

证券期货业统计指标 标准指引

（2019 年修订）

总目录.....	1
编制说明.....	12
股票市场.....	14
SK-I: 市场规模.....	14
SK-I-1: 上市公司家数.....	14
SK-I-2: 上市公司股本.....	16
SK-I-3: 股票筹资公司家数.....	18
SK-I-4: 股票筹资金额.....	22
SK-I-5: 股票市值.....	25
SK-I-6: 上市公司市值.....	27
SK-I-7: 股票账户数.....	28
SK-I-8: 股票投资者数.....	31
SK-II: 股票交易.....	32
SK-II-1: 涨跌幅.....	32
SK-II-2: 振幅.....	34
SK-II-3: 成交量.....	36
SK-II-4: 成交金额.....	37
SK-II-5: 换手率.....	37
SK-II-6: 市盈率.....	40
SK-II-7: 市净率.....	43
SK-II-8: 账户持股市值.....	45
SK-II-9: 股票账户买卖净额.....	46

SK-II-10: 破净比例.....	47
SK-II-11: 破净率.....	48
SK-II-12: 平均股价.....	49
SK-III: 功能与影响.....	50
SK-III-1: 证券化率.....	50
SK-III-2: 上市公司上缴税费总额.....	51
SK-III-3: 上市公司现金分红总额.....	52
SK-III-4: 股息率.....	54
SK-III-5: 股票交易费用.....	56
SK-III-6: 股权激励家数.....	56
SK-IV: 上市公司财务.....	58
SK-IV-1: 上市公司净利润总额.....	58
SK-IV-2: 上市公司平均净资产收益率.....	58
SK-IV-3: 现金分红率.....	60
SK-IV-4: 上市公司平均资产负债率.....	61
SK-IV-5: 上市公司平均总资产收益率.....	62
SK-V: 信用交易.....	63
SK-V-1: 融资融券交易金额.....	63
SK-V-2: 融资融券余额.....	64
SK-V-3: 维持担保比例.....	66
SK-V-4: 融资买入金额.....	67
SK-V-5: 融券卖出金额.....	68

SK-V-6: 信用证券账户数.....	69
SK-V-7: 信用交易客户数.....	70
SK-V-8: 转融通交易金额.....	70
SK-V-9: 转融通归还金额.....	71
SK-V-10: 转融通期末余额.....	72
SK-V-11: 转融通保证金余额.....	73
SK-V-12: 转融通保证金比例.....	74
SK-VI: 新股发行.....	75
SK-VI-1: 平均超募比率.....	75
SK-VI-2: 平均首发价格.....	76
SK-VI-3: 平均网上发行中签率.....	77
SK-VI-4: 新股破发率.....	78
SK-VI-5: 老股转让数量.....	80
SK-VI-6: 老股转让比例.....	80
SK-VI-7: 老股转让金额.....	82
SK-VII: 股票质押式回购.....	83
SK-VII-1: 质押率.....	84
SK-VII-2: 质押比例.....	83
SK-VII-3: 股票质押式回购成交金额.....	84
SK-VII-4: 待购回金额.....	85
SK-VII-5: 履约保障比例.....	86
SK-VIII: 上市公司并购重组.....	86

SK-VIII-1: 上市公司并购重组家数.....	86
SK-VIII-2: 上市公司并购重组金额.....	88
SK-VIII-3: 上市公司收购家数.....	89
SK-VIII-4: 上市公司收购金额.....	92
SK-VIII-5: 上市公司资产重组家数.....	93
SK-VIII-6: 上市公司资产重组金额.....	96
SK-VIII-7: 上市公司合并家数.....	98
SK-VIII-8: 上市公司合并金额.....	100
SK-VIII-9: 上市公司分立分拆家数.....	102
SK-VIII-10: 上市公司分立分拆金额.....	103
SK-VIII-11: 上市公司股份回购家数.....	105
SK-VIII-12: 上市公司股份回购金额.....	106
SK-IX: 沪（深）港通交易.....	107
SK-IX-1: 沪股通股票只数、深股通股票只数、沪港通下的港股 通股票只数、深港通下的港股通股票只数.....	107
SK-IX-2: 沪股通买入金额、深股通买入金额、沪港通下的港股 通买入金额、深港通下的港股通买入金额.....	108
SK-IX-3: 沪股通卖出金额、深股通卖出金额、沪港通下的港股 通卖出金额、深港通下的港股通卖出金额.....	110
SK-IX-4: 账户持沪股通股票市值、账户持深股通股票市值、账 户持沪港通下的港股通股票市值、账户持深港通下的港 股通股票市值.....	110

SK-X: 优先股.....	112
SK-X-1: 优先股公司家数.....	112
SK-X-2: 优先股股本.....	114
SK-X-3: 优先股市值.....	115
SK-X-4: 优先股筹资公司家数.....	116
SK-X-5: 优先股筹资金额.....	117
SK-X-6: 优先股成交量.....	118
SK-X-7: 优先股成交金额.....	119
SK-X-8: 优先股股息总额.....	121
SK-X-9: 优先股股息率.....	122
SK-XI: 股票期权.....	124
SK-XI-1: 期权保证金.....	124
SK-XI-2: 期权成交量.....	126
SK-XI-3: 期权成交金额.....	126
SK-XI-4: 期权持仓量.....	127
SK-XII: 科创板.....	128
SK-XII-1: 科创板企业研发投入总额.....	128
SK-XII-2: 科创板企业研发投入占比.....	129
SK-XII-3: 科创板企业研发员工占比.....	129
SK-XII-4: 科创板企业营业收入总额.....	130
债券市场.....	131
BD-I: 市场规模.....	131

BD-I-1: 债券发行只数.....	131
BD-I-2: 债券发行额.....	132
BD-I-3: 债券托管额.....	132
BD-I-4: 债券上市只数.....	133
BD-I-5: 债券发行金额.....	134
BD-I-6: 持债账户数.....	135
BD-II: 债券交易.....	136
BD-II-1: 债券成交金额.....	136
BD-II-2: 标准券总额.....	137
BD-II-3: 回购标准券使用率.....	137
BD-II-4: 回购定盘利率.....	138
BD-II-5: 回购未到期金额.....	138
BD-II-6: 兑付金额.....	139
BD-II-7: 本年待偿还债券总额.....	140
BD-II-8: 债券平均收益率.....	141
基金市场.....	143
FD-I: 市场规模.....	143
FD-I-1: 基金只数.....	143
FD-I-2: 上市基金只数.....	143
FD-I-3: 基金份额.....	144
FD-I-4: 基金资产总值.....	145
FD-I-5: 上市基金市值.....	146

FD-I-6: 基金账户数.....	146
FD-I-7: 基金投资者数.....	147
FD-I-8: 基金认购金额、基金募集金额.....	147
FD-I-9: 基金资产净值.....	148
FD-II: 基金交易.....	149
FD-II-1: 基金申购金额、基金赎回金额.....	150
FD-II-2: 上市基金成交金额.....	150
FD-II-3: 基金平均折（溢）价率.....	151
FD-III: 基金绩效及分红.....	151
FD-III-1: 基金利润.....	151
FD-III-2: 基金分红金额.....	152
FD-III-3: 基金总持有成本.....	153
FD-IV: QFII 等指标.....	154
FD-IV-1: QFII 家数、RQFII 家数、QDII 家数.....	154
FD-IV-2: QDII 额度.....	155
FD-V: 私募基金.....	156
FD-V-1: 私募基金只数.....	156
FD-V-2: 私募基金管理人家数.....	157
FD-V-3: 私募基金资产规模.....	158
期货市场.....	160
FS-I: 市场规模.....	160
FS-I-1: 保证金.....	160

FS-I-2: 期货会员机构数.....	163
FS-I-3: 期货账户数.....	164
FS-I-4: 客户数.....	165
FS-II: 期货交易.....	166
FS-II-1: 涨跌幅.....	166
FS-II-2: 振幅.....	168
FS-II-3: 成交量.....	170
FS-II-4: 成交金额.....	171
FS-II-5: 持仓量.....	172
FS-II-6: 持仓金额.....	173
FS-II-7: 基差.....	174
FS-II-8: 交割量.....	176
FS-II-9: 交割率.....	176
FS-II-10: 杠杆率.....	177
FS-II-11: 单位客户持仓占比.....	178
FS-III: 期货期权.....	180
FS-III-1: 期权保证金.....	180
FS-III-2: 期权成交量.....	180
FS-III-3: 期权成交金额.....	181
FS-III-4: 期权持仓量.....	182
经营机构.....	184
PI-I: 机构规模.....	184

PI-I-1: 证券公司家数.....	184
PI-I-2: 证券营业部家数.....	184
PI-I-3: 证券公司分公司家数.....	185
PI-I-4: 基金管理人家数.....	186
PI-I-5: 期货公司家数.....	187
PI-I-6: 期货公司分支机构家数.....	188
PI-I-7: 就业人员数量.....	188
PI-I-8: 基金管理公司子公司家数.....	189
PI-I-9: 证券公司子公司家数.....	190
PI-II: 机构财务.....	190
PI-II-1: 总资产.....	190
PI-II-2: 净资产.....	191
PI-II-3: 平均财务杠杆.....	191
PI-II-4: 营业收入.....	192
PI-II-5: 营业支出.....	193
PI-II-6: 利润总额.....	193
PI-II-7: 净利润.....	193
PI-III: 风险控制.....	194
PI-III-1: 净资本总额.....	194
PI-III-2: 风险资本准备总额.....	195
PI-III-3: 风险覆盖率.....	197
PI-III-4: 证券公司资本杠杆率.....	198

