

中华人民共和国金融行业标准

JR/T XXXXX—XXXX

证券期货业数据标准属性框架

Data standard attribute framework of securities and futures industry

(征求意见稿)

XXXX—XX—XX 发布

XXXX—XX—XX 实施

目 次

前言	II
引言	III
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
4 基础类数据标准	2
4.1 基础类数据标准架构	2
4.2 业务属性	3
4.3 技术属性	5
4.4 管理属性	7
5 指标类数据标准	7
5.1 指标类数据标准架构	7
5.2 业务属性	8
5.3 技术属性	9
5.4 管理属性	10
附录 A（资料性） 基础类数据标准示例	11
附录 B（资料性） 指标类数据标准示例	13
附录 C（资料性） 数据标准主题及信息项分类示例	15
参考文献	17

前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

本文件由中国证券监督管理委员会提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本文件起草单位：中国证券监督管理委员会科技监管局、中证数据有限责任公司、中证信息技术服务有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、中国期货市场监控中心、全国中小企业股份转让系统有限责任公司、中国证券金融股份有限公司、中国证券投资者保护基金有限责任公司、中国金融期货交易所、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会、中国期货业协会、中证指数有限公司、中证机构间报价系统股份有限公司。

本文件主要起草人：待定

引 言

数据标准是数据治理工作的核心领域之一，通过建立定义清晰、属性明确、约束规范的一组数据标准，有助于业务、数据、技术等各相关方对数据的统一理解和使用，确保数据在采集、加工、交换和共享等环节的一致性和准确性，减少系统数据转换和清洗工作复杂程度，降低数据处理和应用成本，对于促进数据规范融合、提升数据质量水平、提高数据交换效率、发挥数据应用价值等都具有十分重要的意义。开展证券期货业数据标准编制工作，能够帮助增强资本市场业务操作者、系统建设者、数据应用者等各相关参与方对数据理解和使用的一致性、准确性，为构建上层数据模型、信息模型、事件模型等提供基础参考，对于推动开展行业数字化转型、夯实应用系统数据基础、强化数据底座建设、提升行业机构数据互操作效率，促进实现“数据让监管更加智慧”的愿景等都具有重要意义。《证券期货业科技发展“十四五”规划》中明确指出，要“大力推进资本市场基础数据标准和监管数据标准制定”，为行业数据标准的研究、制定及推广工作指明了方向。

建立一套适用于证券期货业的数据标准属性框架，对提高证券期货业数据管控水平，规范证券期货业数据标准的定义，统一证券期货业数据属性的描述，促进证券期货经营机构间数据的共享具有重大意义。

本文件规定了证券期货业基础类数据标准和指标类数据标准应包含的业务属性、技术属性和管理属性及各属性的说明及要求，为证券期货业各领域数据标准建设提供指导和参考。

证券期货业数据标准属性框架

1 范围

本文件规定了证券期货业基础类数据标准和指标类数据标准的属性框架。

本文件适用于在中华人民共和国境内注册和经营的证券期货经营机构开展数据收集、治理相关等各项数据类相关工作。

2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅所注日期的版本适用于本文件。凡是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。

GB/T 5271.1-2000 信息技术 词汇 第 1 部分：基本术语

GB/T 18391.1—2009 信息技术 元数据注册系统 (MDR) 第 1 部分：框架（ISO/IEC 11791-1:2004, IDT）

GB/T 20000.1-2014 标准化工作指南 第 1 部分：标准化和相关活动的通用术语

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

数据 data

信息的可再解释的形式化表示，以适用于通信、解释或处理。

注：数据可以由人工或自动的方式加工、处理。

[来源：GB/T 5271.1-2000，术语和定义 01.01.02]

3.2

标准 standard

通过标准化活动，按照规定的程序经协商一致制定，为各种活动或其结果提供规则、指南或特性，供共同使用和重复使用的文件。

注：标准宜以科学、技术和经验的综合成果为基础。

[来源：GB/T 20000.1-2014，规范性文件的种类 5.3]

