

证券期货业统计指标 标准指引 (2025 年修订)

目 录

编制说明	1
股票市场	3
SK-I: 市场规模	3
SK-I-1: 上市公司家数	3
SK-I-2: 上市公司股本	4
SK-I-3: 股票融资公司家数	6
SK-I-4: 股票融资金额	9
SK-I-5: 非金融企业直接融资规模	13
SK-I-6: 股票市值	14
SK-I-7: 上市公司市值	15
SK-I-8: 证券化率	17
SK-I-9: 股票账户数	17
SK-I-10: 股票投资者数	20
SK-I-11: 资金账户数	21
SK-II: 股票交易	22
SK-II-1: 涨跌幅	22
SK-II-2: 振幅	24
SK-II-3: 成交量	25
SK-II-4: 成交金额	26

SK-II-5: 换手率	27
SK-II-6: 市盈率	29
SK-II-7: 市净率	32
SK-II-8: 账户持股市值	34
SK-II-9: 股票账户买卖净额	35
SK-II-10: 破净股票比例	35
SK-II-11: 破净率	36
SK-II-12: 平均股价	37
SK-II-13: 股票交易费用	39
SK-III: 上市公司财务	40
SK-III-1: 上市公司上缴税费总额	40
SK-III-2: 上市公司净利润总额	40
SK-III-3: 上市公司平均净资产收益率	41
SK-III-4: 上市公司现金分红总额	43
SK-III-5: 股息率	46
SK-III-6: 现金股利支付率	48
SK-III-7: 上市公司平均资产负债率	49
SK-III-8: 上市公司平均总资产收益率	50
SK-III-9: 上市公司营业总收入	51
SK-III-10: 上市公司研发投入总额	52
SK-III-11: 上市公司研发投入占比	53
SK-III-12: 上市公司研发员工占比	53

SK-III-13: 股权激励家数	54
SK-IV: 信用交易	55
SK-IV-1: 融资融券交易金额	55
SK-IV-2: 融资融券余额	57
SK-IV-3: 维持担保比例	58
SK-IV-4: 融资买入金额	59
SK-IV-5: 融券卖出金额	59
SK-IV-6: 信用证券账户数	60
SK-IV-7: 信用交易客户数	61
SK-IV-8: 客户担保物集中度	61
SK-IV-9: 单一股票的担保物比例	63
SK-IV-10: 转融通交易金额	63
SK-IV-11: 转融通归还金额	64
SK-IV-12: 转融通期末余额	65
SK-IV-13: 转融通保证金余额	66
SK-IV-14: 转融通保证金比例	67
SK-IV-15: 做市借券融出金额	68
SK-IV-16: 做市借券归还金额	69
SK-IV-17: 做市借券期末余额	69
SK-IV-18: 做市借券保证金余额	70
SK-IV-19: 做市借券保证金比例	71
SK-V: 新股发行	72

SK-V-1: 平均超募比率	72
SK-V-2: 平均首发价格	73
SK-V-3: 平均网上发行中签率	74
SK-V-4: 新股破发率	75
SK-VI: 股票质押式回购	77
SK-VI-1: 质押率	77
SK-VI-2: 质押比例	77
SK-VI-3: 股票质押式回购成交金额	78
SK-VI-4: 待购回金额	79
SK-VI-5: 履约保障比例	80
SK-VII: 上市公司并购重组	80
SK-VII-1: 上市公司并购重组家数	80
SK-VII-2: 上市公司并购重组金额	82
SK-VII-3: 上市公司收购家数	84
SK-VII-4: 上市公司收购金额	86
SK-VII-5: 上市公司资产重组家数	88
SK-VII-6: 上市公司资产重组金额	90
SK-VII-7: 上市公司合并家数	93
SK-VII-8: 上市公司合并金额	95
SK-VII-9: 上市公司分立分拆家数	96
SK-VII-10: 上市公司分立分拆金额	98
SK-VII-11: 上市公司股份回购家数	99

SK-VII-12: 上市公司股份回购金额	100
SK-VIII: 沪（深）港通交易	101
SK-VIII-1: 沪（深）港通标的证券只数	101
SK-VIII-2: 沪（深）港通交易金额	102
SK-VIII-3: 账户持沪（深）港通证券市值	103
SK-IX: 优先股	104
SK-IX-1: 优先股公司家数	104
SK-IX-2: 优先股股本	105
SK-IX-3: 优先股市值	106
SK-IX-4: 优先股融资公司家数	107
SK-IX-5: 优先股融资金额	108
SK-IX-6: 优先股成交量	109
SK-IX-7: 优先股成交金额	110
SK-IX-8: 优先股股息总额	111
SK-IX-9: 优先股股息率	112
SK-X: 股票期权	114
SK-X-1: 期权保证金	114
SK-X-2: 期权持仓量	115
SK-X-3: 期权成交量	116
SK-X-4: 期权成交金额	117
SK-X-5: 期权成交面额	118
SK-X-6: 期权行权金额	118

SK-X-7: 期权交割数量	119
SK-X-8: 期权交割金额	120
债券市场	122
BD-I: 市场规模	122
BD-I-1: 债券发行只数	122
BD-I-2: 债券发行规模	123
BD-I-3: 债券发行金额	124
BD-I-4: 债券净融资金额	125
BD-I-5: 债券托管额	126
BD-I-6: 债券上市只数	126
BD-I-7: 持债账户数	127
BD-I-8: 债券平均发行利率	128
BD-II: 债券交易	129
BD-II-1: 债券成交金额	129
BD-II-2: 标准券总额	131
BD-II-3: 回购标准券使用率	132
BD-II-4: 回购定盘利率	132
BD-II-5: 回购未到期金额	133
BD-II-6: 兑付金额	133
BD-II-7: 本年债券待兑付本金	135
BD-II-8: 本年债券待兑付利息	135
BD-II-9: 债券平均收益率	136

BD-II-10: 借贷加权费率	137
基金市场	139
FD-I: 市场规模	139
FD-I-1: 基金只数	139
FD-I-2: 上市基金只数	139
FD-I-3: 基金份额	140
FD-I-4: 基金资产总值	141
FD-I-5: 上市基金市值	142
FD-I-6: 基金账户数	143
FD-I-7: 基金投资者数	143
FD-I-8: 基金认购金额、基金募集金额	144
FD-I-9: 基金资产净值	145
FD-II: 基金交易	146
FD-II-1: 基金申购金额、基金赎回金额	146
FD-II-2: 上市基金成交金额	147
FD-II-3: 上市基金折（溢）价率	148
FD-III: 基金绩效及分红	149
FD-III-1: 基金利润	149
FD-III-2: 基金分红金额	149
FD-III-3: 基金总持有成本	150
FD-IV: 跨境投资者	152
FD-IV-1: 合格境外投资者家数、QDII 家数	152

FD-IV-2: QDII 额度	153
FD-V: 私募基金	153
FD-V-1: 私募基金只数	153
FD-V-2: 私募基金管理人人数	154
FD-V-3: 私募基金管理规模	156
FD-VI: 不动产投资信托基金	156
FD-VI-1: 不动产投资信托基金只数	156
FD-VI-2: 不动产投资信托基金募集金额	157
FD-VI-3: 不动产投资信托基金市值	158
FD-VI-4: 不动产投资信托基金成交规模	159
FD-VI-5: 不动产投资信托基金分红金额	159
期货市场	161
FS-I: 市场规模	161
FS-I-1: 保证金	161
FS-I-2: 期货会员机构数	165
FS-I-3: 期货账户数	166
FS-I-4: 期货客户数	167
FS-II: 期货交易	169
FS-II-1: 涨跌幅	169
FS-II-2: 振幅	171
FS-II-3: 成交量	173
FS-II-4: 成交金额	175

FS-II-5: 持仓量	176
FS-II-6: 持仓金额	177
FS-II-7: 基差	179
FS-II-8: 交割量	181
FS-II-9: 交割率	181
FS-II-10: 杠杆率	182
FS-II-11: 单位客户持仓占比	184
FS-III: 期货期权	185
FS-III-1: 期权保证金	185
FS-III-2: 期权成交量	186
FS-III-3: 期权成交金额	188
FS-III-4: 期权持仓量	189
经营机构	191
PI-I: 机构规模	191
PI-I-1: 证券公司家数	191
PI-I-2: 证券公司分支机构数量	191
PI-I-3: 公募基金管理人家数	192
PI-I-4: 期货公司家数	193
PI-I-5: 期货公司分支机构家数	194
PI-I-6: 基金管理公司子公司家数	195
PI-I-7: 证券公司子公司家数	195
PI-II: 机构财务	196

PI-II-1: 总资产	196
PI-II-2: 净资产	197
PI-II-3: 平均财务杠杆	197
PI-II-4: 营业收入	198
PI-II-5: 营业支出	198
PI-II-6: 利润总额	199
PI-II-7: 净利润	199
PI-II-8: 从事证券服务业务会计师事务所营业收入	199
PI-II-9: 会计师事务所证券服务业务收入	200
PI-II-10: 从事证券服务业务资产评估机构营业收入	200
PI-II-11: 资产评估机构证券服务业务收入	201
PI-III: 风险控制	201
PI-III-1: 净资本总额	201
PI-III-2: 风险资本准备总额	202
PI-III-3: 机构风险覆盖率	204
PI-III-4: 证券公司资本杠杆率	204
PI-III-5: 证券公司流动性覆盖率	205
PI-III-6: 证券公司净稳定资金率	206
PI-IV: 机构业务	206
PI-IV-1: 客户托管资产总额	207
PI-IV-2: 代理买卖证券总额	207
PI-IV-3: 证券期货经营机构资产管理业务规模	208

PI-IV-4: 期货公司客户权益总额	209
PI-IV-5: 客户交易结算资金余额	210
PI-IV-6: 银证转账净转入额	210
全国股转系统	212
NQ-I-1: 挂牌公司家数	212
NQ-I-2: 挂牌公司股本	213
NQ-I-3: 股票发行家数	214
NQ-I-4: 股票发行次数	215
NQ-I-5: 股票融资金额	216
NQ-I-6: 挂牌公司股票市值	217
NQ-I-7: 全国股转系统股票账户数	219
NQ-I-8: 挂牌公司并购重组家数	221
NQ-I-9: 挂牌公司并购重组金额	222
NQ-I-10: 挂牌公司市盈率	223
区域性股权市场	227
REM-I: 市场规模	227
REM-I-1: 区域性股权市场服务企业家数	227
REM-I-2: 区域性股权市场转交易所上市企业家数	227
REM-I-3: 区域性股权市场转全国股转系统挂牌企业家数 ...	228
REM-I-4: 区域性股权市场融资金额	229
REM-II: 市场转让	231
REM-II-1: 区域性股权市场转让金额	231

衍生品市场	234
DM-I: 市场规模	234
DM-I-1: 名义本金	234
DM-I-2: 衍生品经营机构数量	235
DM-I-3: 保证金	236
DM-I-4: 市场价值	237
DM-I-5: 市场集中度	238
DM-II: 对冲交易	239
DM-II-1: 对冲交易规模	239
DM-II-2: 对冲交易量	240
DM-III: 杠杆	240
DM-III-1: 杠杆率	240
DM-III-2: 个股合约端杠杆率	243
DM-III-3: 个股对冲端杠杆率	244
公司控股情况分类标准	245
股票投资者分类标准	250
相关制度规则	256

编制说明

一、根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国统计法》《证券期货市场统计管理办法》等法律、行政法规和部门规章，制定本指引。

二、本指引主要用于规范证券期货监管系统内部的统计工作。系统各单位、各司局生产、报送和发布证券期货领域的统计数据，应遵守本指引规定的统计标准。

三、本指引共分股票市场、债券市场、基金市场、期货市场、经营机构、全国中小企业股份转让系统（以下简称全国股转系统）、区域性股权市场、衍生品市场、统计分类标准和附录十大部分。如无特殊说明，本指引所称的境内证券交易所为上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所。

四、指标的编写结构分为：“指标名称”“基本定义”“统计属性”“指标种类”“指标说明”“相关制度规则”等组成部分。

五、本指引所涉及的财务类指标，一般作汇总统计。

六、本指引中所涉及“股票”“股份”和上市公司财务数据如无特殊说明均指普通股。

七、本指引中所涉及“基金”，如无特殊说明均指公募基金。

八、本指引所涉及的成交量、成交金额按单边计算，交易量、交易金额按双边计算。

九、本指引中所用 B 股汇率每周调整一次，使用上周最后一个

交易日国家外汇管理局对外公布的汇率中间价。

十、本指引的上市公司行业分类参照《中国上市公司协会上市公司行业统计分类指引》。公司控股情况分类、投资者分类分别按“统计分类标准”章节中的《公司控股情况分类标准》和《股票投资者分类标准》执行。

十一、本指引中引用的相关制度或规则均按照相关文件的最新版本执行。由于制度、产品创新或法规变动引起统计指标计算产生冲突与歧义的，由中国证监会市场监管一司与相关报送单位商定临时解决方案。

十二、中国证监会市场监管一司、中证数据有限责任公司定期对本指引进行修订。

十三、本指引由中国证监会负责解释。

股票市场

SK-I：市场规模

SK-I-1：上市公司家数

一、基本定义

上市公司家数指统计期末其发行的股票在境内证券交易所上市的股份有限公司的数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股（含CDR，下同）、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.境内证券交易所；
- 6.监管辖区，行政区划；
- 7.是否发行优先股（是、否）；
- 8.是否红筹企业（是、否）；
- 9.是否特殊股权结构企业（是、否）。

三、指标种类

根据上市公司股票上市交易的状态，上市公司家数分为：

（一）上市公司家数

上市公司家数指统计期末其发行的股票在境内证券交易所上市的股份有限公司数量。

（二）退市公司家数

退市公司家数指统计期内其发行的股票终止在境内证券交易所上市的股份有限公司数量。

四、指标说明

（一）上市公司家数以股票上市日作为指标的统计日。

（二）退市公司家数以股票终止上市日作为指标的统计日。

（三）同时发行 A、B 股的上市公司，统计时按 1 家计算。

（四）是否发行优先股的上市公司家数以优先股上市日进行统计。

（五）红筹企业指按《关于开展创新企业境内发行股票或存托凭证试点若干意见》，注册地在境外、主要经营活动在境内的企业。

（六）特殊股权结构企业指按照《上海证券交易所科创板股票上市规则》等规定，拥有特别表决权股份的企业。

（七）如无特殊说明，统计时 CDR 参照 A 股处理，下同。

SK-I-2：上市公司股本

一、基本定义

上市公司股本指统计期末上市公司发行的全部股份数量合计。

本指引中的上市公司股本通常指上市公司境内总股本，包括 A 股、B 股。

A 股股本指上市公司发行的人民币普通股票数量。

B 股股本指上市公司发行的人民币特种股票（人民币标示面值，以外币购买和交易的股票）数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：股

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
4. 是否红筹企业（是、否）；
5. 是否特别表决权股（是、否）。

三、指标种类

按上市公司股票的不同交易限制条件，上市公司股本分为：

（一）限售股本

限售股本指统计期末未解禁的限售股份数量合计，包括 A 股限售股本、未股改公司的非流通股本以及纯 B 股公司的非流通股本。

（二）非限售股本

非限售股本通常也称为流通股本。计算公式为：

非限售股本=上市公司股本－限售股本

（三）A 股流通股本

A 股流通股本即 A 股非限售股本，指上市公司非限售股本中 A 股数量的合计。计算公式为：

$$\text{A 股流通股本} = \text{A 股股本} - \text{A 股限售股本}$$

（四）自由流通股本

自由流通股本指可供投资者在境内证券交易所自由买卖的 A 股股票数量。计算公式为：

$$\text{自由流通股本} = \text{A 股股本} - \text{A 股限售股本} - \text{减持受控非限售股本} - \text{合计持有 5\% 以上的大股东持有的其他非限售股本}$$

合计持有 5% 以上指（按一码通账户计）股东及一致行动人持有的限售股份与非限售股份，合计占上市公司总股本（含 H 股等境外股本）的比例在 5% 以上。

四、指标说明

（一）上市公司股本以股票上市日作为指标的统计日。

（二）上市公司库存股纳入上市公司股本统计。

（三）如上市公司股本含境外股份，应在使用时具体说明。

五、相关制度规则

《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 5 号——公司股份变动报告的内容与格式》（证监会公告〔2022〕8 号）。

SK-I-3：股票融资公司家数

一、基本定义

股票融资公司家数指统计期内上市公司在境内证券交易所通过发行普通股、优先股和存托凭证募集资金的上市公司数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.境内证券交易所；
- 6.监管辖区，行政区划；
- 7.是否红筹企业（是、否）；
- 8.是否特殊股权结构企业（是、否）。

三、指标种类

按照上市公司是否为首次发行融资，分为首发融资公司家数和再融资公司家数。其中，再融资公司家数可分为增发公司家数、配股公司家数、行权融资公司家数（含可转债转股公司家数）、发行优先股公司家数等。

（一）首发融资公司家数

首发融资公司家数指统计期内首次公开发行普通股（IPO）进行融资的公司数量。

以吸收合并、分拆等方式上市且未公开发行新股融资的公司，转板上市、重新上市等不涉及募集资金的公司均不计入首发融资公司家数。

（二）再融资公司家数

再融资公司家数指统计期内通过增发（公开增发和定向增发）、配股、行权融资、发行优先股等方式进行融资的上市公司数量。

1.增发公司家数

增发公司家数指统计期内通过增发普通股进行融资的上市公司数量。根据增发对象不同，增发公司家数可分为公开增发公司家数和定向增发公司家数两个指标。股权激励（详见 SK-III-13 小节）和发行 GDR 融资纳入定向增发统计。

2.配股公司家数

配股公司家数指统计期内通过向原股东配售普通股进行融资的上市公司数量。

3.行权融资公司家数

行权融资公司家数指统计期内权证（期权）行权融资上市公司数量。其中，可转债转股公司家数指统计期内通过可转债转新增股份的上市公司数量。

4.发行优先股公司家数

发行优先股公司家数指统计期内发行优先股进行融资的上市公司数量。

四、指标说明

（一）以股份上市日作为指标的统计日。

（二）统计期内多次融资的上市公司统计时按 1 家计算。

（三）在境外上市的红筹企业通过沪伦通等业务发行存托凭证不纳入统计。

（四）统计期内，在北交所向不特定合格投资者公开发行股票并上市按照首发融资公司统计。

五、相关制度规则

（一）《首次公开发行股票注册管理办法》（证监会令第 205 号）；

（二）《上市公司证券发行注册管理办法》（证监会令第 206 号）；

（三）《优先股试点管理办法》（证监会令第 209 号）；

（四）《北京证券交易所向不特定合格投资者公开发行股票注册管理办法》（证监会令第 210 号）；

（五）《北京证券交易所上市公司证券发行注册管理办法》（证监会令第 211 号）；

（六）《关于在上海证券交易所设立科创板并试点注册制的实施意见》（证监会公告〔2019〕2 号）。

SK-I-4：股票融资金额

一、基本定义

股票融资金额指统计期内上市公司在境内证券交易所通过发行

普通股、优先股和存托凭证募集的资金总额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.境内证券交易所；
- 6.监管辖区，行政区划。

三、指标种类

按照是否为首次公开发行融资，股票融资金额分为首发融资金额和再融资金额。其中，再融资金额可分为增发融资金额、配股融资金额、行权融资金额（含可转债转股融资金额）、发行优先股融资金额等指标。

（一）首发融资金额

首发融资金额指统计期内IPO筹集的资金总额。

首发融资金额=Σ（每股发行价格×发行股份数）。

其中，对于发行股份吸收合并已上市公司的融资金额，计算公式为：

首发融资金额（吸收合并）=Σ〔每股发行价格×（发行股份数

- 换股股份数)]

对于存在超额配售权的 IPO，根据超额配售权的实际行使情况（时间、规模），按完成超额配售后的股份上市日进行统计。

（二）再融资金额

再融资金额指统计期内上市公司通过增发（公开增发和定向增发）、配股、行权、发行优先股等方式筹集的资金总额。股权激励（详见 SK-III-13 小节）和发行 GDR 融资纳入定向增发统计。

1. 增发融资金额

增发融资金额指统计期内上市公司增发普通股筹集的资金总额。

增发融资金额 = $\sum$ （增发每股价格 × 发行股份数）。

根据股份认购对象的不同，增发融资金额可分为公开增发融资金额和定向增发融资金额。

根据增发时是否以现金认购，增发融资金额可分为增发融资金额（现金认购）和增发融资金额（非现金资产认购）。

2. 配股融资金额

配股融资金额指统计期内上市公司通过向原股东配售普通股筹集的资金总额。

配股融资金额 = $\sum$ （配股价格 × 配售股份数） = $\sum$ （配股价格 × 股份数量 × 配售比例）。

3. 行权融资金额

行权融资金额指统计期内权证（期权）行权筹集的资金总额。

行权融资金额= $\sum$ （行权价格×行权认购股份数）。

其中，可转债转股融资金额指统计期内上市公司通过可转债转新增股份（不含来源于回购的转股股份）的转股金额合计。

可转债转股融资金额= $\sum$ （可转债转新增股份数×转股价格）。

4.发行优先股融资金额

发行优先股融资金额指统计期内上市公司发行优先股筹集的资金总额。

四、指标说明

（一）以股份上市日作为指标的统计日。

（二）已在境外上市的红筹企业通过沪伦通等业务发行存托凭证不纳入股票融资金额统计。

（三）在北交所向不特定合格投资者公开发行股票并上市按照首次公开发行普通股（IPO）融资金额统计。

五、相关制度规则

（一）《科创板首次公开发行股票注册管理办法（试行）》（证监会令第153号）；

（二）《首次公开发行股票注册管理办法》（证监会令第205号）；

（三）《上市公司证券发行注册管理办法》（证监会令第206号）；

（四）《优先股试点管理办法》（证监会令第209号）；

（五）《北京证券交易所向不特定合格投资者公开发行股票注

册管理办法》（证监会令第210号）；

（六）《北京证券交易所上市公司证券发行注册管理办法》（证监会令第211号）；

（七）《关于在上海证券交易所设立科创板并试点注册制的实施意见》（证监会公告〔2019〕2号）。

SK-I-5：非金融企业直接融资规模

一、基本定义

非金融企业直接融资规模指非金融企业通过境内金融市场发行股票、债券等直接融资工具筹集的资金总额，包括现金和等价物。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 行业分类；
2. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
3. 监管辖区，行政区划。

三、指标说明

（一）基于当前数据可得性以及统计实践，非金融企业直接融资规模具体包括非金融企业在境内证券交易所和全国股转系统的股票融资，在境内证券交易所、全国股转系统和银行间市场的债券净融资，区域性股权市场融资金额，私募基金及持牌机构私募资产管理

理产品投向境内未上市未挂牌非金融企业股权的资金总额。

（二）非金融企业直接融资可分增量和存量两个口径进行统计。其中，非金融企业直接融资增量指统计期内非金融企业通过直接融资工具筹集的资金总额，非金融企业直接融资存量指从某一时点（一般采用 1990 年）以来至统计期末非金融企业直接融资累计增量。

（三）根据统计需要也可将非金融企业拓展至所有企业。

SK-I-6：股票市值

一、基本定义

股票市值指统计期末上市公司发行的某类股份按对应价格计算的股权价值合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 股票指数成份股；
5. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
6. 境内证券交易所；
7. 监管辖区，行政区划。

三、指标种类

（一）A 股市值

A 股市值指根据 A 股股票价格与股本计算的股权价值合计。

（二）A 股流通市值

A 股流通市值指根据 A 股股票价格与其流通股本计算的股权价值合计。

（三）B 股流通市值

B 股流通市值指根据 B 股股票价格与其流通股本计算的股权价值合计。其中，B 股股票价格一般应换算成人民币价格。

（四）自由流通市值

自由流通市值指根据 A 股股票价格与其自由流通股本计算出的股权价值合计。

四、指标说明

（一）如当日无交易价格，采用最后交易日的收盘价。

（二）未股改公司的非流通股以流通 A 股价格计算市值。

（三）仅发行 B 股的上市公司的非流通股不纳入该指标统计。

（四）对当日除权股票进行市值计算时需要包含在途股份（已登记未上市的股份）的市值。

SK-I-7：上市公司市值

一、基本定义

上市公司市值指统计期末上市公司发行的股份数量 and 对应股票

价格计算的股权价值合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.股票指数成份股；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 6.境内证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划；
- 8.是否红筹企业（是、否）；
- 9.是否特殊股权结构企业（是、否）。

三、指标种类

（一）上市公司市值

与上市公司股本一致，本指引中的上市公司市值通常指上市公司境内总市值，即上市公司A股市值和B股市值合计，计算公式为：

$$CAP = CAP_a + CAP_b = P_a \times SHR_a + P_b \times SHR_b \times R$$

其中：

P_a 、 P_b 分别表示A股价格、B股价格；

SHR_a 、 SHR_b 分别表示A股股本、B股股本；

R 表示人民币兑美元或人民币兑港币的汇率。

（二）上市公司流通市值

上市公司流通市值指上市公司 A 股流通市值和 B 股流通市值合计。

四、指标说明

（一）仅发行 B 股的上市公司的非流通股不纳入该指标统计。

（二）如需统计含境外股份的上市公司市值，则应注明境外股份市值的具体计算方法。

SK-I-8：证券化率

一、基本定义

证券化率指统计期末上市公司市值合计与年度国内生产总值的比率。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

