

证券公司分支机构监管报送数据口径 规范化研究

【摘要】 本课题以证券经营机构监管报送指标数据为研究基础，坚持业务为导向，通过“主题层-指标层-报送层”三层模型与“指标+维度”建模方法，有效提升机构对监管要求的理解一致性与执行敏捷性。为确保数据标准的落地实效，课题围绕“组织协同机制、质量管控规范、平台化落地实施”，建设以“业务为导向、多部门协同、技术可承载”的数据标准应用体系，提升证券经营机构数据治理能力。本课题研究过程中提取指标数据管理经验，建立一套可落地、可复用的证券经营机构监管报送指标数据管理指南。

关键词： 监管报送； 指标数据管理； 维度建模。

目 录

一、 引言	3
(一) 研究背景	3
(二) 研究目标	4
(三) 研究意义	5
(四) 研究价值	6
二、 研究方法	8
(一) 文献研究法	8
(二) 调研访谈法	9
(三) 技术验证法	9
(四) 专家论证法	9
三、 研究结果	9
(一) 现状分析与梳理	9
(二) 数据标准体系设计	17
(三) 数据标准应用设计	55
四、 研究结论与建议	61
(一) 研究成果	61
(二) 未来展望	62
参考文献	65

正文

一、引言

（一）研究背景

近年来,随着我国资本市场监管体系的不断完善与细化,证券期货业对机构数据报送的及时性、准确性和规范性提出了更高要求。监管数据作为风险识别、市场监测和合规管理的重要依据,其质量与标准化程度直接影响监管效能与行业健康发展。证监会及地方证监局围绕监管数据治理密集出台政策与标准:《证券期货业数据模型》明确了数据分类与实体关系框架,《证券期货业基础数据元规范第1部分:基础数据元》统一了核心数据元的定义与口径,《证券经营机构数据报送接口规范》《证券公司分支机构数据报送接口规范》等细化了数据传输与交互要求,为证券行业监管数据报送提供了顶层指引。

本课题以证券经营机构的监管报送为基础,系统分析当前证券经营机构在监管数据报送过程中存在的共性问题与挑战,旨在构建一套科学、系统、可推广的证券经营机构监管报送指标数据管理指南。本课题通过构建快速响应监管变化的数据标准规范体系,系统提升数据治理能力,形成“主题层-指标层-报送层”三层模型架构,将监管规则高效转化

为证券经营机构数据资产，实现监管合规要求与数据资产的有机衔接，为行业提供可复用、可扩展的数据标准应用实践参考。

（二）研究目标

本课题围绕实施路径、架构搭建、动态适配、价值转化四大维度开展研究，具体目标如下：

1. 构建可落地的数据标准实施路径

通过明确数据定义、业务口径、格式约束与取值规则的落地方法与责任机制，指导总部与分支机构在系统配置、数据加工与报送执行中实现语义对齐，确保监管数据在执行侧内部的逻辑一致、执行统一。

2. 建立模型驱动三层标准架构

建立“主题层—指标层—报送层”联动的数据标准模型，将监管接口要求与执行侧内部业务逻辑有机衔接，实现指标定义的高复用性、维度组合的灵活性与报送映射关系的清晰性。

3. 强化监管动态适配能力

确保指标数据定义在语义、结构和逻辑上严格对标现行监管规范，并具备对监管规则新增、调整或细化的快速响应能力，支撑敏捷合规。

4. 推动监管标准向业务价值转化

将“指标+维度”标准化成果延伸复用于风险管理、经营分析、绩效考核等内部场景，实现监管合规成果向企业级数据资产的有效转化，赋能业务决策与管理提升。

（三）研究意义

本课题通过与浙江证监局联合研究，以证券经营机构总部及分支机构的监管数据报送作为研究对象，开展深入的差异分析和口径梳理，为制定一体化的监管数据标准框架提供实践经验，形成证券经营机构监管报送指标数据管理指南，具有重要的理论价值与实践意义。

在理论层面，课题组通过系统开展数据标准及数据模型的结构化设计，将监管数据要求转化为证券经营机构可执行的落地实施标准，有效支持机构落实监管数据治理工作。在此基础上，课题组研究构建“主题层-指标层-报送层”三层联动的数据标准框架，创新性应用“指标+维度”矩阵建模方法及监管数据中台分层架构，为实现数据统一整合、质量可控和自动化报送提供了可落地的技术路径。

在实践层面，课题组研究形成了一套源于业务、对标监管要求、具备动态适应能力的监管报送指标数据管理框架。基于该框架，通过权威的指标定义与可配置的维度组合，能

够快速响应监管规则的新增、调整或细化。同时，该框架也具备向风险管理、经营分析、绩效评估等不同应用场景延伸复用的基础特性，进一步推动监管合规成果转化为企业级数据资产，为证券经营机构构建跨业务、可复用的统一数据能力奠定坚实基础。

（四）研究价值

本课题遵循“价值导向、模型构建、实践验证、规范输出”的研究理念，通过对证券经营机构监管数据报送场景的深入剖析，系统性梳理证券经营机构在监管报送过程中存在的对监管要求理解的差异与不足，并基于现状设计了覆盖全业务域的数据标准体系，利用维度建模的方法对指标数据进行结构化定义与参数化表达，提升标准的复用性与灵活性，形成一套逻辑清晰、语义统一、可扩展的监管报送指标数据管理框架。课题组通过实践验证与迭代优化，输出适用于证券经营机构多层次、多类型监管报送需求的数据标准框架与数据应用模型，通过“指标+维度”建模，实现对监管规则动态调整的快速响应能力，为行业提供可复制、可推广的管理指南。

1. 业务引领理论创新

本课题研究以提升证券经营机构内部对监管报送要求的

标准化响应能力为核心，通过“两轴双翼，以面带全”的研究模式开展课题研究。其中，“两轴”指业务轴与数据生命周期轴；以业务场景的识别与分析为起点，围绕监管报送需求，开展从标准框架设计、数据模型构建、维度体系设计到报送落地实践的全链条标准体系构建。“双翼”指总部与分支机构数据报送场景的协同分析；通过系统梳理数据口径、指标逻辑和报送映射的现状与共性挑战，提炼形成统一的数据标准规范。通过制定可复制、可推广的监管数据标准体系落地实施路径，为证券经营机构内部开展数据标准体系建设做好实施指引。

2. 落地引导技术创新

课题组通过构建“主题层-指标层-报送层”三层联动的数据标准框架，纳入兼具适配性与扩展性的“指标+维度”矩阵模型，并创新性地将其应用在监管报送领域。通过维度拆解、属性标准化与规则参数化，实现指标定义在多种报送类型中的快速适配与复用，以满足监管报送的灵活性和时效性要求，整体提升证券经营机构对监管政策变化的响应效率。

3. 实践领航体系创新

本课题研究的监管数据标准体系落地实施路径，其底层数据定义与模型结构与证券经营机构的业务流程密不可分，天然具备业务可解释性与可操作性，具备对监管规则新增、

调整或细化的快速响应能力。因此，研究成果在满足当前监管合规要求的同时，可延伸应用于内部经营分析、风险监测、绩效管理等不同应用场景，实现监管标准资产向企业级数据资产转化，为后续业务拓展提供可复用、可扩展的数据基础。

二、研究方法

为实现研究目标，本课题采用了多层次、系统化的研究方法：一是通过规范性文件研读，确立研究的基础框架与规范依据；二是开展实地调研与问卷访谈，广泛收集证券经营机构的需求反馈与实践建议；三是围绕“指标+维度”矩阵建模方法的落地可行性进行验证；四是结合专家论证评审意见，对核心研究成果进行持续优化与完善。

（一）文献研究法

系统归集与研究课题相关的规范性文件，分析与实际业务活动的关系，并对其进行整理和分析，按照以下步骤展开。

1. 收集整理证券行业规范性文件，作为数据标准规范制定的依据和基础。根据文件的效力层级与来源，可划分为国家标准、部门规章与行业研究三个层次。

2. 基于规范性文件对证券经营机构的业务体系进行分析梳理，形成覆盖全面、层次清晰的分类体系，为后续标准规范建设提供业务框架支撑。

3. 基于数据标准框架，构建三层数据标准模型。在此基础上，同步参考国家及金融行业编码规范，制定公司级统一标准编码规则，确保数据标准的规范性、扩展性与可落地性。

（二）调研访谈法

针对证券经营机构开展调研，通过实地走访、线上交流、问卷调研等多元方式，聚焦“报送周期、制表现状、数据口径及质量管控”等核心要素，收集各家机构的反馈与建议。

（三）技术验证法

对研究提出的“指标+维度”矩阵模型技术方案，结合证券经营机构监管报送系统建设进行可行性验证，确保方案落地实施的可行性。

（四）专家论证法

邀请行业专家、证券经营机构一线人员及监管机构专家等组成论证组，对研究过程中的核心成果进行评审，并持续优化完善研究成果。

三、研究结果

（一）现状分析与梳理

为深入贯彻落实中国证监会关于证券行业数据治理与监管报送的规范性要求，切实提升证券经营机构数据报送质量

与监管协同效能，本课题聚焦于证券经营机构监管数据标准体系落地实施路径的设计与制定，以《证券经营机构数据报送接口规范》《证券公司分支机构数据报送接口规范》《证券期货业基础数据元规范第1部分：基础数据元》等核心监管文件和行业标准为基准，紧扣监管合规性、业务一致性、标准可操作性的核心设计原则，聚焦当前证券行业数据报送中存在的共性问题，系统性构建覆盖全业务域、可落地执行的监管报送指标数据管理指南，推动监管要求精准落地、业务口径全局统一、系统数据协同一致。

本课题研究严格遵循“唯一性、通用性、前瞻性、可扩展性、稳定性和可行性”六大基本原则，研究成果既确保现行监管规则的严格执行，又为未来业务创新预留适配空间。针对证券行业数据来源分散、标准不统一、映射关系不明晰等痛点，课题组采用了“自上而下对标监管+自下而上梳理业务”的双向驱动方法，系统化梳理数据标准落地实施步骤，设计并定义统一的数据名称、业务含义、格式规范等，确保各业务系统与监管报送要求在语义和逻辑层面保持一致。

具体分为三个关键步骤：

步骤一，全面调研。通过系统化摸底，全面梳理业务现状与监管要求的衔接点，准确把握当前数据管理实际情况与监管规范之间的对应关系，为标准设计提供基础输入。

步骤二，报送口径差异分析。基于调研结果，识别并归因为“计算规则差异、数据来源差异、统计维度差异、事件认定标准不一致”等问题，为制定具有针对性和普适性的标准规范提供依据。

步骤三，数据标准梳理与规范制定。通过构建覆盖监管报送全业务域的统一标准体系，逐层拆解监管接口规范与内部业务逻辑的映射关系，着力解决数据定义模糊、理解歧义等核心矛盾，最终形成结构清晰、语义明确、技术可实现的数据标准规范，包括统一的数据定义、格式、取值范围和业务规则。