3.3

数据标准 data standard

对数据的表达、格式及定义的一致约定，包含数据业务属性、技术属性和管理属性的统一定义。

3.4

基础类数据标准 Basic data standard

基础类数据标准是对基础类数据进行标准化后形成的标准化规范。

注：基础类数据指对日常业务开展过程中所产生、未经过加工和处理的基础性数据。

3.5

指标类数据标准 Indicator data standard

指标类数据标准是为满足内部分析管理、风险控制等需要以及外部监管指标要求，对基础类数据加工而产生的指标类数据标准化规范。

注：指标类数据是指按一定的统计口径、分析规则加工而成的衍生数据。

3.6

属性框架 attribute framework

为了明确数据标准所包含的内容，清晰的描述数据的特性，从业务属性、技术属性和管理属性三个维度规定的的数据标准架构。

4 基础类数据标准

4.1 基础类数据标准架构

证券期货业基础类数据标准的内容是证券期货经营机构在开展业务过程中所涉及的基础类数据的特性。基础类数据标准属性框架包括业务属性信息、技术属性信息、管理属性信息：

a) 业务属性：描述数据与证券期货业务相关联的特性。业务属性包括主题、信息大类、信息小类、中文名称、业务含义、标准别名、被引用项名称、代码编码、参考依据、代码取值、代码取值含义、代码取值编码规则；

b) 技术属性：描述数据与信息技术实现相关联的特性，是数据在信息系统项目实现时统一的技术方面的描述。技术属性包括英文名称、数据格式、数据类型及长度、度量单位、取值范围；

c) 管理属性：描述数据标准与数据管理相关联的特性，是数据管控在数据标准管理领域的统一要求。管理属性包括编码、归口管理部门、标准相关部门、当前版本号、版本日期、发布状态。

框架中的每个具体属性不是在所有情况下都是必须的，这些属性被分为必选、可选两种约束类型，证券期货业基础类数据标准架构如图1所示。



图1 证券期货业基础类数据标准架构

基于上述数据标准架构的基础类数据标准示例参见附录A。

4.2 业务属性

4.2.1 主题

主题是指信息项归属的数据标准主题。证券期货行业中主要涉及的主题包括：主体、品种、账户、行为、资产、协议、财务、监管、披露等。

4.2.2 信息大类

描述主题下的信息项主分类，如：在主体主题域下，信息大类分为投资者信息、发行人信息、中介服务机构信息等，主体主题域信息大类分类示例参见附录C。

4.2.3 信息小类

描述信息项主分类下的子分类，如：在投资者信息大类下，信息小类分为证券投资者信息、债券投资者信息、期货投资者信息等，主体主题域信息小类分类示例参见附录C。

4.2.4 中文名称

描述信息项的中文名称。数据标准中文名称应易于被数据使用人员理解和识别。信息项中文命名应遵循以下规则：

- a) 唯一性规则：信息项中文名称应唯一；
- b) 为描述特定语境的信息项，可以通过多个定语的组合限定应用场景，如“股东全部权益账面价值”，其中“股东”、“全部”、“权益”为定语；
- c) 信息项名称中应不出现“与”、“或”、“及”为连接词；
- d) 信息项名称中应不出现下划线、斜杠等符号以及括号等备注类信息；
- e) 信息项名称具有现行国家标准、行业标准可供参考时，应遵循国家标准、行业标准命名，如“组织机构代码”、“统一社会信用代码”、“法人机构识别编码”、“投资者识别码”等。

4.2.5 业务含义

业务含义是指信息项的详细说明信息。业务含义应该精准、细致，以利于数据使用人员理解，不应有循环引用或直接用中文名称进行描述。业务含义可参考相关国家标准和行业标准、外部监管机构的定义、证券期货经营机构内部业务制度、信息系统业务需求定义、以及行业经验的总结性归纳。

