

证券期货业数据标准规划 (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、中证数据有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所、中证信息技术服务有限责任公司、上证所信息网络有限公司、财通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中融基金管理有限公司、国泰君安期货有限公司、恒生电子股份有限公司、恒生聚源数据服务有限公司、华锐金融科技研究所、上海大智慧财汇数据科技有限公司、深圳市金证科技股份有限公司、金证财富南京科技有限公司、港融科技有限公司、上海金仕达软件科技有限公司、阿里云研究院

规划起草人员：

姚前、蒋东兴、汪洵、周云晖、路一、侯智杰、柏小虎、周婵、汪萌、张春艳、王婷、朱旭、敖雯、吴贤、谷博、李小明、周惠东、吕凯峰、马丽霞、黎峰、万晓鹰、朱仲春、梅晓访、郝健、曹雷、郭东坡、崔健、吴征、冯春平、杜旭、段健、任妍

目 录

1	总体目标	1
2	总体要求	1
3	基本原则	1
4	规划设计方法	1
5	问题与挑战	8
6	重点任务	8
6.1	数据元标准	8
6.2	监管数据报送	26
6.3	数据标准及治理领域研究	27
7	任务计划	28
8	实施保障	29
9	组织保障	30
9.1	推进协同合作	28
9.2	加强能力建设	30
9.3	完善物资配备	30

为加快推进证券期货行业数字化转型，为监管部门和行业机构提供基础标准支撑，提升监管报送、系统建设、数据应用等标准化和规范化水平，促进机构间数据交换、数据共享、数据互操作等工作效率的提升，强化机构内部数据设计、开发及应用的规范化，夯实监管系统数据基础、强化数据底座建设，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，以组织制定证券期货业基础类数据、监管数据等标准并推动标准应用落地为主要目标，为监管部门和行业机构提供基础标准支撑，促进标准应用，提升监管报送、系统建设、数据应用等标准化和规范化水平，同时以数据标准为抓手开展重点问题研究，会同相关工作组共同推进行业数据治理工作。

2 总体要求

本规划遵从国家相关法律法规标准要求，适用于指导证券期货业数据标准领域标准的制定与应用工作。

证券期货业数据标准领域标准的制定过程中，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，有计划地推进相关标准制定与应用工作。

3 基本原则

——结合实际，统筹设计。基于行业数据应用实际情况，对行业当前数据标准相关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进行分析，确定数据标准领域工作的开展方向，设计行业数据标准体系，同步开展相关研究工作，推动产出高质量标准成果。

——合理划分，科学归类。根据不同市场参与主体、业务条线、数据应用的特点，制订科学的标准框架，明确业务领域划分原则，选取合理的数据主题域，建立各领域数据标准的关联关系，确定清晰、明确的数据标准归属类别和业务条线。

——聚焦需求，突出重点。以行业监管机构、核心机构、经营机构的实际需求为主要依据，聚焦各机构数据标准应用面临的问题，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。

——明确定位，面向应用。充分考虑数据标准落地应用的可行性，合理设计标准应用场景、推广策略及实施路径。根据不同业务领域数据应用特点制定相应的标准落地策略，确保制定的数据标准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

——结合国家标准及行业实际，研究制订数据标准体系。根据 GB/T 18391《信息技术 元数据注册系统（MDR）》（采自 ISO/IEC 11179 系列标准）定义，数据元是数据标准的重要基础组成，即数据标准的基本单元，在各行业得到了广泛应用。但截止目前，证券期货业尚没有适用于本行业的数据元标准，无法满足行业标准化工作的需要。因此本规划选择以数据元标准作为切入点开展规划制订工作，并首先初步构建了证券期货业数据元标准体系（如图

1 所示)。数据元标准体系包括基础数据元标准以及监管、交易所、中介机构、服务机构、发行人等业务域标准。

图 1 证券期货业数据元标准体系

基础数据元	公共信息										
	主体	品种	财务	账户	监管	披露	协议	资产	行为		
监管业务域	政务服务										
	法规诚信			政务信息			投资者保护				
	法律法规库	自律规则库	诚信数据库	政务信息发布		政务办事服务	投诉举报	信访管理	投资者保护服务		
	市场监管		公司监管		机构监管		功能监管		行为监管		
	市场运行监测		全周期监管		机构非现场检查		服务机构统一备案		非法经营证券		
	市场风险监测		公司评价分析		机构审批备案				非法交易行为		
	市场违规监测		公司分类监管		机构分类监管		服务机构执业监管		非法发行 非法活动		
	风险发现与预警										
	风险监测			风险预警			风险分析		风险评估		
	交易所业务域	稽查处罚									
稽查案管					处罚诉讼						
线索管理		初步调查	立案调查	执法措施	移交移送	立案结案通知	行政处罚	行政复议	行政诉讼	行政和解	
证券交易所		北交所	上交所	深交所	期货交易所	大商所 郑商所	上期所 中金所	广期所			
中介机构业务域	证券公司自身业务					基金公司自身业务				期货公司自身业务	
	经纪业务	信用业务	资管业务	柜台业务	托管业务	证券研究	自营业务	私募投资基金	另类投资业务	做市业务	固定收益
服务机构业务域	监管报送业务					报送证监会	交易所	中国结算	协会	投保公司	
	资讯服务商	宏观数据	行业数据	资本市场数据	货币及外汇市场	新闻公告简报	会计师事务所 律师事务所	资产评估机构 资信评级机构	信息技术服务商 基金托管机构		
发行人业务域	拟上市公司		上市公司		非公众公司		基金发行人		债券发行人		

——**梳理各领域标准现状，分别开展规划设计。**根据数据元标准体系，分别对基础数据元及各业务域数据标准现状及应用情况进行分析，开展具体领域数据元标准设计，包括明确数据主题或业务条线划分、明确数据归类、确定具体梳理方法等。以证券公司、基金公司、期货公司等行业经营机构为例，首先梳理已发布的相关数据标准，标识出覆盖到的数据主题、业务条线等，分别形成证券公司、基金公司、期货公司数据业务二维框架图（如表 1-3 所示），再开展业务条线划分、数据归集、梳理方法设计等工作。

表 1 证券公司数据业务二维框架图

数据域划分 (证券公司 逻辑模型 √)	数据分类				证券公司业务线												
	《数据分类分级指引》①	《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式第1部分：证券》②	《证券市场交易结算资金监控数据接口第1部分：证券公司》报批稿③	监管报送-《证券投资基金经营机构资产管理业务数据报送接口规范》④	经纪业务	信用业务	资管业务	柜台业务	证券研究	托管业务	合格境外投资者业务	固定收益业务	做市业务	投资银行业务	另类投资业务	私募投资基金业务	自营业务
主体	个人投资者基本信息 机构投资者基本信息 投资者衍生信息 投资者信用信息 服务机构信息		客户基本信息	销售-客户情况	√ ① ③	√ ① ③	√ ① ④	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①		√ ①	√ ①	√ ①	④	√ ①
账户	投资者开户/账户信息 银行账务信息		客户资金账户信息 客户资金账户与证券账户对应信息 客户存管账户信息	销售-账户汇总	√ ① ③	√ ① ③	√ ① ④				√ ①					④	√ ①
品种	产品信息 其他产品信息 行情数据-普通行情数据			产品-产品基本信息 产品-下属产品基本信息 产品-产品募集信息 产品-下属产品募集信息 产品-产品成立信息 产品-下属产品成立信息 产品-产品运行信息 产品-下属产品运行信息 产品-产品投资比例限制 产品-产品净值信息 产品-产品收益分配信息 风控-涉诉情况	√ ①	√ ①	√ ① ④	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①		√ ①	√ ①	√ ①	④	√ ①
行为	成交信息 委托信息 资金划转信息 交易业务参数信息 交易日志信息-注册登记日志 投资者合约合同信息 交易日志信息-信息变更 投资者衍生信息 客户服务信息		客户资金结算明细 客户结息金额明细 客户资金存取明细 客户账户类交易明细 证券公司资金应收应付汇总 客户资金账户综合支付结算明细 客户衍生品资金变动明细 客户信用资金变动明细 客户场外业务资金结算明细	销售-交易汇总 销售-净申购赎回1亿或超基金资产净值10%客户 投资-标准化资管产品投资明细 投资-场内期权投资明细 投资-场外互换投资明细 投资-场外期权投资明细 投资-场外远期投资明细 投资-定期存款投资明细 投资-股票投资明细	√ ① ③	√ ① ③	√ ① ④		√ ①	√ ①	√ ①		√ ①	√ ①	√ ①	④	√ ①
资产	资金状况信息 持仓信息	经纪业务数据-投资者资金余额数据 经纪业务数据-投资者证券余额数据 经纪业务数据-投资者限售股余额数据 信用业务数据-投资者两融资金余额数据 信用业务数据-投资者两融证券余额数据 信用业务数据-投资者两融合约负债数据 信用业务数据-投资者两融资产负债数据 信用业务数据-投资者融券权益补偿数据 衍生品业务数据-投资者期权资金余额数据 衍生品业务数据-投资者期权持仓数据	客户证券市值 客户负债 客户资金余额对账	销售-份额汇总 销售-产品最终投资者 销售-产品关系人购买情况 销售-前200大投资者 销售-投资者年龄结构 销售-投资者份额结构 投资-资产组合 投资-产品的最终投向 投资-产品多层嵌套投资 投资-按区域分类的房地产投资组合 投资-按投向分类的非标投资组合	√ ① ② ③	√ ① ② ③	√ ① ④	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①		√ ①	√ ①	√ ①	④	√ ①
协议	合约信息 投资者合约合同信息	信用业务数据-投资者股票质押合同数据 信用业务数据-投资者约定购回合同数据 信用业务数据-投资者债券质押式回购合同数据 信用业务数据-投资者两融合同数据			√ ①	√ ① ②	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①
渠道	渠道信息				√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①	√ ①		√ ①	√ ①	√ ①		√ ①
营销	客户服务信息 市场营销推广信息 客户经营分析 客户关系信息 服务人员信息				√ ①	√ ①			√ ①	√ ①			√ ①	√ ①			

