

长江期货股份有限公司企业标准

CJQH 001—2026

全面风险管理系统数据标准及技术规范

2026 - 03 发布

2026 - 03 实施

长江期货股份有限公司 发布

目 次

前言	II
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
3.1 业务条线	1
3.2 全面风险管理	2
3.3 市场风险	2
3.4 信用风险	2
3.5 流动性风险	2
3.6 操作风险	2
3.7 声誉风险	2
3.8 并表管理	2
4 期货公司全面风险管理数据标准	2
4.1 全面风险管理流程	2
4.2 逻辑模型清单	3
4.3 英文词根表	4
4.4 数据表和数据项	4
5 应用系统交互规范	22

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范》的规定起草。

本文所有内容应符合强制性国家标准、行业标准和地方标准，若与其相抵触时，以国家标准、行业标准和地方标准为准。

本文件参考“JR/T 0176.5—2024 证券期货业数据模型 第5部分：期货公司逻辑模型”起草。

本标准由长江期货股份有限公司提出。

本标准由长江期货股份有限公司归口管理。

本文件起草单位：长江期货股份有限公司。

本文件主要起草人：程敏、周小华、方慎林、马恋、李宇、周永聪、樊健、徐若冉。

全面风险管理系统数据标准及技术规范

1 范围

本文件规定了期货公司全面风险管理相关数据的标准和使用规范。本标准基于长江期货公司全面风险管理实践初步探索和总结，参考证券期货行业数据标准进行编写，适用于长江期货公司全面风险管理系统。

2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

JR/T 0318—2024 证券期货业数据标准属性框架

JR/T 0176.5—2024 证券期货业数据模型 第5部分：期货公司逻辑模型

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1 业务条线

根据期货公司及其子公司获得的业务牌照或许可、服务内容进行划分，主要包括期货经纪、资产管理、风险管理、自有资金投资、期货交易咨询、基金销售等。其中：

（1）期货经纪业务是指公司接受客户委托、按照客户的指令、以公司的名义为客户在期货交易所进行期货交易并收取交易手续费的中间业务。

（2）资产管理业务是公司根据资产管理合同约定的方式、条件、要求及限制，对客户资产进行运作，为客户提供证券、期货及衍生品的投资管理服务并收取管理费用以及相应业绩报酬的业务。

（3）风险管理子公司是开展风险管理业务的主体，包括场外衍生品业务、做市业务和期现业务。场外衍生品业务是指子公司与客户进行场外期权、远期、互换等衍生品交易，同时在场内利用期货与期权进行风险对冲的业务；做市业务是指子公司按照交易所相关规则，为特定的期货合约提供连续报价或者回应报价，以获得买卖价差和交易所返还的业务；期现业务（又称“大宗商品风险管理业务”）是指期货风险管理公司为帮助实体企业管理生产经营的风险，提供一体化风险管理解决方案，开展普通贸易、基差贸易、含权贸易、串换贸易、约定购回、代理采购、代理销售、仓储物流等期现相关业务。

（4）自有资金投资是指在满足规定限额的最低结算准备金要求和结算要求的前提下运用自有资金进行的投资业务活动。

（5）期货交易咨询业务是指公司基于客户委托，开展风险管理顾问、期货研究分析并向客户收取咨询费用的业务。

（6）基金销售业务是指公司接受基金管理人的委托，签订书面代销协议，代理销售相关基金产品，提供配套服务并收取销售费用的中间业务。

3.2 全面风险管理

指董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，在战略制定和日常运营中，对面临的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、洗钱风险、声誉风险、信息技术风险、廉洁从业风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理的持续过程。

3.3 市场风险

是指公司因市场价格（利率、汇率、股票价格和商品价格）变动而给公司带来损失的风险。

3.4 信用风险

是指公司业务开展过程中，因客户（包括融资方、交易对手或发行人等）违约导致损失的风险。

3.5 流动性风险

指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

3.6 操作风险

指由于不完善或有问题的内部程序、人员、信息技术系统，以及外部事件所造成损失的风险。包括法律风险，但不包括战略风险和声誉风险。

3.7 声誉风险

指因公司及子公司、工作人员行为或外部事件等，导致交易者及社会舆论对公司产生负面评价，从而损害公司品牌价值，不利于其正常经营，甚至影响到市场稳定和行业形象的风险。

3.8 并表管理

指证券公司对并表管理体系的公司治理、资本和财务等进行全面持续的管控，有效识别、计量、监测、评估和控制证券公司的总体风险状况。并表管理适用于境内依法设立的证券公司，并表管理体系由证券公司及其下设的各级附属机构组成（含境外子公司）。

4 期货公司全面风险管理数据标准

4.1 全面风险管理流程

公司通过系统化、结构化的方法，持续识别、评估、监控和应对各类风险，以保证公司各类风险可测、可控和可承受，保障公司稳健经营和各项创新业务发展。全面风险管理遵循全覆盖的基本原则，覆盖公司面临的所有风险类别，以及公司各部门、子公司及所有业务，贯穿决策、执行、监督和反馈的全

