

Q/CCZQ

长城证券股份有限公司企业标准

Q/CCZQ-001-2024

长城证券营运管理指标标准

长城证券股份有限公司

发布

目录

前 言	4
长城证券营运管理指标标准	5
1 范围	5
2 规范性引用文件	5
3 术语和定义	6
3.1 营运管理	6
3.2 柜台业务	6
3.3 交易运行	6
3.4 清算业务	7
3.5 核算监控	7
3.6 交收	7
4 基本原则	8
4.1 科学性	8
4.2 合理性	8
4.3 适用性	8
4.4 安全性	8
5 总则	8
5.1 工作提醒指标	9
5.2 营运监控指标	9
5.3 业务稽核指标	9
5.4 营运统计指标	9
5.5 营运效能指标	10
5.6 账户质量管理	10

6 预警与响应机制.....	10
6.1 预警通知方式.....	10
6.2 响应流程.....	10
7 持续改进.....	11
7.1 定期评估.....	11
7.2 优化调整.....	11
7.3 技术升级.....	11

前 言

随着证券行业信息化程度的不断提高，证券公司运营的安全、稳定对公司的业务发展至关重要。为了确保应用系统的高效、可靠运行，及时发现和解决运用业务中存在的风险，长城证券制定了证券业应用系统监控指标体系企业标准。

本标准按照 CB/T 1.1-2020《标准化工作准则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》给予的规则起草。

请注意本标准的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本标准由长城证券股份有限公司提出。

本标准由长城证券股份有限公司起草。

本标准主要起草人：陈军、方程、蔡泳林、王冠东、延志勇、刘素景、林晓俊、聂江、李才齐。

本标准为首次发布，形成了证券公司营运领域中的营运管理方法论。

长城证券营运管理指标标准

1 范围

本标准规定了证券公司营运管理指标体系的基本原则和指标内容。

本标准适用于长城证券股份有限公司（以下简称长城证券）内部营运管理部所有证券业应用系统的监控管理，包括柜台业务系统、交易系统、行情系统、结算系统、风险管理系统等。

2 规范性引用文件

证券投资基金经营机构信息技术管理办法（2021年修正）

证券业务示范实践第1号-证券公司运营管理信息报告机制（中证协发〔2020〕109号）

证券公司客户资料管理规范（JR/T0110—2014）

金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法（2007）

证券经营机构投资者适当性管理投资者评估数据要求（JRT0262—2022）

企业标准体系要求（GB/T 15496-2023）

企业标准化工作—评价与改进（GB/T 19273-2017）

3 术语和定义

3.1 营运管理

狭义上的证券公司营运工作。主要为证券公司经营过程中与之相关的计划、组织、实施和控制工作等，包括账户开户、交易管理、清算交收、数据稽核及信息报送等一系列的活动。

3.2 柜台业务

证券经营机构在其营业场所内，通过柜台为客户提供证券交易、账户管理、产品销售、客户服务等一系列综合性金融服务的业务活动。它涵盖了开户、销户、资料变更、证券买卖委托、资金存取、产品咨询与销售等多种具体业务操作。

3.3 交易运行

指通过自身的交易系统及相关技术平台，保障客户证券交易指令的准确接收、快速传递、高效撮合与成交确认的全过程。包括交易系统的日常管理与维护，确保交易的稳定性、安全性和及时性；执行交易规定，防范违规交易

行为；处理交易数据，为客户提供准确的交易信息反馈和查询服务等。

3.4 清算业务

指在证券交易完成后，对交易各方的应收应付证券和资金进行计算和核对的过程。通过清算，确定交易各方的债权债务关系，为后续的资金交收和证券交收做好准备。主要包括交易数据的汇总、轧差计算、费用计算等。

3.5 核算监控

对证券业务中的财务数据进行准确核算，并对业务运行过程进行实时监督和控制的活动。核算包括对证券交易的成本、收益、资产负债等进行计算和记录；监控则涉及对交易合规性、风险状况、财务指标等进行持续监测和分析，以便及时发现问题并采取相应措施，保障证券业务的稳健运行和投资者的合法权益。

3.6 交收

指按照清算结果，在证券交易双方之间完成证券和资金的实际交付的过程。交收包括证券的过户登记和资金的划转，确保买卖双方能够按时、足额地收到相应的证券和资金，完成交易的最后环节。

