

2016年7月统计月报



中国证券投资者保护基金有限责任公司
CHINA SECURITIES INVESTOR PROTECTION FUND CORPORATION LIMITED



[统计概要]	1
[统计情况]	5
一、客户证券交易结算资金和个人债权收购进度	5
二、投保基金债权受偿情况表	9
三、投保基金筹集和使用情况	10
四、证券公司分类与上缴基金情况表	11
五、投保基金公司发放投保基金情况表	12
六、证券公司证券及股票期权投资者的资金账户月末情况	13
七、证券公司证券及股票期权投资者的资金余额及变动情况	15
八、证券公司客户交易结算资金分布情况	20
九、客户资金账户余额分层情况统计表	21
十、存放在银行专用账户中的交易结算资金月末占比统计表	22
十一、中国证券市场投资者信心指数月度变化情况	23
十二、中国证券市场投资者信心指数图	24
[指标说明]	25

统计概要

【客户证券交易结算资金和个人债权收购】

7月，投保基金公司未发放投保基金。

【债权受偿情况】

根据被处置证券公司资产负债情况，投保基金公司对26家被处置证券公司投保基金受偿率进行了预估。截至7月底，河北证券、兴安证券已达到100%受偿，其他24家证券公司中，受偿率下限预计在50%以上的有2家，分别是南方证券、闽发证券；20%-50%的有6家，分别是大鹏证券、中富证券、汉唐证券、西北证券、华夏证券、中关村证券；10%-20%的有8家，分别是亚洲证券、北方证券、民安证券、广东证券、中科证券、天同证券、天一证券和新疆证券；5%-10%的有1家，为武汉证券；5%以下的有7家，分别是德恒证券、恒信证券、五洲证券、甘肃证券、昆仑证券、天勤证券和新华证券。

截至7月底，共有24家证券公司进行了破产财产分配。投保基金公司共受偿现金40.840亿元（包括代财政部管理的债权受偿现金0.059亿元）、受偿股票11只，基金1只；投保基金公司代财政部管理的债权受偿股票2只。

【投保基金筹集和使用】

7月，投保基金筹集金额新增7.641亿元，其中，交易经手费6.074亿元，申购冻结资金利息0.001亿元，利息收入（包括基金存款及贷款利息）1.540亿元，其他收入0.026亿元。

1-7月，投保基金累计筹集金额为54.848亿元，其中，交易经手费30.194亿元，证券公司上缴基金17.625亿元，申购冻结资金利息2.549亿

元，利息收入（包括基金存款及贷款利息）2.546亿元，运用基金投资债券的转让及利息收入1.821亿元，有关责任方追偿收入和破产财产清偿收入0.086亿元，其他收入0.027亿元。

7月，投保基金公司使用投保基金0.293亿元，全部为其他支出。

1-7月，投保基金公司累计使用投保基金0.201亿元，其中，运用基金投资债券的成本支出-20亿元，其他支出20.201亿元。

【证券公司分类与上缴基金】

7月，未发生证券公司按证监会批准的缴纳比例上缴投保基金事项。

1-7月，证券公司按证监会批准的缴纳比例上缴投保基金17.625亿元，其中，AA类证券公司上缴8.187亿元，A类证券公司上缴5.653亿元，BBB类证券公司上缴2.222亿元，BB类证券公司上缴0.606亿元，B类证券公司上缴0.676亿元，CCC类证券公司上缴0.281亿元。

【发放投保基金情况】

7月，投保基金公司未发生使用市场筹集基金发放投保基金事项。

截至7月底，投保基金公司累计使用市场筹集基金发放投保基金10.941亿元，其中，6.413亿元用于弥补客户证券交易结算资金，4.528亿元用于收购个人债权。

【证券公司证券及股票期权投资者的资金账户月末情况】

截至7月底，全市场经纪业务客户人民币资金账户共计176,248,058户，交易结算资金余额共计15,180.32亿元。与上月末相比，账户增加2,538,933户，环比增加1.46%；余额减少4.36亿元，环比减少0.03%。参与上海证券交易所股票期权交易试点的衍生品资金账户共计142,642户，期权保证金余额共计38.28亿元。

【证券公司证券及股票期权投资者的资金余额及变动情况】

7月各周¹客户交易结算资金周平均余额分别为15,784、16,482、16,438、15,807、15,506亿元；银证转账周净转入（转出）额分别为-120、-278、-160、-278、168亿元。7月份累计净转出证券市场资金668亿元。

7月各周股票期权保证金周平均余额分别为36.19、37.29、38.61、39.48、39.51亿元；银衍转账周净变动额分别为0.08、1.49、1.32、0.35、-0.98亿元。7月份累计净入金2.26亿元。

【证券公司客户交易结算资金分布情况】

截至7月底，全市场客户交易结算资金规模达1,000亿元以上（含）的证监局辖区5个（包括51家证券公司），占资金总规模的70.37%；交易结算资金规模在100（含）至1,000亿元的辖区共计19个（包括34家证券公司），占资金总规模的26.17%；交易结算资金规模在100亿元以下的辖区共计12个（包括13家证券公司），占资金总规模的3.46%。

【客户资金账户余额分层情况】

截至7月底，资金账户余额5万元以下的户数为171,802,337户，占比97.48%，金额合计2,579.78亿元，占比16.99%，呈现明显的非对称分布特征。

与上月相比，50万元以下分层资金账户的余额均有所减少。

¹ 7月的第一周跨月（6月27日-7月1日），此处周数据不含6月27日-6月30日数据，下同。

【存放在三方存管银行专用存款账户中的交易结算资金情况】

截至7月底，以证券公司名义存放在第三方存管银行客户资金专用存款账户中的客户交易结算资金合计12,821.95亿元，占客户交易结算资金总额的84.23%。

【中国证券市场投资者信心指数变化情况】

本期中国证券市场投资者信心调查自2016年7月26日起依托投保基金公司投资者调查固定样本库进行，其中包括1,295名个人投资者和186名一般机构投资者，发放调查问卷共计1,481份。截至7月31日，收回有效问卷1,422份，有效问卷回收率达到96.0%。

调查结果显示，受月末大盘震荡，尤其是中小盘股调整较大的影响，7月中国证券市场投资者信心指数为51.6，环比下降6.0%，但仍高于上半年的平均值50.0，同时这也是今年投资者信心指数首次连续两个月都处于乐观区间。

各项子指数具体表现为：随着近期欧美股市不断上涨，国际经济金融环境指数延续了近两个月小步上升的走势，环比上升5.9%，达到43.3，成为7月唯一环比上升的子指数；7月我国宏观经济大体运行平稳，积极因素不断积累，虽然制造业PMI降至荣枯线下，但非制造业PMI创出年内新高，国内经济基本面指数仍维持在50.8的乐观区间；国内经济政策指数为52.1，环比下降8.3%，与今年以来的平均值基本持平；市场方面，大盘抗跌指数59.9，环比微降1.8%，继续保持高位；大盘反弹指数为50.5，环比小幅下降4.0%；7月大盘乐观指数为50.9，波动相对较大，环比下降了12.7%，投资者对大盘未来走势的判断趋于保守；7月买入指数降至50中性值以下为47.7，倾向持仓观望和视情况而定的投资者比例有所增多；股票估值指数44.6，环比下降6.1%，股票估值压力依然较大。

