范。	

围绕行业内基金互认等跨境、跨区域业务需要，推动制定或采用与国际接轨的统一底层通信传输标准。

专栏 8	跨境、跨区域业务标准化专项
1. 制定基金跨境业务数据交换协议。	
2. 制定香港基金业务数据交换标准。	
3. 制定大湾区理财通业务数据交换标准	

7 任务计划

以工作组已开展工作现状为基础，结合行业需求，突出行业应用，确定重点任务需求程度和年度工作规划（见表 4，*越多，代表紧迫度越高，最高 4 颗*）。

表 4 证券期货信息交换标准制修订计划表

序号	体系位置	标准项目	标准编号（如有）	制修订	进展	紧迫程度	时间计划
1	结算 - 基金结算	私募 FOF 底层基金数据传输规范		制定	起草草案	****	2023 年
2	交易 - 场外交易	场外通用传输接口规范		制定	已立项，正在制定	****	2022 年
3	结算 - 资管托管	资产托管业务数据交换协议		制定	未启动	****	2023 年
4	交易 - 基金交易	基金跨境业务数据交换协议		制定	未启动	*	2023 年
5	交易 - 基金交易	香港基金业务数据交换标准		制定	未启动	*	2023 年
6	交易 - 其他	大湾区理财通业务数据交换标准		制定	未启动	*	2023 年
7	行情资讯 - 资讯	资讯信息数据处理接口规范		制定	未启动	***	2023 年
8	行情资讯 - 证券行情 / 期货行情	高速行情数据传输标准		制定	未启动	**	2023 年
9	行情资讯 - 资讯	非结构化资讯数据处理交换标准		制定	未启动	*	2025 年
10	信息披露 - 基金公	基金公司信息披露数据接口规范		制定	未启动	***	2024 年

序号	体系位置	标准项目	标准编号（如有）	制修订	进展	紧迫程度	时间计划
	司						
11	信息披露-非公众公司	非公众公司信息披露数据接口规范		制定	未启动	***	2024年
12	信息披露-上市公司	上市公司信息披露电子化规范	JR/T 0021-2004	修订	未启动	***	2024年
13	监管报送-交易所报送	交易所市场报送数据接口标准		制定	未启动	*	2025年
14	监管报送-期货保证金监控	期货保证金监控数据接口标准		制定	未启动	*	2025年
15	监管报送-其他	期货运行监测监控数据接口标准		制定	未启动	*	2025年
16	监管报送-资金监控	资金监控数据接口标准		制定	未启动	*	2025年
17	监管报送-其他	机构和从业人员信息报送数据交换标准		制定	未启动	*	2025年
18	监管报送-市场预警及统计	市场预警及统计数据报送数据交换标准		制定	未启动	*	2025年
19	监管报送-资金监控	证券市场交易结算资金监控数据接口 第1部分：证券公司		制定	已立项，正在制定	***	2022年
20	监管报送-资金监控	证券市场交易结算资金监控数据接口 第2部分：商业银行		制定	已立项，正在制定	***	2022年
21	业务类别-其他	证券期货业机构内部接口 资产管理投资交易		制定	已立项，正在制定	***	2022年
22	业务类别-其他	证券期货业机构内部接口 资产管理估值核算		制定	已立项，正在制定	***	2022年
23	交易-证券交易	证券期货业机构内部接口 证券交		制定	已立项，正在制定	***	2022年

序号	体系位置	标准项目	标准编号（如有）	制修订	进展	紧迫程度	时间计划
		易					
24	业务类别-其他	证券期货业机构内部接口 账户管理		制定	已立项，正在制定	***	2022年
25	行情资讯-资讯	证券期货业机构内部接口 资讯数据		制定	已立项，正在制定	***	2022年
26	业务类别-其他	证券业投资者权益相关数据集中备份数据接口规范		制定	未启动	*	2024年
27	业务类别-其他	期货业投资者权益相关数据集中备份数据接口规范		制定	未启动	*	2024年

8 标准实施保障

更好借鉴其他行业发展实践，积极倡导建立行业内多方共建共享共治的信息交换统一平台，推动标准在平台建设中的有效应用。探索建立信息交换领域标准实施情况统计和标准一致性评价制度，追踪相关方使用标准情况，及时修订完善标准，试行接口设计和标准要求一致性检测评价认证，保障标准的有效实施。

9 规划组织保障

9.1 推进协同合作

建立由证券分技术委员会指导，信息交换工作组组织实施，各有关单位参与的标准化建设规划推进机制。各单位应加强沟通、统一思想、积极参与相关工作。建立信息交换工作组与证券分技术委员会其他工作组协调机制，加强与金融技术委员会其他分技术委员会相关工作组的交流协同，推动大金融行业信息交换标准化。

9.2 加强能力建设

向证券行业内有关单位宣传标准化建设目的意义，组织开展标准化专业培训活动，树立各单位管理层的标准化意识，提高技术人员的标准化能力，实现利用标准让行业知识能够显性化、体系化来降低行业知识门槛，从而显著推动行业治理工作的开展。

9.3 完善物资配备

加强对信息交换标准化建设工作的经费投入力度,证券分技术委员会和信息交换工作组有关单位应设置标准化专项资金。鼓励发挥市场机制作用,带动多方投入,为标准化工作提供资金保障。