

# GTA\_STKMT

## 融资融券研究数据库

# 融资融券研究数据库

## 使用指南

### (2011 版)



国泰安信息技术有限公司  
GTA Information Technology Company

# 目 录

目 录.....	I
用户许可协议.....	II
一、产品开发说明.....	IV
二、说明书使用指南.....	2
1、本产品针对的用户.....	2
2、本说明书的结构.....	2
三、产品使用指南.....	3
1、内容.....	3
2、特点.....	3
3、使用方式.....	3
四、数据库说明.....	4
1、总体结构.....	4
2、命名规则.....	4
五、数据结构说明.....	5
附录.....	20
1. 重要计算公式说明.....	20
2. 业务描述.....	20
参考文献.....	21

# 用户许可协议

## 版权与所有权声明

国泰安的融资融券研究数据库（Margin Transaction Research Database）系统是由国泰安信息技术有限公司设计并开发。融资融券研究数据库系统及其文档的所有权归属于国泰安信息技术有限公司（以下简称“国泰安公司”或者“本公司”），并受中华人民共和国国家《著作权法》、《商标法》和国际协约条款的保护。由国泰安公司负责融资融券研究数据库系统的更新、维护和销售等活动。用户不得从本系统中删去版权声明，要保证为本系统的拷贝（全部或部分）复制版权声明，并同意制止以任何形式非法拷贝本系统及文档。未经授权擅自复制或散布本数据库的部分或全部内容，将会面对民事起诉。

“融资融券研究数据库”的名称已受到注册商标和其他形式的所有权的保护。

## 用户许可协议声明

本协议一方为本数据库的个人或机构使用者，另一方为国泰安公司。用户使用本数据库之前，须首先认可本许可协议，如持有异议，请不要使用，并于 30 日内，携带未开封的软件和书面声明到本公司办理有关事宜。

## 许可协议条款

1. 用户承认本系统提供的数据和资料花费了国泰安公司大量的人力、物力和财力。
2. 本系统仅给用户提供一个使用许可权。用户必须承诺不把本系统提供的全部或部分资料和数据以任何形式转移、出售和公开给任何第三者。
3. 用户必须同意并保证，采取必要和合适的措施保护本系统提供的资料 and 数据的版权和所有权。
4. 用户必须通知其所有相关使用者有关本系统的版权声明和本许可协议，并要求所有相关使用者都必须遵循本许可协议的一切条款。

## 售后保证

本公司保证在正常使用的情况下，本系统软件载体无材料或工艺上的缺陷。自售出之日起九十日内，经验证确有缺陷时，本公司负责退换数据载体。在原担保剩余时间内，退换的载体享受原担保的承诺。因不可抗力、意外事故、不合规操作或错误应用而导致的载体损害，本公司概不负责。

## 许可权利的终止

用户若违反本协议的任一条款或条件，国泰安公司可以随时终止其使用许可。一旦许可权利被终止，用户必须立即销毁本系统及文档的所有拷贝，或将其归还本公司。

## 适用法律

中华人民共和国《知识产权保护条例》、《著作权法》、《商标法》、《专利法》等。

## 免责条款

国泰安公司尽力为用户提供可信的、准确的资料和数据，但无法完全保证其百分之百的准确和完整。因此，无论在什么情况下，由使用本系统所产生的任何形式的间接或直接的、特别或意外的、必然或偶然的损失和破坏，本公司概不负责。在上述情况发生时，即使本公司事先被告知此类事情有可能发生，本公司亦不对由此导致的任何后果承担责任。

本公司将尽快更新资料数据，但不承担由于使用数据资料延误造成的损失或责任。如果用户发现数据文件中的错误，请立即通知本公司，本公司将尽最大的努力在下一个版本中更正。

如果用户对本协议条款有任何疑问，请按照如下方式与本公司联系：

国泰安信息技术有限公司

地址：深圳市北环大道 7003 号中审大厦 21 楼

邮编：518034

电话：400-609-6665 800-999-3099

传真：0755-83940070

电子邮件：service@gtadata.com

## 一、产品开发说明

融资融券作为一种信用交易,是指投资者向具有上海证券交易所或深圳证券交易所会员资格的证券公司提供担保物,借入资金买入上市证券或借入上市证券并卖出的行为。与现有证券现货交易模式相比较,投资者可以通过向证券公司融资或融券,扩大交易筹码,具有一定的财务杠杆效应。