4.2.6 标准别名

标准别名是描述信息项的别名，如信息项“报告所属年度”的标准别名为“报告年度”。

4.2.7 被引用项名称

被引用项名称是描述被引用信息项的名称，如信息项“报告所属年度”的被引用项名称为“年度”。

4.2.8 代码编码

信息项为枚举值类型时规定的代码编码，由字母D+4位数字构成。

4.2.9 参考依据

描述制定该信息项的参考依据，包括：包括法律法规、部门规章、规范性文件、国家标准、行业标准。

4.2.10 代码取值

采用简短的数字或字符，描述预定的含义，如：HKG在“国家及地区代码”中代表“中国香港”。

4.2.11 代码取值含义

描述代码取值对应的具体业务含义。

4.2.12 代码取值编码规则

描述代码取值的编码规则，如：1级1位编码、1级2位编码、2级2位编码等。代码取值编码规则见表1。

表 1 代码取值编码规则

编码规则	说明	示例
字母编码	代码取值编码由字母组成，遵循国家标准或其他编码标准中已定义的编码规则	HKG 在“国家及地区代码”中代表“中国香港”；CNY 在“币种”中代表“人民币”
XX级XX位编码	代码取值编码由数字组成，在国家标准或其他编码标准中有编码规则定义，则直接采用已有标准定义	“性别”为1级1位编码采用GB/T 2261.1-2003 个人基本信息分类与代码 第1部分：人的性别代码 中定义的编码规则（0-未知的性别、1-男性、2-女性、9-未说明的性别）
	代码取值编码由数字组成，采用2位数字为1级，如：1级2位编码、2级4位编码、3级6位编码	“证件类型”为3级6位编码 1级：01 个人，02 机构，03 产品 2级：0101 身份证，……，0106 士兵证 3级：010601 解放军士兵证，010602 武警士兵证

4.3 技术属性

4.3.1 英文名称

描述信息项在实施到物理平台时采用的英文名称，由字母、数字及下划线构成，原则上不超过60个字符，采用尽量简洁的英文缩写，通过下划线进行区隔。英文字段名称编制的具体规则如下：

- a) 英文词根均采用大写；
- b) 英文词根只能用下划线“_”作为连接符；
- c) 单个英文词根不超过5个字符；
- d) 单个英文词根不足5个字节时，一般全取，多于5个时，一般去掉形容词后缀，或仅取有标志性的前缀词头；
- e) 关键字不能作为词根，如：CREAT、SUBMIT、INSERT、DELETE等；
- f) 英文词根中不含标点符号等特殊字符；
- g) 对于复合词和词组，如有约定俗称的缩写，则作为单个词根采用；如需自定义，一般取其中单个词的首字母组合；
- h) 有特指的英文缩写优先采用，如：_Wind对应_WDI、IPO对应_IPO。

4.3.2 数据格式

描述信息项的数据格式分类，数据格式分成六类：C 字符型、B 布尔型、N 数值型、D 日期型、T 日期时间型、E 枚举型。

数据格式的详细描述如下：

- a) 数值型 N：实际实现的数据类型应为：INTEGER或DECIMAL(长度,小数点)，其中对于整型数值数据，数据类型应为INTEGER；对于浮点型数值数据，数据类型应为DECIMAL(长度,小数点)；
- b) 字符型 C：实际实现的数据类型应为CHAR(长度)或VARCHAR(长度)；
- c) 日期型 D：实际实现的数据类型应为DATE；
- d) 时间型 T：实际实现的数据类型应为DATETIME或TIMESTAMP；
- e) 布尔型 B：实际实现的数据类型应为CHAR(1)。在数据项代码取值中应说明“0”、“1”所代表的含义，一般“0”应表示“否”的含义，“1”应表示“是”的含义；