一 客户证券交易结算资金和个人债权收购进度

序号	被处置 证券公司 名称	国务院 批准 总额度	担保基金 发放总额	已兑付额 占批准 额度比例	弥补客户证券交易结算资金缺口进度				收购个人债权进度				接收监管 机构		
					批次	已发放情况	申请金额	发放金额	正在申请情况	批次	已发放情况	申请金额		发放户数	正在申请情况
1	德恒证券	21.620	14.126	65.34%	人行划转	5.0754264978	5.0754264978	批次	已发放情况	申请金额	发放金额	发放户数	正在申请情况	上海专员办	
								人划转	5.7254029606	5.7254029606	1047				
								12批第一部分	0.7090798258	0.5493298258	35				
								12批第二部分	0.3352891140	0.0671130000	5				
								湖北、山西 第一批第一部分	0.5556196575	0.1773333000	18				
								湖北、山西 第一批第二部分	-	0.0907081875	6				
								湖北、山西 第一批第三部分	-	0.1487700000	15				
								山西第二批	0.0229640175	0.0229640175	15				
								12批第三部分	0.1082847093	0.0552600000	2				
								前期剔除第一批	-	0.2435801796	10				
								上海、湖北、广东 重庆、天津	0.2099360791	0.2099360791	11				
								沈阳椰券	0.00000419223	0.0000419223	-				
								十二批第四部分	0.0283518000	2					
2	恒信证券	2.090	1.551	74.19%	第一批 第二批 第三批 第四批及缺口利息 第一批休眠账户、单资金账户	0.2831295279 - - 0.0251219628 0.0085706859	0.1425667691 0.0640541097 0.0708150969 0.0251219628 0.0085706859	批次	已发放情况	申请金额	发放金额	发放户数	正在申请情况	湖南证监局	
								人划转	0.957729601	0.957729601	69				
								北京、湖南	0.0214825469	0.0214825469	2				
								江苏	0.0584910000	0.0584910000	1				
								福建	0.1029600000	0.0806850000	1				
								第四批	0.12100005000	0.12100005000	3				
								人划转	0.0362200590	0.0362200590	2				
								第二批	0.5350743000	0.5350743000	39				
								第二批	0.0754128000	0.0328950000	1				
								第二批第三部分	-	0.0425178000	1				
								上海、浙江、福建	0.2604546000	0.1785006000	1				
								第三批	0.0073800000	0.0073800000	1				
								已募资收购部分	-	0.0819540000	7				
第四批	0.0171000000	0.0171000000	1												
人划转	0.1907610300	0.1907610300	13												
第一批	0.6685950384	0.6685950384	30												
第二批第一部分	0.6657480000	0.0577980000	5												
第二批第三部分	-	0.0984600000	5												
椰券	0.1811910062	0.1811910062	302												
第二批第三部分	-	0.0405900000	1												
第三批	0.0324900000	0.0324900000	1												
第二批第四部分	-	0.0794700000	1												
第三批第五部分	-	0.3894300000	7												
3	中富证券	3.750	0.932	24.84%	人行划转	17.5200000000	17.5200000000	批次	已发放情况	申请金额	发放金额	发放户数	正在申请情况	上海专员办	
								人划转	0.0362200590	0.0362200590	2				
4	汉唐证券	27.250	19.259	70.67%	第一批 第二批 第三批 第四批及缺口利息 第一批休眠账户、单资金账户	0.2831295279 - - 0.0251219628 0.0085706859	0.1425667691 0.0640541097 0.0708150969 0.0251219628 0.0085706859	批次	已发放情况	申请金额	发放金额	发放户数	正在申请情况	深圳证监局	
								人划转	0.0362200590	0.0362200590	2				

客户证券交易结算资金和个人债权收购进度（续一）

序号	被处置 证券公司 名称	国务院 批准 总规模	投保基金 发放总额	已发放额 占批准 额度比例	弥补客户证券交易结算资金缺口进度				收购个人债权进度				授权监督 机构			
					已发放情况		正在申请情况		已发放情况		正在申请情况					
					批次	申请金额	发放金额	批次	申请金额	发放金额	发放户数	批次		申请金额	发放金额	发放户数
5	闽发证券	21.040	15.300	72.72%	第一批	7.8900230270	4.9653075107			8.0213994355	8.0213994355	7578	福建证监局			
					第二批	2.6045996259	1.7587200722									
					第三批	-	0.2845792409									
					第四批及缺口利息	0.2694217690	0.2694217690									
					第五批	0.0286362915	0.0286362915									
6	大鹏证券	22.210	19.892	89.56%	人行划转	15.9830075479	15.9830075479			2.2398191993	2.2398191993	7489	深圳证监局			
														第一批休眠账户、单资金账户	0.265811249	0.265811249
														第二批休眠账户、单资金账户	0.009523591	0.009523591
														第三批休眠账户、单资金账户	0.0597060000	0.0597060000
														第四批休眠账户、单资金账户	0.0009962000	0.0009962000
7	亚洲证券	39.140	29.081	74.30%	人行划转	17.4999000000	17.4999000000			4.8111915687	4.8111915687	7260	上海专员办			
														第一批	1.3067066186	1.0343049793
														第二批及缺口利息	0.2172433847	0.2172433847
														第三批	0.0082690824	0.0082690824
														第四批及缺口利息	0.0003708000	0.0003708000
8	北方证券	13.030	11.138	85.48%	人行划转	11.0700000000	11.0700000000			0.0672964938	0.0672964938	4	上海证监局			
														第一批	1.3067066186	1.0343049793
														第二批及缺口利息	0.2172433847	0.2172433847
														第三批	0.0082690824	0.0082690824
														第四批及缺口利息	0.0003708000	0.0003708000
9	五洲证券	4.230	3.247	76.77%	人行划转	3.0678359437	3.0678359437			0.0672964938	0.0672964938	4	河南证监局			
														第一批休眠账户、单资金账户	0.1793773572	0.1793773572
														第二批休眠账户、单资金账户	0.0042085317	0.0042085317
														第三批休眠账户、单资金账户	0.0009962000	0.0009962000
														第四批休眠账户、单资金账户	0.0597060000	0.0597060000
10	民安证券	6.660	11.842	177.81%	人行划转	15.9830075479	15.9830075479			2.2398191993	2.2398191993	7489	广东证监局			
														第一批	1.3067066186	1.0343049793
														第二批及缺口利息	0.2172433847	0.2172433847
														第三批	0.0082690824	0.0082690824
														第四批及缺口利息	0.0003708000	0.0003708000
11	武汉证券	5.890	5.022	85.27%	人行划转	11.0700000000	11.0700000000			0.0672964938	0.0672964938	4	湖北证监局			
														第一批	1.3067066186	1.0343049793
														第二批及缺口利息	0.2172433847	0.2172433847
														第三批	0.0082690824	0.0082690824
														第四批及缺口利息	0.0003708000	0.0003708000

客户证券交易结算资金和个人债权收购进度(续二)

序号	被处置 证券公司 名称	国务院 批准 总额度	担保基金 发放总额	已发放额 占批准 额度比例	弥补客户证券交易结算资金缺口进度										正在申请情况	收购个人债权进度					授权监管 机构					
					已发放情况					正在申请情况						已发放情况						正在申请情况				
					批次	申请金额	发放金额	批次	申请金额	批次	申请金额	发放金额	批次	申请金额		发放金额	批次	申请金额	发放金额	批次		申请金额	发放金额			
12	甘肃证券	0.890	1.778	199.79%	第一批	0.6600000000	0.6600000000							第一批	0.1466499789	0.1346054872	496		甘肃证监局							
					第二批	0.9035428420	0.8575023393							第二批	0.1108497327	0.0934988802	205									
														第三批	0.0062253626	0.0027153626	15									
														第三批第三部分	-	0.0035100000	1									
														第四批	0.0037578500	0.0211087025	33									
					第三批及缺口利息	0.0039633771	0.0039633771							破产公告后新登记第一批	0.0003300000	0.0003300000	2									
														破产公告后新登记第二批	0.0008920000	0.0008920000	3									
														破产公告后新登记第三批	0.0001500000	0.0001500000	1									
														第一批	0.3823119000	0.3823119000	673									
														深圳第一部分	0.3009897000	0.0348187500	1									
13	昆仑证券	2.600	2.436	93.71%	第一批	1.7549584516	1.7485913206							深圳第二部分	-	0.0695232000	1		青海证监局							
														武汉	0.0015480000	0.0015480000	3									
														深圳第三部分	-	0.1963496700	8									
														深圳第四部分	0.0033262282	0.0033262282	93									
														抵押券第一批	1.1285701644	1.1285701644	254									
					第二批	6.8000000000	5.0485850793							抵押券第二批	0.0166165330	0.0166165330	8		深圳专员办							
					第三批	3.2995963400	1.7671291828							第一批	0.8638613517	0.8638613517	102									
														第二批	0.2796993254	0.2796993254	8									
					第三批第三部分	-	1.0813248694							第三批	0.0100168092	0.0100168092	1									
					第四批	0.3843377331	0.3796275493																			
					第五批及缺口利息	0.1802460593	0.1802460593																			
					第一批休眠账户、单资金账户	0.1116815030	0.1116815030																			
					第一批	2.4069625672	1.8400000000																			
					第二批	-	0.3181510152																			
					第三批	-	0.0713657307																			
15	天勤证券	1.900	2.337	123.01%	第四批	-	0.0600000000							青岛	0.0094995000	0.0094995000	2		北京证监局							
					第五批及缺口利息	0.0286326101	0.0286326101																			
					第一批	2.3672703088	2.3436878440																			
					第一批	16.3913794235	8.0000000000																			
					第一批第二部分	-	4.7242871529																			
16	西北证券	2.690	2.344	87.13%															宁夏证监局							
					第二批	-	1.7035799900																			
					第三批	-	0.7946742499																			
					第四批	0.5791038886	0.5791038886																			
					第一批休眠账户、单资金账户	0.0409390112	0.0409390112																			
					第二批休眠账户、单资金账户	0.0347014558	0.0347014558							抵押券	3.2389727164	2.7825779379	5264		北京证监局							
					第三批休眠账户、单资金账户	0.0038363036	0.0038363036							第四批	0.1231614000	0.0469575000	2									
					第一批	0.5736229317	0.2924959502							第四批第二部分	-	0.0686619000	7									
					第二批及缺口利息	0.0089314111	0.0089314111							抵押券剔除	-	0.1651116318	4									
					第二批	0.2204410500	0.0294534000							第五批和第四批第三部分	0.0646985427	0.2689848851	336									
17	华夏证券	20.08	20.281	101.00%															北京证监局							
					上海、陕西和江苏	0.0646088004	0.1177434504																			
					第八批	-	0.1616850000																			
					第九批	0.3257100000	0.3257100000																			
					第十批	0.0244800000	0.0244800000																			
18	兴安证券	2.790	0.314	11.25%															黑龙江证监局							
					黑龙江	0.0125100000	0.0125100000																			
19	河北证券	3.700	2.483	67.12%															河北证监局							
					第二批	0.0108630495	0.0108629485																			