2010年3月31日起,深圳交易所和上海交易所在6家已获资质券商正式启动融资融券交易试点,经过四年准备的融资融券交易正式进入市场操作阶段。

融资融券业务的开展,在引入了一定程度上的做空机制,改变了我国证券市场历年来的单边市场形态;因此,融资融券交易同样也为股指期货及其他金融衍生品的推出奠定基础。

为了及时、准确、全面地反映融资融券业务的发展状况和趋势,为客户提供一个权威、综合、便捷的信息平台,国泰安信息技术有限公司设计开发了融资融券研究数据库。该库涵盖了融资融券的明细数据、汇总数据,融资买入标的证券信息,融券卖出标的证券信息,融资融券担保证券信息等;我们希望融资融券数据库的推出,能够对我国融资融券的实证研究有一个快速的、高质量的提高,同时维护和推动我国金融业的持续稳定、健康有序的发展。

## 二、 说明书使用指南

本指南是《融资融券研究数据库（Margin Transaction Research Database）》（2011 版）的使用说明。

融资融券研究数据库在以下章节中简称融资融券库。

融资融券库（2011 版）数据区间为 2010 年至今。

### 1、 本产品针对的用户

本数据库所提供的资料和数据主要用于研究目的，针对的用户是高等院校金融、经济、管理等专业的教师、学生和研究学者，以及证券、基金、银行、保险等金融公司的经济、货币、外汇等研究机构和个人。

### 2、 本说明书的结构

本说明书由三个部分组成：

（一）用户许可协议：版权及所有权声明、用户许可协议声明、许可协议条款、售后保证、许可权利的终止、适用法律、免责条款等。

（二）产品开发说明，说明书使用指南，产品使用指南，数据库说明，数据结构说明。

（三）附录：重要计算公式说明，业务描述，参考文献

## 三、 产品使用指南

### 1、 内容

融资融券库收集了 2010 年 3 月以来,深交所和上交所中融资融券的交易明细及汇总信息,融资融券资格会员信用交易的状况,以及融资融券标的证券及担保物的详细信息。

### 2、 特点

- 完整性

融资融券库不仅收录了从该市场建立首日起至今的明细交易数据,还将标的证券和担保物的信息进行了整理,另对会员的信用交易状况进行了详细展示。

- 准确性

原始数据来源权威准确,通过严格采编及质检程序,保证数据准确、系统和完整。

- 及时性

我们将对资源数据库进行不定时更新,以保证其及时性和持续性。

- 便捷性

资源数据库采用开放式的数据结构,能灵活地以 Foxpro、Excel、TXT 等格式输出,可供 SAS、SPSS 等统计软件和 Fortran、C、Pascal 等高级语言直接调用。数据分类合理清晰,能够方便快捷地检索和获取满足一定条件的数据。

### 3、 使用方式

本公司提供两种服务方式,可针对不同用户提供相应的服务:

(1)根据用户特定的数据需求,提供用户所需求的部分数据。这种服务方式的优点在于用户不需要熟悉整个数据库的数据结构及数据调用方法。

(2)提供整个数据库文件。用户可随时根据自己的需要调用资源数据库中的数据。资源数据库提供的数据格式有文本格式和 DBF 格式两种,可直接供 SAS、SPSS 等通用统计软件调用。