4 基本原则

4.1 科学性

指标内容包括运营管理的主要业务，能够反映运营管理的业务状况。

4.2 合理性

指标结构合理，包括运营管理中的各业务模块，各指标之间相互配合，前后呼应。

4.3 适用性

各项指标便于理解、采集和使用。

4.4 安全性

满足公司对运营管理数据安全运行的要求。

5 总则

按照行业现行相关管理规定和证券公司业务运营管理要点将指标划分为工作提醒、营运状态、业务稽核、统计分析、账户质量管理以及营运效能等几大类指标。具体如下：

5.1 工作提醒指标

主要包括重点业务到期提醒与待办事项提示等，目的是对风险业务事项进行操作提示，防止出现重要事项遗漏，尤其针对部分具有时效性的业务。

5.2 营运监控指标

涉及超时业务、客户透支、参数检查等一系列有关操作及合规等风险事项的监控。基于营运指标提供业务运营的全面风险监控，通过即时跟踪指标变化情况，识别营运工作风险，揭示各类业务的发生情况。

5.3 业务稽核指标

体现各团队业务的数据稽核能力，确保业务处理结果的准确性与一致性，包括清算交收数据的稽核等。

5.4 营运统计指标

通过阶段数据的分类统计，为营运人员提供全面、即时的统计数据，有效掌握经营变化情况。

5.5 营运效能指标

通过直观、量化的统计指标展示业务处理能力与效率，有效促进资源的引入与调配，包括业务审核时长、清算时长等。

5.6 账户质量管理

针对证券公司客户资金账户及证券账户进行有效管理和监控，主要包括账户的安全性、账户信息的合规与完整性、账户的合规等。

基本指标名称及说明详见附录 A。

6 预警与响应机制

6.1 预警通知方式

采用多种通知方式，如短信、邮件、即时通讯等，确保相关人员能够及时收到预警信息。

6.2 响应流程

制定详细的响应流程，明确各部门和人员的职责，确保在发生异常情况时能够迅速采取有效的措施进行处理。

7 持续改进

7.1 定期评估

定期对运营管理指标体系进行评估，分析数据，找出存在的问题和不足。

7.2 优化调整

根据评估结果，对运营管理指标体系进行优化调整，提高运营管理的准确性和有效性。

7.3 技术升级

关注行业技术发展动态，及时引入新的技术和工具，提升运营管理水平。

附录 A

(规范性附录)

营运管理指标名称及说明

表 A.1 柜台业务指标名称及说明

一级指标	二级指标	三级指标	定义说明
工作提醒	柜台冻结业务	资金冻结到期	因交易、司法冻结等业务产生的资金冻结，监控资金冻结到期日，在资金到期前提醒
		股份冻结到期	上交所司法冻结业务股份冻结到期日，在股份冻结截止日期前提醒
			深交所司法冻结业务股份冻结到期日，在股份冻结截止日期前提醒
		北交所/股转司法冻结业务股份冻结到期日，在股份冻结截止日期前提醒	
	外部机构信息	退市确权公告	全国中小企业股份转让系统两网及退市公司确权公告
		交易所测试通知	中国结算与交易所的仿真测试与全网测试、通关测试通知
业务规则变化		交易所、中国结算及其他监管机构的重要通知、业务规则发布、表单变更、收费标准变化等	
实时审核业务	集中营运平台待审核业务量	营业平台待复核业务量	需要支持过滤某些业务，可设置相应的阈值
		集中交易系统待复核业务量	设置一定的阈值
		中登电子平台 (PROP)待处理业务量	设置一定的阈值
		超时审核业务	受理超时业务
	办理超时业务		业务受理总时长超时，即业务流程发起至审核通过的时长超出某一值(需根据不同业务设置不同阈值)
	审核超时业务		审核业务认领至业务通过或驳回的时长超出某一值(需根据不同业务设置不同阈值)
		RPA 报错信息	包括团队所有 RPA 流程的进度展示，异常流程突出展示

运营监控	业务办理状况	高风险业务办理情况(集中营运)	是否有三方存管余额调整业务,如有显示业务单号、客户号、流程状态
			是否有现金红冲蓝补业务,如有显示业务单号、客户号、流程状态
			是否有资金冻结解冻业务,如有显示业务单号、客户号、流程状态
			是否有资金冻结解冻取消业务,如有显示业务单号、客户号、流程状态
			是否有证券红冲蓝补业务,如有显示业务单号、客户号、流程状态
运营统计	历史业务分布(集中营运)	业务受理数量	历史每个时间段(每隔10分钟)的受理业务数量,绘制成折线图
		业务审核数量	历史每个时间段(每隔10分钟)的审核业务数量,绘制成折线图
	集中营运业务办理状况	当日集中营运业务受理总数	当日集中营运业务受理总数
		当日集中营运各业务受理数量排名	当日集中营运各业务受理数量排名(倒序排列)
		当日集中营运业务审核总数	当日集中营运业务审核总数
		当日集中营运各业务审核数量排名	当日集中营运各业务审核数量排名(倒序排列)