表 2 基金公司数据业务二维框架图

数据域划分 (基金公司 逻辑模型 √)	数据分类				基金公司业务线									
	《数据分类分级指引》①	《证券期货业投资者权益相关数据的 内容和格式第3部分：基金》②	监管报送-《证券投资基金机构资产管理 业务数据报送接口规范》③	监管报送-《公募基金管理人及相 关子公司数据报送接口规范》④	产品创设	基金募集	投资管理	基金销售	基金运营	产品清算	信息披露	特殊业务	基金托管	基金市场服务
主体	机构投资者基本信息 个人投资者基本信息 投资者衍生信息 人员信息（非公开） 服务机构信息		产品-基金经理信息 销售-客户情况	机构-公司基本信息 机构-公司分支机构信息 机构-公司股东信息 机构-公司实际控制人信息 机构-公司持牌业务信息 机构-公司证照信息 机构-公司人员情况 机构-数据报送人员	√ ①	√ ①	√ ①	√ ① ③	√ ① ③ ④		√ ①	√ ①	√ ①	√ ①
账户	投资者开户/账户信息 银行账户信息	投资者账户数据	销售-账户汇总			√ ① ②	√ ①	√ ① ② ③	√ ①		√ ①	√ ①	√ ①	√ ①
品种	产品信息 基金净值 基金投资组合信息 运行管理	基金行情数据 基金分红数据	产品-产品基本信息 产品-下属产品基本信息 产品-产品募集信息 产品-下属产品募集信息 产品-产品成立信息 产品-下属产品成立信息 产品-产品运行信息 产品-下属产品运行信息 产品-产品投资比例限制 产品-产品净值信息 产品-产品收益分配信息 风控-涉诉情况	互认-香港互认基金信息	√ ① ③	√ ① ③	√ ①	√ ① ② ③ ④	√ ① ② ③ ④		√ ① ②	√ ①	√ ①	√ ①
行为	基金投资成交信息 基金投资委托信息 客户服务信息 企业经营数据 投资者交易信息	投资者权益相关的交易类确认数据	销售-交易汇总 销售-净申购超1亿或超基金资产净值10%客 户 投资-标准化资管产品投资明细 投资-场内期权投资明细 投资-场外互换投资明细 投资-场外期权投资明细 投资-场外远期投资明细 投资-定期存款投资明细	投资-固有资金交易明细	√	√ ① ② ③	√ ①	√ ① ② ③ ④	√ ① ③ ④	√	√	√	√ ①	√ ①
资产	持仓信息 客户经营分析	份额对账数据	销售-份额汇总 销售-产品最终投资者 销售-产品关系人购买情况 销售-前200大投资者 销售-投资者年龄结构 销售-投资者份额结构 投资-资产组合 投资-产品的最终投向 投资-产品多层嵌套投资 投资-按区域分类的房地产投资组合 投资-按投向分类的非标投资组合 投资-按土地使用性质分类的房地产投资组 合	风险准备金投资明细 固有资金投资明细		√ ①	√ ①	√ ① ② ③	√ ① ③ ④		√ ①	√ ①		√ ①
协议	合同信息				√ ①	√ ①	√	√ ①	√ ①		√	√ ①	√ ①	√ ①
渠道	渠道信息					√ ①		√ ①	√ ①		√ ①			√ ①
营销	客户服务信息 客户关系信息 市场营销推广信息							√ ①	√ ①					

表 3 期货公司数据业务二维框架图

数据域划分 (期货公司逻辑模型 ✓)	数据分类					期货公司业务线				
	《数据分类分级指引》①	《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式第2部分：期货》②	《期货公司柜台系统数据接口规范》③	《期货市场客户开户数据接口》④	《期货保证金监控系统数据报送接口（期货公司）》⑤	期货（期权）经纪业务	资产管理业务	投资咨询业务	产品销售业务 (基金代销)	风险管理子 公司业务
主体	监管报送-监管信息 投资者管理-投资者基本信息 投资者管理-投资者鉴别信息 综合管理-人力数据	投资者基本资料数据	客户信息	个人客户数据 一般单位客户数据 特殊单位客户数据 资产管理客户数据 参考证件数据 企业经营范围数据	客户基本资料文件	✓ ① ② ③ ④ ⑤	✓ ④ ⑤	✓	✓	
账户	合规风控-合规类信息 结算管理-银行账户信息 投资者管理-投资者开户/账户信息	投资者编码数据 投资者结算账户数据	客户交易编码及资金账户	银行账户数据 期货账户对应现货账户数据	客户编码文件 客户结算账户文件 单一客户综合类资产管理业务投资账户文件 资产管理业务托管账户和资管结算账户文件	✓ ① ② ③ ④ ⑤	✓ ④ ⑤		✓	
品种	产品管理-产品信息 产品管理-期货合约信息 产品管理-其他产品信息 行情、资讯-行情数据 行情、资讯-资讯信息		合约信息 行情信息			✓ ① ③	✓		✓	
行为	合规风控-合规类信息 合规风控-风控类信息 交易管理-成交信息 交易管理-委托信息 交易管理-银期转账 交易管理-交易业务参数信息 交易管理-交易日志信息 结算管理-交割信息 结算管理-资金划转信息	待交割数据 交割数据 货币充抵明细数据 非货币充抵明细数据	委托信息 成交信息		客户出入金记录文件 期货成交明细文件 客户其它分项资金数据文件 其它需要说明的信息或数据文件 期货平仓明细文件 非货币充抵明细文件 期货交割明细文件 期货待交割结算合约文件 汇兑明细文件 货币充抵资金文件 期权成交明细文件 期权行权明细文件 期权平仓明细文件 客户证券现货成交明细文件	✓ ① ② ③ ⑤	✓ ⑤	✓	✓	
资产	结算管理-持仓信息 结算管理-资金状况信息 结算管理-仓单信息 结算管理-投资者质押	投资者期货持仓数据 投资者期权持仓数据 投资者现货持仓数据 投资者期货期权账户资金数据 投资者现货账户资金数据 投资者其他分项资金数据	交易编码昨持仓 交易编码昨持仓明细		客户期货期权账户基本资金数据文件 期货持仓数据文件 期货持仓明细文件 资产管理非本公司经纪业务资金数据文件 资产管理非本公司经纪业务资金明细文件 期权持仓数据文件 期权持仓明细文件 客户证券现货资金文件	✓ ① ② ③ ⑤	✓ ⑤		✓	
协议	投资者管理-投资者合同信息					✓ ①	✓	✓	✓	
渠道	营销服务-渠道信息					✓ ①				
营销	营销服务-客户关系信息 营销服务-客户服务信息 营销服务-客户经营分析 营销服务-市场营销推广信息 营销服务-服务机构信息 营销服务-服务人员信息					✓ ①			✓	

——评估行业现状，选取数据标准关键应用场景。经初步调研行业机构数据标准应用需求及重点难点问题，结合行业监管机构关注热点及工作要求，选取机构监管数据报送作为数据标准应用的关键场景，重点推进该应用场景下相关数据标准的研究、编制及落地工作（见图 2 及表 4-6）。