## 四、数据库说明

### 1、总体结构

序号	表名	字段数	区间	频率	来源
1	交易明细表（日）	12	2010.03.31~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所
2	交易明细表（周）	18	2010.03.31~	周度	上海证券交易所和深圳证券交易所
3	交易明细表（月）	18	2010.03.31~	月度	上海证券交易所和深圳证券交易所
4	交易明细表（年）	18	2010.03.31~	年度	上海证券交易所和深圳证券交易所
5	交易汇总表（日）	12	2010.03.31~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所
6	交易汇总表（周）	14	2010.03.31~	周度	上海证券交易所和深圳证券交易所
7	交易汇总表（月）	14	2010.03.31~	月度	上海证券交易所和深圳证券交易所
8	交易汇总表（年）	14	2010.03.31~	年度	上海证券交易所和深圳证券交易所
9	融资融券标的信息表（日）	6	2010.03.31~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所
10	可冲抵保证金证券信息表	5	2010.03.31~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所
11	会员融资融券信息表（月）	9	2010.03.31~	月度	上海证券交易所和深圳证券交易所
12	融资融券业务资格表	4	2010.03.31~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所

### 2、命名规则

#### 一、文件命名规则

文件物理名称：依据文件名英文缩写命名。

如表 1. 交易明细表命名 CHN\_STKMT\_DDDetails

#### 二、字段命名规则

依据其英文简称命名。如字段月度标识命名为 Month，融券卖出量命名为 SecurityShort。



## 五、数据结构说明

表 1 交易明细表（日）（CHN\_STKMT\_DDDetails）

Table one: Margin Transaction Details Of Individual Stock (Daily)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	MTDate	信用交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 形式
2	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
3	StockCode	股票代码	C	6	0			交易所股票代码编码
4	StockName	股票简称	C	20	0			交易所股票简称
5	FinanceAmount	融资买入额	N	16	0	元		信用交易者在一个交易日内通过融资业务买入该标的证券的总金额
6	FinanceRepay	融资偿还额	N	16	0	元		=昨日余额+本日买入额-今日融资余额 (信用交易者在一个交易日内通过直接还款, 卖券还款或者被强制平仓而偿还因融资业务产生的全部或部分融资负债)。
7	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元		交易所公布数据。(本期融资余额=上一期的融资余额+融资买入额-融资偿还额)
8	SecurityShort	融券卖出量	N	14	0	股		信用交易者在一个交易日内通过融券业务卖出该标的证券的总数量

9	SecurityRepay	融券偿还量	N	14	0	股	融券偿还量=上一期融券余量-本期融券余量+本期融券卖出量
10	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股	交易所公布数据。信用交易者在一個交易日内通过融券业务卖出该标的证券的总数量
11	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元	深交所公布该数据，但上交所没有，上交所数据为GTA统计所得。融券余额等于融券余量*该交易日的收盘价（如若收盘价不可得，则往前取最近的收盘价）。
12	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元	融资融券余额=融资余额+融券余额

表 2 交易明细表（周）（CHN\_STKMT\_WDetails）

Table Two: Margin Transaction Details Of Individual Stock (Weekly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单 位	特 殊 值	字段说明
			类 型	长 度	小 数 位			
1	MTWeek	信用交易周份	C	7				YYYY-WW 格式
2	WeekBeginDate	周份开始交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式，取每周的第一个交易日期
3	WeekEndDate	周份最后交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式，取每周的最后一个交易日期
4	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
5	StockCode	股票代码	C	6				交易所股票代码编码

6	StockName	股票简称	C	20			交易所股票简称
7	FinanceAmount	融资买入额	N	16	0	元	本周各个交易日的融资买入额总和
8	FinanceRepay	融资偿还额	N	16	0	元	本周各个交易日的融资偿还额总和
9	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元	本周最后一个交易日的融资余额
10	FinanceBalanceGrowth	融资余额较上周增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本周融资余额} / \text{上周融资余额} - 1) * 100$
11	SecurityShort	融券卖出量	N	14	0	股	本周各个交易日的融券卖出量总和
12	SecurityRepay	融券偿还量	N	14	0	股	本周各个交易日的融券偿还额总和
13	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股	本周最后一个交易日的融券余量
14	SecShortBalanceGrowth	融券余量较上周增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本周融券余量} / \text{上周融券余量} - 1) * 100$
15	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元	融券余量*最后一个交易日的收盘价
16	ShortBalanceGrowth	融券余额较上周增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本周融券余额} / \text{上周融券余额} - 1) * 100$
17	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元	本周融券余额+本周融资余额
18	MTBalanceGrowth	融资融券余额较上周增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本周融资融券余额} / \text{上周融资融券余额} - 1) * 100$