过程。

4.2 逻辑模型清单

本文按照“基础数据-业务数据-专项风险数据”三级标准体系，制定通用的数据字典、数据规范和计量标准，形成合约、账户、业务条线等维度的参考数据标准规范。

表 1 逻辑模型清单总览

序号	业务线	一级报表	详细定义
1	整体风险管理	期货风险监管指标报表	期货公司的 6 项风险监管指标
2	整体风险管理	集团风险限额监测表	集团公司和期货公司授权风险限额
3	专项风险管理-市场风险	VaR 值监测表	相关业务条线的 VaR 值
4	专项风险管理-信用风险	债券持仓资产分类	各风险类别持仓债券规模和占比
5	专项风险管理-流动性风险	公司资金头寸和缺口	公司账户资金头寸和流动性缺口
6	专项风险管理-操作风险	操作风险事件表	公司历年发生的操作风险事件的基本情况
7	专项风险管理-声誉风险	声誉风险舆情监测表	与公司相关的声誉风险舆情信息
8	业务风险管理-经纪业务	经纪业务情况表	公司经纪业务的基本情况
9	业务风险管理-经纪业务	经纪业务穿仓客户明细表	公司经纪业务穿仓客户基本情况和穿仓金额
10	业务风险管理-资产管理业务	产品分布表	公司管理的各类资管产品的数量和规模
11	业务风险管理-资产管理业务	资管产品明细表	公司管理的存续资管产品的基本信息和规模情况
12	业务风险管理-资产管理业务	固收产品风险表	公司管理的固定收益类产品的风险指标
13	业务风险管理-自有资金投资	自有资金投资持仓表	公司自有资金投资持仓明细表
14	业务风险管理-自有资金投资	自有资金投资风险限额监测表	公司自有资金授权风险限额执行情况
15	业务风险管理-交易咨询业务	交易咨询情况表	公司交易咨询业务开展情况
16	业务风险管理-基金销售业务	基金销售情况表	公司基金销售业务开展情况
17	风险管理子公司-整体风险	风险管理子公司风险监管指标报表	期货风险管理子公司的 4 项风险监管指标
18	风险管理子公司-整	风险管理子公司风险	期货公司和子公司授权风险限额

	体风险	限额监测表	
19	风险管理子公司-做市业务	做市业务持仓表	做市业务持仓情况
20	风险管理子公司-做市业务	做市业务日盈亏表	做市业务各账户盈亏情况
21	风险管理子公司-场外业务	场外业务持仓表	场外业务持仓情况
22	风险管理子公司-场外业务	场外业务日盈亏表	场外业务各类型持仓的盈亏情况
23	风险管理子公司-场外业务	场外业务客户资金表	场外业务客户资金收支、授信使用和追保情况
24	风险管理子公司-场外业务	客户授信管理	场外业务客户授信额度和使用情况，以及内部评级和评级有效期
25	风险管理子公司-场外业务	客户清单表	场外业务客户基本情况表
26	风险管理子公司-期现业务	期现业务持仓表	期现业务持仓情况
27	风险管理子公司-期现业务	期现业务日盈亏表	期现业务各账户盈亏情况
28	风险管理子公司-期现业务	现货购销存明细表	期现业务现货购进、销出和库存情况
29	集团并表管理	金融资产表	公司自有资金持仓金融资产明细
30	集团并表管理	金融衍生品表	风险管理子公司持仓金融衍生品明细
31	集团并表管理	股权投资表	公司和子公司股权投资情况

4.3 英文词根表

数据表和数据项英文词根，遵循《JR/T 0176.5—2024 证券期货业数据模型 第5部分：期货公司逻辑模型》第9章节规范。

4.4 数据表和数据项

期货公司全面风险管理核心数据表的主要数据项，如表 1-32 所示：

表 1 期货风险监管指标报表

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
净资本	net_capi	净资产基础上，按照变现能力对资产负债项目及其他项目进行风险调整后得出的综合性风险监管指标	数值型
净资本/风险资	net_capi_risk_capi	净资本/风险资本准备总额	字符型

本准备总额	_amt		
净资本/净资产	net_capi_net_ast	净资本/风险资本准备总额	字符型
流动资产/流动负债	Vare_ast_liab	流动资产/流动负债	字符型
负债/净资产	Liab_net_ast	负债/净资产	字符型
结算准备金额	clr_prep_amt	期货公司按照交易所及登记结算机构的有关要求以自有资金缴存用于履约担保的最低金额	数值型

表 2 集团风险限额监测表

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
自有资金投资业务规模	selo_fund_ivsm_busi_scal	期货公司本部自有资金投资证券的规模	数值型
衍生品持仓名义本金	deri_hldp_nomn_prin	风险管理业务的衍生品持仓名义本金	数值型
衍生品持仓净敞口	deri_hldp_net_epsu	风险管理业务的衍生品持仓净敞口	数值型
损失实际值	loss_actl_val	合并报表范围，公司年度经营产生的亏损	数值型
减值金额	imp_m_val_amt	合并报表范围，公司资产可收回金额低于账面价值的损失	数值型

表 3 VaR 值监测表

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
整体 VaR 值	whl_varval	期货公司自有资金投资和子公司合并计算在一定置信水平下的最大可能损失值，VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	数值型
风险管理子公司 VaR 值	indus_whl_varval	子公司在一定置信水平下的最大可能损失值，VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	数值型
自有资金 VaR 值	selo_cptl_varval	公司自有资金投资在一定置信水平下的最大可能损失值，VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	数值型
风险管理子公司自有资金 VaR 值	indus_selo_cptl_varval	风险管理子公司自有资金在一定置信水平下的最大可能损失值，VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	数值型
做市业务 VaR 值	mkt_busi_varval	做市业务在一定置信水平下的最大可能损失值，VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	数值型
场外业务	otc_busi_varval	场外业务在一定置信水平下的最大可能损失	数值型

VaR 值		值, VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	
期现 VaR 值	fturisp_busi_varval	期现业务在一定置信水平下计算的最大可能损失值, VaR95%、VaR99%分别表示置信水平为 95%、99%的情况下的最大损失值	数值型

表 4 债券持仓资产分类

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
债券资产名称	bond_ast_nam	根据债券属性进行分类。包括信用债、利率债等	字符型
债券资产分类	bond_ast_clas	债券的资产分类结果。包括正常类、关注类和不良类	字符型
债券资产规模	bond_ast_scal	正常类、关注类和不良类债券的市值	数值型
债券资产比率	bond_ast_rate	正常类、关注类和不良类债券市值占全部持仓债券市值的比例	字符型

表 5 公司资金头寸和缺口

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
公司资金头寸	corp_cptl_position	当日末公司头寸	数值型
7 天的流动性缺口	vare_gap_7d	当日预测 7 天后的流动性缺口	数值型
30 天的流动性缺口	vare_gap_30d	当日预测 30 天后的流动性缺口	数值型