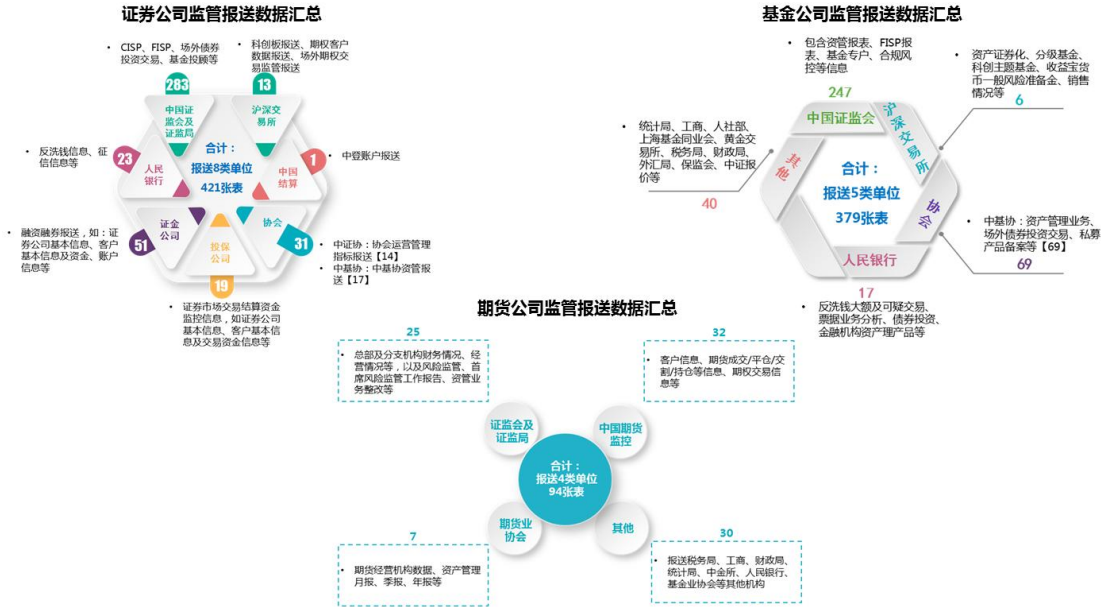


图 2 证券公司、基金公司、期货公司监管报送数据汇总

对外接口名称	对外接口类别	接收方名称	表编码	表中文名称	涉及表情况	表详细定义	交互依据
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A01	证券公司基本信息文件	T_SIFF_A01	报送数据为证券公司基本信息	《1. 监控系统证券公司接口规范（V1.8.2）.doc》
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A02	证券公司营业部信息文件	T_SIFF_A02	报送数据为证券公司营业部信息	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A03	证券公司存管银行信息文件	T_SIFF_A03	报送数据为证券公司客户资金存管银行（含三方存管银行）信息	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A04	客户基本信息文件	T_SIFF_A04_Q1	报送数据为客户基本信息	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A05	客户资金账户信息文件	T_SIFF_A05_Q1	报送数据为客户资金账户信息	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A06	客户资金账户与证券账户对应信息文件	T_SIFF_A06_Q1	报送数据为客户资金账户与证券账户之间对应关系信息	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A07	客户存管账户信息文件	T_SIFF_A07_Q1	报送数据为三方存管情况下的客户账户信息	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A08	客户资金结算明细文件	T_SIFF_A08	报送数据为客户一般资金账户的结算明细，不含客户一般资金账户参与场外市场交易的结算数据	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A09	客户资金余额明细文件	T_SIFF_A09	报送数据为客户一般资金账户的资金余额明细	
证券市场交易结算资金监控系统证券公司接口规范	报送类	中国证券投资者保护基金有限责任公司	A10	客户资金存取明细文件	T_SIFF_A10	报送数据为客户一般资金账户的资金存取明细	
证金融资融券报送	报送类	中国证券金融股份有限公司	B01	证券公司-基本资料	T_CSFC_B01	申报证券公司机构编码及名称	《中国证券金融股份有限公司融资融券统计监测系统接口规范（证券公司）（V1.0）.pdf》
证金融资融券报送	报送类	中国证券金融股份有限公司	B02	证券公司-账户代码	T_CSFC_B02	申报证券公司参与融资融券业务所涉及的有关代码、资金账户及证券账户	
证金融资融券报送	报送类	中国证券金融股份有限公司	B03	证券公司-证券账户余额	T_CSFC_B03	申报证券公司各账户下的股票余额，包括所有已经属于该账户但未到期的证券余额	
证金融资融券报送	报送类	中国证券金融股份有限公司	B04	证券公司-资金账户余额	T_CSFC_B04	申报证券公司各账户下的资金余额，包括从证券公司融资融券借入的资金	
证金融资融券报送	报送类	中国证券金融股份有限公司	B05	证券公司-标的证券与可充抵保证金证券折算率	T_CSFC_B05	主要申报当日证券公司标的证券、可充抵保证金证券名单及折算率、保证金比例等参数	
上交所报送	报送类	上海证券交易所		期权市场参与数据报送接口	T_OPT_C7B5	期权客户的沪市账户资料、保证金金额、资金划入划出金额、合约市值、证券市值、资金余额等。	《TS113 上海证券交易所期权全真模拟交易系统市场参与数据接口规范说明书1.084版本（草稿、修订）.doc》
人行反洗钱报送	报送类	中国人民银行		营业部与批次号对应关系表	tb_chk_total_log		《证券期货业大额交易和可疑交易数据报送接口规范（2008修订）.doc》

表 4 证券公司监管报送表清单示例

对外接口名称	对外接口类别	接收方名称	涉及表情况				交互依据
			表编码	表中文名称	表英文名称	表详细定义	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.1	公司基本信息		用途：报送基金（子）公司的基本信息。需求方字段：机构监管（全部字段）。	公募基金管理人及相关子公司数据报送接口规范（试行）.xls 公募基金管理人及相关子公司数据报送接口规范（试行）.doc 接口文件传输工具操作说明.doc
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.2	公司分支机构信息		用途：报送基金（子）公司的分支机构（分公司、办事处）的信息。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.3	公司股东信息		用途：报送基金（子）公司的股东信息。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.4	公司实际控制人信息		用途：报送基金公司的实际控制人信息。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.5	公司持续业务信息		用途：报送基金（子）公司及其分支机构的持续业务信息。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.6	公司证照信息		用途：报送基金（子）公司及其分支机构的营业执照、各种业务许可证。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.7	公司人员情况		用途：报送基金（子）公司签订劳动合同的人员情况。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
公募基金管理人及相关子公司数据报送	报送类	中国证券监督管理委员会	3.2.1.8	数据报送人员		用途：报送基金（子）公司与数据报送工作相关的主要人员信息。需求方字段：机构监管（全部字段）。	
开放式基金业务数据交换协议-最新	报送类	中国结算	表5	账户信息数据	开户申请(001)，账户信息修改申请(003)		开放式基金业务数据交换协议-最新.doc
开放式基金业务数据交换协议-最新	报送类	中国结算	表6	开户确认数据	开户确认(101)		
开放式基金业务数据交换协议-最新	报送类	中国结算	表7	销户/撤销交易账户申请数据	销户申请(002)，撤销交易账户申请(009)		
开放式基金业务数据交换协议-最新	报送类	中国结算	表8	账户确认数据	销户确认(102)，账户信息修改确认(103)，基金账户冻结确认(104)，基金账户解冻确认(105)		
开放式基金业务数据交换协议-最新	报送类	中国结算	表9	基金账户冻结申请数据	基金账户冻结申请(004)		
开放式基金业务数据交换协议-最新	报送类	中国结算	表10	账户解冻/账户卡解挂申请数据	基金账户解冻申请(005)，基金账户卡解挂申请(007)		
场外债券投资交易监测报送	报送类	基金业协会		债券回购杠杆超限表			表10-债券回购杠杆超限表.xlsx
场外债券投资交易监测报送	报送类	基金业协会		债券投资交易杠杆报告表			表11-债券投资交易杠杆报告表.xlsx

表 5 基金公司监管报送表清单示例

对外接口名称	对外接口类别	接收方名称	涉及表情况				交互依据
			表编码	表中文名称	表英文名称	表详细定义	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		客户基本资料文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		客户编码文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		客户结算账户文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		客户期货期权账户基本资金数据文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		客户出入金记录文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		期货成交明细文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		期货持仓数据文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		其它分期货主数据文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		其它需要说明的信息或数据文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		期货平仓明细文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		期货持仓明细文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		非货币充抵明细文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		期货交割明细文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		期货持仓交割结算单文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		汇兑明细文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
期货保证金监控系统数据报送接口	报送类	期货市场监控中心		货币充抵资金文件		期货保证金监控系统数据报送接口.pdf	
穿透式监管	报送类	期货市场监控中心		交易设备及软件信息	报的是后端交易的实际IP	期货公司客户交易终端信息采集及接入认证技术规范.pdf	
期货经营机构数据	报送类	中国期货业协会		期货经营情况报表		V1_期货经营机构数据导入模板-据期货协会.xls	
总部及分支机构综合监管报表	报送类	证监会		总部及分支机构财务情况		13总部及分支机构综合监管报表（1904） - 报证监会.xls	
总部及分支机构综合监管报表	报送类	证监会		总部及分支机构经营情况		13总部及分支机构综合监管报表（1904） - 报证监会.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS加总客户账户资金余额报表-个人账户信息		附表1：CRS加总客户账户资金余额报表（模板）.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS加总客户账户资金余额报表-机构账户信息		附表2：CRS加总客户账户资金余额报表（模板）.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS动态监控客户信息报表-个人账户信息		附表2：CRS动态监控客户信息报表（模板）.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS动态监控客户信息报表-机构账户信息		附表2：CRS动态监控客户信息报表（模板）.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS非居民尽调信息报表-个人账户信息		附表3：CRS非居民尽调信息报表（模板）.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS非居民尽调信息报表-机构账户信息		附表3：CRS非居民尽调信息报表（模板）.xls	
CRS	报送类	税务局		CRS非居民尽调信息报表-消极非金融机构		附表3：CRS非居民尽调信息报表（模板）.xls	

表 6 期货公司监管报送表清单示例

5 问题与挑战

建立一套适用证券期货行业，具有基础性、通用性特征的数据标准，主要面临以下四个方面的问题与挑战：

一是各机构数据治理程度参差不齐，给数据梳理工作带来挑战。以基金公司为例，目前部分产品的业务流程尚处于手工阶段，缺乏统一的数据规范；信息系统较为单一，数据孤岛情况严重，且重要信息系统存在接口不开放及版本不一、数据接口繁杂等情况，数据梳理较为困难。因此应从业务梳理入手，首先确定业务域范围并形成业务条线划分，再基于业务流程梳理、分析和阐明各业务流程中生产、存储、交换的核心业务数据。

二是各类机构业务繁冗复杂，数据标准梳理面临多源数据整合的挑战。以证券公司为例，由于业务多样，对应业务系统数量较多，产生的数据量大，同时随着金融市场的创新不断，新业务不断涌现，业务复杂性不断增加，对多业务条线多数据源的整合都带来很大挑战。因此应分业务条线分步实施，首先选取具有公共性、通用性并满足监管要求的数据纳入数据标准范围，再不断迭代更新。

三是数据标准的应用推广具有较大难度。由于历史原因，各家机构均存在大量的遗留系统，数据标准的落地应用有可能造成改造、适配等风险。因此应以场景应用带动数据标准的应用，选取市场关注度高、行业亟需、满足监管要求的应用场景开展重点研究和落地验证，从而进一步推动数据标准在行业内的广泛应用。

四是数据标准的更新完善机制需要长远考虑。随着业务发展、技术更新和市场变化，如何做好数据标准后续的更新维护工作，并确保基础数据标准与各业务域数据标准的有效衔接成为需要关注的重要问题之一。因此要结合实际应用情况，逐步建立有效的标准维护长效机制，对数据标准的各属性定义持续修订完善，不断回溯补充、更新验证，从而确保数据标准内容完整性和准确性。

6 重点任务

6.1 数据元标准

数据元标准编制遵循以下六个原则：**唯一性原则**，即数据标准的命名、定义等内容应具有唯一性和排他性，不允许同一层次下标准内容出现二义性。**通用性原则**，即对数据标准的定义需考虑数据的通用性，形成一套具有通用性特点的、满足各业务需要的行业数据标准。**前瞻性原则**，即借鉴相关国际标准、国家标准、行业标准和规范，并充分参考同业的先进实践经验，使数据标准能够充分体现业务的发展方向，满足一定的前瞻性。**可扩展性原则**，即可基于各类创新业务以及监管的差异性进行相应的扩展。**稳定性原则**，即应在特定范围和时间区间内尽量保持其稳定性。**可行性原则**，即充分考虑业务改造风险和技术实施风险，并能够指导各企业数据标准在业务、技术、操作、流程、应用等层面的落地工作。

6.1.1 基础数据元标准

6.1.1.1 数据主题分类

基础数据元规范包含基础数据元和基础代码，两者采用相同的数据元分类。基础数据元规范分类主要按照数据元所属主题进行分类，包括主体、品种、账户、财务、协议、行为、资产、披露和监管9大主题。每个主题再基于所涉及的业务和数据进行细分，逐层递进地划分出数据元的二级分类，确保每一个数据有唯一的主题归属。数据主题及二级分类详见图3。