三、指标说明

国内生产总值一般采用国家统计局公布的最近一个年度的国内生产总值进行计算。

SK-I-9：股票账户数

一、基本定义

股票账户数指统计期末在中国证券登记结算公司开立的股票账户数量合计，包括 A 股账户和 B 股账户，不包含已注销账户。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：户

（三）常用维度：

1.账户类型（A 股、B 股）；

2.投资者类型（详见股票投资者分类标准）；

3.投资者开户地区；

4.交易权限（创业板权限、科创板权限、北交所权限、港股通权限）。

三、指标种类

（一）新开账户数

新开账户数指统计期内新开立的股票账户数量。

（二）新销账户数

新销账户数指统计期内销户的股票账户数量。

（三）休眠账户数

休眠账户数指统计期末“证券账户余额为零、关联的资金账户余额不超过 100 元且最近连续 3 年无交易”的股票账户数量。

（四）有效账户数

有效账户数指统计期末股票账户数减去休眠账户数之后的股票账户数量。

（五）参与交易股票账户数

参与交易股票账户数指统计期内参与境内证券交易所股票交易并完成至少 1 次买或卖行为的有效账户数量。

（六）参与交易股票账户数占比

参与交易股票账户数占比指统计期内参与交易股票账户数占期末股票有效账户数的比例。

（七）持股账户数

持股账户数指统计期末持有股票数量不为零的股票账户数。

四、指标说明

（一）港股通包含沪港通下的港股通和深港通下的港股通。

（二）应在有效账户中统计开通某类权限的账户，即开通某类权限的账户是有效账户的子集。

五、相关制度规则

（一）《境内外证券交易所互联互通存托凭证业务监管规定》（证监会公告〔2023〕50 号）；

（二）《内地与香港股票市场交易互联互通机制登记、存管、结算业务实施细则》；

（三）《中国证券登记结算有限责任公司境内外证券交易所互联互通存托凭证登记结算业务实施细则》；

（四）《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》；

（五）《中国证券登记结算有限责任公司北京分公司北京证券交易所股票登记结算业务指南》；

（六）《北京证券交易所投资者适当性管理业务指南》。

SK-I-10：股票投资者数

一、基本定义

股票投资者数指统计期末持有未注销、未休眠的 A 股、B 股的一码通账户数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：个

（三）常用维度：

- 1.账户类型（A 股、B 股）；
- 2.投资者类型；
- 3.投资者开户地区；
- 4.交易权限（创业板权限、科创板权限、北交所权限、港股通权限）。

三、指标种类

（一）新开户股票投资者数

新开户股票投资者数指统计期内新开立一码通账户的股票投资者数量。

（二）新增股票投资者数

新增股票投资者数指统计期末股票投资者数量和上期末股票投资者数量的差值。

四、相关制度规则

《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》。

SK-I-11：资金账户数

一、基本定义

资金账户数指证券市场交易结算资金监控系统获取的统计期末在证券公司开立的所有未销户的资金账户数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）常用计量单位：户

（三）常用维度：

1. 资金账户类别（一般资金账户、信用资金账户、衍生品资金账户）；
2. 投资者类型；
3. 证券公司。

三、指标种类

（一）新开资金账户数

新开资金账户数指统计期内新开立的资金账户数量。

（二）新销资金账户数

新销资金账户数指统计期内新注销的资金账户数量。

（三）发生股票交易的资金账户数

发生股票交易的资金账户数指统计期内存在股票交易的资金账

户数量。

（四）发生转账的资金账户数

发生转账的资金账户数指统计期内存在银证转账的资金账户数量。

四、相关制度规则

《客户交易结算资金管理办法》（证监会令第184号）。

SK-II：股票交易

SK-II-1：涨跌幅

一、基本定义

涨跌幅指统计期内股票期末价格相对期初价格的变化幅度。计算公式为：

$$R = \left(\frac{P_t}{P_0} - 1 \right) \times 100\%$$

其中：

R—涨跌幅

P_t —期末收盘价

P_0 —期初前收盘价

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A 股、B 股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

三、指标说明

（一）指数涨跌幅参照股票涨跌幅计算。

（二）如统计区间内存在分红、送股、配股等事件，需对股票价格进行复权处理，复权价格的计算公式为：

复权价格=当前价格×（1+送股比例+配股比例）+每股红利-配股价格×配股比例

若统计期内存在多次分红、送股、配股事件，复权价格可采用递归方式进行计算，也可采用区间分段涨跌幅连乘或复权因子连乘进行速算。

（三）若统计区间包含上市首日，通常采用期末价格和首发价格计算涨跌幅。如有需要，也可按期末价格和上市首日开盘价或上市首日收盘价进行计算，但应注明具体计算方法。

（四）计算一段时期内 IPO 股票上市首日平均涨跌幅时，通常使用统计期内所有 IPO 股票上市首日涨跌幅的算术平均值。

（五）涨停个股数量按个股价格达到涨停价进行统计，跌停个股数量按个股价格达到跌停价进行统计，无涨跌停价格的个股不纳入涨停个股、跌停个股统计。

SK-II-2：振幅

一、基本定义

振幅指股票价格统计期内的波动程度，采用统计区间内最高价和最低价之差与基准价格的比例进行计算。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

三、指标种类

（一）振幅（最低价）

振幅（最低价）指统计区间内股票价格最大差价与最低价的比例。计算公式为：

$$A = \frac{(P_h - P_l)}{P_l} \times 100\%$$

其中：

A—振幅（最低价）

P_h —区间复权最高价

P_l —区间复权最低价

(二) 振幅 (前收盘价)

振幅 (前收盘价) 指统计区间内股票价格最大差价与期初前收盘价的比。计算公式为:

$$A = \frac{(P_h - P_l)}{P_{\text{preclose}}} \times 100\%$$

其中:

A —振幅 (前收盘价)

P_h —区间复权最高价

P_l —区间复权最低价

P_{preclose} —期初前收盘价

四、指标说明

(一) 指数振幅参照股票振幅计算。

(二) 如期初日为股票上市首日则前收盘价可采用首发价。

五、相关制度规则

(一) 《上海证券交易所交易规则》;

(二) 《深圳证券交易所交易规则》;

(三) 《北京证券交易所交易规则 (试行)》。

SK-II-3: 成交量

一、基本定义

成交量指统计期内境内证券交易所全部股票成交数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：股

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 6.境内证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

成交量统计范围包含竞价交易、大宗交易和盘后固定价格交易。

SK-II-4：成交金额

一、基本定义

成交金额指统计期内境内证券交易所全部股票成交金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 6.境内证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

成交金额统计范围包含竞价交易、大宗交易和盘后固定价格交易。

SK-II-5：换手率

一、基本定义

换手率指股票成交量（或成交金额）与相应股票数量（或股票市值）的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

- 4.股票指数成份股;
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）;
- 6.境内证券交易所;
- 7.监管辖区，行政区划。

三、指标种类

（一）股本换手率

股本换手率指当日股票成交量与其流通股本的比例。计算公式为：

$$TR_{d1} = \frac{TV_{od}}{TS_d} \times 100\%$$

其中：

TR_{d1}—股本换手率

TV_{od}—当日成交量

TS_d—流通股本

（二）市值换手率

市值换手率指当日股票成交金额与其流通市值的比例。计算公式为：

$$TR_{d2} = \frac{TV_{ad}}{CAP_d} \times 100\%$$

其中：

TR_{d2}—市值换手率

TV_{ad}—当日成交金额

CAP_d—流通市值

四、指标说明

（一）通常对单只股票采用股本换手率，对一组股票采用市值换手率。

（二）上市首日平均换手率指统计期内所有 IPO 股票上市首日换手率的算术平均值。

（三）区间换手率通常为统计期内各交易日换手率加总，区间日均换手率为区间换手率除以区间交易日数量。

（四）如有需要，也可采用当日股票成交量（成交金额）与其自由流通股本（自由流通市值）的比例来计算股本换手率（市值换手率），但应注明统计口径。

SK-II-6：市盈率

一、基本定义

市盈率指上市公司每股股价与其每股收益的比率。通常用上市公司股票市值与其对应的归属母公司股东净利润的比率进行计算。计算公式为：

$$PE = \frac{P}{EPS} = \frac{CAP}{NP}$$

其中：

PE—市盈率

P—每股股价

EPS—每股收益

CAP—股票市值

NP—该股份对应的归属母公司股东净利润

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：倍

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A 股、B 股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 6.境内证券交易所；
- 7.是否含净利润为负的上市公司股票（是、否）。

三、指标种类

按照对股票每股收益选取的不同，市盈率主要有以下三种指标：

（一）静态市盈率

静态市盈率指统计期末上市公司每股股价与最新年度财务报告中披露的每股收益的比率。

（二）滚动市盈率

滚动市盈率指统计期末上市公司每股股价与最近连续 4 个季度每股收益合计的比率。

（三）预测市盈率

预测市盈率指统计期末上市公司每股股价与预测每股收益的比

率。其中，预测每股收益采用以下方法计算：

预测每股收益=一季度财务报告中实现的每股收益×4；

预测每股收益=半年财务报告中实现的每股收益×2；

预测每股收益=三季度财务报告中实现的每股收益×4/3。

根据时间最近原则选取财务报告。

四、指标说明

（一）统计时应注明使用的市盈率口径，对一组股票计算市盈率时还应注明是否剔除了净利润为负的上市公司股票。

（二）每股收益和净利润可在财务报告公告截止日的次日集中更新，也可公告一家更新一家，在具体使用时注明即可。

（三）对单只股票计算市盈率时仅考虑每股收益为正的股票。

（四）对一组股票计算市盈率时通常采用上市公司股票市值合计与其对应的归属母公司股东的净利润合计的比率进行计算。计算公式为：

$$PE = \frac{\sum_{i=1}^n CAP_i}{\sum_{i=1}^n NP_i}$$

其中：

PE—市盈率

n—股票数

CAP_i—第 i 只上市公司股票市值

NP_i—第 i 只上市公司股票对应的归属母公司股东的净利润

（五）对于发行多种类型股份的公司，根据各类型股份数量按

比例分配该公司归属母公司股东的净利润。

（六）上市公司首发市盈率指上市公司股票发行价格与每股收益的比例。其中，每股收益通常按照摊薄法计算，即最新年度财务报告中对应的归属母公司股东的净利润除以发行后总股本；也可按照发行前的总股本和新发股本的权重进行计算，即每股收益=最新年度财务报告中对应的归属母公司股东的净利润÷[发行前总股本+本次公开发行股本×（1-发行月份÷12）]。

SK-II-7：市净率

一、基本定义

市净率指上市公司每股股价与每股净资产的比率。通常用股票市值与对应的归属母公司股东权益的比率进行计算。计算公式为：

$$PB = \frac{P}{BPS} = \frac{CAP}{NA}$$

其中：

PB—市净率

P—每股股价

BPS—每股净资产

CAP—股票市值

NA—对应的归属母公司股东权益

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：倍

(三) 常用维度:

1. 股份类型 (A 股、B 股);
2. 行业分类;
3. 公司控股情况分类 (国有、民营、外资等);
4. 股票指数成份股;
5. 上市板块 (主板、创业板、科创板、北交所);
6. 境内证券交易所。

三、指标说明

(一) 市净率计算通常采用最新财务报告中的每股净资产数据。

(二) 对单只股票计算市净率时仅考虑每股净资产为正的股票。

(三) 对一组股票计算平均市净率时通常采用上市公司股票市值合计与其对应的归属母公司股东权益合计的比率进行计算, 一般情况下应包含归属母公司股东权益为负的上市公司股票。计算公式为:

$$PB = \frac{\sum_{i=1}^n CAP_i}{\sum_{i=1}^n NA_i}$$

其中:

PB—市净率

n—股票只数

CAP_i—第 i 只上市公司股票市值

NA_i—第 i 只上市公司股票对应的归属母公司股东的权益

(四) 对于发行多种类型股份的公司, 根据各类型股份数量按

比例分配该公司归属母公司股东的权益。

SK-II-8：账户持股市值

一、基本定义

账户持股市值指统计期末某个或一组股票账户所持股票市值的合计。计算公式为：

$$TCAP = \sum_{i=1}^n P_i \times SHR_i$$

其中：

TCAP—账户持股市值

n—持有股票只数

P_i—持有第 i 只股票的价格

SHR_i—持有第 i 只股票的数量

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资者类型；
- 2.投资者开户地区；
- 3.股份类型（A 股、B 股）；
- 4.境内证券交易所。

三、指标说明

在除权除息日统计账户持股市值时，股票价格应采用除权除息

后的价格，持有股票数量应包含在途股份（已登记未上市的股份）。

SK-II-9：股票账户买卖净额

一、基本定义

股票账户买卖净额指统计期内某个或一组股票账户在境内证券交易所买入和卖出股票的金额轧差之后的净额。计算公式为：

股票账户买卖净额=买入金额合计－卖出金额合计

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.投资者类型；

2.投资者开户地区。

SK-II-10：破净股票比例

一、基本定义

破净股票比例指统计期末每股价格跌破每股净资产的股票数量占境内证券交易所上市股票数量的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

SK-II-11：破净率

一、基本定义

破净率指对于股价跌破每股净资产的股票，其股价与每股净资产的偏离比率，也可按股票市值与归属母公司股东权益的偏离比率进行计算。计算公式为：

$$\text{BNAR} = \left(\frac{P}{\text{BPS}} - 1 \right) \times 100\% = \left(\frac{\text{CAP}}{\text{NA}} - 1 \right) \times 100\%$$

其中：

BNAR—破净率

P—每股股价

BPS—每股净资产

CAP—股票市值

NA—对应的归属母公司股东权益

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

(三) 常用维度:

1. 股份类型 (A 股、B 股);
2. 行业分类;
3. 公司控股情况分类 (国有、民营、外资等);
4. 股票指数成份股;
5. 上市板块 (主板、创业板、科创板、北交所)。

三、指标说明

(一) 破净率计算通常采用最新财务报告中的每股净资产数据。

(二) 对一组破净股票计算破净率时通常采用上市公司股票市值合计与其对应的归属母公司股东的权益合计的偏离比率进行计算。计算公式为:

$$\text{BNAR} = \left(\frac{\sum_{i=1}^n \text{CAP}_i}{\sum_{i=1}^n \text{NA}_i} - 1 \right) \times 100\%$$

其中:

BNAR—破净率

n—破净股票只数

CAP_i—第 i 只破净股票市值

NA_i—第 i 只破净股票对应的归属母公司股东权益

SK-II-12: 平均股价

一、基本定义

平均股价指统计期末一组股票的平均价格, 包括加权平均股价

和算术平均股价。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

三、指标种类

（一）加权平均股价

加权平均股价指统计期末一组股票的总市值与总股本的比率。

计算公式为：

$$P = \frac{\sum_{i=1}^n CAP_i}{\sum_{i=1}^n SHR_i}$$

其中：

P—平均股价

n—股票只数

CAP_i—第 i 只股票市值

SHR_i—第 i 只股票的数量

（二）算术平均股价

算术平均股价指统计期末一组股票的价格之和除以股票只数。

四、指标说明

平均股价一般指加权平均股价。

SK-II-13：股票交易费用

一、基本定义

股票交易费用指统计期内投资者在买卖股票时支付的各种税收和费用合计，包括证券交易佣金、交易经手费、过户费、证券交易监管费、印花税等。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股票类型（A股、B股）；
- 2.投资者类型；
- 3.境内证券交易所；
- 4.监管辖区，行政区划。

三、相关制度规则

（一）《上海证券交易所收费管理规则适用指引第1号——收费项目及标准》；

（二）《深圳证券交易所业务收费管理办法》；

（三）《北京证券交易所业务收费管理办法》。

SK-III：上市公司财务

SK-III-1：上市公司上缴税费总额

一、基本定义

上市公司上缴税费总额指上市公司统计期内上缴的各种税费合计。

二、统计属性

（一）基本频度：年

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
2. 行业分类；
3. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
4. 监管辖区，行政区划。

三、相关制度规则

《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 5 号——公司股份变动报告的内容与格式》（证监会公告〔2022〕8 号）。

SK-III-2：上市公司净利润总额

一、基本定义

上市公司净利润总额指统计期内上市公司净利润的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：季

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.股票指数成份股；
- 6.境内证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

在对一组上市公司净利润总额进行同比和环比分析时应保持样本的一致性。

SK-III-3：上市公司平均净资产收益率

一、基本定义

上市公司平均净资产收益率指上市公司净利润总额与上市公司净资产总额的比率。计算公式为：

$$ROE = \frac{\sum_{i=1}^n NP_i}{\sum_{i=1}^n NA_i} \times 100\%$$

其中：

ROE—净资产收益率

n—上市公司家数

NP_i—第 i 个上市公司净利润

NA_i—第 i 个上市公司净资产

二、统计属性

（一）基本频度：年

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 股票指数成份股；
6. 监管辖区，行政区划。

三、指标说明

（一）计算净资产收益率应使用归属于母公司股东净利润。

（二）净资产取期初和期末归属母公司股东权益的平均值。

（三）在对一组上市公司平均净资产收益率进行同比和环比分析时应保持样本的一致性。

四、相关制度规则

《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 9 号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》（证监会公告〔2010〕2 号）。

SK-III-4：上市公司现金分红总额

一、基本定义

上市公司现金分红总额指统计期内上市公司现金分红金额合计，包括股息和红利。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 2.股份类型（A股、B股）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.境内证券交易所；
- 6.监管辖区、行政区划；
- 7.统计时点（除息日、预案公告日、股东会公告日、实施公告日）。

三、指标种类

按照会计年度或自然年度、预案或实施、是否归属境内股份等不同维度，实际使用中存在以下多种统计口径：

（一）实际现金分红总额

实际现金分红总额指上市公司统计区间内（通常用最近12个月

内)的现金分红金额合计,一般按除息日统计。

(二) 实际境内现金分红总额

实际境内现金分红总额指上市公司统计区间内(通常用最近12个月内)向持有境内股份投资者实施的现金分红金额合计,一般按除息日统计。

(三) 预案现金分红总额

预案现金分红总额指会计年度内根据每期财务报告(含一季报、半年报、三季报、年报)的分红预案计算的拟现金分红金额合计,一般按预案公告日统计。

(四) 预案境内现金分红总额

预案境内现金分红总额指会计年度内根据每期财务报告(含一季报、半年报、三季报、年报)的分红预案计算的拟向持有境内股份投资者现金分红金额合计,一般按预案公告日统计。

(五) 年报预案现金分红总额

年报预案现金分红总额指年度财务报告的分红预案中拟现金分红金额合计,一般按预案公告日统计。

(六) 年报预案境内现金分红总额

年报预案境内现金分红总额指年度财务报告的分红预案中拟向持有境内股份投资者现金分红金额合计,一般按预案公告日统计。

(七) 中期分红预案现金分红总额

中期分红预案现金分红总额指会计年度内根据短于一个会计周期的财务报告(含一季报、半年报、三季报)的分红预案计算的拟

现金分红金额合计，一般按预案公告日统计。

（八）中期分红预案境内现金分红总额

中期分红预案境内现金分红总额指会计年度内根据短于一个会计周期的财务报告（含一季报、半年报、三季报）的分红预案计算的拟向持有境内股份投资者现金分红金额合计，一般按预案公告日统计。

（九）预案实施现金分红总额

预案实施现金分红总额指会计年度内每期财务报告（含一季报、半年报、三季报、年报）的现金分红预案中已实现的现金分红金额合计，一般按除息日统计。

（十）预案实施境内现金分红总额

预案实施境内现金分红总额指会计年度内每期财务报告（含一季报、半年报、三季报、年报）的现金分红预案中已实现的向持有境内股份投资者现金分红金额合计，一般按除息日统计。

四、指标说明

（一）现金分红总额为含税数据，实际现金分红也可按实施公告日统计，预案现金分红也可按股东会公告日统计。

（二）预案现金分红金额不含未在财务报告中披露的特别分红数据。若特别分红的公司公告未明确分红所属报告期，则归属至最近一个已披露定期报告的报告期。

（三）上市公司现金分红金额采用人民币计价。

（四）“最近 12 个月”根据以下原则处理：统计期末为当月最

后一个自然日，统计期含当月，否则不含当月。

（五）除特别注明外，现金分红一般不包括回购金额。

五、相关制度规则

（一）《上市公司监管指引第3号——上市公司现金分红》（证监会公告〔2023〕61号）；

（二）《关于修改〈上市公司章程指引〉的决定》（证监会公告〔2023〕62号）；

（三）《上海证券交易所股票上市规则》；

（四）《上海证券交易所科创板股票上市规则》；

（五）《深圳证券交易所股票上市规则》；

（六）《北京证券交易所股票上市规则》。

SK-III-5：股息率

一、基本定义

股息率指每股现金分红与股票价格之间的比率。为了消除股本变动带来的影响，通常用对应的现金分红总额与股票市值的比率来计算股息率。计算公式为：

$$DP = \frac{DY}{CAP} \times 100\%$$

其中：

DP—股息率

DY—统计期内现金分红金额合计

CAP—样本股票市值

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成份股；
- 5.境内证券交易所。

三、指标种类

（一）实际现金分红股息率

实际现金分红股息率指实际境内现金分红总额（按除息日统计）与统计期末对应境内股票市值的比率。股息率默认按此口径统计。

（二）预案现金分红股息率

预案现金分红股息率指预案境内现金分红总额（按预案公告日统计）与统计期末对应境内股票市值的比率。

（三）历史年度现金分红股息率

历史年度现金分红股息率指境内上市公司在某一特定自然年度内向持有境内股份投资者实施的现金分红金额（按除息日统计）合计与当年度股票日均市值的比率。

四、指标说明

对一组股票的平均股息率通常用总体法计算。计算公式为：

$$DP_{(avg)} = \frac{\sum_{i=1}^n DY_i}{\sum_{i=1}^n CAP_i} \times 100\%$$

其中：

$DP_{(avg)}$ ——平均股息率

n ——股票只数

DY_i ——第 i 只股票现金分红金额

CAP_i ——第 i 只股票的期末市值

SK-III-6：现金股利支付率

一、基本定义

现金股利支付率指统计期内预案实施现金分红总额与年度上市公司净利润总额的比率。

二、统计属性

（一）基本频度：年

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

- 5.股票指数成份股;
- 6.境内证券交易所;
- 7.监管辖区,行政区划。

三、指标说明

根据统计需要,在计算一组上市公司的现金股利支付率时,可剔除净利润为负的公司,也可剔除未实施现金分红的公司,具体使用时注明统计口径即可。

SK-III-7: 上市公司平均资产负债率

一、基本定义

上市公司平均资产负债率指统计期末一组上市公司的总负债与总资产的比率。计算公式为:

$$ALR = \frac{\sum_{i=1}^n TL_i}{\sum_{i=1}^n TA_i} \times 100\%$$

其中:

ALR—资产负债率

n—上市公司家数

TL_i—第 i 个上市公司统计期末总负债

TA_i—第 i 个上市公司统计期末总资产

二、统计属性

(一) 基本频度: 季

(二) 基本计量单位: %

（三）常用维度：

1. 是否含上市金融企业、是否含上市银行（是、否）；
2. 股份类型（A 股、B 股）；
3. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
4. 行业分类；
5. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
6. 股票指数成份股；
7. 境内证券交易所；
8. 监管辖区，行政区划。

SK-III-8：上市公司平均总资产收益率

一、基本定义

上市公司平均总资产收益率指上市公司净利润总额与上市公司资产总额的比率。计算公式为：

$$ROA = \frac{\sum_{i=1}^n NP_i}{\sum_{i=1}^n TA_i} \times 100\%$$

其中：

ROA—总资产收益率

n—上市公司家数

NP_i—第 i 个上市公司净利润

TA_i—第 i 个上市公司总资产

二、统计属性

（一）基本频度：季

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.是否含上市金融企业、是否含上市银行（是、否）；
- 2.股份类型（A股、B股）；
- 3.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 4.行业分类；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 6.股票指数成份股；
- 7.境内证券交易所；
- 8.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

（一）上市公司总资产采用期初和期末总资产的平均值。

（二）在对一组上市公司平均总资产收益率进行同比和环比分析时应保持样本的一致性。

SK-III-9：上市公司营业总收入

一、基本定义

上市公司营业总收入指统计期内上市公司营业总收入的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：季

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股等）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 股票指数成份股；
6. 境内证券交易所；
7. 监管辖区，行政区划。

三、指标说明

在对一组上市公司营业总收入进行同比和环比分析时应保持样本的一致性。

SK-III-10：上市公司研发投入总额

一、基本定义

上市公司研发投入总额指统计期内上市公司研发投入金额的合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：季