PI-III-5: 证券公司流动性覆盖率.....	198
PI-III-6: 证券公司净稳定资金率.....	199
PI-IV: 机构业务.....	200
PI-IV-1: 客户托管资产总额.....	200
PI-IV-2: 代理买卖证券总额.....	201
PI-IV-3: 资产管理业务规模.....	201
PI-IV-4: 期货公司客户权益总额.....	202
股转系统.....	204
NQ-I: 市场规模.....	204
NQ-I-1: 挂牌公司家数.....	204
NQ-I-2: 挂牌公司股本.....	205
NQ-I-3: 股票发行家数.....	207
NQ-I-4: 股票发行次数.....	208
NQ-I-5: 股票筹资金额.....	209
NQ-I-6: 挂牌公司股票市值.....	209
NQ-I-7: 股转系统股票账户数.....	211
NQ-I-8: 挂牌公司并购重组家数.....	213
NQ-I-9: 挂牌公司并购重组金额.....	215
NQ-II: 股票转让.....	216
NQ-II-1: 市盈率.....	216
NQ-II-2: 做市商家数.....	219
统计分类标准.....	220

1.公司控股情况分类标准.....	220
2.股票投资者分类标准.....	226
附录：相关制度规则.....	233

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。

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（以下简称股转系统）、统计分类标准和附录八大部分。

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、本指引期货市场所有指标均按单边计算。其他非期货市场部分所涉及的成交量、成交金额按单边计算，交易量、交易金

额按双边计算。

九、本指引中除“证券营业部家数”、“证券公司分公司家数”、“基金管理人家数”、“基金管理公司子公司家数”和“期货公司分支机构家数”等指标中涉及监管辖区维度按机构所在地口径划分外，其他指标均按机构注册地口径划分。

十、本指引中所用 B 股汇率每周调整一次，使用上周五外管局对外公布的汇率中间价。

十一、本指引所涉及的全市场指标，其计算结果由中国证监会市场监管部对外提供和公布。

十二、本指引的上市公司行业分类、公司控股类型、投资者分类分别参照中国证监会《上市公司行业分类指引》、“统计分类标准”项下《公司控股情况分类标准》和《股票投资者分类标准》。

十三、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部与相关报送单位商定临时解决方案。

十四、中国证监会市场监管部定期对本指引进行修订。

十五、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）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.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 1 家计算。

（三）是否发行优先股的上市公司家数以优先股上市/挂牌日进行统计。

（四）红筹企业是指按照《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。

（五）特殊股权结构企业是指按照《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。

SK-I-2：上市公司股本

一、基本定义

上市公司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合计，其中上市公司在境内发行的股份包括 A 股股本、B 股股本、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。

其他不流通股股本是指纯 B 股公司的非流通股数量。

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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 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

限售股本是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，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

（一）上市公司股本以上市日为统计指标计算日。

（二）科创板战略投资者在承诺的持有期限内，通过转融通业务出借的获配股份计入流通股本，上述股份归还后重新计入限售股本。

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）中证指数有限公司《沪深 300 指数编制细则》（2012）；

（三）上海证券交易所 中国证券金融股份有限公司 中国证券登记结算有限责任公司《科创板转融通证券出借和转融券业务实施细则》（2019）。

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上市公司在沪、深证券交易所通过发行普通股和优先股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、中小企业板、创业板、科创板);
3. 行业分类;
4. 公司控股情况分类 (国有、民营、外资等);
5. 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、发行优先股公司家数等。

(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普通股 (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。

1. 老股转让公司家数

老股转让公司家数是指统计期内首次公开发行股份 (IPO) 时实施老股转让的公司数量。

2. 未实施老股转让公司家数

未实施老股转让公司家数是指统计期内首次公开发行股份（IPO）时未实施老股转让的公司数量。

（二）再筹资公司家数

再筹资公司家数是指统计期内通过增发（公开增发和定向增发）、配股、行权筹资、发行优先股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普通股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普通股进行筹资的上市公司数量。

3. 行权筹资公司家数

行权筹资公司家数是指统计期内权证（期权）行权筹资上市公司家数。

4. 发行优先股公司家数

发行优先股公司家数是指统计期内发行优先股进行筹资的上市公司家数。

四、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。

（三）已在境外上市的红筹公司通过沪伦通等业务发行存托凭证的公司不纳入股票筹资家数。

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 141 号）；

（二）《首次公开发行股票并在创业板上市管理办法》（证监会令第 123 号）；

（三）《上市公司证券发行管理办法》（证监会令第 30 号）；

（四）《优先股试点管理办法》（证监会令第 97 号）；

（五）《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）；

（六）《中国证监会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）；

（七）《首次公开发行股票时公司股东公开发售股份暂行规定》（证监会公告〔2014〕11 号）；

（八）《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：股票筹资金额

一、基本定义

股票筹资金额是指统计期内上市公司在沪、深证券交易所通过发行普通股和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.股份类型（A股、B股）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.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筹资，股票筹资金额分为首发筹资金额和再筹资金额。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、发行优先股筹资金额等指标。

（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=∑（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筹资金额，计算

公式为：

首发筹资金额（吸收合并）= $\sum$ （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、发行优先股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普通股筹集的资金总额。

增发筹资金额= $\sum$ （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普通股筹集的资金总额。

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

3. 行权筹资金额

行权筹资金额是指统计期内权证（期权）行权筹集的资金总额。

行权筹资金额= $\sum$ （行权价格×行权认购股份数）。

4.发行优先股筹资金额

发行优先股筹资金额是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）以普通股上市日作为统计指标的计算日。

（二）首发筹资金额中不包含老股转让金额。

（三）已在境外上市的红筹公司通过沪伦通等业务发行存托凭证不纳入股票筹资金额。

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141号）；

（二）《首次公开发行股票并在创业板上市管理办法》（证监会令第123号）；

（三）《上市公司证券发行管理办法》（证监会令第30号）；

（四）《优先股试点管理办法》（证监会令第97号）；

（五）《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）；

（六）《中国证监会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）；

（七）《首次公开发行股票时公司股东公开发售股份暂行规定》（证监会公告〔2014〕11号）；

（八）《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：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）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.股票指数成分股；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 6.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 股股票价格与其流通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/转让价格，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发行的股票的价格与其各自对应的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）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.股票指数成分股；
- 6.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

上市公司市值等于上市公司A股市值和B股市值之和，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，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. 证券交易所；

3. 投资者类型（自然人、一般机构、专业机构、陆股通投资者）；

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上海、深圳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。

（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例。

（九）参与港股通交易股票账户数

参与港股通交易股票账户数是指统计期内参与港股通标的股票交易并完成至少 1 次买或卖行为的有效账户数量。

（十）持港股通标的股票账户数

持港股通标的股票账户数是指统计期末持有港股通标的股票数量不为零的账户数。

（十一）参与港股通交易股票账户数占比

参与港股通交易股票账户数占比是指统计期内参与港股通交易股票账户数占期末股票有效账户数的比例。

（十二）开通科创板交易权限账户数

开通科创板交易权限账户数是指统计期末 A 股有效账户数中开通科创板股票交易权限的账户数。

（十三）参与科创板交易股票账户数占比

参与科创板交易股票账户数占比是指统计期内参与科创板交易股票账户数占期末股票有效账户数的比例。

四、指标说明

港股通包含沪港通下的港股通和深港通下的港股通。

五、相关制度规则

（一）《关于进一步加强账户规范管理有关事项的通知》（2015）；

（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》(2016);

(三)《上海证券交易所与伦敦证券交易所互联互通存托凭证登记结算业务实施细则(试行)》(2018);

(四)《中国证券登记结算有限责任公司科创板股票登记结算业务细则(试行)》(2019)。

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. 证券交易所;

3. 投资者类型 (自然人、一般机构、专业机构、陆股通投资者);

4. 投资人开户地区;

5. 是否为跨期现投资者 (是、否);

6. 是否开通科创板权限 (是、否)。

三、指标种类

新增股票投资者数

新增股票投资者数是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。

新增股票投资者数=统计期末股票投资者数-上期末股票投资者数

四、指标说明

跨期现投资者是特指同时在股票市场和股指期货市场开立账户的股票投资者，不包括同时在债券市场和国债期货市场、大宗商品现货和期货市场从事交易的投资者。

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。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.股票指数成分股；

5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）。

三、指标说明

（一）指数涨跌幅参照股票涨跌幅计算。

（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。

（三）若统计区间包含上市首日，通常采用统计期内股票期末价格相对首发价格的变化幅度进行计算。另外，也可按统计期内股票期末价格相对上市首日开盘价或上市首日收盘价的变化

幅度进行计算。

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

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）；
- 2.行业分类；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票指数成分股；
- 5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）。

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例进行计算。计算公式为：

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

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例进行计算。

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

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}—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》（2018）；

（二）《深圳证券交易所交易规则》（2019）。

SK-II-3：成交量

一、基本定义

成交量是指在统计期内沪、深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.股票指数成分股；
- 5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 6.证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

在进行成交量统计时，包含竞价交易、协议交易（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

成交金额是指在统计期内沪、深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.股票指数成分股；
- 5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 6.证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

在进行成交金额统计时，包含竞价交易、协议交易（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. 股票指数成分股;

5. 上市板块 (主板、中小企业板、创业板、科创板);

6. 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

股本换手率是指当日股票成交量与其流通股本的比例。计算公式为:

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

其中:

TR_d —股本换手率

TV_{od} —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例来计算股本换手率。

区间换手率通常为统计期内全部交易日的股本换手率加总。

（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例。计算公式为：

$$TR_d = \frac{TVa_d}{CAP_d} \times 100\%$$

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例来计算市值换手率。

区间换手率通常为统计期内全部交易日的市值换手率加总。

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。

（三）上市首日平均换手率是指统计期内 IPO 股票上市首日换手率的算术平均值。

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.股票指数成分股；

5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；

6.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。

四、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（一般情况下剔除净利润为负的上市公司股票和暂停上市公司股票）：