客户证券交易结算资金和个人债权收购进度（续三）

序号	被处置 证券公司 名称	国务院 批准 总规模	投保基金 发放总额	已发放额 占批准 额度比例	弥补客户证券交易结算资金缺口进度				收购个人债权进度				授权监管 机构		
					已发放情况			正在申请情况		已发放情况				正在申请情况	
					批次	申请金额	发放金额	批次	申请金额	批次	申请金额	发放金额		批次	申请金额
20	新疆证券	5.710	4.513	79.03%	第一批	3.4737980151	2.8996839578	第二批	0.0300924324	第一批	1.1552220000	1.1552220000	3180	新疆证监局	
					第二批	-				第二批	0.1395630000	0.1395630000	97		
					第三批及缺口利息	0.2880583361	0.2880583361			汕头第一批	0.8188380000	0.8188380000	2058		
					第一批	2.0000000000	2.0000000000			上海第一批	0.0598320000	0.0598320000	29		
21	中关村 证券	12.190	9.567	78.48%	第二批	3.8826468466	3.0486203393			汕头第二批	0.6954417000	0.6954417000	540	北京证监局	
					第三批	0.7260566723	0.2019541538			汕头第三批	2.0568132000	2.0568132000	680		
					第四批	0.5205523067	0.4989259061			北京第一批 及上海第二批	0.1152720000	0.1152720000	68		
					第五批	-	0.0595232043			椰寨	0.3700351793	0.3700351793	495		
					第一批休眠账户、单资金账户	0.0117887954	0.0117887954			大连	0.0855519910	0.0788157856	287		
					第二批	4.0000000000	4.0000000000			大连 (处置日后利息)	-	0.0017394141	-		北京证监局
第三批	-	0.2826453702			沈阳第一部分	0.0283038167	0.0081240930	4							
第四批	0.0919029861	0.0919029861			沈阳第二部分	-	0.0079689510	1							
第一批休眠账户、单资金账户	0.0663257409	0.0663257409			沈阳第三部分	-	0.011697899	1							
第一批	4.2853662073	2.1761502837			第一批	2.5306984367	2.3456071367	1793	山东证监局						
第二部分	-	0.0815433422			第二批	2.5767881550	2.5214216550	1505							
第三批	-				第三批	2.2606878146	1.4845159800	2030							
第四部分	-				椰寨第一部分	0.6511865338	0.3091848932	1916							
					第二批	0.218396883	0.062173524	36							
					椰寨第二部分	-	0.2745633696	471							
					与696 国债 有关的个人债权	-	0.0329058000	503							
					第五批	0.0017384322	0.0013977000	19							
					第六批	0.0588741300	0.0340568100	45							
					第六批第三部分	-	0.0248173200	6							
					椰寨 (济南中油债券)	-	0.0351016549	244							
					第三批第二部分	-	0.0009000000	1							
					第四批第三部分	-	0.0505529190	1							
					第三批第三部分	-	0.0317720000	1							
					第三批第四部分	-	0.0365400000	1							
					第七批	0.0005850000	0.0005850000	9							
					宁波	0.2950415145	0.2950415145	49	宁波证监局						
					上海	0.0093420000	0.0093420000	2							
					破产受理公告日后登记第一批	0.0000782700	0.0000782700	1							
					破产受理公告日后登记第二批	0.0001500000	0.0001500000	1							
24	天一证券	7.920	3.489	44.06%	第三批	-	0.0086087694			64.9444165098	62.5551411102	61313	0		
	合计	282.510	224.994	79.64%		178.3458784044	162.6498712969			0					

说明：1、亚洲证券个人债权发放明细如下：天津第二批0.2033500483亿元（32户）；哈尔滨第二批0.601416亿元（1010户）；武汉第三批0.18072亿元（733户）；孝感0.009099亿元（2户）；恩施0.082719亿元（218户）；武汉第五批0.20304亿元（564户）；武汉第六批0.20655亿元（459户）；当阳0.042507亿元（115户）；武汉第七批0.1782亿元（330户）；武汉第八批0.12474亿元（198户）；武汉第九批0.13392亿元（186户）；武汉第十批0.08424亿元（104户）；武汉第十一批0.02123亿元（62户）；哈尔滨第三批0.00819亿元（1户）；天津第三批0.00819亿元（1户）；武汉第十二批0.1359亿元（151户）；武汉第十三批0.74481237亿元（903户）；成都第一批0.00081亿元（4户）；武汉第十四批0.5446679亿元（223户）；天津第四批0.2901566643亿元（41户）；武汉第十四批0.4286439亿元（903户）；安徽宁波天津第五批0.000216亿元（1户）；安徽1户、天津1户共0.0705440亿元（2户）；武汉第十五批0.0109843961亿元（41户）；深圳、上海、四川（第二批）0.091068亿元（5户）；武汉、宁波地区1人0.203994（4户）

2、个别公司超出国务院批准额度部分在巨田证券及表中24家被处置证券公司国务院批准总额度内进行调剂。

制表人：张海新

二 投保基金公司债权受偿情况表

序号	破产证券 公司名称	确认债权金额	受偿情况预估		已受偿现金	已 受 偿 情 况				备注
			下限	上限		股票名称	已受偿股票		实际受偿率	
							股数	受偿价值		
1	德恒证券	16.100	0.41%	0.57%						
2	恒信证券	1.718	1.66%	2.53%	0.022					1.41%
3	中富证券	1.045	29.92%	34.89%	0.307					29.42%
4	汉唐证券	20.392	43.10%	53.00%	2.793	股票1	18,609,302	1.727	50.16%	
						股票2	9,408,047	1.472		
						股票3	6,516,319	1.028		
						股票4	9,044,917	1.901		
						股票5	3,428,113	0.533		
5	闽发证券	14.922	63.01%	65.00%	2.998	股票1	14,008,381	3.506	63.01%	
						股票2	7,559,899	2.695		
6	大鹏证券	20.249	26.51%	30.00%	5.368				26.51%	
7	亚洲证券	30.797	12.00%	15.00%	2.446				8.00%	
8	北方证券	11.533	10.00%	15.00%						
9	五洲证券	3.120	3.71%	18.16%	0.125				4.24%	
10	民安证券	12.895	12.61%	15.00%	1.833				14.21%	
11	武汉证券	5.062	7.70%	13.00%	0.553				11.00%	
12	甘肃证券	1.819	3.63%	5.59%	0.087				4.80%	
13	昆仑证券	2.406	2.32%	8.87%	0.115				4.77%	
14	广东证券	21.443	15.05%	16.00%	3.228				15.05%	
15	天勤证券	2.349	3.56%	3.56%	0.084				3.56%	
16	西北证券	2.241	23.30%	35.00%	0.322	股票1	2,708,541	0.290	28.86%	
						股票2	285,549	0.021		
						基金	1,186,400	0.014		
17	华夏证券	21.217	20.00%	33.23%	3.382				16.00%	
18	兴安证券	0.319	100.00%	100.00%	0.315				100.00%	
19	河北证券	2.242	100.00%	100.00%	2.236				100.00%	
20	新疆证券	4.555	13.50%	23.00%	0.988				21.52%	
21	中关村证券	9.972	15.55%	32.95%	2.792				28.00%	
22	中科证券	12.998	15.08%	25.00%	2.494				19.19%	
23	天同证券	11.071	12.31%	21.79%	1.873				16.80%	
24	天一证券	3.511	10.00%	30.00%	0.878				25.00%	
其他	南方证券	15.580	62.00%	75.00%	5.504	股票1	8,474,964	2.048	71.40%	
					股票2	32,625,414	3.572			
		0.166			0.059	股票1	90,406	0.022		
						股票2	348,032	0.038		
	新华证券	2.829	3.00%	8.00%	0.039				1.37%	
	合计	252.551			40.840			18.867		