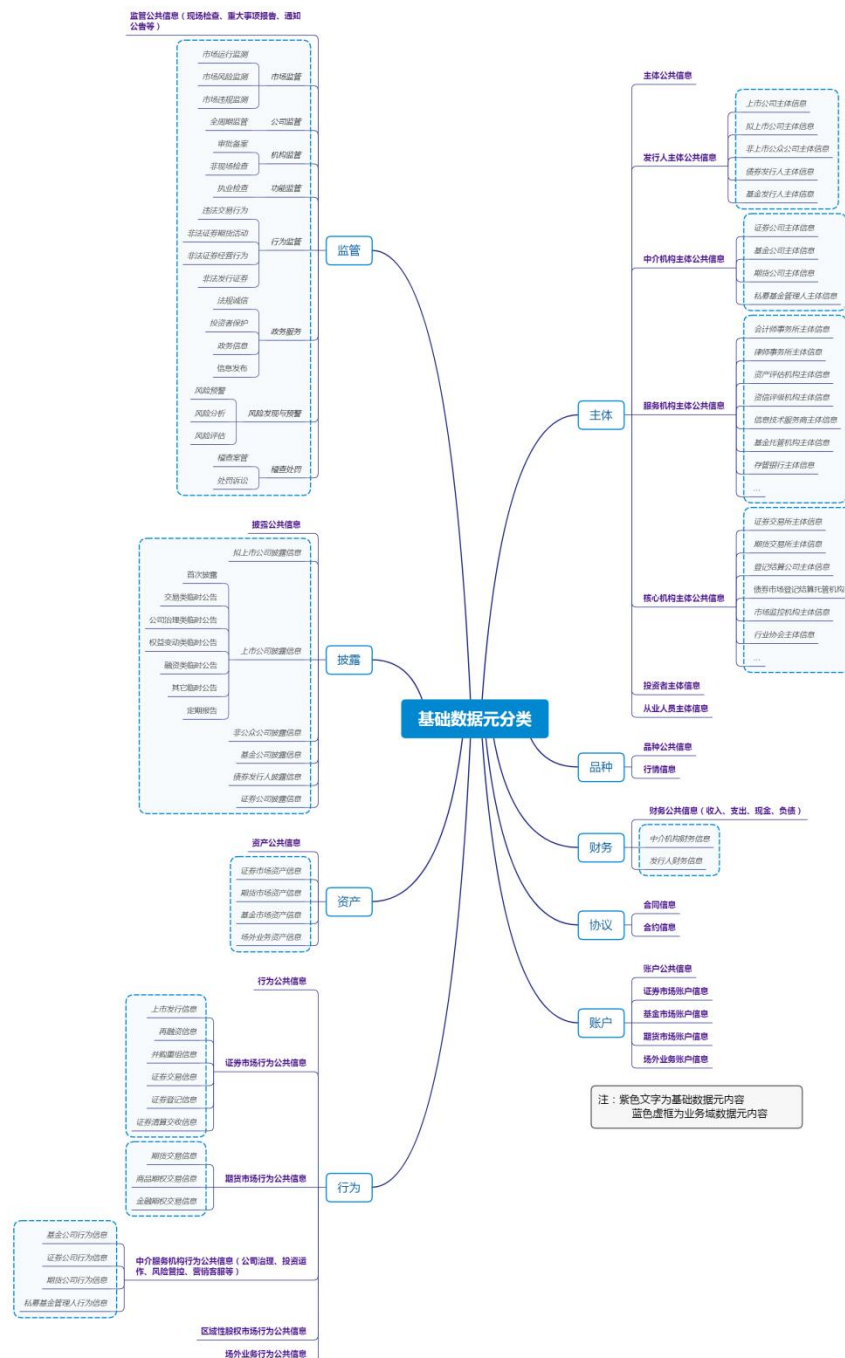


图 3 基础数据元分类

6.1.1.2 与业务域数据元关系

不同的业务可根据不同需求对基础数据元进行必要的扩展，即通过对这些数据元中的对象类词、特性词或表示词加限定词，形成特性化的新的业务域数据元。扩展后的数据元在业务定义、数据类型及长度、值域等属性上应具有严格的继承关系，不应与基础数据元出现不一致或矛盾现象。基础数据元与业务域数据元之间的关系示如图4所示：

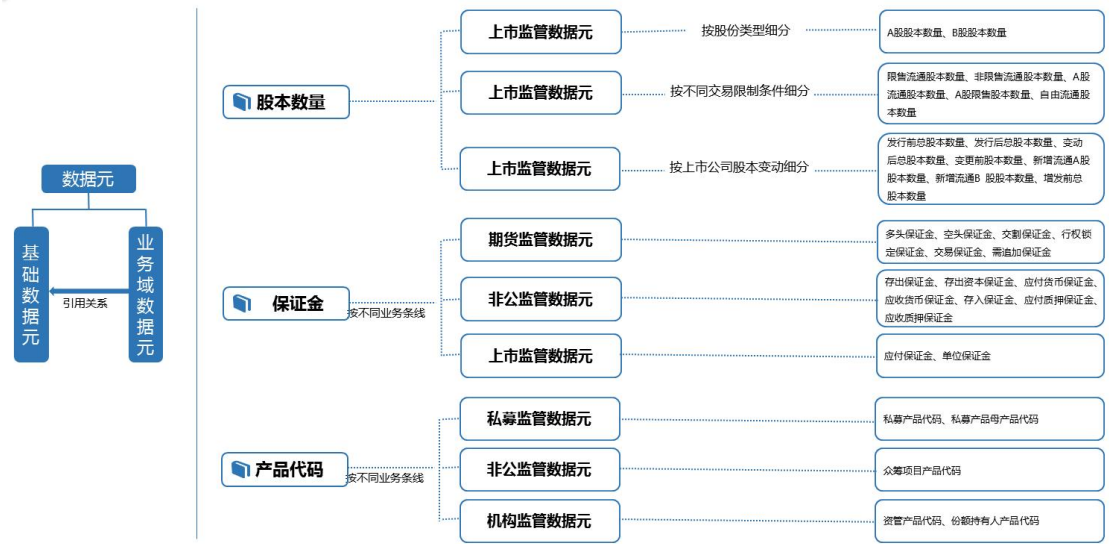


图 4 基础数据元与业务域数据元之间的关系示例

6.1.1.2 梳理方法

- 基础数据元的梳理，采用以下步骤进行筛选、提取与定义：
- 筛选被引用项并去重，基于行业标准前期梳理成果，筛选被引用项；
 - 人工剔除非基础数据元部分，剔除带有业务场景的数据元，例如：基金留存总资产→基金留存现金类总资产；
 - 引用已有基础数据元或定义新的被引用项，对于基础数据元暂未包含的部分，自行提取相关核心词形成被引用项；
 - 基于各业务域中新增的被引用项，经过整合、标准化形成新的基础数据元，补充到基础数据元集合。
- 基础代码的梳理，采用以下步骤进行筛选、提取与定义：
- 依据基础数据元，筛选代码类被引用项并去重；
 - 用已有基础代码或定义新的被引用代码，对于基础代码暂未包含的部分，自行提取相关核心词形成被引用项；
 - 基于各业务域中新增的被引用代码，经过整合、标准化形成新的基础代码，补充到基础代码集合。

6.1.2 证券公司业务域数据元

6.1.2.1 业务条线划分

证券公司业务域数据元标准基于数据元标准“总一分”逐层递进的梳理原则，参考《证券期货业业务标准设计方案》，将证券业务划分为经纪业务、信用业务、资产管理业务、柜台业务、证券研究、托管业务、合格境外投资者业务、自营业务、私募投资基金业务、另类投资业务、投资银行、固定收益业务、新三板做市业务等十三个一级业务分类，形成合理的业务域分类体系（详见图5）。

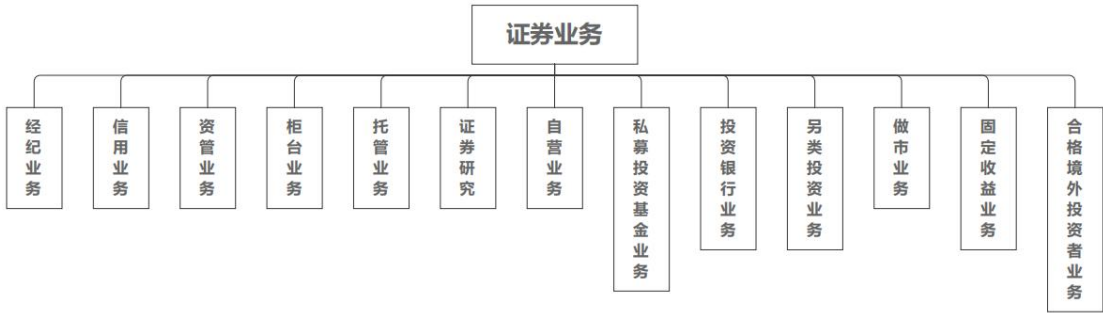


图 5 证券业务条线分类

根据业务线的定义及涵盖范围梳理，再选取相应范围的核心信息系统。经纪业务、信用业务数据域梳理，核心信息系统主要涉及柜台交易系统、融资融券系统、转融通系统、股转新三板系统、个股期权系统、多金融产品销售系统、沪港通系统、深港通系统、监管报送系统等一系列相关系统。

6.1.2.3 数据归类

数据表归类是指筛选纳入该业务域的数据表范围，建立数据表与业务条线之间的对应关系。数据表的描述属性主要包括业务条线、所属数据域、表中文名称、表英文名称、表的业务定义（可选）、来源系统等。其中所属数据域主要包括：主体、品种、账户、行为、资产、协议、营销、渠道九大数据域。

表 7 数据表清单示例

序号	业务条线大类	业务条线小类	所属数据域	表中文名称	表英文名称	表的业务定义（可选）	来源系统
1	经纪业务		主体	（证券）交易单元	pty_secu_trd_unit	交易单元是指交易所会员（一般指证券公司）取得席位后向交易所申请设立的、参与本所证券交易与接受本所监管及服务的基本业务单位，交易单元是交易权限的技术载体。会员参与交易及会员权限的管理通过交易单元来实现。	柜台交易系统

6.1.2.2 梳理方法

证券公司业务域数据元梳理具体采用以下方法：

——确定业务域范围并形成业务条线划分，以经纪业务和信用业务为例，从业务角度梳理证券公司经纪业务、信用业务的分类，形成业务域分类体系；

——根据业务域范围选择相关核心系统，筛选证券公司经纪业务、信用业务涉及的相关核心系统，主要包括柜台交易系统、融资融券系统等；

——开展数据表归类，建立数据表与业务条线之间的关系，基于证券公司经纪业务、信用业务的业务域分类体系，对核心系统数据表进行归类整理，建立数据表与业务条线之间的对应关系，同时剔除系统管理表等非业务域场景的内容；数据表归属条线确定时，可以参考借鉴行业数据模型现有业务条线划分；

——开展数据元筛选，形成业务域各条线数据元库，基于经纪业务、信用业务各业务条线的数据表范围，在各数据表中筛选本条线业务含义明确、具有条线业务特征的数据元，纳入本业务域数据元范畴；针对各条线重复出现的数据元，结合其业务特性，归属到唯一业务条线；