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

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

（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是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,也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。另外,每股收益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。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.股票指数成分股；

5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；

6.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（包含权益为负的上市公司股票，并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

（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。

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（自然人、一般机构、专业机构、陆股通投资者）；

2.投资者开户地区；

3.股份类型（A股、B股）；

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（自然人、一般机构、专业机构、陆股

通投资者);

2.投资者开户地区。

SK-II-10：破净比例

一、基本定义

破净比例是指统计期末，每股价格跌破每股净资产的股票数量占沪深证券交易所上市股票数量的比例（剔除暂停上市公司股票）。计算公式为：

$$\text{BNAP} = \frac{m}{n} \times 100\%$$

其中：

BNAP—破净比例

m—破净股票只数

n—统计期末股票只数

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.行业分类；

3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

4.股票指数成分股；

5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）。

SK-II-11：破净率

一、基本定义

破净率是指对于每股价格跌破每股净资产的股票，其每股价格与每股净资产的偏离比率。通常用股票市值与归属母公司股东权益偏离比率进行计算。

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

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.股票指数成分股；

5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）。

三、指标说明

（一）通常用最新财务报告中的每股净资产数据进行破净率计算。

（二）对一组破净股票计算平均破净率时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（剔除暂停上市公司股票）：

$$BNAR = \left(\frac{\sum_{i=1}^n CAP_i}{\sum_{i=1}^n NA_i} - 1 \right) \times 100\%$$

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

平均股价是指统计期末，沪、深证券交易所上市股票的平均价格（剔除暂停上市公司股票）。通常用股票市值与对应股本的比率进行计算。

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

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、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.股票指数成分股；
- 5.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）。

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：上市公司上缴税费总额

一、基本定义

上市公司上缴税费总额是指上市公司在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、中小企业板、创业板、科创板);
- 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》。

SK-III-3: 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: 人民币

(三) 常用维度:

- 1.上市板块(主板、中小企业板、创业板、科创板);
- 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.证券交易所;
- 6.监管辖区、行政区划;

三、指标种类

按照现金分红实施与否分为实际现金分红总额、预案现金分红总额和预案实施现金分红总额：

（一）实际现金分红总额

实际现金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）预案现金分红总额

预案现金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）预案实施现金分红总额

预案实施现金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现金分红总额合计。

四、指标说明

（一）现金分红总额为含税数据。

（二）预案现金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）“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）根据《关于支持上市公司回购股份的意见》（证监会公告〔2018〕35 号），上市公司以现金为对价，采用要约方式和集中竞价方式回购股份的，视同上市公司现金分红，纳入现金分

红的相关比例计算。在统计现金分红时，在注明的情况下现金分红可包括上述回购金额。

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，通常用对应的实际现金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、科创板）；

2.行业分类；

3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

4.股票指数成分股；

5.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：

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

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（自然人、一般机构、专业机构、陆股通投资者）；

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》（2015）。

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、科创板）；
- 2.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 3.激励方案；
- 4.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》（证监会令第148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）；
- 2.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.股票指数成分股；
- 6.证券交易所；
- 7.监管辖区，行政区划。

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：

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

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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.股票指数成分股；
- 6.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

（一）计算净资产收益率时所用净利润为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

现金分红率是指统计期内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);
2. 上市板块 (主板、中小企业板、创业板、科创板);
3. 行业分类;
4. 公司控股情况分类 (国有、民营、外资等);
5. 股票指数成分股;
6. 证券交易所;
7. 监管辖区, 行政区划。

SK-IV-4：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是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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 4.行业分类；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；

- 6.股票指数成分股;
- 7.证券交易所;
- 8.监管辖区, 行政区划。

SK-IV-5: 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是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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 4.行业分类；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 6.股票指数成分股；
- 7.证券交易所；
- 8.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

（一）上市公司总资产使用上市公司期初和期末总资产的平均值。

（二）在对上市板块、行业分类等主题为主的上市公司平均总资产收益率作前后比较时，应保持样本的一致性。

SK-V：信用交易

SK-V-1：融资融券交易金额

一、基本定义

融资融券交易金额是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、基金等);
2. 业务类型 (融资、融券);
3. 证券交易所, 中介机构。

三、指标说明

融资买入金额见 SK-V-4 小节, 融券卖出金额见 SK-V-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》;

(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);

(五) 《证券公司风险控制指标管理办法》(证监会令第 125 号);

(六) 中国证券业协会《融资融券合同必备条款》(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。

$$\begin{aligned}
 \text{融资融券余额} &= \text{融资余额} + \text{融券余额} \\
 &= \Sigma (\text{融资买入额} - \text{融资偿还额}) \\
 &\quad + \Sigma (\text{融券卖出量} - \text{融券偿还量})
 \end{aligned}$$

× 标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、卖券还款和融资强制平仓。

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

(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》（证监会令第 117 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》；

(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(自然人、一般机构、专业机构);

2.中介机构。

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

（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》；

（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（自然人、一般机构、专业机构）；

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》（证监会令第117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》；

（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（自然人、一般机构、专业机构）；

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》（证监会令第117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》；

（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：信用证券账户数

一、基本定义

信用证券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（自然人、一般机构、专业机构）；

2.证券交易所，中介机构。

SK-V-7：信用交易客户数

一、基本定义

信用交易客户数是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（自然人、一般机构、专业机构）；
- 2.证券交易所，中介机构。

SK-V-8：转融通交易金额

一、基本定义

转融通交易金额是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。

转融通交易金额=转融资交易额+转融券交易额=转融资新合约融出额+转融资展期合约融出额+转融券新合约融出额+转融券展期合约融出额。

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、债券等）；
2. 业务类型（转融资、转融券）；
3. 期限（3 天、7 天、14 天、28 天、182 天等）；
4. 证券交易所。

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 75 号）；
- （二）《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则（试行）》（2012）；
- （三）上海、深圳证券交易所《转融通证券出借交易实施办法（试行）》；
- （四）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（试行）》（2012）。

SK-V-9：转融通归还金额

一、基本定义

转融通归还金额是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。

$$\text{转融通归还金额} = \text{转融资归还金额} + \text{转融券归还金额} = \text{转融资归还金额} + \sum (\text{转融券融出归还量} \times \text{标的证券统计日收盘价})$$

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. 证券类别 (股票、基金、债券等);
2. 业务类型 (转融资、转融券);
3. 期限 (3 天、7 天、14 天、28 天、182 天等);
4. 证券交易所。

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 75 号);

(二)《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则(试行)》
(2012);

(三) 上海、深圳证券交易所《转融通证券出借交易实施办法 (试行)》;

(四) 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 (试行)》(2012)。

SK-V-10: 转融通期末余额

一、基本定义

转融通期末余额是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。

转融通期末余额=转融资期末余额+转融券期末余额
= Σ (业务开展以来转融资借入总额 - 业务开展以来转融资归还总额) + Σ (转融券融出量 - 转融券融出归还量 + 未了结转融券合约的权益补偿量) $\times$ 标的证券统计日收盘价。

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. 证券类别（股票、基金、债券等）；
2. 业务类型（转融资、转融券）；
3. 期限（3 天、7 天、14 天、28 天、182 天等）；
4. 证券交易所。

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 75 号)；

(二)《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则(试行)》
(2012)；

(三) 上海、深圳证券交易所《转融通证券出借交易实施办法(试行)》；

(四) 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(试行)》(2012)。

SK-V-11：转融通保证金余额

一、基本定义

转融通保证金余额是指统计期末借入人(证券公司)在中国证券金融公司交存的转融通担保物的余额。担保物包括资金和中国证券金融公司认可的证券。

转融通保证金余额=现金+未到账现金权益+ Σ 可充抵保证金证券市值 $\times$ 证券转融通折算率+ Σ 未到账证券权益市值 $\times$ 证券转融通折算率。

其中：

现金=转融通担保资金账户余额-被异常冻结的保证金+被临时使用的保证金等，

可充抵保证金证券市值=(转融通担保证券账户证券-被异常冻结的证券+被临时使用的证券等) $\times$ 证券最近成交价格或公允价格。

二、统计属性

(一) 基本频度：日

(二) 基本计量单位：元

(三) 常用维度：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)》(2012)。

SK-V-12：转融通保证金比例

一、基本定义

转融通保证金比例是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。

转融通保证金比例=(现金+ Σ 可充抵保证金证券市值 $\times$ 证券

转融通折算率) / (未偿还转融资负债金额 + Σ 未偿还转融券证券市值 + 未偿还现金权益补偿金额 + Σ 未偿还证券权益补偿市值 + 未偿还转融通费用、罚金等)。

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

《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）》（2012）。

SK-VI：新股发行

SK-VI-1：平均超募比率

一、基本定义

平均超募比率是指统计期内全部 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

FAF_i ——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、中小企业板、创业板、科创板);
3. 行业分类;
4. 公司控股情况分类 (国有、民营、外资等);
5. 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。

SK-VI-2：平均首发价格

一、基本定义

平均首发价格是指统计期内 IPO 股票的平均发行价格。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、中小企业板、创业板、科创板）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

SK-VI-3：平均网上发行中签率

一、基本定义

平均网上发行中签率是指统计期内 IPO 股票的网上发行中签率的平均值。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、中小企业板、创业板、科创板）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

SK-VI-4：新股破发率

一、基本定义

新股破发率是指统计期内破发的 IPO 股票占全部 IPO 股票的比率。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、中小企业板、创业板、科创板）；