表 3 交易明细表（月）（CHN\_STKMT\_MDetails）

Table Three: Margin Transaction Details Of Individual Stock (Monthly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	MTMonth	信用交易月份	C	7				YYY-MM 格式
2	MonthBeginDate	月份开始交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式，取每月的第一个交易日期
3	MonthEndDate	月份最后交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式，取每月的最后一个交易日期
4	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
5	StockCode	股票代码	C	6				交易所股票代码编码
6	StockName	股票简称	C	20				交易所股票简称
7	FinanceAmount	融资买入额	N	16	0	元		本月各个交易日的融资买入额总和
8	FinanceRepay	融资偿还额	N	16	0	元		本月各个交易日的融资偿还额总和
9	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元		本月最后一个交易日的融资余额
10	FinanceBalanceGrowth	融资余额较上月增长比例	N	10	2	%		= (本月融资余额/上月融资余额-1) *100

11	SecurityShort	融券卖出量	N	14	0	股	本月各个交易日的融券卖出量总和
12	SecurityRepay	融券偿还量	N	14	0	股	本月各个交易日的融券偿还量总和
13	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股	本月最后一个交易日的融券余量
14	SecShortBalanceGrowth	融券余量较上月增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本月融券余量} / \text{上月融券余量} - 1) * 100$
15	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元	融券余量*最后一个交易日的收盘价
16	ShortBalanceGrowth	融券余额较上月增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本月融券余额} / \text{上月融券余额} - 1) * 100$
17	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元	本月融券余额与融资余额的和
18	MTBalanceGrowth	融资融券余额较上月增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本月融资融券余额} / \text{上月融资融券余额} - 1) * 100$

表 4 交易明细表（年）（CHN\_STKMT\_YDetails）

Table Four: Margin Transaction Details Of Individual Stock (Yearly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	MTYear	信用交易年份	C	4				YYYY 格式
2	YearBeginDate	年份开始交易日期	C	10				YYYY-WW-DD 格式，取每年的第一个交易日期

3	YearEndDate	年份最后交易日期	C	10			YYYY-WW-DD 格式，取每年的最后一个交易日期
4	ExchangeCode	交易所代码	C	10			SHSE：上交所；SZSE：深交所
5	StockCode	股票代码	C	6			交易所股票代码编码
6	StockName	股票简称	C	20			交易所股票简称
7	FinanceAmount	融资买入额	N	16	0	元	本年各个交易日的融资买入额总和
8	FinanceRepay	融资偿还额	N	16	0	元	本年各个交易日的融资偿还额总和
9	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元	本年最后一个交易日的融资余额
10	FinanceBalanceGrowth	融资余额较上年增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本年融资余额} / \text{上年融资余额} - 1) * 100$
11	SecurityShort	融券卖出量	N	14	0	股	本年各个交易日的融券卖出量总和
12	SecurityRepay	融券偿还量	N	14	0	股	本年各个交易日的融券偿还额总和
13	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股	本年最后一个交易日的融券余量
14	SecShortBalanceGrowth	融券余量较上年增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本年融券余量} / \text{上年融券余量} - 1) * 100$
15	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元	融券余量*最后一个交易日的收盘价
16	ShortBalanceGrowth	融券余额较上年增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本年融券余额} / \text{上年融券余额} - 1) * 100$
17	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元	本年融券余额与融资余额的和
18	MTBalanceGrowth	融资融券余额较上期增长比例	N	10	2	%	$= (\text{本年融资融券余额} / \text{上年融资融券余额} - 1) * 100$ 券余额

