

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0176.3—2021

证券期货业数据模型
第3部分：证券公司逻辑模型

Securities and futures industry data model—
Part 3: Logical data model of securities company

2021-11-02 发布

2021-11-02 实施

目 次

| | |
|--------------------|-----|
| 前言..... | II |
| 引言..... | III |
| 1 范围..... | 1 |
| 2 规范性引用文件..... | 1 |
| 3 术语和定义..... | 1 |
| 4 逻辑模型梳理..... | 2 |
| 4.1 逻辑模型梳理方式..... | 2 |
| 4.2 逻辑模型的梳理步骤..... | 2 |
| 5 数据域划分..... | 2 |
| 5.1 概述..... | 2 |
| 5.2 主体数据域..... | 3 |
| 5.3 账户数据域..... | 3 |
| 5.4 品种数据域..... | 3 |
| 5.5 交易数据域..... | 3 |
| 5.6 资产数据域..... | 4 |
| 5.7 合同数据域..... | 4 |
| 5.8 渠道数据域..... | 5 |
| 5.9 营销数据域..... | 5 |
| 6 数据域间关联关系..... | 5 |
| 7 实体关系图..... | 6 |
| 8 数据表和数据项..... | 8 |
| 9 英文词根库..... | 9 |
| 10 证券业务分类标签..... | 10 |
| 11 数据敏感性标识..... | 12 |
| 12 代码映射关系..... | 13 |
| 13 产出物说明..... | 13 |
| 参考文献..... | 14 |

前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规范》的规定起草。

本文件是JR/T 0176《证券期货业数据模型》的第3部分。JR/T 0176已经发布了以下部分：

——第1部分：抽象模型设计方法；

——第3部分：证券公司逻辑模型。

本文件由中国证券监督管理委员会提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本文件起草单位：中国证券监督管理委员会、中证信息技术服务有限责任公司、中证数据有限责任公司、中国期货市场监控中心有限责任公司、申万宏源证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、华金证券股份有限公司、华菁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、深圳市金证科技股份有限公司、恒生电子股份有限公司、北京根网科技有限公司、福建新意科技有限公司、上海金仕达软件科技有限公司、福建顶点软件股份有限公司。

本文件主要起草人：姚前、蒋东兴、刘铁斌、罗凯、程立、周云晖、陆骋、金星、周思宇、王恺、周皓、张喆、谢晨、路一、孙宏伟、黄璐、汪萌、张春艳、朱旭、刘佳、王瑞娜、石宏飞、东晓亮、刘建坤、陈真珠、聂亚妮、肖钢、许立芳、宗浩鹏、马丽霞、林柏、燕振华、张玲岩、吴保杰、于鹏、孙静、刘力、凌乐乐、刘殿兴、邱华勇、李细杰、陈林、陈东东、郑振湖、孟祥凯、朱阿柯、吴辉、龙建益、杨展昆、周晓露、孙磊、杨伟锦、陆明其、朱仲春、王俊凯、蒋征中、张凤林、王金辉、白立祥、张晓川、宋子才。

引 言

证券期货业数据化程度相对较高，机构多、类型广、交易方式多样，机构内及机构间数据交换频繁、业务发展迅速，为提高数据交换效率、规范行业机构数据应用系统建设、推进行业数据标准化水平，证券期货行业组织开展了行业数据模型建设工作，旨在清晰描述整个市场的数据流向、数据名称、数据定义、结构类型、代码取值和关联关系等，为行业机构内部系统建设和机构间数据交换提供了基础。

证券期货业数据模型包括抽象模型和逻辑模型两大部分，其中逻辑模型部分，按照行业数据模型公共部分和证券交易所、期货交易所、证券公司、期货公司、基金公司、监管机构的不同视角，以“1+6”的方式，依托抽象模型，设计一系列实用性比较强的数据表，最终形成逻辑模型。

《证券期货行业数据模型》标准共分为8个部分：

- 第1部分：抽象模型设计方法；
- 第2部分：逻辑模型公共部分 行业资讯模型；
- 第3部分：证券公司逻辑模型；
- 第4部分：基金公司逻辑模型；
- 第5部分：期货公司逻辑模型；
- 第6部分：证券交易所逻辑模型；
- 第7部分：期货交易所逻辑模型；
- 第8部分：监管机构逻辑模型。

其中第1部分的目的在于形成一套符合监管规范的模型框架，以及一套依据监管规则提炼形成的行业数据字典；第2部分的目的在于规范行业机构资讯数据模型的建设；第3、4、5部分的目的在于规范证券公司、基金公司、期货公司开展数据中心、数据仓库、大数据平台等数据归集建设中的逻辑模型梳理，以及支持应用系统建设；第6、7部分的目的在于规范证券、期货交易所开展逻辑模型梳理；第8部分的目的在于规范监管机构的逻辑模型建设。

证券公司逻辑模型依托抽象数据模型成果，归纳各类业务交易行为、过程中的数据共性，合并、提炼数据特征，形成数据分类；其次，通过找出散乱归类中的核心数据特性，归纳、划分逻辑模型数据域；然后根据“主体-行为-关系”（Identity-Behavior-Relevance，以下简称IBR）的方法，建立数据域之间的关系，形成从核心到外延的逻辑模型架构；最后，以逻辑模型架构为基础，采用通用的逻辑模型设计步骤，进行系统级分析、表级分析、字段级分析、代码整合，构建各数据域中实体及实体间关系，并补充完善实体属性，最终形成证券公司逻辑模型。本文件主要给出了证券公司逻辑模型梳理方法及形成的相关产出物。