3.行业分类；

4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

三、指标种类

（一）破发通常以期末价格跌破首发价格确定。另外，也可以盘中最低价格跌破首发价格确定。

（二）上市首日破发率是指统计期内 IPO 股票中上市首日破发的股票数量占比。

（三）实际统计破发率时，需要明确统计哪个时期内的 IPO 股票以及统计的 IPO 股票在哪个时期内的破发情况。

SK-VI-5：老股转让数量

一、基本定义

老股转让数量是指统计期内 IPO 公司所发行股份中，老股转让数量的合计。

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.上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
- 3.行业分类；
- 4.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 5.证券交易所；
- 6.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

以股份上市日作为统计指标的计算日。

SK-VI-6：老股转让比例

一、基本定义

老股转让比例是指 IPO 公司所发行股份中老股转让数量占全部发行股份数量的比例。

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. 上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
3. 行业分类；
4. 公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
5. 证券交易所；
6. 监管辖区，行政区划。

三、指标说明

(一) 以股份上市日作为统计指标的计算日。

(二) 一组股票的平均老股转让比例通常用总体法进行计算：

$$R = \frac{\sum_{i=1}^n OS_i}{\sum_{i=1}^n IS_i} \times 100\%$$

其中：

R—老股转让比例

n—股票只数

OS_i —第 i 只 IPO 公司老股转让数量

IS_i—第 i 只 IPO 公司发行股份数量

SK-VI-7：老股转让金额

一、基本定义

老股转让金额是指统计期内上市公司 IPO 时通过老股转让筹集的资金总额，计算公式为：

$$\text{老股转让金额} = \sum (\text{每股发行价格} \times \text{老股转让数量})$$

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

三、指标说明

（一）以股份上市日作为统计指标的计算日。

（二）老股转让金额不计入股票筹资金额。

SK-VII：股票质押式回购

SK-VII-1：质押率

一、基本定义

质押率是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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 2.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

上海、深圳证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》（2018）。

SK-VII-2：质押比例

一、基本定义

质押比例是指统计期末单只 A 股股票质押数量与其 A 股股本的比值。

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、中小企业板、创业板、科创板）；

2.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（自有资金出资）、证券公司资产管理计划）。

三、相关制度规则

上海、深圳证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》（2018）。

SK-VII-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是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、中小企业板、创业板、科创板）；

- 2.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

上海、深圳证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》(2018)。

SK-VII-4: 待购回金额

一、基本定义

待购回金额是指统计期末融入方应付金额。

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(自有资金出资)、证券公司资产管理计划)。

三、相关制度规则

上海、深圳证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》(2018)。

SK-VII-5：履约保障比例

一、基本定义

履约保障比例是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（自有资金出资）、证券公司资产管理计划）。

三、相关制度规则

上海、深圳证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》（2018）。

SK-VIII：上市公司并购重组

SK-VIII-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是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、中小企业板、创业板、科创板）；
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. 跨境情况；
7. 是否涉及行政许可（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、指标说明

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

(三) 是否发行优先股是指上市公司是否通过发行优先股的方式实施并购重组。

四、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159号);

(二)《上市公司收购管理办法》(证监会令第108号);

(三)上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-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是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、中小企业板、创业板、科创板);
- 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.跨境情况;
- 7.是否涉及行政许可(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、指标说明

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

四、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 159 号）；
- （二）《上市公司收购管理办法》（证监会令第 108 号）；
- （三）上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-3：上市公司收购家数

一、基本定义

上市公司收购家数是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，需要履行信息披露义务所涉及的上市公司数量。

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、中小企业板、创业板、科创板）；

- 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.跨境情况(投资者境内、投资者境外);
- 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。

协议收购家数是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,取得被上市公司股份的行为所涉及的上市公司数量。

要约收购家数是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。

间接收购家数是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)。

大股东增持家数是指在实际控制人未变更的情形中，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。

(三) 根据是否需要行政许可，上市公司收购家数分为：上市公司收购家数(需要行政许可)和上市公司收购家数(不需行政许可)。

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；还包括对上市公司控制权产生影响的配股、公开增发、非公开发行、股东权证行权、股东可转债转股等交易行为。

(二) 涉及行政许可的上市公司收购家数以上市公司收购报告书(全文)披露日作为统计指标的计算日；不涉及行政许可的上市公司收购家数以权益变动报告书披露日作为统计指标的计算日。

(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；上市公司收购上市公司的行为计为 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 108 号)；

(二) 上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-4：上市公司收购金额

一、基本定义

上市公司收购金额是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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 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.跨境情况（投资者境内、投资者境外）；
- 7.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

上市公司收购金额的指标分类参见 SK-VIII-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；间接收购的收购金额为 $ACAM_{in}$ ，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—被收购的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

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行为的金额一般为零。

（二）统计范围和统计口径见 SK-VIII-3 小节。

五、相关制度规则

（一）《上市公司收购管理办法》（证监会令第 108 号）；

（二）上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-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是指统计期内公告购买、出售资产的上市公司数量的合计，包括重大资产重组家数和非重大资产重组家数。

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. 股份类型（A 股、B 股）；
2. 上市板块（主板、中小企业板、创业板、科创板）；
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. 跨境情况（标的资产境内、标的资产境外）；
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。

重组上市家数是指满足《上市公司重大资产重组管理办法》第十三条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是指除重组上市以外，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；第三方购买家数是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。

产业整合家数是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，前三个指标计算采用单项支付方式的上市公司资产重组家数，第四个指标计算含可转债支付方式的上市公司资产重组家数，第五个指标计算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，以核准日为统计指标的计算日，也可以采用股东大会决议公告日；（2）根据《上海证券交易所股票上市规则》和《深圳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为统计指标的计算日；（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，以资产交易公告日为统计指标的计算日。

（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

（一）《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 159 号）；

（二）上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-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是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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 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.跨境情况（标的资产境内、标的资产境外）；
- 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）是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）是指上市公司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的合计。其中，上市公司资产重组金额（配套融资·核准最高）是中国证券监督管理委员会核准的募集配套资金的总额；上市公司资产重组金额（配套融资·实际募集）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是指特定对象以现金或者资产认购上市公司非公开发行的股份后，上市公司用同一次非公开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是指上市公司发行股份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-VIII-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)统计范围和时间口径请参见SK-VIII-5小节。

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159号);

(二)上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-7: 上市公司合并家数

一、基本定义

上市公司合并家数是指统计期内根据《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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 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）。

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）和上市公司合并家数（混合）。其中，前两个指标计算单项支付方式的上市公司合并家数，第三个指标计算混合支付方式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核准日作为统计指标的计算日，不涉及行政许可的吸收合并采用股东大会决议公告日作为统计指标的计算日。

五、相关制度规则

《中华人民共和国公司法》（中华人民共和国主席令第八号）。

SK-VIII-8：上市公司合并金额

一、基本定义

上市公司合并金额是指统计期内根据《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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 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）。

三、指标种类

上市公司合并金额的指标分类参见 SK-VIII-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) 统计范围和时间口径参见 SK-VIII-7 小节。

五、相关制度规则

《中华人民共和国公司法》(中华人民共和国主席令第八号)。

SK-VIII-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是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行为。

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、中小企业板、创业板、科创板)；
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. 跨境情况 (境内、境外)。

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。

派生分立家数是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；新设分立家数是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。

分拆家数是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了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八号）；

（二）《关于规范境内上市公司所属企业到境外上市有关问题的通知》（证监发〔2004〕67号）。

SK-VIII-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是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、中小企业板、创业板、科创板);
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. 跨境情况 (境内、境外)。

三、指标种类

上市公司分立分拆金额的指标种类参见 SK-VIII-9 小节。

四、指标说明

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。

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。

统计口径参见 SK-VIII-9 小节。

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八号);

(二) 《关于规范境内上市公司所属企业到境外上市有关问题的通知》(证监发〔2004〕67号)。

SK-VIII-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是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、中小企业板、创业板、科创板）；
- 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）统计范围：上市公司公告股份回购报告书的案例；统计时可参考上市公司的股份回购进展公告及回购结果公告。

（二）以回购实施完成日为统计指标的计算日，即上市公司披露股份回购实施结果及股份变动公告日期。

（三）统计期内同一家上市公司实施了多次股份回购行为的计为 1 家。

五、相关制度规则

（一）《关于上市公司以集中竞价交易方式回购股份的补充规定》（证监会公告〔2008〕39 号）；

（二）《上市公司回购社会公众股份管理办法（试行）》（证监发〔2005〕51 号）；

（三）上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-VIII-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是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、中小企业板、创业板、科创板）；

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-VIII-11 小节。

四、指标说明

统计范围和时间口径参见 SK-VIII-11 小节。

五、相关制度规则

（一）《关于上市公司以集中竞价交易方式回购股份的补充规定》（证监会公告〔2008〕39号）；

（二）《上市公司回购社会公众股份管理办法（试行）》（证监发〔2005〕51号）；

（三）上海、深圳证券交易所《股票上市规则》。

SK-IX：沪（深）港通交易

SK-IX-1：沪股通股票只数、深股通股票只数、沪港通下的港股通股票只数、深港通下的港股通股票只数

一、基本定义

沪股通股票只数是指统计期末沪股通投资标的股票只数。

深股通股票只数是指统计期末深股通投资标的股票只数。

沪港通下的港股通股票只数是指统计期末沪港通下的港股通投资标的股票只数。

深港通下的港股通股票只数是指统计期末深港通下的港股通投资标的股票只数。

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. 沪港通标的股票范围（上证 180 指数成份股、上证 380 指数成份股、上证 A+H 股上市公司 A 股、恒生综合大型股指数成份股、恒生综合中型股指数成份股、A+H 上市公司 H 股）；

2. 深港通标的股票范围（深证成份指数成份股、深证中小创新指数成份股、深证 A+H 股上市公司 A 股、恒生综合大型股指数成份股、恒生综合中型股指数成份股、恒生综合小型股指数成份股、A+H 上市公司 H 股）。

