

证券期货业统计指标标准指引

中国证券监督管理委员会

2013 年 1 月

总目录	2
编制说明	8
股票市场	10
SK-I: 市场规模	10
SK-I-1: 上市公司家数	10
SK-I-2: 上市公司股本	11
SK-I-3: 股票筹资公司家数	13
SK-I-4: 股票筹资金额	16
SK-I-5: 股票市值	18
SK-I-6: 上市公司市值	20
SK-I-7: 股票账户数	21
SK-I-8: 股票投资者数	23
SK-II: 股票交易	23
SK-II-1: 涨跌幅	23
SK-II-2: 振幅	25
SK-II-3: 成交量	26
SK-II-4: 成交金额	27
SK-II-5: 换手率	28
SK-II-6: 市盈率	30
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-III: 功能与影响	36
SK-III-1: 证券化率	36
SK-III-2: 上市公司上缴税款总额	36
SK-III-3: 上市公司分红总额	37
SK-III-4: 股息率	39
SK-III-5: 股票交易费用	40
SK-III-6: 股权激励家数	41
SK-III-7: 重大资产重组家数	42
SK-III-8: 重大资产重组金额	43
SK-IV: 上市公司财务	44
SK-IV-1: 上市公司净利润总额	44
SK-IV-2: 上市公司平均净资产收益率	45
SK-IV-3: 现金分红率	46
SK-V: 信用交易	47
SK-V-1: 信用交易金额	47
SK-V-2: 融资融券余额	48
SK-V-3: 维持担保比例	50
SK-V-4: 融资买入金额	51
SK-V-5: 融券卖出金额	52
SK-V-6: 信用交易账户数	53
债券市场	55
BD-I: 市场规模	55

BD-I-1: 债券发行只数	55
BD-I-2: 债券发行额	56
BD-I-3: 债券托管额	56
BD-I-4: 债券上市只数	57
BD-I-5: 债券融资金额	58
BD-I-6: 持债账户数	59
BD-II: 债券交易	59
BD-II-1: 债券成交金额	59
BD-II-2: 标准券总额	60
BD-II-3: 回购标准券使用率	61
BD-II-4: 回购定盘利率	61
BD-II-5: 回购未到期金额	62
BD-II-6: 兑付金额	62
BD-II-7: 本年待偿还债券总额	63
基金市场	65
FD-I: 市场规模	65
FD-I-1: 基金只数	65
FD-I-2: 上市基金数	65
FD-I-3: 基金份额	66
FD-I-4: 基金资产规模	67
FD-I-5: 上市基金市值	68
FD-I-6: 基金账户数	68

FD-I-7: 基金投资者数	69
FD-I-8: 基金认购金额、基金募集金额	70
FD-II: 基金交易	70
FD-II-1: 基金申购金额、基金赎回金额	70
FD-II-2: 上市基金成交金额	71
FD-II-3: 基金平均折（溢）价率	71
FD-III: 基金绩效及分红	72
FD-III-1: 基金利润	72
FD-III-2: 基金分红金额	73
FD-III-3: 基金总持有成本	74
FD-IV: QFII 等指标	75
FD-IV-1: QFII 家数、RQFII 家数、QDII 家数	75
FD-IV-2: QFII 额度、RQFII 额度、QDII 额度	76
期货市场	78
FS-I: 市场规模	78
FS-I-1: 保证金	78
FS-I-2: 期货会员机构数	81
FS-I-3: 期货账户数	82
FS-I-4: 客户数	84
FS-II: 期货交易	84
FS-II-1: 涨跌幅	84
FS-II-2: 振幅	86

FS-II-3: 成交量	88
FS-II-4: 成交金额	89
FS-II-5: 持仓量	89
FS-II-6: 持仓金额	90
FS-II-7: 基差	92
FS-II-8: 交割量	93
FS-II-9: 交割率	94
FS-II-10: 杠杆率	95
FS-II-11: 单位客户持仓占比	96
经营机构	98
PI-I: 机构规模	98
PI-I-1: 证券公司家数	98
PI-I-2: 证券营业部家数	98
PI-I-3: 证券公司分公司家数	99
PI-I-4: 基金管理公司家数	100
PI-I-5: 期货公司家数	100
PI-I-6: 期货营业部家数	101
PI-I-7: 就业人员数量	102
PI-II: 机构财务	102
PI-II-1: 总资产	102
PI-II-2: 净资产	103
PI-II-3: 平均财务杠杆	104

PI-II-4:	营业收入	104
PI-II-5:	营业支出	105
PI-II-6:	利润总额	105
PI-II-7:	净利润	106
PI-III:	风险控制	106
PI-III-1:	净资本总额	106
PI-III-2:	证券公司风险资本准备总额	107
PI-III-3:	证券公司风险覆盖率	108
PI-IV:	机构业务	108
PI-IV-1:	客户托管资产总额	108
PI-IV-2:	代理买卖证券总额	109
PI-IV-3:	资产管理业务规模	110
PI-IV-4:	期货公司客户权益总额	110
附录一:	涨跌幅速算公式	112
附录二:	相关制度规则	114

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、各部门生产、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口径。其他市场参与主体向监管部门报送统计数据应当符合本指引要求，除此以外可自愿使用，但不强制使用。

三、本指引统计指标共分股票市场、债券市场、基金市场、期货市场、证券期货经营机构五大部分。

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。期货合约的持仓量、持仓金额按单边计算。

七、本指引所涉及的全市场指标，其计算结果由中国证监会统计管理部门对外提供和公布。

八、对于 2012 年 6 月份中国证监会公布的《证券期货业统计指标标准指引第 1 号（试行）》涉及的股息率等 9 个指标，本指引已全部收入，以本指引为准。

九、本指引的上市公司行业分类参照中国证监会《上市公司行业分类指引》。

十、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，由中国证监会统计管理部门与相关报送单位商定临时解决方案。

十一、中国证监会统计管理部门定期对本指引进行修订。

十二、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

上市公司家数是指在统计期末其发行的股票在沪、深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、B股等）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
- 3.行业分类；
- 4.证券交易所；
- 5.监管辖区、行政区划。

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

上市公司家数是指在统计期末其发行的股票在沪、深证券交

易所上市的股份有限公司数量。

（二）暂停上市公司家数

暂停上市公司家数是指在统计期末其发行的股票暂停在证券交易所上市的股份有限公司数量。

（三）退市公司家数

退市公司家数是指在统计期内其发行的股票终止在证券交易所上市的股份有限公司的数量。

四、指标说明

（一）上市公司家数、暂停上市公司家数、退市公司家数分别以股票上市日，暂停上市日和终止上市日（摘牌日）进行统计。

（二）同时发行 A、B 股的上市公司，按一家计算。

SK-I-2: 上市公司股本

一、基本定义

上市公司股本也称上市公司总股本，是指统计期末上市公司发行的全部股份数量合计。

为统计方便，本指引中的上市公司股本仅指上市公司在境内发行的股份数量，包括 A 股股本、B 股股本和其他不流通的境内股本。

A 股股本是指上市公司发行的人民币普通股票数量。

B 股股本是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股等）；

2.上市板块（主板、中小企业板、创业板）。

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

限售股本是指统计期末未解禁的限售股的数量合计，包括A股限售股本，未股改公司的非流通股本，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：

A股流通股本=A股股本-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证券交易所自由买卖的A股股票数量。

自由流通股本计算公式为：

自由流通股本=A 股股本-A 股限售股本-(如果合计持有超过 5%) 6 类股本中的非限售股本；

其中 6 类股本指：1.公司创建者、家族和高级管理人员长期持有的股份；2.国有股份；3.战略投资者持有的股份；4.被冻结股份；5.受限的员工持有的股份；6.上市公司交叉持有的股份。

