

GTA_IDX 2011V

指数研究数据库

中国证券市场指数研究数据库

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	1
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	4
四、数据库说明	5
1、总体结构	5
2、产品统计	6
3、计算方法	6
4、特殊说明	7
五、数据结构说明	8
附录	18
附录一、参考法规	18
附录二、行业代码分类结构	19

用户许可协议

版权与所有权声明

中国证券市场指数研究数据库（China Securities Market Indices Research Database）系统是由深圳市国泰安信息技术有限公司设计、开发。系统及其文档的所有权归属于深圳市国泰安信息技术有限公司（以下简称“国泰安信息技术有限公司”、“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。

“中国证券市场指数研究数据库”的名称已受到注册商标和其它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，另一方为国泰安信息技术有限公司。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、本系统仅给用户提供了唯一使用许可权。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。
- 2、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和数据版权和所有权。
- 3、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。
- 4、用户必须同意在本许可协议终止前，一直承担本协议所要求的一切责任和义务。

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，国泰安公司可以即时终止其使用许可。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

指数是一种表明社会经济现象动态的相对数，运用指数可以测定不能直接相加和不能直接对比的社会经济现象的总动态；可以分析社会经济现象总变动中各因素变动的的影响程度；可以研究总平均指标变动中各组标志水平和总体结构变动的作用。证券指数即证券价格指数，是由证券交易所或金融服务机构编制的表明证券市场走向和变动的一种供参考的指示数字。证券价格指数代表了那些构成指数的证券的价值，是某一个特定市场或行业的晴雨表，也是衡量金融或经济实效的基准。由于证券价格起伏无常，投资者必然面临市场价格风险。对于具体某一种证券的价格变化，投资者容易了解，而对于多种证券的价格变化，要逐一了解，既不容易，也不胜其烦。为了适应这种情况和需要，一些金融服务机构就利用自己的业务知识和熟悉市场的优势，编制出证券价格指数，公开发布，作为市场价格变动的指标。投资者据此就可以检验自己投资的效果，并用以预测证券市场的动向。

早在1884年，道·琼斯公司的创始人查理斯·道就开始编制世界历史上最为悠久的股票指数道·琼斯股票指数，其他几个目前世界上很有影响力的指数也都在二十世纪初期和中期纷纷面世。例如：标准·普尔证券价格指数，纽约证券交易所股票价格指数，日经道·琼斯股价指数，《金融时报》股票价格指数，和香港恒生指数等等。相比之下，我国的证券市场起步较晚，证券价格指数最早出现于上个世纪九十年代初期。尽管如此，随着我国近年来经济实力的不断增强，与世界经济和金融的交融也越来越多，我国的证券市场在过去的二十年间发展迅猛，与此同时，很多作为某个特定市场或行业的晴雨表的指数发展也很快。

中国证券市场指数研究数据库的设计主要是以研究为目的，它包含了所有上交所和深交所发布的指数基本信息文件、1990年到2011年指数行情数据、指数取样变更文件和股票指数样本股信息。中国证券市场指数研究数据库将每年更新一次，以确保数据的持续性。中国证券市场指数研究数据库结构合理、查询方便，能根据用户的要求，方便快捷的检索出一系列数据，并能灵活地以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，这为研究人员从事研究带来了很大的方便。

希望中国证券市场指数研究数据库的推出，能促进高等院校的经济、会计与金融学者，金融机构（尤其是证券公司、基金公司、投资银行）等中国金融市场研究机构和个人对中国金融市场的研究。

二、说明书使用指南

本使用指南是《中国证券市场指数研究数据库（China Securities Market Indices Research Database）》（2011 版）的使用说明。

中国证券市场指数研究数据库在以下章节中简称指数研究数据库。

指数研究数据库（2011 版）数据区间为 1990 年—2011 年。

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，针对的用户是金融、经济、管理等类高等院校及其学生、教师和研究学者，金融机构（尤其是证券公司、基金公司、投资银行）等中国金融市场的研究机构和个人。