表 5 交易汇总表（日）（CHN\_STKMT\_DSsummary）

Table Five: Margin Transaction Summary (Daily)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	MTDate	信用交易日期	C	10				以交易所公布的证券代码为准
3	FinanceAmount	融资买入额	N	16	0	元		融资买入额=各交易所所有可融资标的股票当日的融资买入额总和
4	FinanceRepay	融资偿还额	N	16	0	元		融资偿还额=各交易所所有可融资标的股票当日的融资偿还额总和
5	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元		融资余额=各交易所所有可融资标的股票当日的融资余额总和
6	SecurityShort	融券卖出量	N	14	0	股		融券卖出量=各交易所所有可融券标的股票当日的融券卖出量总和
7	SecurityRepay	融券偿还量	N	14	0	股		融券偿还量=各交易所所有可融券标的股票当日的融券偿还量总和
8	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股		融券余量=各交易所所有可融券标的股票当日的融券余量总和
9	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元		融券余额=各交易所所有可融券标的股票当日的融券余额总和
10	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元		融券余额=各交易所所有可融资或融券标的股票当日的融资融券余额总和

11	NumStockFinance	当日发生融资的股票数量	N	14	0	只		当日可融资标的股票实际发生融资的股票只数
12	NumStockShort	当日发生融券的股票数量	N	14	0	只		当日可融券标的股票实际发生融券的股票只数

表 6 交易汇总表（周）（CHN\_STKMT\_WSummary）

Table Six: Margin Transaction Summary (Weekly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	MTWeek	信用交易周份	C	7				YYYY-WW 格式
3	WeekBeginDate	周份开始交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式, 取每周的第一个交易日期
4	WeekEndDate	周份最后交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式, 取每周的最后一个交易日期
5	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元		融资余额=各交易所所有可融资标的股票当周最后一个交易日的融资余额总和
6	FinanceBalanceGrowth	融资余额较上周增长比例	N	10	2	%		= (本周融资余额/上周融资余额-1) *100
7	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股		融券余量=各交易所所有可融券标的股票当周最后一个交易日的融券余量总和
8	SecShortBalanceGrowth	融券余量较上周增长	N	10	2	%		= (本周融券余量/上周融券余量-1) *100



		比例						
9	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元		融券余额=各交易所所有可融资标的股票当周最后一个交易日的融券余额总和
10	ShortBalanceGrowth	融券余额较上周增长比例	N	10	2	%		= (本周融券余额/上周融券余额-1) *100
11	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元		融资融券余额=各交易所所有可融资或融券标的股票当周最后一个交易日的融资融券余额总和
12	MTBalanceGrowth	融资融券余额较上周增减比例	N	10	2	%		= (本周融资融券余额/上周融资融券余额-1) *100
13	NumStockFinance	当周发生融资的股票数量	N	14	0	只		各交易所当周融资买入量不为 0 的股票数量
14	NumStockShort	当周发生融券的股票数量	N	14	0	只		各交易所当周融券卖出量不为 0 的股票数量

表 7 交易汇总表（月）（CHN\_STKMT\_MSummary）

Table Seven: Margin Transaction Summary (Monthly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	MTMonth	信用交易月份	C	7				YYYY-MM 格式

3	MonthBeginDate	月份最初交易日期	C	10			YYYY-MM-DD 格式, 取每月的第一个交易日期
4	MonthEndDate	月份最后交易日期	C	10			YYYY-MM-DD 格式, 取每月的最后一个交易日期
5	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元	融资余额=各交易所所有可融资标的股票当月最后一个交易日的融资余额总和
6	FinanceBalanceGrowth	融资余额较上月增长比例	N	10	2	%	= (本月融资余额/上月融资余额-1) *100
7	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股	融券余量=各交易所所有可融券标的股票当月最后一个交易日的融券余量总和
8	SecShortBalanceGrowth	融券余量较上月增长比例	N	10	2	%	= (本月融券余量/上月融券余量-1) *100
9	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元	融券余额=各交易所所有可融券标的股票当月最后一个交易日的融券余额总和
10	ShortBalanceGrowth	融券余额较上月增长比例	N	10	2	%	= (本月融券余额/上月融券余额-1) *100
11	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元	融资融券余额=各交易所所有可融资或融券标的股票当月最后一个交易日的融资融券余额总和
12	MTBalanceGrowth	融资融券余额较上月增减比例	N	10	2	%	= (本月融资融券余额/上月融资融券余额-1) *100
13	NumStockFinance	当月发生融资的股票数量	N	14	0	只	各交易所当月融资买入量不为 0 的股票数量
14	NumStockShort	当月发生融券的股票数量	N	14	0	只	各交易所当月融券卖出量不为 0 的股票数量