证券期货业数据模型 第3部分：证券公司逻辑模型

1 范围

本文件规定了证券公司逻辑模型的梳理方式及步骤、数据域划分、数据域间关联关系、实体关系图、数据表和数据项、英文词根库、证券业务分类标签、数据敏感性标识、代码映射关系及模型产出物说明的相关内容。

本文件适用于证券公司开展数据中心、数据仓库、大数据平台等数据归集建设中的逻辑模型梳理，以及企业数据标准化、主数据管理等数据治理相关工作。

2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

JR/T 0158—2018 证券期货业数据分类分级指引

JR/T 0176.1—2019 证券期货业数据模型 第1部分：抽象模型设计方法

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

主体 identity

证券公司开展业务过程中的相关各方。

3.2

账户 account

记录主体（3.1）关于品种、资金的持有情况及变动情况的载体。

3.3

品种 variety

可以被主体（3.1）发行、出售、购买的能够满足特定金融需求的各种金融工具或金融服务。

3.4

交易 trading

证券公司与客户等主体（3.1）的交互行为，客户在证券公司参与证券期货市场的所有行为，以及该行为触发的其他参与者的所有行为。

3.5

资产 asset

主体（3.1）在证券期货市场上投资、交易形成的能够带来经济利益的资源。

3.6

合同 agreement

证券公司根据相关法律法规、规章制度以及交易所的交易规则制定的协议。

3.7

渠道 channel

证券公司与客户、合作伙伴及内部机构等在开户、交易、资金存取、通知、产品营销推荐等业务场景下进行交互的通道。

3.8

营销 marketing

为了获取、维护、增强证券公司与客户的关系而开展的一些促销活动。

注：包括各类营销任务、营销服务等内容。

4 逻辑模型梳理

4.1 逻辑模型梳理方式

证券公司逻辑模型采用上下结合的方式进行梳理：

——上则是以行业抽象模型为基础，采用自顶向下的方法进行梳理；

——下则是从自底向上的角度，采用金融行业逻辑模型通用的建设方法进行设计，通过系统级分析、表级分析、字段级分析、代码整合，构建各数据域中实体及实体间关系，并补充完善实体属性，最终形成逻辑模型。

4.2 逻辑模型的梳理步骤

数据域的划分、数据域和数据域之间关联关系的构建是模型编制的基础。证券公司逻辑模型的梳理步骤如下：

- a) 针对证券公司所涉及到的品种，根据 JR/T 0176.1—2019 的抽象模型设计方法，归纳业务交易行为、数据共性，合并、提炼数据特征，形成数据分类；
- b) 在数据分类中，根据核心数据特性归纳并划分逻辑模型数据域（见第 5 章）；
- c) 结合证券公司业务系统的分析，建立数据域间关联关系（见第 6 章），形成从核心到外延的逻辑模型架构；
- d) 在逻辑模型架构的基础上，采用通用的逻辑模型设计步骤，形成逻辑模型成果（见第 7 章～13 章），具体如下：
 - 1) 实体关系图；
 - 2) 数据表和数据项；
 - 3) 行业英文词根库及模型的英文翻译；
 - 4) 证券业务分类标签；
 - 5) 数据敏感性标签；
 - 6) 主流系统软件商代码映射关系。

5 数据域划分

5.1 概述

证券公司逻辑模型数据域的划分是应用第 4 章给出的逻辑模型梳理方式，在抽象模型的梳理成果的基础上，结合证券公司逻辑模型所涉及的数据范围，通过归纳数据特征，提炼得到数据共性，进而形成

数据归类，划分为主体、账户、品种、交易、资产、合同、渠道、营销八个数据域，下述第 5.2~5.9 节分别为各数据域主要内容的介绍。

5.2 主体数据域

主体数据域是证券公司开展客户关系管理、进行客户画像和标签管理、建设以客户为中心的应用系统的重要基础性模型。主体数据域与账户、交易、资产和合同等其他数据域之间存在着密切的关联关系，是核心数据域，根据证券公司实际业务过程特征、数据分布、完整性、一致性等方面将主体归纳、抽象为用户、客户、内部组织与其他外部组织四大类：

- a) 用户：区别于客户，主要指在正式注册登记为客户前的客户存在形式；
- b) 客户：分为机构客户、个人客户、产品客户；
- c) 内部组织具体包括：
 - 1) 内部机构；
 - 2) 内部员工；
 - 3) 经纪人。
- d) 其他外部组织具体包括：
 - 1) 发行机构；
 - 2) 登记机构；
 - 3) 支付机构；
 - 4) 销售机构。