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1. 行业分类；

- 2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 3.是否红筹企业（是、否）；
- 4.是否特殊股权结构企业（是、否）；
- 5.是否盈利（是、否）；
- 6.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

SK-III-11：上市公司研发投入占比

一、基本定义

上市公司研发投入占比指统计期内上市公司研发投入总额与营业收入总额的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：季

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 3.是否红筹企业（是、否）；
- 4.是否特殊股权结构企业（是、否）；
- 5.是否盈利（是、否）；
- 6.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

SK-III-12：上市公司研发员工占比

一、基本定义

上市公司研发员工占比指统计期末上市公司从事研发工作的人员数量与公司员工数量的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：年

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 3.是否红筹企业（是、否）；
- 4.是否特殊股权结构企业（是、否）；
- 5.是否盈利（是、否）；
- 6.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）。

SK-III-13：股权激励家数

一、基本定义

股权激励家数指统计期内股权激励方案获得股东会通过或实施的上市公司家数。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
2. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
3. 激励方案（股票期权、限制性股票授予等）；
4. 境内证券交易所；
5. 监管辖区，行政区划。

三、指标种类

（一）股权激励公司家数（股东会通过）

股权激励公司家数（股东会通过）指统计期内在股东会上通过股权激励方案的上市公司家数，按股东会通过日统计。

（二）股权激励公司家数（方案实施）

股权激励公司家数（方案实施）指统计期内实施股权激励方案的上市公司家数，按方案实施日统计。

四、相关制度规则

《上市公司股权激励管理办法》（证监会令第148号）。

SK-IV：信用交易

SK-IV-1：融资融券交易金额

一、基本定义

融资融券交易金额指统计期内融资买入金额和融券卖出金额的合计。

融资融券交易金额=融资买入金额+融券卖出金额

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.证券类别（股票、ETF 等）；

2.业务类型（融资、融券）；

3.境内证券交易所；

4.证券公司。

三、指标说明

融资买入金额见 SK-IV-4 小节，融券卖出金额见 SK-IV-5 小节。

四、相关制度规则

（一）《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会令第 117 号）；

（二）《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第 166 号）；

（三）《证券公司融资融券业务内部控制指引》（证监会公告〔2011〕32 号）；

（四）《上海证券交易所融资融券交易实施细则》；

（五）《深圳证券交易所融资融券交易实施细则》；

（六）《北京证券交易所融资融券交易细则》；

（七）《中国证券登记结算有限责任公司融资融券登记结算业务实施细则》。

SK-IV-2：融资融券余额

一、基本定义

融资融券余额指统计期末投资者未了结的融资交易和融券交易的金额。计算公式为：

$$\begin{aligned}\text{融资融券余额} &= \text{融资余额} + \text{融券余额} \\ &= \Sigma (\text{融资买入额} - \text{融资偿还额}) + \Sigma [(\text{融券卖出} \\ &\quad \text{量} - \text{融券偿还量}) \times \text{标的证券统计日收盘价格}]\end{aligned}$$

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 证券类别（股票、ETF 等）；
2. 业务类型（融资、融券）；
3. 境内证券交易所；
4. 证券公司。

三、指标说明

（一）融资偿还包括直接还款、卖券还款和融资强制平仓。

（二）融券偿还包括买券还券、直接还券、融券强制平仓、余券划转、融券正负权益调整和现金偿还。

（三）不计利息和费用。

四、相关制度规则

同 SK-IV-1 制度规则。

SK-IV-3：维持担保比例

一、基本定义

维持担保比例指统计期末客户担保物价值与融资融券债务之间的比例。计算公式为：

$$\begin{aligned}\text{维持担保比例} &= \frac{\text{担保物价值}}{\text{融资融券业务负债}} \times 100\% \\ &= \frac{\text{现金} + \sum \text{信用账户证券市值} + \text{其他担保物价值}}{\text{融资买入余额} + \text{融券卖出证券数量} \times \text{市价} + \text{利息及费用}} \times 100\%\end{aligned}$$

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.投资者类型；

2.证券公司。

三、指标说明

信用证券账户内的证券，由于调出可充抵范围、暂停交易、权益处理、实施风险警示等原因，其市值可根据约定的公允价格或其他方式计算。

四、相关制度规则

同 SK-IV-1 制度规则。

SK-IV-4：融资买入金额

一、基本定义

融资买入金额指统计期内投资者从证券公司借入资金买入标的证券的金额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 证券类别（股票、ETF 等）；
2. 投资者类型；
3. 境内证券交易所；
4. 证券公司。

三、指标说明

具体统计时，融资买入金额为通过投资者信用账户且交易申报指令为融资买入的金额。

四、相关制度规则

同 SK-IV-1 制度规则。

SK-IV-5：融券卖出金额

一、基本定义

融券卖出金额指统计期内投资者从证券公司借入证券并卖出的

金额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 证券类别（股票、ETF 等）；
2. 投资者类型；
3. 境内证券交易所；
4. 证券公司。

三、指标说明

具体统计时，融券卖出金额为通过投资者信用账户且交易申报指令为融券卖出的金额。

四、相关制度规则

同 SK-IV-1 制度规则。

SK-IV-6：信用证券账户数

一、基本定义

信用证券账户数指统计期末投资者为参与融资融券交易开立的信用证券账户数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：户

(三) 常用维度:

1. 投资者类型;
2. 境内证券交易所;
3. 证券公司。

三、相关制度规则

同 SK-IV-1 制度规则。

SK-IV-7: 信用交易客户数

一、基本定义

信用交易客户数指统计期末已开立信用账户的投资者数量。

二、统计属性

(一) 基本频度: 日

(二) 基本计量单位: 个

(三) 常用维度:

1. 投资者类型;
2. 境内证券交易所;
3. 证券公司。

三、相关制度规则

同 SK-IV-1 制度规则。

SK-IV-8: 客户担保物集中度

一、基本定义

客户担保物集中度指单一客户提交的担保物中单一担保物市值占该客户总担保物市值的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.证券类别（股票、存托凭证等）；

2.投资者类型。

三、相关制度规则

（一）《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会令第117号）；

（二）《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第166号）；

（三）《证券公司融资融券业务内部控制指引》（证监会公告〔2011〕32号）；

（四）《上海证券交易所融资融券交易实施细则》；

（五）《深圳证券交易所融资融券交易实施细则》；

（六）《北京证券交易所融资融券交易细则》；

（七）《中国证券登记结算有限责任公司融资融券登记结算业务实施细则》；

（八）《上海证券交易所融资融券交易业务指引第1号——担保物集中度管理》；

（九）《深圳证券交易所证券交易业务指引第2号——融资融券担保物集中度管理》；

（十）《北京证券交易所融资融券担保物集中度管理业务指引》。

SK-IV-9：单一股票的担保物比例

一、基本定义

单一股票的担保物比例指客户提交的信用账户担保物中单一股票（含存托凭证）总量占其上市可流通量的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：证券类别（股票、存托凭证等）。

三、相关制度规则

同 SK-IV-8 制度规则。

SK-IV-10：转融通交易金额

一、基本定义

转融通交易金额指统计期内中国证券金融公司将自有或者依法筹集的资金和证券出借给证券公司的金额。计算公式为：

$$\begin{aligned}\text{转融通交易金额} &= \text{转融资交易额} + \text{转融券交易额} \\ &= \text{转融资新合约融出额} + \text{转融券新合约融出额} + \\ &\quad \text{转融券展期合约融出额}\end{aligned}$$

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.业务类型（转融资、转融券）；

2.期限；

3.费率。

三、相关制度规则

（一）《转融通业务监督管理试行办法》（证监会令第177号）；

（二）《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则（试行）》；

（三）《上海证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》；

（四）《深圳证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》；

（五）《中国证券登记结算有限责任公司证券出借及转融通登记结算业务实施细则》。

SK-IV-11：转融通归还金额

一、基本定义

转融通归还金额指统计期内证券公司到期需归还给中国证券金融公司的转融通本金金额，不包含息费。计算公式为：

$$\begin{aligned}\text{转融通归还金额} &= \text{转融资归还金额} + \text{转融券归还金额} \\ &= \text{转融资归还金额} + \sum (\text{转融券融出归还量} \times \\ &\quad \text{标的证券实际归还日收盘价})\end{aligned}$$

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.业务类型（转融资、转融券）；
- 2.期限；
- 3.费率。

三、相关制度规则

同 SK-IV-10 制度规则。

SK-IV-12：转融通期末余额

一、基本定义

转融通期末余额指统计期末证券公司未了结的转融资合约和转融券合约的金额。计算公式为：

转融通期末余额=转融资期末余额+转融券期末余额

$$\begin{aligned} &= \Sigma (\text{业务开展以来转融资融出总额} - \text{业务开展} \\ &\quad \text{以来转融资归还总额}) + \Sigma [(\text{转融券融出量} \\ &\quad - \text{转融券融出归还量} + \text{未了结转融券合约的} \\ &\quad \text{权益补偿量}) \times \text{标的证券统计日收盘价或公} \\ &\quad \text{允价格}] + \text{未了结转融券合约的权益补偿资金} \\ &\quad \text{金额} \end{aligned}$$

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1.业务类型（转融资、转融券）；

2.期限；

3.费率。

三、相关制度规则

同 SK-IV-10 制度规则。

SK-IV-13：转融通保证金余额

一、基本定义

转融通保证金余额指统计期末借入人（证券公司）在中国证券金融公司交存的作为转融通业务担保物的余额。担保物包括资金和中国证券金融公司认可的证券。计算公式为：

$$\begin{aligned} \text{转融通保证金余额} = & \text{保证金资金} + \text{未到账现金权益} + \\ & \Sigma (\text{可充抵保证金证券市值} \times \text{证券转融通} \\ & \text{折算率}) + \Sigma (\text{未到账证券权益市值} \times \text{证券} \\ & \text{转融通折算率}) \end{aligned}$$

其中：

$\text{保证金资金} = \text{转融通担保资金账户余额} - \text{被异常冻结的保证金资金} + \text{被临时使用的保证金资金等}$ ，

$\text{可充抵保证金证券市值} = (\text{转融通担保证券账户证券} - \text{被异常冻$

结的证券+被临时使用的证券等)×最新收盘价或公允价格。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1.担保物类别；

2.证券公司。

三、相关制度规则

《中国证券金融股份有限公司转融通业务保证金管理实施细则(试行)》。

SK-IV-14：转融通保证金比例

一、基本定义

转融通保证金比例指统计期末证券公司交存的保证金与证券公司未偿还的转融通负债价值的比例。

$$\text{转融通保证金比例} = \frac{\text{转融通保证金余额}}{\{\text{转融资金额} + \sum[(\text{出借证券数量} + \text{权益补偿证券数量}) \times \text{最新收盘价}] + \text{转融通费用} + \text{权益补偿资金} + \text{违约金}\}} \times 100\%$$

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：%

（三）常用维度：证券公司。

三、相关制度规则

同 SK-IV-13 制度规则。

SK-IV-15：做市借券融出金额

一、基本定义

做市借券融出金额指统计期内中国证券金融公司出借给证券公司并供其用于证券做市业务的证券市值。计算公式为：

$$\begin{aligned}\text{做市借券融出金额} &= \text{做市借券新融出额} + \text{做市借券展期融出额} \\ &= \Sigma (\text{做市借券新融出数量} \times \text{标的证券融出日} \\ &\quad \text{收盘价}) + \Sigma (\text{做市借券展期融出数量} \times \text{标的} \\ &\quad \text{证券展期日收盘价})\end{aligned}$$

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.期限；

2.费率。

三、相关制度规则

（一）《转融通业务监督管理试行办法》（证监会令第177号）；

（二）中国证券金融股份有限公司、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司《科创板做市借券业务细则》；

(三)《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则(试行)》;
(四)《上海证券交易所转融通证券出借交易实施办法(试行)》;
(五)《深圳证券交易所转融通证券出借交易实施办法(试行)》;
(六)《中国证券登记结算有限责任公司证券出借及转融通登记结算业务实施细则》。

SK-IV-16: 做市借券归还金额

一、基本定义

做市借券归还金额指统计期内证券公司做市借券到期需归还给中国证券金融公司的证券市值,不包含息费。计算公式为:

做市借券归还金额=Σ(做市借券归还数量×标的证券归还日收盘价)

二、统计属性

- (一)基本频度: 日
- (二)基本计量单位: 元
- (三)常用维度:

1.期限;

2.费率。

三、相关制度规则

同 SK-IV-15 制度规则。

SK-IV-17: 做市借券期末余额

一、基本定义

做市借券期末余额指统计期末证券公司未了结的做市借券合约金额。计算公式为：

做市借券期末余额=Σ〔（做市借券融出数量－做市借券归还数量+未了结做市借券合约的权益补偿数量）×标的证券统计日收盘价或公允价格〕+未了结做市借券合约的权益补偿资金金额

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.期限；

2.费率。

三、相关制度规则

同 SK-IV-15 制度规则。

SK-IV-18：做市借券保证金余额

一、基本定义

做市借券保证金余额指统计期末借入人（证券公司）在中国证券金融公司交存的做市借券业务担保物的价值，包括资金余额和中国证券金融公司认可的证券价值。计算公式为：

做市借券保证金余额=保证金资金+未到账现金权益+Σ〔（可充抵保证金证券市值+未到账证券权益市值）×折算率〕

其中：

保证金资金=做市借券担保资金账户余额 - 被异常冻结的保证金资金+被临时使用的保证金资金

可充抵保证金证券市值=(做市借券担保证券账户证券数量 - 被异常冻结的证券数量+被临时使用的证券数量)×最新收盘价或公允价格。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1.担保物类别；

2.证券公司。

三、相关制度规则

(一) 中国证券金融股份有限公司、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司《科创板做市借券业务细则》；

(二) 《中国证券金融股份有限公司转融通业务保证金管理实施细则（试行）》。

SK-IV-19：做市借券保证金比例

一、基本定义

做市借券保证金比例指统计期末证券公司交存的保证金与证券公司未偿还的做市借券负债价值的比例。计算公式为：

保证金比例=做市借券保证金余额÷{Σ[(出借证券数量+权益补偿证券数量)×最新收盘价]+做市借券费用+权益补偿资金+违约金}
×100%

二、统计属性

- (一) 基本频度：日
- (二) 基本计量单位：%
- (三) 常用维度：证券公司

三、相关制度规则

同 SK-IV-18 制度规则。

SK-V：新股发行

SK-V-1：平均超募比率

一、基本定义

平均超募比率指统计期内全部 IPO 公司的超募资金与预计募集资金的比率。计算公式为：

$$FAFR = \frac{\sum_{i=1}^n FAF_i}{\sum_{i=1}^n FEF_i} \times 100\%$$

其中：

FAFR—平均超募比率

n—统计期内 IPO 股票只数

FAFi—第 i 只 IPO 股票超募资金

FEF_i —第 i 只 IPO 股票预计募集资金

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：%

(三) 常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 境内证券交易所。

三、指标说明

(一) 超募资金=首发募集资金—预计募集资金，其中首发募集资金不扣除发行费用。

(二) 在计算一组股票平均超募比率时，包含首发募集资金少于预计募集资金的股票。

(三) 在北交所向不特定合格投资者公开发行股票并上市按照 IPO 统计。

SK-V-2：平均首发价格

一、基本定义

平均首发价格指统计期内 IPO 股票的算术平均发行价格。计算公式为：

$$FP = \frac{\sum_{i=1}^n FP_i}{n}$$

其中：

FP—平均首发价格

n—统计期内 IPO 股票只数

FP_i—第 i 只 IPO 股票的首发价格

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A 股、B 股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.境内证券交易所。

三、指标说明

在北交所向不特定合格投资者公开发行股票并上市按照 IPO 统计。

SK-V-3：平均网上发行中签率

一、基本定义

平均网上发行中签率指统计期内 IPO 股票的网上发行中签率的算术平均值。计算公式为：

$$ISR = \frac{\sum_{i=1}^n ISR_i}{n}$$

其中：

ISR—平均网上发行中签率

ISR_i—第 i 只 IPO 股票的网上发行中签率

n—统计期内 IPO 股票只数

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

三、指标说明

在北交所向不特定合格投资者公开发行股票并上市按照 IPO 统计。

SK-V-4：新股破发率

一、基本定义

新股破发率指统计期内破发的 IPO 股票数量占全部 IPO 股票数量的比率。计算公式为：

$$BR = \frac{m}{n} \times 100\%$$

其中：

BR—新股破发率

m—统计期内破发的 IPO 股票只数

n—统计期内 IPO 股票只数

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 境内证券交易所。

三、指标说明

（一）破发一般指期末价格跌破首发价格。根据统计需要，在注明的情况下也可按盘中最低价格跌破首发价格判定破发。

（二）统计时应注明 IPO 时间区间和判定破发的时间区间。例如，上市首日破发率指统计期内 IPO 股票中上市首日破发的股票数量占比。

（三）在北交所向不特定合格投资者公开发行股票并上市按照 IPO 统计。

SK-VI：股票质押式回购

SK-VI-1：质押率

一、基本定义

质押率指初始交易金额与质押标的证券市值的比率。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 2.境内证券交易所；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

三、相关制度规则

《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》。

SK-VI-2：质押比例

一、基本定义

质押比例指统计期末单只 A 股股票质押数量与其 A 股股本的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 2.境内证券交易所；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.融出方类型（个人、一般企业、银行、证券公司自有资金、证券公司资产管理计划、证券公司资产管理子公司管理的资产管理计划等）。

三、相关制度规则

同 SK-VI-1 制度规则。

SK-VI-3：股票质押式回购成交金额

一、基本定义

股票质押式回购成交金额指统计期内成交确认的全部股票质押式回购初始交易成交金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 2.境内证券交易所；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.融出方类型（个人、一般企业、银行、证券公司自有资金、证券公司资产管理计划、证券公司资产管理子公司管理的资产管理计划等）。

三、相关制度规则

同 SK-VI-1 制度规则。

SK-VI-4：待购回金额

一、基本定义

待购回金额指统计期末融入方应付金额。计算公式为：

待购回金额=初始交易合约的未偿还本金+未偿还利息+未偿还
罚息+未偿还违约金+未偿还其他费用

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：融出方类型（个人、一般企业、银行、证券公司自有资金、证券公司资产管理计划、证券公司资产管理子公司管理的资产管理计划等）。

三、相关制度规则

同 SK-VI-1 制度规则。

SK-VI-5：履约保障比例

一、基本定义

履约保障比例指统计期末质押资产总额（初始交易合约及其合并管理的质押标的证券、相应孳息及其他担保物价值之和）与融入方应付金额的比值。计算公式为：

履约保障比例=质押资产总额/融入方应付金额

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：融出方类型（个人、一般企业、银行、证券公司自有资金、证券公司资产管理计划、证券公司资产管理子公司管理的资产管理计划等）。

三、相关制度规则

同 SK-VI-1 制度规则。

SK-VII：上市公司并购重组

SK-VII-1：上市公司并购重组家数

一、基本定义

上市公司并购重组家数指统计期内实施上市公司收购、资产重组、合并、分立分拆和股份回购行为的上市公司数量的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否有境外投资者参与（是、否）；
- 7.是否发行定向可转换债券（是、否）；
- 8.是否发行优先股（是、否）；
- 9.是否涉及行政许可（是、否）。

三、指标种类

根据是否包含回购，上市公司并购重组家数可分为：上市公司并购重组家数（含回购）和上市公司并购重组家数（不含回购）。

四、指标说明

（一）上市公司收购家数见 SK-VII-3 小节；上市公司资产重组家数见 SK-VII-5 小节；上市公司合并家数见 SK-VII-7 小节；上市公司分立分拆家数见 SK-VII-9 小节；上市公司股份回购家数见 SK-VII-11 小节。

（二）统计期内同一家上市公司出现了收购、资产重组、合并、

分立分拆和股份回购中的多种行为的计为 1 家，下同。

（三）是否发行优先股指上市公司是否通过发行优先股的方式实施并购重组，下同。

（四）是否发行定向可转换债券指上市公司是否通过发行定向可转换债券的方式实施并购重组，下同。

（五）一般情况下，上市公司并购重组家数包括回购。

五、相关制度规则

（一）《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 214 号）；

（二）《上市公司收购管理办法》（证监会令第 166 号）；

（三）《上市公司分拆规则（试行）》（证监会公告〔2022〕5 号）；

（四）《上市公司股份回购规则》（证监会公告〔2023〕63 号）；

（五）《上海证券交易所股票上市规则》；

（六）《上海证券交易所科创板股票上市规则》；

（七）《深圳证券交易所股票上市规则》；

（八）《深圳证券交易所创业板股票上市规则》；

（九）《北京证券交易所股票上市规则》。

SK-VII-2：上市公司并购重组金额

一、基本定义

上市公司并购重组金额指统计期内上市公司收购、资产重组、

合并、分立分拆和股份回购的交易金额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否有境外投资者参与（是、否）；
- 7.是否发行定向可转换债券（是、否）；
- 8.是否发行优先股（是、否）；
- 9.是否涉及行政许可（是、否）。

三、指标种类

根据是否包含回购，上市公司并购重组金额可分为：上市公司并购重组金额（含回购）和上市公司并购重组金额（不含回购）。

四、指标说明

（一）上市公司收购金额见 SK-VII-4 小节；上市公司资产重组金额见 SK-VII-6 小节；上市公司合并金额见 SK-VII-8 小节；上市公司分立分拆金额见 SK-VII-10 小节；上市公司股份回购金额见 SK-VII-12 小节。

（二）一般情况下，上市公司并购重组金额包括回购金额。

五、相关制度规则

同 SK-VII-1 制度规则。

SK-VII-3：上市公司收购家数

一、基本定义

上市公司收购家数指统计期内投资者按照《上市公司收购管理办法》直接或间接取得上市公司股份，且涉及履行信息披露义务的上市公司数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A 股、B 股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否有境外投资者参与（是、否）；
- 7.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

（一）根据上市公司收购方式，上市公司收购家数分为：协议

收购家数，要约收购家数，集中竞价交易收购家数，间接收购家数，国有股行政划转、变更或合并方式收购家数，执行法院裁定方式收购家数，继承方式收购家数，赠予方式收购家数等。

协议收购家数指投资者在证券交易所之外，与被收购公司的股东就股份的收购价格、数量等方面进行协商，取得被收购上市公司股份所涉及的上市公司数量。

要约收购家数指投资者按照同等价格和同一比例等相同的要约条件向上市公司股东公开发出收购其所持有的公司股份的行为所涉及的上市公司数量。

间接收购家数指投资者虽不是上市公司的股东，但通过投资关系、协议、其他安排导致其拥有上市公司的股份达到《上市公司收购管理办法》规定的信息披露义务标准的行为所涉及的上市公司数量。

（二）根据实际控制人变更情况，上市公司收购家数分为：上市公司收购家数（实际控制人变更）和上市公司收购家数（实际控制人未变更）。在实际控制人未变更的情形中，可进一步统计大股东增持家数，指第一大股东以及持股 30%以上的股东收购上市公司股份行为所涉及的上市公司数量。

四、指标说明

（一）上市公司收购家数的统计范围包括：简式权益变动报告书、详式权益变动报告书、上市公司收购报告书（含要约收购报告书）和股份增持公告等披露的上市公司收购行为。

（二）上市公司收购家数可使用收购报告书、权益变动报告书或股份增持公告披露日作为指标的统计日，实际使用时应注明具体统计口径。

（三）统计期内，同一家上市公司出现了多次收购行为的计为 1 家；交易双方均为上市公司的计为 1 家。

五、相关制度规则

- （一）《上市公司收购管理办法》（证监会令第 166 号）；
- （二）《上海证券交易所股票上市规则》；
- （三）《上海证券交易所科创板股票上市规则》；
- （四）《深圳证券交易所股票上市规则》；
- （五）《深圳证券交易所创业板股票上市规则》；
- （六）《北京证券交易所股票上市规则》。

SK-VII-4：上市公司收购金额

一、基本定义

上市公司收购金额指统计期内投资者收购上市股份所支付金额的合计。

二、统计属性

- （一）基本频度：月
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；

- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否有境外投资者参与（是、否）；
- 7.是否发行优先股。

三、指标种类

上市公司收购金额的指标分类参见 SK-VII-3 小节。

四、指标说明

（一）上市公司收购金额一般为投资者收购上市公司股份实际支付的金额；间接收购金额为 $ACAM_{in}$ ，计算公式为：

$$ACAM_{in} = EAV \times \frac{NEA_{ma} \times SHR}{NEA}$$

其中：

$ACAM_{in}$ —间接收购金额

EAV —投资者实际支付的金额

SHR —被收购上市公司股东持有上市公司股份比例

NEA_{ma} —上市公司的净资产总额

NEA —被收购的上市公司股东的净资产总额

（二）国有股行政划转、变更或合并，继承，赠予等方式收购上市公司的收购金额一般为零。

（三）统计范围同 SK-VII-3 相关说明。

五、相关制度规则

同 SK-VII-3 制度规则。

SK-VII-5：上市公司资产重组家数

一、基本定义

上市公司资产重组家数指统计期内公告购买、出售资产的上市公司数量的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 监管辖区，行政区划；
6. 标的资产（境内资产、境外资产）；
7. 是否关联交易（是、否）；
8. 是否发行定向可转换债券（是、否）；
9. 是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