表 6 操作风险事件表

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
状态	stat	操作风险事件最新处理进展, 可分为: 已处理、未处理	字符型
类型_操作风险	type_oper_risk	根据操作风险事件发生原因进行分类, 包括人员问题、流程问题、系统问题和外部问题等	字符型
事件描述	evt_desc	具体说明操作风险事件发生过程, 内容包括事件的发生时间、发生单位、发生原因、损失金额、造成影响等	文本型
影响	infl	说明操作风险事件导致的后果, 包括不限于引起监管关注、客户投诉等	字符型
涉及金额	invl_amt	说明操作风险事件导致公司损失的具体金额	字符型
涉及客户数量	invl_cust_vol	说明操作风险事件中受到影响客户的数量	字符型
涉及子部门	invl_dept	说明操作风险事件发生的具体部门	字符型

表 7 声誉风险舆情监测表

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
新闻标题	news_title	在新闻正文内容前面,对新闻内容加以概括或评价的简短文字	字符型
摘要	abs	概要、内容提要。是以提供内容梗概为目的,不加评论和补充解释,简明、确切地记述重要内容的短文	字符型
发布时间	rela_time	新闻的发布时间	字符型
舆情倾向	pub_setm_tdn	评估舆情信息对公司声誉影响的情感倾向,包括中性、正面、负面等	字符型
信息来源	info_src	新闻的转发机构	字符型
发布机构	rela_org	新闻的首发机构	字符型
舆情因子	ftor	触发舆情的关键词	字符型
智能倾向	intelg_tdn	评估舆情信息未来对公司声誉影响的情感趋势,包括中性、正面、负面等	字符型
地址链接	addr_link	根据统一资源定位符(URL, uniform resource location),运用超文本标记语言(HTML, hyper text markup language),将网站内部网页之间、系统内部之间或不同系统之间的超文本和超媒体进行链接。	字符型

表 8 经纪业务情况表

数据中文名	数据英文名	数据说明	数据类型
当月开户数	mth_oact_num	当月成功办理期货开户的客户数	数值型
累计客户数	aggr_cust_num	查询日公司未销户的客户数(含休眠账户)	数值型
当日成交额	tdy_mtch_amt	当日公司所有客户交易期货期权的成交总金额	数值型
当月成交额	mth_mtch_amt	当月公司所有客户交易期货期权的成交总金额	数值型
当年累计成交额	year_aggr_mtch_amt	当年公司所有客户交易期货期权的成交总金额	数值型
当日成交额市占(万分之)	tdy_mtch_amt_mkt	公司当日成交额占全市场当日成交额的比例	数值型
当日客户权益	tdy_cust_equi	当日结算后所有客户权益之和	数值型
当年日均客户权益	year_day_cust_equi	当年公司每日客户权益的平均值	数值型
当年客户权益峰值	year_cust_equi_peak	当年我司客户权益的最大值	数值型
当日新增穿仓客	tdy_nadd_stot_cu	上一交易日结算后期末权益为正且当	数值型

户数	st_num	前交易日结算后期末权益为负的客户数	
当前穿仓客户数	curr_stot_cust_num	当日结算后客户权益为负的客户数量	数值型
当前穿仓金额	curr_stot_amt	当日结算后处于穿仓状态的客户权益之和	数值型

表 9 经纪业务穿仓客户明细表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
客户号	cust_num	公司给客户开立的资金账号	字符型
客户名称_经纪业务	cust_nam_brok_busi	客户的姓名	字符型
客户权益	cust_equi	客户当日结算后的权益	数值型

表 10 产品分布表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
产品类别	pd_clas	根据资产管理计划基本信息从不同维度进行分类, 包括两种分类, 分别为: 产品类型、投资类型	字符型
产品分类	pd_clas	结合资产管理计划基本信息, 对产品类别进一步细分	字符型
产品数量	pd_vol	存续资产管理计划的数量	数值型
产品规模	pd_sca1	存续资产管理计划的规模	数值型

表 11 资管产品明细表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
产品代码	pd_cd	资产管理计划在估值表上的 6 位数代码	字符型
产品名称	pd_nam	资产管理计划在中基协备案的产品全称	字符型
产品类型	pd_type	根据资产管理计划投资者数量进行分类, 包括单一、集合	字符型
投资类型	ivsm_type	根据资产管理计划投资范围和投资比例进行分类, 具体包括: 固定收益类、混合类、权益类、期货和衍生品类	字符型
成立日期	setp_date	管理人公告资产管理计划成立的日期	字符型
预计到期日期	expe_matu_date	资产管理计划合同中约定的到期日期	字符型
结构化最大比例	stru_max_rati	资产管理计划优先级份额/资产管理计划劣后级份额。 其中, 中间级份额计入优先级份额	数值型
资产份额	ast_shr	单个资产管理计划的资产份额	数值型
累计净值	aggr_nv1	单位资产管理计划份额净值和计划历史上累计份额分红金额之和	数值型

资产总值	ast_tot_val	单个资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和	数值型
资产净值	nav	单个资产管理计划总值减去负债后的价值	数值型
单位净值	unit_nvl	单个资产管理计划资产净值/该资产管理计划的资产份额	数值型

表 12 固收产品风险表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
产品代码	pd_cd	资产管理计划在估值表上的 6 位数代码	字符型
产品名称	pd_nam	资产管理计划在中基协备案的产品全称	字符型
资产净值	nav	单个资产管理计划总值减去负债后的价值	数值型
债券规模	bond_scal	单个资产管理计划持仓债券规模（按全价计）之和	字符型
久期	pd	单个资产管理计划全部持仓债券的加权平均久期，以单只债券面额为权重	数值型
行权久期	exer_pd	单个资产管理计划全部持仓债券的加权平均行权久期，以单只债券面额为权重	数值型
杠杆	levg	资产管理计划资产总值/该资产管理计划的资产净值	字符型
DV01	DV01	债券收益率每上升一个基点，资产管理计划持仓债券价值的变动值	字符型