5.3 账户数据域

账户数据域是主体因业务需求在相关机构登记的各类账户信息，账户数据域按照账户类型划分三大类，包括交易账户、资金账户、银行账户：

- a) 交易账户：证券登记结算机构、基金公司等机构为投资者设立的，用于准确记载投资者所持的证券种类、名称、数量及相应权益和变动情况的账册。按照交易的类型有证券账户、基金账户、基金交易账户、中债登账户、资管账户、资管交易账户、贵金属交易账户、一码通证券账户等。此外，证券账户分类下的某些特定账户存在一些特殊属性，如衍生品合约账户、股票质押出借人账户以及转融通证券出借人账户等，因此对这些账户进行了单独的补充描述；
- b) 资金账户：证券公司为客户开立的专门用于证券交易用途的账户，通过该账户对客户的证券买卖交易进行前端控制以及清算交收和计付利息等，资金账户可按币种维度进行扩展；
- c) 银行账户：银行为客户开立的，用于存放和管理客户证券买卖用途的交易结算资金的账户。

账户数据域包含账户从申请、开立到销户过程中需要的完整信息，与主体、合同、交易、资产数据域有密切联系。

5.4 品种数据域

品种的范围包括证券公司本身对外提供的金融工具和服务，还包括在证券公司业务流程中涉及的其他方提供的金融工具和服务，品种分类如下：

- a) 一级分类包括权益、集合投资工具、债务工具、权利、上市期权、非上市期权和复合上市期权、期货、互换、融资、参考性金融工具等，分类方法按照 GB/T 35964-2018；
- b) 二级分类代表每个品种类别下的细分品种，分类方法按照 GB/T 35964-2018；
- c) 三级及以下级别分类为结合国内品种现状的自定义分类。

5.5 交易数据域

交易数据域用于描述各种与证券公司相关活动的详细情况。这些活动通常指证券公司与客户等主体的交互活动，包括详细的交易行为数据，还包括导致主体、账户、合同等其他数据域数据变化的非交易行为数据。交易数据域可划分为交易事件和非交易事件：

- a) 交易事件：按“交易过程+品种”进行层次划分，即先按交易过程进行分类，再在每个交易过程中按品种进行分类，在证券公司新增业务时，只需在委托等交易过程的子数据域下增加对应品种的交易事件实体，交易事件按交易的过程划分为委托、成交、清算、待交收、股份变动、资金变动、其他交易流水七个子数据域；
- b) 非交易事件：除上述交易事件外，证券公司与客户等主体的交互以及证券公司内部的业务交互，分为管理类事件、操作类事件、服务类事件及其他类非交易事件四个子类的数据划分。非交易事件依据证券公司内部参与主体，对“经营管理领域+经营管理活动”进行层次划分，即先按经营管理领域进行分类，再在每个经营管理领域中按经营管理活动进行分类，同一经营管理领域具有相近的管理属性。

5.6 资产数据域

资产数据域用于描述主体的资产，包括资金的余额、证券的持有、在途资金及证券、客户的抵质押、负债，还包括一些具体场景下的修正。同时，将虚拟资产也一并纳入，以完整描述主体的拥有。

资产数据域按照资产的表现形式，可以分为不同部分。

- a) 市值部分：
 - 1) 持仓；
 - 2) 在途份额；
 - 3) 代销产品份额持有。
- b) 资金部分：
 - 1) 资金余额；
 - 2) 在途资金；
 - 3) 其他应收。
- c) 资产的修正。
- d) 虚拟资产：客户的积分。
- e) 负债：
 - 1) 应还的回购证券款；
 - 2) 应还的融资本金、利息、罚息；
 - 3) 应还的融券市值。

资产数据域既反映了客户资产及证券公司自营资产的历史状态，也代表了未来的经济价值，同时又与其他数据域密切相关。

5.7 合同数据域

合同数据域的数据涵盖证券公司与交易对手方线上签署的电子化合同，客户与证券公司签署的开展某种业务或购买某种产品的协议，以及客户在进行证券交易时产生的交易合约。合同数据域的分类如下：

- a) 合同分类包括：理财产品合同、融资融券授信合同、融资融券信用客户合同、转融通参与人合同、证券收益互换合同；
- b) 合约分类包括：场内合约、场外合约、银行间合约：
 - 1) 场内合约：股票交易市场内标准化的合约交易，包括：融资融券、转融通、股票质押、债券回购、报价回购、约定购回合约；
 - 2) 场外合约：证券收益互换合约；