（一）根据标的资产规模，上市公司资产重组家数分为：重大

资产重组家数和非重大资产重组家数。

（二）根据重组类型，上市公司资产重组家数分为：重组上市家数、大股东资产注入家数、第三方购买家数及其他类型重组家数。

重组上市家数指满足《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重组行为所涉及的上市公司数量。

大股东资产注入家数指除重组上市以外，上市公司向大股东购买资产的重组行为所涉及的上市公司数量。

第三方购买家数指上市公司购买非关联第三方资产的重组行为所涉及的上市公司数量。

（三）根据重组目的，上市公司资产重组家数分为：产业整合家数和非产业整合家数。

产业整合家数指上市公司收购资产所属行业与上市公司所属行业相关或处于行业上下游的重组行为所涉及的上市公司数量。

（四）根据支付方式，上市公司资产重组家数分为：上市公司资产重组家数（现金）、上市公司资产重组家数（股份）、上市公司资产重组家数（资产）、上市公司资产重组家数（含可转债）、上市公司资产重组家数（混合）。其中，上市公司资产重组家数（现金）、上市公司资产重组家数（股份）、上市公司资产重组家数（资产）统计口径为仅采用对应单项支付方式的上市公司资产重组家数，上市公司资产重组家数（含可转债）统计口径为含可转债支付方式的上市公司资产重组家数，上市公司资产重组家数（混合）统计口径为除上述支付方式以外的上市公司资产重组家数。

（五）根据是否需要行政许可，上市公司资产重组家数分为：上市公司资产重组家数（需要行政许可）和上市公司资产重组家数（不需行政许可）。

四、指标说明

（一）上市公司资产重组家数的统计范围及时间口径：（1）满足《上市公司重大资产重组管理办法》规定的行为，以注册日作为指标的统计日，也可在注明的情况下采用股东会决议公告日；（2）根据《上海证券交易所股票上市规则》《深圳证券交易所股票上市规则》《深圳证券交易所创业板股票上市规则》《上海证券交易所科创板股票上市规则》《北京证券交易所股票上市规则》披露的行为，以董事会决议公告日作为指标的统计日；（3）除（1）和（2）的情形外，上市公司发布公告披露的资产交易行为，以资产交易公告日作为指标的统计日。

（二）统计期内，同一家上市公司实施了多次资产重组行为的计为 1 家；上市公司资产重组行为中，交易双方均为上市公司的计为 1 家。

五、相关制度规则

同 SK-VII-3 制度规则。

SK-VII-6：上市公司资产重组金额

一、基本定义

上市公司资产重组金额指统计期内上市公司实施资产重组交易

金额的合计，包含重大资产重组金额和非重大资产重组金额。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.标的资产（境内资产、境外资产）；
- 7.是否关联交易（是、否）；
- 8.是否发行定向可转换债券（是、否）；
- 9.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

（一）根据资金情况，上市公司资产重组金额分为：上市公司资产重组金额（资产交易）和上市公司资产重组金额（配套融资）。

上市公司资产重组金额（资产交易）指上市公司资产重组中标的资产交易定价金额的合计；上市公司资产重组金额（配套融资）指上市公司资产重组中发行股份或定向可转债购买资产涉及的募集配套资金金额的合计。其中，上市公司资产重组金额（注册募集配套融资）是经中国证券监督管理委员会注册的募集配套资金的总额；

上市公司资产重组金额（实际募集配套融资）是上市公司实际募集的配套资金的总额。

上市公司资产重组金额（配套融资）可以分为支付对价的配套融资金额和非支付对价的配套融资金额。其中，支付对价的配套融资金额指特定对象以现金或者资产认购上市公司向特定对象发行的股份或定向可转债后，上市公司用同一次向特定对象发行所募集的资金向该特定对象购买资产所支付的金额；非支付对价的配套融资金额指上市公司发行股份或定向可转债购买资产的同时募集部分配套资金，且未用于支付本次资产购买行为的资金总额。上市公司资产重组金额=上市公司资产重组金额（资产交易）+非支付对价的配套融资金额=上市公司资产重组金额（资产交易）+上市公司资产重组金额（配套融资）-支付对价的配套融资金额。

（二）上市公司资产重组金额的其他指标种类参见 SK-VII-5 小节。

四、指标说明

（一）资产重组交易金额不进行抵消处理，如上市公司以存量资产与重组方进行置换、向第三方出售资产再向重组方购买资产等情形，均以各项资产金额之和作为本次交易金额；未披露资产交易金额的记为零。

（二）统计范围和统计时点口径参见 SK-VII-5。

五、相关制度规则

同 SK-VII-3 制度规则。

SK-VII-7：上市公司合并家数

一、基本定义

上市公司合并家数指统计期内根据《中华人民共和国公司法》规定实施合并行为的上市公司数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否涉及跨境（是、否）；
- 7.是否发行优先股（是、否）；
- 8.是否发行定向可转债（是、否）。

三、指标种类

（一）根据合并类型，上市公司合并家数分为：上市公司吸收合并非上市公司家数、上市公司吸收合并上市公司家数和非上市公司吸收合并上市公司家数。

（二）根据合并目的，上市公司合并家数分为：产业整合合并

家数和非产业整合合并家数。

产业整合合并家数指上市公司吸收合并行为中，吸收合并方和被吸收合并方属于同行业或相近产业的行为所涉及的上市公司数量；非产业整合合并家数指除产业整合合并外的上市公司合并家数。

（三）根据支付方式，上市公司合并家数分为：上市公司合并家数（现金）、上市公司合并家数（换股）、上市公司合并家数（含可转债）和上市公司合并家数（混合）。其中，上市公司合并家数（现金）、上市公司合并家数（换股）统计口径为仅采用对应单项支付方式的上市公司合并家数，上市公司合并家数（含可转债）统计口径为含可转债支付方式的上市公司合并家数，上市公司合并家数（混合）统计口径为除上述支付方式以外的上市公司合并家数。

四、指标说明

（一）统计期内同一家上市公司实施了多次吸收合并行为的计为 1 家。

（二）涉及行政许可的吸收合并采用注册日作为指标的统计日，不涉及行政许可的吸收合并采用股东会决议公告日作为指标的统计日。

五、相关制度规则

（一）《中华人民共和国公司法》（中华人民共和国主席令第十五号）；

（二）《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 214 号）。

SK-VII-8：上市公司合并金额

一、基本定义

上市公司合并金额指统计期内根据《中华人民共和国公司法》规定实施合并行为所涉及交易金额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否涉及跨境（是、否）；
- 7.是否发行优先股（是、否）；
- 8.是否发行定向可转债（是、否）。

三、指标种类

上市公司合并金额的指标分类参见 SK-VII-7 小节。

四、指标说明

（一）上市公司合并金额分为上市公司合并成交金额和上市公司合并交易金额。

上市公司合并成交金额的计算公式为：

$$MERAM_{un} = SHR_{mer} \times PRM + CPAY$$

其中：

$MERAM_{un}$ —上市公司合并成交金额

SHR_{mer} —合并方发行股数

PRM —换股价格

$CPAY$ —现金支付对价（上市公司合并方案没有现金支付，则现金支付对价为零）

上市公司合并交易金额的计算公式为：

$$MERAM_{bi} = MERAM_{un} + MAV_{me}$$

其中：

$MERAM_{bi}$ —上市公司合并交易金额

MAV_{me} —吸收合并定价日，吸收合并方的市值

（二）统计范围和统计时点口径参见 SK-VII-7 小节。

五、相关制度规则

同 SK-VII-7 制度规则。

SK-VII-9：上市公司分立分拆家数

一、基本定义

上市公司分立分拆家数指统计期内实施分立或分拆行为的上市公司数量的合计，包括全资子公司和控股子公司的分立分拆。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.标的资产（境内资产、境外资产）。

三、指标种类

根据分立分拆类型，上市公司分立家数可以分为：派生分立家数，新设分立家数和分拆家数。

派生分立家数指上市公司分立行为中，原公司的主体资格未消灭的上市公司家数；新设分立家数指上市公司分立行为中，原公司的主体资格消灭的上市公司家数。

分拆家数指上市公司所属企业单独上市的家数。

四、指标说明

统计期内同一家上市公司实施多次分立分拆行为的计为1家。

五、相关制度规则

（一）《中华人民共和国公司法》（中华人民共和国主席令第十五号）；

（二）《上市公司分拆规则（试行）》（证监会公告〔2022〕5

号)。

SK-VII-10：上市公司分立分拆金额

一、基本定义

上市公司分立分拆金额指统计期内上市公司实施分立或分拆行为所涉及金额的合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：月

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 监管辖区，行政区划；
6. 标的资产（境内资产、境外资产）。

三、指标种类

上市公司分立分拆金额的指标种类参见 SK-VII-9 小节。

四、指标说明

(一) 上市公司分立金额计算时采用新上市公司上市首个公告日前原上市公司的市值。

(二) 上市公司分拆金额计算时采用新上市公司上市首个公告

日前原上市公司最近一个会计年度合并报表中享有的该所属企业的净资产。

五、相关制度规则

同 SK-VII-9 制度规则。

SK-VII-11：上市公司股份回购家数

一、基本定义

上市公司股份回购家数指统计期内购买本公司发行的社会公众股份的上市公司数量的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A 股、B 股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

根据回购方式，上市公司股份回购家数分为：竞价回购家数、要约回购家数和其他方式回购家数。

四、指标说明

（一）以回购实施完成日作为指标的统计日，即上市公司披露股份回购实施结果及股份变动公告日。

（二）统计期内同一家上市公司实施多次股份回购的计为 1 家。

五、相关制度规则

（一）《上市公司股份回购规则》（证监会公告〔2023〕63 号）；

（二）《上海证券交易所股票上市规则》；

（三）《上海证券交易所科创板股票上市规则》；

（四）《深圳证券交易所股票上市规则》；

（五）《北京证券交易所股票上市规则》；

（六）《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 7 号——回购股份》；

（七）《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 9 号——回购股份》；

（八）《北京证券交易所上市公司持续监管指引第 4 号——股份回购》。

SK-VII-12：上市公司股份回购金额

一、基本定义

上市公司股份回购金额指统计期内上市公司购买本公司发行的社会公众股份所支付金额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、创业板、科创板、北交所）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.监管辖区，行政区划；
- 6.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

上市公司股份回购金额的指标种类参见 SK-VII-11 小节。

四、指标说明

统计范围和统计时点口径参见 SK-VII-11 小节。

五、相关制度规则

同 SK-VII-11 制度规则。

SK-VIII：沪（深）港通交易

SK-VIII-1：沪（深）港通标的证券只数

一、基本定义

沪（深）港通标的证券只数指统计期末满足内地与香港股票市场交易互联互通机制要求的标的证券只数。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

1. 证券类别（股票、股票 ETF）；

2. 互联互通类型（沪股通、深股通、沪港通下港股通、深港通下港股通）。

三、指标说明

同时属于沪港通下港股通标的和深港通下港股通标的的证券按 1 只统计。

四、相关制度规则

（一）《内地与香港股票市场交易互联互通机制若干规定》（证监会令第 200 号）；

（二）《上海证券交易所沪港通业务实施办法》；

（三）《深圳证券交易所深港通业务实施办法》。

SK-VIII-2：沪（深）港通交易金额

一、基本定义

沪（深）港通交易金额指统计期内通过内地与香港股票市场交易互联互通机制发生的标的证券交易金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 证券类别（股票、股票 ETF）；
2. 互联互通类型（沪股通、深股通、沪港通下港股通、深港通下港股通）；
3. 港股通投资者类型；
4. 买卖方向（买入金额、卖出金额）。

三、指标说明

统计时应包含曾被纳入但已调出标的范围的证券。

四、相关制度规则

同 SK-VIII-1 制度规则。

SK-VIII-3：账户持沪（深）港通证券市值

一、基本定义

账户持沪（深）港通证券市值指统计期末沪（深）港通投资者所持沪（深）港通标的证券市值的合计。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：
 1. 证券类别（股票、股票 ETF）；
 2. 互联互通类型（沪股通、深股通、沪港通下港股通、深港通下港股通）；

3. 港股通投资者类型。

三、指标说明

统计时应包含曾被纳入但已调出标的范围的证券。

SK-IX：优先股

SK-IX-1：优先股公司家数

一、基本定义

优先股公司家数指统计期末发行优先股的公司数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1.行业分类；

2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

3.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；

4.监管辖区，行政区划；

5.发行场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标说明

（一）发行优先股的公司指其发行的优先股在中国证券登记结算有限责任公司进行登记存管的公司。

（二）优先股公司家数一般按优先股初始登记日统计，也可在注明的情况下按上市日或挂牌日统计。

（三）发行多只优先股的公司，统计时按 1 家计算。

（四）在境内发行优先股且注册在境内的境外上市公司按非上市公司公众公司统计。

四、相关制度规则

（一）《优先股试点管理办法》（证监会令第 209 号）；

（二）《上海证券交易所优先股试点业务实施细则》；

（三）《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》；

（四）《北京证券交易所上市公司向特定对象发行优先股业务细则》；

（五）《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引第 1 号——发行和挂牌的申请文件与程序》；

（六）《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引第 2 号——主办券商推荐工作报告的内容与格式》；

（七）《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引第 3 号——法律意见书的内容与格式》。

SK-IX-2：优先股股本

一、基本定义

优先股股本指统计期末在中国证券登记结算有限责任公司登记存管的优先股股份数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

(二) 基本计量单位：股

(三) 常用维度：

- 1.发行方式（公开、非公开）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
- 5.优先股种类（是否固定股息、是否强制分红、是否累积分红、是否参与、可否回购）；
- 6.发行场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标说明

优先股股本默认按初始登记日进行统计，在注明统计口径的情形下也可按上市日或挂牌日统计。

四、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-3：优先股市值

一、基本定义

优先股市值指统计期末根据已上市或挂牌公司的优先股价格和对应优先股数量计算的股权价值合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 发行方式（公开、非公开）；
2. 行业分类；
3. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
4. 公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
5. 优先股种类（是否固定股息、是否强制分红、是否累积分红、是否参与、可否回购）；
6. 发行场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标说明

如当日无交易价格，采用最后一次竞价交易价格，如无则采用最后一次协议交易价格。如无交易成交记录，采用发行价格。

四、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-4：优先股融资公司家数

一、基本定义

优先股融资公司家数指统计期内通过发行优先股募集资金的公司数量。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：家
- （三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 3.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
- 4.监管辖区；
- 5.是否首次发行优先股（是、否）；
- 6.发行场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标说明

（一）优先股融资公司家数按优先股初始登记日统计，也可在注明的情况下按优先股上市日或挂牌日统计。

（二）统计期内多次发行优先股的上市公司统计为 1 家。

四、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-5：优先股融资金额

一、基本定义

优先股融资金额指统计期内通过发行优先股筹集的资金总额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.发行方式（公开、非公开）；
- 2.行业分类；

- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
- 5.是否首次发行优先股融资（是、否）；
- 6.优先股种类（是否固定股息、是否强制分红、是否累积分红、是否参与、可否回购）；
- 7.发行认购方式（现金、资产）；
- 8.发行场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标说明

统计口径相关说明参见 SK-IX-4。

四、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-6：优先股成交量

一、基本定义

优先股成交量指统计期内全部优先股成交数量合计。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：股
- （三）常用维度：
 - 1.发行方式（公开、非公开）；
 - 2.行业分类；
 - 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

- 4.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
- 5.交易/转让场所（境内证券交易所、全国股转系统）；
- 6.优先股种类（是否固定股息、是否强制分红、是否累积分红、是否参与、可否回购）。

三、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-7：优先股成交金额

一、基本定义

优先股成交金额指统计期内全部优先股成交金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.发行方式（公开、非公开）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
- 5.交易/转让场所（境内证券交易所、全国股转系统）；
- 6.优先股种类（是否固定股息、是否强制分红、是否累积分红、是否参与、可否回购）。

三、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-8：优先股股息总额

一、基本定义

优先股股息总额指统计期内公司派发的优先股股息合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.行业分类；

2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

3.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；

4.交易/转让场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标种类

根据公司派发股息的实际情况，优先股股息总额可以分为：

（一）应付优先股股息总额

应付优先股股息总额指统计期内公司按照协议应派发的优先股股息合计。

（二）实际优先股股息总额

实际优先股股息总额指统计期内公司实际派发的优先股股息合计。

四、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-IX-9：优先股股息率

一、基本定义

优先股股息率指优先股的每股股息与其价格之间的比率。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 3.公司上市情况分类（上市公司、非上市公众公司）；
- 4.交易/转让场所（境内证券交易所、全国股转系统）。

三、指标种类

根据股息和优先股价格选取的不同，股息率可以分为：

（一）票面股息率

票面股息率指优先股发行时约定的每股股息与其票面金额之间的比率。计算公式为：

$$NDP = \frac{NDY}{ND} \times 100\%$$

其中：

NDP—票面股息率

NDY—每股约定股息

ND—优先股票面金额

（二）实际股息率

实际股息率指优先股实际派发的每股股息与其价格的比率。通常用优先股实际派发的股息总额与优先股期末市值的比率来计算股息率，计算公式为：

$$DP = \frac{DY}{CAP} \times 100\%$$

其中：

DP—实际股息率

DY—统计期内的优先股实际派发的股息总额

CAP—样本优先股期末市值

四、指标说明

（一）对一组优先股的平均票面股息率通常用算术平均法计算，计算公式为：

$$NDP_{(avg)} = \frac{\sum_{i=1}^n NDP_i}{n}$$

其中：

$NDP_{(avg)}$ —平均票面股息率

n—优先股股票只数

NDP_i —第 i 只优先股票面股息率

（二）对一组优先股的平均实际股息率通常用总体法计算，计算公式为：

$$DP_{(avg)} = \frac{\sum_{i=1}^n DY_i}{\sum_{i=1}^n CAP_i} \times 100\%$$

其中：

$DP_{(avg)}$ ——平均实际股息率

n ——优先股股票只数

DY_i ——第 i 只优先股实际派发的股息总额

CAP_i ——第 i 只优先股期末市值

五、相关制度规则

同 SK-IX-1 制度规则。

SK-X：股票期权

SK-X-1：期权保证金

一、基本定义

期权保证金是指统计期末股票期权交易者按照规定标准缴纳的资金或者证券，用于结算期权合约和担保期权合约履行。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.期权品种；

2.期权合约。

三、指标种类

按照保证金的不同类别，主要有以下两种保证金指标：

（一）交易保证金

交易保证金分为开仓保证金和维持保证金。

1. 开仓保证金指交易所对每笔卖出开仓申报实时计算并对有效卖出开仓申报实时扣减的保证金日间额度。

2. 维持保证金指结算参与者存入期权保证金账户、用于履约担保且已被合约占用的保证金。

（二）结算准备金

结算准备金指结算参与者存入期权保证金账户，未被合约占用的保证金。

四、指标说明

股票期权交易中，股票期权买方不需要缴纳保证金。

五、相关制度规则

（一）《上海证券交易所股票期权试点交易规则》；

（二）《上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司股票期权试点风险控制管理办法》；

（三）《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》。

SK-X-2：期权持仓量

一、基本定义

期权持仓量指统计期末未平仓期权合约数量的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：张

（三）常用维度：

1.期权品种；

2.合约系列；

3.合约类型（认购期权合约、认沽期权合约）；

4.境内证券交易所。

三、指标说明

（一）期权合约了结方式包括平仓、行权和自动到期。

（二）期权品种的持仓量为统计期末该品种所有期权合约的持仓量合计值。

（三）期权市场的持仓量为统计期末全部期权品种的持仓量合计值。

四、相关制度规则

同 SK-X-1 制度规则。

SK-X-3：期权成交量

一、基本定义

期权成交量指统计期内全部期权合约成交数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

(二) 基本计量单位：张

(三) 常用维度：

1. 期权品种；
2. 合约系列；
3. 合约类型（认购期权合约、认沽期权合约）；
4. 境内证券交易所。

三、指标说明

合约系列按期权合约对应的标的进行统计，下同。

四、相关制度规则

- (一) 《上海证券交易所股票期权试点交易规则》；
- (二) 《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》。

SK-X-4：期权成交金额

一、基本定义

期权成交金额指统计期内所有已成交合约的权利金合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度：日
- (二) 基本计量单位：元
- (三) 常用维度：

1. 期权品种；
2. 合约系列；
3. 合约类型（认购期权合约、认沽期权合约）；

4.境内证券交易所。

三、相关制度规则

同 SK-X-1 制度规则。

SK-X-5：期权成交面额

一、基本定义

期权成交面额指统计期内对已成交合约名义上行权结算的金额合计。计算公式为：

期权成交面额=期权合约成交数量×合约行权价×合约单位

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 期权品种；
2. 合约系列；
3. 合约类型（认购期权合约、认沽期权合约）；
4. 境内证券交易所。

三、相关制度规则

同 SK-X-1 制度规则。

SK-X-6：期权行权金额

一、基本定义

期权行权金额指统计期内期权买方对期权合约行权的金额合计。计算公式为：

期权行权金额=期权行权数量×合约行权价×合约单位

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 期权品种；
2. 合约系列；
3. 境内证券交易所。

三、相关制度规则

同 SK-X-1 制度规则。

SK-X-7：期权交割数量

一、基本定义

期权交割数量指统计期内期权买方通过行权了结到期未平仓合约的期权合约数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：张

（三）常用维度：

1. 期权品种；

2. 合约系列;
3. 境内证券交易所。

三、相关制度规则

- (一) 《上海证券交易所股票期权试点交易规则》;
- (二) 《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》;
- (三) 《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所股票期权试点结算规则》;
- (四) 《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所股票期权试点结算业务实施细则》。

SK-X-8: 期权交割金额

一、基本定义

期权交割金额指统计期内期权买方通过行权了结到期未平仓合约对应标的物的价值合计。计算公式为:

期权交割金额=期权交割数量×合约单位×合约标的物收盘价

二、统计属性

- (一) 基本频度: 日
- (二) 基本计量单位: 元
- (三) 常用维度:
 1. 期权品种;
 2. 合约系列;
 3. 境内证券交易所。

三、指标说明

合约标的物收盘价一般按行权交收日的收盘价统计，也可在注明的情况下按行权日的收盘价统计。

四、相关制度规则

同 SK-X-7 制度规则。

债券市场¹

BD-I：市场规模

BD-I-1：债券发行只数

一、基本定义

债券发行只数指统计期内成功发行的债券数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 期限；
3. 利率类型；
4. 发行人注册地；
5. 发行人行业类别；
6. 发行方式；
7. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、指标说明

（一）具体统计时可选择按初始登记日、发行首日、发行结束日、起息日或上市日（挂牌日）统计，并注明统计口径。

1 本节所指的债券一般为交易所市场债券，具体统计范围为中国证监会注册以及境内证券交易所备案和全国股转系统审核的公司债（含企业债）、可转债、可交换公司债、可分离债、资产支持证券等，以及在境内证券交易所招标的国债、地方政府债、政策性金融债、政府支持机构债等。

（二）发行人是境内证券交易所上市公司的，应使用中国上市公司协会发布的上市公司行业分类结果，其他情况参照《中国上市公司协会上市公司行业统计分类指引》有关规定进行分类。

（三）资产支持证券的发行人作为原始权益人。

四、相关制度规则

（一）《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 222 号）；

（二）《上海证券交易所公司债券发行上市审核规则》；

（三）《深圳证券交易所公司债券发行上市审核规则》；

（四）《北京证券交易所公司债券发行上市审核规则》。

BD-I-2：债券发行规模

一、基本定义

债券发行规模指统计期内各类债券发行票面金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 期限；
3. 利率类型；
4. 发行人注册地；
5. 发行人行业类别；

6. 发行方式;
7. 发行人属性 (政府、国有企业、民营企业、外资企业等)。

三、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-I-3: 债券发行金额

一、基本定义

债券发行金额指统计期内债券发行所募集的资金总额。

二、统计属性

- (一) 基本频度: 日
- (二) 基本计量单位: 元
- (三) 常用维度:
 1. 债券品种;
 2. 期限;
 3. 利率类型;
 4. 发行人注册地;
 5. 发行人行业类别;
 6. 发行方式;
 7. 发行人属性 (政府、国有企业、民营企业、外资企业等)。

三、指标说明

- (一) 统计时点有关说明参见 BD-I-1。
- (二) 基于债券市场发展情况和现行统计实践, 一般采用债券

发行票面金额来计算债券发行金额。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-I-4：债券净融资金额

一、基本定义

债券净融资金额指统计期内债券发行金额与本金兑付金额（详见 BD-II-6 小节）的差值。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 期限；
3. 利率类型；
4. 发行人注册地；
5. 发行人行业类别；
6. 发行方式；
7. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-I-5：债券托管额