——基于业务域数据元模板，逐一开展业务域数据元定义，针对各业务域数据元逐一定义其数据元编号、中文名称、英文名称等基础属性，引用数据元编号、引用数据元名称等与其他数据元的关系，以及常用维度、统计口径等扩展属性。

证券公司业务域代码的梳理方法如下：

——依据业务域数据元，筛选代码类数据元；

——基于业务域代码模板，逐一开展业务域代码定义、代码编号、代码名称、代码取值、代码含义、代码编码规则等属性梳理。

6.1.3 基金公司业务域数据元

6.1.3.1 业务条线划分

基于数据元标准“总一分”逐层递进的梳理原则，从基金公司实际业务分类出发，参考《证券期货业业务标准设计方案》，明确各业务条线并厘清相互之间的数据流程与逻辑关系，形成合理的业务域分类体系（详见图7）；然后以基金业务逻辑模型为基础，结合已有行业数据标准成果，建立基金业务数据资产目录，梳理基金业务域数据元标准和代码标准，制定并形成统一的标准规范。

通过建立业务与数据资产的对应关系，针对每一个业务类别及业务流程产生的业务域数据元和代码标准进行定义，描述属性包含编号、中文名称、英文名称、业务定义、数据类型及长度、代码编号、与其他数据元的关系；业务域代码的描述属性包含代码编号、代码名称、代码取值、代码含义、代码编码规则。



图 6 基金业务分类

6.1.3.2 数据归类

首先明确相关业务条线的定义、涵盖范围及业务流程，结合业务流程梳理相应核心信息系统，提取出相关业务域数据元。如：在基金募集业务条线下，份额发售分类中交易与申购子类的业务流程梳理过程中涉及TA系统，提取出申购确认表中的部分数据为例，如表8所示：

表 8 业务域数据元提取示例

业务分类			数据项			
一级	二级	三级	序号	标识	中文名	定义
基金募	份额发	交易与	1	TAAccount ID	投资者基金账号编码	基金公司为投资者开立的、用于标识投资者的唯一基金账号。
			2	DistributorCode	销售机构编码	中国证监会下发的，销售机构唯一编码。

业务分类			数据项			
一级	二级	三级	序号	标识	中文名	定义
集	售	申购	3	TransactionAccount ID	投资者交易账户编码	基金公司为投资者开立的,用于标识投资者交易的账户,交易账户或有多。
			4	FundCode	基金代码	基金公司管理的基金的代码,由中国证监会下属中证技术公司统一发布。
			5	TransactionDate	交易发生日期	投资者提交交易申请的自然日。
			6	ApplicationAmount	申请金额	投资者提交交易申请的金额,以人民币显示。

其次同步结合目前已有的数据应用,包括现有的人民银行、证监会监管数据报送、基金产品信息披露数据报送的情况进行综合对比,形成统一的业务数据资产目录。

然后结合行业数据模型中已形成的数据域划分,对业务数据资产目录进行数据元归类,建立基金公司数据元在各数据域下的数据资产目录。

各数据域之间的关联关系如图7所示:

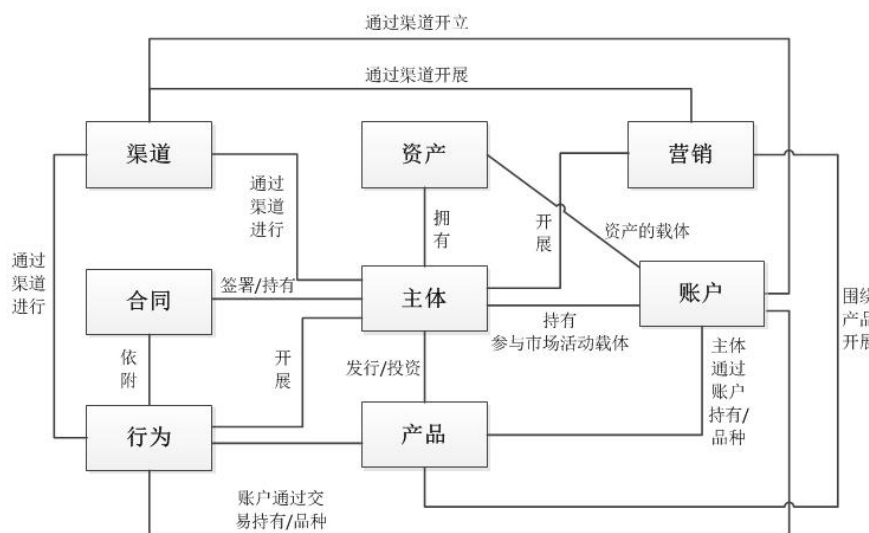


图 7 基金公司数据域划分及各数据域之间的关联关系

6.1.3.3 梳理方法

基金公司业务域数据元的梳理,将基金业务数据资产目录划分为主体、账户、产品、交易、资产、合同、渠道、营销等8大主题,结合对基金公司业务和相关数据的关注程度、重要性、使用频率、通用性和可实施性等原则,明确基金公司业务域的核心数据范围,采用以下步骤进行范围的筛选和业务域数据元的提取与定义:

——基于基金业务流程,筛选业务域数据元。一是自上而下提取:在流程和功能分析的基础上,结合证券期货业数据抽象模型和基金公司逻辑模型,分析提取数据元及属性,建立业务数据资产目录和对应关系,筛选业务域数据元;二是自下而上提取:基于基金全业务流程,对核心信息系统及相关资源的数据,进行分析、梳理,纳入本业务域数据元范畴;通过

梳理、分析和阐明各业务流程中生产、存储、交换的核心业务数据的各个属性以及属性的约束要求，形成数据元标准库；

——针对各条线重复出现的数据元，结合其业务特性，归属到唯一业务条线；

——基于统一业务域数据元模板，针对各业务域数据元逐一定义其数据元编号、中文名称、英文名称等基础属性，引用数据元编号、引用数据元名称等与其他数据元的关系，以及常用维度、统计口径等扩展属性；

——基金公司业务域数据元标准定义完成后，一是与证券公司、期货公司业务域集合之间开展冲突性检查工作，二是与已发及在建标准数据元定义开展冲突性检查工作，消除业务数据元之间的冲突，确保数据元及代码标准定义的一致性。

基金公司业务域代码的梳理，是以已定义的业务域数据标准为依据，在此基础上进行代码类数据元的筛选，并按照业务域代码属性描述的模板进行代码属性定义，按照以下步骤开展：

——依据业务域数据元，基于已定义的业务域数据元，筛选代码类数据元作为业务域代码的范畴；

——基于业务域代码模板，针对各业务域代码逐一定义其代码编号、代码名称、代码取值、代码含义、代码编码规则等属性；

——基金公司业务域数据代码标准定义完成后，一是与证券公司、期货公司业务域集合之间开展冲突性检查工作，二是与已发及在建标准数据域代码开展冲突性检查工作，消除业务数据代码之间的冲突，确保数据代码标准定义的一致性。

6.1.4 期货公司业务域数据元

6.1.4.1 业务条线划分

参照《证券期货业业务标准设计方案（2019 版）》中的分类，划分为期货（期权）经纪业务、产品销售业务、资产管理业务、投资咨询业务、风险管理子公司业务（见图8）。计划首先选取期货公司最核心的期货（期权）经纪业务，再逐步扩展到其他业务；产品销售业务中的基金销售业务与证券公司高度类同，计划参照证券公司业务域相关标准；资产管理业务与基金公司高度类同，计划参照基金公司业务域相关标准。

期货公司经纪业务主要围绕期货交易所产品开展，因此本业务域数据元标准要与期货交易所数据标准协调一致；期货公司经纪业务中的开户业务，目前是由中国期货市场监控中心统一进行账户管理，因此开户业务数据元标准要与中国期货市场监控中心的数据规范协调一致。

参考《证券期货业业务标准设计方案》中的期货业务分类树，全面梳理期货公司业务域数据元标准。在制定期货公司业务域数据元系列标准时，将系列标准分为两大类，第一类是基础类数据标准，包含账户服务和投资者适当性、交易结算和交割等；第二类是指标类数据标准，如风险管理类指标、合规类指标等。

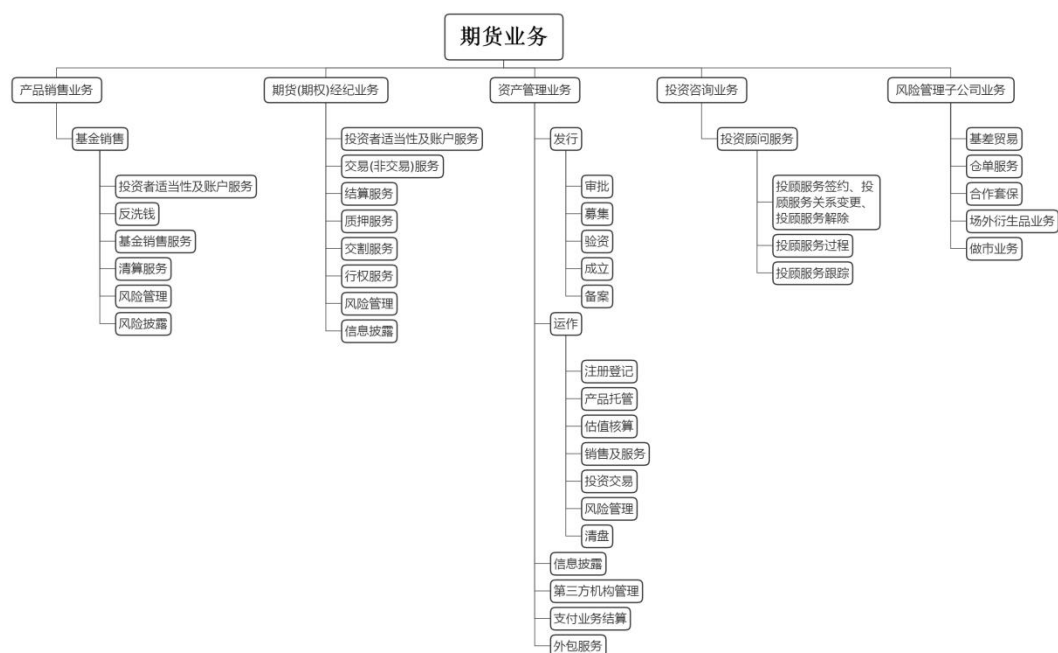


图 8 期货业务条线划分

6.1.4.2 数据归类

以期货（期权）经纪业务数据元梳理为例，首先开展业务条线分类，将经纪业务划分为账户服务和投资者适当性、交易和结算、交割三大业务条线，然后再对各业务条线进一步细分，其中交易和结算业务条线细分为委托、成交、持仓、行权、对冲、费率、资金、监管报送等小类。期货（期权）经纪业务条线分类具体如图9所示：