表 8 交易汇总表 (年) (CHN\_STKMT\_YSummary)

Table Eight: Margin Transaction Summary (Yearly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	MTYear	信用交易年份	C	7				YYYY 格式
3	YearBeginDate	年份开始交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式, 取每年的第一个交易日期
4	YearEndDate	年份末尾交易日期	C	10				YYYY-MM-DD 格式, 取每年的最后一个交易日期
5	FinanceBalance	融资余额	N	16	0	元		融资余额=各交易所所有可融资标的股票当年最后一个交易日的融资余额总和
6	FinanceBalanceGrowth	融资余额较上年增长比例	N	10	2	%		= (本年融资余额/上年融资余额-1) *100
7	SecShortBalance	融券余量	N	14	0	股		融券余量=各交易所所有可融券标的股票当年最后一个交易日的融券余量总和
8	SecShortBalanceGrowth	融券余量较上年增长比例	N	10	2	%		= (本年融券余量/上年融券余量-1) *100
9	ShortBalance	融券余额	N	16	0	元		融券余额=各交易所所有可融券标的股票当年最后一个交易日的融券余额总和
10	ShortBalanceGrowth	融券余额较上年增长比例	N	10	2	%		= (本年融券余额/上年融券余额-1) *100
11	MTBalance	融资融券余额	N	16	0	元		融资融券余额=各交易所所有可融资或融券标的股票当年最后一个交易日的融资融券余额总和
12	MTBalanceGrowth	融资融券余额较上年	N	10	2	%		= (本年融资融券余额/上月融资融券余额-1) *100

		增减比例					
13	NumStockFinance	当年发生融资的股票数量	N	14	0	只	各交易所当年融资买入量不为 0 的股票数量
14	NumStockShort	当年发生融券的股票数量	N	14	0	只	各交易所当年融券卖出量不为 0 的股票数量

表 9 融资融券标的信息表（日）（CHN\_STKMT\_DUnderlyings）

Table Night: Information Of Underlying In Margin Transaction (Daily)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	MTDate	信用交易日期	C	10				YYYY-MM-DD
3	StockCode	股票代码	C	6				
4	StockName	股票简称	C	20				
5	FinanceAvailable	可融资标识	C	1				Y: 表示可融资; N: 表示该期不可融资
6	ShortAvailable	可融券标识	C	1				Y: 表示可融券; N: 表示该期不可融券

表 10 可冲抵保证金证券信息表 (CHN\_STKMT\_Collateral)

Table Ten: Information Of Collaterals In Margin Transaction

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	ImplementDate	实施日期	C	10				YYYY-MM-DD
3	SecurityType	证券类别	C	20				
4	SecurityType_Sub	-证券类别细分	C	60				
5	HighestDiscount	最高折算率	N	6	2			试点阶段, 以《上海证券交易所融资融券交易试点实施细则》和《深圳证券交易所融资融券交易试点实施细则》中规定的各类证券充抵保证金的最高折算率为准。各券商的实际折算率均低于或等于该最高折算率

表 11 会员融资融券信息表 (月) (CHN\_STKMT\_MMemberStat)

Table Eleven: Information Of Qualified Members In Margin Transaction (Monthly)

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			

1	ExchangeCode	交易所代码	C	10				SHSE: 上交所; SZSE: 深交所
2	MTMonth	信用交易月份	C	10				YYYY-MM 形式
3	MemberName	会员名称	C	100				
4	FinanceAmount	本月累计融资买入额	N	16	0	元		深交所公布数据, 上交所暂无此数据。
5	FinanceBalance	月末融资余额	N	16	0	元		深交所公布数据, 上交所暂无此数据。
6	SecurityShort	本月累计融券卖出量	N	14	0	股		深交所公布数据, 上交所暂无此数据。
7	SecurityBalance	月末融券余量	N	14	0	股		深交所公布数据, 上交所暂无此数据。
8	ShortBalance	月末融券余额	N	16		元		深交所公布数据, 上交所暂无此数据。
9	MTBalance	月末融资融券余额	N	16	0	元		深交所公布数据, 上交所暂无此数据。