一、基本定义

债券托管额指统计期末托管在债券登记结算机构的各类债券票面金额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 期限；
3. 利率类型；
4. 发行人注册地；
5. 发行人行业类别；
6. 发行方式；
7. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-I-6：债券上市只数

一、基本定义

债券上市只数指统计期末在境内证券交易所和全国股转系统上市交易或挂牌转让的债券数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 期限；
3. 利率类型；
4. 交易/转让场所（境内证券交易所、全国股转系统）；
5. 发行方式；
6. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）；
7. 发行人注册地；
8. 发行人行业类别。

三、指标说明

债券上市只数一般按债券上市日或挂牌日统计。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-I-7：持债账户数

一、基本定义

持债账户数指统计期末持有债券数量大于零的证券账户数。

二、统计属性

（一）基本频度：日

(二) 基本计量单位: 户

(三) 常用维度:

1. 债券品种;
2. 利率类型;
3. 投资者类型。

三、指标说明

具体统计时应包括已转入回购质押库中的债券。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-I-8: 债券平均发行利率

一、基本定义

债券平均发行利率指统计期内按发行规模为权重计算的债券发行利率加权平均值。

二、统计属性

(一) 基本频度: 日

(二) 基本计量单位: %

(三) 常用维度:

1. 债券品种;
2. 期限;
3. 利率类型;
4. 信用等级;

5. 发行人注册地;
6. 发行方式;
7. 发行人行业类别;
8. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、指标说明

统计期内纳入统计的债券一般按发行结束日统计，也可在注明的情况下按初始登记日、发行首日、起息日或上市日（挂牌日）统计。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-II：债券交易

BD-II-1：债券成交金额

一、基本定义

债券成交金额指统计期内债券成交金额合计，包括债券现货成交金额、债券回购成交金额和债券借贷成交金额。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：
 1. 交易/转让方式（现货、回购、借贷）；
 2. 债券品种；

3. 回购品种;
4. 证券公司;
5. 监管辖区, 行政区划。

三、指标种类

(一) 债券现货成交金额

债券现货成交金额 = Σ (成交价格 $\times$ 成交量〔现货〕)

(二) 债券回购成交金额

债券回购成交金额 = Σ (成交量〔回购〕 $\times 100$)

(三) 债券借贷成交金额

债券借贷成交金额 = Σ (成交量〔借贷〕 $\times 100$)

四、指标说明

(一) 回购成交金额可按回购融资方实际融入的资金金额进行统计。统计时按单边计算, 不含到期交易。

(二) 借贷成交金额可按债券借入方实际借入的标的债券总面额进行统计, 不含到期交易。

(三) 债券回购包括通用质押式回购、质押式协议回购、质押式三方回购和买断式回购。

五、相关制度规则

- (一) 《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 222 号);
- (二) 《上海证券交易所债券交易规则》;
- (三) 《深圳证券交易所债券交易规则》;
- (四) 《北京证券交易所债券交易规则》。

BD-II-2：标准券总额

一、基本定义

标准券总额指统计期末已质押券按相应折算率形成的可以进行融资的总额度。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.回购方式；
- 2.质押券品种；
- 3.证券公司；
- 4.信用等级；
- 5.发行人注册地；
- 6.发行人行业类别；
- 7.发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、相关制度规则

- （一）《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第222号）；
- （二）《上海证券交易所债券交易规则》；
- （三）《深圳证券交易所债券交易规则》；
- （四）《北京证券交易所债券交易规则》；

（五）中国证券登记结算有限责任公司《标准券折算率（值）管理办法》。

BD-II-3：回购标准券使用率

一、基本定义

回购标准券使用率指统计期末回购未到期金额占回购质押标准券总额的比率。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：%
- （三）常用维度：投资者类型。

三、相关制度规则

同 BD-II-2 制度规则。

BD-II-4：回购定盘利率

一、基本定义

回购定盘利率指以债券回购利率为基础计算出的回购价格参考基准。根据业务规则相关调整，2017 年 5 月 22 日前后采用不同的计算公式，具体如下：

2017 年 5 月 22 日及之后，

$$\text{回购定盘利率} = \frac{\sum \text{当日逐笔成交价} \times \text{当日逐笔成交量}}{\text{当日总成交量}}$$

2017年5月22日（不含）之前，

回购定盘利率

$$= \frac{\sum \text{当日逐笔成交价} \times \text{当日逐笔成交量}}{\text{当日总成交量}} \\ \times \frac{\text{回购品种天数}}{\text{到期交收日} - \text{首期交收日}}$$

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：回购期限。

BD-II-5：回购未到期金额

一、基本定义

回购未到期金额指统计期末未了结回购合约的金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 回购期限；
2. 回购方式；
3. 投资者类型。

BD-II-6：兑付金额

一、基本定义

兑付金额指统计期内债券发行人按照约定向债券投资者偿还本金和支付利息的金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 剩余期限；
3. 利率类型；
4. 发行人注册地；
5. 发行方式；
6. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）；
7. 兑付类型（本金兑付、付息）。

三、指标说明

（一）本金兑付金额以实际本金兑付资金发放日计算；利息兑付以实际利息兑付资金发放日计算。

（二）本金兑付包含现金兑付、可转债转股、可交换债换股等，其中现金兑付可分为到期兑付、回售、赎回、分期偿还、分期摊还等。回售兑付金额为剔除转售部分的净额。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-II-7：本年债券待兑付本金

一、基本定义

本年债券待兑付本金指本年度尚未兑付的债券本金总额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 利率类型；
3. 发行人注册地；
4. 发行方式；
5. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、指标说明

统计范围具体为本金兑付日自统计时点至年末的债券。如分期偿还债券的当期兑付日在统计期内，其当期应兑付本金应纳入统计。永久性债券没有规定本金兑付期限，不纳入统计。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-II-8：本年债券待兑付利息

一、基本定义

本年债券待兑付利息指本年度尚未兑付的债券利息总额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 债券品种；
2. 利率类型；
3. 发行人注册地；
4. 发行方式；
5. 发行人属性（政府、国有企业、民营企业、外资企业等）。

三、指标说明

统计范围具体为利息兑付日自统计时点至年末的债券。

四、相关制度规则

同 BD-I-1 制度规则。

BD-II-9：债券平均收益率

一、基本定义

债券平均收益率指统计期末一组债券收益率的算术平均值。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.债券品种;
- 2.剩余期限;
- 3.利率类型;
- 4.信用等级。

三、指标分类

根据收益率的类型不同,债券平均收益率主要有以下两种指标:

(一) 债券平均到期收益率

债券平均到期收益率指一组债券到期收益率的算术平均值。其中,到期收益率指投资者在二级市场买入已发行的债券并持有到期的年平均收益率。

(二) 债券平均当期收益率

债券平均当期收益率指一组债券当期收益率的算术平均值。其中,当期收益率指债券的年息除以债券当前市场价格所计算出的收益率。

BD-II-10: 借贷加权费率

一、基本定义

借贷加权费率指按借贷成交量加权计算出的借贷价格。计算公式为:

$$\text{借贷加权费率} = \frac{\sum(\text{借贷价格} \times \text{借贷成交量})}{\sum(\text{借贷成交量})} \times 100\%$$

二、统计属性

(一) 基本频度: 日

(二) 基本计量单位: %

(三) 常用维度: 借贷期限。

基金市场

FD-I：市场规模

FD-I-1：基金只数

一、基本定义

基金只数指统计期末基金市场上基金产品的数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人。

三、指标说明

（一）自基金合同生效日（基金成立日）纳入统计，自基金合同终止日剔除。

（二）基金只数应当根据证监会主代码（基金主合同）统计，如使用其他统计口径应加以注明。

FD-I-2：上市基金只数

一、基本定义

上市基金只数指统计期末在境内证券交易所上市交易的基金数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.基金管理人；
- 5.境内证券交易所。

三、指标说明

（一）自基金在境内证券交易所上市日纳入上市基金数的统计，自终止上市日剔除。

（二）上市基金只数按境内证券交易所证券代码统计。

（三）实时申赎货币基金等仅在境内证券交易所场内申赎但不上市交易的基金不纳入指标统计。

FD-I-3：基金份额

一、基本定义

基金份额指统计期末基金市场基金份额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：份

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人。

FD-I-4：基金资产总值

一、基本定义

基金资产总值指统计期末基金资产的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人。

三、指标说明

以外币结算的基金总值按相应币种统计，下同。

四、相关制度规则

（一）《证券投资基金信息披露编报规则第1号〈主要财务指标的計算与披露〉》（证监基金字〔2003〕104号）；

（二）《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2017〕13号）。

FD-I-5：上市基金市值

一、基本定义

上市基金市值指统计期末在境内证券交易所上市交易的基金市值合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.境内证券交易所。

三、指标说明

（一）自基金在境内证券交易所上市日纳入统计，自终止上市日剔除。

（二）实时申赎货币基金等仅在境内证券交易所场内申赎但不上市交易的基金不纳入指标统计。

FD-I-6：基金账户数

一、基本定义

基金账户数指统计期末注册登记人为投资人建立的用于管理和记录基金持有的账户数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：户

（三）常用维度：

1. 投资者类型；
2. 基金管理人。

三、指标说明

（一）基金账户即基金 TA 账户。

（二）基金账户自注册登记人确认登记成功日起纳入统计。

（三）基金账户中，中国证券登记结算有限责任公司基金账户不包括封闭式基金账户。

FD-I-7：基金投资者数

一、基本定义

基金投资者数指统计期末已开立基金账户的投资者数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：个

（三）常用维度：

1.投资者类型；

2.基金管理人。

三、指标说明

统计基金投资者数时，根据投资者全称、证件代码等对基金账户进行去重处理。

FD-I-8：基金认购金额、基金募集金额

一、基本定义

基金认购金额指统计期内投资人向基金管理人购买募集期内基金份额的金额。

基金募集金额指统计期内基金在募集期内扣除相关费用实际募集到的金额与在募集期内产生的相关利息的总计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人。

三、指标说明

（一）基金募集金额按募集截止日进行统计，统计期末募集尚未结束的基金不纳入统计。

（二）基金认购金额按实际统计区间进行统计。

FD-I-9：基金资产净值

一、基本定义

基金资产净值指统计期末基金总资产扣除基金总负债后的余额。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；

5.基金管理人。

三、指标说明

（一）基金份额净值

基金份额净值，又称基金单位资产净值，指每一基金份额代表的基金资产的净值。计算公式为：

$$\text{基金份额净值} = \frac{\text{基金资产净值}}{\text{基金份额}}$$

（二）基金份额累计净值

基金份额累计净值，又称基金单位累计资产净值，指基金份额净值与基金成立以后历次份额分红金额的合计。计算公式为：

$$\text{基金份额累计净值} = \text{基金份额净值} + \sum_{i=1}^n \text{基金份额分红金额}_i$$

其中：

n—基金分红次数

基金份额分红金额_i—第i次分红的基金份额分红金额

基金份额净值、基金份额分红金额计算时应使用拆分前的基金份额。

FD-II：基金交易

FD-II-1：基金申购金额、基金赎回金额

一、基本定义

（一）基金申购金额

基金申购金额指统计期内投资者在开放式基金合同生效后，确

认申购基金份额的金额。

（二）基金赎回金额

基金赎回金额指统计期内基金持有人要求基金管理人购回其所持有的开放式基金份额的金额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人。

FD-II-2：上市基金成交金额

一、基本定义

上市基金成交金额指统计期内在境内证券交易所上市的各类基金成交金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.基金管理人；
- 5.境内证券交易所。

FD-II-3：上市基金折（溢）价率

一、基本定义

上市基金折（溢）价率指统计期末境内证券交易所某只上市基金市值与其基金资产净值之间的偏离比率。

基金平均折（溢）价率指统计期末境内证券交易所全部上市基金市值与其基金资产净值之间的平均偏离比率。

$$\text{基金平均折（溢）价率} = \left(\frac{\sum_{i=1}^n \text{基金价格}_i \times \text{基金份额}_i}{\sum_{i=1}^n \text{基金单位净值}_i (\text{基金份额参考净值}_i) \times \text{基金份额}_i} - 1 \right) \times 100\%$$

折（溢）价率大于零为溢价，小于零为折价。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；

- 4.基金管理人；
- 5.境内证券交易所。

FD-III：基金绩效及分红

FD-III-1：基金利润

一、基本定义

基金利润指统计期内基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益及其他收入之和扣除相关费用后的金额。

基金利润=利息收入+投资收益+公允价值变动损益+其他收入－相关费用

二、统计属性

- （一）基本频度：季
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：
 - 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
 - 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs等）；
 - 3.运作类型（封闭、开放）；
 - 4.是否上市交易（是、否）；
 - 5.基金管理人。

FD-III-2：基金分红金额

一、基本定义

基金分红金额指统计期内基金向基金持有人分派投资红利的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：季

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人。

三、指标说明

基金分红金额包括现金分红和分红再投资金额。

四、相关制度规则

（一）《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第104号）；

（二）《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第120号）。

FD-III-3：基金总持有成本

一、基本定义

基金总持有成本指统计期内基金投资人在投资基金期间所承担的各项费用，包括管理费、托管费、认购费、申购费、赎回费、销

售服务费及其他运营费用等。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资标的（股票、债券、货币、混合、商品等）；
- 2.基金类别（ETF、LOF、QDII、FOF、REITs 等）；
- 3.运作类型（封闭、开放）；
- 4.是否上市交易（是、否）；
- 5.基金管理人；
- 6.费用类别。

三、指标说明

基金的总持有成本可分为两大类：

（一）基金持有人费用，从其资金账户中扣除，用于完成各项交易的费用，主要包括认购费、申购费、赎回费和基金转换费等。

（二）基金运营费用，从基金资产中扣除，用于支付各项管理和服务的费用，主要包括管理费、托管费、销售服务费和其他运营费用（包括证券交易费用、信息披露费、审计费、律师费和上市年费等）。

四、相关制度规则

同 FD-III-2 制度规则。

FD-IV：跨境投资者

FD-IV-1：合格境外投资者家数、QDII 家数

一、基本定义

合格境外投资者家数指统计期末合格境外投资者的数量。

QDII 家数指统计期末合格境内机构投资者的数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：投资者国别/地区。

三、指标说明

根据统计需要，合格境外投资者家数可分为 QFII 家数和 RQFII 家数。

四、相关制度规则

（一）《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（证监会令第 46 号）；

（二）《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（证监会、人民银行、外汇局令〔第 176 号〕）；

（三）《关于实施〈合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法〉有关问题的规定》（证监会公告〔2020〕63 号）。

FD-IV-2: QDII 额度

一、基本定义

QDII 额度指统计期末国家外汇管理局批准合格境内机构投资者进行境外证券投资的投资额度。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：美元

三、相关制度规则

《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（证监会令第46号）。

FD-V: 私募基金

FD-V-1: 私募基金只数

一、基本定义

私募基金只数指统计期末在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人管理的备案私募基金产品只数。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

1.基金类型（私募证券投资基金、私募股权投资基金、创业投资基金、私募资产配置类基金、其他私募投资基金）；

- 2.组织形式（契约型、公司型、合伙型、其他）；
- 3.管理类型（自主管理、顾问管理）；
- 4.私募基金管理人。

三、指标种类

根据私募基金的存续状态，私募基金分为：

（一）私募基金存续只数

私募基金存续只数指统计期末在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人管理的备案且未清盘的私募基金产品只数。一般情况下私募基金只数为存续只数。

（二）私募基金清盘只数

私募基金清盘只数指统计期末已在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人管理的备案私募基金产品完成清盘的只数。

四、指标说明

私募基金只数自私募基金在基金业协会备案成功日起纳入统计，私募基金清盘只数自协会审核通过之日起纳入统计。

五、相关制度规则

- （一）《私募投资基金监督管理条例》（国务院令 第 762 号）；
- （二）《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令 第 105 号）；
- （三）中国证券投资基金业协会《私募投资基金登记备案办法》。

FD-V-2：私募基金管理人人数

一、基本定义

私募基金管理人家数指统计期末在中国证券投资基金业协会登记的从事私募基金管理业务的机构数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.机构类型（私募证券投资基金管理人、私募股权投资基金管理人、创业投资基金管理人、私募资产配置类基金管理人、其他私募投资基金管理人）；

3.企业性质（内资企业、中外合资企业、中外合作企业、外商独资企业）；

4.组织形式（股份有限公司、有限责任公司、普通合伙企业、有限合伙企业、其他）；

5.控股类型（国有控股、社团集体控股、自然人及其所控制民营企业控股、外商控股、其他（控股主体性质不明或无控股主体））。

三、指标说明

私募基金管理人家数统计时不含已注销机构。

四、相关制度规则

同 FD-V-1 制度规则。

FD-V-3：私募基金管理规模

一、基本定义

私募基金管理规模指统计期末正在运作的在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人管理的备案私募基金产品管理规模。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.基金类型（私募证券投资基金、私募股权投资基金、创业投资基金、私募资产配置类基金、其他私募投资基金）；
- 2.组织形式（契约型、公司型、合伙型、其他）；
- 3.管理类型（自主管理、顾问管理）；
- 4.私募基金管理人。

三、指标说明

私募基金管理规模按相关基金期末净资产统计。如相关基金新设立且尚未申报期末净资产，按募集资金规模统计。

四、相关制度规则

同 FD-V-1 制度规则。

FD-VI：不动产投资信托基金

FD-VI-1：不动产投资信托基金只数

一、基本定义

不动产投资信托基金（REITs）只数指统计期末在境内证券交易所上市的不动产投资信托基金只数。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：只

（三）常用维度：

1.资产类型；

2.境内证券交易所。

三、相关制度规则

《关于修改<公开募集基础设施证券投资基金指引>第五十条的决定》（证监会公告〔2023〕55号）。

FD-VI-2：不动产投资信托基金募集金额

一、基本定义

不动产投资信托基金（REITs）募集金额指统计期内基金管理人在境内证券交易所通过发售不动产投资信托基金份额筹集的资金总额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.资产类型；

2.境内证券交易所。

FD-VI-3：不动产投资信托基金市值

一、基本定义

不动产投资信托基金（REITs）市值指统计期末在境内证券交易所上市的不动产投资信托基金市值合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.资产类型；

2.境内证券交易所。

三、指标种类

（一）不动产投资信托基金（REITs）总市值

不动产投资信托基金（REITs）总市值指根据不动产投资信托基金（REITs）价格与其场内份额数量计算出的基金价值合计。

（二）不动产投资信托基金（REITs）流通市值

不动产投资信托基金（REITs）流通市值指根据不动产投资信托基金（REITs）价格与其场内流通份额计算出的基金价值合计。

四、指标说明

（一）如当日无交易价格，该基金产品市值采用最后 1 个交易日的收盘价计算。

（二）在注明的情况下，可按包含场外份额的口径统计 REITs 市值。其中，场外份额按 REITs 的场内价格计价。

FD-VI-4：不动产投资信托基金成交规模

一、基本定义

不动产投资信托基金（REITs）成交规模指统计期内在境内证券交易所上市的不动产投资信托基金成交金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.资产类型；

2.境内证券交易所。

FD-VI-5：不动产投资信托基金分红金额

一、基本定义

不动产投资信托基金（REITs）分红金额指统计期内不动产投资信托基金向份额持有人分派现金红利的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.资产类型;
- 2.境内证券交易所。

期货市场

FS-I：市场规模

FS-I-1：保证金

一、基本定义

保证金指统计期末期货交易者及期货经营机构按照规定标准缴纳用于结算和履约保障的现金或者提交的国债、股票、基金份额、标准仓单等流动性强的有价证券。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.期货品种；
- 3.合约类别；
- 4.交易者类型。

三、指标种类

按照保证金的不同类别划分，主要有以下五种保证金指标：

（一）交易保证金

交易保证金指统计期末已被合约占用的保证金。计算公式为：

$$TM=CV\times MR$$

其中：

TM—交易保证金

CV—合约价值

MR—期货交易所规定的交易保证金比率

（二）结算准备金

结算准备金指当日结算准备金余额，即统计期末未被合约占用的保证金。计算公式为：

$$SM=MB$$

其中：

SM—结算准备金

MB—当日结算准备金余额

（三）交易所保证金总额

交易所保证金总额指统计期末期货会员机构按规定向交易所缴纳用于结算和保证履约的现金或者提交的国债、股票、基金份额、标准仓单等流动性强的有价证券折算后的价值总额。计算公式为：

$$M=TM+SM$$

其中：

M—交易所保证金总额

TM—交易保证金

SM—结算准备金

（四）追加保证金

追加保证金指统计期末结算完毕后，有结算资格的会员的结算准备金余额低于最低余额标准时需追加的保证金金额。计算公式为：

$$MC = \begin{cases} 0 & MB \geq MM \\ MM - MB & MB < MM \end{cases}$$

其中：

MC—追加保证金

MM—期货交易所规定的结算准备金的最低余额

MB—当日结算准备金余额

（五）期货市场资金总量（TF）指所有参与者在市场中投入的资金总额，是广义的期货保证金总额。计算公式为：

$$TF=M+B$$

其中：

TF—期货市场资金总量

M—交易所保证金总额

B—期货公司保证金专用账户余额

四、指标说明

（一）合约价值

商品期货合约价值=结算价×交易单位×期货合约数量

股指期货合约价值=结算价×合约乘数×期货合约数量

国债期货合约价值=结算价×合约面值/100 元×期货合约数量

其中，商品期货合约交易单位，股指期货合约乘数参见期货交易所期货合约的规定。

（二）交易保证金比率

期货交易所风险管理实行保证金制度，交易所设定最低交易保证金比率并可根据市场情况调整各合约交易保证金标准。

（三）当日结算准备金余额

期货交易所实行当日无负债结算制度，在每日交易结束后，交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金及手续费等费用，计算当日结算准备金余额，对应收应付的款项实行净额一次划转，相应增加或减少有结算资格的会员的结算准备金。

当日结算准备金余额=上一交易日结算准备金余额+上一交易日交易保证金－当日交易保证金+当日资产作为保证金的实际可用金额－上一交易日资产作为保证金的实际可用金额+当日盈亏+权利金收入－权利金支出+入金－出金－手续费等

五、相关制度规则

（一）《期货公司保证金封闭管理办法》（证监会公告〔2022〕43号）；

（二）《上海期货交易所结算管理办法》；

（三）《上海期货交易所风险控制管理办法》；

（四）《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》；

（五）《郑州商品交易所期货结算管理办法》；

（六）《大连商品交易所结算管理办法》；

（七）《大连商品交易所风险管理办法》；

（八）《中国金融期货交易所风险控制管理办法》；

（九）《中国金融期货交易所结算细则》；

- (十) 《广州期货交易所风险管理办法》；
- (十一) 《广州期货交易所结算管理办法》；
- (十二) 《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》；
- (十三) 《上海国际能源交易中心结算细则》。

FS-I-2：期货会员机构数

一、基本定义

期货会员机构数指统计期末经期货交易所审核批准，在交易所进行期货经纪、结算和交易的中华人民共和国境内登记注册的企业法人和其他经济组织的数量。

二、统计属性

- (一) 基本频度：月
- (二) 基本计量单位：家
- (三) 常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

(一) 商品期货交易所的会员包括期货公司会员和非期货公司会员。

(二) 中国金融期货交易所的会员包括交易结算会员、全面结算会员、特别结算会员和交易会员。

四、相关制度规则

- (一) 《上海期货交易所会员管理办法》；
- (二) 《郑州商品交易所会员管理办法》；
- (三) 《大连商品交易所会员管理办法》；
- (四) 《中国金融期货交易所会员管理办法》；
- (五) 《广州期货交易所会员管理办法》；
- (六) 《上海国际能源交易中心会员管理细则》。

FS-I-3：期货账户数

一、基本定义

期货账户数指统计期末已通过中国期货市场监控中心有限责任公司（以下简称中国期货监控）开立交易编码的期货公司内部资金账户数量合计，不包含已注销全部交易编码的内部资金账户。

二、统计属性

- (一) 基本频度：日
- (二) 基本计量单位：户
- (三) 常用维度：
 - 1.期货交易所；
 - 2.期货公司；
 - 3.客户类型（个人、一般单位、特殊单位）；
 - 4.客户地域（境内、境外）。

三、指标种类

- (一) 新开账户数

新开账户数指统计期内新开期货公司内部资金账户数量。

（二）有效账户数

有效账户数指统计期末期货公司内部资金账户中剔除休眠账户和逾期未规范账户后的账户数量。

（三）单位客户账户数

单位客户账户数指统计期末期货公司的一般单位及特殊单位客户内部资金账户数量。

四、指标说明

（一）休眠账户指截至统计期末（休眠认定日）满足以下四个条件的账户：一是开户时间一年以上；二是最近一年以上无持仓；三是最近一年以上无交易（含一年）；四是认定日的客户权益在 1000 元以下（含 1000 元）。其中，客户权益以期货公司内部资金账户为单位进行认定。