表 A.2 交易运行指标名称及说明

一级指标	二级指标	三级指标	定义说明
工作提醒	业务提醒	重点业务提醒	包含账户比对、外部监管报表报送、交易所数据处理、系统资金持仓核对、基金参数配置、产品设置提醒；新股申购中签放弃等重点业务的监控与提醒
	OA 待办事项	OA 待办事项	OA 当前待办事项展示与新待办流程提醒
账户质量管理	账户信息监控	账户基本信息完备性	包含 15 位一代身份证号、客户基本信息、证件有效期、客户影像信息的有效与完备
		账户关键信息规范性	包含客户信息三要素、一码通信息、账户使用信息的准确与规范
	账户异常监控	特别关注账户	未满 18 周岁的未成年人账户、年满 100 周岁的老年人账户
			失信人员开户、处罚主体开户
		账户使用情况	交易方面频繁交易、同客户使用多设备交易、多客户同设备地址交易、委托手机号码与预留不一致等
			转账方面频繁转账、转账地址多人共用、密码变更前后资金进出异常、同地址多客户大额转账、同客户多地址大额转账等
营运统计	交易所业务	交易所交易情况	包括上海、深圳、北京交易所股票、债券、回购等品种成交额以及股转摘牌专区业务笔数、成交金额
	基金业务	基金业务情况	包含现金宝、资管产品、公募基金保有量规模统计；私募基金及公募基金代销产品数量；理财产品每日销售金额
	银证业务	银证转账处理状况	银证转账流水数量超过一定阈值
营运监控	交易权限	越权交易监控	未开通相应业务权限仍进行品种交易的情况
	交易状态	非正常交易状态监控	OTC 柜台资金及交易流水异常状态的监测

表 A.3 清算业务指标名称及说明

一级指标	二级指标	三级指标	定义说明
工作提醒	OA 待办事项	OA 待办事项	OA 当前待办事项展示与新待办流程提醒
数据稽核	股份余额	深港通股份余额	柜台与中登深港通市场股份余额的核对
		沪 A 股份余额	柜台与中登沪 A 市场股份余额的核对
		沪 A 质押债券余额	柜台与中登质押债券股份余额的核对
		沪 A 场内基金份额	柜台与中登场内基金份额的核对
	资金发生额	沪 A 资金发生额	法人与柜台的沪 A 资金交收发生额的核对
		资金发生额(中登)	核对中登与柜台的深 A 资金交收发生额
	资金余额	经纪业务资金余额	核对日终的法人与柜台经纪业务资金余额
		信用业务资金余额	核对日终的法人与柜台信用业务资金余额
	开放式基金收付款	开放式基金收款核对	核对 OTC 与资金结算系统的开放式基金交收收款情况
		开放式基金付款核对	核对 OTC 与中登文件的开放式基金交收付款情况
	固收业务	固收业务深交所对账	固收业务账户在深圳市场对账文件中的持仓
		固收业务深交所结果	固收业务账户在深圳市场结果文件中的交易情况
		固收业务其他数量	固收业务账户在深圳市场结果文件中的交易情况
		固收上海证券余额	固收业务账户在上海市场余额文件中的持仓
营运效能	清算效能	多金 OTC 柜台业务	包含柜台多批次清算以及现金宝业务的扫单处理。
		现金宝业务	包含现金宝业务的日间及日终数据采集、导入、对账等处理
		柜台清算业务	包含期权、集中交易、两融、恒生、转融通、新意等柜台清算各个环节，显示已完成环节所占百分比及各环节所用时间。
营运监控	日间业务监测	重点业务监测	包括交易所代收付款、债券利息、现金差额、基金退补款等重点业务的数据与文件监测
	业务参数监测	法人业务参数	包含法人系统交收规则、基金参数配置方面的检查

		柜台业务参数	包含 OTC 柜台、集中交易柜台基金申赎配置方面的检查
产品账户监测		产品账户状态	包含产品账户的配置状态、销户状态等
		产品账户配置	包含新增数据接口、市场配置检查等
特殊业务监测		正回购业务	包含沪深市场正回购业务盯市监控、欠库检查、标准券预警、折算率与使用率监控等
清算流程监控		清算前业务	包含中登手工清算业务、交易所非交易过户、债券兑付兑息、要约业务、限售股所得税、违约处置业务、质押业务的流水与数据情况
		清算时业务	包括各类透支情况、卖空情况、挂账情况、异常流水状况等

表 A.4 核算监控指标名称及说明

一级指标	二级指标	三级指标	定义说明
工作提醒	日常事务	常规工作	包括每日、月度、季度及年度的重要工作内容。
		专项工作	涉及重要考核或外部监管的工作内容。
	事务信息	OA 待办事项	包括 OA 当前待办事项展示与待办流程。
业务稽核	财务稽核	重点资金检查	包括小额休眠、中止交易等重点业务，检查其发生变动情况。
	交收稽核	交收数据核对	包括三方与信用交收数据，确保系统间交收数据的一致。
营运统计	账务类	手工记账情况	系统手工处理账务的情况。
	收入类	信用佣金情况	通过柜台系统统计相应的佣金金额。
	业务类	关联方数据	每季度关联方数据的统计。
营运监控	法人业务	特殊业务账务	定时查询特殊业务数据，并进行及时告知。