表 13 自有资金投资持仓表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
证券名称	scr_nam_selo_cptl	持仓证券名称	字符型
证券代码	scr_cd_selo_cptl	持仓证券在交易所、银行间或场外市场交易的代码	字符型
资产类别	ast_clas_selo_cptl	按照指定规则判断持仓证券归属的金融资产类别	字符型
持仓数量	hldp_vol_selo_cptl	持仓证券的持有数量或者持有比例	字符型
持仓成本	hldp_cost_selo_cptl	持仓证券的初始投资规模	数值型
持仓市值	hldp_mval_selo_cptl	持仓证券的当日末市值	数值型
当日盈亏	tdy_pl_selo_cptl	持仓证券的当日盈利或亏损	数值型
本月累计盈亏	mtl_aggr_pl_selo_cptl	自有资金投资持仓证券的本月累计的盈利或亏损	数值型
本年累计盈亏	year_aggr_pl_selo_cptl	自有资金投资持仓证券的本年累计的盈利或亏损	数值型

表 14 自有资金投资风险限额监测表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
本部关联方金融产品规模	relp_fin_pd_scal_corp	公司本部自有资金投资关联方金融产品的持仓市值	数值型
本部开展现金流管理规模	cash_flow_mang_scal_corp	公司本部自有资金开展现金流管理的持仓市值	数值型
子公司关联方金融产品规模	indus_relp_fin_pd_scal	风险管理子公司自有资金投资关联方金融产品的持仓市值	数值型
子公司开展现金流管理规模	indus_cash_flow_mang_scal	风险管理子公司自有资金开展现金流管理的持仓市值	数值型
监测结果	rslt_selo_cptl	自资金投资投资业务各授权风险指标监测结果，包括正常和超限	数值型

表 15 交易咨询情况表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
在服务客户数	serv_cust_num	当前在服务期内的客户数。	数值型
当月新增收入	mtl_nadd_incm	当月客服已审核的订单金额—当月退款金额	数值型
本年累计收入	year_aggr_incm	当年客服已审核的订单金额—当年退款金额	数值型

表 16 基金销售情况表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
月末基金保有量	mtl_fnd_own_qty	月末客户持有公司代销基金规模之和，其中单基金规模=客户份额*月末日代销基金单位净值	数值型
本月销售额	mtl_sale_amt	指本月确认成功的认购和申购金额、转换入、定投金额	数值型
本月赎回额	mtl_redp_amt	指本月确认成功的赎回金额、转换出金额	数值型
本年累计销售额	year_aggr_sale_amt	指本年确认成功的累计认购和申购金额、转换入、定投金额。	数值型
本年累计赎回额	year_aggr_redp_amt	指本年确认成功的累计赎回金额、转换出金额。	数值型

表 17 风险管理子公司监管指标报表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
风险管理子公司净资本	net_capi_indus_fin	净资本由核心净资本和附属净资本构成。其中： 核心净资本=净资产—优先股及永续次级债等—资产项目的风险调整—或有负债的风险调整—/+协会认定或核准的其他调整	数值型

		项目。 附属净资本=长期次级债×规定比例-/+ 协会认定或核准的其他调整项目。 附属净资本不得超过核心净资本。	
风险管理子公司 净资本/净资产	net_capi_net_a st_indus_fin	风险管理子公司净资本/风险管理子公司净 资产	数值型
风险管理子公司 风险覆盖率	risk_covr_rate _indus_fin	风险管理子公司净资本/各项风险资本准备 之和×100%	数值型
风险管理子公司 流动性覆盖率	vare_covr_rate _indus_fin	风险管理子公司优质流动性资产/未来 30 日现金净流出×100%	数值型

表 18 风险管理子公司限额监测表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
做市衍生品持仓名 义本金市	deri_hldp_nmpr_mkt	做市业务所有合约的名义本金之和	数值型
场外衍生品持仓名 义本金	deri_hldp_nmpr_otc	场外业务所有合约的名义本金之和	数值型
期现衍生品持仓名 义本金	deri_hldp_nmpr_ftu rsp	期现业务所有合约的名义本金之和	数值型
场外信用风险敞口	cred_risk_epsu_otc	场外衍生品业务每日末所有交易对手 方的违约风险暴露之和（压力情景下 的潜在损失）	数值型
期现信用风险敞口	cred_risk_epsu_ftu rsp	包括需要提前支付给交易对手的定 金、保证金，销售合同中先交付全部 或部分货物产生的应收账款部分，采 购合同中先行支付全部或部分货款产 生的预付账款部分，交易对手亏损等	数值型
信用风险敞口	cred_risk_epsu_sum	存在信用风险敞口业务的信用风险敞 口的合计值	数值型
做市衍生品持仓净 敞口	deri_hldp_net_epsu _mkt	做市业务名下未被对冲的风险暴露	数值型
场外衍生品持仓净 敞口	deri_hldp_net_epsu _otc	场外业务名下名下未被对冲的风险暴 露	数值型
期现衍生品持仓净 敞口	deri_hldp_net_epsu _ftursp	期现业务名下名下未被对冲的风险暴 露	数值型
做市累计综合损益	aggr_cmps_loss_mkt	做市业务本年累计盈亏	数值型
场外累计综合损益	aggr_cmps_loss_otc	场外业务本年累计盈亏	数值型
期现累计综合损益	aggr_cmps_loss_ftu rsp	期现业务本年累计盈亏	数值型

做市资金占用规模	cptl_occp_scal_mkt	做市业务所占用的资金总额	数值型
场外资金占用规模	cptl_occp_scal_otc	场外业务所占用的资金总额	数值型
期现资金占用规模	cptl_occp_scal_ftu rsp	期现业务所占用的资金总额	数值型
资金占用规模	cptl_occp_scal_sum	做市业务、场外业务和期现业务 3 个 业务条线所占用的资金总额	数值型