本课题遵循“两轴双翼，以面带全”的研究模式，监管数据标准体系落地实施路径的设计与制定工作将同步覆盖证券经营机构全业务域。

1. 现状调研

课题组以证券经营机构为调研核心对象，紧密围绕《证券经营机构数据报送接口规范》《证券公司分支机构数据报送接口规范》中明确的运营情况、财务信息，以及经纪业务、信用业务、资产管理业务、柜台业务、自营业务等各大业务条线，采用业务访谈、系统探查和文档分析等调研方式，系统梳理当前数据报送的口径理解差异与执行痛点，为监管报送数据标准规范化的有效落地提供实证支撑。

（1）业务访谈

面向 35 家证券经营机构，组织一线业务人员、合规管理人员及 IT 支持人员开展系统性调研，课题组通过问卷收集、现场访谈等形式收集实践中的报送口径理解与执行情况，梳理形成差异分析底稿，为数据标准定义提供重要输入。

（2）系统探查

为了识别标准规范在公司核心系统的适配性，检查跨系统的一致性以及数据在流转过程中是否具备统一的技术约束条件，课题组面向包括柜台系统、财务系统和监管报送系统在内的核心系统开展探查工作，重点解析数据表结构、字段定义、取值规则及系统间关联逻辑，为标准化技术实现路径提供依据。

（3）文档分析

系统归集与研究课题相关的规范性文件，分析与实际业务活动的关系，并对其进行整理和分析，本课题设计方案将现有的相关规范性文件进行三个层次的分类梳理：

国家标准，指由国家标准化管理委员会批准发布，在全国范围内统一的标准，是我国最高级别的技术法规和准则。

部门规章，指中国证监会等行业监管部门发布规定或规范性文件。

行业研究，指证券行业相关专业机构或同业机构在监管

数据标准建设等领域发布的方法论、实践案例或可参考的指引性文件。

以上三个层次的规范性文件初期共梳理 48 个。按照重要性和相关性等进行整理后,共有 23 个规范性文件应用到此次数据标准落地实施研究中(如表 1 所示)。

表 1 规范性文件整理情况

规范性文件	发布单位	数量
国家标准	国家市场监督管理总局、国家标准化管理委员会	4
部门规章	中国证券监督管理委员会	14
行业研究	中信建投证券股份有限公司	2
	中泰证券股份有限公司	1
	中证机构间报价系统股份有限公司	1
	明朝万达科技股份有限公司	1

在上述规范性文件的研究基础上,课题组进一步分析证券经营机构监管报送现状,识别最具代表性的研究对象。证券经营机构监管数据报送体系呈现报送对象多、报表数量大以及业务覆盖广的显著特征。

据不完全统计,证券经营机构需向中国证监会等 13 个主要监管单位报送 765 个监管报表接口,其中向证监会报送的报表接口达 489 个,占比 64%。这些报表业务覆盖广,涵盖资产管理、证券经纪、信用交易、场外衍生品等核心业务条

线，且监管报送指标数据关联度高，因此强化其规范性、统一性与复用性至关重要。课题组以监管报送指标数据为核心研究对象，摸排数据报送中的口径理解差异现状，为后续制定统一规范、可落地的数据标准提供扎实的一线依据。

2. 差异分析

为系统性评估机构数据报送标准的实际理解与执行情况，本次调研以证券经营机构为核心对象，课题组聚焦于报送周期、制表机制、报送方式、数据口径及潜在风险等关键环节，系统梳理了经营机构在标准应用过程中存在的理解偏差。

《证券经营机构数据报送接口规范》《证券公司分支机构数据报送接口规范》等监管文件已对报送字段名称、格式及基本业务含义作出标准规定，但证券经营机构在实际执行过程中，由于缺乏企业级统一的数据标准管理体系与精细化的指标数据管理机制，仍有部分数据指标存在“同名不同义”“同义不同名”“统计逻辑隐含歧义”等共性问题，导致部分监管报送数据可能在实际填报执行中出现偏差，影响数据一致性。

据此，课题组梳理总结了各机构在监管报送数据理解和应用中的典型问题，具体如下：

第一，同一监管字段在总部与分支机构间存在“同名不同义”现象，反映出指标数据管理尚需进一步精细化。监管

报送接口规范中对字段名称“自营债券回购标的券市值”虽已作出统一规定，但在实际落地过程中，由于缺乏对指标业务含义、统计范围、维度组合的结构化定义，总部与分支机构往往基于本地业务习惯或系统现状，对同一字段赋予不同的计算逻辑与数据来源，形成事实上的“同名不同义”。例如，自营债券回购标的券市值在《证券公司自营债券回购业务报表》按中债估值全价口径统计，《自营债券回购明细》按中证估值全价口径统计。两者虽使用相同指标名称，但数据来源确有不同。

第二，关键指标依赖手工填报或非结构化定义，证券经营机构内部易引发理解偏差与操作风险。在《Y 证券分支机构基本信息表》中，“证券投资顾问人员数量”“营销人员数量”等字段虽有明确名称，但未规定数据来源与更新频率。实践中，分支机构分别从中国证券业协会从业人员信息公示平台、公司 HR 系统或合规台账中取数，导致同一指标在不同分支间数据来源不一、口径不一。在《Y0 监管问卷》中，“集体投诉”“群体性事件”等事件类指标缺乏结构化认定标准，如人数阈值、是否含线上投诉等，仅凭填报人员主观判断，造成“同义不同名”或“同名不同义”的情况。

第三，指标计算逻辑未标准化，同一业务事实存在多种统计路径。在 Y2《账户情况表》中，“本期增加账户数”存

在两种统计方式：一是“现场开户数+网上开户数+见证开户数”累加；二是“期末账户明细与期初账户明细轧差”计算。两种方式在理想状态下应一致，但因系统延迟、数据清洗规则不同，实际结果常有偏差。由于缺乏统一的原子指标定义与计算规则固化，分支机构可自由选择路径，导致数据逻辑不可复现、不可追溯。类似问题也出现在 Y4 “最低/最高佣金率”统计中，部分机构按实际交易佣金计算，部分按佣金率模板上下限取值，结果值略有差异。

第四，维度分类标准不统一，影响多维分析与监管勾稽。监管要求对“账户规范类型”进行分类统计，但未强制定义各类型的业务边界。实践中，部分分支机构将“公司主动休眠户”归入“休眠账户”，部分则归入“其他账户”。此类维度取值不一致，虽不影响单表填报，但会阻碍跨报表勾稽（如 Y2 与 C1_1）及跨机构数据比对，削弱监管分析效能。

第五，报送系统与业务系统缺乏有效贯通，各环节数据开发缺乏统一衔接。当前多数报送流程仍采用“报表驱动”模式，即围绕每张监管报表单独开发取数逻辑。这导致同一业务实体，例如“合格账户”在不同报表中被重复定义、重复加工，且定义逻辑不透明。当监管要求变更时，需逐表修改 ETL 脚本、校验规则与操作手册，响应周期较长。根本原因在于缺乏从主题层到指标层的标准化建模，使得标准仅停

留在文档层面，未能嵌入数据生产与加工流程。

上述问题反映出证券经营机构在监管报送执行中，尚未建立起一套结构清晰、逻辑严谨、可执行、可追溯的企业级指标数据管理体系。在监管字段名称统一的前提下，如何通过精细化的指标定义、维度管理与标准落地机制，消除内部口径理解歧义、提升数据一致性与自动化水平，已成为行业亟须解决的核心课题。

为有效解决上述问题，课题组将重点推进监管报送数据标准框架研究，构建主题层、指标层、报送层三层的标准体系，从而统一标准与模型，消除口径歧义，确保关键指标在各机构间理解一致、计算同源；构建清晰、结构化的数据标准规范，实现数据“一次加工、多处复用”，大幅提升制表与报送效率；强化数据底座与校验规则，强化标准与数据底座、校验规则的联动设计，提升数据质量与自动化水平，减少手工干预与误报风险，缩短核准周期。本课题通过设计与构建科学设计、逻辑严密、技术可行的数据标准落地实施路径，为监管报送、经营管理与业务分析提供及时、准确、可信的数据支撑。

（二）数据标准体系设计

本课题以“标准引领、模型驱动、监管适配、业务赋能”

作为核心原则，将监管报送数据标准体系的构建根植于证券经营机构真实业务场景与监管合规需求之中。通过数据标准融合技术规范，形成业务规则、监管要求与管理意图的结构化表达。因此，本课题将围绕证券经营机构监管报送痛点，以解决“业务口径不一致、报送效率低、数据难复用”等实际问题为导向，全面设计覆盖“主题层-指标层-报送层”的三层联动数据标准体系。

1. 标准框架设计

（1）定义标准层级

为有效承接多样化的监管报送场景，以业务域为锚点，构建“主题层-指标层-报送层”三层联动的数据标准框架，课题组通过标准化定义各层级的逻辑关系与技术属性，实现从原始数据到监管报送的全链路规范管控，旨在解决当前证券经营机构在数据报送过程中存在的“数据定义分散、指标口径不一致、报送映射低效”等问题，为证券经营机构提升监管报送数据质量、降低报送成本提供标准化支撑。

主题层是数据标准体系的底层支撑，聚焦于对证券经营机构业务数据的全局性、结构性整合，其核心功能是将分散于不同业务系统的原始数据，按照数据主题进行归集与标准化建模，形成跨系统、跨业务的一致性数据视图，破解“数据烟囱”导致的定义分歧与复用障碍。

指标层基于监管报送对数据颗粒度、计算口径、业务含义的差异化需求，由监管报送业务场景驱动，将主题层通用数据拆解为“维度+指标”的标准化分析单元，识别出最细业务颗粒度，并据此析出原子指标与维度。通过对指标与维度间的灵活组装，提升数据服务在监管场景中的复用能力。

报送层是数据标准体系的最终输出层，直接对接监管报送报表数据要求。基于指标层的“维度+指标”标准，建立与报送报表中具体字段的映射关系，并规范字段的数据类型、格式、取值范围等物理属性。

（2）定义标准属性制定

为支撑“主题层 - 指标层 - 报送层”三层联动的数据标准体系，课题组以业务场景为起点，结合监管要求与内部管理实践，系统构建了一套适用于多层次的统一数据标准属性框架。

该框架的建立基于三方面依据：一是监管规范，包括《证券公司分支机构数据报送接口规范》《证券期货业数据标准属性框架》等文件中对数据项业务含义、统计口径、报送位置的明确定义；二是业务实践，通过开展深度访谈，梳理业务场景中的真实业务规则；三是治理需求，引入数据全生命周期管理视角，补充技术实现与管理控制维度。

在此基础上，课题组确立了数据标准属性(如图 1 所示)，

形成适用于指标层和报送层对象的通用描述模板。



图1 数据标准属性

① 业务属性

描述数据与证券业务相关联的特性，包括信息大类、信息小类、指标中文名称、业务含义、统计口径、计算公式、统计口径包括范围及条件、统计维度、统计周期、参考依据。

② 技术属性

描述数据与信息技术实现相关联的特性，包括英文名称、数据类型及长度、度量单位、指标类型、数据来源。

③ 管理属性

描述数据与数据管理控制相关联的特性，包括编码、版本号、版本日期。

(3) 定义编码规则

为实现数据的高效管理与精准应用，课题组制定了一套清晰且规范的编码规则来对各要素进行细致区分与标识，让数据在各层级中有序流转与被准确识别，编码规则覆盖主题层的主题域和标准字段、指标层的原子指标和维度属性，以及报送层的报送项。