三、指标说明

属于不同标的股票范围的同 1 只股票，统计时计为 1 只。

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 128 号）；

（二）《上海证券交易所沪港通业务实施办法》（2018）；

（三）《深圳证券交易所深港通业务实施办法》（2018）。

SK-IX-2：沪股通买入金额、深股通买入金额、沪港通下的 港股通买入金额、深港通下的港股通买入金额

一、基本定义

沪股通买入金额是指统计期内通过沪股通买入的股票交易金额合计。

深股通买入金额是指统计期内通过深股通买入的股票交易金额合计。

沪港通下的港股通买入金额是指统计期内通过沪港通下的港股通买入的股票交易金额合计。

深港通下的港股通买入金额是指统计期内通过深港通下的港股通买入的股票交易金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

港股通投资者类型（自然人、一般机构、专业机构）。

SK-IX-3：沪股通卖出金额、深股通卖出金额、沪港通下的 港股通卖出金额、深港通下的港股通卖出金额

一、基本定义

沪股通卖出金额是指统计期内通过沪股通卖出的股票交易金额合计。

深股通卖出金额是指统计期内通过深股通卖出的股票交易金额合计。

沪港通下的港股通卖出金额是指统计期内通过沪港通下的港股通卖出的股票交易金额合计。

深港通下的港股通卖出金额是指统计期内通过深港通下的港股通卖出的股票交易金额合计。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

港股通投资者类型（自然人、一般机构、专业机构）。

SK-IX-4：账户持沪股通股票市值、账户持深股通股票市值、账户持沪港通下的港股通股票市值、账户持深港通下的港股通股票市值

一、基本定义

账户持沪股通股票市值是指统计期末沪股通投资者所持沪股通投资标的股票市值的合计。计算公式为：

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

其中：

TCAP_{HG}—账户持沪股通股票市值

n—持有沪股通投资标的股票只数

P_i—持有第 i 只沪股通投资标的股票的价格

SHR_i—持有第 i 只沪股通投资标的股票的数量

账户持深股通股票市值是指统计期末深股通投资者所持深股通投资标的股票市值的合计。计算公式为：

$$TCAP_{SG} = \sum_{j=1}^n P_j \times SHR_j$$

其中：

TCAP_{SG}—账户持深股通股票市值

n—持有深股通投资标的股票只数

P_j—持有第 j 只深股通投资标的股票的价格

SHR_j—持有第 j 只深股通投资标的股票的数量

账户持沪港通下的港股通股票市值是指统计期末港股通投资者所持沪港通下的港股通投资标的股票市值的合计。计算公式为：

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

其中：

TCAP_{HG}—账户持沪港通下的港股通股票市值

n—持有沪港通下港股通投资标的股票只数

P_i —持有第 i 只沪港通下港股通投资标的股票的价格

SHR_i —持有第 i 只沪港通下的港股通投资标的股票的数量

账户持深港通下的港股通股票市值是指统计期末港股通投资者所持深港通下的港股通投资标的股票市值的合计。计算公式为：

$$TCAP_{SG} = \sum_{j=1}^m P_j \times SHR_j$$

其中：

$TCAP_{SG}$ —账户持深港通下的港股通股票市值

m —持有深港通下港股通投资标的股票只数

P_j —持有第 j 只深港通下港股通投资标的股票的价格

SHR_j —持有第 j 只深港通下的港股通投资标的股票的数量

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：元

（三）常用维度：

港股通投资者类型（自然人、一般机构、专业机构）。

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-X：优先股

SK-X-1：优先股公司家数

一、基本定义

优先股公司家数是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。

三、指标说明

（一）发行优先股的公司是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）优先股公司家数以优先股初始登记日进行统计。另外，也可以按照上市/挂牌日口径统计。

（三）发行多只优先股的公司，统计时按 1 家计算。

（四）在境内发行优先股的境外上市公司（注册在境内）按非上市公众公司统计。

四、相关制度规则

（一）《优先股试点管理办法》（证监会令第 97 号）；

（二）《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》（2014）；

(三)《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》(2014);

(四)《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引(试行)》
(2015)。

SK-X-2: 优先股股本

一、基本定义

优先股股本是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、是否参与、可否回购)。

三、指标说明

优先股股本按照优先股初始登记日进行统计。另外,也可以按照上市/挂牌日口径统计。

四、相关制度规则

- (一)《优先股试点管理办法》(证监会令第97号);
- (二)《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》(2014);
- (三)《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》(2014);
- (四)《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引(试行)》(2015)。

SK-X-3: 优先股市值

一、基本定义

优先股市值是指统计期末根据优先股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、是否参与、可否回购)。

三、指标说明

- (一)优先股市值统计的公司是统计期末有优先股上市或挂

牌的公司。

（二）如当日无交易/转让价格，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。

（三）如无交易/转让成交记录，优先股价格通常采用发行价格进行计算。

四、相关制度规则

（一）《优先股试点管理办法》（证监会令第97号）；

（二）《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》（2014）；

（三）《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》（2014）；

（四）《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引（试行）》（2015）。

SK-X-4：优先股筹资公司家数

一、基本定义

优先股筹资公司家数是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）。

三、指标说明

（一）优先股筹资公司家数以优先股初始登记日口径统计。另外，也可以按照优先股上市/挂牌日口径统计。

（二）同一家公司在统计期内多次发行优先股时，优先股发行家数计为 1 家。

四、相关制度规则

- （一）《优先股试点管理办法》（证监会令第 97 号）；
- （二）《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》（2014）；
- （三）《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》（2014）；
- （四）《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引（试行）》（2015）。

SK-X-5：优先股筹资金额

一、基本定义

优先股筹资金额是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筹资（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）。

三、指标说明

优先股筹资金额以优先股初始登记日口径统计。另外，也可以按照优先股上市/挂牌日口径统计。

四、相关制度规则

- （一）《优先股试点管理办法》（证监会令第97号）；
- （二）《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》（2014）；
- （三）《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》（2014）；
- （四）《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引（试行）》（2015）。

SK-X-6：优先股成交量

一、基本定义

成交量是指在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(沪、深证券交易所,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、指标说明

在进行成交量统计时,包含在沪、深证券交易所交易/转让的数量和在全国股转系统转让的数量。

四、相关制度规则

(一)《优先股试点管理办法》(证监会令第97号);

(二)《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》(2014);

(三)《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》(2014);

(四)《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引(试行)》(2015)。

SK-X-7: 优先股成交金额

一、基本定义

成交金额是指在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（沪、深证券交易所，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、指标说明

在进行成交金额统计时，包含在沪、深证券交易所的交易/转让金额和在全国股转系统的转让金额。

四、相关制度规则

(一)《优先股试点管理办法》（证监会令第97号）；

(二)《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》（2014）；

(三)《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》（2014）；

(四)《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引（试行）》（2015）。

SK-X-8：优先股股息总额

一、基本定义

优先股股息总额是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）。

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是指统计期内公司按照协议应该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是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

（一）《优先股试点管理办法》（证监会令第97号）；

- (二)《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》(2014);
- (三)《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》(2014);
- (四)《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引(试行)》(2015)。

SK-X-9: 优先股股息率

一、基本定义

优先股股息率是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)。

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

票面股息率是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

实际股息率是指优先股每股股息与其价格之间的比率。通常用实际优先股股息总额与期末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—实际股息率

DY—统计期内的优先股股息合计

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 只优先股股息总额

CAP_i—第 i 只优先股的期末市值

五、相关制度规则

(一)《优先股试点管理办法》(证监会令第 97 号);

(二)《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》(2014);

(三)《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》(2014);

(四)《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引(试行)》(2015)。

SK-XI: 股票期权

SK-XI-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：期权品种、期权合约

三、指标种类

按照保证金的不同类别划分，主要有以下 2 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. 开仓保证金是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. 维持保证金是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

结算准备金是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》（2015）；

(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》(2015)。

SK-XI-2：期权成交量

一、基本定义

期权成交量是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.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，以下同。

四、相关制度规则

《上海证券交易所股票期权试点交易规则》(2015)。

SK-XI-3：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权利金的合计。

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.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.证券交易所。

三、相关制度规则

《上海证券交易所股票期权试点交易规则》（2015）。

SK-XI-4：期权持仓量

一、基本定义

期权持仓量是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：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.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

《上海证券交易所股票期权试点交易规则》（2015）。

SK-XII：科创板

SK-XII-1：科创板企业研发投入总额

一、基本定义

科创板企业研发投入总额是指统计期内科创板上市公司研发投入的金额合计。

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.是否发行特别表决权类别股份（是、否）;
- 5.是否盈利（是、否）。

SK-XII-2：科创板企业研发投入占比

一、基本定义

科创板企业研发投入占比是指统计期内科创板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.是否发行特别表决权类别股份（是、否）;
- 5.是否盈利（是、否）。

SK-XII-3：科创板企业研发员工占比

一、基本定义

科创板企业研发员工占比是指统计期末科创板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.是否发行特别表决权类别股份（是、否）；

5.是否盈利（是、否）。

SK-XII-4：科创板企业营业收入总额

一、基本定义

科创板企业营业收入总额是指统计期内科创板上市公司营业收入金额合计。

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.是否发行特别表决权类别股份（是、否）；

5.是否盈利（是、否）。

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；
- 5.发行方式；
- 6.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

三、指标说明

（一）本部分所称债券仅指交易所债券市场发行的债券（下同）。

（二）债券品种分为国债、地方政府债、政策性金融债、企业债、公司债、可转债、可交换公司债、可分离债、资产支持证券等。

（三）债券发行可按初始登记日、发行首日、发行结束日、起息日或上市日等时点统计，实际使用中注明统计口径。

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；
- 5.发行方式；
- 6.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

三、指标说明

债券发行可按初始登记日、发行首日、发行结束日、起息日或上市日等时点统计，实际使用中注明统计口径。

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；
- 4.发行方式；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 6.发行人注册地。