f) 枚举型 E: 实际实现的数据类型应为CHAR(长度), 在数据项代码取值中应说明数据项所描述的键值关系或引用的数据标准, 代码原则上应以数字描述。

4.3.3 数据类型及长度

描述信息项在实施到物理平台时采用的数据类型和长度。数据格式与数据类型及长度对应关系见表2。

表2 数据格式与数据类型及长度对应关系

C 字符型	N 数值型	D 日期型	T 时间型	E 枚举型	B 布尔型
VARCHAR(10)	DECIMAL(4, 0)	DATE	TIMESTAMP(0)	CHAR(1)	CHAR(1)
VARCHAR(20)	DECIMAL(9, 0)	—	TIMESTAMP(6)	CHAR(2)/VARCHAR(2)	—
VARCHAR(30)	DECIMAL(9, 4)	—	—	CHAR(3)/VARCHAR(3)	—
VARCHAR(40)	DECIMAL(18, 0)	—	—	CHAR(4)/VARCHAR(4)	—
VARCHAR(50)	DECIMAL(18, 4)	—	—	CHAR(5)/VARCHAR(5)	—
VARCHAR(60)	DECIMAL(18, 6)	—	—	CHAR(6)/VARCHAR(6)	—
VARCHAR(100)	DECIMAL(20, 4)	—	—	VARCHAR(10)	—
VARCHAR(200)	DECIMAL(20, 6)	—	—	VARCHAR(20)	—
VARCHAR(300)	DECIMAL(24, 4)	—	—	VARCHAR(30)	—
VARCHAR(400)	DECIMAL(24, 6)	—	—	VARCHAR(40)	—
VARCHAR(500)	DECIMAL(26, 4)	—	—	—	—
VARCHAR(600)	DECIMAL(38, 4)	—	—	—	—
VARCHAR(800)	—	—	—	—	—
VARCHAR(1000)	—	—	—	—	—
VARCHAR(2000)	—	—	—	—	—
VARCHAR(3000)	—	—	—	—	—
VARCHAR(4000)	—	—	—	—	—
VARCHAR(6000)	—	—	—	—	—
VARCHAR(32000)	—	—	—	—	—
VARCHAR(80000)	—	—	—	—	—
TEXT	—	—	—	—	—

4.3.4 度量单位

描述信息项在实施到物理平台时采用的度量单位。

4.3.5 取值范围

描述信息项在实施到物理平台时取值范围。

4.4 管理属性

4.4.1 编码

为信息项分配的唯一编号，由数据标准制定者统一指定编码规则，如：由代表信息项归属主题的3位字母+4位数字序号构成。

4.4.2 归口管理部门

对该信息项进行制定并行使解释权的部门。

4.4.3 标准相关部门

描述与该信息项相关的部门。

4.4.4 安全级别

描述该信息项对应的行业数据分级认定相关制度规范所规定的的数据级别。

4.4.5 使用级别

描述该信息项对应的使用范围级别，从低到高划分为四级。一级：依法公开数据；二级：机构或者组织体系内共享数据；三级：本业务领域范围共享数据，可在指定单位、部门范围内使用；四级：特定共享，依申请经数据源单位同意后使用。

4.4.6 防控级别

描述该信息项对应的《证券期货业数据安全风险防控 数据分类分级指引》所规定的的数据级别。

4.4.7 版本日期

描述该信息项的版本日期。

4.4.8 当前版本号

描述该信息项的版本号。

4.4.9 发布状态

描述该信息项的发布情况。

5 指标类数据标准

5.1 指标类数据标准架构

证券期货业指标类数据标准的内容是证券期货经营机构在开展业务过程中所涉及的指标类数据的特性。指标类数据标准属性框架包括业务属性信息、技术属性信息、管理属性信息：

a) 业务属性：描述数据与证券期货业务相关联的特性。业务属性包括信息大类、信息小类、指标中文名称、常用维度、业务含义、计算公式、范围及条件、标准别名、相关基础标准、相关指标标准、参考依据、统计周期；

b) 技术属性：描述数据与信息技术实现相关联的特性，是数据在信息系统项目实现时统一的技术方面的描述。技术属性包括英文名称、数据类型及长度、度量单位、取值范围；

c) 管理属性：描述数据标准与数据管理相关联的特性，是数据管控在数据标准管理领域的统一要求。管理属性包括编码、归口管理部门、安全级别、使用级别、防控级别、版本日期、当前版本号、发布状态。