① 编码核心原则

开展编码设计时，编码规则以业务需求为核心，兼顾实用性、适配性、追溯性与稳定性，具体原则如下：

A. 业务导向

编码结构深度贴合业务分类逻辑，字段含义与层级划分符合业务人员认知习惯，降低理解与使用门槛。

B. 分层适配

针对主题层、指标层、报送层不同对象的角色定位，设计差异化编码结构，精准反映其在标准体系中的层级关系与功能属性。

C. 唯一可溯

每个标准对象分配全局唯一编码，在编码中嵌入关联层

级标识，支持跨层级对象关联与数据全链路追溯。

D. 简洁稳定

避免冗余字段与复杂结构，核心编码框架长期固定，仅在业务范围扩展、分类体系调整时，对局部编码段进行适度扩充，保障编码的延续性。

② 编码规则设计

为保障数据标准体系各对象的唯一可溯，课题组对主题域、主题字段、维度属性、原子指标、报送项五类核心对象定义了相应的编码规则（编码规则示例，如表 2 所示）。

表 2 编码规则示例

对象类型		编码结构	示例	说明
维度属性		D-[主题简码]- [六位序列号]	D-ACC-000 001	采用三级编码结构：一级“D”表示维度（Dimension），二级为主题域简码（如 ACC 表示账户、PTY 表示主体），三级为六位自增序列号
基础指标	原子指标	A-[业务类型码]- [主题简码]-[六位 序列号]	A-BRO-AST -000001	采用四级编码结构：一级“A”表示原子指标（Atomic Indicators），二级为业务类型码，三级为主题域简码，四级为六位自增序列号。示例为经纪业务资产类原子指标编码
	派生指标	D-[业务类型码]- RDS-[六位序列号]	D-BRO-RDS -000001	采用四级编码结构：一级“D”表示派生指标（Derived Indicators），二级为业务类型码，三级为监管数据报送场景简码 RDS（Regulatory Data Submission），四级为六位自增序列号
衍生指标		C-[业务类型码]- RDS-[六位序列号]	C-BRO-RDS -000001	采用四级编码结构：一级“C”表示衍生指标（Composite Indicators），二级为业务类型码，三级为监管数据报送场景简码 RDS（Regulatory Data Submission），四级为六位自增序列号。

A. 主题域编码

主题域采用英文简码,与全文模型表命名前缀保持一致,确保命名统一、技术可识别(如表3所示)。

表3 主题域编码表

主题域	英文简称	英文全称
公共	PUB	public
渠道	CHN	channel
营销	MKT	marketing
账户	ACC	account
主体	PTY	party
交易	EVT	event
资产	AST	asset
品种	VAR	variety
合同	AGMT	agreement
财务	FIN	finance

B. 维度属性编码

维度是对基础指标进行分类和分析的观察角度或实体,如:账户、产品、机构等。维度属性是维度的下一层级,用于对维度内的实体进行细分(如表4所示)。维度属性采用三级编码结构: D_[主题简码]_[六位序列号],其中,一级“D”表示维度(Dimension),二级为主题域简码(如ACC表示账户、PTY表示主体),三级为六位自增序列号。

表 4 维度属性示例

维度分类	维度小类	维度编码	维度名称
主体	客户	D-PTY-000001	客户类别代码
		D-PTY-000002	客户状态代码
	负责人	D-PTY-000003	个人证件类型代码
		D-PTY-000004	国家地区代码
	机构	D-PTY-000005	分支机构类型代码
		D-PTY-000006	所属辖区代码
		D-PTY-000007	省份代码
		D-PTY-000008	城市代码
	员工	D-PTY-000009	分支机构人员类型代码
账户	证券账户	D-ACC-000001	账户规范类型代码
		D-ACC-000002	开户渠道代码
		D-ACC-000003	账户状态代码
		D-ACC-000004	证券账户类别代码
		D-ACC-000005	当月增加账户标志
		D-ACC-000006	当月减少账户标志
	资金账户	D-ACC-000001	账户规范类型代码
		D-ACC-000002	开户渠道代码
		D-ACC-000003	账户状态代码
		D-ACC-000004	账户类别代码
		D-ACC-000005	当月增加账户标志
		D-ACC-000006	当月减少账户标志
		D-ACC-000007	银行代码
		D-ACC-000008	资产属性代码
		D-ACC-000009	主账户标志

维度分类	维度小类	维度编码	维度名称
品种	代销产品	D-VAR-000001	代销产品类型代码
		D-VAR-000002	产品风险等级代码
		D-VAR-000003	产品投资性质代码
		D-VAR-000004	产品特征代码
		D-VAR-000005	销售方式代码
	证券	D-VAR-000005	柜台证券类别代码
交易	交易	D-EVT-000001	参与市场代码
		D-EVT-000002	板块类型代码
		D-EVT-000003	委托方式代码
		D-EVT-000004	业务类型代码
		D-EVT-000005	业务大类代码
		D-EVT-000006	买卖方向代码
合同	融资融券	D-AGMT-000001	融资方向代码
		D-AGMT-000002	担保品类型代码
		D-AGMT-000003	负债类型代码

C. 指标编码

原子指标是满足监管报送最小业务颗粒度的、不可再拆分的业务度量单元，具备唯一性、可复用性和业务可解释性。是构建更高级别指标的基础。其编码依据监管报送指标数据的业务分类及主题域，确保业务归属清晰、管理便捷。原子指标采用四级编码结构：A_[业务类型码]_[主题简码]_[六位序列号]，其中：一级“A”表示原子指标（Atomic Indicator），二级为业务类型码（如表5所示），三级为主题域简码（如

表 3 所示)，四级为六位自增序列号。

表 5 业务类型码表

业务线名称	业务类型码	英文全称	备注
投资银行	IB	Investment Banking	含 IPO、并购、承销等业务
经纪业务	BRO	Brokerage Business	证券经纪、代理买卖等
信用业务	CRD	Credit Business	融资融券、股票质押等
托管业务	CSTD	Custody Business	资产托管、资金保管等
做市业务	MM	Market Making Business	证券做市、报价交易等
固定收益	FI	Fixed Income	债券交易、固定收益产品等
私募投资基金业务	PF	Private Fund	私募股权、私募证券等
证券研究	ER	Equity Research	行业研究、投研服务等
另类投资业务	AI	Alternative Investment	非标资产、另类产品投资等
自营业务	SLF	Self-operated Business	自有资金证券投资等
资管业务	AM	Asset Management	集合资管、定向资管等
柜台业务	OTC	Over-the-Counter Business	柜台市场交易、定制产品等
QFII/RQFII	QFII	Qualified Foreign Institutional Investor	境外合格机构投资者业务
风险管理	RSK	Risk Management	信用风险、市场风险等
内控与合规管理	ICCM	Internal Control and Compliance Management	业务控制、信息系统控制等
财务管理	FIN	Finance Management	财务核算、财务报表等

派生指标是在原子指标基础上，结合特定维度、时间周期或业务限定条件形成的业务度量单元。其编码依据监管报送指标数据的业务分类及应用场景，确保业务归属清晰、管理便捷。派生指标采用四级编码结构：D_[业务类型

码]_RDS_[六位序列号],其中一级“D”代表派生指标(Derived Indicator);二级为业务类型码(如表5所示);三级为监管数据报送场景简码“RDS”(Regulatory Data Submission),四级为六位自增序列号。

衍生指标是若干个基础指标通过各种逻辑运算复合而成的指标。其编码方式同派生指标。衍生指标编码格式为:C_[业务类型码]_RDS_[六位序列号],其中一级“C”代表衍生指标(Composite Indicator);二级为业务类型码(如表5所示);三级为监管数据报送场景简码“RDS”(Regulatory Data Submission),四级为六位自增序列号。

编码规则设计以指标分层为一级分类,业务类型为二级分类,层级清晰且更贴合“业务引领”原则,同时与全文“55个二级分类归属13个一级业务”的逻辑保持一致。

2. 主题模型层标准设计

本课题在证券经营机构监管报送数据模型设计上遵循完整性、实用性、通用性、稳定性和扩展性的原则,采用“上下结合”的研究方法开展。其中,“上”是重点参考行业标准《证券期货业数据模型第1部分:抽象模型设计方法》

(JR/T0176.1-2019)监管部分模型设计方法,以相关法律法规为基础,对监管对象、监管主体、监管方式、监管流程进行多维分析,梳理对应业务流程及相关信息,提取公共流

程和数据项，形成数据分类，归纳逻辑模型数据域，建立数据域之间的关系，形成逻辑模型架构；“下”是继承行业标准《证券期货业数据模型第3部分：证券公司逻辑模型》（JR/T0176.3-2021）模型成果，采用通用的逻辑模型设计步骤，构建各数据域中实体及实体间关系，并补充完善实体属性；“上”“下”结合最终设计形成证券经营机构监管报送领域逻辑模型。证券经营机构监管报送数据模型的设计研究工作主要包含监管报送业务流程梳理、监管报送数据模型设计以及模型验证三个部分。

（1）业务流程梳理

① 业务流程梳理方法

参考《证券期货业数据模型第1部分：抽象模型设计方法》第8章规定，课题组引入金融行业流程建模方法，设计监管报送业务流程三级建模梳理标准模板。同时，重点参照《证券期货业业务标准设计方案》中证券业务的分类框架，通过梳理各监管场景业务流程，进行标准化、去差异化，形成易于理解的业务流程。通过编写流程描述和流程输入输出项，对业务描述进行有效论证，提升业务数据的整合度、标准化与规范化，同时结合“主体-行为-关系”（IBR）方法形成完整的业务梳理模式。

② 业务流程梳理步骤

本课题针对证券经营机构监管报送业务流程梳理步骤如下：

第一步，确定适合监管报送业务的流程梳理方案和梳理模板，结合《证券期货业业务标准设计方案》的业务分类原则、监管要求与券商实际业务场景，与业务部门、合规部门、技术部门达成梳理共识。

第二步，收集监管报送相关法律法规、监管通知、业务系统文档、历史报送报表，以及参考《证券期货业业务标准设计方案》中证券业务分类及流程，作为业务流程梳理模板的输入。

第三步，逐一拆解每类报表隐含的业务关联逻辑，重点对每类报表对应的业务场景开展一级和二级业务流程梳理。

第四步，确定各类监管场景一级和二级业务流程后，开展三级流程梳理，明确流程目标、范围、数据项信息，同时落实不同数据项所对应的业务主管部门，实现数据的业务认责，生成《监管报送业务流程梳理表》。

第五步，组织合规部门、业务部门、技术部门及行业专家对业务流程文档进行反复研讨论证，通过具体报送场景检验业务流程和数据的正确性。

③ 业务流程梳理结果

本课题对业务流程的梳理全面覆盖了核心监管、财务管理、业务监管等 12 项监管报送需求，通过“监管报表 - 业务流程”的拆解思路，完成了全场景业务流程的标准化梳理，明确报表数据在证券经营机构前中后台业务中的生成路径。例如，针对“融资融券业务监管报表”，拆解出客户开户、授信审批、交易执行、担保物管理、强制平仓等全流程环节；针对“自营债券回购明细报表”，拆解出交易对手准入、回购成交、标的券管理、到期结算等核心环节。