（二）逾期未规范账户指在账户规范工作规定的时间内，资料未上报中国期货监控，未通过中国期货监控和期货交易所检查或反馈未成功的历史账户。

五、相关制度规则

《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2022〕43 号）。

FS-I-4：期货客户数

一、基本定义

期货客户数指统计期末期货客户数量合计，按统一开户编码数

量统计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：个

（三）常用维度：

1.期货交易所；

2.期货公司；

3.客户类型（个人、一般单位、特殊单位）；

4.客户地域（境内、境外）。

三、指标种类

（一）新开期货客户数

新开期货客户数指统计期内首次开立期货账户的期货客户数量。

（二）有效期货客户数

有效期货客户数指统计期末剔除休眠客户和逾期未规范客户后的期货客户数量。

（三）单位期货客户数

单位期货客户数指统计期末客户类型为一般单位及特殊单位的客户数量。

四、指标说明

（一）休眠期货客户指在期货市场开立的全部内部资金账户均为休眠账户的客户。

（二）逾期未规范期货客户指在期货市场开立的全部内部资金账户均为逾期未规范账户的客户。

五、相关制度规则

（一）《期货公司监督管理办法》（证监会令第155号）；

（二）《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2022〕43号）。

FS-II：期货交易

FS-II-1：涨跌幅

一、基本定义

涨跌幅指统计期内期货合约的结算价（收盘价）与前结算价（前收盘价）的变动幅度。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.期货品种；

2.合约类别。

三、指标种类

（一）涨跌幅（结算价）

$$CHG_1 = \frac{S_t - S_{t-1}}{S_{t-1}} \times 100\%$$

其中：

CHG₁—涨跌幅（结算价）

S_t—区间最后交易日结算价

S_{t-1}—区间前一交易日结算价

（二）涨跌幅（收盘价/结算价）

$$\text{CHG}_2 = \frac{P_t - S_{t-1}}{S_{t-1}} \times 100\%$$

其中：

CHG₂—涨跌幅（收盘价/结算价）

P_t—区间最后交易日收盘价

S_{t-1}—区间前一交易日结算价

（三）涨跌幅（收盘价）

$$\text{CHG}_3 = \frac{P_t - P_{t-1}}{P_{t-1}} \times 100\%$$

其中：

CHG₃—涨跌幅（收盘价）

P_t—区间最后交易日收盘价

P_{t-1}—区间前一交易日收盘价

四、指标说明

（一）合约收盘价和结算价的定义见各期货交易所有关规则。

（二）涨跌幅应根据各期货交易所交易规则确定具体计算方式，并加以注明。

（三）期货交易品种的涨跌幅以其对应的主力合约进行计算，

即通过主力合约的涨跌幅反映期货品种的价格变动幅度。

（四）主力合约为统计期末各期货合约中持仓量最大的合约，如持仓量相同则选取成交量最大合约为主力合约，如持仓量和成交量均相同或统计期末该品种的所有合约均无成交和持仓，则选用与统计期末最近的合约为主力合约。

（五）若统计期包括主力合约挂牌日，则区间前一交易日结算价（收盘价）取合约挂牌价。

五、相关制度规则

- （一）《上海期货交易所交易管理办法》；
- （二）《上海期货交易所结算管理办法》；
- （三）《郑州商品交易所期货交易管理办法》；
- （四）《郑州商品交易所期货结算管理办法》；
- （五）《大连商品交易所交易管理办法》；
- （六）《大连商品交易所结算管理办法》；
- （七）《中国金融期货交易所交易规则》；
- （八）《中国金融期货交易所结算细则》；
- （九）《广州期货交易所交易管理办法》；
- （十）《广州期货交易所结算管理办法》；
- （十一）《上海国际能源交易中心交易规则》；
- （十二）《上海国际能源交易中心结算细则》。

FS-II-2：振幅

一、基本定义

振幅指统计期内期货合约价格的波动程度，采用区间内最大价差与基准价格的相对变动幅度来计算。根据基准价格的不同，分为振幅（最低价）、振幅（前结算价）和振幅（前收盘价）。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.期货品种；

2.合约类别。

三、指标种类

（一）振幅（最低价）

$$APT_1 = \frac{HP - LP}{LP} \times 100\%$$

其中：

APT₁—振幅（最低价）

HP—区间内合约最高价

LP—区间内合约最低价

（二）振幅（前结算价）

$$APT_2 = \frac{HP - LP}{S_{t-1}} \times 100\%$$

其中：

APT₂—振幅（前结算价）

HP—区间内合约最高价

LP—区间内合约最低价

S_{t-1}—区间前一交易日合约结算价

(三) 振幅 (前收盘价)

$$APT_3 = \frac{HP - LP}{P_{t-1}} \times 100\%$$

其中:

APT₃—振幅 (前收盘价)

HP—区间内合约最高价

LP—区间内合约最低价

P_{t-1}—区间前一交易日收盘价

四、指标说明

(一) 期货交易品种的振幅以其对应的主力合约进行计算, 即通过主力合约的振幅反映期货品种的价格波动程度。

(二) 若统计期包括主力合约挂牌日, 则区间前一交易日结算价 (收盘价) 取合约挂牌价。

(三) 主力合约的选取原则参见 FS-II-1 指标说明。

五、相关制度规则

同 FS-II-1 制度规则。

FS-II-3: 成交量

一、基本定义

成交量指统计期内期货合约按单边计算的成交数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：手

（三）常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.期货品种；
- 3.合约类别；
- 4.监管辖区，行政区划；
- 5.交易者类型。

三、指标说明

（一）期货品种的成交量为统计期内该品种全部期货合约的单边成交量合计。

（二）合约类别的成交量为统计期内该合约类别的单边成交量合计。

（三）期货交易所的成交量为统计期内该期货交易所所有品种的单边成交量合计。

（四）监管辖区、行政区划的交易量分别为统计期内按证券期货经营机构营业部所归属监管辖区、行政区划的买入量和卖出量的合计。

（五）按交易者类型统计的交易量为统计期内该交易者类型买入量和卖出量的合计。

四、相关制度规则

- (一) 《上海期货交易所交易管理办法》；
- (二) 《郑州商品交易所期货交易管理办法》；
- (三) 《大连商品交易所交易管理办法》；
- (四) 《中国金融期货交易所交易规则》；
- (五) 《广州期货交易所交易管理办法》；
- (六) 《上海国际能源交易中心交易规则》。

FS-II-4：成交金额

一、基本定义

成交金额指统计期内期货合约按单边计算的成交金额合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度：日
- (二) 基本计量单位：元
- (三) 常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.期货品种；
- 3.合约类别；
- 4.监管辖区，行政区划；
- 5.交易者类型。

三、指标说明

(一) 期货品种的成交金额为统计期内该品种全部期货合约的单边成交金额合计。

（二）合约类别的成交金额为统计期内该合约类别的单边成交金额合计。

（三）期货交易所的成交金额为统计期内该期货交易所所有品种的单边成交金额合计。

（四）监管辖区、行政区划的交易金额分别为统计期内按证券期货经营机构营业部所归属监管辖区、行政区划的买入金额和卖出金额的合计。

（五）按交易者类型统计的交易金额为统计期内该交易者类型买入金额和卖出金额的合计。

四、相关制度规则

同 FS-II-3 制度规则。

FS-II-5：持仓量

一、基本定义

持仓量指统计期末未平仓期货合约按单边（多头或空头）计算的数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：手

（三）常用维度：

1.期货交易所；

2.期货品种；

- 3.合约类别;
- 4.持仓方向（多仓、空仓）;
- 5.交易者类型。

三、指标说明

（一）未平仓合约指交易者持有的，并未因合约到期、完成商品交割、现金交割或以反向操作等原因而结束合约责任的期货合约。

（二）期货品种的持仓量为统计期末该品种所有期货合约的单边持仓量合计值。

（三）合约类别的持仓量为统计期末该合约类别的单边持仓量合计值。

（四）期货交易所的持仓量为统计期末该期货交易所全部期货品种的单边持仓量合计值。

（五）按交易者类型统计的持仓量为统计期内该交易者类型多头持仓和空头持仓的合计。

四、相关制度规则

同 FS-II-3 制度规则。

FS-II-6：持仓金额

一、基本定义

持仓金额指统计期末未平仓期货合约的金额合计。计算公式为：

$$VOI=OI_t \times TU_t \times S_t$$

其中：

VOI—持仓金额

OI_t—T 日该期货合约持仓量

TU_t—T 日该期货合约交易单位或合约乘数

S_t—T 日该期货合约结算价格

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.期货品种；
- 3.合约类别；
- 4.持仓方向（多仓、空仓）；
- 5.交易者类型。

三、指标说明

(一) 某一期货品种的持仓金额为统计期末该品种所有期货合约的单边持仓金额合计值： $VOI = \sum_i^n OI_{i,t} \times TU_{i,t} \times S_{i,t}$ 。

其中：

VOI—持仓金额

OI_{i,t}—T 日第 i 只期货合约持仓量

TU_{i,t}—T 日第 i 只期货合约交易单位或合约乘数

S_{i,t}—T 日第 i 只期货合约结算价格

i—第 i 只期货合约

（二）合约类别的持仓金额为统计期末该合约类别的单边持仓金额合计。

（三）期货交易所的持仓金额为统计期末该期货交易所全部期货品种的单边持仓金额合计。

（四）商品期货合约统计采用历史期货交易发生时的交易单位，股指期货、国债期货合约统计采用历史期货交易发生时的合约乘数。

（五）按交易者类型统计的持仓金额为统计期内该交易者类型多头持仓金额和空头持仓金额的合计。

四、相关制度规则

同 FS-II-3 制度规则。

FS-II-7：基差

一、基本定义

基差指统计期末期货标的现货价格与该期货合约价格的差值。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元、点

（三）常用维度：期货品种。

三、指标种类

（一）基差（主力合约价格）

基差（主力合约价格）指现货价格减去期货主力合约价格。

基差（主力合约价格）= 现货价格 - 期货主力合约价格。

（二）基差（最近交割月的合约价格）

基差（最近交割月的合约价格）指现货价格减去期货最近交割月合约价格。

基差（最近交割月的合约价格）= 现货价格 - 最近交割月合约价格。

四、指标说明

（一）期货合约价格一般按结算价统计，也可在注明的情况下按收盘价和实时成交价统计。

（二）股指期货合约对应的现货价格为现货标的的指数点位。

（三）国债期货合约对应的现货价格通常采用国债期货主力合约对应的最便宜可交割券（CTD 券）的中债估值。期货合约价格通常采用当日结算价，并考虑转换因子，具体为：国债期货基差=现货价格-国债期货合约价格×转换因子，转换因子的计算参见中金所发布的国债期货转换因子和应计利息计算公式的相关通知。

（四）期货对应的现货价格选取需综合考虑数据可获得性、市场认同度、数据发布机构的权威性及数据更新的频率等。

（五）基差为正表示期货合约贴水，贴水率=（现货价格-期货价格）÷现货价格。基差为负表示期货合约升水，升水率=〔（现货价格-期货价格）的绝对值〕÷现货价格。

五、相关制度规则

同 FS-II-1 制度规则。

FS-II-8：交割量

一、基本定义

交割量指期货客户了结到期未平仓合约的数量。

二、统计属性

- （一）基本频度：月
- （二）基本计量单位：手
- （三）常用维度：期货品种。

三、指标说明

期货品种交割量为统计期内该品种全部期货合约交割量合计。

四、相关制度规则

- （一）《上海期货交易所交割细则》；
- （二）《郑州商品交易所期货交割管理办法》；
- （三）《大连商品交易所交割管理办法》；
- （四）《广州期货交易所交割管理办法》；
- （五）《上海国际能源交易中心交割细则》；
- （六）《中国金融期货交易所结算细则》。

FS-II-9：交割率

一、基本定义

交割率指统计期内期货品种交割量与总成交量的比例。计算公式为：

$$\text{交割率} = \frac{\text{统计期内交割量}}{\text{统计期内总成交量}} \times 100\%$$

二、统计属性

- （一）基本频度：月
- （二）基本计量单位：%
- （三）常用维度：期货品种。

三、相关制度规则

同 FS-II-8 制度规则。

FS-II-10：杠杆率

一、基本定义

杠杆率指统计期末持仓金额与对应期货合约交易保证金的比率。计算公式为：

$$LR = \frac{VOI}{TM} \times 100\%$$

其中：

LR—杠杆率

VOI—持仓金额

TM—交易保证金

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.期货品种；
- 3.合约类别。

三、指标说明

一组合约的杠杆率应按总体法计算，计算公式为：

$$LR = \frac{\sum_i^n VOI_i}{\sum_i^n TM_i} \times 100\%$$

其中：

LR—杠杆率

n—期货合约只数

VOI_i—第 i 只期货合约的持仓金额

TM_i—第 i 只期货合约的交易保证金

四、相关制度规则

- （一）《上海期货交易所结算管理办法》；
- （二）《上海期货交易所风险控制管理办法》；
- （三）《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》；
- （四）《郑州商品交易所期货结算管理办法》；
- （五）《大连商品交易所结算管理办法》；
- （六）《大连商品交易所风险管理办法》；
- （七）《中国金融期货交易所风险控制管理办法》；

- (八) 《中国金融期货交易所结算细则》;
- (九) 《广州期货交易所风险管理办法》;
- (十) 《广州期货交易所结算管理办法》;
- (十一) 《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》;
- (十二) 《上海国际能源交易中心结算细则》。

FS-II-11: 单位客户持仓占比

一、基本定义

单位客户持仓占比指统计期末单位客户账户持仓占期货市场总持仓的比例。

二、统计属性

(一) 指标频度: 日

(二) 计量单位: %

(三) 常用维度:

- 1.期货交易所;
- 2.期货品种;
- 3.合约类别;
- 4.持仓方向(多仓、空仓)。

三、指标种类

按照单位客户持仓分类不同,主要有以下四种指标:

(一) 单位客户持多(空)仓量占比

单位客户持多(空)仓量占比指统计期末单位客户账户持多(空)

仓占期货市场多（空）仓的比例。

（二）单位客户持多（空）仓金额占比

单位客户持多（空）仓金额占比指统计期末单位客户账户持多（空）仓金额占期货市场多（空）仓金额的比例。

（三）单位客户日均持多（空）仓量占比

单位客户日均持多（空）仓量占比指统计期内单位客户账户日均持多（空）仓量占期货市场日均多（空）仓量的比例。

（四）单位客户日均持多（空）仓金额占比

单位客户日均持多（空）仓金额占比指统计期内单位客户账户日均持多（空）仓金额占期货市场日均多（空）仓金额的比例。

四、相关制度规则

（一）《期货交易管理条例》（国务院令第 676 号）；

（二）《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2022〕43 号）。

FS-III：期货期权

FS-III-1：期权保证金

一、基本定义

期权保证金指统计期末，期权卖方按照规定标准缴纳用于结算和履约保障的资金。计算公式为：

期权保证金=期权合约结算价×标的期货合约交易单位
+max [（标的期货合约交易保证金－期权合约虚值额÷2），

标的期货合约交易保证金÷2]

二、统计属性

- (一) 基本频度：日
- (二) 基本计量单位：元
- (三) 常用维度：期权品种。

三、指标说明

期权交易中，期权买方不需要缴纳保证金。

四、相关制度规则

- (一) 《上海期货交易所期权交易管理办法》；
- (二) 《上海期货交易所风险控制管理办法》；
- (三) 《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》；
- (四) 《郑州商品交易所期权交易管理办法》；
- (五) 《大连商品交易所期权交易管理办法》；
- (六) 《大连商品交易所风险管理办法》；
- (七) 《广州期货交易所风险管理办法》；
- (八) 《广州期货交易所交易管理办法》；
- (九) 《上海国际能源交易中心期权交易管理细则》；
- (十) 《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》。

FS-III-2：期权成交量

一、基本定义

期权成交量指统计期内全部期权合约按单边计算的成交数量的

合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：手

（三）常用维度：

1.期货交易所；

2.期权品种；

3.合约系列；

4.合约类型（看涨期权合约、看跌期权合约）；

5.交易者类型。

三、指标说明

（一）合约系列按期权合约对应的期货合约进行统计，下同。

（二）按交易者类型统计的交易量为统计期内该交易者类型买入量和卖出量的合计。

四、相关制度规则

（一）《上海期货交易所期权交易管理办法》；

（二）《上海期货交易所风险控制管理办法》；

（三）《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》；

（四）《郑州商品交易所期权交易管理办法》；

（五）《大连商品交易所期权交易管理办法》；

（六）《大连商品交易所风险管理办法》；

（七）《中国金融期货交易所股指期货期权合约交易细则》；

- （八）《中国金融期货交易所风险控制管理办法》；
- （九）《广州期货交易所风险管理办法》；
- （十）《上海国际能源交易中心期权交易管理细则》；
- （十一）《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》。

FS-III-3：期权成交金额

一、基本定义

期权成交金额指统计期内全部期权合约成交价格与其成交数量按单边计算的成交金额合计。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：

- 1.期货交易所；
- 2.期权品种；
- 3.合约系列；
- 4.合约类型（看涨期权合约、看跌期权合约）；
- 5.交易者类型。

三、指标说明

按交易者类型统计的交易金额为统计期内该交易者类型买入金额和卖出金额的合计。

四、相关制度规则

同 FS-III-2 制度规则。

FS-III-4：期权持仓量

一、基本定义

期权持仓量指统计期末按单边（多头或空头）统计的未了结期权合约头寸的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：手

（三）常用维度：

1.期货交易所；

2.期权品种；

3.合约系列；

4.合约类型（看涨期权合约、看跌期权合约）；

5.交易者类型。

三、指标说明

（一）期权合约了结方式包括平仓、行权和自动到期。

（二）期权品种的持仓量为统计期末该品种所有期权合约的单边持仓量合计值。

（三）期权市场的持仓量为统计期末全部期权品种的单边持仓量合计值。

（四）按交易者类型统计的持仓量为统计期内该交易者类型空

头持仓和多头持仓的合计。

四、相关制度规则

同 FS-III-2 制度规则。

经营机构

PI-I：机构规模

PI-I-1：证券公司家数

一、基本定义

证券公司家数指统计期末获得中国证监会颁发经营证券期货业务许可证的证券公司数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.分类结果。

三、指标说明

证券公司家数自获得经营证券期货业务许可证起纳入统计，自办理机构注销起从统计中剔除。

四、相关制度规则

《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2020〕42号）。

PI-I-2：证券公司分支机构数量

一、基本定义

证券公司分支机构数量指统计期末获得中国证监会颁发经营证券期货业务许可证的证券公司分支机构（含分公司、营业部）数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.分类结果；
- 3.证券公司；
- 4.分支机构类别（分公司、营业部）。

三、相关制度规则

《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2020〕42号）。

PI-I-3：公募基金管理人人数

一、基本定义

公募基金管理人人数指统计期末获得中国证监会颁发经营证券期货业务许可证的公募基金管理机构数量合计，包括经中国证监会批准设立的公募基金管理公司以及获批公募基金管理资格的其他资产管理机构。

二、统计属性

（一）基本频度：月

(二) 基本计量单位：家

(三) 常用维度：监管辖区，行政区划。

三、指标种类

按照不同机构类型，目前公募基金管理人人数主要有以下三种指标：

(一) 基金管理公司家数

基金管理公司家数指统计期末获得中国证监会颁发经营证券期货业务许可证的基金管理公司的数量合计。

(二) 证券公司及其资产管理子公司家数

证券公司及其资产管理子公司家数指统计期末经中国证监会批准获得公募基金管理资格的证券公司及其资产管理子公司的数量合计。

(三) 保险资产管理公司家数

保险资产管理公司家数指统计期末经中国证监会批准获得公募基金管理资格的保险资产管理公司的数量合计。

PI-I-4: 期货公司家数

一、基本定义

期货公司家数指统计期末获得中国证监会颁发经营证券期货业务许可证的期货公司数量合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.分类结果。

三、相关制度规则

《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2022〕43号）。

PI-I-5：期货公司分支机构家数

一、基本定义

期货公司分支机构家数指统计期末在期货公司住所地经中国证监会派出机构备案，由期货公司申请依法设立的分支机构数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.分类结果；
- 3.期货公司；
- 4.分支机构类别（分公司、营业部）。

三、相关制度规则

《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2022〕43号）。

PI-I-6: 基金管理公司子公司家数

一、基本定义

基金管理公司子公司家数指统计期末经中国证监会批准，基金管理公司在境内依法设立的从事资产管理业务及其相关业务的基金管理公司子公司数量合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度： 月
- (二) 基本计量单位： 家
- (三) 常用维度：
 - 1.监管辖区，行政区划；
 - 2.分类结果；
 - 3.基金管理公司。

PI-I-7: 证券公司子公司家数

一、基本定义

证券公司子公司家数指统计期末经中国证监会批准，依法设立的从事证券业务的证券公司子公司数量合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度： 月
- (二) 基本计量单位： 家
- (三) 常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.分类结果；
- 3.证券公司。

三、相关制度规则

《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2020〕42号）。

PI-II：机构财务

PI-II-1：总资产

一、基本定义

总资产指统计期末证券期货经营机构全部资产总额合计。

二、统计属性

- （一）基本频度：月
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

三、指标说明

- （一）统计时应注明证券期货经营机构的具体统计范围，下同。
- （二）证券公司和期货公司总资产一般包括客户资金，基金管理公司总资产不含客户资金。
- （三）总资产和本指引中其他机构财务数据来自各机构的财务报表，具体计算标准参见《证券公司年度报告内容与格式准则》（证

监会公告〔2013〕41号）等。

PI-II-2: 净资产

一、基本定义

净资产指统计期末证券期货经营机构净资产合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

PI-II-3: 平均财务杠杆

一、基本定义

平均财务杠杆指统计期末证券期货经营机构总资产与净资产的比率。计算公式为：

平均财务杠杆 = 总资产/净资产

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：倍

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

PI-II-4: 营业收入

一、基本定义

营业收入指统计期内证券期货经营机构营业收入金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

PI-II-5: 营业支出

一、基本定义

营业支出指统计期内证券期货经营机构营业支出金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

PI-II-6: 利润总额

一、基本定义

利润总额指统计期内证券期货经营机构利润总额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

PI-II-7: 净利润

一、基本定义

净利润指统计期内证券期货经营机构净利润的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司等）。

PI-II-8: 从事证券服务业务会计师事务所营业收入

一、基本定义

从事证券服务业务会计师事务所营业收入指统计期内从事证券服务业务的会计师事务所营业收入合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度：年
- (二) 基本计量单位：元
- (三) 常用维度：监管辖区，行政区划。

PI-II-9：会计师事务所证券服务业务收入

一、基本定义

会计师事务所证券服务业务收入指统计期内会计师事务所证券服务业务收入合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度：年
- (二) 基本计量单位：元
- (三) 常用维度：监管辖区，行政区划。

PI-II-10：从事证券服务业务资产评估机构营业收入

一、基本定义

从事证券服务业务资产评估机构营业收入指统计期内从事证券服务业务的资产评估机构营业收入合计。

二、统计属性

- (一) 基本频度：年

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：监管辖区，行政区划。

PI-II-11: 资产评估机构证券服务业务收入

一、基本定义

资产评估机构证券服务业务收入指统计期内资产评估机构证券服务业务收入合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：年

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：监管辖区，行政区划。

PI-III: 风险控制

PI-III-1: 净资本总额

一、基本定义

净资本总额指统计期末证券公司、期货公司和基金管理公司子公司净资本金额合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：月

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

1. 监管辖区；

2.机构类型（证券公司、期货公司、基金管理公司子公司等）；

3.分类结果。

三、指标说明

（一）基金管理公司子公司指从事特定客户资产管理业务的子公司。

（二）证券公司净资本的计算参见《证券公司风险控制指标计算标准规定》（证监会公告〔2024〕13号）和相关规定；期货公司净资本的计算参见《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令第202号）和相关规定；基金管理公司子公司净资本的计算参见《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标管理暂行规定》（证监会公告〔2016〕30号）和相关规定。

PI-III-2：风险资本准备总额

一、基本定义

风险资本准备总额指统计期末全部证券公司、期货公司和基金管理公司子公司风险资本准备合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.机构类型（证券公司、期货公司、基金管理公司子公司等）；

3.分类结果。

三、指标分类

按照不同机构类型，风险资本准备总额主要有以下三种指标：

（一）证券公司风险资本准备总额

证券公司风险资本准备总额指统计期末全部证券公司风险资本准备的合计。

（二）期货公司风险资本准备总额

期货公司风险资本准备总额指统计期末全部期货公司风险资本准备的合计。

（三）基金管理公司子公司风险资本准备总额

基金管理公司子公司风险资本准备总额指统计期末全部基金管理公司子公司风险资本准备的合计。

四、指标说明

单家证券公司、期货公司和基金管理公司子公司的风险资本准备按各证券公司、期货公司和基金管理公司子公司风险资本准备计算表中的“各项风险资本准备之和”统计。

五、相关制度规则

（一）《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令第202号）；

（二）《证券公司风险控制指标计算标准规定》（证监会公告〔2024〕13号）；

（三）《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标

管理暂行规定》（证监会公告〔2016〕30号）。

PI-III-3: 机构风险覆盖率

一、基本定义

机构风险覆盖率指统计期末证券公司、期货公司、基金管理公司子公司净资本总额与各项风险资本准备总额的比率。

机构风险覆盖率=（净资本总额÷各项风险资本准备总额）
×100%

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.机构类型（证券公司、期货公司、基金管理公司子公司等）；
- 3.分类结果。