- 3) 银行间合约：包括利率互换合约、利率远期合约、债券远期合约、同业拆借合约、证券借贷合约、协议存款合约、外汇远期合约、外汇掉期合约、信用违约掉期合约。

5.8 渠道数据域

渠道用于表述业务发生的地点、通道或路径，通常与业务事件关联。渠道数据域由电话、呼叫中心、柜台、银行、客户交易软件终端、合作方渠道及其他渠道组成。

5.9 营销数据域

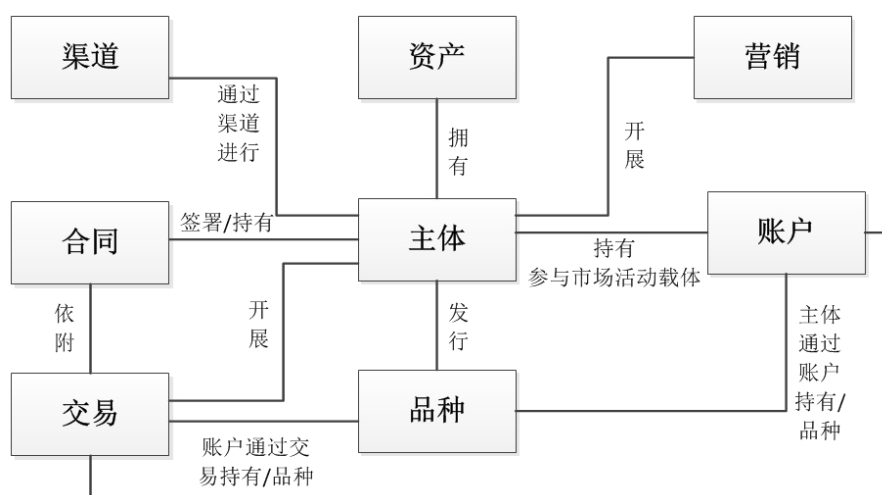
营销用于表述一个主体在意图开展营销活动的领域进行营销活动的行为方式，营销数据域的主要实体有：营销活动、营销任务等，营销数据域涵盖了营销活动全流程，记录营销过程中有价值的数

据。开展营销活动的步骤为：

- 确定营销目标，包括交付目标、预算等；
- 制定营销策略和方案；
- 根据营销方案制定营销任务，包括资源计划和时间计划等；
- 根据营销任务执行营销活动；
- 营销活动结果分析和改进。

6 数据域间关联关系

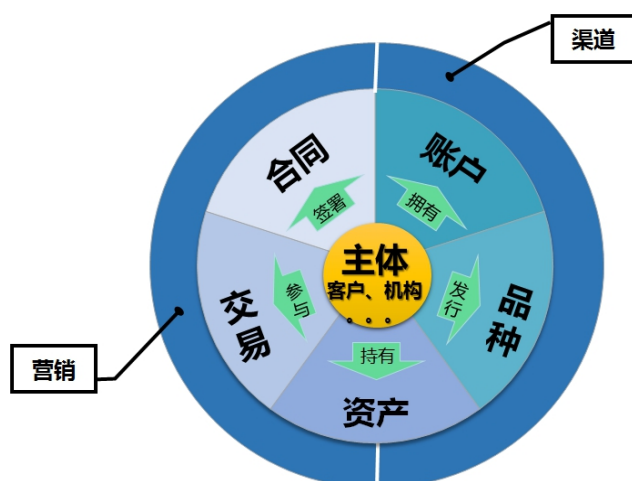
数据域间的关联关系是应用第4章给出的逻辑模型梳理方式，通过对证券公司业务系统的分析，形成各数据域间的关联关系，利用各数据域间的关联关系来体现证券公司的核心业务过程。证券公司逻辑模型中各数据域之间的关联关系如图1所示。



注：上图所述“发行”是指证券公司相关主体发行的相关品种，不泛指股票的发行主体，如股份公司，债券发行主体，如政府机构、金融机构、企业事业单位等。

图1 核心关系

根据数据域和数据域之间的关联关系，确立了以“客户”和“机构”为核心地位的证券公司逻辑模型架构，如图2所示。



注：上图所述“机构”包括证券公司内部组织及登记机构、销售机构等外部组织。

图 2 证券公司逻辑模型中核心到外延的逻辑模型架构

7 实体关系图

实体关系图是证券公司逻辑模型成果之一，是对每个数据域中的数据表、数据项进行关联表达所形成的实体-关系图谱（简称实体关系图），可清晰的体现各数据域中所涉及的数据内容。

通过“主体-行为-关系”（Identity-Behavior-Relevance，简称 IBR）的方法，找出数据域中核心数据的特征和关系，构建数据域之间的核心关系。在证券公司逻辑模型中划分为主体、账户、品种、交易、资产、合同、渠道、营销八大数据域（见第 5 章），在每个数据域中形成各自的实体关系图，证券公司逻辑模型设计过程中账户数据域的实体关系图示例如图 3 所示。