框架中的每个具体属性不是在所有情况下都是必须的，这些属性被分为必选、可选两种约束类型，证券期货业指标类数据标准架构如图2所示。

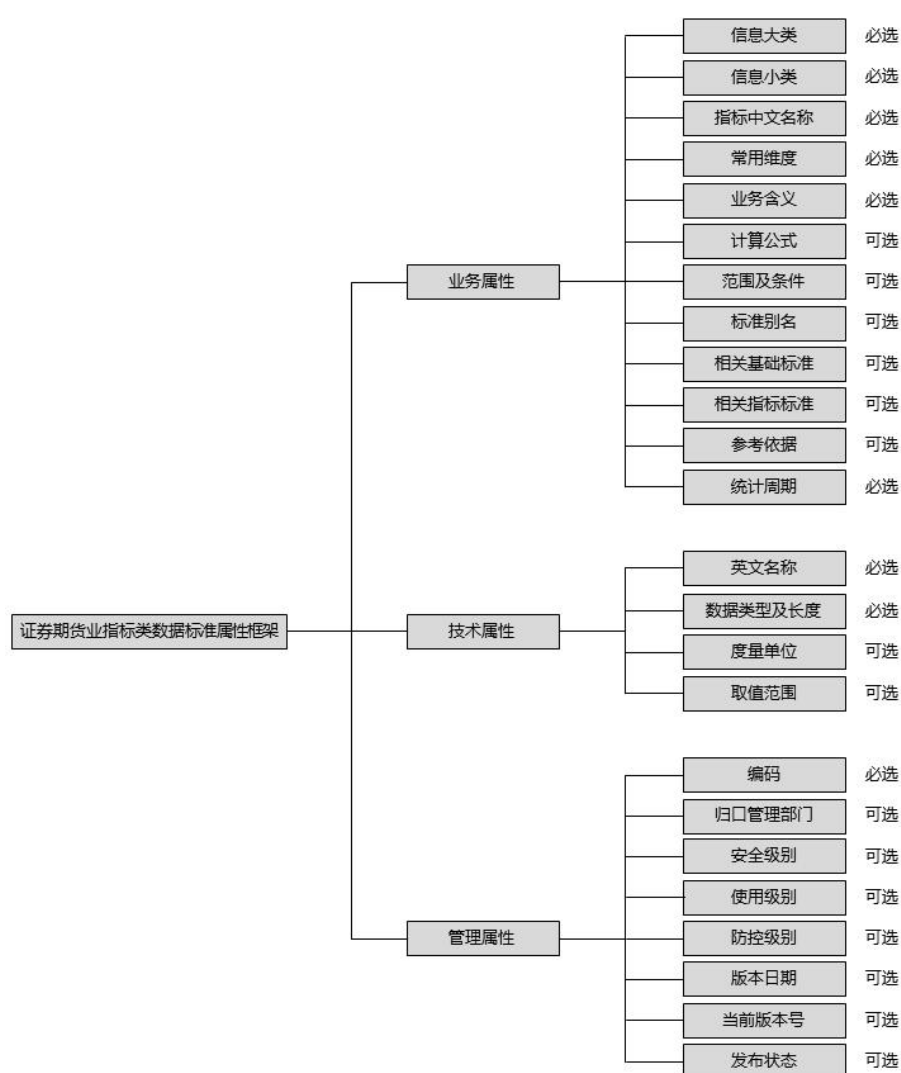


图2 证券期货业指标类数据标准架构

基于上述数据标准架构的指标类数据标准示例参见附录B。

5.2 业务属性

5.2.1 信息大类

描述指标数据归属信息大类，如：股票市场、债券市场、基金市场、期货市场等。

5.2.2 信息小类

描述信息大类下的子分类，如：在股票市场信息大类下，信息小类分为市场规模、新股发行、股票交易等。

5.2.3 指标中文名称

描述指标标准项的中文名称。

5.2.4 常用维度

描述指标标准项常见的统计维度集。

5.2.5 业务含义

描述指标的业务概念。业务含义应该精准、细致，以利于数据使用人员理解。

5.2.6 计算公式

描述指标标准的数学公式和汇总路径，从而满足“口径统一”的要求。

5.2.7 范围及条件

描述计算该指标标准所采用的各种业务限制条件，如：统计范围的筛选规则、信息间的关联关系和约束条件以及例外情况等，从而满足“口径统一”的要求。

5.2.8 标准别名

描述除已确定的指标名称外的常用名称列举。

5.2.9 相关基础标准

描述与该指标有关的基础数据标准项，或者是该指标在计算过程中用到的基础数据标准项。

5.2.10 相关指标标准

描述与该指标有关的指标标准项，或者是指标在计算过程中用到的指标标准项。

5.2.11 参考依据

描述制定该指标标准的参考依据，包括：包括法律法规、部门规章、规范性文件、国家标准、行业标准。

5.2.12 统计周期

描述指标常用的计算频率周期，主要有日、周、月、季度、半年、年等。

5.3 技术属性

5.3.1 英文名称

描述指标标准在实施到物理平台时采用的英文名称，由字母、数字及下划线构成，原则上不超过60个字符，采用尽量简洁的英文缩写，通过下划线进行区隔。英文字段名称编制的具体规则同4.3.1。

5.3.2 数据类型及长度

描述指标标准在实施到物理平台时采用的数据类型和长度。

5.3.3 度量单位

描述指标标准在实施到物理平台时采用的度量单位，反映指标的度量衡。常用的数值度量单位包括份数、户数、百分比等；常用的金额度量单位包括元、万元、亿元等。

5.3.4 取值范围

描述指标标准在实施到物理平台时取值范围。