三、相关制度规则

同 PI-II-2 制度规则。

PI-III-4: 证券公司资本杠杆率

一、基本定义

证券公司资本杠杆率指统计期末证券公司核心净资本与表内外资产总额的比率。

资本杠杆率=（核心净资本÷表内外资产总额）×100%

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.分类结果。

三、指标说明

在计算证券公司资本杠杆率时，核心净资本不扣除担保等或有负债的风险调整。

四、相关制度规则

《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第166号）。

PI-III-5：证券公司流动性覆盖率

一、基本定义

证券公司流动性覆盖率指统计期末证券公司优质流动性资产与未来30天现金净流出量的比率。计算公式为：

证券公司流动性覆盖率=（优质流动性资产÷未来30天现金净流出量）×100%

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.分类结果。

三、相关制度规则

《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第166号）。

PI-III-6：证券公司净稳定资金率

一、基本定义

证券公司净稳定资金率指统计期末证券公司可用稳定资金与所需稳定资金的比率。

证券公司净稳定资金率=（可用稳定资金÷所需稳定资金）
×100%

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.监管辖区，行政区划；
- 2.分类结果。

三、相关制度规则

《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第166号）。

PI-IV：机构业务

PI-IV-1：客户托管资产总额

一、基本定义

客户托管资产总额指统计期末在证券经纪业务中，客户托管市值与客户交易结算资金总额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.监管辖区、行政区划；
- 2.证券公司；
- 3.投资者类型。

三、指标说明

（一）客户托管市值指投资者委托证券公司保管的证券市值，不包括证券公司出租交易单元上的证券市值。

（二）客户交易结算资金包括客户保证足额交收而存入的资金，出售有价证券所得到的所有款项（减去经纪佣金和其他正当费用），持有证券所获得的股息、现金股利、债券利息，上述资金获得的利息，以及中国证监会认定的其他资金。

PI-IV-2：代理买卖证券总额

一、基本定义

代理买卖证券总额指统计期内证券公司代理投资者进行证券

买卖的金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.监管辖区、行政区划；
- 2.证券公司；
- 3.投资者类型；
- 4.证券品种（股票、基金、债券、期权等）。

三、指标说明

代理买卖证券总额包含证券公司出租交易单元上所发生的证券买卖金额。

PI-IV-3：证券期货经营机构资产管理业务规模

一、基本定义

证券期货经营机构资产管理业务规模指统计期末证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司和期货公司及其子公司提供专业资产管理服务的资产金额合计，一般按公允价值计算。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.监管辖区、行政区划；
- 2.机构类型（证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理公司子公司、期货公司、期货公司子公司）；
- 3.产品属性（公募资管、私募资管）。

三、指标说明

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》对证券基金机构私募资产管理业务范围的有关规定，证券基金机构的资产管理业务规模统计不含资产支持专项计划。

PI-IV-4：期货公司客户权益总额

一、基本定义

期货公司客户权益总额指统计期末由期货公司代理进行期货交易的客户资产总额的合计，包括被合约占用的保证金以及未被合约占用的可用资金。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：元
- （三）常用维度：
 - 1.监管辖区，行政区划；
 - 2.分类结果；
 - 3.期货公司。

PI-IV-5: 客户交易结算资金余额

一、基本定义

客户交易结算资金余额指证券市场交易结算资金监控系统获取的通过证券公司结算的全部经纪业务客户的人民币交易结算资金余额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.监管辖区，行政区划；

2.资金账户类别（一般资金账户、信用资金账户、衍生品资金账户）；

3.证券公司；

4.投资者类型。

三、相关制度规则

《客户交易结算资金管理办法》（证监会令第184号）。

PI-IV-6: 银证转账净转入额

一、基本定义

银证转账净转入额指投资者证券资金账户从银行结算账户转入的资金净额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.资金账户类别（一般资金账户、信用资金账户、衍生品资金账户）；

2.投资者类型。

三、相关制度规则

《客户交易结算资金管理办法》（证监会令第184号）。

全国股转系统

NQ-I-1：挂牌公司家数

一、基本定义

挂牌公司家数指统计期末其股票在全国股转系统挂牌的股份有限公司的数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模（大型、中型、小型、微型等）；
- 7.主办券商；
- 8.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

挂牌公司家数可分为：

（一）挂牌公司家数

挂牌公司自挂牌首日起纳入统计，自终止挂牌日剔除。

（二）终止挂牌公司家数

终止挂牌公司按终止挂牌日统计。

四、指标说明

是否发行优先股的挂牌公司家数以优先股挂牌日进行统计。

五、相关制度规则

《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》。

NQ-I-2：挂牌公司股本

一、基本定义

挂牌公司股本也称挂牌公司总股本，指统计期末挂牌公司全部股份数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：股

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类；
- 5.股票交易方式；

6. 企业规模;

7. 主办券商。

三、指标种类

按挂牌公司股份的不同交易限制条件，挂牌公司股本分为：

（一）限售股本

限售股本指统计期末挂牌公司未解除交易限制的股份数量合计，包括挂牌公司控股股东及实际控制人直接或间接持有的未解除交易限制股票等。

（二）非限售股本

非限售股本也称流通股本，指统计期末挂牌公司已解除交易限制的股份数量合计。计算公式为：

非限售股本 = 挂牌公司总股本 - 限售股本

四、指标说明

挂牌公司股本按挂牌日统计。

五、相关制度规则

（一）《非上市公众公司信息披露内容与格式准则第 9 号——创新层挂牌公司年度报告》（证监会公告〔2020〕5 号）；

（二）《非上市公众公司信息披露内容与格式准则第 10 号——基础层挂牌公司年度报告》（证监会公告〔2020〕6 号）；

（三）《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》。

NQ-I-3：股票发行家数

一、基本定义

股票发行家数指统计期内在全国股转系统发行股票募集资金的挂牌公司数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模；
- 7.主办券商。

三、指标说明

（一）通常以新增股份挂牌日作为指标的统计日。

（二）同一家挂牌公司统计期内多次发行股票进行融资时，股票发行家数计为 1 家。

四、相关制度规则

《全国中小企业股份转让系统股票定向发行规则》。

NQ-I-4：股票发行次数

一、基本定义

股票发行次数指统计期内挂牌公司在全国股转系统发行股票筹集资金的次数。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：次

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模；
- 7.主办券商。

三、指标说明

（一）通常以新增股份挂牌日作为指标的统计日。

（二）挂牌公司分期发行情形下，每次发行新股票均纳入发行次数统计。

四、相关制度规则

同 NQ-I-3 制度规则。

NQ-I-5：股票融资金额

一、基本定义

股票融资金额指统计期内挂牌公司在全国股转系统发行股票筹集的资金总额。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模；
- 7.主办券商。

三、指标说明

通常以新增股份挂牌日作为指标的统计日。

NQ-I-6：挂牌公司股票市值

一、基本定义

挂牌公司股票市值指统计期末根据挂牌公司股票价格和总股本计算的股权价值合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模；
- 7.主办券商。

三、指标种类

按挂牌公司股票的不同交易限制条件，挂牌公司股票市值分为：

（一）挂牌公司股票市值

挂牌公司股票市值指根据股票价格与其总股本计算出的股权价值合计。

（二）挂牌公司流通市值

挂牌公司流通市值指根据股票价格与其流通股本计算出的股权价值合计。

四、指标说明

（一）股票价格通常以收盘价计算；无交易记录但有股票发行记录的，按最近一次发行价格计算。

（二）在计算挂牌公司股票市值时，既无交易成交记录又无股

票发行记录的挂牌公司股票，市值估算方法为：

1.对于净利润为正的挂牌公司股票，股票市值通常按平均市盈率估算。计算公式为：

$$CAP = \overline{PE} \times NP$$

其中：

CAP—挂牌公司股票市值

$\overline{PE}$ —以全市场有交易记录的股票为样本计算的平均市盈率（剔除净利润为负的挂牌公司股票）

NP—该类型股票归属挂牌公司母公司股东的净利润

2.对于净利润为负的挂牌公司股票，股票价格按每股面值估算。

（三）使用其他方法计算挂牌公司股票价格或股票市值的，需特别说明。

五、相关制度规则

《全国中小企业股份转让系统股票交易规则》。

NQ-I-7：全国股转系统股票账户数

一、基本定义

全国股转系统股票账户数指统计期末在中国证券登记结算公司开立的股转系统股票账户数量合计，不包含已注销账户。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：户

（三）常用维度：

1. 投资者类型；
2. 投资者开户地区。

三、指标种类

（一）新开账户数

新开账户数指统计期内新开立的股票账户数量。

（二）新销账户数

新销账户数指统计期内销户的股票账户数量。

（三）休眠账户数

休眠账户数指统计期末“证券账户余额为零、关联的资金账户余额不超过 100 元且最近连续 3 年无交易”的股票账户数量

（四）有效账户数

有效账户数指统计期末股票账户数减去休眠账户数之后的股票账户数量。

（五）参与交易股票账户数

参与交易股票账户数指统计期内参与全国股转系统股票交易并完成至少 1 次买或卖行为的有效账户数量。

（六）参与交易股票账户数占比

参与交易股票账户数占比指统计期内参与交易股票账户数占期末股票有效账户数的比例。

（七）持股账户数

持股账户数指统计期末持有股票数量不为零的账户数。

四、相关制度规则

- （一）《国务院关于全国中小企业股份转让系统有关问题的决定》（国发〔2013〕49号）；
- （二）《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》；
- （三）《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理办法》。

NQ-I-8：挂牌公司并购重组家数

一、基本定义

挂牌公司并购重组家数指统计期内实施并购重组挂牌公司的数量。

二、统计属性

- （一）基本频度：日
- （二）基本计量单位：家
- （三）常用维度：
 - 1.行业分类；
 - 2.挂牌公司分层；
 - 3.监管辖区，行政区划；
 - 4.公司控股情况分类；
 - 5.股票交易方式；
 - 6.企业规模；
 - 7.主办券商。

三、指标种类

按照并购重组类型，挂牌公司并购重组家数包含收购家数、重大资产重组家数和股份回购家数三种类型。

四、指标说明

（一）挂牌公司并购重组家数通常以收购报告书公告日、重大资产重组报告书公告日以及回购实施完成日作为指标的统计日。

（二）统计期内同一家挂牌公司出现了多种并购重组行为的计为 1 家。

（三）挂牌公司并购重组家数如不含回购，应注明挂牌公司并购重组家数（不含回购）。

五、相关制度规则

（一）《非上市公司收购管理办法》（证监会令第 166 号）；

（二）《非上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 213 号）；

（三）《全国中小企业股份转让系统非上市公司重大资产重组业务细则》。

NQ-I-9：挂牌公司并购重组金额

一、基本定义

挂牌公司并购重组金额指统计期内挂牌公司实施并购重组交易金额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.公司控股情况分类；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模；
- 7.主办券商。

三、指标种类

按照并购重组类型，挂牌公司并购重组金额包含收购金额、重大资产重组金额和股份回购金额三种类型。

四、指标说明

(一) 挂牌公司并购重组金额通常以收购报告书公告日、重大资产重组报告书公告日以及回购实施完成日作为指标的统计日。

(二) 挂牌公司并购重组金额如不含回购，应注明挂牌公司并购重组金额（不含回购）。

五、相关制度规则

同 NQ-I-8 制度规则。

NQ-I-10：挂牌公司市盈率

一、基本定义

挂牌公司市盈率指挂牌公司每股股价与每股收益的比率。通常用挂牌公司股票市值与其归属母公司股东净利润的比率进行计算。

计算公式为：

$$PE = \frac{P}{EPS} = \frac{CAP}{NP}$$

其中：

PE—市盈率

P—每股股价

EPS—每股收益

CAP—挂牌公司股票市值

NP—归属挂牌公司母公司股东的净利润

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：倍

（三）常用维度：

- 1.行业分类；
- 2.挂牌公司分层；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.监管辖区，行政区划；
- 5.股票交易方式；
- 6.企业规模（大型、中型、小型、微型等）；

三、指标种类

按照对挂牌公司股票每股收益选取的不同，市盈率主要有以下三种指标：

（一）静态市盈率

静态市盈率指统计期末挂牌公司每股股价与最新年度财务报告中披露的每股收益的比率。通常用挂牌公司股票市值与其最新年度财务报告中对应的归属母公司股东净利润的比率进行计算。

（二）滚动市盈率

滚动市盈率指统计期末挂牌公司每股股价与最近连续2个半年度产生的每股收益合计的比率。通常用挂牌公司股票市值与其最近连续2个半年度对应的归属母公司股东的净利润合计的比率进行计算。

（三）预测市盈率

预测市盈率指统计期末挂牌公司每股股价与预测每股收益的比率。其中，预测每股收益采用以下方法计算：

预测每股收益=半年财务报告中实现的每股收益×2

根据数据可采集时间最近原则选取财务报告。

四、指标说明

（一）统计时应注明使用的市盈率口径，对一组股票计算市盈率时还应注明是否剔除了净利润为负的挂牌公司股票。

（二）每股收益和净利润可在财务报告公告截止日的次日集中更新，也可公告一家更新一家，统计时应具体注明。

（三）对单只股票计算市盈率时仅考虑每股收益为正的股票。

（四）对多只股票计算平均市盈率时通常采用挂牌公司股票市值合计与其对应的归属母公司股东的净利润合计的比率进行计算（剔除无成交挂牌公司股票）。计算公式为：

$$PE = \frac{\sum_{i=1}^n CAP_i}{\sum_{i=1}^n NP_i}$$

其中：

PE—市盈率

n—股票只数

CAP_i—第 i 只挂牌公司股票市值

NP_i—第 i 只挂牌公司归属母公司股东的净利润

区域性股权市场

REM-I：市场规模

REM-I-1：区域性股权市场服务企业家数

一、基本定义

区域性股权市场服务企业家数指统计期末区域性股权市场服务的企业数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1. 企业类型（股份有限公司、有限责任公司、合伙企业等）；
2. 服务时间；
3. 运营机构。

三、相关制度规则

《区域性股权市场监督管理试行办法》（证监会令第132号）。

REM-I-2：区域性股权市场转交易所上市企业家数

一、基本定义

区域性股权市场转交易所上市企业家数指统计期内区域性股权市场转境内证券交易所上市企业数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1. 服务类型（转主板、转创业板、转科创板、转北交所）；
2. 服务时间；
3. 运营机构。

三、相关制度规则

《区域性股权市场监督管理试行办法》（证监会令第132号）。

REM-I-3：区域性股权市场转全国股转系统挂牌企业家数

一、基本定义

区域性股权市场转全国股转系统挂牌企业家数指统计期内区域性股权市场转全国股转系统挂牌企业数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：家

（三）常用维度：

1. 服务类型（转全国股转系统基础层、转全国股转系统创新层）；
2. 服务时间；
3. 运营机构。

三、相关制度规则

《区域性股权市场监督管理试行办法》（证监会令第132号）。

REM-I-4：区域性股权市场融资金额

一、基本定义

区域性股权市场融资金额指统计期内企业在区域性股权市场发生的股权融资、债券融资、质押融资、信贷对接等金额的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 行业分类；
2. 企业标签分类（专精特新小巨人、专精特新中小企业、创新型中小企业、科技型中小企业、国家高新技术企业等）；
3. 监管辖区，行政区划；
4. 企业控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 企业类型（股份有限公司、有限责任公司、合伙企业等）；
6. 融资时间；
7. 企业规模（大型、中型、小型、微型等）；
8. 运营机构。

三、指标种类

（一）区域性股权市场股权融资金额

区域性股权市场股权融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过新增股权类资产实际发生的融资金额。

（二）区域性股权市场债券融资金额

区域性股权市场债券融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过非公开发行债券实际发生的融资金额。在区域性股权市场公开发行的债券限于可转换为股票的公司债券以及国务院有关部门按程序认可的其他债券。

（三）区域性股权市场质押融资金额

区域性股权市场质押融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过将股权等资产质押给融出方并约定在未来一定期限内返还资金、解除质押实际发生的融资金额。根据质押资产类型的不同，质押融资金额可分为股权质押融资金额、知识产权质押融资金额、合伙企业份额质押融资金额、私募基金份额质押融资金额等。

1. 股权质押融资金额

股权质押融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过将股份（股票）、股权质押给融出方实际发生的融资金额。

2. 知识产权质押融资金额

知识产权质押融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过将专利权、注册商标专用权、著作权等知识产权中的财产权质押给融出方实际发生的融资金额。

3. 合伙企业份额质押融资金额

合伙企业份额质押融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过将持有的合伙企业份额质押给融出方实际发生的融资金额。

4. 私募基金份额质押融资金额

私募基金份额质押融资金额指统计期内企业在区域性股权市场通过将持有的私募基金份额质押给融出方实际发生的融资金额。

（四）区域性股权市场信贷对接金额

区域性股权市场信贷对接金额指统计期内企业通过区域性股权市场服务实际获得的信贷融资金额。

四、指标说明

股权类资产包括股份（股票）、股权、合伙企业份额等。

五、相关制度规则

（一）《国务院办公厅关于规范发展区域性股权市场的通知》（国办发〔2017〕11号）；

（二）《区域性股权市场监督管理试行办法》（证监会令第132号）。

REM-II：市场转让

REM-II-1：区域性股权市场转让金额

一、基本定义

区域性股权市场转让金额指统计期内企业在区域性股权市场转让所持有的股权、债券、合伙企业份额、私募基金份额等证监会认可的资产的实际发生金额。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1. 行业分类；
2. 企业控股情况分类（国有、民营、外资等）；
3. 交易资产类型；
4. 转让规模、转让单价；
5. 转让时间；
6. 交易形式（协议转让、单向单价、非交易过户）；
7. 企业规模（大型、中型、小型、微型等）；
8. 运营机构。

三、指标种类

根据转让资产类型的不同，转让金额可分为股份转让金额、股权转让金额、债券转让金额、合伙企业份额转让金额、基金份额转让金额等。

（一）股份转让金额

股份转让金额指统计期内股份有限公司股东在区域性股权市场转让所持有股份（股票）实际发生的金额。

（二）股权转让金额

股权转让金额指统计期内有限责任公司股东在区域性股权市场转让所持有股权实际发生的金额。

（三）债券转让金额

债券转让金额指统计期内债券持有人在区域性股权市场转让所持有债券实际发生的金额。

（四）合伙企业份额转让金额

合伙企业份额转让金额指统计期内企业合伙人在区域性股权市场转让所持有合伙企业份额实际发生的金额。

（五）私募基金份额转让金额

私募基金份额转让金额指统计期内私募基金份额持有人在区域性股权市场转让所持有私募基金份额实际发生的金额。

四、相关制度规则

（一）《国务院办公厅关于规范发展区域性股权市场的通知》（国办发〔2017〕11号）；

（二）《区域性股权市场监督管理试行办法》（证监会令第132号）。

衍生品市场

DM-I: 市场规模

DM-I-1: 名义本金

一、基本定义

名义本金指衍生品交易双方在协议中确定的合约规模。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.交易商类别（一级、二级）；
- 2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）；
- 3.标的类型（权益类、商品类、利率类、汇率类、信用类、其他类（混合类）等）；
- 4.衍生工具类型（场外期权、收益互换、远期）；
- 5.交易者类型。

三、指标种类

（一）新增（新开仓）名义本金

新增（新开仓）名义本金指统计期内新增衍生品合约的名义本金。

（二）存续（持仓）名义本金

存续（持仓）名义本金指统计期末存续衍生品合约的名义本金。

（三）实际（有效）名义本金

实际（有效）名义本金指经参与率和年化系数调整后的名义本金。其中，参与率反映实际回报与行权收益的关系，即按照一定系数获得行权收益程度；年化系数指把约定期限权益收益率转化为年化收益率的系数， $\text{年化系数} = \text{实际期限} / \text{年化天数}$ 。

四、指标说明

（一）对于商品类标的的衍生品合约，一般情况下通过约定的标的资产数量和实际建仓价格确定名义本金。对于权益、利率和汇率等金融类标的的衍生品合约，一般按衍生品交易双方在协议直接约定的名义本金规模统计。

（二）对于权益类多空收益互换业务，取多头与空头名义本金的较高值进行名义本金计算。

DM-I-2: 衍生品经营机构数量

一、基本定义

衍生品经营机构数量指统计期末经依法批准或核准开展衍生品交易业务的证券期货经营机构的数量。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：个

（三）常用维度：

1.交易商类别（一级、二级）；

2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）。

三、相关制度规则

《中华人民共和国期货和衍生品法》（中华人民共和国主席令第一一一号）。

DM-I-3: 保证金

一、基本定义

保证金指衍生品经营机构按照规定标准收取并用于保证履约和衍生品交易结算的现金、有价证券等资产。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

1.标的类型（权益类、商品类、利率类、汇率类、信用类、其他类（混合类）等）；

2.衍生工具类型（场外期权、收益互换、远期）。

三、指标种类

按照保证金的实际收取情况，主要有以下两种保证金指标：

（一）应收保证金

应收保证金指统计期末衍生品经营机构按照规定标准，应当收取并用于保证履约和衍生品交易结算的现金、有价证券等资产。

（二）实收保证金

实收保证金指统计期末衍生品经营机构在客户利用授信覆盖保证金后，实际收取并用于保证履约和衍生品交易结算的现金、有价证券等资产。

四、指标说明

有价证券用作保证金时，应按照一定的折算系数计算。

DM-I-4：市场价值

一、基本定义

市场价值指统计期末所有场外衍生品合约的市值合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.交易商类别（一级、二级）；
- 2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）；
- 3.标的类型（权益类、商品类、利率类、汇率类、信用类、其他类（混合类）等）；
- 4.产品结构类型（收益互换分为多头、空头、多空、其他；场外期权分为香草及组合、二元及组合、障碍及组合、自动赎回、区间累计、安全气囊、其他）；
- 5.衍生工具类型（场外期权、收益互换、远期）；
- 6.交易者类型。

DM-I-5：市场集中度

一、基本定义

市场集中度指头部参与者或头部标的规模占全市场总规模的比例。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.交易商（如前五名、前十名交易商集中度）；
- 2.标的（如前五名、前十名标的集中度）；
- 3.交易者（如前五名、前十名交易者集中度）。

三、指标种类

按照集中度统计的不同类型，主要有以下三种集中度指标：

（一）交易商集中度

$$CR_{n1} = \frac{\sum_{i=1}^n X_i}{T} \times 100\%$$

其中，

CR_{n1} —前 n 名交易商集中度（ $n \geq 1$ ）

X_i —第 i 个交易商的存续规模

T —所有交易商的存续规模合计

（二）标的集中度

$$CR_{n2} = \frac{\sum_{i=1}^n X_i}{T} \times 100\%$$

其中，

CR_{n2} —前 n 个标的集中度（ $n \geq 1$ ）

X_i —标的 i 的存续规模

T —所有标的的存续规模合计

（三）交易者集中度

$$CR_{n3} = \frac{\sum_{i=1}^n X_i}{T} \times 100\%$$

其中，

CR_{n3} —前 n 个交易日集中度（ $n \geq 1$ ）

X_i —交易者 i 的存续规模

T —所有交易者的存续规模合计

四、指标说明

存续规模一般采用存续名义本金（DM-I-1）统计，也可在注明的情况下采用市场价值（DM-I-4）统计。

DM-II：对冲交易

DM-II-1：对冲交易规模

一、基本定义

对冲交易规模指统计期内衍生品经营机构为对冲衍生品风险通过对冲专用账户实现的交易金额。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：

- 1.交易商类别（一级、二级）；
- 2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）；
- 3.标的类型（股票、期货、基金、债券等）。

DM-II-2: 对冲交易量

一、基本定义

对冲交易量指统计期内衍生品经营机构为对冲衍生品风险通过对冲专用账户实现的交易量。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：股、张、份、手等

(三) 常用维度：

- 1.交易商类别（一级、二级）；
- 2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）；
- 3.标的类型（股票、期货、基金、债券等）。

DM-III: 杠杆

DM-III-1: 杠杆率

一、基本定义

杠杆率指统计期末存续名义本金与保证金及缴纳期权费的比率。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.交易商类别（一级、二级）；
- 2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）；
- 3.标的类型（权益类、商品类、利率类、汇率类、信用类、其他类（混合类）等）；
- 4.产品结构类型（收益互换分为多头、空头、多空、其他；场外期权分为香草及组合、二元及组合、障碍及组合、自动赎回、区间累计、安全气囊、其他）；
- 5.衍生工具类型（场外期权、收益互换、远期）；
- 6.交易者类型。