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、产品使用指南

1、内容

指数研究数据库收集了最早从 1990 年 12 月 19 日以来上交所和深交所发布的指数行情。本数据库内容涵盖了：

- ◇ 指数基本信息文件，包括交易所指数代码、指数名称、基准日期、基准点数、样本范围、加权方式、发布机构、指数类别、指数类型、所属市场和计算公式等字段。
- ◇ 指数取样变更文件，包括变更日期、成份证券代码、成份证券名称和变动方式等字段。
- ◇ 指数行情文件，包括交易日期、开盘指数、最高指数、最低指数、收盘指数、成份证券成交量、成份证券成交金额和指数汇报率等字段。
- ◇ 股票指数样本股基本信息文件，包括证券代码、证券简称、公司全称、公司英文名称、成立日期、上市日期、招股日期和行业类型等字段。

2、特点

- **完整性**

本数据库记录了来源于权威信息源的，相关研究课题及领域的全部信息，具有其它国内同类数据库无可比拟的完整性，数据项全面完整，并在合理预测的基础上留有设计空间以满足日后需要。

- **准确性**

本数据库主要是以研究为目的而设计开发，具有高度的准确性。我们对数据逐项进行了细致的校对和查验工作，并在此基础上采用了严格的数据检验方法，进行了多种方法的严格查证和确认，避免了错漏情况的发生，确保了数据的准确性。

- **及时性**

我们将对本数据库每年进行定期更新以及不定期跟踪增补，以保证其及时性和持续性。

- **规范性**

本数据库的开发借鉴了 CRSP、Compustat 和 PACAP (Pacific-Basin Capital Markets) 等国际知名数据库成功的开发经验, 力求在规范性上达到世界标准。

- 便捷性

本数据库采用开放式的数据结构, 配合国泰安开发的数据专用软件系统, 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研究数据。

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) 提供整个数据库文件, 用户可随时根据自己的需要调用数据库中的数据。数据采用专用格式 (.gta) 集成, 配合国泰安出品的数据专用软件系统使用, 具体使用指南参照软件说明书。
- (2) 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, 由国泰安专门的客户服务部门负责。

四、数据库说明

1、总体结构

本数据库的总体结构如下：

表名	字段数	数据区间	频率	来源
指数基本信息文件	12	1991.04.04.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
指数取样变更文件	7	1991.04.04.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
指数成份股权权重文件	5	2008.01.04.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
指数日行情文件	9	1991.04.04.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
指数月行情文件	11	1991.04.04.~	月度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
指数年行情文件	11	1991.04.04.~	年度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
股票指数样本股基本信息文件	9	1991.04.04.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
股票指数日市值文件	8	1991.04.04.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
股票指数样本股日市值文件	10	1990.12.19.~	日度	上海证券交易所和深圳证券交易所上市的公司的定期及临时公告
国际指数基本信息文件	3	2005.08.15.~	日度	各国证券交易所
国际指数日行情文件	8	2005.08.15.~	周度	各国证券交易所
国际指数月	10	2005.08.15.~	月度	各国证券交易所

行情文件				
国际指数年行情文件	10	2005.08.15.~	年度	各国证券交易所

2、产品统计

GTA_IDX-CN-2011 版共有 13 个文件，113 个字段，涉及 115 个指数。

3、计算方法

(1) 指数基本信息文件 (IDX_IdxInfo)

派氏加权方式：由德国经济学家 Hermann Paasche 提出，用于测量当前相对于某一特定基点或基期的价格或数量水平。该指数与拉氏加权方式（由另一个德国经济学家 étienne Laspeyres 提出）的不同之处在于它是采用了现时加权。

指数计算公式：上证指数：

报告期指数= 报告期成份股的调整市值/ 基期× 基期指数

深证指数：

实时指数=上一交易日收市指数× Σ （样本股实时成交价×样本股权数）/ Σ （样本股上一交易日收市价×样本股权数）

(2) 指数行情文件 (IDX_IdxTrd)

指数回报率：

$$R_{n,t} = \frac{r_{n,t}}{r_{n,t-1}} - 1$$

其中：

$R_{n,t}$ ：指数 n 在 t 日的回报率；

$r_{n,t}$ ：指数 n 在 t 日的收盘指数；

$r_{n,t-1}$: 指数 n 在 t-1 日的收盘指数。

4、特殊说明

(1) 行业类型:

以中国证监会制定颁布的上市公司行业分类为准。 它是国家统计局《上市公司行业分类指引》(2001 版) 为主要依据。

五、数据结构说明

表一 指数基本信息文件 (IDX_Idxinfo)

序号	字段名称	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	Indexcd	交易所指数代码	C	10				以交易所实际指数代码为准
2	Idxinfo01	指数名称	C	100				以交易所实际指数名称为准
3	Idxinfo02	基准日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
4	Idxinfo03	基准点数	N	18	3			
5	Idxinfo04	样本范围	M					以实际披露录入
6	Idxinfo05	加权方式	C	100				1=派氏加权法; 2=简单平均加权法; 3=等权重方式; 4=其它
7	Idxinfo06	发布机构	C	100				1=上海证券交易所; 2=深圳证券交易所; 3=中证指数有限公司; 4=深圳证券信息有限公司; 5=其它
8	Idxinfo07	指数类别	C	20				1=股票类,2=基金类,3=债券类
9	Idxinfo08	指数类型	N	1	0			1=综合指数类,2=样本指数类,3=分类指数类,4=其他指数类
10	Idxinfo09	所属市场	C	100				1=上海, 2=深圳, 3=沪深
11	Idxinfo10	计算公式	C	200				以实际披露为准
12	Idxinfo11	开始日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示

表二 指数取样变更文件 (IDX_Chgsmp)

序号	字段名称	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	Indexcd	交易所指数代码	C	10				以交易所实际指数代码为准
2	Chgsmp01	变更日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
3	Chgsmp02	成份证券代码	C	50				以上交所、深交所公布的证券代码为准
4	Chgsmp03	成份证券简称	C	50				以上交所、深交所公布的证券简称为准
5	Chgsmp04	变动方式	C	10				1=新增, 2=剔除
6	Chgsmp05	证券类型	C	10				1=股票类,2=基金类,3=债券类
7	Chgsmp06	公告日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示

表三 指数成份股权重文件 (IDX_Smprat)

序号	字段名称	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	Indexcd	指数代码	C	10				以交易所实际指数代码为准
2	Enddt	截止日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
3	Stkcd	成份证券代码	C	50				以上交所、深交所公布的证券代码为准

序号	字段名称	中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
4	Constdnme	成份证券简称	C	50				以上交所、深交所公布的证券简称为准
5	Weight	权重	N	10	4	%		

表四 指数日行情文件 (IDX_Idxtrd)

序号	字段名称	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	Indexcd	交易所指数代码	C	10				以交易所实际指数代码为准
2	Idxtrd01	交易日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
3	Idxtrd02	开盘指数	N	18	2			每日交易中的第一条指数
4	Idxtrd03	最高指数	N	18	2			每日交易中的最高一条指数
5	Idxtrd04	最低指数	N	18	2			每日交易中的最低一条指数
6	Idxtrd05	收盘指数	N	18	2			每日交易中的最后一条指数
7	Idxtrd06	成份证券成交量	N	18	2	万股		0=没有交易量
8	Idxtrd07	成份证券成交金额	N	18	2	万元		计量货币：人民币。 0=没有交易金额或交易量较小
9	Idxtrd08	指数回报率	N	18	6	%		字段说明见“回报率计算方法”

表五 指数月行情文件 (IDX_Idxtrdmth)

序号	字段名称	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	Indexcd	指数代码	C	10				以交易所实际指数代码为准
2	Month	月度标识	C	7				以 YYYY-MM 表示
3	Opdt	月开盘日期	C	10				
4	Clsdt	月收盘日期	C	10				
5	Opnidx	开盘指数	N	18	2			
6	Highidx	最高指数	N	18	2			
7	Lowidx	最低指数	N	18	2			
8	Clsidx	收盘指数	N	18	2			
9	Vol	成份证券成交量	N	18	2	万股		0=没有交易量
10	Value	成份证券成交金额	N	18	2	万元		计量货币：人民币。0=没有交易金额或交易量较小
11	Idxrtn	指数回报率	N	18	6	%		字段说明见“回报率计算方法”

表六 指数年行情文件 (IDX_Idxtrdyear)