5.4 管理属性

5.4.1 编码

为指标标准分配的唯一编号，由数据标准制定者统一指定编码规则，如：由2位字母+6位数字序号构成。

5.4.2 归口管理部门

对该指标标准进行制定并行解释权的部门。

5.4.3 安全级别

描述该指标对应的行业数据分级认定相关制度规范所规定的的数据级别。

5.4.4 使用级别

描述该指标对应的使用范围级别，从低到高划分为四级。一级：依法公开数据；二级：机构或者组织体系内共享数据；三级：本业务领域范围共享数据，可在指定单位、部门范围内使用；四级：特定共享，依申请经数据源单位同意后使用。

5.4.5 防控级别

描述该指标对应的《证券期货业数据安全风险防控 数据分类分级指引》所规定的的数据级别。

5.4.6 版本日期

描述该指标标准的版本日期。

5.4.7 当前版本号

描述该指标标准的版本号。

5.4.8 发布状态

描述该指标标准的发布情况。

附 录 A
(资料性)
基础类数据标准示例

表A.1给出了根据基础类数据标准属性框架对“融资融券业务类型”数据标准的描述示例。

表 A.1 “融资融券业务类型”数据标准

属性	内容
编码	BHV1045
主题	行为
信息大类	证券交易所行为数据
信息小类	证券交易数据
中文名称	融资融券业务类型
业务含义	用于区分融资融券的业务类型的代码。融资融券业务，是指在证券交易所或者国务院批准的其他证券交易场所进行的证券交易中，证券公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。
标准别名	融资融券业务类型代码
被引用项名称	/
代码编码	D0001
代码取值	代码取值 代码取值含义 01 担保品买入 02 担保品卖出 03 融资买入 04 卖券还款 05 买券还券 06 融券卖出 07 融券平仓 08 融资平仓 09 直接还款 10 直接还券
代码取值编码规则	1级2位编码
参考依据	《证券公司融资融券业务管理办法》证监会令第117号
英文字段名称	SMT_BIZ_TYPE

属性	内容
数据格式	E
数据类型及长度	VARCHAR(2)
度量单位	/
取值范围	/
归口管理部门	中证数据
标准相关部门	上交所、深交所、中国结算、投保基金
安全级别	一般
使用级别	三级
防控级别	二级（中）
版本日期	2022年12月
当前版本号	V2.0
发布状态	已发布