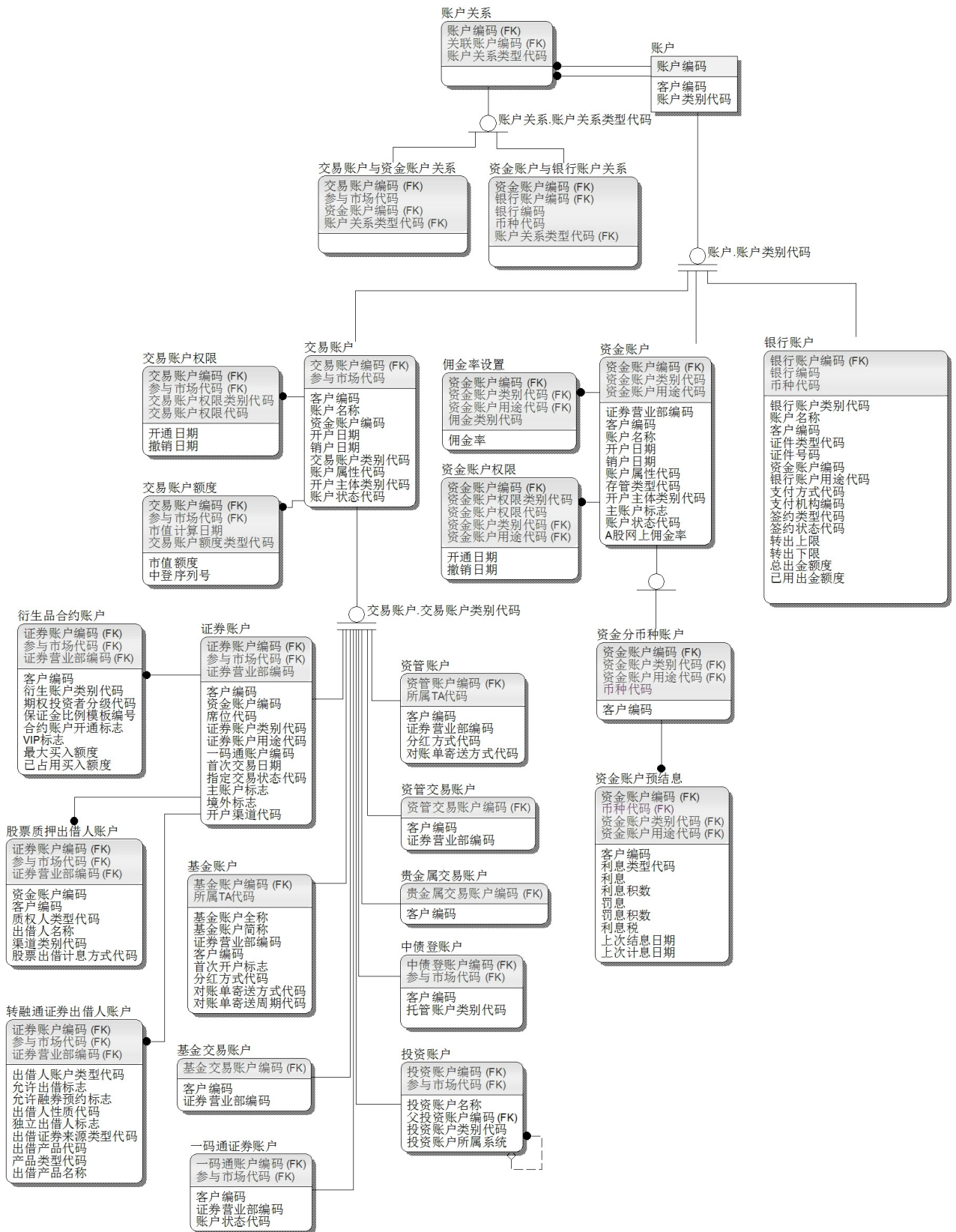


图3 账户数据域实体关系图

8 数据表和数据项

根据实体关系图，梳理整合各数据域中的业务系统，筛选出符合该数据域定义范围的数据表，并完成数据表及数据项的补充。数据表和数据项是证券公司逻辑模型梳理的成果之一。

注：数据表是基于抽象模型的梳理成果进行抽取、制定、设计形成的一系列实用性比较强的表。

在筛选、补充数据表过程中，以划分的各数据域为基础，甄别每项数据域中数据表是否需要新增或删除，并对经筛选和完善后的数据表进行细化设计，确定其具有的数据项及其业务属性。

图4为证券公司逻辑模型中账户数据域关键表及其数据项业务属性的示例。

| 数据域 | 数据表名称 | *数据项名称 | *数据类型 | *属性详细定义 | 代码取值 | *主键标志 |
|-----|-------|-----------|-------|------------------------------------|----------|-------|
| 账户 | 证券账户 | 证券账户编码 | C | 唯一区分客户证券账户的标识。 | | Y |
| 账户 | 证券账户 | 参与市场代码 | C | 用于区分证券交易参与市场的标识。 | DIMLS111 | Y |
| 账户 | 证券账户 | 营业部编码 | C | 唯一区分证券公司下属营业部的标识。 | | Y |
| 账户 | 证券账户 | 客户编码 | C | 唯一区分证券公司客户的标识，由证券公司开立。 | | |
| 账户 | 证券账户 | 资金账户编码 | C | 唯一区分资金持有账户的标识，由证券公司开立。 | | |
| 账户 | 证券账户 | 席位代码 | C | 唯一区分证券公司向交易所进行委托报盘的标识。 | | |
| 账户 | 证券账户 | 证券账户类别代码 | C | 用以区分证券账户类别的标识。 | DIMLS262 | |
| 账户 | 证券账户 | 证券账户用途代码 | C | 用以区分证券账户用途的标识。 | DIMLS263 | |
| 账户 | 证券账户 | 一码通证券账户编码 | C | 唯一区分客户一码通证券账户的标识。 | | |
| 账户 | 证券账户 | 首次交易日期 | D | 记录客户首次交易日期。 | | |
| 账户 | 证券账户 | 指定交易状态代码 | C | 用以区分股东账户的指定交易状态的标识。 | DIMLS273 | |
| 账户 | 证券账户 | 主账户标志 | C | 用于区分该账户是否是主账户的标识。清算交收时用主账户的资金进行结算。 | | |
| 账户 | 证券账户 | 境外标志 | C | 用于区分证券账户是否境外账户的标识。 | | |