合计持有是指以上 6 类股本的股东及一致行动人持有的限售股与非限售股按股东的合计。

5%是指合计持有的股本与 A 股股本的比例。

四、指标说明

上市公司股本以上市日为计算日。

五、相关制度规则

(一)《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》(证监公司字〔2007〕98 号)；

(二)中证指数公司《沪深 300 指数编制细则》(2012)。

SK-I-3: 股票筹资公司家数

一、基本定义

股票筹资公司家数是指统计期内通过发行股票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 股等）；
2. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
3. 行业分类；
4. 证券交易所；
5. 监管辖区、行政区划。

三、指标种类

按照上市公司是否为首次发行筹资，分为首发筹资公司家数和再筹资公司家数。其中，再筹资公司家数可分为增发公司家数、配股公司家数、行权筹资公司家数等。

(一) 首发筹资公司家数

首发筹资公司家数是指在统计期内首次公开发行股份(IPO)进行筹资的公司数量。

以吸收合并、分拆等方式上市且未公开发行新股筹资的公司，不计入首发筹资公司家数。

(二) 再筹资公司家数

再筹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、行权筹资等方式进行筹资的上市公司家数。

1. 增发公司家数

增发公司家数是指统计期内通过增发股份进行筹资的上市

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。

2.配股公司家数

配股公司家数是指统计期内通过向原股东配售股份进行筹资的上市公司数量。

3.行权筹资公司家数

行权筹资公司家数包括统计期内权证（期权）行权筹资公司家数和可转债转股公司家数。

权证（期权）行权筹资是指统计期内权证（期权）持有人根据约定向上市公司认购股份从而增加上市公司股份的行为。

五、指标说明

（一）以股份上市日作为统计指标的计算日。

（二）同一家公司在统计期内多次筹资时，筹资公司家数计为 1 家。

六、相关制度规则

（一）《首次公开发行股票并上市管理办法》（证监会令第 32 号）；

（二）《首次公开发行股票并在创业板上市管理暂行办法》（证监会令第 61 号）；

（三）《上市公司证券发行管理办法》（证监会令第 30 号）。

SK-I-4: 股票筹资金额

一、基本定义

股票筹资金额是指统计期内通过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. 股份类型 (A 股、B 股等);
2. 上市板块 (主板、中小企业板、创业板);
3. 行业分类;
4. 证券交易所;
5. 监管辖区、行政区划。

三、指标种类

按照是否为首次公开发行筹资, 股票筹资金额分为首发筹资金额和再筹资金额两个指标。其中, 再筹资金额可分为增发筹资金额、配股筹资金额、行权筹资金额等指标。(参见股票筹资家数)。

(一) 首发筹资金额

首发筹资金额是指统计期内 IPO 筹集的资金总额。

首发筹资金额 = Σ (每股发行价格 $\times$ 发行股份数)。

其中, 对于发行股份吸收合并已上市公司的筹资金额, 计算公式为:

首发筹资金额（吸收合并）=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对统计期内的 IPO 募集资金进行回溯调整。

（二）再筹资金额

再筹资金额是指统计期内上市公司通过增发（公开增发和定向增发）、配股、行权等方式筹集的资金总额。

1. 增发筹资金额

增发筹资金额是指统计期内上市公司增发股份筹集的资金总额。

增发筹资金额=Σ（增发每股价格×发行股份数）。

根据股份认购对象的不同，增发筹资金额指标可分为公开增发筹资金额和定向增发筹资金额。

根据增发时是否以现金认购，增发筹资金额指标可分为增发筹资金额（现金认购）和增发筹资金额（非现金资产认购）。

2. 配股筹资金额

配股筹资金额是指统计期内上市公司通过向原股东配售股份筹集的资金总额。

配股筹资金额=Σ（配股价格×配售股份数）=Σ（配股价格×股份数量×配售比例）。

3. 行权筹资金额

行权筹资金额包括权证（期权）行权筹资金额和可转债转股

金额。

行权筹资金额 = Σ (行权价格 $\times$ 行权认购股份数) + Σ (转股价格 $\times$ 可转债转股数量)。

四、指标说明

以股份上市日作为统计指标的计算日。

五、相关制度规则

(一)《首次公开发行股票并上市管理办法》(证监会令第32号);

(二)《首次公开发行股票并在创业板上市管理暂行办法》(证监会令第61号);

(三)《上市公司证券发行管理办法》(证监会令第30号)。

SK-I-5: 股票市值

一、基本定义

股票市值是指统计期末根据上市公司股票价格和对应股票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.股份类型(A股、B股等);

2.上市板块(主板、中小企业板、创业板);

3.行业分类，股票指数；

4.证券交易所；

5.监管辖区、行政区划。

三、指标种类

（一）A 股市值

A 股市值是指根据 A 股股票价格与其股票数量计算出的股权价值合计。

（二）A 股流通市值

A 股流通市值是指根据 A 股股票价格与其非限售股本计算出的股权价值合计。

（三）B 股流通市值

B 股流通市值是指根据 B 股股票价格与其流通股本计算出的股权价值合计。

统计时，B 股流通市值一般换算成人民币计算。

（四）自由流通市值

自由流通市值是指根据 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；暂停上市股票的价格以零计算。

（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，其非流通股不纳入股票市值

计算。

（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）的市值。

SK-I-6: 上市公司市值

一、基本定义

上市公司市值是指统计期末根据上市公司股票价格和对应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.股份类型（A股、B股等）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
- 3.行业分类，股票指数；
- 4.证券交易所；
- 5.监管辖区、行政区划。

三、指标种类

（一）上市公司市值

上市公司市值等于上市公司A股市值与B股市值之和：

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

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

上市公司流通市值是指上市公司 A 股流通市值和 B 股流通市值的合计。

SK-I-7: 股票账户数

一、基本定义

股票账户数是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。

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. 证券交易所；
3. 投资者类型（个人、机构）；
4. 投资人开户地区。

三、指标种类

（一）新开账户数

新开账户数是指统计期内新开立的股票账户数量。

（二）新销账户数

新销账户数是指统计期内销户的股票账户数量。

（三）休眠账户数

休眠账户数是指统计期末根据“证券账户余额为零、资金账户余额不超过 100 元且最近连续 3 年以上无交易”原则统计的账户数量。

（四）有效账户数

有效账户数是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）开通创业板功能账户数

开通创业板功能账户数是指统计期末 A 股有效账户数中开通创业板功能的账户数。

（六）参与交易股票账户数

参与交易股票账户数是指统计期内参与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。

（七）持股账户数

持股账户数是指统计期末持有股票数量不为零的账户数。

（八）参与交易股票账户数占比

参与交易股票账户数占比是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率。

四、相关制度规则

《关于进一步规范账户管理工作的通知》（2007）。

SK-I-8: 股票投资者数

一、基本定义

股票投资者数是指统计期末已开立股票账户的投资者数量。统计时按照“投资者全称相同且证件代码相同”合并计算。

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. 证券交易所;
3. 投资者类型 (个人、机构);
4. 投资人开户地区。

三、指标种类

新增投资者数

新增投资者数是指统计期内首次开立股票账户的投资者数量。

SK-II: 股票交易

SK-II-1: 涨跌幅

一、基本定义

涨跌幅是指统计期内股票期末价格相对期初价格的变化幅度。

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

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股等）

2.行业分类，交易板块，股票指数；

3.上市板块（主板、中小企业板、创业板）。

三、指标说明

（一）指数涨跌幅参照股票涨跌幅处理。

（二）对股票区间涨跌幅的计算需要对股票价格进行复权处理。复权因素包括分红、送股、配股等。复权价格的公式为：

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，复权价格采用递归方式进行计算。

在计算复权价时，通常采用区间分段涨跌幅连乘或复权因子连乘进行速算（速算公式详见附录）。

SK-II-2: 振幅

一、基本定义

振幅是指股票价格在统计期内的波动程度，采用区间内最大差价与基准价格的相对变动幅度来进行计算。

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 股等）；

2. 行业分类，交易板块，股票指数；

3. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）。

三、指标种类

(一) 振幅（最低价）

振幅（最低价）采用区间内股票价格最大差价与区间内最低价格的比率进行计算。

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

其中：

A — 振幅

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）是指采用统计期内股票价格最大差价与期初前收盘价的比率进行计算。