说明：1、已受偿股票价值是指经法院裁定的分配方案中所确定的每股股票价格乘以分配股数。

2、结合各公司已实际分配的情况，我对受偿预估进行了调整，现数据更符合各公司实际情况。

制表人：张海新

三 投保基金筹集和使用情况

项 目		行次	本月数据	本年数据	项 目	行次	本月数据	本年数据
一、人民银行再贷款					3、本期使用的基金	18	0.293	0.201
1、期初再贷款基金存款余额		1	-	-	(1) 拨付风险处置基金	19		
2、本期承贷的再贷款		2	-	-	(2) 发行债券费用	20		
3、再贷款存款利息净收入		3	-	-	(3) 偿付应付债券利息	21		
4、本期使用的再贷款（扣除划回数）		4	-	-	(4) 偿付应付债券本金	22		
5、期末再贷款存款余额（5=1+2+3-4）		5	-	-	(5) 偿付人民银行再贷款利息	23		
					(6) 偿付人民银行再贷款本金	24		
二、公司筹集的基金					(7) 运用基金投资债券的成本支出	25		-20.000
1、期初基金存款余额		6	332.820	285.521	(8) 其他支出	26	0.293	20.201
2、本期筹集的基金		7	7.641	54.848	4、期末基金余额（26=6+7-18）	27	340.168	340.168
(1) 交易经手费		8	6.074	30.194	三、公司发行债券			
(2) 证券公司上缴基金		9		17.625	1、期初发行债券存款余额	28		
(3) 申购冻结资金利息		10	0.001	2.549	2、发行债券收入	29		
(4) 接受捐赠		11			3、本期使用的发行债券基金	30		
(5) 利息收入（包括基金存款及贷款利息）		12	1.540	2.546	4、期末发行债券存款余额（31=28+29-30）	31		
(6) 运用基金投资债券的转让及利息收入		13		1.821	四、全部资金筹集和使用			
(7) 有关责任方追偿收入和破产财产清偿收入		14		0.086	1、期初余额（32=1+6+28）	32	332.820	285.521
(8) 受偿资产处置净收入		15			2、本期筹集金额（33=2+3+7+29）	33	7.641	54.848
(9) 收到退回已拨付风险处置基金		16			3、本期使用金额（33=4+18+30）	34	0.293	0.201
(10) 其他收入		17	0.026	0.027	4、期末余额（35=32+33-34）	35	340.168	340.168

单位：亿元

说明：1、表中第1、6、27、31行列报的“本年数据”指填报年度期初余额，即2015年1月1日余额。

2、自2014年1月1日起，在“二、公司筹集的基金”项下增加“收到退回已拨付风险处置基金”统计科目，专项统计托管清算机构、被处置证券公司破产管理人或商业银行等机构退回的已拨付风险处置基金。

制表人：应丹莺 李中奇

四 证券公司分类与上缴基金情况表

分类结果		证券公司家数	缴纳比例 (%)	本月缴纳金额	本年累计缴纳金额
A	AAA				
	AA	43	0.75%		8.187
	A	44	1.00%		5.653
B	BBB	23	1.50%		2.222
	BB	7	1.75%		0.606
	B	1	2.00%		0.676
C	CCC	1	2.50%		0.281
	CC	0			
	C	0			
D	D				
合计		119		-	17.625

注:1. 尚未取得分类结果的证券公司不在本表统计范围之内;
2. 分类结果: 证监会确定的证券公司分类结果;
3. 缴纳比例: 证监会批准的证券公司按营业收入缴纳投保基金的比例。

制表人: 李中奇

五 投保基金公司发放投保基金情况表

序号	被处置证券 公司名称	国务院批准额度			中央收购 个人债权 额度		使用人民银行再贷款发放投保基金		使用市场筹集基金发放投保基金				剩余额度	
		总额度	客户证券交易 结算资金	个人债权	(4)=(3)*90%	(5)	个人债权	客户证券交易 结算资金	客户证券交易 结算资金	个人债权		客户证券 交易结算 资金	个人债权	
										本期新增	累计			
		(1)=(2)+(3)	(2)	(3)	(4)=(3)*90%	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)=(2)+(5)+(7)	(10)=(3)+(6)+(8)			
1	德恒证券	21.620	7.440	14.180	12.762	5.075	7.319		1.732	2.365	5.129			
2	恒信证券	2.090		2.090	1.881	0.278	0.979	0.033	0.260	-0.311	0.851			
3	中富证券	3.750	1.660	2.090	1.881		0.825		0.106	1.660	1.159			
4	汉唐证券	27.250	24.310	2.940	2.646	17.520	1.349		0.389	6.790	1.202			
5	闽发证券	21.040	11.350	9.690	8.721	7.008	8.021	0.298	0.0002	4.044	1.668			
6	大鹏证券	22.210	18.160	4.050	3.645	15.983	2.727	0.275	0.916	1.902	0.407			
7	亚洲证券	39.140	23.260	15.880	14.292	17.500	10.088	1.252	0.242	4.509	5.550			
8	北方证券	13.030	11.480	1.550	1.395	11.070	0.0004		0.068	0.410	1.482			
9	五洲证券	4.230	4.130	0.100	0.090	3.068		0.179		0.883	0.100			
10	民安证券	6.660	5.760	0.900	0.810	4.950	6.603	0.207	0.087	0.603	-5.789			
11	武汉证券	5.890	5.806	0.084	0.076	4.908	0.045	0.106		0.792	0.039			
12	甘肃证券	0.890	0.660	0.230	0.207	1.518	0.234	0.004	0.022	-0.861	-0.027			
13	昆仑证券	2.600	1.740	0.860	0.774	1.749	0.688			-0.009	0.172			
14	广东证券	21.730	18.730	3.000	2.700	17.897	2.289	0.671	0.010	0.162	0.701			
15	天勤证券	1.900	1.840	0.060	0.054	2.290	0.009	0.029	0.010	-0.478	0.041			
16	西北证券	2.690	2.560	0.130	0.117	2.344				0.216	0.130			
17	华夏证券	20.080	16.080	4.000	3.600	14.428	3.774	1.453	0.630	0.199	-0.404			
18	兴安证券	2.790	2.550	0.240	0.216	0.292	0.013	0.009		2.249	0.227			
19	河北证券	3.700	3.690	0.007	0.006	2.433	0.050	0.048		1.209	-0.043			
20	新疆证券	5.710	3.970	1.740	1.566	2.929	1.295	0.288		0.753	0.445			
21	中关村证券	12.190	6.840	5.350	4.815	5.250	3.746	0.570		1.020	1.604			
22	中科证券	17.180	16.220	0.960	0.864	11.848	0.459	0.441	0.019	3.931	0.482			
23	天同证券	16.220	5.030	11.190	10.071	2.714	7.209	0.550	0.037	1.766	3.944			
24	天一证券	7.920	5.030	2.890	2.601	3.185	0.304		0.0002	1.845	2.585			
	合计	282.510	198.296	84.211	75.790	156.237	58.027	6.413	4.528	35.646	21.656			