图 4 账户关键表及其数据项业务属性示例

9 英文词根库

证券公司逻辑模型中涉及的英文名称及词根的描述应符合表 1 给出的规则。英文词根库是证券公司逻辑模型梳理的成果之一。

表 1 英文名称及词根的描述规则

| 序号 | 规则 | 规则描述 |
|----|------------|---|
| 1 | 大小写规则 | 采用小写字母 |
| 2 | 连接符 | 只能用下划线“_”作为连接符 |
| 3 | 表英文名命名规则 | 1. 需加前缀，前缀为主题域名 |
| | | 2. 表名长度：25 位以内 |
| 4 | 字段英文名命名规则 | 1. 用的词汇不超过 5 个，连接符不超过 4 个 |
| | | 2. 长度：25 位以内，如果超长，需要重新切词 |
| 5 | 切词原则 | 1. 按中文字段名中的词汇进行切词 |
| | | 2. 如遇中文名称过长，抽取主要部分进行翻译，重新切词 |
| 6 | 词根 | 长度不超过 4 位：3 位辅音+1 位元音 |
| 7 | 英文翻译时词根选择 | 1. 词汇不超过长：取易理解业务含义的词根 |
| | | 2. 词汇超长：词根选取从长原则 |
| 8 | 各数据域英文词根命名 | 主体 id、品种 var、账户 acc、交易 evt、资产 ast、营销 mkt、渠道 chn、合同 agt、财务 fin、咨询 inf、跨数据域 pub |

英文词根库（见图5示例），模型的英文名称定义（见图6示例）。

| 序号 | 中文全称 | 英文全称 | 英文缩写 | 增加标志 | 字段长度 (增加标志) | 备注-其他参考 | 所属数据域 |
|----|------|------------|------|-------|----------------|----------|-------|
| 1 | 主体 | Identity | id | _id | 3 | | 主体 |
| 2 | 名称 | Name | name | _name | 5 | | 主体 |
| 3 | 账户 | Account | acc | _acc | 4 | | 账户 |
| 4 | 币种 | Currency | crrc | _crrc | 5 | | 账户 |
| 5 | 品种 | Variety | var | _var | 4 | | 品种 |
| 6 | 证券 | Securities | scr | _scr | 4 | | 品种 |
| 7 | 股票 | Stock | stk | _stk | 4 | | 品种 |
| 8 | 基金 | Fund | fnd | _fnd | 4 | | 品种 |
| 9 | 债券 | Bond | bond | _bond | 5 | | 品种 |
| 10 | 期货 | Futures | futr | _futr | 5 | | 品种 |
| 11 | 委托 | Entrust | etru | _etru | 5 | Entrust | 交易 |
| 12 | 成交 | Match | mtch | _mtch | 5 | DoneDeal | 交易 |
| 13 | 拜访 | Visit | vist | _vist | 5 | | 营销 |

图 5 英文词根库示例

| *编码 | *中文名称 | *英文名称 | *数据类型 | 枚举值编码 | 详细定义 |
|------------|-----------|--------------------|-------|----------|--|
| DLS0000001 | A股网上佣金率 | astk_onle_cms_rate | N | | 设置A股买卖时客户的佣金率。 |
| DLS0000002 | A股资金变动金额 | astk_cptl_chg_amt | N | | A股资金变动发生金额。 |
| DLS0000003 | B股结算会员代码 | bstk_clea_mem_code | C | | 用于区分B股结算会员的标识。 |
| DLS0000004 | 金融工具分类编码 | cfi_num | C | | ISO组织的证券及相关金融工具分类代码，由6位字母组成，首位字母表示顶层产品类别，第二位字母代表每个产品类别下的细分产品种类，后四位字母表示每个产品种类在实际应用中最重要的属性。 |
| DLS0000005 | ECIF号 | ecif_num | C | | 券商内部的经过整合的唯一识别同一客户的编号的标识。 |
| DLS0000006 | ETF类型代码 | etf_type_code | C | DIMLS001 | 用于区分所属ETF产品类型的代码。 |
| DLS0000007 | ETF性质代码 | etf_char_code | C | DIMLS002 | 用于区分所属ETF性质的代码。 |
| DLS0000008 | FPML | fpml | C | | 金融产品标记语言 (Financial Products Markup Language, FpML) 是一种基于可扩展标记语言 (XML) 的商业信息交换标准，它使用互联网进行商业对商业柜台市场 (场外市场, over-the-counter, OTC) 的金融衍生交易。金融产品标记语言可用于在参与公司之间交流柜台市场交易详细资料，它也可以在公司内部分享柜台市场交易信息，也可用于在参与公司和外部公司之间提供关于柜台买卖交易的服务。 |
| DLS0000009 | 国际移动设备身份码 | imei | C | | 国际移动设备身份码的缩写为IMEI(International Mobile Equipment Identity)，国际移动设备身份码，是由15位数字组成的“电子序号”，它与每台移动电话机一一对应，而且该码是全世界唯一的。每一只移动电话机在组装完成后都将被赋予一个全球唯一的一组号码，这个号码从生产到交付使用都将被制造生产的厂商所记录。 |
| DLS0000010 | 国际证券识别码 | isin_num | C | | ISIN(The International Securities Identification)编码: 国际证券识别码体系，是全球通用的、用于识别各个国家或地区证券的唯一代码。该编码由12位数字或字母组成，主要包括三部分：前缀是由2位字母组成的国家或地区编码(ISO 3166，中国为CN)，此后的基本号码为9位字母或数字，由各个国家和地区自行编制，最后1位是校验码。 |
| DLS0000011 | LOF基金标志 | lof_fund_flag | C | DIMLS298 | 用于区分是否为LOF基金的标识。1-是，0-否。 |