序号	字段名称	中文名称	字段类型	单位	特殊	字段说明
----	------	------	------	----	----	------

			类型	长度	小数位			
1	Indexcd	指数代码	C	10				以交易所实际指数代码为准
2	Year	年度标识	C	4				以 YYYY 标识
3	Opdt	年开盘日期	C	10				
4	Clsdt	年收盘日期	C	10				
5	Opnidx	开盘指数	N	18	2			
6	Highidx	最高指数	N	18	2			
7	Lowidx	最低指数	N	18	2			
8	Clsidx	收盘指数	N	18	2			
9	Vol	成份证券成交量	N	18	2	万股		0=没有交易量
10	Value	成份证券成交金额	N	18	2	万元		计量货币：人民币。0=没有交易金额或交易量较小
11	Idxrtn	指数回报率	N	18	6	%		字段说明见“回报率计算方法”

表七 股票指数样本股基本信息文件 (IDX_Smpinfo)

序号	字段名称	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	Stkcd	证券代码	C	10				以上交所、深交所公布的证券代码为准
2	Smpinfo01	证券简称	C	20				以上交所、深交所公布的证券简称为准
3	Smpinfo02	公司全称	C	100				上市公司的全称

序号	字段名称	中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
4	Smpinfo03	公司英文全称	C	100				上市公司的英文全称
5	Smpinfo04	成立日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
6	Smpinfo05	上市日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
7	Smpinfo06	招股日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
8	Smpinfo07	行业类型	C	10				以中国证监会制定颁布的上市公司行业分类为准
9	Smpinfo08	A、B 股交叉码	C	10				指该公司发行的其他证券代码，以交易所公布的证券代码为准。NULL：指该公司只发行了 A 股。

表八 股票指数日市值文件 (IDX_Idxcop)

序号	字段名称	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	Indexcd	交易所指数代码	C	6				以上交所、深交所公布的证券代码为准
2	Idxcop01	指数名称	C	20				以交易所实际指数名称为准
3	Idxcop02	交易日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
4	Idxcop03	总股本	N	18	2	股		
5	Idxcop04	流通股本	N	18	2	股		
6	Idxcop05	样本数量	N	18	2	家		

序号	字段名称	中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
7	Idxcop06	样本股组合总市值	N	20	2	千元		交易当天的样本股交易市值总数
8	Idxcop07	样本股组合流通市值	N	20	2	千元		交易当天的样本股交易流通股市值总数

表九 股票指数样本股日市值文件 (IDX_Idxstk)

序号	字段名称	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	Stkcd	证券代码	C	6				以上交所、深交所公布的证券代码为准
2	Idxstk01	交易日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
3	Idxstk02	总股数	N	18	2	股		
4	Idxstk03	A 股流通股数	N	18	2	股		
5	Idxstk04	B 股流通股数	N	18	2	股		
6	Idxstk05	H 股流通股数	N	18	2	股		
7	Idxstk06	股票总市值	N	18	2	千元		总股数*当日收盘价
8	Idxstk07	流通股市值	N	18	2	千元		流通股*当日收盘价
9	Idxstk08	收盘价	N	18	3			A 股以人民币计元, 上海 B 以美元计, 深圳 B 以港币计。
10	Idxstk09	成交量	N	18	3	股		0=没有交易量或交易量很少

表十 国际指数基本信息文件 (IDX_Gidxinfo)

序号	字段名称	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	Indexcd	指数代码	C	50				GTA 指数代码, 为指数永久性代码。此为指数唯一标识
2	Idxnme	指数简称	C	100				
3	Cuncd	指数所属国别代码	C	100				

表十一 国际指数日行情文件 (IDX_Gidxtrd)

序号	字段名称	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	Indexcd	指数代码	C	50				GTA 指数代码, 为指数永久性代码。此为指数唯一标识
2	Trddt	交易日期	C	10				以 YYYY-MM-DD 表示
3	Opnidx	开盘指数	N	18	2			每日交易中的第一条指数
4	Highidx	最高指数	N	18	2			每日交易中的最高一条指数
5	Lowidx	最低指数	N	18	2			每日交易中的最低一条指数
6	Clsidx	收盘指数	N	18	2			每日交易中的最后一条指数
7	Vol	成份证券成交量	N	18	2	万股		0=没有交易量