表 12 融资融券业务资格表 (CHN\_STKMT\_CoQuarified)

Table Thirteen: Information Of Qualified Securities Company In Margin Transaction

序号	字段名称	字段中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
1	CoName	会员名称	C	100				证监会审批的资格券商

2	QuarifiedDate	审批日期	C	10			YYYY-MM-DD 形式
3	FinanceQuarified	融资资格	C	1			Y:是; N:否
4	ShortQuarified	融券资格	C	1			Y:是; N:否

## 附录

### 1. 重要计算公式说明

- \* 融资融券余额=本日融资余额+本日融券余额
- \* 本日融资余额=前日融资余额+本日融资买入额-本日融资偿还额;
- \* 本日融资偿还额=本日直接还款额+本日卖券还款额+本日融资强制平仓额+本日融资正权益调整-本日融资负权益调整;
- \* 本日融券余量=前日融券余量+本日融券卖出数量-本日融券偿还量;
- \* 本日融券偿还量=本日买券还券量+本日直接还券量+本日融券强制平仓量+本日融券正权益调整-本日融券负权益调整-本日融券应划转量;
- \* 本日融券余额=本日融券余量\*本日融券标的收盘价(若本日收盘价无法取得,用最近的交易日的收盘价)
- \* 融券单位:股(标的证券为股票)/份(标的证券为基金)/手(标的证券为债券)。(关于债券单位:上交所单位为手 深交所为张)

### 2. 业务描述

#### 一、什么是融资交易

融资交易是指,投资者向证券公司交纳一定的保证金,融(借)入一定数量的资金买入股票的交易行为。投资者向证券公司提交的保证金可以是现金或者可充抵保证金的证券。证券公司向投资者进行授信后,投资者可以在授信额度内买入由证券交易所和证券公司公布的融资标的名单内的证券。投资者信用账户内融资买入的证券及其他资金证券,整体作为其对证券公司所负债务的担保物。

融资交易为投资者提供了一种新的交易方式。如果证券价格符合投资者预期上涨,融入资金购买证券,而后通过以较高价格卖出证券归还欠款能放大盈利;如果证券价格不符合投资者预期,股价下跌,融入资金购买证券,而后卖出证券归还欠款后亏损将被放大。因此融资交易是一种杠杆交易,能



放大投资者的盈利或者亏损，参与融资融券交易要求投资者有较强的证券研究能力和风险承受能力。（来自光大证券）

## 二、什么是融券交易

融券交易是指，投资者向证券公司交纳一定的保证金，融入一定数量的证券并卖出的交易行为。投资者融入的证券不进入其信用证券账户，而是在融券卖出成交当日结算时由证券公司代为支付，卖出证券所得资金除买券还券外不得作其他用途。投资者信用账户内的融券卖出资金及其他资金证券，整体作为其对证券公司所负债务的担保物。

融券交易为投资者提供了新的盈利方式和规避风险的途径。投资者如果预期证券价格即将下跌，可以借入证券卖出，而后通过以更低价格买入还券获利；或是通过融券卖出来对冲已持有证券的价格波动，以套期保值。

## 参考文献

[上海证券交易所融资融券交易试点会员业务指南 \(2010-03-22\)](#)

[上海证券交易所融资融券交易试点实施细则](#)

[深圳证券交易所融资融券交易试点会员业务指南 2010 修订版](#)

[深圳证券交易所融资融券交易试点实施细则](#)

[上交所 关于融资融券业务试点初期标的证券与可充抵保证金证券范围的通知](#)

[深交所 关于融资融券业务试点初期标的证券名单与可充抵保证金证券范围的通知](#)

[上海证券交易所市场参与者融资融券实施技术指引](#)

[《中国证券登记结算有限责任公司融资融券试点登记结算业务实施细则》](#)