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

其中：

A — 振幅

P_h — 区间复权最高价

P_l — 区间复权最低价

P_{preclose} — 一期初复权前收盘价

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基准不适用。

五、相关制度规则

（一）《上海证券交易所交易规则》（2012）；

（二）《深圳证券交易所交易规则》（2012）。

SK-II-3: 成交量

一、基本定义

成交量是指在统计期内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 股等）；
2. 行业分类，交易板块，股票指数；
3. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
4. 证券交易所。

三、指标说明

在进行成交量统计时，包含竞价交易和协议交易（大宗交易）。

SK-II-4: 成交金额

一、基本定义

成交金额是指在统计期内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 股等）；
2. 行业分类，交易板块，股票指数；
3. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
4. 证券交易所。

三、指标说明

在进行成交金额统计时，包含竞价交易和协议交易（大宗交易）。

SK-II-5: 换手率

一、基本定义

换手率是指股票成交量（或成交金额）与相应股票股本（或股票市值）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. 股份类型（A 股、B 股等）；
2. 行业分类，交易板块，股票指数；
3. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
4. 证券交易所。

三、指标种类

（一）股本换手率

股本换手率是指当日股票成交量与其流通股本的比率。计算公式为：

$$TR_d = \left(\frac{TVo_d}{TS_d} \right) \times 100\%$$

其中：

TR_d —股本换手率

TVo_d —当日成交股数

TS_d —流通股本

另外，也可采用当日股票成交量与其自由流通股本的比率来计算股本换手率。

对区间换手率的计算，通常采用统计期内全部交易日的股本换手率合计进行计算。

（二）市值换手率

市值换手率是指当日股票成交金额与其流通市值的比率。计算公式为：

$$TR_d = \left(\frac{TVa_d}{CAP_d} \right) \times 100\%$$

其中：

TR_d —市值换手率

TVa_d —当日成交金额

CAP_d —流通市值

另外，也可采用当日股票成交金额与其自由流通市值的比率来计算市值换手率。

对区间换手率的计算，通常采用统计期内全部交易日的市值换手率合计进行计算。

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)在计算一组股票换手率时,暂停上市股票不纳入计算。

SK-II-6: 市盈率

一、基本定义

市盈率是指上市公司每股股价与每股收益的比率。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。

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

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股等);

2.行业分类,交易板块,股票指数;

3.上市板块（主板、中小企业板、创业板）；

4.证券交易所。

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

静态市盈率是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。通常用上市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

滚动市盈率是指统计期末上市公司每股股价与最近连续 4 个季度产生的每股收益合计的比率。通常用上市公司股票市值与其最近连续 4 个季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

预测市盈率是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。

五、指标说明

(一) 每股收益和净利润数据在财务报告公告截止日的次日集中更新。

(二) 对单只股票计算市盈率时仅考虑每股收益为正的股票。

(三) 通常的市盈率指静态市盈率；滚动市盈率和预测市盈率作分析用。

(四) 对多只股票计算平均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（剔除暂停上市公司股票）：

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

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

SK-II-7: 市净率

一、基本定义

市净率是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。

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

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股等）；
- 2.行业分类，交易板块，股票指数；
- 3.上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
- 4.证券交易所。

三、指标说明

（一）每股净资产数据在财务报告公告截止日的次日集中更新。

（二）通常用最新财务报告中的每股净资产数据进行市净率

计算。

(三)对单只股票计算市净率时仅考虑每股净资产为正的股票。

(四)对多只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的权益合计的比率进行计算(剔除暂停上市公司股票):

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

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

SK-II-8: 账户持股市值

一、基本定义

账户持股市值是指统计期末股票账户所持股票市值的合计。

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

其中:

TCAP—账户持股市值

n—股票只数

P_i —第 i 只股票价格

SHR_i —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（个人、机构）；

2.投资者开户地区；

3.股份类型（A 股、B 股等）；

4.证券交易所。

三、指标说明

暂停上市公司股票价格按最后交易日的收盘价计算。

SK-II-9: 股票账户买卖净额

一、基本定义

股票账户买卖净额是指在统计期内一组股票账户在证券交易所买入和卖出股票的金额轧差之后的净额。

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（个人、机构）；
- 2.投资者开户地区。

SK-III： 功能与影响

SK-III-1: 证券化率

一、基本定义

证券化率是指上市公司市值合计与国内生产总值的比率。证券化率是衡量证券市场发展程度的重要指标。计算公式为：

$$SR = \frac{MCAP}{GDP} \times 100\%$$

其中：

SR—证券化率

MCAP—上市公司市值

GDP—国内生产总值

二、统计属性

（一）基本频度： 年

（二）基本计量单位： %

三、指标说明

国内生产总值采用国家统计局公布的国内生产总值进行计算。

SK-III-2: 上市公司上缴税款总额

一、基本定义

上市公司上缴税款总额是指上市公司在统计期内上缴的各种税款合计。

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、中小企业板、创业板）；
- 2.行业分类；
- 3.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》。

SK-III-3:上市公司分红总额

一、基本定义

上市公司分红总额是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、中小企业板、创业板）；

- 2.股份类型（A股、B股等）；
- 3.行业分类；
- 4.证券交易所；
- 5.监管辖区、行政区划。

三、指标种类

按照分红实施与否分为实际分红总额、预案分红总额和预案实施分红总额：

（一）实际分红总额

实际分红总额是指上市公司最近 12 个月内的现金分红金额合计。

（二）预案分红总额

预案分红总额是指会计年度内根据每期财务报告的分红预案中拟现金分红数据计算的分红总额合计。

（三）预案实施分红总额

预案实施分红总额是指会计年度内每期财务报告的分红预案中已实现的分红总额合计。

四、指标说明

（一）现金分红总额为含税数据。

（二）预案分红总额不含未在财务报告中披露的特别分红数据。

（三）上市公司现金分红额采用人民币计价金额。

（四）实际分红总额以除息日计算。

（五）“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、相关制度规则

（一）《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）；

（二）《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）。

SK-III-4: 股息率

一、基本定义

股息率是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，通常用对应的实际分红总额与期末股票市值的比率来计算股息率：

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

其中：

DP—股息率

DY—统计期内的对应现金分红合计

CAP—样本股票期末市值

另外，也可采用预案分红总额与期末股票市值的比率来计算预案分红股息率。

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、中小企业板、创业板）；

2.行业分类，股票指数；

3.证券交易所。

三、指标说明

(一) 统计时剔除暂停上市公司。

(二) 对一组股票的平均股息率通常用总体法计算：

$$DP_{(avg)} = \left(\frac{\sum_i^n DY_i}{\sum_i^n CAP_i} \right) \times 100\%$$

其中：

$DP_{(avg)}$ —平均股息率

n —股票只数

DY_i —第 i 只股票现金分红总额

CAP_i —第 i 只股票的期末市值

SK-III-5: 股票交易费用

一、基本定义

股票交易费用是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（个人、机构）；
- 3.证券交易所；
- 4.监管辖区、行政区划。

三、相关制度规则

上海、深圳证券交易所《资金清算各项收费标准一览表》
（2012）。

SK-III-6: 股权激励家数

一、基本定义

股权激励家数是指统计期内其股权激励方案获得股东大会通过或实施的上市公司家数。

股权激励方案包括股票期权和限制性授予等形式。

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、中小企业板、创业板）；
- 2.激励方案；
- 3.证券交易所；
- 4.监管辖区、行政区划。

三、指标种类

（一）股权激励公司家数（股东大会通过）

股权激励公司家数（股东大会通过）是指统计期内在股东大会上通过股权激励方案的上市公司家数。以股东大会通过日作为指标统计日。

（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）是指统计期内实施股权激励方案的上市公司家数。以方案实施日作为指标统计日。