课题组通过全量报表的流程拆解，最终形成“监管报表 - 业务环节 - 数据要素”的三维映射关系：明确了每类报表对应的核心业务流程、关键参与方、数据生成节点及流转路径，提取了跨报表共性数据要素（如主体、账户、交易、资产等），同时澄清了不同报表间的数据口径差异（如同一“交易金额”字段在不同监管场景下的统计范围）。

课题研究梳理结果不仅实现了监管报送业务流程的标准化、透明化，更精准定位了数据模型所需覆盖的核心数据范围、数据关联关系及监管特殊要求，为后续主题域划分、实体设计、属性定义提供了直接且全面的业务依据，确保数据模型能够完整支撑接口规范中全部监管报表的生成与报送需求。

（2）主题数据模型设计

基于监管报送业务流程、数据要素的梳理成果，本课题模型设计核心依托《证券期货业数据模型第3部分：证券公司逻辑模型》（JR/T0176.3-2021）模型成果，沿用核心数据主题划分，对相关主题域进行实体和属性的新建、扩充和优化。通过归纳各级业务活动的数据共性，合并、提炼数据特征，形成数据分类；通过找出数据分类中的核心数据特性，对逻辑模型各主题域进行扩充和优化；然后根据“主体-行为-关系”（IBR）的方法，建立主题域之间的关系，形成监管报送业务逻辑模型架构；最后，以该架构为基础，采用通用的逻辑模型设计步骤，构建各主题域中实体及实体间关系，并补充完善实体属性，最终形成证券经营机构监管报送业务逻辑模型。

本模型对逻辑模型的优化主要体现在两个方面：一是新增财务、公共主题域；二是在原有主题域基础上补充监管报送涉及的实体，如在主体域中增加监管机构等。

① 主题域划分及分主题研究

基于证券经营机构监管报送业务流程梳理，证券经营机构监管报送数据可划分为主体、账户、品种、交易、资产、合同、渠道、营销、财务、公共十大主题域（如表6所示），明确了各主题域的业务边界与数据范围。

表 6 主题域分类

序号	主题域	英文简称	英文全称	核心定义
1	主体	PTY	Party	主体主题域与账户、交易、资产和合同等其他主题域之间存在着密切的关联关系，是核心主题域，根据证券公司实际业务过程特征、数据分布、完整性、一致性等方面将主体归纳、抽象为用户、客户、内部组织与其他外部组织四大类
2	账户	ACC	Account	账户主题域是主体因业务需求在相关机构登记的各类账户信息，账户主题域按照账户类型划分三大类，包括交易账户、资金账户、银行账户
3	品种	VAR	Variety	品种的范围包括证券公司本身对外提供的金融工具和服务，还包括在证券公司业务流程中涉及的其他方提供的金融工具和服务
4	交易	EVT	Event	交易主题域用于描述各种与证券公司相关活动的详细情况。这些活动通常指证券公司与客户等主体的交互活动，包括详细的交易行为数据，还包括导致主体、账户、合同等其他主题域数据变化的非交易行为数据
5	资产	AST	Asset	资产主题域用于描述主体的资产，包括资金的余额、证券的持有、在途资金及证券、客户的抵质押、负债，还包括一些具体场景下的修正。同时，将虚拟资产也一并纳入，以完整描述主体的拥有
6	合同	AGMT	Agreement	合同主题域的数据涵盖证券公司与交易对手方线上签署的电子化合同，客户与证券公司签署的开展某种业务或购买某种产品的协议，以及客户在进行证券交易时产生的交易合约
7	渠道	CHN	Channel	渠道用于表述业务发生的地点、通道或路径，通常与业务事件关联。渠道主题域由电话、呼叫中心、柜台、银行、客户交易软件终端、合作方渠道及其他渠道组成
8	营销	MKT	Marketing	营销用于表述一个主体在意图开展营销活动的领域进行营销活动的行为方式，营销主题域的主要实体有：营销活动、营销任务等，营销主题域涵盖了营销活动全流程，记录营销过程中有价值的数
9	财务	FIN	Finance	(新增域)财务用于记录证券公司经营过程中产生的全部财务活动与结果数据，涵盖收入、成本、利润、资本全链条的核算、计量与报告
10	公共	PUB	Public	(新增域)公共用于存储各业务域通用的基础支撑数据，涵盖公共代码字典、基础参数等

② 主题域间关联关系研究

基于上述证券业务模型梳理方式及主题域划分成果，课

题组按照“主体-行为-关系”的 IBR 方法，研究形成各主题域间的关联关系，并利用各主题域间的关联关系来体现证券经营机构监管报送涉及的核心业务过程（如图 2 所示）。

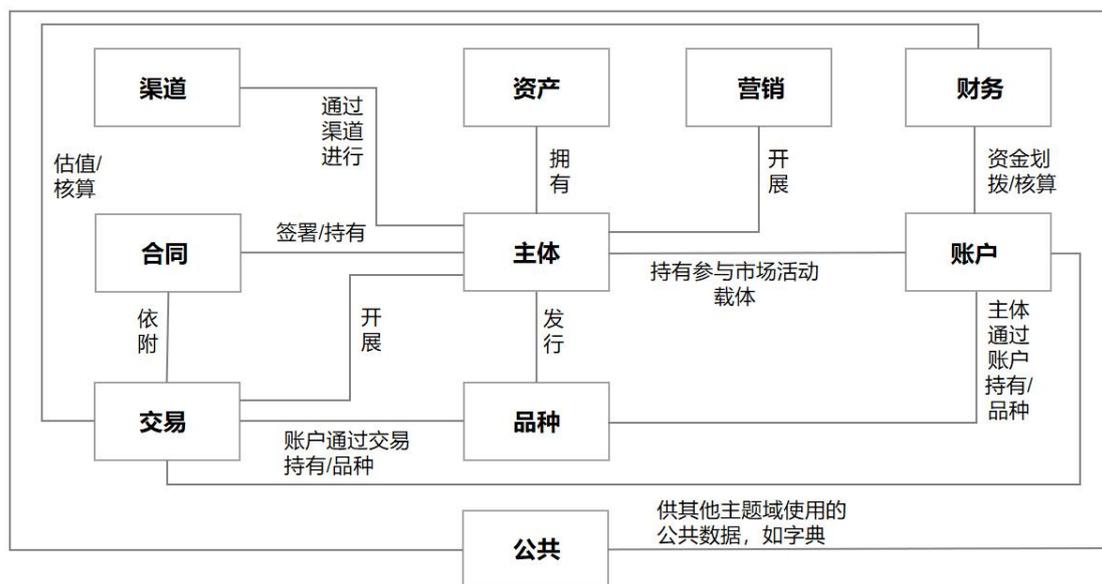


图 2 主题域间关联关系

- 主体与其他主题域：主体作为业务参与的核心载体，通过“主体编码”关联账户、交易等。
- 账户与其他主题域：账户记录主体开户、交易、资产等。
- 品种与其他主题域：品种记录交易标的、资产。
- 交易与其他主题域：交易记录证券期货市场参与主体购买品种等交易行为。
- 资产与其他主题域：资产通过账户记录变动，交易触发资产增减。
- 合同与其他主题域：通过签约关联主体，生成非交易类

事件。

- 渠道与其他主题域：通过业务入口关联交易。
- 营销与其他主题域：推广产品关联品种，转化结果关联账户。
- 财务与其他主题域：财务账户记录资金核算，资产估值关联资产。
- 公共与其他主题域：为上述主题域提供通用支撑，如主体证件代码、品种分类代码，保障数据标准化。

③ 各主题域中实体关系研究

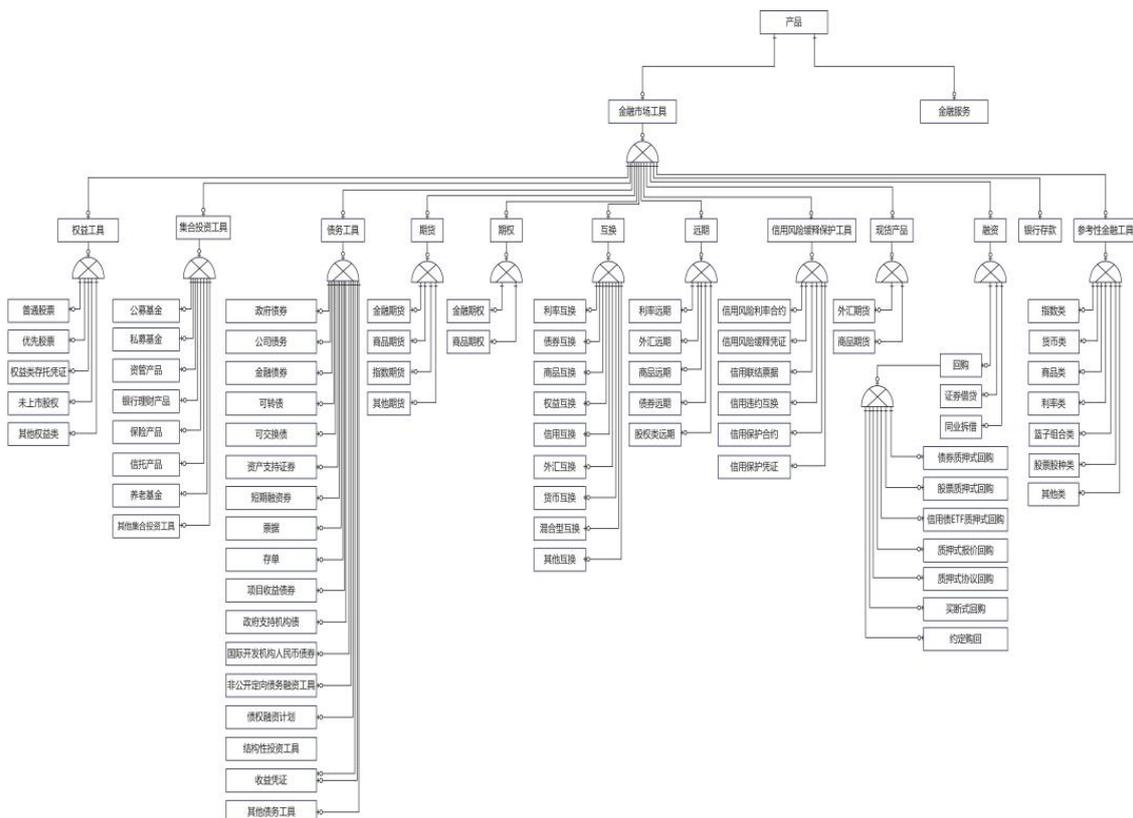


图3 品种主题域实体关系图

通过对证券业务流程梳理结果中的输入输出项分析，梳理监管报送业务流程中核心数据项和数据属性的特征，在各主题域下追加监管专属实体和属性，构建实体间关系，形成各自的实体关系图（以品种主题域实体关系图为例，如图3所示）。

④ 主题域中数据表和数据项研究

在明确监管报送逻辑模型的主题域划分及关联关系后，依据《证券期货业数据模型第3部分：证券公司逻辑模型》（JR/T 0176.3-2021）对数据表和数据项的定义方式，课题组通过对梳理出的证券业务流程进行分析梳理，细化设计各主题域中的数据表，确定核心数据表范围和数据项的业务属性、技术属性和管理属性，形成标准化的数据表和数据项（以账户主题域为例，如表7所示）。