表 19 做市业务持仓表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
交易账户	trd_acc_mkt	用于在中国期货市场监控中心投资者查询 服务系统查询的用户名	字符型
客户账号	cust_num_mkt	在各期货公司开立的账户账号	字符型
品种	var	持仓合约对应的期货品种	字符型
合约	cont	持仓期货（期权）合约代码	字符型
买持仓手数	buy_hldp_lot	单个期货期权合约买持仓数量	数值型
卖持仓手数	sell_hldp_lot	单个期货期权合约卖持仓数量	数值型
合约资金占用 规模	cptl_occp_scal_co nt	单个期货期权合约占用的保证金	数值型
合约名义本金	nmpr_mkt_cont	期货期权单个合约对应的标的规模	数值型
合约 delta 敞 口	delta_epsu_mkt_co nt	单个合约多空轧差后的净敞口规模	数值型
合约 gamma 敞 口	gamma_epsu_mkt_co nt	单个期货期权合约 delta 相对于基础资产 价格变动的敏感性度量	数值型
合约 vega 敞口	vega_epsu_mkt_con t	单个期货期权合约价格相对于基础资产 价格波动率变动的敏感性度量。	数值型

表 20 做市业务日盈亏表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
交易账户	trd_acc_mkt	用于在中国期货市场监控中心投资者查询 服务系统查询的用户名	字符型
客户账号	cust_num_mkt	在各期货公司开立的账户账号	字符型
账户资金占 用规模	cptl_occp_scal_acc	单个账户所有用于建仓而被冻结的保证金 总和	字符型
当日持仓盈 亏	tdy_hldp_pl	按逐日盯市计算的当日期货持仓盈亏	字符型

当日平仓盈亏	tdy_position_pl	按逐日盯市计算的当日期货平仓盈亏	数值型
权利金收入	righ_amount_incm	当日卖出期权合约获得的金额	数值型
权利金支出	righ_amount_out	当日买入期权合约支付的金额	数值型
多头期权市值	lpos_opt_mval	买持仓期权按当日结算价计算的市值	数值型
空头期权市值	spos_opt_mval	卖持仓期权按当日结算价计算的市值	数值型
上日多头期权市值	day_lpos_opt_mval	上一交易日买持仓期权按上一交易日结算价计算的市值	数值型
上日空头期权市值	day_spos_opt_mval	上一交易日卖持仓期权按上一交易日结算价计算的市值	数值型
手续费	chag	当日交易产生手续费	数值型
账户当日盈亏	tdy_pl_mkt	按逐日盯市计算的单个交易账户当日合计盈亏	数值型
做市奖励	rew_mkt	因完成交易所做市义务获得的交易所奖励	数值型

表 21 场外业务持仓表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
交易编号	trd_no	场外交易合约的交易编号，具有唯一性	字符型
业务分类	busi_clas	根据交易类型内部对交易进行业务分类，名称由子公司场外交易员在交易确认时录入	字符型
具体项目	body_proj	具体项目名称	字符型
交易对手	trd_cntp	交易对手名称	字符型
买卖方向	buy_sler	衍生品的买卖方向	字符型
期权性质	opt_char	衍生品的结构或类型	字符型
挂钩品种	link_var	持仓挂钩标的合约的品种代码	字符型
标的合约	subj_cont	挂钩的标的合约的代码	字符型
合约名义本金	nmpr_otc_cont	单个合约对应的标的规模	数值型

合约权利金收入	righ_amount_incm_otc_cont	当日开仓时买卖期权的权利金收支，其中收入为“+”，支付为“-”	数值型
累计浮动盈亏	aggr_flot_pl_otc_cont	该笔持仓从交易开始至持有当日的浮动盈亏	数值型
合约资金占用规模	cptl_occp_scal_otc_cont	仅指场内对冲头寸的保证金占用资金之和	数值型
合约 delta 敞口	epsu_delta_amt_otc_cont	单个合约多空轧差后的净敞口规模	数值型
合约 gamma 敞口	epsu_gamma_amt_otc_cont	单个合约 delta 相对于基础资产价格变动的敏感性度量	数值型

表 22 场外业务日盈亏表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
持仓类型	hldp_type_otc	根据场外业务对持仓类型进行分类，目前包括场外期权、远期/掉期、互换、场内对冲、月末估值调整	字符型
场内对冲当日持仓盈亏	tdy_hldp_pl_exch_hedg	按逐日盯市计算的场外业务场内期货持仓的当日持仓盈亏合计	数值型
场内对冲当日平仓盈亏	tdy_position_pl_exch_hedg	按逐日盯市计算的场外业务场内期货持仓的当日平仓盈亏合计	数值型
场内对冲当日盈亏	tdy_pl_exch_hedg	按逐日盯市计算的场外业务场内期货期权持仓的当日盈亏合计	数值型
场外期权当日持仓盈亏	tdy_hldp_pl_otc_opt	按逐日盯市计算的场外期权当日持仓盈亏	数值型
场外期权当日平仓盈亏	tdy_position_pl_otc_opt	按逐日盯市计算的场外期权当日平仓盈亏	数值型
场外期权当日盈亏	tdy_pl_otc_opt	当日持仓盈亏_场外期权+当日平仓盈亏_场外期权	数值型
互换当日持仓盈亏	tdy_hldp_pl_swap	按逐日盯市计算的互换当日持仓盈亏	数值型
互换当日平仓盈亏	tdy_position_pl_swap	按逐日盯市计算的互换当日持仓盈亏	数值型
互换当日盈亏	tdy_pl_swap	按逐日盯市	数值型
远期/掉期当日持仓盈亏	tdy_hldp_pl_fwd_swap	按逐日盯市计算的远期掉期当日持仓盈亏	数值型
远期/掉期当日平仓盈亏	tdy_position_pl_fwd_swap	按逐日盯市计算的远期掉期当日持仓盈亏	数值型
远期/掉期当日盈亏	tdy_pl_fwd_swap	当日持仓盈亏__远期掉期+当日平仓盈亏__远期掉期	数值型

调整项当日持仓盈亏	tdy_hldp_pl_adj	按逐日盯市计算，根据业务实质需对当日持仓盈亏的调整项，包括但不限于月末估值调整	数值型
调整项当日平仓盈亏	tdy_position_pl_adj	按逐日盯市计算，根据业务实质需对当日持仓盈亏的调整项，包括但不限于月末估值调整	数值型
调整项当日盈亏	tdy_pl_adj	按逐日盯市计算，根据业务实质需对当日盈亏的调整项，包括但不限于月末估值调整	数值型