四、相关制度规则

《上市公司股权激励管理办法（试行）》（证监公司字〔2005〕151号）。

SK-III-7:重大资产重组家数

一、基本定义

重大资产重组家数是指统计期内实施重大资产重组上市公司的数量。

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.上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
- 2.行业分类；
- 3.证券交易所；
- 4.监管辖区、行政区划。

三、指标说明

重大资产重组家数可选用董事会预案公告日、股东大会批准日、证监会核准日和实施完毕日计算。

四、相关制度规则

《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第73号）。

SK-III-8:重大资产重组金额

一、基本定义

重大资产重组金额是指在统计期内实施重大资产重组的交易金额的合计，包括资产交易金额和配套融资金额。

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、中小企业板、创业板）；
- 2.行业分类；

3.证券交易所;

4.监管辖区、行政区划。

三、指标种类

(一) 重大资产重组金额 (配套融资金额)

配套融资金额是指重大资产重组中发行股份购买资产所涉及的募集配套资金金额。

(二) 重大资产重组金额 (资产交易金额)

资产交易金额是指剔除配套融资金额之外的重大资产重组金额。

四、指标说明

重大资产重组金额可选用董事会预案公告日、股东大会批准日、证监会核准日和实施完毕日计算。

五、相关制度规则

《上市公司重大资产重组管理办法》(证监会令第 73 号)。

SK-IV: 上市公司财务

SK-IV-1: 上市公司净利润总额

一、基本定义

上市公司净利润总额是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 股等);
2. 上市板块 (主板、中小企业板、创业板);
3. 行业分类, 股票指数;
4. 证券交易所;
5. 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解释性公告第 1 号——非经常性损益 (2008)》(证监会公告〔2008〕43 号)。

SK-IV-2: 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是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:

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

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) 计算维度：

1. 股份类型（A 股、B 股等）；
2. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
3. 行业分类，股票指数；
4. 监管辖区、行政区划。

三、指标说明

在对上市板块、行业分类等主题为主的上市公司平均净资产收益率作前后比较时，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-IV-3: 现金分红率

一、基本定义

现金分红率是指预案实施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 股等）；
2. 上市板块（主板、中小企业板、创业板）；
3. 行业分类，股票指数；
4. 证券交易所；
5. 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解释性公告第 1 号——非经常性损益（2008）》（证监会公告〔2008〕43 号）。

SK-V:信用交易

SK-V-1: 信用交易金额

一、基本定义

信用交易金额是指统计期内通过融资融券方式在市场上进行证券交易的金额。

信用交易金额=融资交易金额+融券交易金额
=融资买入金额+卖券还款金额+融资强制平仓金额
+融券卖出金额+买券还券金额+融券强制平仓金额

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、基金等);
2. 业务类型 (融资、融券);
3. 交易方向 (开仓、平仓);
4. 证券交易所、中介机构。

三、指标说明

融资买入、卖券还款、融券卖出、买券还券、融资强制平仓、融券强制平仓等交易指标以交易系统中申报指令的标签为计算基准, 合同约定的其他强制平仓不计算在内。

四、相关制度规则

(一) 《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告〔2011〕31号);

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

(三) 上海、深圳证券交易所《融资融券交易实施细则》(2011);

(四) 《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》(2011)。

SK-V-2: 融资融券余额

一、基本定义

融资融券余额是指统计期末投资者未了结的融资交易和融

券交易的金额。

融资融券余额 融资余额 融券余额

$$= \sum \text{融}(\text{资买入额} - \text{融资偿还额})$$

$$- \sum \text{融}(\text{券卖出量} - \text{融券偿还量})$$

标的的证券统计日收盘价格

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. 证券类别（股票、基金）；
2. 业务类型（融资、融券）；
3. 证券交易所、中介机构。

三、指标说明

(一) 融资偿还包括直接还款、卖券还款、融资强制平仓和融资正负权益调整。

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

(三) 不计利息和费用。

四、相关制度规则

(一) 《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告〔2011〕31号）；

(二) 《证券公司融资融券业务内部控制指引》（证监会公告

(2011) 32 号);

(三) 上海、深圳证券交易所《融资融券交易实施细则》(2011);

(四)《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》(2011)。

SK-V-3: 维持担保比例

一、基本定义

维持担保比例是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:

$$\begin{aligned}\text{维持担保比例} &= \frac{\text{担保品价值}}{\text{融资融券业务负债}} \times 100\% \\ &= \frac{\text{现金} + \sum \text{信用账户证券价值}}{\text{融资余额} + \text{融券余额} + \text{利息和费用}} \times 100\%\end{aligned}$$

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 (个人、机构);
2. 中介机构。

三、指标说明

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

（二）在证券交易所关于维持担保比例的统计中，不考虑现金、利息和其它费用。

四、相关制度规则

（一）《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告〔2011〕31号）；

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

（三）上海、深圳证券交易所《融资融券交易实施细则》（2011）；

（四）《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》（2011）。

SK-V-4: 融资买入金额

一、基本定义

融资买入金额是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、基金等);
2. 投资者类型 (个人、机构);
3. 证券交易所、中介机构。

三、指标说明

融资买入以交易系统中申报指令的标签为计算基准。

四、相关制度规则

(一) 《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告〔2011〕31号);

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

(三) 上海、深圳证券交易所《融资融券交易实施细则》(2011);

(四) 《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》(2011)。

SK-V-5: 融券卖出金额

一、基本定义

融券卖出金额是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、基金等）；

2. 投资者类型（个人、机构）；

3. 证券交易所、中介机构。

三、指标说明

融券卖出以交易系统中申报指令的标签为计算基准。

四、相关制度规则

(一) 《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告〔2011〕31号）；

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

(三) 上海、深圳证券交易所《融资融券交易实施细则》（2011）；

(四) 《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》（2011）。

SK-V-6: 信用交易账户数

一、基本定义

信用交易账户数是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（个人、机构）；
- 2.证券交易所、中介机构。

债券市场

BD-I: 市场规模

BD-I-1: 债券发行只数

一、基本定义

债券发行只数是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。

三、指标说明

（一）本部分所称债券仅指交易所债券市场的债券（下同）。

（二）债券品种分为国债、地方政府债、企业债、公司债、分离债、可转债、私募债、资产支持类债券等，其中公司债一般指经证监会审批的公司债（下同）。

（三）通常债券发行只数以初始登记日计算。另外，也可按发行首日、发行结束日、起息日、上市日等口径统计。

BD-I-2: 债券发行额

一、基本定义

债券发行额是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。

三、指标说明

通常债券发行只数以初始登记日计算。另外,也可按发行首日、发行结束日、起息日、上市日等口径统计。

BD-I-3: 债券托管额

一、基本定义

债券托管额是指统计期末托管在债券登记结算机构的各类债券面额合计。

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. 剩余期限；

3. 利率类型。

三、指标说明

债券登记结算机构指中国证券登记结算有限责任公司。

BD-I-4: 债券上市只数

一、基本定义

债券上市只数是指统计期末在证券交易所上市（含挂牌转让）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. 交易方式（现货、回购）；

5. 证券交易所。

三、指标说明

债券上市只数按债券上市日（挂牌转让日）进行统计。包括债券现货只数和债券回购只数。

BD-I-5: 债券融资金额

一、基本定义

债券融资金额是指统计期内债券发行所募集到的资金总额。

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。

三、指标说明

（一）通常债券融资金额统计范围包括中国证监会审批的公司债券（含证券交易所备案的中小企业私募债）。

（二）债券融资额以初始登记日计算。另外，也可按发行首日、发行结束日、起息日、上市日等口径统计。

BD-I-6: 持债账户数

一、基本定义

持债账户数是指在统计期末持有债券数量(含已转入回购质押库中的债券)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(个人、机构)。

BD-II: 债券交易

BD-II-1: 债券成交金额

一、基本定义

债券成交金额是指统计期内各类债券成交金额合计,包括债券现货成交金额和债券回购成交金额。

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. 交易方式(现货、回购);