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;
6. 发行方式;
7. 公司控股情况分类 (国有、民营、外资等);
8. 发行人注册地。

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: 债券发行金额

一、基本定义

债券发行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;
- 5.发行方式;
- 6.公司控股情况分类(国有、民营、外资等)。

三、指标说明

(一)通常债券发行金额统计范围包括中国证监会审批以及交易场所备案的公司债、可转债、可交换公司债、可分离债、资产支持证券等。

(二)债券发行金额可按初始登记日、发行首日、发行结束日、起息日或上市日等时点统计,实际使用中注明统计口径。

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(自然人、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；

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×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〕×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 (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(值)管理办法(2016 修订版)》。

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（自然人、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：

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

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；

5.发行方式；

6.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

三、指标种类

兑付金额既可分为本金兑付金额和利息兑付金额，又可分为到期兑付金额和回售兑付金额。

四、指标说明

（一）本金兑付金额以到期日或回售日计算；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；
- 4.发行方式；
- 5.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）。

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。

BD-II-8：债券平均收益率

一、基本定义

债券平均收益率是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是指一组债券到期收益率的算术平均值。到期收益率是指投资者在二级市场买入已发行的债券并持有到期满为止的这个期限的年平均收益率。

（二）债券平均当期收益率

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

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、QDII、FOF、商品基金、其他）；
- 2.运作类型（封闭、开放（包括LOF、ETF））；
- 3.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：上市基金只数

一、基本定义

上市基金只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（封闭、开放（包括 LOF、ETF））；

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、QDII、FOF、

商品基金、其他);

2.运作类型(封闭、开放(包括LOF、ETF));

3.基金管理人。

三、指标说明

分级基金统计份额时,包括母基金份额和子基金份额。

FD-I-4: 基金资产总值

一、基本定义

基金资产总值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、QDII、FOF、商品基金、其他);

2.运作类型(封闭、开放(包括LOF、ETF));

3.基金管理人。

三、指标说明

对统一募集,自动拆分的分级基金统计基金资产总值时,包括母基金和子基金资产总值。

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

指标的计算与披露》》（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、混合、货币、QDII、FOF、商品基金、其他）；

2.运作类型（封闭、开放（包括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，基金账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（自然人、机构）；

2.基金管理人。

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。统计时按照“投资者全称且证件代码相同”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.投资者类型（自然人、机构）；

2.基金管理人。

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、QDII、FOF、商品基金、其他）；

2.运作类型（封闭、开放（包括 LOF、ETF））；

3.基金管理人。

FD-I-9：基金资产净值

一、基本定义

基金资产净值是指统计期末市场上基金产品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.投资类型（股票、债券、混合、货币、QDII、FOF、商品基金、其他）；
- 2.运作类型（封闭、开放（包括 LOF、ETF））；
- 3.基金管理人。

三、指标说明

（一）基金份额净值

基金份额净值，又称为基金单位资产净值，即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，是指基金份额净值与基金成立以后历次份额分红金额之和。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

计算基金份额净值、基金份额分红金额使用的基金份额为拆分前的基金份额。

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、QDII、FOF、商品基金、其他）；
- 2.运作类型（开放（包括 LOF、ETF））；
- 3.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、开放（包括 LOF、ETF））；

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。

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

一般将计算数值大于零称为溢价率，小于零称为折价率。

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、开放（包括 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。

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、QDII、FOF、商品基金、其他);

2.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、QDII、FOF、商品基金、其他);

2.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、QDII、FOF、商品基金、其他);

2.基金管理人;

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，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，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

（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）《证券投资基金销售管理办法》（证监会令第91号）；

（三）《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第120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：投资者国别/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)《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90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: QDII 额度

一、基本定义

QDII 额度是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) 常用维度：投资者国别/地区

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

私募基金只数是指统计期末已在中国证券投资基金业协会备案的私募基金产品只数。

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（自我管理、受托管理、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）私募基金只数

私募基金只数是指统计期末已在中国证券投资基金业协会备案的私募基金产品只数，按照是否包含已清盘私募基金可分为私募基金存续只数和私募基金清盘只数两个指标。

（二）私募基金存续只数

私募基金存续只数是指统计期末已在中国证券投资基金业

协会备案且未清盘的私募基金只数。

（三）私募基金清盘只数

私募基金清盘只数是指统计期内已在中国证券投资基金业协会备案的私募基金完成清盘的只数。

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，私募基金清盘只数以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暂行办法》（证监会令第105号）；

（二）《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（中基协发〔2014〕1号）。

FD-V-2：私募基金管理人人数

一、基本定义

私募基金管理人人数是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、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

私募基金管理人人数统计时不含已注销机构。

四、相关制度规则

（一）《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第105号）；

（二）《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（中基协发〔2014〕1号）。

FD-V-3：私募基金管理规模

一、基本定义

私募基金管理规模是指统计期末正在运作的私募基金管理规模。

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.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（自我管理、受托管理、顾问管理）；
- 4.私募基金管理人。

三、指标说明

关于私募基金管理规模，以相关基金填报的运行表中期末净资产为准。如相关基金新设立，且暂未更新运行表，以募集资金规模为准。

四、相关制度规则

（一）《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第105号）；

（二）《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（中基协发〔2014〕1号）。

期货市场

FS-I：市场规模

FS-I-1：保证金

一、基本定义

保证金是指统计期末期货交易者按照规定标准缴纳的资金或者提交的流动性强的标准仓单、国债和外汇资金等资产，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

结算准备金也即当日结算准备金余额，指统计期末未被合约占用的保证金。

$$SM = MB$$

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或者提交的流动性强的标准仓单、国债和外汇资金等资产折算后的价值总额。

$$M = TM + SM$$

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

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，但交易所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+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）上海期货交易所、上海国际能源交易中心、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的风险管理办法。

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市场监控中心有限责任公司（以下简称期货市场监控中心）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

期末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）休眠账户由期货市场监控中心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）逾期末规范账户是指在账户规范工作规定的时间内，资料未上报期货市场监控中心，未通过期货市场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）《期货公司监督管理办法》（证监会令第155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)

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

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)

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

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、相关制度规则

（一）上海期货交易所、上海国际能源交易中心、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基准价格的相对变动幅度来计算。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：%

（三）常用维度：

1.合约类别；

2.期货品种。

三、指标种类

(一) 振幅 (最低价)

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

其中:

APT—振幅

HP—区间内合约最高价

LP—区间内合约最低价

(二) 振幅 (前结算价)

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

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

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取合约挂牌价。

（三）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、上海国际能源交易中心、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；
- 4.监管辖区，行政区划。

三、指标说明

期货品种的成交量为统计期内该品种全部期货合约的成交量合计。

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；
- 4.监管辖区，行政区划。

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货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货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货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，国债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
- （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）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

（一）期货合约价格一般以结算价进行统计，也可以收盘价进行统计。

（二）股指期货合约对应的现货价格为该期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 & 数据更新的频率等。

五、相关制度规则

（一）上海期货交易所、上海国际能源交易中心、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。

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

期货品种的交割量为统计期内该品种全部期货合约的交割量合计。

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》（2016）。

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合约最大日持仓量的比率。

$$\text{交割率} = \frac{\text{交割量}}{\text{统计期内合约最大日持仓量}} \times 100\%$$

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

定义中合约最大日持仓量指的是合约存续周期内的最大持仓量。

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》(2016)。

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_i—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、上海国际能源交易中心、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的风险管理办法。

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统计期末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 666 号);

(二)《期货市场客户开户管理规定》(证监会公告〔2012〕1 号)。

FS-III：期货期权

FS-III-1：期权保证金

一、基本定义

期权保证金是指统计期末，期货期权卖方按照规定标准缴纳的资金，用于结算和保证履约。其计算公式为：

$$\begin{aligned} \text{期权保证金} = & \text{期权合约结算价} \times \text{标的期货合约交易单位} \\ & + \max[(\text{标的期货合约交易保证金} - 1/2 \times \text{期权合约虚值额}), \\ & 1/2 \times \text{标的期货合约交易保证金}] \end{aligned}$$

二、统计属性

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

三、指标说明

期货期权交易中，期货期权买方不需要缴纳保证金。

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《期权交易管理办法》。

FS-III-2：期权成交量

一、基本定义

期权成交量是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：手

（三）常用维度：

1.期权品种；

2.合约系列；

3.合约类型（看涨期权合约、看跌期权合约）；

4.期货交易所。

三、指标说明

合约系列按期权合约对应的期货合约进行统计，下同。

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《期权交易管理办法》。

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

三、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《期权交易管理办法》。

FS-III-4: 期权持仓量

一、基本定义

期权持仓量是指统计期末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. 期权品种;
2. 合约系列;
3. 合约类型 (看涨期权合约、看跌期权合约);
4. 期货交易所。

三、指标说明

(一) 期权合约了结方式包括平仓、行权和放弃。

（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

上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所《期权交易管理办法》。

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〔2017〕11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〔2017〕11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〔2017〕11号）。

PI-I-4：基金管理人人数

一、基本定义

基金管理人人数是指统计期末经中国证监会批准获得公募基金管理资格的基金管理公司、证券公司及其资产管理公司、保险资产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、指标种类

按照不同机构类型，基金管理人人数主要有以下 3 种指标：

（一）基金管理公司家数

基金管理公司家数是指统计期末经中国证监会批准获得公募基金管理资格的基金管理公司的数量合计。

（二）证券公司及其资产管理公司家数

证券公司及其资产管理公司家数是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是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。

四、指标说明

基金管理人以数获得公募基金管理资格证书为标准，已办理取消公募基金管理资格证书的基金管理人从统计中剔除。

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〔2019〕5号）。

PI-I-6：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是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.期货公司；
- 2.期货公司分类结果；
- 3.监管辖区，行政区划；
- 4.营业部，分公司。