表7 主题域数据表示例

主题域	模型表 英文名称	模型表 中文名称	字段 中文名称	字段 英文名称	字段 属性	必填 标志	主键 标志	枚举值 编码
账户	dwd-acc- cpt1-acc	资金 账户	数据日期	data_dt	varchar (8)	Y	Y	
账户	dwd-acc- cpt1-acc	资金 账户	资金账户 编码	cpt1-acc _num	varchar (40)	Y	Y	
账户	dwd-acc- cpt1-acc	资金 账户	内部机构 编码	inr-ins- num	varchar (20)			
账户	dwd-acc- cpt1-acc	资金 账户	开户日期	oact_dat e	varchar (8)			
账	dwd-acc-	资金	销户日期	clos_dat	varchar			

主题域	模型表英文名称	模型表中文名称	字段中文名称	字段英文名称	字段属性	必填标志	主键标志	枚举值编码
户	cpt1-acc	账户		e	(8)			
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	存管银行编码	depo-bnk-num	varchar (40)			
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	主账户标志	main-acc-flag	varchar (1)			0 - 主账户 1 - 辅账户
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	资金账户类别代码	cpt1-acc-clas-cd	varchar (1)			1: 普通 A 股 2: 普通 B 股美元 3: 普通 B 股港币 4: 信用 7: 衍生品
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	账户规范类型代码	acc-std-type-cd	varchar (2)			01: 合格 02: 不合格 03: 休眠 04: 其他
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	账户状态代码	acc-stat-cd	varchar (2)			01: 正常 02: 挂失 03: 冻结 04: 注销 05: 关闭 06: 休眠 07: 风险处置 08: 不合格
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	来源系统代码	src-sys-cd	varchar (10)			
账户	dwd-acc-cpt1-acc	资金账户	etl 加载时间	etl-time	date			

⑤ 英文词根库研究

本课题参照《证券期货业数据模型第 3 部分：证券公司逻辑模型》（JR/T 0176.3 - 2021）给出的英文名称及词根描述规则，梳理了证券经营机构监管报送逻辑模型的英文名称及对应词根，确保英文命名规范、统一、易理解（如表 8 所示）。

表 8 英文词根库示例

序号	中文全称	英文全称	英文缩写	增加标志	字段长度	所属数据域
1	主体	party	pty	-pty	4	主体
2	担保人	guarantor	guar	-guar	5	主体
3	发行人	issuer	issr	-issr	5	主体
4	票面利率	coupon	coup	-coup	5	品种
5	币种	currency	crrc	-crrc	5	品种
6	付息	interest payment	intp	-intp	5	品种
7	利差	spread	spr	-spr	4	品种
8	面值	par value	parv	-parv	5	品种
9	规模	scale	scal	-scal	5	品种
10	价格	price	prc	-prc	4	品种
11	违约	defaulting	dflt	-dflt	5	品种
12	回售	put	put	-put	4	品种

⑥ 数据敏感性标识研究

参照《证券期货业数据安全风险防控 数据分类分级指引》（GB/T 42775 - 2023）《证券期货业数据分类分级指引》（JR/T0158 - 2018）规定的的数据级别标识要求（如表 9 所示），并结合证券经营机构监管报送数据特点、证券业务的数据安全属性及行业实践，课题组为每个实体增加对应的数据敏感性标签，形成实体的数据敏感性标识对应关系（如表 10 所示）。

表9 数据级别标识要求

数据级别标识	数据重要程度标识	数据特征
4	极高	1. 数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围大（跨行业或跨机构），影响程度一般是“严重” 2. 一般特征：数据主要用于行业内大型或特大型机构中的重要业务使用，一般针对特定人员公开，且仅为必须知悉的对象访问或使用
3	高	1. 数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围中等（一般局限在本机构），影响程度一般是“严重” 2. 一般特征：数据用于重要业务使用，一般针对特定人员公开，且仅为必须知悉的对象访问或使用
2	中	1. 数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围较小（一般局限在本机构），影响程度一般是“中等”或“轻微” 2. 一般特征：数据用于一般业务使用，一般针对受限对象公开；一般指内部管理且不宜广泛公开的数据
1	低	1. 数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围较小（一般局限在本机构），影响程度一般是“轻微”或“无” 2. 一般特征：数据可被公开或可被公众获知、使用

表10 数据敏感性标识示例

中文名称	英文名称	最低参考数据级别	《证券期货业数据分类分级指引》对应数据分类	详细定义
收盘价	clqn-prc	1	行情数据	一般指交易所公布的交易行情，包括证券即时行情、证券收市行情、期货交易行情、期货实时行情、期货合约日交易参数、期货升贴水、期货现货价格等
股票类别名称	stk-clas-name	1	股票信息	一般指证券期货行业中与股票属性相关信息，包含股票代码、行业类别代码、证券简称、交易场所代码、首次发行日期、发行人标识等信息
发行人简称	issr-abbr	2	发行人信息	一般指为筹措资金而发行产品的政府及其机构、金融机构、公司和企业等主体的基本信息

中文名称	英文名称	最低参考数据级别	《证券期货业数据分类分级指引》对应数据分类	详细定义
开户方式	oact_mode	3	投资者开户/账户信息	一般指投资者与交易活动相关的识别信息，包括账户名称、投资者标识、账户类别、账户用途、账户状态代码等信息
账户编码	acc_num	4	账户信息	一般指证券期货行业会管单位交易、结算业务相关联的交易账户、资金账户、银行账户信息，包含会管单位下属会员或机构账户，投资者账户等信息
成交数量	mtch_vol	4	成交信息	证券交易所交易系统接受申报后，要根据订单的成交规则进行撮合配对或者确认，使买卖双方达成交易，确定的交易数量
委托金额	entr_amt	4	委托信息	一般指证券期货行业会管单位产品的委托相关信息，包含申请编号、证券代码、委托价格、委托数量、委托方向、委托类型、委托时间、委托价格、委托日期、会员编码、账户编码、品种合约等

⑦ 主流系统软件商代码映射关系研究

证券经营机构监管报送逻辑模型代码类属性可与软件提供商在不同业务系统中的代码取值定义建立映射关系，打通系统间数据对接链路，保障模型代码在数据采集、加工、报送各层级间一致流转（如表 11 所示）。

表 11 逻辑模型代码映射关系示例

代码表编码	代码表名称	代码编码	代码名称	系统来源	系统来源编码	系统代码编码	系统代码名称
EVT00002	持仓变动性质代码	01	增仓	衡泰 XIR	HT_TRD_GS	142	认购完成
EVT00002	持仓变动性质代码	01	增仓	衡泰 XIR	HT_TRD_GS	10	买入

代码表编码	代码表名称	代码编码	代码名称	系统来源	系统来源编码	系统代码编码	系统代码名称
EVT00002	持仓变动性质代码	01	增仓	衡泰 XIR	HT-TRD-GS	144	申购完成
EVT00002	持仓变动性质代码	02	减仓	衡泰 XIR	HT-TRD-GS	200	债券行权回售
EVT00002	持仓变动性质代码	02	减仓	衡泰 XIR	HT-TRD-GS	20	卖出
EVT00002	持仓变动性质代码	01	增仓	恒生自营 032	HS-032	R	行权认购
EVT00002	持仓变动性质代码	01	增仓	恒生自营 032	HS-032	X	卖出开仓
EVT00002	持仓变动性质代码	01	增仓	恒生自营 032	HS-032	J	承销买入
EVT00002	持仓变动性质代码	02	减仓	恒生自营 032	HS-032	W	卖出平仓
EVT00002	持仓变动性质代码	02	减仓	恒生自营 032	HS-032	A	转股

（3）主题数据模型验证

本课题以证券经营机构监管报送业务系统作为回归验证对象，通过实际业务系统对理论逻辑模型进行验证，重点覆盖核心监管、财务监管、业务监管、专项监管等核心报送场景，检查模型对账户明细、交易流水、财务核算等核心数据范围的涵盖情况，考察模型符合实际业务的情况，包括对现有监管报送所涉业务覆盖和对未来业务发展、监管政策的兼容性。

课题组选取监管报送中 12 类典型场景（覆盖核心监管、业务监管、专项监管、财务监管、关联方监管等）开展深度验证：其中核心监管报送场景，验证数据模型能否通过账户

（如自营、信用账户信息）、资产（如持仓市值、担保品市值）、财务（如货币资金、结算备付金）等主题域的联动，能够完整提供净资本计算、风险资本准备计算等共 6 张报表所需的财务、客户融资、股票质押交易等数据，为指标模型层准确生成“融资金额”等指标提供稳定的数据支撑。

实践验证表明，本模型可有效覆盖现有监管业务源系统重要数据，支持指标模型层的数据需求，同时具备对新增监管政策的扩展适配能力，为模型在行业内的落地执行提供了参考。

3. 指标模型层标准设计

指标模型层是连接业务事实与监管要求的关键桥梁。本课题在设计上采用“以维度建模为核心，以业务场景为驱动，以原子指标为基础”的思路，基于主题层已实现标准化的业务实体，通过灵活组合明确的业务规则与维度来生成各类指标。

（1）设计目标

指标层标准化设计是连接业务事实与监管要求的核心纽带，其核心目标可概括为三点：

① 实现数据源头统一

通过标准化设计，消除不同业务部门对同一指标的口径理解差异，确保监管报送数据从源头保持一致性。

② 提升指标复用效率

以原子指标为核心，构建可灵活组合的指标体系，支撑“一次建模、多处复用”，减少重复开发成本。

③ 满足监管动态适配

基于分层建模与维度体系，快速响应监管要求变化，无需重构底层数据模型即可调整指标统计逻辑。

（2）设计思路

① 维度建模设计

以维度建模为核心，遵循“指标定义→维度梳理→事实表与维度表关联”的标准化流程，课题组系统性地拆解核心维度和原子指标，构建可复用的指标体系。该设计旨在将复杂的业务数据转化为逻辑清晰、易于理解的分析视图，既能精准支撑监管报送要求，又能灵活满足多维分析需求，实现数据资产的标准化管理与高效应用。

② 业务场景驱动

建模过程紧密围绕实际业务场景需求展开，课题组根据前期梳理的业务流程和数据项，系统性地收集与整理指标及其口径，规范指标定义，并将指标归集至对应的业务域；尤其针对多维度、细粒度的监管统计要求，开展专项设计与适配。

③ 原子指标为核心

以原子指标为最小粒度聚合单元，课题组构建了灵活可扩展的指标体系，支撑监管报送与数据复用目标。原子指标基于统一规范定义，明确业务含义、统计口径、参考依据及适用维度，确保跨部门、跨场景执行的一致性，最终实现“一次建模、多处复用”的高效数据治理效果。

④ 指标分层构建

以原子指标和维度为基础、派生指标为场景化表达、衍生指标为复合计算结果的结构化标准体系，明确原子指标的复用范围、维度的组合规则、派生指标的构建方式以及衍生指标的计算逻辑，分层构建以支撑监管需求与内部数据的快速、灵活对接。

（3）设计步骤

① 业务体系梳理

本课题基于“总-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（2019版）》的业务分类，梳理了证券经营机构监管报送内容，形成业务域分类体系（如图4所示）。