2.债券品种;

3.回购品种;

4.中介机构。

三、指标种类

(一) 债券现货成交金额

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

回购成交金额 = Σ (成交量 (回购) $\times$ 1000)

四、指标说明

(一) 现货成交量的单位以张计。

(二) 回购成交量的单位以手计, 每手 10 张。

(三) 债券回购包括质押式回购, 买断式回购, 报价回购, 约定式购回中的债券交易。

BD-II-2: 标准券总额

一、基本定义

标准券总额是指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（质押式回购、报价回购）；
- 2.质押券品种；
- 3.中介机构。

三、相关制度规则

中国证券登记结算有限责任公司《标准券折算率管理办法》（2012）。

BD-II-3: 回购标准券使用率

一、基本定义

回购标准券使用率是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：投资者分类（个人、机构）。

BD-II-4: 回购定盘利率

一、基本定义

回购定盘利率是指以债券回购利率为基础计算出的回购价格参考基准。计算公式为：

$$\text{回购定盘利率} = \frac{\sum \text{回购价格} \times \text{回购成交量}}{\sum \text{回购成交量实}} \times \frac{\text{回购天数}}{\text{实际占用天数}}$$

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

回购未到期金额是指在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（质押式回购、买断式回购、报价回购、约定式购回）。

BD-II-6: 兑付金额

一、基本定义

兑付金额是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。

三、指标种类

兑付金额可分为本金兑付金额和利息兑付金额。

四、指标说明

- (一) 本金兑付金额以到期日计算；利息兑付以付息日计算。
- (二) 债券兑付如果跨期，仅包括统计期内债券的实际兑付金额。

BD-II-7: 本年待偿还债券总额

一、基本定义

本年待偿还债券总额是指本年度尚未偿还的债券本金总额。

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。

三、指标说明

(一)统计范围包括偿还日在统计期内(统计时点至本年末)的债券本金。

(二)永久性债券由于没有规定本金偿还期限,不纳入本年待偿还债券总额统计。

(三)如分期偿还债券的当期偿还日在统计期内,则将应偿还债券金额计入本年待偿还总额。

基金市场

FD-I: 市场规模

FD-I-1: 基金只数

一、基本定义

基金只数是指统计期末基金市场上基金产品的只数。

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.投资类型（股票、债券、混合、货币等）；
- 2.运作类型（封闭、开放、LOF、ETF）；
- 3.基金管理公司。

三、指标说明

（一）自基金合同生效日（基金成立日）纳入统计，自基金合同终止日从统计中剔除。

（二）基金只数一般根据证监会主代码（基金主合同）口径统计。

FD-I-2: 上市基金数

一、基本定义

上市基金数是指统计期末在交易所上市的基金产品的数量。

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.运作类型（LOF、ETF、封闭）；

2.证券交易所。

三、指标说明

（一）自基金在交易所挂牌上市日纳入上市基金数的统计，自终止上市日（摘牌日）从统计中剔除。

（二）上市基金数按交易所挂牌代码统计。

（三）仅在交易所场内申赎的基金不纳入指标统计。

FD-I-3：基金份额

一、基本定义

基金份额是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：月

（二）基本计量单位：份

（三）常用维度：

1.投资类型（股票、债券、混合、货币等）；

2.运作类型（封闭、开放、LOF、ETF）；

3.基金管理公司。

三、指标说明

（一）基金中的基金（FOF）产品、联接基金不纳入份额统计。

（二）对分级基金统计份额时，只计母基金份额。

FD-I-4: 基金资产规模

一、基本定义

基金资产规模是指在统计期末市场上基金产品资产的合计。

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.投资类型（股票、债券、混合、货币等）；
- 2.运作类型（封闭、开放、LOF、ETF）；
- 3.基金管理公司。

三、指标说明

（一）FOF产品、联接基金不纳入资产规模统计。

（二）对统一募集，自动拆分的分级基金统计基金资产规模时，只计母基金资产规模。对分开募集的分级基金统计基金资产规模时，同时统计不同子基金份额的资产规模。

四、相关制度规则

(一)《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字〔2007〕21号);

(二)《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)。

FD-I-5: 上市基金市值

一、基本定义

上市基金市值是指统计期末在交易所上市的基金市值合计。

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.投资类型(股票、债券);

2.运作类型(封闭、LOF、ETF);

3.证券交易所。

FD-I-6: 基金账户数

一、基本定义

基金账户通常称基金TA账户,**基金帐户数**是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（个人、机构）；

2.基金管理公司。

三、指标说明

(一) 基金账户自注册登记人确认登记成功之日起纳入统计。

(二) 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原封闭式基金账户。

FD-I-7: 基金投资者数

一、基本定义

基金投资者数是指统计期末已开立基金账户的投资者的数量。按照“投资者全称且证件代码相同”原则合并的基金投资者数量。

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（个人、机构）；

2.基金管理公司。

FD-I-8: 基金认购金额、基金募集金额

一、基本定义

基金认购金额是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。

基金募集金额是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之和。

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.投资类型(股票、债券、混合、货币);
- 2.运作类型(封闭、开放、LOF、ETF);
- 3.基金管理公司。

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

基金申购金额是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

基金赎回金额是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：月

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

- 1.投资类型（股票、债券、混合、货币）；
- 2.运作类型（开放、LOF、ETF）；
- 3.基金管理公司。

FD-II-2: 上市基金成交金额

一、基本定义

上市基金成交金额是指统计期内在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.运作类型（封闭、ETF、LOF）；
- 2.证券交易所。

FD-II-3: 基金平均折（溢）价率

一、基本定义

基金平均折（溢）价率是指统计期末交易所上市基金市值与其基金资产规模之间的偏离比率。

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

一般将计算数值大于零称为溢价率，小于零成为折价率。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：运作类型（封闭、LOF、ETF）。

FD-III：基金绩效及分红

FD-III-1:基金利润

一、基本定义

基金利润是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。

计算公式：

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.投资类型（股票、债券、混合、货币等）；
- 2.基金管理公司。

FD-III-2:基金分红金额

一、基本定义

基金分红金额是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.投资类型（股票、债券、混合、货币等）；
- 2.基金管理公司。

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)《证券投资基金运作管理办法》（证监会令第79号）；

(二)《货币市场基金管理暂行规定》（证监发〔2004〕78号）；

(三)《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》（证监

基金字〔2005〕41号）。

FD-III-3:基金总持有成本

一、基本定义

基金总持有成本是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、申购（认购）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.投资类型（股票、债券、混合、货币等）；
- 2.基金管理公司；
- 3.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，是指由单个持有人承担，从其资金账户中扣除，用于完成各项交易的费用，主要包括申购（认购）费、赎回费和基金转换费等。

（二）基金运营费用，是指由所有持有人承担，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

露费、审计费、律师费和上市年费等)。

四、相关制度规则

- (一)《证券投资基金运作管理办法》(证监会令第79号);
- (二)《证券投资基金销售管理办法》(证监会令第72号);
- (三)《货币市场基金管理暂行规定》(证监发〔2004〕78号);
- (四)《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字〔2005〕41号)。

FD-IV: QFII 等指标

FD-IV-1: QFII 家数、RQFII 家数、QDII 家数

一、基本定义

QFII 家数是指统计期末合格境外机构投资者的数量。

RQFII 家数是指统计期末人民币合格境外机构投资者的数量。

QDII 家数是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: 投资者地区。

三、相关制度规则

- (一)《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》(证

监会令第 36 号);

(二)《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资者试点办法》(证监会令第 76 号);

(三)《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-IV-2: QFII 额度、RQFII 额度、QDII 额度

一、基本定义

QFII 额度是指统计期末国家外汇管理局批准合格境外机构投资者投资境内证券市场的投资额度。

RQFII 额度是指国家外汇管理局批准人民币合格境外机构投资者投资境内证券市场的投资额度。

QDII 额度是指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)常用维度: 投资者地区。

三、相关制度规则

(一)《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》(证监会令第 36 号);