说明：我公司自2008年7月3日起使用市场筹集基金收购被处置证券公司个人债权和弥补客户证券交易结算资金缺口。

制表人：李中奇

六 证券公司证券及股票期权投资者的资金账户月末情况

日期	资金类别	资金账户 (户)	与上月末的增减变动		资金余额 (亿元)	与上月末的增减变动	
			户数 (户)	环比		余额 (亿元)	环比
2015年01月30日	证券交易结算资金	115,536,811	1,244,812	1.09%	11,193.37	216.23	1.97%
	股票期权保证金	-	-	-	-	-	-
2015年02月27日	证券交易结算资金	116,262,001	725,190	0.63%	11,309.47	116.11	1.04%
	股票期权保证金	4,715	-	-	1.11	-	-
2015年03月31日	证券交易结算资金	119,307,785	3,045,784	2.62%	15,446.48	4,137.01	36.58%
	股票期权保证金	7,996	3,281	69.59%	1.88	0.77	69.37%
2015年04月30日	证券交易结算资金	126,807,883	7,500,098	6.29%	20,516.77	5,070.29	32.82%
	股票期权保证金	11,610	3,614	45.20%	4.08	2.20	117.02%
2015年05月29日	证券交易结算资金	133,596,700	6,788,817	5.35%	28,603.95	8,087.17	39.42%
	股票期权保证金	15,510	3,900	33.59%	6.25	2.17	53.19%
2015年06月30日	证券交易结算资金	140,832,816	7,236,116	5.42%	29,639.76	1,035.81	3.62%
	股票期权保证金	22,838	7,328	47.25%	10.24	3.99	63.84%
2015年07月31日	证券交易结算资金	144,160,773	3,327,957	2.36%	28,892.62	-747.14	-2.52%
	股票期权保证金	28,974	6,136	26.87%	14.05	3.81	37.21%
2015年08月31日	证券交易结算资金	146,514,910	2,354,137	1.63%	25,127.78	-3,764.83	-13.03%
	股票期权保证金	37,920	8,946	30.88%	17.96	3.91	27.83%
2015年09月30日	证券交易结算资金	148,482,861	1,967,951	1.34%	19,807.22	-5,320.57	-21.17%
	股票期权保证金	44,656	6,736	17.76%	16.37	-1.59	-8.85%
2015年10月30日	证券交易结算资金	150,491,640	2,008,779	1.35%	21,203.07	1,395.85	7.05%
	股票期权保证金	50,779	6,123	13.71%	18.59	2.22	13.56%
2015年11月30日	证券交易结算资金	153,368,659	2,877,019	1.91%	21,511.85	308.78	1.46%
	股票期权保证金	63,049	12,270	24.16%	22.25	3.66	19.69%
2015年12月31日	证券交易结算资金	156,421,468	3,052,809	1.99%	17,648.83	-3,863.02	-17.96%
	股票期权保证金	82,420	19,371	30.72%	23.22	0.97	4.36%

日期	资金类别	资金账户 (户)	与上月末的增减变动		资金余额 (亿元)	与上月末的增减变动	
			户数 (户)	环比		余额 (亿元)	环比
2016年01月29日	证券交易结算资金	158,833,803	2,412,335	1.54%	16,538.86	-1,109.96	-6.29%
	股票期权保证金	86,223	3,803	4.61%	26.53	3.31	14.25%
2016年02月29日	证券交易结算资金	160,950,519	2,116,716	1.33%	15,748.72	-790.15	-4.78%
	股票期权保证金	89,493	3,270	3.79%	27.72	1.19	4.49%
2016年03月31日	证券交易结算资金	165,305,073	4,354,554	2.71%	16,161.86	413.15	2.62%
	股票期权保证金	98,575	9,082	10.15%	29.29	1.57	5.66%
2016年04月29日	证券交易结算资金	168,069,381	2,764,308	1.67%	15,757.66	-404.21	-2.50%
	股票期权保证金	108,021	9,446	9.58%	30.77	1.48	5.05%
2016年05月31日	证券交易结算资金	170,763,469	2,694,088	1.60%	16,246.52	488.86	3.10%
	股票期权保证金	118,761	10,740	9.94%	34.97	4.20	13.65%
2016年06月30日	证券交易结算资金	173,709,125	2,945,656	1.72%	15,184.69	-1,061.83	-6.54%
	股票期权保证金	131,675	12,914	10.87%	36.11	1.14	3.26%
2016年07月29日	证券交易结算资金	176,248,058	2,538,933	1.46%	15,180.32	-4.36	-0.03%
	股票期权保证金	142,642	10,967	8.33%	38.28	2.17	6.01%

注：1、“证券交易结算资金”是指“证券市场交易结算资金监控系统”获取的有经纪业务的证券公司全部经纪业务客户（含部分采取第三方存管模式的资产管理业务客户）从事证券交易等的人民币交易结算资金，不包括投资者从事B股交易、融资融券业务等的资金，也不包括证券公司自营、QFII以及采用托管人结算模式的证券公司资产管理计划和公开募集证券投资基金等从事证券交易的资金。

2、“股票期权保证金”是指“证券市场交易结算资金监控系统”获取的证券公司的客户用于交易所股票期权交易、行权结算和履约保证的资金（包括权利金、保证金及行权资金），不包括证券公司自营及做市业务、QFII及采用托管人结算模式的证券公司资产管理计划和公开募集证券投资基金等从事股票期权交易、行权结算和履约保证的资金。

七 证券公司证券及股票期权投资者的资金余额及变动情况

日期	资金类别	资金余额 (亿元)		投资者银证转账/银衍转账引起的资金 变动金额 (亿元)		
		周末余额	周平均余额	周累计转 入额	周累计转 出额	周累计净转入 (转出) 额
2015.01.05-01.09	证券交易结算资金	12,663	12,450	5,144	4,086	1,058
2015.01.12-01.16	证券交易结算资金	13,386	11,769	8,470	3,983	4,486
2015.01.19-01.23	证券交易结算资金	12,736	13,823	3,975	7,449	-3,474
2015.01.26-01.30	证券交易结算资金	11,193	12,245	3,762	4,177	-415
2015.02.02-02.06	证券交易结算资金	12,427	12,015	4,447	3,761	685
2015.02.09-02.13	证券交易结算资金	13,405	12,180	9,028	7,808	1,220
	股票期权保证金	0.97	0.85	1.66	0.64	1.02
2015.02.16-02.17	证券交易结算资金	10,738	11,667	1,596	4,444	-2,848
	股票期权保证金	0.96	0.97	0.15	0.17	-0.02
2015.02.25-02.27	证券交易结算资金	11,309	11,383	2,654	2,046	608
	股票期权保证金	1.11	1.04	0.30	0.15	0.15
2015.03.02-03.06	证券交易结算资金	12,424	12,166	4,941	3,618	1,323
	股票期权保证金	1.22	1.21	0.41	-0.24	0.17
2015.03.09-03.13	证券交易结算资金	17,782	13,067	12,147	3,960	8,187
	股票期权保证金	1.25	1.23	0.32	-0.31	0.01
2015.03.16-03.20	证券交易结算资金	16,447	16,591	5,705	10,788	-5,083
	股票期权保证金	1.56	1.45	0.54	-0.24	0.30
2015.03.23-03.27	证券交易结算资金	15,859	16,266	6,602	6,208	394
	股票期权保证金	1.78	1.73	0.50	-0.36	0.14
2015.03.30-04.03	证券交易结算资金	17,410	16,453	7,793	6,169	1,624
	股票期权保证金	2.30	2.05	1.00	0.38	0.62
2015.04.07-04.10	证券交易结算资金	19,482	19,181	7,877	5,147	2,730
	股票期权保证金	2.93	2.75	1.00	0.31	0.69
2015.04.13-04.17	证券交易结算资金	25,409	20,378	17,722	9,908	7,814
	股票期权保证金	3.30	3.07	1.05	0.66	0.39
2015.04.20-04.24	证券交易结算资金	22,102	23,076	8,802	11,444	-2,642
	股票期权保证金	3.85	3.81	1.52	0.98	0.54
2015.04.27-04.30	证券交易结算资金	20,517	21,741	6,893	7,531	-638
	股票期权保证金	4.08	4.05	0.88	0.64	0.24
2015.05.04-05.08	证券交易结算资金	26,378	21,237	17,388	8,812	8,576
	股票期权保证金	4.69	4.37	1.76	0.94	0.82
2015.05.11-05.15	证券交易结算资金	23,702	24,771	8,250	11,969	-3,719
	股票期权保证金	6.34	5.84	2.49	0.71	1.78
2015.05.18-05.22	证券交易结算资金	31,613	24,288	16,773	11,121	5,652
	股票期权保证金	6.21	6.23	1.76	1.72	0.04
2015.05.25-05.29	证券交易结算资金	28,604	28,765	12,195	13,469	-1,274
	股票期权保证金	6.25	6.67	2.51	2.15	0.36