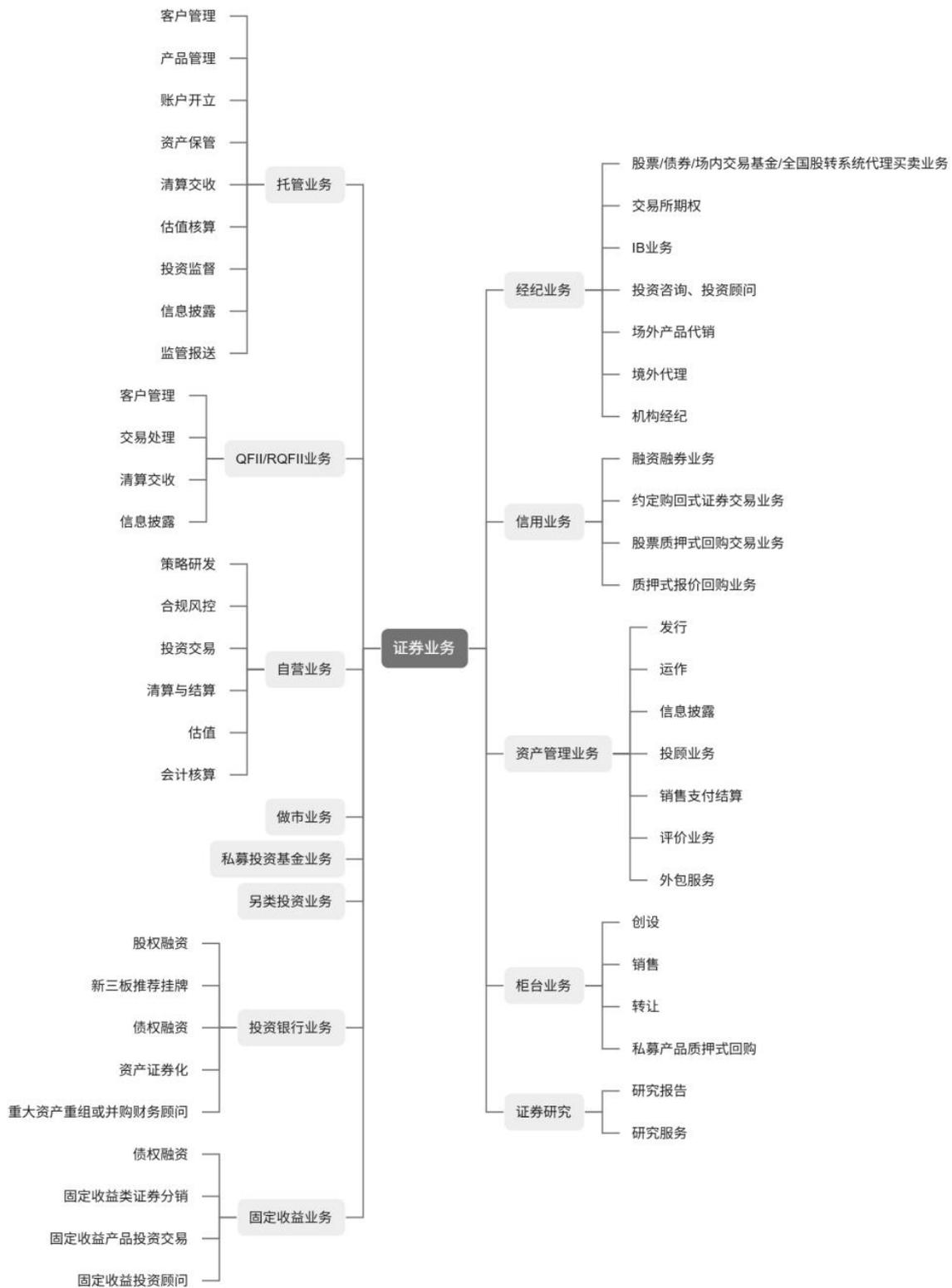


图 4 证券业务分类

具体梳理步骤如下：

第一步，课题组通过访谈机构内部监管报送责任部门、调研监管报送接口规范要求及系统供应商情况，完成机构监管报送接口清单的梳理工作。

第二步，结合监管报送相关的接口规范文档，进一步梳理详细的接口列表及填报说明。

第三步，对机构监管报送数据接口进行调研整理，形成详细的指标口径标准文档，为后续数据模型构建做好基础。

第四步，根据“总-分”逐层梳理方法，对自动化取数接口的数据进行业务的梳理与拆分，组织课题参与人员对业务拆分结果进行反复研讨论证，通过具体报送数据检验业务分类的正确性。

② 原子指标生成及维度析出

在业务颗粒度明确的基础上，课题组提炼出“原子指标”作为指标层的核心标准对象。原子指标是指满足监管报送最小业务颗粒度的、不可再拆分的业务度量单元，具备唯一性、可复用性和业务可解释性。原子指标的生成遵循“业务含义清晰、计算逻辑明确、数据来源可靠”三大原则。本课题从识别报表颗粒度出发，对明细数据进行拆解与分析，形成原子指标。

步骤一，明细数据拆解与分析。

A. 识别报表颗粒度：通过识别报表的数据颗粒度，奠定数据报送的基石，识别出满足监管报送场景的最细颗粒度。结合具体监管报送业务场景和底层数据，拆解出最细的业务原子粒度（如表 12 所示）。

表 12 监管报送数据颗粒度示例

报送内容	原子粒度	主要颗粒度
客户账户情况	资金账户数	个人
	证券账户数	个人
证券交易情况	股票交易金额	个人+证券品种
	债券交易金额	个人+证券品种
	基金交易金额	个人+证券品种

B. 析出原子指标、维度及维度属性：完成对监管报表最细颗粒度识别与分析后，从监管报送业务流程中归纳各级业务的数据共性，合并、提炼数据特征，梳理出原子指标所需的维度、维度属性，构建指标维度矩阵（如表 13 所示）。

表 13 指标维度表示例

维度 \ 指标		主题域—账户	主题域—资产
		原子指标— 证券账户户数	原子指标— 资金账户余额
日期维度	日		
	周		
	月	✓	✓
	年		

维度 \ 指标		主题域—账户	主题域—资产
		原子指标— 证券账户户数	原子指标— 资金账户余额
机构维度	机构编码	✓	✓
	机构类型	✓	✓
资金账户维度	资金账户编码		✓
	存管银行编码		✓
	客户类别代码		✓
	开户渠道代码		✓
	主账户标志		✓
	资金账户类别代码		✓
	账户规范类型代码		✓
证券账户维度	证券账户编码	✓	
	客户类别代码	✓	
	开户渠道代码	✓	
	证券账户类别代码	✓	
	账户规范类型代码	✓	
	账户状态代码	✓	

步骤二，原子指标定义与属性填充。

A. 制定原子指标标准定义：根据析出的原子指标，撰写清晰的业务定义、技术定义、计算口径，明确业务属性、技术属性、管理属性三大类（如表 14 所示）。

B. 形成标准文档：构建原子指标口径文档，作为统一的报送口径前置文档，完成原子指标口径标准定义。

表 14 原子指标口径标准定义示例

业务属性	信息大类	经纪	信用
	信息小类	交易	交易
	指标中文名称	股票普通交易金额	股票信用交易金额
	业务含义	投资者通过自有资金开展股票交易，其交易过程中交易金额的大小	投资者通过信用账户借入资金或证券，即通过融资融券开展股票交易，其交易过程中交易金额大小
	统计口径 (计算公式)	指定维度条件下的交易金额合计值	指定维度条件下的交易金额合计值
业务属性	统计口径 (范围及条件)	<p>客户类别：个人，机构，产品</p> <p>交易市场：上海证券交易所，深圳证券交易所，沪港通下港股通，深港通下港股通，全国中小企业股份转让系统，区域股权市场，北京证券交易所</p> <p>渠道类别：柜面，手机，网上</p> <p>证券交易分类：A 股主板股票，A 股创业板股票，A 股科创板股票，B 股（折人民币），全国中小企业股份转让系统挂牌股票，沪港通，深港通，存托凭证</p> <p>业务标志：证券卖出、证券买入</p>	<p>客户类别：个人，机构，产品</p> <p>交易市场：上海证券交易所，深圳证券交易所，沪港通下港股通，深港通下港股通，全国中小企业股份转让系统，区域股权市场，北京证券交易所</p> <p>渠道类别：柜面，手机，网上</p> <p>证券交易分类：A 股主板股票，A 股创业板股票，A 股科创板股票，B 股（折人民币），全国中小企业股份转让系统挂牌股票，沪港通，深港通，存托凭证</p> <p>业务标志：还款卖出、融资买入、融券卖出、还券买入、融资平仓、融券平仓</p>
	统计维度	<p>日期</p> <p>客户类别</p> <p>交易市场</p> <p>渠道类别</p> <p>证券交易分类</p> <p>业务代码</p> <p>货币代码</p>	<p>日期</p> <p>客户类别</p> <p>交易市场</p> <p>渠道类别</p> <p>证券交易分类</p> <p>业务代码</p> <p>货币代码</p>
	统计周期	日	日
	参考依据	引用《证券公司经营机构数据报送接口规范》	引用《证券公司经营机构数据报送接口规范》

技术属性	数据类型及长度	NUMBER (19, 2)	NUMBER (19, 2)
	度量单位	元	元
	指标类型	原子指标	原子指标
	数据来源	柜台	柜台
管理属性	编码	A-BRO-EVT-000001	A-CRD-EVT-000001
	版本号	V1.0	V1.0
	版本日期	20250101	20250101

步骤三，维度体系建设。

为实现原子指标的灵活复用，课题组同步构建了完整的维度体系。维度是指标分析的分类依据，用于描述业务事实的不同观察角度。课题组从维度属性的视角入手，梳理描述客户、账户、品种、机构等主体的特征属性信息，例如，“账户规范类型”“主账户标志”“代销产品类型”“营业部编码”等均为关键维度。

维度体系建设以“业务一致性”和“监管适配性”为双重目标（如表 15 所示）。一方面，维度定义严格对齐《证券公司分支机构数据报送接口规范》中的分类要求，例如“账户规范类型”“主账户标志”“代销产品类型”等；另一方面，维度取值规则充分吸纳一线业务实践中的共识，例如“休眠账户”是否包含公司主动休眠户等，并通过标准文档固化，确保总部与分支机构对同一维度的理解完全一致。

表 15 监管报送核心维度属性示例

维度分类	维度属性	维度属性编码	维度属性码值	维度属性码值名称	业务定义与监管依据
账户维度	账户规范类型	D-ACC-000001	01, 02, 03, 04	合格, 不合格, 休眠, 其他	合格账户指身份真实、状态正常、可交易的账户; 休眠账户指连续 12 个月无交易且余额低于阈值的账户 (依据《接口规范》第 3.2.1 条)
品种维度	代销产品类型	D-VAR-000001	1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12	收益凭证, 公募基金, 基金公司及其子公司资产管理计划, 私募基金, 证券公司资产管理计划, 本公司资产管理计划, 其他公司资产管理计划, 期货公司及其子公司资产管理计划, 商业银行及其理财子公司理财产品, 信托产品, 保险产品, 其他金融产品	金融工具分类标准, 用于区分不同交易类型的统计口径