(二)《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者

者境内证券投资者试点办法》（证监会令第 76 号）；

（三）《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）。

期货市场

FS-I: 市场规模

FS-I-1: 保证金

一、基本定义

保证金是指期货交易者按照规定标准缴纳的资金,用于结算和保证履约。

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。

三、指标种类

按照保证金的不同类别划分,主要有以下 4 种保证金指标:

(一) 交易保证金

交易保证金是指统计期末已被合约占用的保证金。

$$TM = CV \times MR$$

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

结算准备金是指统计期末未被合约占用的保证金。

$$SM = \begin{cases} MB & MB \geq MM \\ MM & MB < MM \end{cases}$$

其中：

SM—结算准备金

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

（三）交易所保证金总额

交易所保证金总额是指统计期末会员按规定向交易所缴纳用于结算和保证履约的资金总额。

$$M = TM + SM$$

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

追加保证金是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，两者的差额。

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

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

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

其中，商品期货合约交易单位和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，但交易所可根据市场情况调整各合约交易保证金标准。

（三）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。

1.商品期货结算准备金余额=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 + 当日实际可用充抵金额 - 上一交易日实际可用充抵金额 + 当日盈亏 + 入金 - 出金 - 手续费等；

2. 股指期货结算准备金余额 = 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 + 当日盈亏 + 入金 - 出金 - 手续费等。

(四) 只有交易保证金能细分到期货品种和合约类别进行计算。

(五) 对一组合约保证金的计算, 采用各合约的保证金合计。

五、相关制度规则

(一) 上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《结算细则》;

(二) 上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《风险管理办法》。

FS-I-2: 期货会员机构数

一、基本定义

期货会员机构数是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

上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《会员管理办法》。

FS-I-3： 期货账户数

一、基本定义

期货账户数是指统计期末在中国期货保证金监控中心公司办理登记的期货账户数量合计。

二、统计属性

(一) 基本频度：月

(二) 基本计量单位：户

(三) 常用维度：期货交易所。

三、指标种类

（一）新开账户数

新开账户数是指统计期内新开立的账户数量。

（二）有效账户数

有效账户数是指在统计期末期货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

单位客户账户数是指统计期末已登记的单位客户账户数量。

四、指标说明

（一）休眠账户由中国期货保证金监控中心公司根据以下条件进行认定：1.开户时间一年以上；2.最近一年以上无持仓；3.最近一年以上无交易（含一年）；4.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）逾期未规范账户是指在账户规范工作规定的时间内，资料未上报中国期货保证金监控中心公司，未通过监控中心和期货交易所检查或反馈未成功的历史账户。

（三）单位客户账户是指以单位客户名义递交开户申请，通过期货交易所审批并获取客户交易编码的账户。证券公司、基金管理公司、信托公司和其他金融机构，以及社会保障类公司、合格境外机构投资者等属单位客户。

五、相关制度规则

《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2012〕1号）。

FS-I-4: 客户数

一、基本定义

客户数是指统计期末已在期货市场开户，按照“客户全称相同且证件代码相同”原则合并的客户数量。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：个

（三）常用维度：

1.客户类型（单位、个人）；

2.期货交易所。

三、相关制度规则

（一）《关于开展期货市场账户规范工作的决定》（证监会公告〔2011〕20号）；

（二）《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2012〕1号）；

（三）《期货公司管理办法》（证监会令第43号）。

FS-II: 期货交易

FS-II-1: 涨跌幅

一、基本定义

涨跌幅是指统计期内期货合约的结算价（收盘价）与前结算价变动幅度。

二、统计属性

- (一) 基本频度：日
- (二) 基本计量单位：%
- (三) 常用维度：
 - 1. 合约类别；
 - 2. 期货品种。

三、指标种类

- (一) 涨跌幅（结算价）

$$\text{CHG} = \frac{S_{tm} - S_{t0-1}}{S_{t0-1}} \times 100\%$$

其中：

CHG—涨跌幅

S_{tm} —区间最后交易日结算价

S_{t0-1} —区间前一交易日结算价

- (二) 涨跌幅（收盘价）

$$\text{CHG} = \frac{P_{tm} - S_{t0-1}}{S_{t0-1}} \times 100\%$$

其中：

CHG—涨跌幅

P_{tm} —区间最后交易日收盘价

S_{t0-1} —区间前一交易日结算价

四、指标说明

（一）合约收盘价、合约结算价的定义见各期货交易所有关规则。

（二）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。

（三）主力合约通常选用统计期末各期限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且持仓量最大的合约为主力合约。

（四）若统计期包括主力合约挂牌日，则区间前一交易日结算价取合约挂牌价。

（五）若区间前一交易日主力合约无成交记录，则选取期初最近有成交记录的交易日的结算价为区间前一交易日结算价。

五、相关制度规则

（一）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《结算细则》；

（二）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-2: 振幅

一、基本定义

振幅是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结算价的相对变动幅度来计算。

$$APT = \frac{HP - LP}{S_{t0-1}} \times 100\%$$

其中：

APT—振幅

HP—区间内合约最高价

LP—区间内合约最低价

S_{t0-1} —区间前一交易日合约结算价

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.合约类别；

2.期货品种。

三、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取合约挂牌价。

（三）若区间前一交易日主力合约无成交记录，选取期初最近有成交记录的交易日的结算价为区间前一交易日结算价。

（四）主力合约的选取原则参见涨跌幅的指标说明。

四、相关制度规则

（一）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《结算细则》；

（二）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-3: 成交量

一、基本定义

成交量是指统计期内全部期货合约成交数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：手

（三）常用维度：

1.期货品种；

2.合约类别；

3.期货交易所。

三、指标说明

期货品种的成交量为统计期内该品种全部期限合约的成交量合计。

四、相关制度规则

上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-4: 成交金额

一、基本定义

成交金额指统计期内全部期货合约成交金额合计。

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.期货品种；
- 2.合约类别；
- 3.期货交易所。

三、指标说明

期货品种的成交金额为统计期内该品种全部期限合约的成交金额合计。

四、相关制度规则

上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-5: 持仓量

一、基本定义

持仓量是指统计期末未平仓期货合约数量的合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

(二) 基本计量单位：手

(三) 常用维度：

1. 期货品种；

2. 合约类别；

3. 期货交易所。

三、指标说明

(一) 未平仓合约是指投资者持有的，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限合约的持仓量合计值。

(三) 期货市场的持仓量为统计期末全部期货品种的持仓量合计值。

四、相关制度规则

上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-6: 持仓金额

一、基本定义

持仓金额是指统计期末未平仓期货合约的金额合计。

$$VOI = \sum_{i=1}^n (OI_{i,t} \times TU_{i,t} \times S_{i,t})$$

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

$S_{i,t}$ —第 i 只期货合约结算价格

i—第 i 只期货合约

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.期货品种；
- 2.合约类别；
- 3.期货交易所。

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限合约的持仓金额合计值。

（二）期货市场的持仓金额为统计期末全部期货品种的持仓金额合计值。

（三）商品期货合约统计采用历史期货交易发生时的交易单

位，股指期货合约统计采用历史期货交易发生时的合约乘数。

四、相关制度规则

上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-7: 基差

一、基本定义

基差是指统计期末商品的现货价格与该商品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
- (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）是指现货价格减去期货主力合约的日结算价。

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）是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