图 6 模型英文名称翻译示例

10 证券业务分类标签

图 7 给出了证券业务分类。



图 7 证券业务分类

按照上述证券业务分类，对证券公司逻辑模型筛选出的数据表进行归类整理，形成数据表与证券公司业务线的对应关系，对证券公司逻辑模型的数据表进行分类标识是模型梳理成果之一。示例如表2所示。

表2 证券公司逻辑模型涉及业务线示例

| 表编码 | 表中文名称 | 表中文名称业务线 |
|------------|----------|--|
| TLS0000193 | 客户 | 经纪业务/资管业务/托管业务/柜台业务/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000111 | 个人客户 | 经纪业务/资管业务/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000153 | 机构客户 | 经纪业务/资管业务/托管业务/柜台业务/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000186 | 经纪人 | 经纪业务 |
| TLS0000286 | 上市公司 | 经纪业务/资管业务/托管业务/柜台业务/自营/信用业务/QFII/RQFII/证券研究/投资银行/直投业务/另类投资业务/新三板做市/黄金/人力资源/研究所 |
| TLS0000084 | 登记机构 | 经纪业务/资管业务/柜台业务 |
| TLS0000400 | 支付机构 | 经纪业务/资管业务/柜台业务 |
| TLS0000397 | 证券账户 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000160 | 基金账户 | 经纪业务/资管业务/自营 |
| TLS0000425 | 资管账户 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务 |
| TLS0000298 | 投资账户 | 自营 |
| TLS0000428 | 资金账户 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000344 | 银行账户 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务 |
| TLS0000239 | 普通股票 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000384 | 债务工具 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000163 | 集合投资工具 | 经纪业务/资管业务/托管业务/柜台业务/自营/信用业务/QFII/RQFII |
| TLS0000241 | 期货 | 经纪业务/资管业务/自营 |
| TLS0000030 | (证券)委托 | 经纪业务/资管业务/托管业务/自营/信用业务/QFII/RQFII/投资银行/直投业务/另类投资业务/新三板做市 |
| TLS0000027 | (证券)成交 | 经纪业务/资管业务/托管业务/自营/信用业务/QFII/RQFII/投资银行/直投业务/另类投资业务/新三板做市 |
| TLS0000016 | (融资融券)委托 | 信用业务 |
| TLS0000015 | (融资融券)成交 | 信用业务 |
| TLS0000006 | (个股期权)委托 | 经纪业务 |
| TLS0000005 | (个股期权)成交 | 经纪业务 |
| TLS0000119 | 股票首发 | 经纪业务/资管业务/自营/信用业务 |
| TLS0000398 | 证券账户持有 | 经纪业务/资管业务/托管业务/自营/信用业务 |
| TLS0000079 | 代销产品份额持有 | 经纪业务/信用业务 |
| TLS0000430 | 资金账户余额 | 经纪业务/资管业务/托管业务/柜台业务/自营/信用业务/QFII/RQFII/证券研究/投资银行/直投业务/另类投资业务/新三板做市/黄金/人力资源/研究所 |
| TLS0000276 | 融资融券授信合同 | 信用业务 |
| TLS0000377 | 债券回购合约 | 经纪业务/资管业务/自营 |
| TLS0000352 | 营销任务 | 经纪业务/托管业务/信用业务/证券研究/投资银行/直投业务/新三板做市 |

11 数据敏感性标识

证券公司逻辑模型数据敏感性标识表示实体的敏感度，在逻辑模型的梳理过程中，数据敏感性标识应符合JR/T 0158—2018规定（见表3），使实体增加对应的数据敏感性标识。形成实体的数据敏感性标识对应关系，相关示例如图8所示。

表3 证券数据级别标识表

| 数据级别标识 | 数据重要程度标识 | 数据特征 |
|--------|----------|--|
| 4 | 极高 | 1、数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围大（跨行业或跨机构），影响程度一般是“严重”； 2、一般特征：数据主要用于行业内大型或特大型机构中的重要业务使用，一般针对特定人员公开，且仅为必须知悉的对象访问或使用。 |
| 3 | 高 | 1、数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围中等（一般局限在本机构），影响程度一般是“严重”。 2、一般特征：数据用于重要业务使用，一般针对特定人员公开，且仅为必须知悉的对象访问或使用。 |
| 2 | 中 | 1、数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围较小（一般局限在本机构），影响程度一般是“中等”或“轻微”。 2、一般特征：数据用于一般业务使用，一般针对受限对象公开；一般指内部管理且不宜广泛公开的数据。 |
| 1 | 低 | 1、数据的安全属性（完整性、保密性、可用性）遭到破坏，数据损失后，影响范围较小（一般局限在本机构），影响程度一般是“轻微”或“无”。 2、一般特征：数据可被公开或可被公众获知、使用。 |