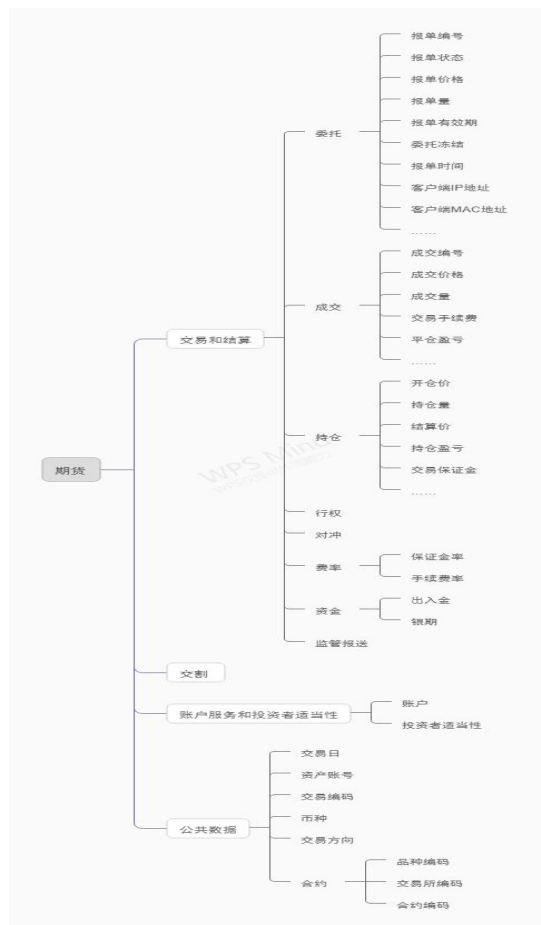


图 9 期货（期权）经纪业务条线分类

针对期货公司业务域数据元按照业务条线进行归类的同时，还需要将每一个数据元归属的数据域进行标识，形成业务、数据两个角度对数据元的管理。期货公司业务域数据元归属数据域主要包括：主体、品种、账户、行为、资产、协议、营销、渠道八大类。

表 9 业务域数据域分类及描述

序号	数据域名称	数据域描述
1	主体	主体是对期货公司运作过程中,对其服务、感兴趣或关注的对象的整体概况。
2	品种	品种主要包括期货交易所产品以及相关的其他金融工具。
3	账户	账户是描述相关主体因业务需求在相关机构登记的交易账户、资金账户、银行账户等各类账户信息。
4	行为	行为是描述期货公司在运营和执行业务时发生的交互活动。
5	资产	资产是描述主体拥有的资产，主要是指客户主体的资产。
6	协议	协议是描述期货公司在经营过程中各主体对象之间签订的各项服务、合同、契约，规定了甲乙双方权利和义务。
7	营销	营销是描述期货公司在开展营销活动时的行为方式。
8	渠道	渠道主要用于表述期货相关业务发生的地点、通道或路径。

6.1.4.3 梳理方法

期货公司业务域数据元梳理按照以下步骤开展：

——确定业务域范围并形成业务条线划分，计划首先聚焦期货公司最基础的期货（期权）经纪业务，包含经纪业务中的账户服务和投资者适当性、交易和结算、交割三大业务条线。

——按照业务条线及归属数据域开展数据元归类，基于期货（期权）经纪业务的业务条线分类，将数据元逐一对应到唯一的业务小类，以及唯一的数据域，完成业务与数据两个维度的数据元识别，形成以业务条线为出发点、辅助数据域标签的期货公司业务域数据元库。

——基于业务域数据元模板，针对各业务域数据元逐一定义其数据元编号、中文名称、英文名称等基础属性，引用数据元编号、引用数据元名称等与其他数据元的关系，以及常用维度、统计口径等扩展属性。

期货公司业务域代码的梳理，主要是以已定义的期货（期权）经纪业务数据元标准为依据，在此基础上进行代码类数据元的筛选，并按照业务域代码的模板进行代码属性定义，具体步骤包括：

——基于已定义的业务域数据元，筛选代码类数据元作为业务域代码的范畴；

——基于数据标准工作组制定的统一业务域代码模板，针对各业务域代码逐一定义其代码编号、代码名称、代码取值、代码含义、代码编码规则等属性。

6.1.5 交易所业务域数据元

6.1.5.1 业务条线划分

交易所业务域基础类数据是交易所产品业务开展过程中所产生的具有共同业务特征的基础性数据，如证券名称、证券代码、成交量等。依照行业习惯及交易所数据资产现状，交易所业务域基础类数据依照股票、债券、基金和衍生品四大产品业务实际包括基本信息、发行、上市、交易、托管及其他数据，其中基本信息数据是指用以描述交易所产品主体直接相关的基本信息，包括证券中英文名称、证券代码、公司注册时间、法定代表人等；发行、上市、交易、托管数据是指在相应业务环节当中，与交易所产品业务相关的数据；其他数据是指除上述内容以外的与交易所保障市场集中交易相关的其他数据。具体类别及描述如下表所示。

表 10 交易所业务域基础数据分类

基础数据分类	基础数据分类描述
基本信息	描述交易所产品主体直接相关的基本信息。
发行	在发行业务环节中，与交易所产品业务相关的数据。
上市	在发上市业务环节中，与交易所产品业务相关的数据。
交易	在交易业务环节中，与交易所产品业务相关的数据。
托管	在托管业务环节中，与交易所产品业务相关的数据。
其他	除上述内容以外的与交易所保障市场集中交易相关的其他数据。

交易所数据元编制工作计划覆盖的数据范围包括：

——交易所核心业务相关数据；

- 共享性高、使用频率高的数据；
- 监管报送或发文涉及的数据。

6.1.5.2 梳理方法

交易所业务域数据元标准计划从市场主体、品种、业务环节等方面，全面梳理交易所各项业务相关数据，形成方便用户查询、快速落地应用的基础类数据标准(含代码类数据标准)；同时提取监管报送数据公共部分，形成标准化数据产品。具体方法如下：

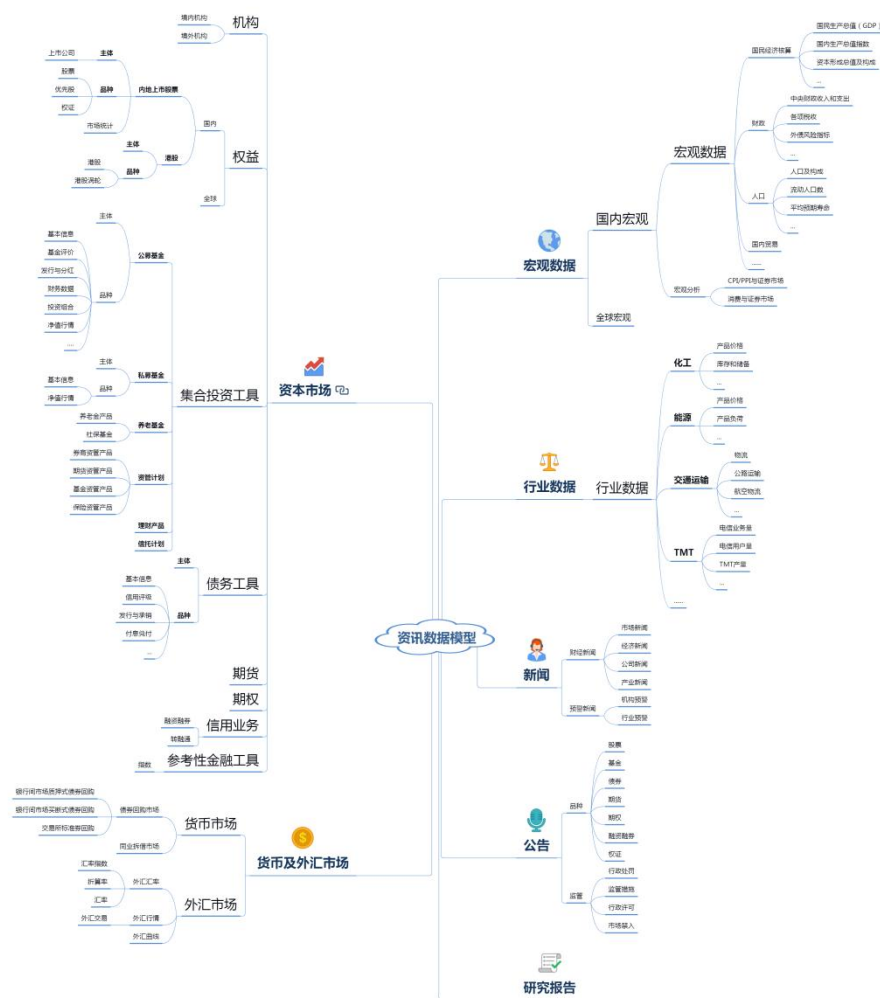
- 结合交易所当前数据资产实际情况及行业经验，依照交易所产品业务条线及技术系统对交易所业务及相关数据进行分类，形成合理的交易所业务域数据体系，明确各分类项下业务域并厘清相互之间逻辑关系。
- 根据数据业务关注度、系统重要性、使用频率、通用性和可实施性等原则明确业务域核心数据范围。
- 梳理每个核心数据元标准和代码标准，制定并形成统一的标准规范，包括：数据元名称、数据元编号、业务定义、数据类型及长度、取值范围及条件、管理部门等。
- 各核心数据元及代码标准定义完成后，还需进行各类数据元集合之间的冲突性检查工作，消除不同业务域数据元之间的冲突，确保重复数据元定义及代码标准的一致性。

6.1.6 资讯业务域数据元

6.1.6.1 总体框架

资讯业务域主要包括宏观数据、行业数据、资本市场数据、货币及外汇市场以及新闻公告研报五个方面。具体如下：

- 宏观数据，涵盖国民经济核算、对外贸易等多个领域数据，为经济学家、行业研究员等提供强有力的数据支持。
- 行业数据，涵盖多类行业数据，内容包括价格、产销量、进出口、库存等数据。
- 资本市场数据，涵盖投资者关注的投资品种的金融资讯数据。
- 货币及外汇市场，货币及外汇市场汇率及行情数据。
- 非结构化数据，涵盖新闻公告研报，提供实时动态的及时多方面资讯情报。