序号	字段名称	中文名称	字段类型			单位	特殊值	字段说明
			类型	长度	小数位			
8	Value	指数回报率	N	18	6	%		字段说明见“回报率计算方法”

表十二 国际指数月行情文件 (IDX_Gidxtrdmth)

序号	字段名称	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	Indexcd	指数代码	C	50				GTA 指数代码, 为指数永久性代码。此为指数唯一标识
2	Month	月度标识	C	7				以 YYYY-MM 表示
3	Opdt	月开盘日期	C	10				
4	Clsdt	月收盘日期	C	10				
5	Opnidx	开盘指数	N	18	2			
6	Highidx	最高指数	N	18	2			
7	Lowidx	最低指数	N	18	2			
8	Clsidx	收盘指数	N	18	2			
9	Vol	成份证券成交量	N	18	2	万股		0=没有交易量
10	Idxrtn	指数回报率	N	18	6	%		字段说明见“回报率计算方法”

表十三 国际指数年行情文件 (IDX_Gidxtrdyear)

序号	字段名称	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	Indexcd	指数代码	C	50				GTA 指数代码, 为指数永久性代码。此为指数唯一标识
2	Year	年度标识	C	4				以 YYYY 表示
3	Opdt	年开盘日期	C	10				
4	Clsdt	年收盘日期	C	10				
5	Opnidx	开盘指数	N	18	2			
6	Highidx	最高指数	N	18	2			
7	Lowidx	最低指数	N	18	2			
8	Clsidx	收盘指数	N	18	2			
9	Vol	成份证券成交量	N	18	2	万股		0=没有交易量
10	Idxrtn	指数回报率	N	18	6	%		字段说明见“回报率计算方法”

附录

附录一、参考法规

在本数据库的建立过程中，参照了如下（但不限于有关中国上市公司的法规制度）：

序号	制度颁布 /更新时间	制度发布单位	制度名称
1	1991年06月22日	深圳证券交易所	深圳证券交易所业务规则
2	1993年01月	上海深圳交易所	上海深圳交易所交易市场业务规则
3	1993年06月3日	中国证监会	关于公开发行股票报送材料要求的通知
4	1993年06月12日	中国证监会	公开发行股票公司信息披露实施细则(试行)
5	1993年08月13日	国务院	国务院证券委员会关于授权中国证券监督管理委员会查处证券违法违纪行为的通知
6	1996年01月25日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于禁止股票发行中不当行为的通知
7	1996年02月10日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于规范上市公司股东大会的通知
8	1996年03月21日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于授权地方证券、期货监管部门行使部分监管职责的决定
9	1996年07月26日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于加强股票发行市场监管工作的通知
10	1996年08月22日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于坚决制止股票发行中透支等行为的决定

11	1996年10月31日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于严禁操纵证券市场行为的通知
12	1996年12月26日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于股票发行工作若干规定的通知
13	1998年03月17日	中国证监会	中国证券监督管理委员会关于股票发行工作若干问题的补充通知
14	2001年	上海证券交易所	上海证券交易所股票上市规则（修订本）
15	2002年	深圳证券交易所	深圳证券交易所股票上市规则（修订本）
16	2006年9月4日	中国证券业协会	关于发布《中国证券业协会会员反商业贿赂公约》的通知
17	2007年1月30日	中国证监会	上市公司信息披露管理办法
18	2007年2月12日	国务院	国务院关于同意建立整治非法证券活动协调小组工作制度的批复
19	2007年3月9日	中国证监会	关于开展加强上市公司治理专项活动有关事项的通知
20	2007年4月4日	上海证券交易所	关于发布《上海证券交易所上市公司信息披露事务管理制度指引》的通知
21	2007年4月25日	中国证监会	关于做好大额交易和可疑交易报告及相关反洗钱工作的通知