表 23 场外业务客户资金表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
报告主体名称	rptl_pty_nam	报告主体的名称	字符型
报告主体的统一社会信用代码	rptl_pty_unif_soci_cred_cd	报告主体的统一社会信用代码	字符型
结算日期	clea_date	当天交易结算日期	字符型
交易对手方名称	trd_cutp_nam	截至结算当日场外业务所有已开户的交易对手方名称（不包括已销户和休眠）	字符型
交易对手方的统一社会信用代码	trd_cutp_unif_soci_cred_cd	交易对手方的统一社会信用代码	字符型
子公司给对手方的狭义授信额度	corp_cutp_crdt_lmt	风子公司给交易对手方的授信额度，在授信额度范围可以免收取保证金和权利金	数值型
对手方可后付的权利金额度	cutp_avl_aft_righ_amt_val	子公司仅授信交易对手方可以后支付权利金的额度	数值型
已使用子公司给的狭义授信额度	has_use_corp_crdt_lmt	若获得授信的交易对手可用资金为负数，则可用资金未超过授信额度的部分即为其授信金额占用	数值型
持仓权利金支出（后付）	hldp_righ_amount_out_aft	在后付权利金额度内，子公司应支出而未支付给对手方的权利金之和	数值型
对手方给子公司的狭义授信额度	cutp_corp_crdt_lmt	交易对手方给子公司授信免交保证金和权利金的额度	数值型
子公司可后付的权利金额度	corp_avl_aft_righ_amt_val	对手方仅授信子公司可后支付权利金的额度	数值型
已使用对手方给的狭义授信额度	has_use_cutp_crdt_lmt	已使用对手方给的狭义授信额度	数值型
持仓权利金收	hldp_righ_amount_incm	在额度内，对手方应交而未交的持仓	数值型

入（后付）	_aft	权利金收入之和	
期初结存	bgng_bal	上一个交易日的期末结存	数值型
当日出入金	tdy_out_in_amount	当日该交易对手方入金（正）和出金（负）的净额	数值型
当日终止收益	tdy_end_payf	对手方当日除期权平仓以外的逐笔平仓盈亏 + 期权平仓权利金收支 + 当日期权行权收益	数值型
当日开仓权利金收支	tdy_opep_righ_amount	与该对手方当日进行期权开仓时应收和应付的权利金之差	数值型
期末结存	end_bal	期初结存 + 出金入金 + 成交（开仓时权利金）收支 + 了结收支	数值型
追保模式	add_marg_md1	定义为4个固定可选项：子公司向对手方单向追保、对手方向子公司单向追保、子公司和对手方双向追保、其他。	字符型
追保到账时间	add_marg_arvd_time	“T+数字”或“不适用”，表示子公司T日追保后要求的最晚追保到账时间，“不适用”代表双方未约定追保到账时间条款	字符型
对手方保证金占用	cutp_marg_occp	在子公司的保证金算法下，应收对手方的保证金占用总额（以实际追保通知对应的保证金占用为准）	数值型
子公司保证金占用	corp_marg_occp	对手方应收子公司的保证金占用总额	数值型
可用资金	avl_cpt1	当日可用于达成新交易的资金规模，可用资金 = 期末结存 - 保证金占用	数值型
可取资金	avl_draw_cpt1	当日结算后未被占用的可出金取出的资金	数值型
应追加资金	appd_cpt1	期末结存、应付交易款、质押市值、授信额度先后抵扣保证金占用后不足以抵扣的部分	数值型
持仓市值	hldp_mval_otc_cont	当日与该交易对手方存续交易的持仓估值之和。	数值型
市值权益	mval_equi	期末结存 + 质押市值 + 持仓市值	数值型

表 24 客户授信管理

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
授信状态	crdt_stat	客户的授信状态，包括有效、无效	字符型
客户编号	cust_no	客户的编号	字符型
客户名称	cust_nam_otc	客户的全称	字符型
授信额度	crdt_lmt	子公司给予客户的授信额度	数值型

授信使用情况	crdt_use_situ	子公司给予客户的授信额度使用情况	字符型
授信生效日期	crdt_tect_date	子公司给予客户授信的生效日期	字符型
授信到期日期	crdt_matu_date	子公司给予客户授信的到期日期	字符型
评级主体	rat_pty	对授信客户进行内部信用评级的实际主体	字符型
评级主体信用代码	rat_pty_cred_cd	对授信客户进行内部信用评级的实际主体的 16 位信用代码	字符型
内部评级	inr_rat	给予子公司授信客户的内部信用评级结果	字符型
内评生效日期	inr_tect_date	给予子公司授信客户内部信用评级的生效日期	字符型
内评到期日期	inr_matu_date	给予子公司授信客户内部信用评级的到期日期	字符型

表 25 客户清单表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
客户编号	cust_no	客户的编号	字符型
客户名称	cust_nam_otc	客户的全称	字符型
联系人姓名	comp_name	客户指定的联系人姓名	字符型
联系人证件类型	comp_cert_type	客户指定的联系人身份证明证件	字符型
联系人证件号码	comp_cert_num	客户指定的联系人证件号码	字符型
联系人邮箱	comp_email	客户指定的联系人邮箱	字符型
机构名称	org_nam	客户所属的机构全称	字符型
法定代表人姓名	rep_oper_name	机构客户的法定代表人	字符型
法定代表人身份证	rep_oper_id_cert	客户的法定代表人身份证号码	字符型
证照类型	cert_type	默认为营业执照	字符型
证照编号	cert_no	证照号码	字符型
行业	indt	客户所属行业	字符型
资信评级	capital_rat	子公司对客户的资信评级结果，分为低风险、中风险、高风险	字符型
客户状态	cust_stat	客户最新的账状态，分为已开户、已销户、已休眠	字符型
客户状态变更时间	cust_stat_altr_time	客户最近一次变更状态的时间	字符型