日期	资金类别	资金余额 (亿元)		投资者银证转账/银行转账引起的资金 变动金额 (亿元)		
		周末余额	周平均余额	周累计转 入额	周累计转 出额	周累计净转入 (转出) 额
2015.06.01-06.05	证券交易结算资金	38,531	29,449	22,699	13,621	9,078
	股票期权保证金	6.72	6.29	2.03	1.19	0.84
2015.06.08-06.12	证券交易结算资金	29,988	31,076	10,634	15,368	-4,734
	股票期权保证金	8.07	7.15	2.00	0.88	1.12
2015.06.15-06.19	证券交易结算资金	22,513	26,547	24,571	9,171	15,400
	股票期权保证金	7.95	8.19	1.72	1.62	0.10
2015.06.23-06.26	证券交易结算资金	29,947	34,913	7,265	19,044	-11,779
	股票期权保证金	9.09	8.75	3.12	1.52	1.60
2015.06.29-07.03	证券交易结算资金	24,261	28,613	17,317	10,988	6,329
	股票期权保证金	10.89	10.33	4.38	1.97	2.41
2015.07.06-07.10	证券交易结算资金	32,970	31,236	14,652	16,409	-1,757
	股票期权保证金	12.39	11.86	3.89	2.44	1.45
2015.07.13-07.17	证券交易结算资金	32,922	33,246	10,019	9,031	988
	股票期权保证金	13.30	13.13	2.82	1.95	0.87
2015.07.20-07.24	证券交易结算资金	31,026	31,908	6,916	8,129	-1,213
	股票期权保证金	12.77	13.12	3.60	2.48	1.12
2015.07.27-07.31	证券交易结算资金	28,893	29,809	7,119	8,130	-1,011
	股票期权保证金	14.05	13.74	3.43	1.93	1.50
2015.08.03-08.07	证券交易结算资金	29,274	29,253	5,761	6,968	-1,207
	股票期权保证金	14.64	14.50	2.01	1.44	0.57
2015.08.10-08.14	证券交易结算资金	28,781	29,439	5,994	6,825	-831
	股票期权保证金	15.43	15.20	2.08	1.17	0.91
2015.08.17-08.21	证券交易结算资金	26,347	27,689	6,682	6,642	40
	股票期权保证金	16.45	16.16	3.04	2.17	0.87
2015.08.24-08.28	证券交易结算资金	25,758	25,942	7,731	7,334	397
	股票期权保证金	17.93	17.98	6.62	3.44	3.18
2015.08.31-09.02	证券交易结算资金	24,161	24,493	3,447	4,499	-1,052
	股票期权保证金	18.34	18.21	2.18	1.57	0.61
2015.09.07-09.11	证券交易结算资金	24,730	25,384	5,655	6,501	-846
	股票期权保证金	18.46	18.75	3.50	3.24	0.26
2015.09.14-09.18	证券交易结算资金	24,181	24,486	5,074	5,809	-735
	股票期权保证金	18.37	18.47	3.08	3.10	-0.02
2015.09.21-09.25	证券交易结算资金	22,582	23,690	4,604	6,158	-1,554
	股票期权保证金	17.23	18.33	3.26	4.17	-0.91
2015.09.28-09.30	证券交易结算资金	19,807	21,091	2,443	5,052	-2,609
	股票期权保证金	16.37	16.76	1.33	2.11	-0.78
2015.10.08-10.09	证券交易结算资金	21,245	21,093	2,873	2,189	684
	股票期权保证金	16.99	16.89	1.19	0.60	0.59

日期	资金类别	资金余额 (亿元)		投资者银证转账/银行转账引起的资金 变动金额 (亿元)		
		周末余额	周平均余额	周累计转 入额	周累计转 出额	周累计净转入 (转出) 额
2015.10.12-10.16	证券交易结算资金	21,825	22,080	5,845	6,175	-330
	股票期权保证金	17.47	17.46	2.54	2.18	0.36
2015.10.19-10.23	证券交易结算资金	21,639	21,927	5,881	5,756	125
	股票期权保证金	17.90	17.74	2.24	1.77	0.47
2015.10.26-10.30	证券交易结算资金	21,203	21,598	5,461	6,007	-546
	股票期权保证金	18.59	18.66	3.10	2.91	0.19
2015.11.02-11.06	证券交易结算资金	21,837	21,263	5,594	5,667	-73
	股票期权保证金	19.49	19.04	3.33	2.53	0.80
2015.11.09-11.13	证券交易结算资金	21,971	22,413	6,494	6,143	351
	股票期权保证金	20.49	20.27	3.76	2.49	1.27
2015.11.16-11.20	证券交易结算资金	21,503	21,715	5,941	5,889	52
	股票期权保证金	21.39	21.16	3.18	1.95	1.23
2015.11.23-11.27	证券交易结算资金	21,073	21,483	6,343	5,876	467
	股票期权保证金	22.93	22.64	4.48	3.20	1.28
2015.11.30-12.04	证券交易结算资金	23,729	21,524	12,740	9,647	3,093
	股票期权保证金	22.65	22.26	3.33	3.23	0.10
2015.12.07-12.11	证券交易结算资金	20,453	21,617	6,085	7,027	-942
	股票期权保证金	23.13	23.10	2.63	1.84	0.79
2015.12.14-12.18	证券交易结算资金	21,664	21,340	10,145	10,823	-678
	股票期权保证金	24.85	24.17	3.62	2.11	1.51
2015.12.21-12.25	证券交易结算资金	26,859	20,825	10,370	6,951	3,419
	股票期权保证金	23.41	24.75	3.74	5.57	-1.83
2015.12.28-12.31	证券交易结算资金	17,649	19,767	5,311	11,216	-5,905
	股票期权保证金	23.22	23.47	2.64	2.83	-0.19
2016.01.04-01.08	证券交易结算资金	19,185	18,868	8,305	6,811	1,494
	股票期权保证金	24.75	24.54	5.34	3.32	2.02
2016.01.11-01.15	证券交易结算资金	17,697	18,216	6,373	6,453	-80
	股票期权保证金	26.63	25.81	5.14	2.56	2.58
2016.01.18-01.22	证券交易结算资金	16,672	17,316	5,741	5,669	72
	股票期权保证金	27.17	26.97	3.79	2.98	0.81
2016.01.25-01.29	证券交易结算资金	16,539	16,728	5,561	5,474	87
	股票期权保证金	26.53	27.41	4.93	4.58	0.35
2016.02.01-02.05	证券交易结算资金	14,455	15,699	4,657	6,381	-1,724
	股票期权保证金	25.54	26.07	2.65	3.40	-0.75
2016.02.15-02.19	证券交易结算资金	16,625	16,438	5,609	4,194	1,415
	股票期权保证金	27.61	26.95	4.18	2.11	2.07
2016.02.22-02.26	证券交易结算资金	15,479	16,360	5,653	4,918	735
	股票期权保证金	27.73	28.25	4.33	4.19	0.14

日期	资金类别	资金余额 (亿元)		投资者银证转账/银行转账引起的资金 变动金额 (亿元)		
		周末余额	周平均余额	周累计转 入额	周累计转 出额	周累计净转入 (转出) 额
2016.02.29-03.04	证券交易结算资金	17,155	16,644	5,562	4,877	685
	股票期权保证金	28.60	28.21	4.45	3.53	0.92
2016.03.07-03.11	证券交易结算资金	16,425	16,887	4,308	4,560	-252
	股票期权保证金	29.55	29.17	3.64	2.67	0.97
2016.03.14-03.18	证券交易结算资金	17,171	16,776	4,938	4,825	113
	股票期权保证金	30.43	30.28	3.83	3.07	0.76
2016.03.21-03.25	证券交易结算资金	17,287	17,718	5,667	5,608	59
	股票期权保证金	29.60	30.75	4.68	5.84	-1.16
2016.03.28-04.01	证券交易结算资金	15,942	16,542	5,379	6,105	-726
	股票期权保证金	29.45	29.43	4.05	4.08	-0.03
2016.04.05-04.08	证券交易结算资金	16,593	16,969	4,557	4,109	448
	股票期权保证金	29.94	29.75	3.47	2.86	0.61
2016.04.11-04.15	证券交易结算资金	16,976	17,084	5,132	5,197	-65
	股票期权保证金	31.26	30.80	4.78	3.35	1.43
2016.04.18-04.22	证券交易结算资金	16,393	16,787	5,332	5,193	139
	股票期权保证金	32.72	32.31	4.88	3.38	1.50
2016.04.25-04.29	证券交易结算资金	15,758	16,299	4,640	5,431	-791
	股票期权保证金	30.77	32.50	4.45	5.98	-1.53
2016.05.03-05.06	证券交易结算资金	16,070	16,361	4,074	3,753	321
	股票期权保证金	32.14	31.73	3.80	2.43	1.37
2016.05.09-05.13	证券交易结算资金	15,744	16,104	4,762	4,449	313
	股票期权保证金	33.99	33.41	5.15	3.08	2.07
2016.05.16-05.20	证券交易结算资金	15,756	15,837	4,296	4,346	-50
	股票期权保证金	34.95	34.79	4.51	3.36	1.15
2016.05.23-05.27	证券交易结算资金	15,285	15,673	4,094	4,676	-582
	股票期权保证金	34.59	35.15	4.14	4.17	-0.03
2016.05.30-06.03	证券交易结算资金	15,975	15,930	4,810	5,005	-195
	股票期权保证金	35.84	35.20	5.25	3.95	1.30
2016.06.06-06.08	证券交易结算资金	15,483	15,819	2,948	3,361	-413
	股票期权保证金	36.52	36.36	2.69	1.86	0.83
2016.06.13-06.17	证券交易结算资金	15,672	15,758	4,994	4,938	56
	股票期权保证金	38.33	37.66	5.91	3.85	2.06
2016.06.20-06.24	证券交易结算资金	15,703	15,809	4,972	5,183	-211
	股票期权保证金	36.70	37.79	4.76	6.22	-1.46
2016.06.27-07.01	证券交易结算资金	15,784	15,844	5,649	6,205	-556
	股票期权保证金	36.19	36.42	5.37	5.86	-0.49
2016.07.04-07.08	证券交易结算资金	16,230	16,482	5,311	5,589	-278
	股票期权保证金	37.54	37.29	4.75	3.26	1.49