附录二、行业代码分类结构

行业代码分类				
A 农、林、牧、渔业	C1399 其他纤维制品制造业	C6730 贵金属冶炼业	D 电力、煤气及水的生产和供应业	I1110 财产保险业

A01 农业	C14 皮革、毛皮、羽绒及制品制造业	C6740 稀有稀土金属冶炼业	D01 电力、蒸汽、热水的生产和供应业	I1115 再保险业
A0101 种植业	C1401 制革业	C6750 有色金属合金业	E0199 其他土木工程建筑业	I1199 其他保险业
A0199 其他农业	C1405 皮革制品制造业	C6760 有色金属压延加工业	E05 装修装饰业	I21 证券、期货业
A03 林业	C1410 毛皮鞣制及制品业	C69 金属制品业	F 交通运输、仓储业	I2101 证券交易所
A05 畜牧业	C1415 羽毛(绒)加工及制品业	C6901 金属结构制造业	F01 铁路运输业	I2111 证券经纪公司
A0501 牲畜饲养放牧业	C2 木材、家具	C6905 铸铁管制造业	F03 公路运输业	I2121 综合类证券公司
A0505 家禽饲养业	C21 木材加工及竹、藤、棕、草制品业	C6910 工具制造业	F0301 汽车运输业	I2151 期货交易所
A0599 其他畜牧业	C2101 锯材、木片加工业	C6920 集装箱和金属包装物品制造业	F0399 其他公路运输业	I2161 期货经纪公司
A07 渔业	C2105 人造板制造业	C6925 金属丝绳及其制品业	F05 管道运输业	I2199 其他证券、期货业
A0701 海洋渔业	C2110 木制品业	C6930 建筑用金属制品业	F07 水上运输业	I31 金融信托业
A0705 淡水渔业	C2115 竹、藤、棕、草制品业	C6935 金属表面处理及热处理业	F0701 远洋运输业	I41 基金业
A09 农、林、牧、渔服务业	C25 家具制造业	C6999 其他金属制品业	F0705 沿海运输业	I99 其他金融业
A0901 农业服务业	C2501 木制家具制造业	C7 机械、设备、仪表	F0710 内河、内湖运输业	J 房地产业
A0905 林业服务业	C2505 竹、藤家具制造业	C71 普通机械制造业	F0799 其他水上运输业	J01 房地产开发与经营业
A0915 畜牧兽医服务业	C2510 金属家具制造业	C7101 锅炉及原动机制造	F09 航空运输业	J05 房地产管理业

		业		
A0920 渔业服务业	C2525 塑料家具制造业	C7105 金属加工机械制造业	F0901 航空客货运输业	J09 房地产中介服务业
A0999 其他农、林、牧、渔服务业	C2599 其他家具制造业	C7110 通用设备制造业	F0910 通用航空业	J0901 房地产经纪业
B 采掘业	C3 造纸、印刷	C7115 轴承、阀门制造业	F11 交通运输辅助业	J0920 房地产评估业
B01 煤炭采选业	C31 造纸及纸制品业	C7120 其他通用零部件制造业	F1101 公路管理及养护业	J0930 房地产咨询业
B0101 煤炭开采业	C3101 纸浆制造业	C7125 铸件制造业	F1105 港口业	J0999 其他房地产中介服务业
B0105 煤炭洗选业	C3105 造纸业	C73 专用设备制造业	F1110 水运辅助业	K 社会服务业
B03 石油和天然气开采业	C3110 纸制品业	C7301 冶金、矿山、机电工业专用设备制造业	F1115 机场及航空运输辅助业	K01 公共设施服务业
B0301 天然原油开采业	C35 印刷业	C7310 石化及其他工业专用设备制造业	F1120 装卸搬运业	K0101 市内公共交通业
B0305 天然气开采业	C37 文教体育用品制造业	C7320 轻纺工业专用设备制造业	F1199 其他交通运输辅助业	K0199 其他公共设施服务业
B0310 油页岩洗选业	C3701 文化用品制造业	C7325 农、林、牧、渔、水利业机械制造业	F19 其他交通运输业	K10 邮政服务业
B05 黑色金属矿采选业	C3710 体育用品制造业	C7340 医疗器械制造业	F21 仓储业	K20 专业、科研服务业
B0501 铁矿采选业	C3799 其他文教用品制造业	C7350 其他专用设备制造业	G 信息技术业	K2001 法律服务业
B0599 其他黑色金属矿采选业	C4 石油、化学、塑胶、塑料	C7355 专用机械设备修理业	G81 通信及相关设备制造业	K2005 广告业
B07 有色金属矿采选业	C41 石油加工及炼焦业	C75 交通运输设备制造业	G8101 通信设备制造业	K2010 会计、统计、审计