表 26 期现业务持仓表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
项目（子账户）	proj_acc_ftursp	开展期现业务开立的账户号	字符型

类型	type_fturisp	期现业务持仓所属的金融资产类型，包括但不限于期货、期权、现货、仓单、场外期权、远期等	字符型
品种代码	var_cd	持仓对应的品种代码	字符型
品种名称	var_nam	持仓对应的品种中文名称	字符型
合约代码	cont_cd	持仓对应的合约代码	字符型
合约名称	cont_nam	持仓合约代码对应的中文全称	字符型
多头持仓数量	lpos_fturisp_cont	若类型为”现货“，则为持有现货的吨数； 若类型为”期货“或”期权“，则为合约买持仓手数	数值型
多头持仓名义本金	lpos_hldp_nmpr_fturisp_cont	期现业务各持仓合约的多头名义本金	数值型
空头持仓数量	spos_fturisp_cont	若类型为”现货“，则填充为”0.00“ 若类型为”期货“或”期权“，则为合约卖持仓手数	数值型
空头持仓名义本金	spos_hldp_nmpr_fturisp_cont	期现业务各持仓合约的空头名义本金	数值型
净头寸	net_pstn_fturisp_cont	期现业务多空轧空后的持仓数量或手数	数值型
净头寸持仓名义本金	net_pstn_hldp_nmpr_fturisp_cont	期现业务多空轧空后的净头寸对应的名义本金	数值型
名义本金	nmpr_fturisp_cont	期现业务各合约空头名义本金与多头名义本金之和	数值型
合约 delta 敞口	epsu_delta_fturisp_cont	单个合约多空轧差后的净敞口规模	数值型
合约 gamma 敞口	epsu_gamma_fturisp_cont	单个合约 delta 相对于基础资产价格变动的敏感性度量	数值型

表 27 期现业务日盈亏表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
项目（子账户）	proj_acc_fturisp	开展期现业务开立的账户号	字符型
类型	type_fturisp	期现业务持仓所属的金融资产类型，包括但不限于期货、期权、现货、仓单、场外期权、远期等	字符型
账户资金占用规模	cptl_occp_scal_acc	单个账户所占用的资金总额	数值型
当日持仓盈亏	tdy_hldp_pl_fturisp_ac	按逐日盯市计算的期现单账户当日	数值型

	c	持仓盈亏	
当日平仓盈亏	tdy_position_pl_fturs p_acc	按逐日盯市计算的期现单账户当日 平仓盈亏	数值型
权利金收入	righ_amount_incm	卖出期权合约获得的金额	数值型
权利金支出	righ_amount_out	买入期权合约支付的金额	数值型
多头期权市值	lpos_opt_mval	买持仓期权按当日结算价计算的市 值	数值型
空头期权市值	spos_opt_mval	卖持仓期权按当日结算价计算的市 值	数值型
上日多头期权 市值	day_lpos_opt_mval	上一交易日买持仓期权按当日结算 价计算的市值	数值型
上日空头期权 市值	day_spos_opt_mval	上一交易日卖持仓期权按当日结算 价计算的市值	数值型
手续费	chag	单个账户交易产生手续费	数值型
账户当日盈亏	tdy_pl_ftursp	单个期现账户的当日盈亏合计	数值型
期现奖励与返 还	rew_retu_ftursp	获得的交易所奖励与返还	数值型

表 28 现货购销存明细表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
购进时间	bin_time	购进合同约定的购入时间	字符型
销货单位	sout_unit	购进合同约定的采购单位	字符型
购进合同编号	agmt_no	购进合同上的合同编号	字符型
品种名称	var_nam	购进合同约定的采购品种	字符型
品种代码	var_cd	购进合同约定的采购品种对应的场内品 种代码	字符型
主连合约代码	main_cont_cd	品种对应的主连合约代码(同花顺代码)	字符型
规格类型	spec_type	购进合同约定的采购品种规格	字符型
生产商	mfrs	购进合同约定的采购货物的生产商	字符型
存货公司	inv_corp	采购货物的存货公司	字符型
存货地址	inv_addr	采购货物的存货地址	字符型
购进含税单价	bin_tax_unpr	采购货物的购进含税单价	数值型
购进含税数量	bin_tax_vol	采购货物的购进含税数量	数值型
购进含税金额	bin_tax_amt	采购货物的购进含税金额	数值型
购进不含税单价	bin_no_tax_unpr	采购货物的购进不含税单价	数值型
购进不含税金额	bin_no_tax_amt	采购货物的购进不含税金额	数值型
购进税金(13%)	bin_tax_one_three	采购货物的购进税金, 固定为 13%	数值型
销出合同编号	sout_agmt_no	销出合同上的合同编号	字符型
销出合同编号	sout_agmt_no	销出合同上的合同编号	字符型
销出合同签约日 期	sout_agmt_sign_da te	销出合同约定的销售时间	字符型

销出单位	sout_unit	销出合同约定的销售单位	字符型
销出含税单价	sout_tax_unpr	销售货物的销出含税单价	数值型
销出含税数量	sout_tax_vol	销售货物的销出含税数量	数值型
销出含税金额	sout_tax_amt	销售货物的销出含税金额	数值型
销出不含税单价	sout_no_tax_unpr	销售货物的销出不含税单价	数值型
销出不含税金额	sout_no_tax_amt	销售货物的销出不含税金额	数值型
销出税金（13%）	sout_tax_one_thre e	销出货物的销售税金，固定为 13%	数值型
库存数量	inv_vol	购进销轧差后各货物在公司的库存数量	数值型
库存金额	inv_amt	购进销轧差后各货物在公司的库存金额	数值型
转成本	tran_cost	销售货物的不含税采购金额	数值型
暂估毛利	est_gp	在未完全确定销售收入和成本时，对预期利润进行的初步估算	数值型