三、指标种类

按照杠杆率统计的不同类型，主要有以下三种杠杆率指标：

（一）交易商杠杆率

$$LR = \frac{\sum_{i=1}^n N_i}{\sum_{i=1}^n M_i} \times 100\%$$

其中：

LR—交易商杠杆率

N_i ——交易商 i 的存续名义本金合计

M_i ——交易商 i 收取的保证金、期权费合计

（二）业务杠杆率

1. 场外期权杠杆率

$$LR_{op} = \frac{\sum_1^n N_{op,j}}{\sum_1^n M_{op,j}} \times 100\%$$

其中：

LR_{op} ——场外期权业务杠杆率

$N_{op,j}$ ——场外期权合约 j 的存续名义本金

$M_{op,j}$ ——场外期权合约 j 的保证金、期权费合计

2. 收益互换杠杆率

$$LR_{sw} = \frac{\sum_1^n N_{sw,j}}{\sum_1^n M_{sw,j}} \times 100\%$$

其中：

LR_{sw} ——收益互换业务杠杆率

$N_{sw,j}$ ——收益互换 j 的存续名义本金

$M_{sw,j}$ ——收益互换 j 的保证金合计

3. 远期杠杆率

$$LR_{fw} = \frac{\sum_1^n N_{fw,j}}{\sum_1^n M_{fw,j}} \times 100\%$$

其中：

LR_{fw} ——远期业务杠杆率

$N_{fw,j}$ ——远期业务 j 的存续名义本金

$M_{fw,j}$ ——远期业务 j 的保证金

(三) 交易对手方杠杆率

$$LR_c = \frac{\sum_1^n N_i}{\sum_1^n M_i} \times 100\%$$

其中：

LR_c ——交易对手方杠杆率

N_i ——交易对手方 i 的存续名义本金合计

M_i ——交易对手方 i 缴纳的保证金、期权费合计

四、指标说明

保证金与期权费按实收金额统计。

DM-III-2：个股合约端杠杆率

一、基本定义

个股合约端杠杆率指统计期末个股衍生品存续名义本金与相应保证金及缴纳期权费的比率。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：%

(三) 常用维度：

- 1.交易商类别（一级、二级）；
- 2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）；
- 3.产品结构类型（收益互换分为多头、空头、多空、其他；场

外期权分为香草及组合、二元及组合、障碍及组合、自动赎回、区间累计、安全气囊、其他）；

4.衍生工具类型（场外期权、收益互换、远期）；

5.交易者类型。

DM-III-3：个股对冲端杠杆率

一、基本定义

个股对冲端杠杆率指统计期末个股对冲持仓市值与相应保证金及缴纳期权费的比率。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.交易商类别（一级、二级）；

2.交易商类型（证券公司及子公司、期货公司及子公司）。

公司控股情况分类标准

第一章 总则

第一条 为更好地开展公司控股情况分类统计工作，根据《中华人民共和国公司法》《证券期货市场统计管理办法》等法律法规和相关规定，制定本标准（以下简称《本标准》）。

第二条 《本标准》所称“公司”指境内证券交易所上市公司和全国股转系统挂牌公司，即以上市公司和挂牌公司作为分类对象。

第三条 《本标准》适用于证券期货监管系统对公司控股情况进行统计、分析及其他相关工作。系统各单位、各司局生产、报送和发布统计数据所涉及的控股情况分类应当符合《本标准》要求。

第二章 控股情况分类

第四条 按照公司控股主体性质进行控股情况分类。实际控制人或控股股东拥有公司的控制权，是公司的控股主体。

第五条 根据控股主体的性质不同，将公司控股情况分为国有控股（包括中央国有控股和地方国有控股）、社团集体控股、自然人控股、外商控股和其他（包括控股主体性质不明确和无控股主体）。

公司控股情况分类结构与代码如下：

代码	控股情况
S	国有控股
11	中央国有控股
12	地方国有控股
C	社团集体控股
P	自然人控股
F	外商控股
O	其他
11	控股主体性质不明确
12	无控股主体

第三章 分类原则与方法

第六条 以公司的控制权作为基本分类原则，以公司的实际控制人、控股股东性质等作为分类依据。

第七条 当公司有实际控制人，根据实际控制人的性质进行分类；当公司没有实际控制人，根据控股股东的性质进行分类。

第八条 具体分类方法：

（一）实际控制人为中央国家机关、中央国有企事业单位、中央国有控股企业，包括国务院国资委、财政部、教育部、汇金公司、中央国有企业的公司，归为中央国有控股。

实际控制人为地方政府机关、地方国有企事业单位、地方国有控股企业，包括地方国资委、地方政府、地方财政厅、地方教育局、地方国有企业的，归为地方国有控股。

中央国有控股和地方国有控股归为国有控股。

（二）实际控制人为企业联合社、职工持股会、工会委员会等社会团体或集体企业（单位）的，归为社团集体控股。

（三）实际控制人为境内自然人，归为自然人控股。

（四）实际控制人为境外（外国及港澳台地区）自然人或法人的，归为外商控股。

（五）无实际控制人，但控股股东为中央国有、地方国有、社团集体企业、境内自然人、境外自然人或法人的，分别归为中央国有控股、地方国有控股、社团集体控股、自然人控股和外商控股。

（六）控股主体性质不明确，包括由两种以上性质主体共同控制、控股主体的股权分散且性质不明确的，归为控股主体性质不明确。

既无实际控制人，又无控股股东的，归为无控股主体。

控股主体性质不明确和无控股主体归为其他。

（七）不能按照上述分类方法确定分类的，由公司控股情况分类专家委员会根据公司股权结构判断公司所属分类。

第四章 管理机构及其职责

第九条 中国证监会统筹指导公司控股情况分类工作，负责牵头

制定、修改和完善《本标准》，对《本标准》进行解释。

第十条 中证数据有限责任公司（以下简称中证数据）负责按照《本标准》组织公司控股情况具体分类工作，向中国证监会报送分类结果。

第十一条 中证数据负责建立公司控股情况分类专家委员会（以下简称专家委员会），并负责专家委员会日常工作的有序开展。专家委员会由证券期货监管系统专家组成，负责对《本标准》的修订和完善提出意见和建议；负责对公司控股情况分类作出最终判断。

第十二条 中国上市公司协会负责与上市公司的沟通工作，全国中小企业股份转让系统有限责任公司负责与挂牌公司的沟通工作，建立与公司的日常沟通机制，就公司控股情况分类及变更情况征求公司意见，并将公司的意见及时反馈中证数据。

第五章 分类流程

第十三条 上市公司控股情况分类按季度开展，依据上市公司依法披露的招股说明书、年度报告、中期报告、季度报告、重大资产重组实施情况报告、权益变动等相关公告进行，最终分类结果经专家委员会确认。

挂牌公司控股情况分类每半年开展一次，依据挂牌公司依法披露的公开转让说明书、定向发行说明书、年度报告、半年度报告、权益变动等相关公告进行，最终分类结果经专家委员会确认。

第十四条 中证数据于季后 6 个工作日内，将截至上季末的上市

公司控股情况预分类结果发送专家委员会征求意见，并形成分类初评结果；于季后 13 个工作日内，完成与上市公司的沟通，上市公司提出不同意见的，提请专家委员会作出最终判断，并形成最终分类结果；中证数据于季后 18 个工作日内，将最终分类结果报送中国证监会。

挂牌公司控股情况分类纳入第二、四季度的公司控股情况分类工作。

第十五条 遇重大事项，公司控股情况分类工作进程可相应后延。

第六章 附则

第十六条 《本标准》下列用语的含义引自《中华人民共和国公司法》：

（一）实际控制人，是指通过投资关系、协议或者其他安排，能够实际支配公司行为的人。

（二）控股股东，是指其出资额占有限责任公司资本总额超过百分之五十或者其持有的股份占股份有限公司股本总额超过百分之五十的股东；出资额或者持有股份的比例虽然低于百分之五十，但依其出资额或者持有的股份所享有的表决权已足以对股东会的决议产生重大影响的股东。

股票投资者分类标准

第一章 总则

第一条 为加强统计基础制度建设，规范股票投资者分类工作，根据《证券期货市场统计管理办法》等规章制度，制定本标准（以下简称《本标准》）。

第二条 《本标准》以在中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）开立证券账户的股票投资者作为分类对象。

第三条 《本标准》适用于证券期货监管系统对股票投资者信息进行统计、分析及其他相关工作。系统各单位、各司局生产、报送和发布统计数据所涉及的股票投资者分类应当符合《本标准》要求。

第二章 股票投资者分类

第四条 股票投资者分为自然人投资者、专业机构投资者、一般机构投资者和沪深股通投资者。

第五条 自然人投资者指在中国结算开立证券账户的自然人。

第六条 专业机构投资者主要指经国家金融监管部门批准设立的持牌金融机构以及其管理的金融产品；经证监会或者其授权机构登记备案的私募基金管理机构及其管理的私募基金产品；证

监会认可的其他专业机构。

第七条 沪深股通投资者，指通过沪港通或深港通机制取得在沪深两市买卖股票业务资格的投资者。

第八条 一般机构投资者指除专业机构投资者和沪深股通投资者以外，在中国结算开立证券账户的法人或非法人组织。

第九条 股票投资者分类结构如下：

一级分类	二级分类	三级分类
自然人投资者	持股市值 10 万以下	持股市值 10 万以下
	持股市值 10-50 万	持股市值 10-50 万
	持股市值 50-300 万	持股市值 50-100 万
		持股市值 100-300 万
	持股市值 300-1000 万	持股市值 300-500 万
		持股市值 500-1000 万
	持股市值 1000 万以上	持股市值 1000-3000 万
		持股市值 3000 万-1 亿
		持股市值 1 亿-10 亿
		持股市值 10 亿以上
专业机构投资者	公募基金	股票型公募基金
		混合型公募基金
		债券型公募基金
		其他
	基金管理公司资产管理计划	基金管理公司单一资产管理计划
		基金管理公司集合资产管理计划
	合格境外投资者	QFII
		RQFII
	证券公司自营	证券公司自有资金
		证券公司场外期权
		证券公司收益互换
		其他
	证券公司资产管理计划	证券公司单一资产管理计划
		证券公司集合资产管理计划

	社会保障基金	全国社会保障基金
		地方社会保障基金
		基本养老保险基金
	企业年金	企业年金
	保险机构	保险产品
		保险资产管理公司资管产品
		保险机构自有资金
		其他
	信托机构	信托产品
		信托公司自有资金
	私募基金	私募基金管理人
		私募证券投资基金
		私募股权投资基金
		创业投资基金
		私募资产配置基金
		其他私募投资基金
	其他专业机构	期货公司资产管理计划
		证券公司资产支持专项计划
		财务公司
		GDR 机构
		商业银行理财产品
		未归类的专业机构
一般机构投资者	一般机构	国有股东
		外商投资企业股东
		境外股东
		无法归类的一般机构
沪深股通投资者	沪股通投资者	普通个人投资者及联名账户
		基金产品
		证券公司自营
		基金管理人及其他机构
	深股通投资者	普通个人投资者及联名账户
		基金产品
		证券公司自营
		基金管理人及其他机构

注：1.上表分组遵循“上组限不在内”的原则，如“10-50 万”包括 10 万，不包括 50 万。
2.上表中单位万、亿指万元、亿元人民币。

第三章 管理机构及其职责

第十条 中国证监会统筹指导股票投资者分类工作，负责牵头制定、修改和完善《本标准》，对《本标准》进行解释。

第十一条 中证数据有限责任公司（以下简称中证数据）负责实施股票投资者分类及标识工作。

第四章 分类流程

第十二条 股票投资者分类工作按日开展，包括自然人投资者分类、机构投资者分类和沪深股通投资者分类。其中，机构投资者分类包括对专业机构投资者和一般机构投资者进行分类，不包括对沪深股通投资者进行分类。

第十三条 自然人投资者以前推 12 个月投资者每交易日末在上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所合计持股市值的最大值作为分类依据；按月度存量和日度增量频率更新分类标识，每日进行分类统计和报送。

月度存量分类指每月初对截至上月末的存量自然人投资者进行分类确定的分类组别，本月内不变；日度增量分类指每日对本月新增自然人投资者进行分类，本月内，新增投资者的分类组别根据当日数据每日更新。

中证数据于每月初 2 个工作日内，完成截至上月末的存量自

然人投资者分类标识，并送系统相关单位使用；每日完成当月截至上一工作日的新增自然人投资者分类标识，并于当日送系统相关单位使用。系统相关单位收到分类结果后，于次日向中国证监会报送据此生产的相关报表。

第十四条 机构投资者分类以一般机构投资者和专业机构投资者在中国结算开立证券账户时提供的基本信息为分类依据；按日度存量频率更新分类标识，每日进行分类统计和报送。

中证数据每日完成截至上一个工作日的存量机构投资者的分类标识，并送系统相关单位使用。系统相关单位收到分类结果后，于次日向中国证监会报送据此生产的相关报表。

第十五条 沪深股通投资者以投资者在中国结算开立证券账户时提供的基本信息（投资者识别码）为分类依据；按日度存量频率更新分类标识，每日进行分类统计和报送。

中证数据每日完成截至上一个工作日的存量沪深股通投资者的分类标识，并送系统相关单位使用。系统相关单位收到分类结果后，于次日向中国证监会报送据此生产的相关报表。

第五章 附则

第十六条 《本标准》用语含义如下：

（一）持股市值，指投资者在上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所的合计持股市值（A股市值和B股市值）。计算自然人投资者持股市值时，以一码通账户号为自然人投资者

的唯一标识，合并计算同一一码通账户下所有证券账户（含信用账户）所持股票市值。

（二）非法人组织，指合法成立的、有一定的组织机构和财产，但又不具备法人资格的组织，包括合伙企业、非法人创业投资企业等。

（三）资产管理计划，指证券期货经营机构非公开募集资金或接受财产委托，设立的私募资产管理计划。

（四）私募基金，指通过非公开方式面向少数个人或机构投资者等特定对象募集资金设立的投资基金。

（五）GDR 机构指 GDR 存托人在境内的存托账户和跨境转换机构的中国指定券商账户。

（六）未归类的专业机构，指在标准执行期间新出现，且无法归入原有类别的专业机构投资者。

（七）无法归类的一般机构，指其他无法归入国有、外商投资企业股东或境外股东的一般机构投资者。

第十七条 在最新分类标识提供前，统计区间内新开户的自然人投资者，暂归入持股市值 10 万以下；统计区间内新开户的机构投资者，暂归入无法归类的一般机构。

相关制度规则

- [1] 《中华人民共和国公司法》（中华人民共和国主席令第十五号）；
- [2] 《期货交易管理条例》（国务院令 第 676 号）；
- [3] 《中华人民共和国期货和衍生品法》（中华人民共和国主席令 第一一一号）；
- [4] 《私募投资基金监督管理条例》（国务院令 第 762 号）；
- [5] 《国务院关于全国中小企业股份转让系统有关问题的决定》（国发〔2013〕49 号）；
- [6] 《国务院办公厅关于规范发展区域性股权市场的通知》（国办发〔2017〕11 号）；
- [7] 《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（证监会、人民银行、外汇局令〔第 176 号〕）；
- [8] 《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（证监会令 第 46 号）；
- [9] 《关于修改上市公司现金分红若干规定的决定》（证监会令 第 57 号）；
- [10] 《证券期货市场统计管理办法》（证监会令 第 60 号）；
- [11] 《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令 第 104 号）；

- [12] 《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第 105 号）；
- [13] 《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会令第 117 号）；
- [14] 《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第 120 号）；
- [15] 《区域性股权市场监督管理试行办法》（证监会令第 132 号）；
- [16] 《上市公司股权激励管理办法》（证监会令第 148 号）；
- [17] 《科创板首次公开发行股票注册管理办法（试行）》（证监会令第 153 号）；
- [18] 《期货公司监督管理办法》（证监会令第 155 号）；
- [19] 《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第 166 号）；
- [20] 《非上市公众公司收购管理办法》（证监会令第 166 号）；
- [21] 《上市公司收购管理办法》（证监会令第 166 号）；
- [22] 《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第 175 号）；
- [23] 《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（证监会、人民银行、外汇局令〔第 176 号〕）；
- [24] 《转融通业务监督管理试行办法》（证监会令第 177 号）；
- [25] 《客户交易结算资金管理办法》（证监会令第 184 号）；
- [26] 《中国证监会派出机构监管职责规定》（证监会令第 199 号）
- [27] 《内地与香港股票市场交易互联互通机制若干规定》（证监会令第 200 号）；
- [28] 《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令第 202 号）；
- [29] 《首次公开发行股票注册管理办法》（证监会令第 205 号）；

- [30] 《上市公司证券发行注册管理办法》（证监会令第 206 号）；
- [31] 《优先股试点管理办法》（证监会令第 209 号）；
- [32] 《北京证券交易所向不特定合格投资者公开发行股票注册管理办法》（证监会令第 210 号）；
- [33] 《北京证券交易所上市公司证券发行注册管理办法》（证监会令第 211 号）；
- [34] 《非上市公众公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 213 号）；
- [35] 《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 214 号）；
- [36] 《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 222 号）；
- [37] 《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 9 号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》（证监会公告〔2010〕2 号）；
- [38] 《证券公司融资融券业务内部控制指引》（证监会公告〔2011〕32 号）；
- [39] 《证券公司年度报告内容与格式准则》（证监会公告〔2013〕41 号）；
- [40] 《关于进一步推进新股发行体制改革的意见》（证监会公告〔2013〕42 号）；
- [41] 《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标管理暂行规定》（证监会公告〔2016〕30 号）；
- [42] 《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2017〕13 号）；
- [43] 《关于支持上市公司回购股份的意见》（证监会公告〔2018〕

35号)；

[44] 《关于在上海证券交易所设立科创板并试点注册制的实施意见》（证监会公告〔2019〕2号）；

[45] 《非上市公众公司信息披露内容与格式准则第9号——创新层挂牌公司年度报告》（证监会公告〔2020〕5号）；

[46] 《非上市公众公司信息披露内容与格式准则第10号——基础层挂牌公司年度报告》（证监会公告〔2020〕6号）；

[47] 《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2020〕42号）；

[48] 《关于实施〈合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法〉有关问题的规定》（证监会公告〔2020〕63号）；

[49] 《上市公司分拆规则（试行）》（证监会公告〔2022〕5号）；

[50] 《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第5号——公司股份变动报告的内容与格式》（证监会公告〔2022〕8号）；

[51] 《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2022〕43号）；

[52] 《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2022〕43号）；

[53] 《期货公司保证金封闭管理办法》（证监会公告〔2022〕43号）；

[54] 《境内外证券交易所互联互通存托凭证业务监管规定》（证监会公告〔2023〕50号）；

[55] 《关于修改〈公开募集基础设施证券投资基金指引〉第五十条的决定》（证监会公告〔2023〕55号）；

[56] 《上市公司监管指引第3号——上市公司现金分红》（证监

- 会公告〔2023〕61号）；
- [57] 《关于修改<上市公司章程指引>的决定》(证监会公告〔2023〕62号)；
- [58] 《上市公司股份回购规则》（证监会公告〔2023〕63号）；
- [59] 《证券公司风险控制指标计算标准规定》(证监会公告〔2024〕13号)；
- [60] 《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》（证监发〔2012〕37号）；
- [61] 《证券投资基金信息披露编报规则第1号〈主要财务指标的计算与披露〉》（证监基金字〔2003〕104号）；
- [62] 《上海证券交易所股票期权试点交易规则》；
- [63] 《上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司股票期权试点风险控制管理办法》；
- [64] 《中国证券登记结算有限责任公司境内外证券交易所互联互通存托凭证登记结算业务实施细则》；
- [65] 《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》（沪市）；
- [66] 《上海证券交易所收费管理规则适用指引第1号-收费项目及标准》；
- [67] 《上海证券交易所交易规则》；
- [68] 《上海证券交易所上市公司自律监管指引第7号——回购股份》；
- [69] 《上海证券交易所融资融券交易实施细则》；
- [70] 《上海证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》；

- [71] 《上海证券交易所融资融券交易业务指引第 1 号——担保物集中度管理》；
- [72] 《上海证券交易所股票上市规则》；
- [73] 《上海证券交易所科创板股票上市规则》；
- [74] 《上海证券交易所沪港通业务实施办法》；
- [75] 《上海证券交易所公司债券发行上市审核规则》；
- [76] 《上海证券交易所收费管理规则适用指引第 1 号——收费项目及标准》；
- [77] 《上海证券交易所优先股试点业务实施细则》；
- [78] 《上海证券交易所债券交易规则》；
- [79] 《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》（深市）；
- [80] 《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》；
- [81] 《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》；
- [82] 《深圳证券交易所融资融券交易实施细则》；
- [83] 《深圳证券交易所交易规则》；
- [84] 《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 9 号——回购股份》；
- [85] 《深圳证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》；
- [86] 《深圳证券交易所证券交易业务指引第 2 号——融资融券担保物集中度管理》；
- [87] 《深圳证券交易所股票上市规则》；
- [88] 《深圳证券交易所创业板股票上市规则》；
- [89] 《深圳证券交易所深港通业务实施办法》；

- [90] 《深圳证券交易所债券交易规则》；
- [91] 《深圳证券交易所公司债券发行上市审核规则》；
- [92] 《深圳证券交易所业务收费管理办法》；
- [93] 《北京证券交易所交易规则（试行）》；
- [94] 《北京证券交易所业务收费管理办法》；
- [95] 《北京证券交易所投资者适当性管理业务指南》；
- [96] 《北京证券交易所上市公司持续监管指引第 4 号——股份回购》；
- [97] 《北京证券交易所融资融券交易细则》；
- [98] 《北京证券交易所融资融券担保物集中度管理业务指引》；
- [99] 《北京证券交易所股票上市规则》；
- [100] 《北京证券交易所公司债券发行上市审核规则》；
- [101] 《北京证券交易所上市公司向特定对象发行优先股业务细则》；
- [102] 《北京证券交易所债券交易规则》；
- [103] 《上海期货交易所期权交易管理办法》；
- [104] 《上海期货交易所交割细则》；
- [105] 《上海期货交易所结算管理办法》；
- [106] 《上海期货交易所会员管理办法》；
- [107] 《上海期货交易所交易管理办法》；
- [108] 《上海期货交易所风险控制管理办法》；
- [109] 《郑州商品交易所会员管理办法》；
- [110] 《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》；

- [111] 《郑州商品交易所期货交割管理办法》；
- [112] 《郑州商品交易所期权交易管理办法》；
- [113] 《郑州商品交易所期货结算管理办法》；
- [114] 《大连商品交易所期权交易管理办法》；
- [115] 《大连商品交易所会员管理办法》；
- [116] 《郑州商品交易所期货交易管理办法》；
- [117] 《大连商品交易所结算管理办法》；
- [118] 《大连商品交易所交割管理办法》；
- [119] 《大连商品交易所交易管理办法》；
- [120] 《大连商品交易所风险管理办法》；
- [121] 《中国金融期货交易所会员管理办法》；
- [122] 《中国金融期货交易所股指期货合约交易细则》；
- [123] 《中国金融期货交易所风险控制管理办法》；
- [124] 《中国金融期货交易所交易规则》；
- [125] 《中国金融期货交易所结算细则》；
- [126] 《广州期货交易所会员管理办法》；
- [127] 《广州期货交易所风险管理办法》；
- [128] 《广州期货交易所交割管理办法》；
- [129] 《广州期货交易所交易管理办法》；
- [130] 《广州期货交易所结算管理办法》；
- [131] 《上海国际能源交易中心期权交易管理细则》；
- [132] 《上海国际能源交易中心交易规则》；
- [133] 《上海国际能源交易中心会员管理细则》；

- [134] 《上海国际能源交易中心交割细则》；
- [135] 《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》；
- [136] 《上海国际能源交易中心结算细则》；
- [137] 《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》；
- [138] 《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所股票期权试点结算规则》；
- [139] 《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所股票期权试点结算业务实施细则》；
- [140] 中国证券登记结算有限责任公司《标准券折算率（值）管理办法》；
- [141] 中国证券金融股份有限公司、上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司《科创板做市借券业务细则》；
- [142] 《中国证券登记结算有限责任公司融资融券登记结算业务实施细则》；
- [143] 《中国证券登记结算公司证券出借及转融通登记结算业务实施细则》；
- [144] 《内地与香港股票市场交易互联互通机制登记、存管、结算业务实施细则》；
- [145] 《中国证券登记结算有限责任公司北京分公司北京证券交易所股票登记结算业务指南》；
- [146] 《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则（试行）》；
- [147] 《中国证券金融股份有限公司转融通业务保证金管理实施细则（试行）》；

- [148] 《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》；
- [149] 《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理办法》；
- [150] 《全国中小企业股份转让系统股票交易规则》；
- [151] 《全国中小企业股份转让系统股票定向发行规则》；
- [152] 《全国中小企业股份转让系统非上市公众公司重大资产重组业务细则》；
- [153] 《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引第 1 号——发行和挂牌的申请文件与程序》；
- [154] 《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引第 2 号——主办券商推荐工作报告的内容与格式》；
- [155] 《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引第 3 号——法律意见书的内容与格式》；
- [156] 《全国中小企业股份转让系统股票交易方式确定及变更指引》；
- [157] 中国证券投资基金业协会《私募投资基金登记备案办法》。