附 录 B
(资料性)
指标类数据标准示例

表B.1给出了根据指标类数据标准属性框架对“融资融券余额”数据标准的描述示例。

表 B.1 “融资融券余额”数据标准

属性	内容
编码	MI000082
信息大类	股票市场
信息小类	信用交易
指标中文名称	融资融券余额
常用维度	1. 证券类别（股票、基金）；2. 业务类型（融资、融券）；3. 证券交易所，中介机构
业务含义	是指统计期末投资者未了结的融资交易和融券交易的金额。
计算公式	融资融券余额=融资余额+融券余额= Σ （融资买入额-融资偿还额）+ Σ （融券卖出量-融券偿还量） ×标的证券统计日收盘价格
范围及条件	1. 融资偿还包括直接还款、卖券还款和融资强制平仓； 2. 融券偿还包括现金偿还、买券还券、直接还券、融券强制平仓、余券划转和融券正负权益调整； 3. 不计利息和费用
常用度量单位	元
取值范围	/
标准别名	/
相关基础标准	/
相关指标标准	/
制定依据	《证券期货业统计指标标准指引》
统计周期	日
指标英文名称	SMT_BAL
数据类型及长度	DECIMAL(18,4)
归口管理部门	中证数据
安全级别	一般

属性	内容
使用级别	三级
防控级别	二级（中）
版本日期	2022 年 12 月
当前版本号	/
发布状态	已发布

附 录 C

(资料性)

数据标准主题及信息项分类示例

表C.1给出了数据标准业务属性中主题、信息大类、信息小类的分类示例，以“主体”主题为例，详见表C.1。

表 C.1 数据标准主题及信息项分类示例

主题	信息大类	信息小类
主体	主体公用信息	主体公用信息
主体	投资者信息	证券投资者信息
主体	投资者信息	债券投资者信息
主体	投资者信息	期货投资者信息
主体	投资者信息	全国股转投资者信息
主体	投资者信息	私募基金投资者信息
主体	投资者信息	报价系统投资者信息
主体	投资者信息	区域性股权投资者信息
主体	发行人信息	上市公司信息
主体	发行人信息	非上市公众公司信息
主体	发行人信息	债券发行人信息
主体	发行人信息	挂牌公司信息
主体	发行人信息	区域性股权市场公司信息
主体	中介服务机构信息	证券公司信息
主体	中介服务机构信息	期货公司信息
主体	中介服务机构信息	公募基金管理人信息
主体	中介服务机构信息	私募基金管理人信息
主体	中介服务机构信息	基金托管机构信息
主体	中介服务机构信息	会计师事务所信息
主体	中介服务机构信息	律师事务所信息
主体	中介服务机构信息	资信评级机构信息
主体	中介服务机构信息	财务/投资顾问机构信息
主体	中介服务机构信息	资产评估机构信息
主体	中介服务机构信息	增信机构信息
主体	中介服务机构信息	其他中介服务机构信息
主体	人员信息	证券从业人员信息
主体	人员信息	期货从业人员信息
主体	人员信息	基金从业人员信息
主体	人员信息	注册会计师信息
主体	人员信息	注册资产评估师信息

主题	信息大类	信息小类
主体	人员信息	公募基金管理人工信息
主体	人员信息	资信评级机构员工信息
主体	人员信息	评级机构执业人员信息
主体	董监高信息	上市公司董监高信息
主体	董监高信息	资信评级机构董监高信息
主体	股东/控制人信息	发行人股东信息
主体	股东/控制人信息	公募基金管理股东信息
主体	股东/控制人信息	公募基金管理实际控制人信息
主体	股东/控制人信息	会计师事务所合伙人信息
主体	其他市场参与者信息	区域性股权市场登记结算机构信息
主体	其他市场参与者信息	区域性股权市场运营机构信息
主体	其他市场参与者信息	区域性股权市场信息
主体	其他市场参与者信息	地方交易场所信息
主体	其他市场参与者信息	国际组织机构信息

参 考 文 献

- [1] GB/T 42775—2023 证券期货业数据安全风险防控 数据分类分级指引
 - [2] JR/T 0105—2014 银行数据标准定义规范
-