表 A.5 适当性管理监控指标名称及说明

一级指标名称	二级指标名称	三级指标名称	指标说明
事后监控类指标	权限开通异常指标	创业板权限开通监控	创业板交易权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产、证券账户状态等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		科创板权限开通监控	科创板权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产、知识测评等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		北交所权限开通监控	北交所权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产、知识测评等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		股转挂牌（一类）权限开通监控	股转挂牌（一类）权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产、知识测评等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		股转挂牌（二类）权限开通监控	股转挂牌（二类）权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产、知识测评等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		两网及退市整理板权限开通监控	两网及退市整理板权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		退市整理板股票权限开通监控	退市整理板股票权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		私募产品合格投资者权限开通监控	私募产品合格投资者权限开通后，监控开通客户的交易经验、实时资产等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		私募资管合格投资者权限开通监控	私募资管合格投资者权限开通后，监控开通客户的交易经验、实时资产等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		风险警示板权限开通监控	风险警示板权限开通后，监控开通客户的风险等级信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		港股通权限开通监控	港股通权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产、知识测评等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		公募 REITS 权限开通监控	公募 REITS 权限开通后，监控开通客户的风险等级信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		可转债权限开通监控	可转债权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
可转债退市整理板权限开通监控	可转债退市整理板权限开通后，监控开通客户的风险等级、交易经验、日均资产等信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。		

		定向可转债权限开通监控	定向可转债权限开通后，监控开通客户的风险等级信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		债券普通投资者权限开通监控	债券普通投资者权限开通后，监控开通客户的风险等级信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
		债券专业投资者权限开通监控	债券专业投资者权限开通后，监控开通客户的风险等级信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。
	风险测评	风险测评跃升监控	监控当日风险测评等级跃升的情况，一次跨越两个等级或以上，多次尝试风险测评且等级不断提升的客户。
		风险测评上升并开通权限	监控当日风险测评等级上升，并且开通了原来风险测评等级无法开通的权限客户
		风险测评上升并购买产品	监控当日风险测评等级上升，并且购买了原来风险测评等级无法购买产品的客户
	交易	产品与风险等级不匹配	由于场内业务未实行强匹配，另外定投业务也未实现强匹配，每日监控此类业务，并落地。
		基金产品购买监控	基金产品购买后，监控开通客户的风险等级信息，确保所有客户开通条件均满足内外规要求。

表 A.6 交收业务指标名称及说明

一级指标	二级指标	三级指标	定义说明
工作提醒	OA 待办事项	OA 待办事项	OA 当前待办事项展示与新待办流程提醒
	到期提醒	支付工具到期	U 盾证书到期日提醒
业务稽核	交收稽核	交收数据核查	包括日终、日间的中国结算、资金结算、法人清算、柜台交易等系统交收数据采集和核查
		支付系统连通	包括超代系统、统一支付系统的连通情况
营运监控	交收合规性	账户报备	包括资金交收账户、存款账户、收款账户的新增、变更、撤销的报备
		划款封闭性	包括交收规则、参数设置、划款路径等内容
	交收安全性	资金交收付款	包括指令状态、付款结果、付款时间、异常信息等内容
		资金收款确认	包括交收款到账跟踪确认、应收未收款核查督促、修改交收日期等
		资金日间盯市	包括中国结算资金交收账户是否足额、存管银行存放比例、资金流动性等
		账实核对	包括日终、月度、年度各账户实际余额与财务系统账实核对
		结算账户	包括存管银行账户和中国结算资金交收账户，账户状态
		低频业务	股票质押、中证资本等低频业务监控
营运统计	交收类	交收笔数及金额	统计各类别交收指令笔数和金额及其在所有指令中占比
	资金类	资金余额及流向	统计各存管银行余额、存取及各类交易结算资金情况
		息差收入统计	统计各银行息差收入，形成季度、年度报表
		存管费统计	统计各银行存管费，形成季度报表，并在分支机构中进行分摊

参考文献

- [1] 证券投资基金经营机构信息技术管理办法（2021年修正）
- [2] 证券业务示范实践第1号-证券公司运营管理信息报告机制（中证协发〔2020〕109号）
- [3] 证券公司客户资料管理规范（JR/T0110—2014）
- [4] 金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法（2007）
- [5] 证券经营机构投资者适当性管理投资者评估数据要求（JRT0262—2022）