金融期货中沪深 300 指数合约对应的现货价格为沪深 300 指数点位。

商品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、相关制度规则

（一）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《结算细则》；

（二）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《交易细则》。

FS-II-8: 交割量

一、基本定义

交割是指期货投资者了结到期未平仓合约的过程，交割量即进行交割的期货合约数量。

交割量 = 交割合约数量 × 合约单位

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：手、吨等

（三）常用维度：期货品种。

三、指标说明

期货品种的交割量为统计期内该品种全部期限合约的交割量合计。

四、相关制度规则

（一）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所《交割细则》；

（二）《中国金融期货交易所结算细则》（2010）。

FS-II-9：交割率

一、基本定义

交割率是指统计期内期货品种的交割量与成交量的比率。

$$\text{交割率} = \frac{\text{交割量}}{\text{合约挂牌后总成交量}} \times 100\%$$

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、指标说明

合约挂牌后总成交量指统计期内该品种完成交割的全部期货合约在其挂牌周期内成交量合计。

四、相关制度规则

（一）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所《交割细则》；

(二) 中国金融期货交易所《结算细则》。

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。

$$LR = \frac{\sum_{i=1}^n OA_i}{\sum_{i=1}^n TM_i} \times 100\%$$

其中：

LR—杠杆率

OA—持仓金额

TM_i—交易保证金

i—期货合约样本

n—期货合约样本数量

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；
3. 期货交易所。

三、相关制度规则

（一）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所《结算细则》，中国金融期货交易所《结算细则》；

（二）上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所《风险管理办法》。

FS-II-11: 单位客户持仓占比

一、基本定义

单位客户持仓占比是指单位客户账户持仓占期货市场持仓的比例。

二、统计属性

（一）指标频度：月

（二）计量单位：%

（三）常用维度：

- 1.多空方向；
- 2.期货品种；
- 3.合约类别；
- 4.期货交易所。

三、指标种类

按照单位客户持仓分类不同，主要有以下 3 种指标：

（一）单位客户持多（空）仓量占比

单位客户持多（空）仓量占比是指统计期末单位客户账户持

多（空）仓占期货市场持多（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）仓金额占比是指统计期末单位客户账户持多（空）仓金额占期货市场持多（空）仓金额的比例。

（三）单位客户日均持多（空）仓占比

单位客户日均持多（空）仓占比是指统计期内单位客户账户日均持多（空）仓量（或金额）占期货市场日均持多（空）仓量（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 627 号）；

（二）《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2012〕1 号）。

经营机构

PI-I: 机构规模

PI-I-1: 证券公司家数

一、基本定义

证券公司家数是指统计期末已获得中国证监会颁发经营证券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.证券公司分类结果。

三、指标说明

证券公司家数以获得经营证券业务许可证为标准，已办理机构注销的证券公司从统计中剔除。

四、相关制度规则

《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2010〕17号）。

PI-I-2: 证券营业部家数

一、基本定义

证券营业部家数是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营业网点数量合计。

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.证券公司；
- 2.证券公司分类结果；
- 3.监管辖区、行政区划。

三、指标说明

证券营业部家数以获得经营证券业务许可证为标准，已办理机构注销的证券营业部从统计中剔除。

四、相关制度规则

《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2010〕17号）。

PI-I-3： 证券公司分公司家数

一、基本定义

证券公司分公司家数是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分公司数量合计。

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.证券公司；

- 2.证券公司分类结果;
- 3.监管辖区、行政区划。

三、相关制度规则

《证券公司分类监管规定》(证监会公告〔2010〕17号)。

PI-I-4: 基金管理公司家数

一、基本定义

基金管理公司家数是指统计期末经中国证监会批准,并获得基金管理资格证书的基金管理公司的数量合计。

二、统计属性

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

三、指标说明

基金管理公司家数以获得基金管理资格证书为标准,已办理取消基金管理资格证书的基金管理公司从统计中剔除。

PI-I-5: 期货公司家数

一、基本定义

期货公司家数是指统计期末经中国证监会批准,并获得中国证监会颁发经营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.期货公司分类结果。

三、指标说明

期货公司家数以获得经营期货业务许可证为标准，已办理机构注销的期货公司从统计中剔除。

四、相关制度规则

《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2011〕9号）。

PI-I-6： 期货营业部家数

一、基本定义

期货营业部家数是指统计期末经中国证监会批准，依法设立的从事期货业务的营业网点数量合计。

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.期货公司

2.期货公司分类结果；

3.监管辖区、行政区划。

三、指标说明

期货营业部家数以获得经营期货业务许可证为标准，已办理机构注销的期货营业部从统计中剔除。

四、相关制度规则

《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2011〕9号）。

PI-I-7: 就业人员数量

一、基本定义

就业人员数是指统计期末在证券公司、基金管理公司和期货公司工作的人员数量合计。

二、统计属性

（一）基本频度：月

（二）基本计量单位：人

（三）常用维度：

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

PI-II: 机构财务

PI-II-1: 总资产

一、基本定义

总资产是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.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司）；

2.监管辖区、行政区划。

三、指标说明

（一）证券期货经营机构包括证券公司、基金管理公司、期货公司。

（二）总资产和本指引中其他财务数据来自各机构的财务报表，具体计算标准参见《企业会计准则》、《证券公司年度报告内容与格式准则（2008年修订）》（证监会公告〔2008〕1号）等。

PI-II-2： 净资产

一、基本定义

净资产是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.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司）；

2.监管辖区、行政区划。

PI-II-3： 平均财务杠杆

一、基本定义

平均财务杠杆是指统计期末证券期货经营机构总资产与净资产的比率。

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

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。包括手续费及佣金净收入、受托客户资产管理业务净收入、利息净收入、投资收益、公允价值变动收益、汇兑净收益及其他业务收入等。

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

PI-II-5: 营业支出

一、基本定义

营业支出是指统计期内证券期货经营机构营业支出金额的合计。

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

PI-II-6: 利润总额

一、基本定义

利润总额是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.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司）；
- 2.监管辖区、行政区划。

PI-II-7： 净利润

一、基本定义

净利润是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.机构类型（证券公司、基金管理公司、期货公司）；
- 2.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

净资本总额是指统计期末证券公司和期货公司净资本金额的合计。

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.机构类型（证券公司、期货公司）；
- 2.证券公司分类结果、期货公司分类结果。

三、指标说明

证券公司净资本的计算参见《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第55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试行办法》（证监发〔2007〕55号）和相关规定。

PI-III-2: 证券公司风险资本准备总额

一、基本定义

证券公司风险资本准备总额是指统计期末全部证券公司风险资本准备的合计。

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；
 - 2.证券公司分类结果。

三、指标说明

单个证券公司风险资本准备参见证券公司风险资本准备计算表中“各项风险资本准备之和”。

四、相关制度规则

《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》（证监会公告〔2012〕36号）。

PI-III-3: 证券公司风险覆盖率

一、基本定义

证券公司风险覆盖率是指统计期末证券公司净资本总额与各项风险资本准备总额的比率。

证券公司风险覆盖率 = （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.证券公司分类结果；
- 2.监管辖区、行政区划。

PI-IV: 机构业务

PI-IV-1: 客户托管资产总额

一、基本定义

客户托管资产总额是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.证券公司、营业部；
- 2.投资者类别（个人、机构）；
- 3.监管辖区、行政区划。

三、指标说明

(一) 客户托管市值是指投资者委托给证券公司保管的其所持有证券市值。

(二) 证券公司客户托管市值不包括其出租交易单元上的证券市值。

(三) 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

代理买卖证券总额是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. 证券品种 (股票、基金、债券等);
2. 监管辖区、行政区划。

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: 资产管理业务规模

一、基本定义

资产管理业务规模是指统计期末证券公司、基金管理公司和期货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. 机构类型 (证券公司、基金管理公司、期货公司);
2. 监管辖区、行政区划。

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是指统计期末由期货公司代理进行期货交易的客户的资产总额合计，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.期货公司；
- 2.期货公司分类结果；
- 3.监管辖区、行政区划。

附录一：涨跌幅速算公式

公式一：区间分段涨跌幅的几何连乘

通常情况下， $\text{PreClose}_i = \text{Close}_{i-1}$ ，除非交易日 i 为除权日。因此公式可以简化为：

$$R = \left(\prod_{j=1}^n \left(\frac{P_{\text{close},jt}}{P_{\text{preclose},j1}} \right) - 1 \right) \times 100\%$$