6.1.6.2 宏观数据

宏观数据一级数据分类分为国内宏观和国际宏观。国内宏观的数据又分为宏观数据和宏观分析。宏观数据为国家宏观经济的各类宏观指标及数据；宏观分析是实际应用需要对重要的宏观指标数据间关系进行分析。数据分类示例如图 11 所示。

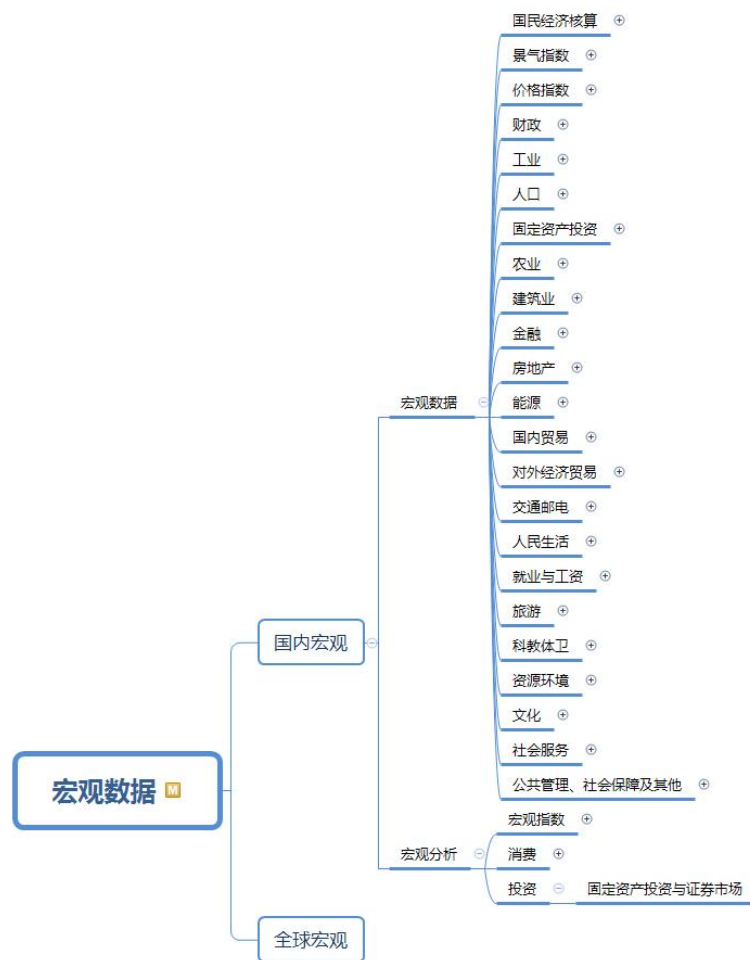


图 11 宏观数据分类示例

6.1.6.3 行业数据

行业数据即行业经济数据，是以权威行业机构（国家统计局、海关总署、工信部、农业部部委等机构）的行业统计数据为依托，提供海量的行业经济数据，主要包括行业产品价格、产量及库存等数据信息，为分析研究行业前景提供数据支撑。

行业数据一级数据分类为行业分类和行业数据。行业分类是指行业分类的定义，存在多种行业分类，有国民经济行业分类标准、申万行业分类标准、上市公司行业分类指引、GICS 全球行业分类标准、Wind 行业分类标准等；行业数据是展示各行业的统计指标的数据，综合主流资讯服务商的行业数据的数据分类。数据分类示例如图 12 所示。



图 12 行业数据分类示例

6.1.6.4 货币及外汇市场

以行业资讯数据实际应用为出发点，对市场主体、品种相关资讯数据按照“市场”属性进行分类，分为货币市场、外汇市场。

货币市场数据以中国人民银行相关规定及人民银行金融市场运行情况统计中对货币市场的统计口径为基础，归纳出具有共性的数据分类，一级数据分类为：债券回购市场、同业拆借市场，基本覆盖了行业资讯中货币市场数据。数据分类示例如图 13 所示。



图 13 货币市场数据分类示例

综合主流资讯服务商的外汇市场数据分类，主要包括外汇汇率、外汇行情和利率曲线。建立全面的外汇市场信息，为投资市场提供追踪、投资、研究等重要数据支持。数据分类示例如图 14 所示。



图 14 外汇市场数据分类示例

6.1.6.5 非结构化数据

6.1.6.5.1 新闻

新闻资讯数据分类包括市场新闻、经济新闻、公司新闻、产业新闻、宏观新闻等，以及针对负面新闻专门打造的负面预警新闻资讯，对投资者及时了解市场动态、捕捉市场热点、追踪股票动态具有重要的指导意义。



图 15 新闻数据分类示例

6.1.6.5.2 公告

公告数据目前包括信息披露公告和监管公告信息。信息披露公告按照主要的投资品种进行公告分类，包括股票、基金、债券、期货等。监管公告信息，按照监管手段对监管信息进行分类。数据分类示例如图 16 所示。

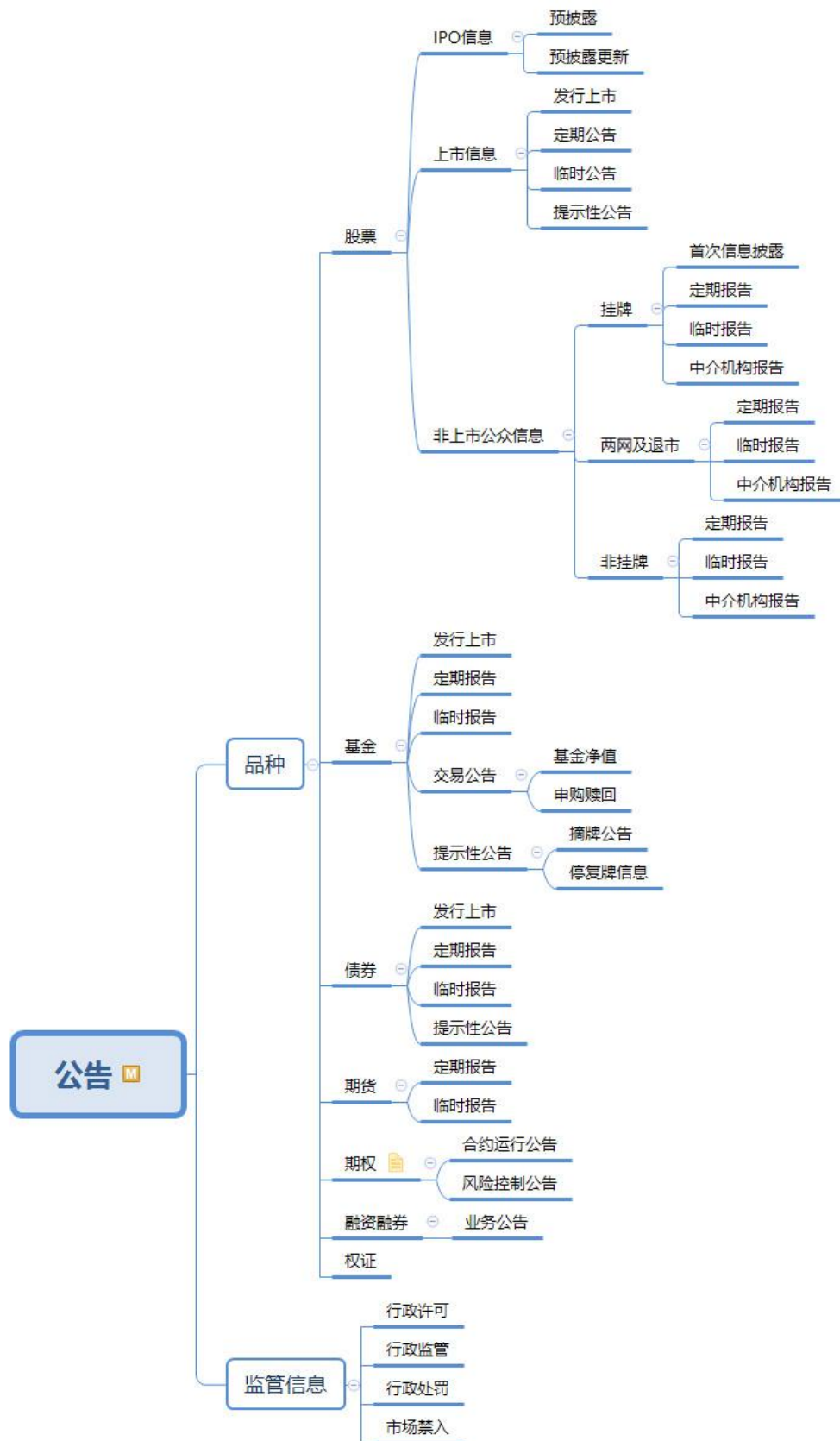


图 16 公告数据分类示例

6.1.6.5.3 研究报告

证券研究报告，是指证券机构、证券投资咨询机构对证券及证券相关产品的价值、市场走势或者相关影响因素进行分析，形成证券估值、投资评级等投资分析意见的报告。数据分类示例如图17所示。