三、相关制度规则

《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2019〕5号）。

PI-I-7：就业人员数量

一、基本定义

就业人员数量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-I-8：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是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基金管理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.基金管理公司；
- 2.基金管理公司分类结果；
- 3.监管辖区，行政区划。

PI-I-9：证券公司子公司家数

一、基本定义

证券公司子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.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〔2017〕11号）。

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）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（2013年修订）》（证监会公告〔2013〕41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。

$$\text{平均财务杠杆} = \text{总资产} / \text{净资产}$$

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

营业收入是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.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、期货公司和基金管理公司子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.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）；
- 3.证券公司分类结果、期货公司分类结果、基金管理

公司子公司分类结果。

三、指标说明

（一）基金管理公司子公司是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〔2016〕10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131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

风险资本准备总额是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.机构类型（证券公司、期货公司、基金管理公司子公司）；

3.证券公司分类结果、期货公司分类结果、基金管理公司子公司分类结果。

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3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是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是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是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

单个证券公司、期货公司和基金管理公司子公司的风险资本准备参见证券公司、期货公司和基金管理公司子公司风险资本准备计算表中“各项风险资本准备之和”。

五、相关制度规则

(一)《证券公司风险控制指标计算标准规定》(证监会公告〔2016〕10号);

(二)《期货公司风险监管指标管理办法》(证监会令第131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

机构风险覆盖率是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。

$$\text{机构风险覆盖率} = (\text{净资本总额} / \text{各项风险资本准备总额}) \times 100\%$$

二、统计属性

(一)基本频度：月

(二)基本计量单位：%

(三)常用维度：

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)；

3.证券公司分类结果、期货公司分类结果、基金管理公司子公司分类结果。

三、相关制度规则

(一)《证券公司风险控制指标计算标准规定》(证监会公告〔2016〕10号)；

(二)《期货公司风险监管指标管理办法》(证监会令第131

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-4: 证券公司资本杠杆率

一、基本定义

证券公司资本杠杆率是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.证券公司分类结果;

2.监管辖区,行政区划。

三、指标说明

在计算证券公司资本杠杆率时的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125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是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。

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.证券公司分类结果；

2.监管辖区，行政区划。

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 125 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是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。

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.证券公司分类结果;
- 2.监管辖区, 行政区划。

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125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(自然人、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.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）；

2.产品属性（公募、私募）；

3.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。

股转系统

NQ-I：市场规模

NQ-I-1：挂牌公司家数

一、基本定义

挂牌公司家数是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，挂牌公司分层；
- 2.监管辖区，行政区划；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商；
- 7.是否发行优先股（是、否）。

三、指标种类

根据股份公司申请挂牌、挂牌、终止挂牌工作流程，挂牌公司家数可分为：

（一）申请挂牌公司家数

申请挂牌公司家数是指统计期内申请其股票在全国股转系统挂牌的股份有限公司的数量，在全国股转公司接收申请材料首日纳入汇总统计，在挂牌首日剔除。

（二）挂牌公司家数

挂牌公司在挂牌首日纳入汇总统计，在终止挂牌日剔除。

（三）终止挂牌公司家数

终止挂牌公司家数是指在统计期内通过终止挂牌公告确认的公司家数。挂牌公司在终止挂牌首日纳入汇总统计，在重新挂牌日剔除。

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）》（2013）。

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，是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，挂牌公司分层；
- 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；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商。

三、指标种类

按挂牌公司股份的不同转让限制条件，挂牌公司股本分为：

（一）限售股本

限售股本是指统计期末挂牌公司未解除转让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转让限制股票等。

（二）无限售股本

无限售股本也称流通股本，是指统计期末挂牌公司已解除转让限制的股份数量合计。计算公式为：

$$\text{无限售股本} = \text{挂牌公司总股本} - \text{限售股本}$$

四、指标说明

挂牌公司股本以挂牌日为计算日。

五、相关制度规则

（一）《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》（2013）；

（二）《全国中小企业股份转让系统挂牌公司年度报告内容

与格式指引（试行）》（2013）；

（三）《全国中小企业股份转让系统创新层挂牌公司年度报告内容与格式指引》（2017）。

NQ-I-3：股票发行家数

一、基本定义

股票发行家数是指统计期内通过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，挂牌公司分层；
- 2.监管辖区，行政区划；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商。

三、指标说明

（一）通常以股票发行情况报告书公告日作为统计指标的计算日。

（二）同一家挂牌公司在统计期内多次发行股票进行筹资

时，股票发行家数计为 1 家。

NQ-I-4：股票发行次数

一、基本定义

股票发行次数是指统计期内挂牌公司在境内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，挂牌公司分层；
- 2.监管辖区，行政区划；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商。

三、指标说明

（一）通常以股票发行情况报告书公告日作为统计指标的计算日。

（二）挂牌公司在“一次核准，多次发行”情形下，每次发行新股票均纳入发行次数统计。

NQ-I-5：股票筹资金额

一、基本定义

股票筹资金额是指统计期内挂牌公司通过在境内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，挂牌公司分层；
- 2.监管辖区，行政区划；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商。

三、指标说明

通常以股票发行情况报告书公告日作为统计指标的计算日。

NQ-I-6：挂牌公司股票市值

一、基本定义

挂牌公司股票市值是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，挂牌公司分层；
- 2.监管辖区，行政区划；
- 3.公司控股情况分类（国有、民营、外资等）；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商。

三、指标种类

按挂牌公司股票的不同转让限制条件，挂牌公司股票市值分为：

（一）挂牌公司股票市值

挂牌公司股票市值是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

挂牌公司流通市值是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；无转让成交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，既无转让成交记录又无

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

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

其中：

CAP—挂牌公司股票市值

$\overline{PE}$ —以全市场有转让成交记录的股票为样本计算的平均市盈率（剔除无成交或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。

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转让细则》（2017）。

NQ-I-7：股转系统股票账户数

一、基本定义

股转系统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（自然人、一般机构、专业机构等）；

2.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）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。

（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例。

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》（2013）；

（二）《全国中小企业股份转让系统业务规则（试行）》（2013）；

（三）《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理细则》（2017）。

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是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，挂牌公司分层；

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；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型；
- 6.主办券商。

三、指标种类

（一）按照并购重组类型，挂牌公司并购重组家数包含收购家数和重大资产重组家数两种类型。

（二）按照统计日期，挂牌公司并购重组家数可以选用董事会决议公告日和实施完毕日计算。

1.挂牌公司并购重组家数（董事会决议公告日）

挂牌公司并购重组家数（董事会决议公告日）是指统计期内董事会决议通过并购重组方案的挂牌公司家数，以董事会决议公告日作为指标统计日。

2.挂牌公司并购重组家数（实施完毕日）

挂牌公司并购重组家数（实施完毕日）是指统计期内并购重组方案实施完毕的挂牌公司家数，以实施完毕日作为指标统计日。

四、指标说明

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。

五、相关制度规则

（一）《非上市公司收购管理办法》（证监会令第 102 号）；

(二)《非上市公司重大资产重组管理办法》(证监会令第127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指引》(2018)。

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是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,挂牌公司分层;
- 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;
- 4.股票转让方式;
- 5.企业规模划型;
- 6.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和重大资产重组金额两种类型。

四、指标说明

挂牌公司并购重组金额通常以重大资产重组报告书、收购报告书公告日作为统计指标的计算日。

五、相关制度规则

(一)《非上市公司收购管理办法》(证监会令第102号);

(二)《非上市公司重大资产重组管理办法》(证监会令第127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指引》(2018)。

NQ-II：股票转让

NQ-II-1：市盈率

一、基本定义

市盈率是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。

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

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，挂牌公司分层；
- 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；
- 4.股票转让方式；
- 5.企业规模划型。

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

静态市盈率是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

滚动市盈率是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

预测市盈率是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）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（剔除无成交或净利润为负的挂牌公司股票）：

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

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

NQ-II-2：做市商家数

一、基本定义

做市商家数是指统计期末为挂牌公司股票进行做市的主办券商家数。

二、统计属性

（一）基本频度：日

（二）基本计量单位：家

三、相关制度规则

（一）《全国中小企业股份转让系统股票转让细则》（2017）；

（二）《全国中小企业股份转让系统股票转让方式确定及变更指引》（2017）。

统计分类标准

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《控股分类标准》）。

第二条 《控股分类标准》所称“公司”是指沪深证券交易所上市公司和全国股份转让系统挂牌公司，即本标准以上市公司和挂牌公司作为分类对象。

第三条 《控股分类标准》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、各部门生产、报送和发布统计数据所涉及的控股情况分类应当符合《控股分类标准》要求。其他机构在进行相关工作时可自愿使用。

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）公司的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、中央国有企业等，将其归为中央国有控股。

公司的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、地方国有企业等，将其归为地方国有控股。

中央国有控股和地方国有控股归为国有控股。

（二）公司的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），将其归为社团集体控股。

（三）公司的实际控制人为境内自然人，将其归为自然人控股。

（四）公司的实际控制人为境外（外国及港澳台地区）自然人或法人，将其归为外商控股。

（五）当公司没有实际控制人，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、境外自然人或法人时，将其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）公司的控股主体性质不明确，包括公司由两种以上性质主体共同控制、公司控股主体的股权分散且性质不明确等，将其归为控股主体性质不明确。

公司既无实际控制人，又无控股股东，将其归为无控股主体。

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公司，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《控股分类标准》，对《控股分类标准》进行解释。

第十条 中证资本市场运行统计监测有限责任公司（以下简称中证监测）负责按照《控股分类标准》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 中证监测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《控股分类标准》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监测。