				咨询服务业
B0701 重有色金属矿采选业	C4101 人造原油生产业	C7501 铁路运输设备制造业	G8110 雷达制造业	K2015 建筑、工程咨询服务业
B0715 轻有色金属矿采选业	C4105 原油加工业	C7505 汽车制造业	G8115 广播电视设备制造业	K2020 专业设计服务业
B0730 贵金属矿采选业	C4110 石油制品业	C7510 摩托车制造业	G8120 通信设备修理业	K2025 管理、科技咨询服务业
B0740 稀有稀土金属矿采选业	C4115 炼焦业	C7515 自行车制造业	G83 计算机及相关设备制造业	K2030 社会调查业
B09 非金属矿采选业	C43 化学原料及化学制品制造业	C7520 电车制造业	G8301 电子计算机制造业	K2035 科研开发服务业
B0901 土砂石开采业	C4301 基本化学原料制造业	C7525 船舶制造业	G8310 计算机相关设备制造业	K2099 其他专业、科研服务业
B0911 化学矿开采业	C4310 化学肥料制造业	C7530 航空航天器制造业	G8335 计算机修理业	K30 餐饮业
B0921 采盐业	C4320 化学农药制造业	C7540 其他交通运输设备制造业	G85 通信服务业	K32 旅馆业
B0999 其他非金属矿开采业	C4330 有机化学产品制造业	C7545 交通运输设备修理业	G8501 电信服务业	K34 旅游业
B49 其他矿采选业	C4350 合成材料制造业	C76 电器机械及器材制造业	G8599 其他通信服务业	K36 娱乐服务业
B50 采掘服务业	C4360 专用化学产品制造业	C7601 电机制造业	G87 计算机应用服务业	K37 卫生、保健、护理服务业
B5001 煤炭采选服务业	C4370 日用化学产品制造业	C7610 输配电及控制设备制造业	G8701 计算机软件开发与咨询	K39 租赁服务业

B5003 石油和天然气开采服务业	C47 化学纤维制造业	C7615 电工器械制造业	G8705 计算机网络开发、维护与咨询	K99 其他社会服务业
B5005 黑色金属矿采选服务业	C4701 纤维素纤维制造业	C7620 日用电器制造业	G8710 计算机设备维护咨询业	L 传播与文化产业
B5007 有色金属矿采选服务业	C4705 合成纤维制造业	C7630 照明器具制造业	G8799 其他计算机应用服务业	L01 出版业
B5009 非金属矿采选服务业	C4710 渔具及渔具材料制造业	C7640 其他电器机械制造业	H 批发和零售贸易	L0101 书、报、杂志、资料出版业
B5099 其他矿采选服务业	C48 橡胶制造业	C7645 电器机械修理业	H01 食品、饮料、烟草和家庭用品批发业	L0110 软件出版业
C 制造业	C4801 轮胎制造业	C78 仪器仪表及文化、办公用机械制造业	H0101 食品、饮料、烟草批发业	L0199 其他出版业
C0 食品、饮料	C4805 力车胎制造业	C7801 通用仪器仪表制造业	H0110 绵、麻、土畜产品批发业	L05 声像业
C01 食品加工业	C4810 橡胶板、管、带制造业	C7805 专用仪器仪表制造业	H0120 纺织品、服装、鞋帽批发业	L0501 声乐制品业
C0101 粮食及饲料加工业	C4815 橡胶零件制造业	C7810 电子测量仪器制造业	H0130 日用百货批发业	L0505 影像制品业
C0111 植物油加工业	C4820 再生橡胶制造业	C7815 计量器具制造业	H0140 日用杂品批发业	L10 广播电影电视业
C0115 制糖业	C4825 橡胶靴鞋制造业	C7820 文化、办公用机械制造业	H0150 五金、交电、化工批发业	L1001 广播
C0120 屠宰及肉类蛋类加工业	C4830 日用橡胶制品业	C7825 钟表制造业	H0160 药品及医疗器械批发业	L1005 电影
C0125 水产品加工业	C4835 橡胶制品翻修业	C7835 其他仪器仪表制造业	H03 能源、材料和机械电子设备批发业	L1010 电视