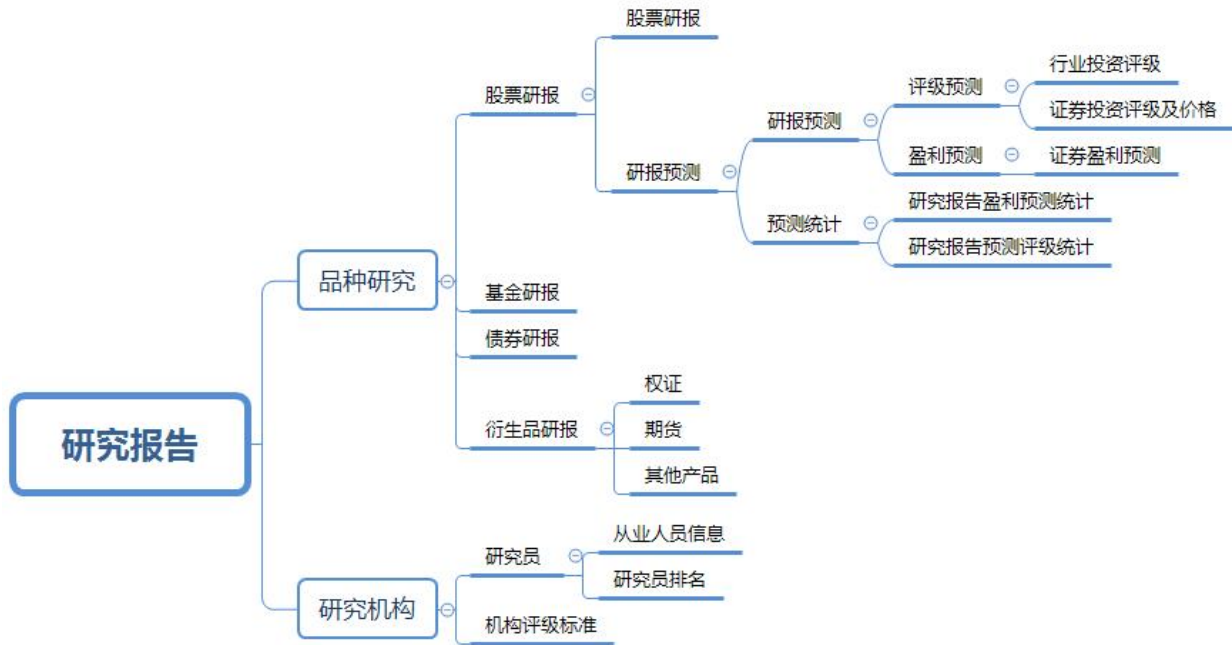


图 17 研究报告数据分类示例

6.2 监管数据报送

监管数据报送领域的标准编制及应用工作计划采取以下方式开展：

——梳理目前监管报送现状及存在的主要问题，调研银保监体系及国外证券业监管报送方案与启示，对证券、基金、期货、场外衍生品等监管报送相关政策与发文进行汇总，走访并收集行业机构反馈的监管报送存在的问题与建议，制订证券期货业监管报送数据标准课题研究报告，从报送机制、数据标准、质量校验等角度出发，提出优化证券期货业监管数据报送工作的建议。

——建立行业数据报送标准规范。梳理监管报送数据指标的定义，包括报送标准、校验标准、统计标准等，为机构内部监管报送系统建设提供指导，进一步提高数据报送的规范性和准确性。

——构建相关领域的监管报送模型。基于数据报送标准规范，汇总机构基本信息、交易、业务、财务等各类数据，形成逻辑清晰、内容完整、规范标准的监管报送模型，为机构内部监管报送系统建设提供指导，提升证券基金业机构数据治理水平。

6.3 数据标准及治理领域研究

6.3.1 常态化研究

及时跟踪掌握行业数据标准及治理动态，总结当前行业数据治理发展现状，明确重点研究方向和内容，持续推出《数据标准微洞察》。

表 11 《数据标准微洞察》主要内容

序号	主要部分	核心内容	具体内容
1	监管动态	中办、国办 网信办 中国人民银行 银保监会 证监会	盘点各政府部门发布的政策法规，对数据标准及数据治理相关监管政策进行跟踪解读。
2	行业聚焦	行业数据标准 数据治理体系 数据资产管理 数据安全防范 数据保护技术 数据产品与服务 数据安全监管处罚典型事件	聚焦证券期货业核心机构、经营机构、中介服务机构行业动态，关注数据标准、数据治理、数据资产、数据安全等领域重点难点热点问题，剖析和解读典型事件。
3	外部观察	美国：证监会（SEC）等 欧盟：欧洲证券及市场管理局（ESMA） 英国：金融行为监管局（FCA） 新加坡：金融管理局（MAS） 香港：证监会（SFC）、港交所（HKEX）	聚焦境外金融监管部门政策法规发布，跟踪监管机构同业动态，梳理境外数据标准及治理主要事件，剖析和解读数据治理重大事件。

6.3.2 深度研究

为清晰掌握行业数据治理发展情况，服务于数据标准制定工作，计划结合当前重点、热点、难点问题，定期编制深度研究性报告或文章，供相关方参考。

表 12 重点研究课题示例

序号	课题名称	主要内容	备注
1	证券期货业数据治理制度体系研究	证券期货业数据治理制度体系战略规划、组织机构、岗位职责、管理策略、监督机制等	保障数据治理可执行。
2	证券期货业数据资产管理与市场化应用	证券期货业数据资产概念的界定，数据资产基本类型，数据资产重要特征，数据资产责任主体，管理体系运营机制，数据如何资产化、如何市场化，如何助力数字经济创新发展。	由于数据资产涉及业务、技术、合规等多个部门，必要时可协调各单位开展市场调研。
3	证券期货业数据安全保护与治理研究	数据安全威胁因素，数据安全的法规政策与监管实践，数据安全保护体系构建，数据分类分级，数据安全全生命周期保护，安全保护技术应用，数据安全应急处置机制。	由于数据安全涉及业务、技术、合规等多个部门，必要时可协调各单位开展市场调研。
4	证券期货业跨境数据流动研究	跨境数据流动业务场景分析，跨境数据流动风险分析，跨境数据分类分级，境内外	由于跨境数据流动涉及具有海外业务的机

序号	课题名称	主要内容	备注
		跨境数据流动监管政策，数据保护技术措施。	构，预计需要对具有海外牌照机构和外资机构开展市场调研。

以证券期货业跨境数据流动研究课题为例，相关研究内容具体如下。

表 13 课题研究具体内容示例

章节划分	章节名称	研究内容
第一章	跨境数据流动的基本内涵	1. 跨境数据流动的内涵与外延； 2. 跨境数据流动需求场景分析； 3. 跨境数据流动的优劣势。
第二章	跨境数据流动的发展现状	1. 行业跨境数据流动存在的问题； 2. 跨境数据分类方法； 3. 跨境数据分级方法； 4. 行业跨境数据流动风险分析。
第三章	境外跨境数据流动法规政策及监管实践	1. 境外跨境数据流动监管政策（美国、欧洲、香港等）； 2. 境外跨境数据流动监管模式实践（地区白名单制度、评估认证制、合同干预制等）。
第四章	境内跨境数据流动法规政策及监管实践	1. 跨境数据流动法规政策（网信部门，金融部门（包括银行保险业、证券业等））； 2. 我国跨境数据保护的基本实践（基本原则、跨境数据分类分级、制度建设、合规风控保障、数据保护技术措施等）。
第五章	跨境数据流动监管模式的选择建议	1. 跨境数据保护技术应用与实施； 2. 跨境数据流动政策体系建设建议。

7 任务计划

结合重点任务规划内容，确定数据元标准编制、监管数据报送标准课题研究、数据标准相关研究等工作计划如下：

表 14 数据元标准工作计划

序号	标准类别	标准名称	标准状态	工作计划
1	基础数据元规范	证券期货业基础数据元规范 第1部分：基础数据元	已立项	2021年12月 完成标准立项 2022年02月 完成草案编写 2022年05月 形成征求意见稿
2		证券期货业基础数据元规范 第2部分：基础代码	已立项	2022年08月 形成送审稿 2022年12月 标准报批 2023年06月 标准发布
3	监管系统类数据元	证券期货业监管系统数据元系列规范（第1部分：业务域数据元、第2部分：业务域代码）	待立项	2023年06月 完成标准立项 2023年08月 形成征求意见稿 2023年12月 形成送审稿 2024年06月 标准报批 2024年12月 标准发布
4	会管单位类数据元	证券交易所业务域数据元系列规范（第1部分：业务域数据元、第2部分：业务域代码）	待立项	2022年12月 标准预研 2023年12月 完成标准立项

序号	标准类别	标准名称	标准状态	工作计划
				2024年05月 形成征求意见稿 2024年08月 形成送审稿 2024年12月 标准报批 2025年06月 标准发布
5	经营机构 类数据元	证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分：证券	已发布	
6		证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第2部分：期货	已发布	
7		证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第3部分：基金	已发布	
8		证券公司业务域数据元系列规范 (第1部分：业务域数据元、第2部分：业务域代码)	待立项	2022年12月 形成工作组讨论稿 2023年05月 完成标准立项 2023年08月 完成标准征求意见 2023年12月 完成标准送审 2024年06月 完成标准报批发布
9		基金公司业务域数据元系列规范 (第1部分：业务域数据元、第2部分：业务域代码)	待立项	2022年12月 形成工作组讨论稿 2023年05月 完成标准立项 2023年08月 完成标准征求意见 2023年12月 完成标准送审 2024年06月 完成标准报批发布
10		期货公司业务域数据元系列规范 (第1部分：业务域数据元、第2部分：业务域代码)	待立项	2022年12月 形成工作组讨论稿 2023年05月 完成标准立项 2023年08月 完成标准征求意见 2023年12月 完成标准送审 2024年06月 完成标准报批发布
11	服务机构 类数据元	面向大数据应用的证券期货业外部数据规范 (第1部分：业务域数据元、第2部分：业务域代码)	已立项	2022年12月 形成工作组讨论稿 2023年05月 完成标准立项 2023年08月 完成标准征求意见 2023年12月 完成标准送审 2024年06月 完成标准报批发布

表 15 监管数据标准课题研究工作计划

序号	时间安排	工作内容
1	2022年1月至3月	开展项目预研工作，收集整理相关材料
2	2022年4月至6月	开展调研工作，制订调研问卷、开展书面调研及现场交流等，针对行业内外、境内外相关情况进行材料汇总，充分了解行业监管数据报送现状。
3	2022年7月至12月	起草调研报告，开展监管报送相关标准、模型编制工作，形成标准初稿。
4	2023年1月至12月	推动标准立项，开展征求意见、送审、报批等工作。

表 16 数据标准相关研究宣传工作计划

序号	时间安排	工作内容
1	每月更新	定期汇总数据标准及相关数据治理领域国内外最新监管动态、行业热点、典型实践案例等，编制并发布工作组微刊物
2	不定期	组织开展专题研讨会，研究探讨行业数据标准等领域热点难点课题
3	不定期	组织开展标准宣讲活动，宣传组内重点标准起草背景、相关内容及工作思路等，强化标准应用推广
4	不定期	组织开展《标准研究》投稿工作

8 实施保障

探索建立数据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，持续开展数据标准审核制度，保障标准的有效实施。

9 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，数据标准工作组组织实施，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。建立数据标准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。

9.2 加强能力建设

向证券期货行业内有关单位积极宣传数据标准工作的目的和意义，组织开展数据标准化宣传活动，树立各单位标准化意识，提高技术人员的标准化能力，推动行业数据治理工作的开展。

9.3 完善物资配备

加强对数据标准建设工作的经费投入力度，证券分技术委员会和数据标准工作组有关单位应加大人力和资金支持。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。