其中：

R —涨跌幅

j —期间内第 j 个区间

其中：时间段内首个区间为时段起始交易日至起始交易日后首个除权日，其余区间均为以除权日为边界的左闭右开区间。

$P_{\text{close},jt}$ —第 j 个区间内最后一个交易日的收盘价

$P_{\text{preclose},j1}$ —第 j 个区间内第一个交易日的前收盘价

公式二：复权价涨跌幅

$$R = \left(\frac{P_{\text{close},i,\text{adj}}}{P_{\text{preclose},1,\text{adj}}} - 1 \right) \times 100\%$$

其中：

R —涨跌幅

$P_{\text{close},i,\text{adj}}$ —时段最后一个交易日的复权收盘价

$P_{\text{preclose},1,\text{adj}}$ —时段第一个交易日的复权前收盘价

个股复权方法如下：

$$P_{\text{close},i,\text{adj}} = P_{\text{close},i} \times AF_i$$
$$P_{\text{preclose},i,\text{adj}} = P_{\text{preclose},i} \times AF_i$$

其中

$$AF_i = \frac{P_{\text{close},i-1}}{P_{\text{preclose},i}} \times AF_{i-1}$$

其中：

AF_0 —上市首日复权因子初始值为 1，即 $AF_0 = 1$

AF_i —第 i 个交易日的复权因子

AF_{i-1} —第 $i-1$ 个交易日的复权因子

$P_{\text{close},i-1}$ —第 $i-1$ 个交易日的收盘价

$P_{\text{preclose},i}$ —第 i 个交易日的前收盘价

$P_{\text{close},i,\text{adj}}$ —第 i 个交易日的复权收盘价

$P_{\text{preclose},i,\text{adj}}$ —第 i 个交易日的复权前收盘价

该复权价算法可使公式二与公式一等价。

附录二：相关制度规则

- (一) 《中华人民共和国公司登记管理条例》(国务院令第 451 号);
- (二) 《期货交易管理条例》(国务院令第 627 号);
- (三) 《证券投资基金信息披露管理办法》(证监会令第 19 号);
- (四) 《上市公司证券发行管理办法》(证监会令第 30 号);
- (五) 《首次公开发行股票并上市管理办法》(证监会令第 32 号);
- (六) 《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》(证监会令第 36 号);
- (七) 《期货公司管理办法》(证监会令第 43 号);
- (八) 《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);
- (九) 《证券公司风险控制指标管理办法》(证监会令第 55 号);
- (十) 《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);
- (十一) 《证券期货市场统计管理办法》(证监会令第 60 号);
- (十二) 《首次公开发行股票并在创业板上市管理暂行办法》(证监会令第 61 号);
- (十三) 《证券登记结算管理办法》(证监会令第 65 号);
- (十四) 《证券投资基金销售管理办法》(证监会令第 72 号);

- (十五) 《上市公司重大资产重组管理办法》(证监会令第 73 号);
- (十六) 《基金管理公司、证券公司人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》(证监会令第 76 号);
- (十七) 《证券投资基金运作管理办法》(证监会令第 79 号);
- (十八) 《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》(证监会令第 83 号);
- (十九) 《证券投资基金管理公司管理办法》(证监会令第 84 号);
- (二十) 《商业银行设立基金管理公司试点管理办法》(证监会公告〔2005〕4 号);
- (二十一) 《证券公司年度报告内容与格式准则(2008 年修订)》(证监会公告〔2008〕1 号);
- (二十二) 《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 1 号〈季度报告〉》(证监会公告〔2008〕36 号);
- (二十三) 《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益(2008)》(证监会公告〔2008〕43 号);
- (二十四) 《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);
- (二十五) 《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》(证监会公告〔2010〕5 号);
- (二十六) 《证券公司分类监管规定》(证监会公告〔2010〕17 号);

- (二十七) 《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 4 号〈基金合同生效公告及十一类临时公告(试行)〉》(证监会公告〔2010〕32 号);
- (二十八) 《期货公司分类监管规定》(证监会公告〔2011〕9 号);
- (二十九) 《关于开展期货市场账户规范工作的决定》(证监会公告〔2011〕20 号);
- (三十) 《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告〔2011〕31 号);
- (三十一) 《证券公司融资融券业务内部控制指引》(证监会公告〔2011〕32 号);
- (三十二) 《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 2 号〈净值公告〉》(证监会公告〔2012〕5 号);
- (三十三) 《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》(证监会公告〔2012〕36 号);
- (三十四) 《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);
- (三十五) 《货币市场基金管理暂行规定》(证监发〔2004〕78 号);
- (三十六) 《期货公司金融期货结算业务试行办法》(证监发〔2007〕54 号);
- (三十七) 《期货公司风险监管指标管理试行办法》(证监发〔2007〕55 号);

- (三十八) 《期货市场客户开户管理规定》(证监会公告〔2012〕1号);
- (三十九) 《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);
- (四十) 《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字〔2005〕41号);
- (四十一) 《关于上市公司股份分类有关业务处理事项的通知》(证监市场字〔2000〕8号);
- (四十二) 《关于社会保障基金理事会委托投资涉及的证券账户、交易席位和结算资金账户有关问题的通知》(证监市场字〔2002〕3号);
- (四十三) 《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字〔2007〕21号);
- (四十四) 《上市公司股权激励管理办法(试行)》(证监公司字〔2005〕151号);
- (四十五) 《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第15号—权益变动报告书》(证监公司字〔2006〕156号);
- (四十六) 《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》(证监公司字〔2007〕98号);
- (四十七) 《全国社会保障基金投资管理暂行办法》(财政部、劳动和社会保障部令〔2001〕12号);

- (四十八) 《企业年金管理办法》(人力资源社会保障部令〔2011〕11号);
- (四十九) 《关于划分企业登记注册类型的规定》(国统字〔2011〕86号);
- (五十) 《高新技术企业认定管理办法》(国科发火〔2008〕172号);
- (五十一) 《上市公司国有股东标识管理暂行规定》(国资发产权〔2007〕108号);
- (五十二) 《郑州商品交易所风险控制管理办法》(2003);
- (五十三) 《深圳证券交易所上市开放式基金业务指引》(2005);
- (五十四) 《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》(2006);
- (五十五) 《中国证券登记结算有限责任公司证券登记规则》(2006);
- (五十六) 中国证券登记结算有限责任公司《关于进一步规范账户管理工作的通知》(2007);
- (五十七) 《上海证券交易所证券投资基金上市规则(修订稿)》(2007);
- (五十八) 《上海期货交易所会员管理办法》(2008);
- (五十九) 《郑州商品交易所会员管理办法》(2009);
- (六十) 《郑州商品交易所期货交易细则》(2009);
- (六十一) 《中国金融期货交易所会员管理办法》(2010);
- (六十二) 《中国金融期货交易所交易细则》(2010);

- (六十三) 《中国金融期货交易所结算细则》(2010);
- (六十四) 《上海期货交易所结算细则》(2011);
- (六十五) 《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》(2011);
- (六十六) 上海、深圳证券交易所《融资融券交易实施细则》(2011);
- (六十七) 中证指数公司《沪深 300 指数编制细则》(2012);
- (六十八) 《上海证券交易所交易规则》(2012);
- (六十九) 《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》(2012);
- (七十) 上海、深圳证券交易所《资金清算各项收费标准一览表》(2012);
- (七十一) 《深圳证券交易所交易规则》(2012);
- (七十二) 《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》(2012);
- (七十三) 中国证券登记结算有限责任公司《标准券折算率管理办法》(2012);
- (七十四) 《上海期货交易所风险控制管理办法》(2012);
- (七十五) 《上海期货交易所交易细则》(2012);
- (七十六) 《大连商品交易所风险管理办法》(2012);
- (七十七) 《大连商品交易所交易细则》(2012);
- (七十八) 《大连商品交易所结算细则》(2012);

(七十九) 《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》
(2012);

(八十) 《郑州商品交易所期货结算细则》(2012);

(八十一) 《中国金融期货交易所风险控制管理办法》(2012)。