③ 指标动态生成

基于原子指标与维度体系, 通过配置维度属性取值、组合逻辑等筛选条件, 可动态生成满足监管报送场景需求的派生指标 (如表 16 所示) 与衍生指标 (如表 17 所示), 实现指标的按需灵活构建与高效复用。

表 16 派生指标组装示例

派生指标	原子指标	维度
期末户数-合格账户-主资金账户	资金账户户数	统计周期: 月 资金账户类别: A 股, B 股, 信用, 衍生品 主账户标志: 主账户 账户规范类型: 合格

派生指标	原子指标	维度
期末户数-休眠账户 -基金账户	证券账户户数	统计周期：月 证券账户类别：基金账户 账户规范类型：休眠

表 17 衍生指标组装示例

报送指标	证券交易额-本月-a 股主板股票-机构
调用原子指标	股票普通交易金额、股票信用交易金额
维度筛选	统计周期：本月累计 主体类别：机构 交易市场：上海证券交易所，深圳证券交易所 渠道类别：柜面，手机，网上 证券交易分类：主板股票 业务标志：证券卖出、证券买入、还款卖出、融资买入、融券卖出、还券买入、融资平仓、融券平仓
计算逻辑	股票普通交易金额+股票信用交易金额

4. 报送层标准设计

报送层是证券经营机构监管报送指标数据管理体系的落地输出核心环节，是连接内部标准化指标体系与外部监管要求的关键枢纽，其运行以指标层标准化成果为根本依据，核心职责是实现结构化指标体系与监管报送接口规范的精准映射、高效衔接。作为合规报送的最终执行载体，报送层需全面承接指标层已明确的原子指标、派生指标、衍生指标及维度属性定义，严格对照监管部门发布的接口规范，包括字段名称、业务语义、统计口径、数据格式、校验规则、报送频率等核心要求，建立一一对应的映射关系。

5. 试点成果验证

为检验“主题层-指标层-报送层”三层数据标准体系在真实业务环境中的有效性，课题组试点聚焦监管报送中最典型、最易产生分歧的业务场景，重点验证标准体系在提升监管响应效率、统一业务口径、释放数据价值等多维度的实际成效。

（1）监管口径变更响应效率显著提升

监管机构2022年对证券公司分支机构监管报送中的“Y2证券公司分支机构账户情况G3004”填报内容做了更明细化的调整，即在原有“资金账户”“证券账户”等分类基础上，新增“合格”“不合格”“休眠”“其他”四类账户规范状态维度。

原报送内容表样（如图5所示）：

分支机构代码		帐户情况表					
		所属辖区					
项目	资金账户	A股证券账户	B股证券账户	基金账户	信用证券账户	衍生品合约账户（户）	
一、账户数量	期初户数						
	本期增加数						
	本期现场开户数						
	本期网上开户数						
	本期见证开户数						
	本期减少数						
	本期现场销户数						
	本期网上销户数						
	本期见证销户数						
	期末户数						
	期末机构户数						
	备注						

图5 原报送表样

现报送内容表样（如图6所示）：

Y2 证券公司分支机构账户情况															
分支机构代码	项目	期初户数	本期增加数	所属辖区	本期现场开户数	本期网上开户数	本期见证开户数	本期减少	本期现场销户数	本期网上销户数	本期见证销户数	期末户数	期末机构户数	备注	
一、账户数量	合格账户	储蓄金账户													
		主资金账户													
		A股证券账户													
		B股证券账户													
		基金账户													
		信用证券账户													
	不合格账户	衍生品合约账户													
		储蓄金账户													
		主资金账户													
		A股证券账户													
		B股证券账户													
		基金账户													
	休眠账户	信用证券账户													
		衍生品合约账户													
		储蓄金账户													
		主资金账户													
		A股证券账户													
		B股证券账户													
	其他账户	基金账户													
		信用证券账户													
		衍生品合约账户													
		储蓄金账户													
		主资金账户													
		A股证券账户													

图 6 现报送表样

在本次试点中，得益于指标层采用“指标+维度”的标准化设计，业务变更仅需在维度体系中启用“账户规范类型”维度及其四个属性，包括合格、不合格、休眠、其他。通过构建精细化、全覆盖的维度-指标矩阵，在无需调整底层指标逻辑的前提下，既满足原有监管表样的报送要求，又能灵活适配当前多样化的业务场景，显著提升工作效率、降低实施成本。同时，基于统一维度与标准组合的落地应用，有效减少了因口径理解不一致引发的数据质量问题，提升监管数据的可比性与可信度。

（2）指标数据复用

本课题所构建的原子指标具备“一地多用”的核心特性：即在满足监管报送口径要求的同时，天然适配公司内部经营管理分析场景。例如，“客户月度交易金额”“合格账户数量”“融资融券余额”等原子指标，既可按监管维度，例如营业部、账户类型、规范状态，组合生成 Y2、Y4 等报送报

表字段，也可直接用于管理驾驶舱、分支机构绩效考核、客户分层运营等经营分析场景。

通过统一指标定义、计算逻辑与数据来源，有效消除了监管报送与经营分析之间的“口径鸿沟”，避免了重复开发与数据不一致问题。这不仅提升了数据资产的复用效率，更推动了监管合规与业务价值的双向融合，真正实现“一套标准、双向赋能”。

本课题明确了监管报送口径与经营分析指标的对应关系，打通数据壁垒，实现指标复用（如表 18 所示）。

表 18 指标复用样例

经营分析指标复用情况					
数据分析模块	业务看板	统计周期	指标名称	复用指标名称	统计维度
管理驾驶舱	经营成果	月	营业收入	本期金额-营业收入	机构维度：营业部
管理驾驶舱	经营成果	月	营业支出	本期金额-营业支出	机构维度：营业部
管理驾驶舱	经营成果	月	净利润	本期金额-净利润	机构维度：营业部
管理驾驶舱	经营成果	月	净资产	期末余额-资产净值	机构维度：营业部
管理驾驶舱	收入结构占比	月	手续费收入	本期金额-营业收入-手续费及佣金收入	机构维度：营业部
管理驾驶舱	收入结构占比	月	利息收入	本期金额-营业收入-利息收入	机构维度：营业部

本课题通过研究指标数据的复用场景，有效提升开发效率、减少潜在成本投入，同步提升证券经营机构数据管理能力、监管报送质量与企业自身的经营分析能力。

（三）数据标准应用设计

本课题所构建的“主题层 - 指标层 - 报送层”三层联动数据标准体系，其价值不仅在于标准本身的科学性与结构性，更在于能否在证券经营机构真实业务场景中实现高效、可持续的落地应用。

为确保数据标准的落地实效，课题组围绕组织协同机制、质量管控规范、平台化落地实施三个维度，设计以业务为导向、多部门协同、技术可承载的数据标准应用体系，实现以业务需求为牵引、以监管要求为准绳、以数据治理为手段，确保标准的落地实践成效，打通标准设计与业务价值实现的“最后一公里”。

1. 组织机制

数据标准的有效落地依赖于业务理解、数据治理与技术实现三者的深度融合。为避免标准设计与执行脱节，课题组设计融合权责对等、流程闭环、动态协同的组织保障机制，明确业务部门、数据管理部门、合规部门与信息技术部门在标准全生命周期中的角色定位与协作方式，形成“共商、共

建、共用、共维”的标准治理格局。

在标准制定与维护环节，设立由业务部门、合规部门、数据管理部门和信息技术部门共同组成的监管数据标准联合工作组。该工作组采用“共商共议、共同确认”机制执行工作（如表 19 所示）。

表 19 分工机制表

业务部门职责	负责提出监管口径变更需求、确认指标业务含义与统计逻辑，确保标准贴合真实业务场景。
数据管理职责	负责标准结构化表达、编码分配、跨系统映射协调及版本管理，确保标准逻辑严谨、可追溯。
信息技术职责	负责评估标准的技术可实现性、设计物理模型、开发数据接口，确保标准可落地、可集成。
合规部门职责	负责审核标准与监管要求的符合性，验证指标合规性，确保标准与监管政策保持一致。

数据标准的新增、变更或废止，需各参与方共同评审并签署确认，确保标准在业务语义、数据逻辑与技术实现三个维度上保持一致。

在标准执行与反馈环节，课题组建立“总部－分支机构”两级协同机制。总部负责标准统一发布、培训宣贯与平台支持。各分支机构指定业务接口人、数据接口人与技术接口人，组成本地标准执行小组，负责标准在本地系统的适配、口径执行监控及问题反馈。

2. 质量规范

数据标准不仅是统一语义的工具，也是数据质量管理的直接依据。本课题在标准设计过程中，将监管报送对数据准确性、完整性、一致性与时效性的要求，内嵌于标准的业务定义、统计口径、数据来源、取值范围等属性之中。通过系统梳理标准内容，可直接派生出可执行的质量检核规则，并据此构建覆盖“主题层-指标层-报送层”的质量管理规范。

首先，标准中对字段是否必填、取值是否合法、主外键关系是否完整等定义，直接转化为数据接入阶段的质量规则。例如，《账户主题标准》规定“账户规范类型代码”（F-ACC-000004）为非空字段，限定了取值范围。据此，系统自动生成两条校验规则：一是该字段不得为空，二是取值必须在预设枚举范围内。此类规则在数据入仓时即执行，确保源头数据符合标准定义，避免因字段缺失或非法值导致下游统计偏差。

其次，原子指标标准中明确的统计周期、计算公式、数据来源与过滤条件，构成指标计算的质量基准。以原子指标

“A_BRO_EVT_000001：股票普通交易金额”为例，其标准定义为：“统计周期为月度，数据来源为柜台系统，统计条件为账户状态非注销”。据此生成三条质量规则：一是指标是否在T+3日内产出；二是数据是否来源于指定系统；三是

是否错误包含已销户账户。规则执行结果与标准编码绑定，异常数据可自动追溯至具体标准条款，便于业务、数据与技术三方协同核查。

最后，标准中对报表字段的勾稽关系、跨字段依赖、格式约束等要求，直接转化为报送前的逻辑校验规则。例如，Y2 报表要求“期初户数 + 新增户数 - 销户数 = 期末户数”，该逻辑被编码为跨字段校验规则，并关联报送项编码 R - G3004 - D04。规则在报送文件生成前自动触发，未通过校验的报表无法提交，从机制上杜绝逻辑矛盾数据上报。

本课题将上述规则统一纳入《监管报送数据质量规则库》，对应责任主体，确保规则可追溯、问题可定位、责任可归属。在此基础上，建立“规则准入 - 执行监控 - 问题闭环”的管理机制：所有质量规则必须源自已发布的数据标准，经联合工作组评审后方可生效；规则通过数据质量管理平台自动执行，生成问题清单并推送至责任方；问题整改需反馈至标准层面，必要时触发标准修订，形成“标准、规则、问题、优化”的持续改进闭环。通过将数据标准直接转化为质量管理规范，实现了质量管控从“事后纠错”向“事前约束、事中控制”的转变，使数据质量成为标准落地的自然结果，切实支撑监管报送数据“可信、可用、可审计”的核心目标。