C0130 盐加工业	C4899 其他橡胶制品业	C7840 仪器、仪表及文化、办公用机械修理业	H0301 能源批发业	L15 艺术业
C0199 其他加工业	C49 塑料制造业	C8 医药、生物制品	H0305 化工材料批发业	L20 信息传播服务业
C03 食品制造业	C4901 塑料薄膜制造业	C81 医药制造业	H0310 木材批发业	L2001 信息、数据收集服务业
C0301 糕点、糖果制造业	C4905 塑料板、管、棒材制造业	C8101 化学药品原药制造业	H0315 建筑材料批发业	L2005 数据处理业
C0310 乳制品制造业	C4910 塑料丝、绳及编织品制造业	C8105 化学药品制剂制造业	H0320 矿产品批发业	L2099 其他信息传播服务业
C0320 罐头食品制造业	C4915 泡沫塑料及人造革、合成革制造业	C8110 中药材及中成药加工业	H0325 金属材料批发业	L99 其他传播、文化产业
C0330 发酵制造业	C4920 塑料包装箱及容器制造业	C8115 动物用药品制造业	H0330 机械、电子设备批发业	M 综合类
C0340 调味品制造业	C4925 塑料鞋制造业	C85 生物制品业	H0335 汽车、摩托车及零配件批发业	
C0399 其他食品制造业	C4930 日用塑料杂品制造业	C8501 生物药品制造业	H0340 再生物资回收批发业	
C05 饮料制造业	C4935 塑料零件制造业	C8599 其他生物制品业	H09 其他批发业	
C0501 酒精及饮料酒制造业	C4999 其他塑料制造业	C99 其他制造业	H11 零售业	
C0510 软饮料制造业	C5 电子	D 电力、煤气及水的生产和供应业	H1101 食品、饮料、烟草零售业	
C0520 制茶业	C6115 砖瓦、石灰和轻质建筑材料制造业	D01 电力、蒸汽、热水的生产和供应业	H1130 日用百货零售业	
C0599 其他饮料制造业	C6120 玻璃及玻璃制品业	D0101 电力生产业	H1140 日用杂品零售业	

C1 纺织、服装、皮毛	C6125 陶瓷制品业	D0105 电力供应业	H1150 五金、交电、化工零售业	
C11 纺织业	C6130 耐火材料制品业	D0110 蒸汽、热水的生产 和供应业	H1160 药品及医疗器械零 售业	
C1101 纤维原料初步加工 业	C6150 石墨及碳素制品业	D03 煤气生产和供应业	H1170 图书报刊零售业	
C1105 棉纺织业	C6160 矿物纤维及其制品 业	D0301 煤气生产业	H1199 其他零售业	
C1110 毛纺织业	C6199 其他非金属矿物制 品业	D0305 煤气供应业	H21 商业经纪与代理业	
C1115 麻纺织业	C65 黑色金属冶炼及压延 加工业	D05 自来水的生产和供应 业	I 金融、保险业	
C1120 丝绢纺织业	C6501 炼铁业	D0501 自来水生产业	I01 银行业	
C1125 针织品业	C6505 炼钢业	D0505 自来水供应业 E 建 筑业	I0101 政策性银行	
C1199 其他纺织品业	C6510 钢压延加工业	E01 土木工程建筑业	I0105 合作银行	
C13 服装及其他纤维制品 制造业	C6515 铁合金冶炼业	E0101 房屋建筑业	I0110 国有独资商业银行	
C1301 服装制造业	C67 有色金属冶炼及压延 加工业	E0105 矿山建筑业	I0199 其他商业银行	
C1320 制帽业	C6701 重有色金属冶炼业	E0110 铁路、公路、隧道、 桥梁建筑业	I11 保险业	
C1340 制鞋业	C6715 轻有色金属冶炼业	E0115 堤坝、电站、码头建筑 业	I1101 人寿保险业	