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 中证监测于季后 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；中证监测于季后 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 《控股分类标准》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，是指虽不是公司的股东，但通过投资关系、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百分之五十以上或者其持有的股份占股份有限公司股本总额百分之五十以上的股东；出资额或者持有股份的比例虽然不足百分之

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、股东大会的决议产生重大影响的股东。

第十七条 《控股分类标准》自 2014 年 1 月 1 日起施行。

股票投资者分类标准

(2019 年修订)

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《标准》）。

第二条 《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 《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、各部门生产、报送和发布统计数据所涉及的股票投资者分类应当符合《标准》要求。其他机构在进行相关工作时可自愿使用。

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、一般机构投资者和陆股通投资者。

第五条 自然人投资者是指在中国结算开立证券账户的自然人。

第六条 专业机构投资者是指根据国家法律法规和行政规章，能够在股票二级市场买卖股票的金融机构（金融产品）和私

募基金。

第七条 一般机构投资者是指除专业机构投资者以外，在中国结算开立证券账户的法人或非法人组织，不包括陆股通投资者。

第八条 陆股通投资者，是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
	公募基金	公募基金
	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

专业机构投资者	QFII	QFII
	RQFII	RQFII
	证券公司自营	证券公司自营
	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
	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
		三资股东
		境外股东
		无法归类的一般机构
陆股通投资者	沪股通投资者	普通个人投资者
		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
		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《标准》，对《标准》进行解释。

第十一条 中证资本市场运行统计监测中心有限责任公司（以下简称中证监测）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，分为自然人投资者分类、机构投资者分类和陆股通投资者分类三部分。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，不包括对陆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沪深两市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。

月度存量分类是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；日度增量分类是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。

中证监测于每月初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

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。

中证监测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 陆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。

中证监测每日完成截至上一个工作日的存量陆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，是指投资者在沪深两市所持股票市值（A股市值和B股市值）之和。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，是指合法成立的、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，是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，是指以非公开方式向投资者募集资金设立的投资基金，包括资产由基金管理人或者普通合伙人管理的以投资活动为目的设立的公司或者合伙企业。

（五）GDR 机构包括 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，是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，是指其他无法归入国有、三资或境外股东的一般机构投资者。

第十七条 系统相关单位在使用分类结果时，统计区间内新开户的自然人投资者，在最新分类标识提供前，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，在最新分类标识提供前，暂归入无法归类的一般机构。

第十八条 本标准自 2020 年 1 月 1 日起施行。

附录：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八号）；
- [2] 《中华人民共和国公司登记管理条例》（国务院令第 666 号）；
- [3] 《期货交易管理条例》（国务院令第 676 号）；
- [4] 《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）；
- [5] 《上市公司证券发行管理办法》（证监会令第 30 号）；
- [6] 《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）；
- [7] 《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）；
- [8] 《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）；
- [9] 《证券期货市场统计管理办法》（证监会令第 60 号）；
- [10] 《转融通业务监督管理试行办法》（证监会令第 75 号）；
- [11] 《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 90 号）；
- [12] 《证券投资基金销售管理办法》（证监会令第 91 号）；
- [13] 《优先股试点管理办法》（证监会令第 97 号）；
- [14] 《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）；

- [15] 《私募投资基金监督管理暂行办法》（证监会令第 105 号）；
- [16] 《非上市公众公司收购管理办法》（证监会令第 102 号）；
- [17] 《非上市公众公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 127 号）；
- [18] 《上市公司收购管理办法》（证监会令第 108 号）；
- [19] 《期货公司监督管理办法》（证监会令第 155 号）；
- [20] 《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会令第 117 号）；
- [21] 《货币市场基金监督管理办法》（证监会令第 120 号）；
- [22] 《首次公开发行股票并上市管理办法》（证监会令第 141 号）；
- [23] 《首次公开发行股票并在创业板上市管理办法》（证监会令第 123 号）；
- [24] 《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第 125 号）；
- [25] 《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 159 号）；
- [26] 《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 128 号）；
- [27] 《期货公司风险监管指标管理办法》（证监会令第 131 号）；
- [28] 《上市公司股权激励管理办法》（证监会令第 148 号）；
- [29] 《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）；
- [30] 《关于上市公司以集中竞价交易方式回购股份的补充规定》（证监会公告〔2008〕39 号）；
- [31] 《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）；

[32] 《证券公司分类监管规定》（证监会公告〔2017〕11号）；

[33] 《期货公司分类监管规定》（证监会公告〔2019〕5号）；

[34] 《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）；

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

[36] 《期货市场客户开户管理规定》（证监会公告〔2012〕1号）；

[37] 《证券公司年度报告内容与格式准则（2013年修订）》（证监会公告〔2013〕41号）；

[38] 《中国证监会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）；

[39] 《首次公开发行股票时公司股东公开发售股份暂行规定》（证监会公告〔2014〕11号）；

[40] 《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》（证监会公告〔2014〕24号）；

[41] 《证券公司风险控制指标计算标准规定》（证监会公告〔2016〕10号）；

[42] 《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）；

[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] 《关于规范境内上市公司所属企业到境外上市有关问题的通知》(证监发〔2004〕67号);

[46] 《上市公司回购社会公众股份管理办法(试行)》(证监发〔2005〕51号);

[47] 《期货公司金融期货结算业务试行办法》(证监发〔2007〕54号);

[48] 《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);

[49] 《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);

[50] 《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);

[51] 《企业年金基金管理办法》(人力资源社会保障部令〔2015〕24号);

[52] 《关于划分企业登记注册类型的规定》(国统字〔2011〕86号);

[53] 《上市公司国有股东标识管理暂行规定》(国资发产权〔2007〕108号);

[54] 《上海证券交易所转融通证券出借交易实施办法(试行)》

- (2012);
- [55] 上海证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》
(2018);
- [56] 《上海证券交易所股票上市规则》(2019);
- [57] 《上海证券交易所优先股业务试点管理办法》(2014);
- [58] 《上海证券交易所沪港通业务实施办法》(2018);
- [59] 《上海证券交易所交易规则》(2018);
- [60] 《上海证券交易所融资融券交易实施细则》(2019);
- [61] 《上海证券交易所资金清算各项收费标准一览表》(2015);
- [62] 《上海证券交易所股票期权试点交易规则》(2015);
- [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》(2015);
- [64] 《上海证券交易所与伦敦证券交易所互联互通存托凭证登记
结算业务实施细则 (试行) 》(2018);
- [65] 上海证券交易所 中国证券金融股份有限公司 中国证券登记
结算有限责任公司《科创板转融通证券出借和转融券业务实
施细则》(2019);
- [66] 深圳证券交易所《股票质押式回购交易及登记结算业务办
法》(2018);
- [67] 《深圳证券交易所股票上市规则》(2019);
- [68] 《深圳证券交易所优先股试点业务实施细则》(2014);
- [69] 《深圳证券交易所融资融券交易实施细则》(2019);

- [70] 《深圳证券交易所资金清算各项收费标准一览表》(2015);
- [71] 《深圳证券交易所交易规则》(2019);
- [72] 《深圳证券交易所转融通证券出借交易实施办法(试行)》
(2016);
- [73] 《深圳证券交易所深港通业务实施办法》(2018);
- [74] 《上海期货交易所会员管理办法》(2008);
- [75] 《上海期货交易所交易规则》(2017);
- [76] 《上海期货交易所风险控制管理办法》(2016);
- [77] 《上海期货交易所结算细则》(2016);
- [78] 《上海期货交易所交割细则》(2016);
- [79] 《上海期货交易所期权交易管理办法》(2019);
- [80] 《上海国际能源交易中心结算细则》(2016);
- [81] 《郑州商品交易所会员管理办法》(2017);
- [82] 《郑州商品交易所期货交易细则》(2015);
- [83] 《郑州商品交易所期货结算细则》(2018);
- [84] 《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》(2018);
- [85] 《郑州商品交易所期货交割细则》(2018);
- [86] 《郑州商品交易所期权交易管理办法》(2018);
- [87] 《大连商品交易所会员管理办法》(2017);
- [88] 《大连商品交易所结算细则》(2018);
- [89] 《大连商品交易所交割细则》(2018);
- [90] 《大连商品交易所交易细则》(2018);

- [91] 《大连商品交易所风险管理办法》(2018);
- [92] 《大连商品交易所期权交易管理办法》(2019);
- [93] 《中国金融期货交易所会员管理办法》(2013);
- [94] 《中国金融期货交易所风险控制管理办法》(2018);
- [95] 《中国金融期货交易所交易细则》(2017);
- [96] 《中国金融期货交易所结算细则》(2017);
- [97] 中国证券登记结算有限责任公司《关于进一步加强账户规范管理有关事项的通知》(2015);
- [98] 《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);
- [99] 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(2016年修订版)》(2016);
- [100] 《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》(2016);
- [101] 《中国证券登记结算有限责任公司科创板股票登记结算业务细则(试行)》(2019);
- [102] 《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则(试行)》(2012);
- [103] 《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)》(2012);
- [104] 《全国中小企业股份转让系统业务规则(试行)》(2013);
- [105] 《全国中小企业股份转让系统挂牌公司年度报告内容与格式

指引（试行）》（2013）；

[106]《全国中小企业股份转让系统股票转让细则》（2017）；

[107]《全国中小企业股份转让系统优先股业务指引（试行）》（2015）；

[108]《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指引》（2018）；

[109]《全国中小企业股份转让系统创新层挂牌公司年度报告内容与格式指引》（2017）；

[110]《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理细则》（2017）；

[111]《全国中小企业股份转让系统股票转让方式确定及变更指引》（2017）；

[112]中国证券业协会《融资融券合同必备条款》（2011）；

[113]中国证券投资基金业协会《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（2014）；

[114]中证指数有限公司《沪深 300 指数编制细则》（2012）。