3. 落地实施

数据标准的价值最终体现在系统化、可操作的落地实践中。为保障“主题层-指标层-报送层”三层标准体系在证券经营机构真实环境中高效运行，课题组围绕标准建模、质量规则嵌入、平台一体化支撑三个关键环节，设计了以标准为驱动、以协同为保障、以平台为载体的落地实施路径，确保标准从文档走向系统、从规则走向能力。

（1）物理模型建设

在物理模型建设上，严格遵循标准编码与属性定义，实现标准到物理表的精准映射。

以主题层字段“账户规范类型代码”，其在《账户主题标准》中明确定义了字段名称、业务含义、枚举值、数据类型及非空约束。在数据中台建设过程中，技术团队依据该标准直接创建对应字段，并通过元数据管理工具将其与标准编码自动关联。这种“标准先行、模型对齐”的做法，确保了不同系统在引用同一字段时语义一致、结构统一，从根本上避免“同名不同义”或“同义不同构”的问题。

（2）质量规范落地

将标准衍生的质量规则嵌入数据加工与报送流程，实现质量管控自动化。

如前所述，原子指标“A_BRO_EVT_000001 股票普通

“交易金额”的标准定义包含统计周期、数据来源与过滤条件，据此生成的校验规则被配置至数据质量管理平台，在指标计算完成后自动执行。若发现数据来源非柜台系统，或包含已销户账户，系统将立即阻断后续报送流程并生成问题工单，推送至业务、数据、技术三方接口人协同处理。此类规则与标准编码强绑定，确保质量问题可追溯、可归责、可闭环，显著降低人工核查成本与误报风险。

（3）一体化平台建设

构建监管报送一体化平台，打通“标准 - 模型 - 质量 - 报送”全链路（如图 7 所示）。

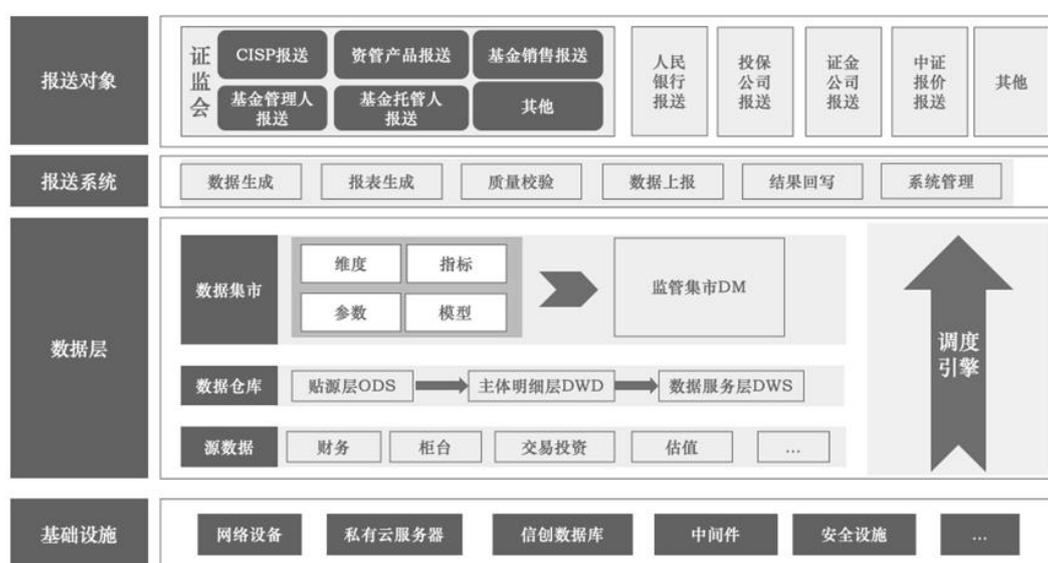


图 7 一体化平台建设

该平台作为标准落地的核心载体，采用分层架构设计，自下而上包括基础设施、数据层、报送系统和报送对象四个层级，形成各层级功能明确、职责清晰，共同支撑标准的全

流程应用。

通过平台化手段，标准执行过程变得透明、可控、可审计。业务人员可直观理解指标构成，数据人员可高效维护口径逻辑，技术人员可快速定位系统问题，三方在统一平台上协同作业，真正实现“一套标准、一个平台、多方共用”。

综上，本课题的落地实施路径，不是简单地将标准文档交付开发，而是通过标准驱动建模、规则嵌入流程、平台支撑协同的系统性设计，将数据标准转化为可执行、可监控、可迭代的组织能力。这一路径不仅满足当前监管报送对准确性与时效性的刚性要求，更为未来标准在风险管理、经营分析等不同场景的复用奠定坚实基础，推动证券经营机构数据治理从“合规驱动”迈向“价值驱动”。

四、研究结论与建议

（一）研究成果

本课题立足于证券经营机构监管报送实践，系统构建了以“业务引领、三层联动、标准先行”为核心的监管报送数据管理体系，并通过试点验证其有效性与可操作性。在此基础上，课题将形成两项核心成果：

1. 《课题研究报告》：报告主要描述了本次课题研究的背景与意义、总体目标、主要研究内容以及研究展望。其中，

主要研究内容包括现状分析与梳理、数据标准体系设计和数据标准应用设计，形成了一套结构清晰且可推广复用的监管数据标准落地方法论，为行业提供了可借鉴的实施路径。

2.《证券经营机构监管报送指标数据管理指南（草案）》：形成一套科学、规范、实用的监管报送指标数据管理工作指南，包括指标管理的总体原则、管理目标、体系框架、工作思路、指标数据全生命周期管理过程（含需求解析、标准定义、评审发布、应用组装、运行监控、变更迭代等）以及保障体系。为证券经营机构开展监管报送指标数据管理工作提供系统性的方法指导，助力机构实现从被动合规到“监管赋能经营”的价值升级，提升证券经营机构整体数据治理水平，为同业提供管理实践参考指南。

（二）未来展望

本次研究以证券经营机构监管报送为基础，构建并验证了“两轴双翼”监管报送模式的有效性。该模式以“业务-数据全生命周期”为核心两轴，覆盖“总部-分支机构”建设的双翼，完成了从现状梳理、标准框架设计、三层模型构建及试点验证的完整路径的实践探索，形成了一套可复用、可扩展的监管报送指标数据管理方法论。基于本课题的研究成果，课题组将继续拓展实践深度及落地范围。

1. 模式的横向推广

基于这套经过验证的方法论和指标数据管理体系，课题组将逐步推广至其他试点单位。通过这一阶段的实践，进一步验证“两轴双翼”模式在多样化场景下的普适性，夯实监管报送指标数据管理建设的实践基础。

（1）数据人才能力提升。系统性开展面向机构内部的数据标准宣贯与应用培训，推动业务、合规与技术人员对统一指标定义、维度体系和报送映射规则的理解与使用，实现标准语言的全域对齐。

（2）数据标准持续适配。在推广过程中，结合监管细则与业务特点，动态完善维度取值、指标口径等标准内容，增强标准体系的包容性与适应性。

2. 模式的纵向深化

围绕监管报送本身的价值深化，课题组将持续优化监管报送指标数据的复用能力。

（1）指标数据持续迭代：基于监管规则变化与业务发展需求，细化原子指标颗粒度，丰富维度组合逻辑，提升指标体系对新报送场景的快速响应能力。

（2）应用场景延伸：推动监管报送指标数据在风控、经营分析、绩效考核等内部场景复用；同时，建设公司级监管报送知识库，提供智能问答与标准检索服务，支持“问即所得”的口径

解读与合规指引，提升智能化应用水平。

同时，在充分论证研究成果的基础上，课题组将积极与监管部门、同业机构等开展合作，推动研究成果具备行业示范效应，促进应用与推广。本课题基于广泛且扎实的调研基础，将成果转化为行业标准后，将为行业提供一套行之有效的监管报送指标数据管理指南，为证券行业的高质量发展贡献力量。

参考文献

- [1] 中国证监会智慧监管平台. 证券经营机构数据报送接口规范[R]. 2025.
- [2] 中国证监会中央监管平台. 证券公司分支机构数据报送接口规范[R]. 2023.
- [3] 全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会. 证券期货业业务标准设计方案(2019版)[Z]. 2019.
- [4] 国家市场监督管理总局. 证券及相关金融工具 金融工具分类: GB/T 35964—2018[S]. 2018.
- [5] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据分类分级指引: JR/T 0158—2018[S]. 2018.
- [6] 国家标准化管理委员会. 证券及相关金融工具 国际证券识别编码体系: GB/T 21076—2017[S]. 2017.
- [7] 国家标准化管理委员会. 证券及相关金融工具 金融工具短名(FISN): GB/T 39601—2020[S]. 2020.
- [8] 国家标准化管理委员会. 证券及相关金融工具 金融工具分类(CFI)编码: GB/T 35964—2023[S]. 2023.
- [9] 中国人民银行, 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据安全风险防控 数据分类分级指引: GB/T 42775—2023[S]. 2023.
- [10] 中国证券监督管理委员会. 证券业登记结算核心术语: JR/T 0249—2022[S]. 2022.
- [11] 中国证券监督管理委员会. 期货合约要素: JR/T 0181—2020[S]. 2020.
- [12] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业基础数据元规范 第1部分: 基础数据元: JR/T 0304.1—2024[S]. 2024.
- [13] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业基础数据元规范 第2部分: 基础代码: JR/T 0304.2—2024[S]. 2024.
- [14] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据模型 第4部分: 基金公司逻辑模型: JR/T 0176.4—2022[S]. 2022.
- [15] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据模型 第5部分: 期货公司逻辑模型: JR/T 0176.5—2024[S]. 2024.
- [16] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据模型 第1部分: 抽象模型设计方法: JR/T 0176.1—2019[S]. 2019.
- [17] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据模型 第3部分: 证券公司逻辑模型: JR/T 0176.3—2021[S]. 2021.
- [18] 中国证券监督管理委员会. 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: JR/T 0177.1—2020[S]. 2020.
- [19] 中国证券监督管理委员会. 证券期货业数据标准属性框架: JR/T 0319—2024[S]. 2024.
- [20] 中国证券监督管理委员会. 期货公司监管数据采集规范 第1部分: 基本信息和经纪业务: JR/T 0293—2023[S]. 2023.
- [21] 中国证券监督管理委员会. 投资研究时序数据参考模型: JR/T 0303—2024[S]. 2024.
- [22] 中信建投证券股份有限公司. 证券公司自营业务数据模型标准研究[R]. 2024.

课题负责人：	黄玉锋	浙商证券股份有限公司	高级管理人员/ 首席信息官
课题成员：	潘豪	中国证券监督管理委员会 浙江监管局机构监管一处	副处长
	黄亮	中国证券监督管理委员会 浙江监管局机构监管二处	四级调研员
	杨锴	中国证券监督管理委员会 浙江监管局机构监管二处	三级主任科员
	童卫	浙商证券股份有限公司 数字应用中心	副总经理 (主持工作)
	林晖晖	浙商证券股份有限公司 数字应用中心	总经理助理
	王一华	浙商证券股份有限公司 信息技术开发部	内控开发部经理
	叶群英	浙商证券股份有限公司 数字应用中心数据资产部	分析师
	吕婴	浙商证券股份有限公司 信息技术事业部	合规专员
	胡纯超	港融科技有限公司	交付总监