日期	资金类别	资金余额 (亿元)		投资者银证转账/银行转账引起的资金 变动金额 (亿元)		
		周末余额	周平均余额	周累计转 入额	周累计转 出额	周累计净转入 (转出)额
2016.07.11-07.15	证券交易结算资金	16,024	16,438	5,081	5,241	-160
	股票期权保证金	38.89	38.61	6.02	4.70	1.32
2016.07.18-07.22	证券交易结算资金	15,432	15,807	4,510	4,788	-278
	股票期权保证金	39.09	39.48	4.34	3.99	0.35
2016.07.25-07.29	证券交易结算资金	15,180	15,506	4,975	4,807	168
	股票期权保证金	38.28	39.51	5.12	6.10	-0.98

注：1、“银证转账”是指在客户交易结算资金第三方存管制度下投资者在银行结算账户和证券资金账户之间的资金划转方式，是引起“证券交易结算资金”变动的重要方式之一。“投资者银证转账引起的资金变动金额”项下的“转入额”是指投资者从银行结算账户转入资金账户的金额；“转出额”是指投资者从资金账户转出到银行结算账户的金额；“净转入（转出）额”=“转入额”-“转出额”，其中，正数为净转入，负数为净转出。

2、“银行转账”是指投资者在银行结算账户和衍生品资金账户之间的资金划转方式，是引起“股票期权保证金”变动的重要方式之一。“投资者银行转账引起的资金变动金额”项下的“转入额”是指投资者从银行结算账户转入衍生品资金账户的金额（入金）；“转出额”是指投资者从衍生品资金账户转出到银行结算账户的金额（出金）；“净转入（转出）额”（即出入金净额）=“转入额”-“转出额”，其中，正数为净转入，负数为净转出。

八 证券公司客户交易结算资金分布情况（2016年7月29日）

序号	辖区名称	证券公司数量 (家)	客户交易结算资金规模 (亿元)	占比
1	深圳辖区	15	3,242.98	21.36%
2	上海辖区	12	2,952.41	19.45%
3	北京辖区	14	2,151.17	14.17%
4	江苏辖区	5	1,269.81	8.36%
5	广东辖区	5	1,066.06	7.02%
6	湖南辖区	3	449.11	2.96%
7	四川辖区	4	390.83	2.57%
8	山东辖区	1	343.58	2.26%
9	浙江辖区	2	333.72	2.20%
10	福建辖区	2	316.31	2.08%
11	湖北辖区	2	289.69	1.91%
12	安徽辖区	2	241.90	1.59%
13	新疆辖区	1	193.86	1.28%
14	陕西辖区	3	156.74	1.03%
15	吉林辖区	1	145.75	0.96%
16	山西辖区	2	137.16	0.90%
17	西藏辖区	2	135.02	0.89%
18	内蒙古辖区	2	133.29	0.88%
19	江西辖区	2	130.16	0.86%
20	重庆辖区	1	129.97	0.86%
21	河北辖区	1	124.84	0.82%
22	广西辖区	1	108.20	0.71%
23	青岛辖区	1	107.24	0.71%
24	河南辖区	1	104.65	0.69%
25	天津辖区	1	84.46	0.56%
26	云南辖区	2	82.22	0.54%
27	海南辖区	2	69.47	0.46%
28	黑龙江辖区	1	68.84	0.45%
29	甘肃辖区	1	53.25	0.35%
30	贵州辖区	1	45.45	0.30%
31	大连辖区	1	44.90	0.30%
32	辽宁辖区	2	43.70	0.29%
33	厦门辖区	1	24.98	0.16%
34	青海辖区	1	8.60	0.06%
35	宁夏辖区	0	0.00	0.00%
36	宁波辖区	0	0.00	0.00%
合计		98	15,180.32	100.00%

注：本表中“辖区”是指中国证监会派出机构负责监管的辖区，每个辖区证券公司家数按证券公司法人注册地进行统计。

九 客户资金账户余额分层情况统计表

资金账户余额分层区间	上期末 (20160630)		本期末 (20160729)		本期增减	
	户数 (户)	余额 (亿元)	户数 (户)	余额 (亿元)	户数 (户)	余额 (亿元)
1亿元以上	478	1,285.35	482	1,322.20	4	36.85
5000万-1亿	594	408.08	663	449.47	69	41.40
1000万-5000万	5,477	1,068.56	6,384	1,248.07	907	179.51
500万-1000万	8,463	573.82	9,277	629.34	814	55.52
200万-500万	33,973	1,003.07	36,083	1,068.64	2,110	65.57
100万-200万	78,086	1,047.65	80,662	1,086.24	2,576	38.60
50万-100万	206,718	1,400.66	206,302	1,401.79	-416	1.13
20万-50万	761,241	2,286.90	734,185	2,211.84	-27,056	-75.06
10万-20万	1,311,599	1,802.01	1,230,750	1,692.96	-80,849	-109.05
5万-10万	2,307,261	1,606.35	2,140,709	1,490.89	-166,552	-115.46
0-5万元	168,995,015	2,703.14	171,802,337	2,579.78	2,807,322	-123.36

十 存放在银行专用账户中的交易结算资金月末占比统计表

日期	银行专用存款账户余额（亿元）	客户交易结算资金存放占比
20150430	17,806.44	86.99%
20150529	24,976.09	87.97%
20150630	25,795.55	87.61%
20150731	25,191.17	86.19%
20150831	22,245.75	86.23%
20150930	13,222.43	81.54%
20151030	13,501.58	83.09%
20151130	20,465.20	85.81%
20151231	14,554.55	78.97%
20160129	13,485.36	82.86%
20160229	13,422.82	84.69%
20160331	14,168.74	85.92%
20160429	13,187.51	84.80%
20160531	13,169.94	84.59%
20160630	13,343.43	86.20%
20160729	12,821.95	84.23%

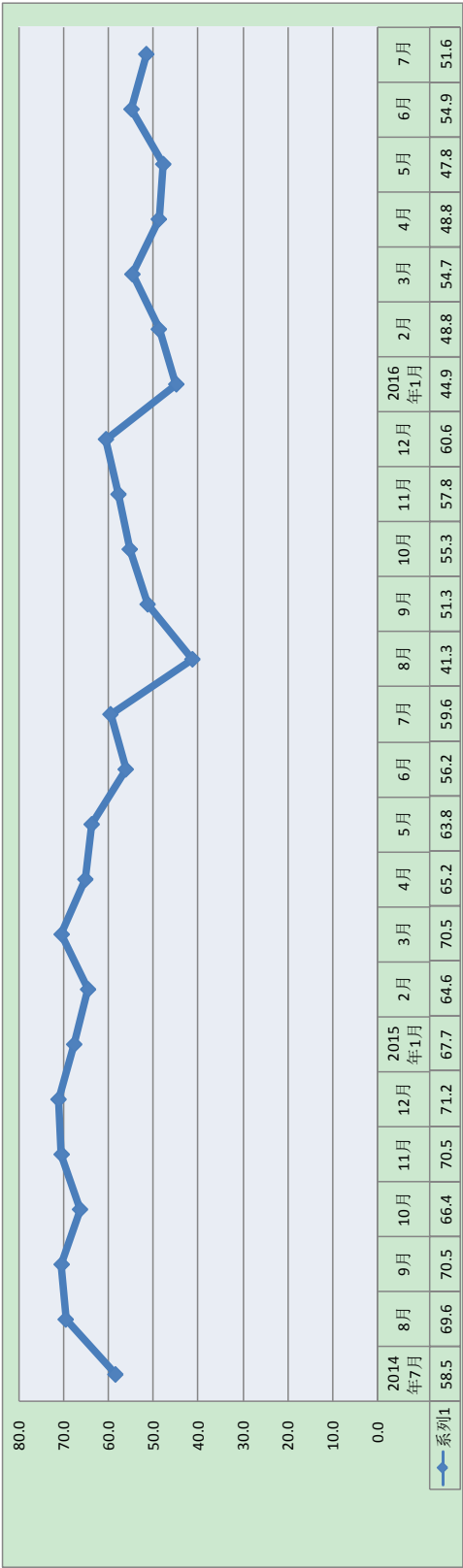
注：客户交易结算资金存放占比=月末银行实际存放客户资金/（月末银行实际存放客户资金+月末客户结算备付金余额）