表 29 金融资产表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
核算单位	acco_unit	金融资产、股权等资产归属的单位	字符型
证券名称	scr_nam	持仓证券全称	字符型
证券代码	scr_cd	持仓证券在交易所、银行间或场外市场交易的代码	字符型
金融资产类别	fin_ast_clas	根据指定规则，判断持仓证券归属的金融资产类别	字符型
资产会计分类	ast_clas	根据并表规则判断持仓证券所属的资产会计分类	字符型
币种	crcc	金额的计量币种	字符型
数量	vol	持仓证券的数量。单位为“股、份、张”，其中股票为“股”，基金为“份”（面额 1 元，部分债券 ETF 等除外），债券为“张”	数值型
成本	cost	持仓证券的初始投资成本	数值型
市值	mval	持仓证券持有市值，不考虑流动性折扣	数值型
公允价值	fair_val	持仓证券考虑流动性折扣后的估值 公允价值=账面净值+利息调整+应收利息+公允价值变动	字符型
总份额	tot_shr	持有证券总份额。单位为“股、份、张”，其中股票为“股”，基金为“份”（面额 1 元，部分债券 ETF 等除外），债券为“张”	数值型
是否有效对冲	is_eff_hedg	是或否	字符型
发行人	issr	资管产品的管理人、债券的发行主体	字符型
是否为合并的结构化主体	is_merg_stru _pty	合并财务报表中纳入的结构化主体，需要根据具体的会计准则、发起人的控制权以及结构化主体的性质和目的等因素进行综合判断。	字符型

投资策略	ivsm_stra	根据交易目的和指定规则，判断投资策略。	字符型
产品分类	pd_clas	针对金融资产类别为集合理财、专户理财、单一产品、信托产品进行再分类，包括：其他现金类管理产品、赎回受限、赎回不受限	字符型
数据来源	data_src	说明数据可以从哪个业务系统	字符型
负责人	nega_oper	列明提供数据的负责人	字符型
资产业绩基准代码	ast_perf_basi_cd	针对基金、资管计划、理财产品、信托产品填写包含后缀的基准代码。	字符型

表 30 金融衍生品表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
核算单位	acco_unit	金融资产、股权等资产归属的单位	字符型
部门名称	dept_nam	衍生品持仓所归属业务部门	字符型
交易所代码	exch_cd	持仓衍生品或其标的所属交易所对应的代码	字符型
交易所	exch	持仓衍生品或衍生品标的的所属的交易所全称	字符型
衍生品代码	deri_cd	场内持仓：期货、期权合约代码 场外持仓：场外期权、互换、远期的交易编号；现货的品种代码	字符型
衍生品名称	deri_nam	持仓衍生品的全称	字符型
金融资产类别	fin_ast_clas	根据指定规则，判断持仓证券归属的金融资产类别，包括但不限于：股指期货、国债期货、商品期货、场内权益期权、场内非权益期权、场外权益期权、场外非权益期权、大宗商品、权益互换、商品互换	字符型
买卖方向	buy_sler	我方的交易方向，分为买和卖两种情况	字符型
多空标志	flag	若价格上涨对我方有利，则为多头；若价格下跌对我方有利，则为空头	字符型
C/P	c_p	仅适用于期权，CALL 为看涨期权，PUT 为看跌期权	字符型
合约名义价值	cont_nomn_val	衍生品合约标的资产的规模	数值型
delta 金额	amt	衍生品合约相对基础资产价格变动的敏感性度量指标。	数值型
权利金价格	righ_amount_prc	持仓期权的成本，即成交时需支付或收到的权利金。	数值型
场外期权最大损失	otc_opt_max_loss	仅适用于场外期权且买卖方向为卖的衍生品持仓。 指不利方向一个停板后期权被行权导致的我方损失，若买卖方向为买，则为 0	数值型
交易对手名称	trd_cntp_nam	与我方开展业务的交易对手的全称，仅适用于场外交易，不适用于场内有中央交易	字符型

		对手方的交易	
交易对手证件类型	trd_cntp_cert_type	交易对手的有效身份证明	字符型
交易对手证件号	trd_cntp_cert_num	交易对手的统一信用代码	字符型
交易账户	trd_acc	用于场内交易的账户	字符型
数量	vol_der_i_cont	持仓合约的合计数量。其中期货期权为手数，场外期权为张数，互换、远期为标的资产的数量，现货为其重量（单位为吨）	数值型
衍生品合约标的代码	der_i_cont_subj_cod	持仓衍生品的标的合约代码	字符型

表 31 股权投资表

数据中文名	数据英文名	字段说明	数据类型
核算单位	acco_unit	金融资产、股权等资产归属的单位	字符型
是否为合并的结构化主体	is_merg_strupty	合并财务报表中纳入的结构化主体，根据具体的会计准则、发起人的控制权以及结构化主体的性质和目的等因素进行综合判断	字符型
被投资单位	ivsm_unit	股权投资的单位全称	字符型
持有比例%	hold_rati	持有被投资单位的股份比例	数值型
初始成本	Init_cost	股权投资的初始投资成本	数值型
账面价值	val	股权投资的账面价值	数值型
分类	clas	根据股权投资情况和财务账务处理方式，指定规则进行分类	字符型
申万一级行业	Pri_indt	股权投资单位所属的申万一级行业	字符型
股东回购情况	repo_situ	若有股东购回则填写，无则不填写	字符型

5 应用系统交互规范

当源端系统发生与全面风险管理相关的业务逻辑变更、数据表结构调整时，源端系统管理部门须提前 5 个工作日告知公司风险管理部与信息技术部。

全面风险管理系统的需求对接归口部门为公司风险管理部，凡涉及全面风险管理系统的需求，均须经公司风险管理部审核同意。因监管检查等临时性工作需采集全面风险管理相关数据的，须通过数据专项审批流程审批通过后，由系统业务管理人员或运维人员按照协商确定的数据口径进行查询并提供，严禁私自导出、传播业务数据。

从全面风险管理系统获取数据，原则上不得直接连接数据库，统一通过数据中台 ODS 抽取数据或通过封装 API 接口访问。