| *编码 | *中文名称 | 英文名称 | *详细定义 | 最低参考数据级别 | 《证券期货业数据分类分级指引》对应数据分类 |
|------------|-------------|-----------------------|---|----------|-----------------------|
| TLS0000007 | (股票质押式回购)成交 | evt_stk_plg_repo_mtch | 股票质押式回购成交情况信息。 | 3 | 成交信息 |
| TLS0000008 | (股票质押式回购)委托 | evt_srp_entr | 记录股票质押式回购委托指令信息。 | 3 | 委托信息 |
| TLS0000027 | (证券)成交 | evt_secu_mtch | 证券交易所交易系统接受申报后，要根据订单的成交规则进行撮合配对或者确认，使买卖双方达成交易。（券商的成交表：是按单方向记录的，即：针对每一笔的成交情况。） | 3 | 成交信息 |
| TLS0000030 | (证券)委托 | evt_secu_entr | 委托是指证券公司接受投资者的交易指令，传送到交易所进行申报。（1、主键为申报编号，因为包含未报等状态，交易所还未生成委托编号（只有报盘程序成功接收的才会生成委托）；2、撤单生成新的申报编号。） | 3 | 委托信息 |
| TLS0000171 | 交易账户 | acc_trd_acc | 股东账户、基金账户、资管账户、黄金账户等。 | 3 | 投资者开户/账户信息 |
| TLS0000428 | 资金账户 | acc_cptl_acc | 资金账户即证券交易结算资金账户，是指投资者用于证券交易资金清算的专用账户。投资者只要在券商或经纪人处开设了资金账户并存入了证券交易所需的资金，就具备了办理证券交易委托的条件。 | 3 | 投资者开户/账户信息 |
| TLS0000344 | 银行账户 | acc_bank_acc | 投资者资金账户的资金来源（存管银行、转账银行、第三方支付）及账户，主要属性有账户类型，来源的机构代码，状态等 | 3 | 银行账务信息 |
| TLS0000397 | 证券账户 | acc_scr_acc | 证券账户是指证券登记结算机构为投资者设立的，用于准确记载投资者所持的证券种类、名称、数量及相应权益和变动情况的账册，是认定股东身份的重要凭证，具有证明股东身份的法律效力，同时也是投资者进行证券交易的先决条件。包含A股账户、融资融券信用担保证券账户、转融通专用证券账户、交收账户、担保证券账户、个股期权合约账户。 | 3 | 投资者开户/账户信息 |
| TLS0000405 | 中债登账户 | acc_cnbd_acc | 中债登根据投资人的机构性质以及可以从事的业务范围对债券托管账户实行了分类设置和集中管理。对于普通的机构投资者，需要在中央债券登记系统开立自营账户以记载其自身所持有的债券。对应有柜台业务资格的商业银行用以记载所属的柜台零售市场上全部投资者的托管债券总单。 | 3 | 投资者开户/账户信息 |

图8 数据敏感性标识示例

12 代码映射关系

证券公司逻辑模型中代码类属性可与软件提供商在不同交易系统、不同版本中的代码取值定义建立映射关系，实现系统间的对接，关系映射表如图9所示，代码映射关系是证券公司逻辑模型梳理的成果之一。

| 代码表编码 | 代码表名称 | 代码编码 | 代码名称 | 厂商 | 版本 | 厂商代码表编码 | 厂商代码表名称 | 厂商代码编码 | 厂商代码名称 |
|----------|-----------|------|------|------|------|-----------|-----------|--------|--------|
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 01 | 未处理 | 厂商 1 | 版本 1 | DD_01_003 | 基金委托申报结果 | 0 | 未申报 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 01 | 未处理 | 厂商 2 | 版本 1 | GW_01_026 | TA 处理状态代码 | -1 | 待确认 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 01 | 未处理 | 厂商 3 | 版本 1 | JZ_01_041 | 基金处理状态 | 0 | 未处理 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 02 | 处理成功 | 厂商 1 | 版本 1 | DD_01_003 | 基金委托申报结果 | 6 | 全部成交 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 02 | 处理成功 | 厂商 2 | 版本 1 | GW_01_026 | TA 处理状态代码 | 0 | 处理成功 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 02 | 处理成功 | 厂商 3 | 版本 1 | JZ_01_041 | 基金处理状态 | 1 | 处理成功 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 03 | 处理失败 | 厂商 2 | 版本 1 | GW_01_026 | TA 处理状态代码 | 1 | 处理失败 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 03 | 处理失败 | 厂商 3 | 版本 1 | JZ_01_041 | 基金处理状态 | 2 | 处理失败 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 04 | 处理中 | 厂商 1 | 版本 1 | DD_01_003 | 基金委托申报结果 | 2 | 已申报 |
| DIMLS003 | TA 处理状态代码 | 04 | 处理中 | 厂商 3 | 版本 1 | JZ_01_041 | 基金处理状态 | 3 | 处理中 |

图 9 逻辑模型代码映射关系示例

13 产出物说明

证券公司逻辑模型已梳理形成了包括主体、账户、品种、交易、资产、合同、渠道、营销八个数据域的模型成果，有关数据表、数据项、英文词根库、行业属性代码及映射关系已通过数据模型管理平台进行存储及管理，并向数据模型管理平台用户提供了浏览、查询、修改、删除、评审等功能。证券期货业数据模型管理平台的访问地址为<http://sdom.csisc.cn>。

参 考 文 献

- [1] GB/T 35964-2018 证券及相关金融工具 金融工具分类（CFI编码）
 - [2] 证券期货业业务标准设计方案（2019版）
-