十一 中国证券市场投资者信心指数月度变化情况

	2016年6月	2016年7月	环比变化
信心指数	54.9	51.6	-3.3
国内经济基本面	53.9	50.8	-3.1
国内经济政策	56.8	52.1	-4.7
国际经济金融环境	41	43.4	2.4
股票估值	47.5	44.6	-2.9
大盘乐观	58.3	50.9	-7.4
大盘反弹	52.6	50.5	-2.1
大盘抗跌	61	59.9	-1.1
买入	50.2	47.7	-2.5

十二 中国证券投资基金投资者信心指数图

2014年7月-2016年7月



指标说明

- ◆ **1、统计内容:**包括对投保基金筹集、管理和使用，证券公司分类与上交基金，投保基金公司受偿债权等情况。

- ◆ **2、统计范围:**2004年以来处置的31家证券公司中，需要由投保基金公司拨付投保基金弥补客户证券交易结算资金缺口和收购个人债权的被处置证券公司共24家；南方证券、辽宁证券由人民银行直接拨付再贷款，不由投保基金公司承担；健桥证券、大通证券、第一证券、巨田证券和中期证券不使用投保基金。因此，本统计报表所称“全部被处置证券公司”是指与投保基金公司有关的24家被处置证券公司，不包括南方证券、辽宁证券、健桥证券、大通证券、第一证券、巨田证券和中期证券。

南方证券处置时使用了15亿元中央财政专项资金。2003年12月25日处置的新华证券使用了2.596亿元证券市场专项补偿基金。24家之外被处置证券公司的有关统计数据包含在相关表格“其他”项中供参考。

- ◆ **3、误差:**数字采用四舍五入方式计算。由于舍入误差，分类数字之和未必等于总额数字。

- ◆ **4、金额单位:**除非特别指出，金额单位均为亿元人民币。

- ◆ **5、客户证券交易结算资金:**指经纪业务客户为保证足额交收而在客户证券交易结算资金专户存入的资金，出售有价证券所得到的所有款项（减去经纪佣金和其它正当费用），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。

- ◆ **6、个人债权:**指居民以个人名义在依法设立的金融机构（这里特指证券公司，下同）中开立账户或进行金融产品交易，并有真实资金投入所形成的对金融机构的债权，不包括个体工商户、个人独资企业、个人合伙企业等开立账户或进行产品交易所形成的对金融机构的债权。

- ◆ **7、投资者互动:**是指投保基金公司主动响应投资者需求，增强与投资者的沟通而建立起的投资者呼叫响应机制。

- ◆ **8、国务院批准额度：**在金融机构被公告处置日前，由监管部门测算，会同财政部、人民银行初步确定，最后报国务院批准的用于收购个人债权及客户证券交易结算资金的额度。
- ◆ **9、中央收购个人债权：**按照《个人债权及客户证券交易结算资金收购意见》等有关政策的规定，收购客户证券交易结算资金的款项全部由中央政府负责；收购个人债权的资金由中央政府负责90%，其余10%由金融机构总部、分支机构、营业网点所在地省级政府分别筹集，但收购正常经纪业务客户被挪用证券的资金全部由中央政府负担。这里的中央收购个人债权指的是由中央政府负责出资收购的个人债权，不含地方政府出资收购的个人债权。
- ◆ **10、承借再贷款：**指以投保基金公司名义直接从人民银行承借的用于垫付证券投资者投保基金初始资金来源的再贷款（包含原由人民银行分支机构发放的再贷款已移交投保基金公司部分）。
- ◆ **11、发放投保基金：**指投保基金公司直接向被处置证券公司的托管清算机构发放的投保基金（包含原由人民银行分支机构发放的再贷款已移交投保基金公司部分）。
- ◆ **12、休眠账户：**指证券账户和资金账户双户齐全、处置日前三年无交易和资金存取且无法联系客户，并且截至破产受理公告日无客户主张权利的账户。
- ◆ **13、单资金账户：**指处置日无对应证券账户且截至破产受理公告日无客户主张权利的账户。
- ◆ **14、预计受偿率：**指被处置证券公司预计破产财产变现金额扣除优先受偿金额和必要费用后，与普通债权总额的比例。下限（上限）指根据各项资产具体情况，对资产可回收金额的保守（乐观）估计。被处置证券公司资产主要包括自营证券、应收账款、长期股权投资、固定资产等。自营证券可回收金额是依据预估周期最后一个交易日二级市场收盘价格计算；应收账款、长期股权投资、固定资产的可回收金额，有评估的按评估价值计算，已经处置的按照实际处置价值计算，没有评估或处置的，根据行政清理组或破产管理人提供的最近一期经审计调整账面价值，结合账龄、债务人及被投资公司经营状况、固定资产市场情况等因素综合估计。

- ◆ **15、受偿债权：**指证券公司被撤销、关闭、破产，或者被中国证券监督管理委员会实施行政接管、托管经营等强制性监管措施时，按照国家有关政策规定，使用投保基金收购个人债权、弥补客户证券交易结算资金缺口后，依法形成的投保基金公司对被处置证券公司的债权。

南方证券使用15亿财政专项资金，由投保基金公司代位受偿。新华证券使用2.596亿元证券市场专项补偿基金，由投保基金公司受托代位受偿。

- ◆ **16、债权受偿：**指投保基金公司取得被处置证券公司受偿债权后，依法参与被处置证券公司的破产清算，并参与破产财产分配的行为。

- ◆ **17、中国证券投资者信心指数简介：**为了解个人证券投资者在当前经济和市场环境下的投资心理和预期变化，2008年5月，投保基金公司在借鉴国内外投资者信心理论研究和调查工作实践的基础上，编制了中国证券投资者信心指数。该指数以月度为单位，从国内经济基本面、国内经济政策、国际经济和金融环境、股票估值指标、大盘乐观指标、大盘反弹指标、大盘抗跌指标、买入指标八个指标进行描述。

中国证券投资者信心指数数值介于0-100之间，50为中性值。指数大于50时，表示投资者中持乐观、积极看法的比例大于持悲观、消极看法的比例，投资者信心整体偏向乐观。指数值越高，表示投资者信心越强。指数小于50时，表示投资者中持乐观、积极看法的比例小于持悲观、消极看法的比例，投资者信心整体偏向悲观。

- ◆ **18、证券交易结算资金：**“证券市场交易结算资金监控系统”获取的有经纪业务的证券公司全部经纪业务客户（含部分采取第三方存管模式的资产管理业务客户）从事证券交易等的人民币交易结算资金，不包括投资者从事B股交易、融资融券业务等的资金，也不包括证券公司自营、QFII以及采用托管人结算模式的证券公司资产管理计划和公开募集证券投资基金等从事证券交易的资金。

- ◆ **19、股票期权保证金：**“证券市场交易结算资金监控系统”获取的证券公司的客户用于证券交易所股票期权交易、行权结算和履约保证的资金（包括权利金、保证金及行权资金），不包括证券公司自营及做市业务、QFII及采用托管人结算模式的证券公司资产管理计划和公开募集证券投资基金等从事股票

期权交易、行权结算和履约保证的资金。

- ◆ **20、银证转账:**在客户交易结算资金第三方存管制度下投资者在银行结算账户和证券资金账户之间的资金划转方式，是引起“证券交易结算资金”变动的重要方式之一。“投资者银证转账引起的资金变动金额”项下的“增加额”是指投资者从银行结算账户转入资金账户的金额；“减少额”是指投资者从资金账户转出到银行结算账户的金额；“净变动额”=“增加额”-“减少额”。
- ◆ **21、银行转账:**投资者在银行结算账户和衍生品资金账户之间的资金划转方式，是引起“股票期权保证金”变动的重要方式之一。“银行转账引起的资金变动金额”项下的“增加额”是指投资者从银行结算账户转入衍生品资金账户的金额（入金）；“减少额”是指投资者从衍生品资金账户转出到银行结算账户的金额（出金）；“净变动额”（出入金净额）=“增加额”-“减少额”。
- ◆ **22、客户交易结算资金银行专用存款账户:**指证券公司以其名义在第三方存管银行开立的，用于存放客户交易结算资金、办理证券交易结算资金结算划转的银行专用存款账户。
- ◆ **23、统计截止日期:**2016年7月30日。

投保基金公司编印

统计截止日期:2016年07月30日

中国 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座

邮编：100034

电话：010-66580839

传真：010-66580616

网址：www.sipf.com.cn