

2017年5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	17
九、客户资金账户余额分层情况统计表	18
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	19
十一、中国证券市场投资者信心指数月度变化情况	20
十二、中国证券市场投资者信心指数图	21
[指标说明]	22

统计概要

【客户证券交易结算资金和个人债权收购】

5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5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8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、中科证券、天一证券；10%-20%的有6家，分别是亚洲证券、北方证券、民安证券、广东证券、天同证券和新疆证券；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5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42.588亿元（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】

5月，投保基金筹集新增0.342亿元，其中，证券公司上缴0.066亿元，基金投资收益0.276亿元。

1-5月，投保基金累计筹集金额为32.349亿元，其中交易经手费10.901亿元，证券公司上缴19.459亿元，申购冻结资金利息0.426亿元，利息收入（包括基金存款及贷款利息）1.284亿元，基金投资收益0.280亿元。

5月，投保基金公司使用投保基金0.935亿元，主要为其他支出。

1-5月，投保基金公司累计使用投保基金14.594亿元，主要为其他支出，未发生拨付风险处置基金事项。

【证券公司分类与上缴基金】

5月，证券公司按证监会批准的缴纳比例上缴投保基金0.066亿元，其中，A类证券公司上缴0.020亿元，BBB类证券公司上缴0.037亿元，B类证券公司上缴0.007亿元，CC类证券公司上缴0.001亿元。

1-5月，证券公司按证监会批准的缴纳比例上缴投保基金19.459亿元，其中，AA类证券公司上缴2.213亿元，A类证券公司上缴3.984亿元，BBB类证券公司上缴10.375亿元，BB类证券公司上缴1.162亿元，B类证券公司上缴0.274亿元，CCC类证券公司上缴0.351亿元，CC类证券公司上缴0.245亿元，C类证券公司上缴0.854亿元。

【发放投保基金情况】

5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5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5月底，全市场经纪业务客户人民币资金账户共计205,260,461户，交易结算资金余额共计12,055.01亿元。与上月末相比，账户增加2,150,589户，环比增加1.06%；余额减少0.19亿元，环比减少0.002%。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225,561户，期权保证金余额共计60.17亿元。

【证券公司证券及股票期权投资者的资金余额及变动情况】

5月各周¹客户交易结算资金周平均余额分别为12,354、12,755、12,638、12,815、12,055亿元；银证转账周净转入（转出）额分别为235、-209、-15、-895、247亿元。5月份累计净转出证券市场资金637亿元。

5月各周股票期权保证金周平均余额分别为58.84、59.90、60.04、61.37、60.17亿元；银行转账周净变动额分别为1.40、0.91、-0.67、0.61、-0.65亿元。5月份累计净入金1.60亿元。

【证券公司客户交易结算资金分布情况】

截至5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3个（包括43家证券公司），占资金总规模的55.79%；交易结算资金规模在100（含）至1,000亿元的辖区共计16个（包括40家证券公司），占资金总规模的36.91%；交易结算资金规模在100亿元以下的辖区共计17个（包括18家证券公司），占资金总规模的7.31%。

【客户资金账户余额分层情况】

截至5月底，资金账户余额5万元以下的户数为201,697,446户，占比98.26%，金额合计2,324.30亿元，占比19.28%，呈现明显的非对称分布特征。

与上月相比，200万以上分层区间的余额均有所增加。

【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5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10,127.25亿元，占客户交易结算资金总额的80.48%。

¹5月的最后一周跨月（5月31日-6月2日），此处周数据不含6月1日-6月2日数据，下同。

【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2017年5月25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1,384名个人投资者和186名一般机构投资者，发放调查问卷共计1,570份。截至2017年6月2日，收回有效问卷1,520份，有效问卷回收率达到96.8%。

调查结果显示，2017年5月中国证券市场投资者信心指数为48.9，环比下降3.0%。投资者对国内宏观经济的信心基本保持稳定，对国内经济政策和海外市场环境的信心环比下降。随着中小创高估值风险逐步释放，投资者对股票估值的信心连续两个月小幅回升。投资者对市场反弹上涨的前景并不乐观，买入意愿持续下降，但同时认为目前大盘仍具有较强的抗跌性。

5月各项子指数的具体表现为：国内方面，制造业PMI与上月持平且连续十个月保持在荣枯线以上，投资者对国内经济基本面的信心为50.2，环比虽小幅下降1.2%，但基本保持稳定；在阶段性不确定因素依然存在和存量资金博弈的背景下，投资者对国内经济政策有利于股市的信心降至47.9，环比下降3.2%；国际方面，投资者对于国际经济金融环境的信心降至43.4，环比下降1.6%；市场方面，随着大盘持续震荡调整，投资者对股票整体估值的认可度升至48.9，环比上升1.9%；但权重蓝筹和中小创的分化表现进一步加剧，增量资金规模难以有效放大，使得大盘乐观和大盘反弹指数降至46.0和47.3，环比分别下降4.0%和4.4%；投资者的买入意愿也进一步萎缩，本月份为43.5，环比下降2.0%；另外，大盘抗跌指数环比下降1.5%，本月份为58.5，仍为八项子指数中的最高值。

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						
					批次	已发放情况	正在申请情况	已发放情况		正在申请情况					
								申请金额		发放金额	批次	申请金额	批次	申请金额	
1	德恒证券	21.620	14.126	65.34%	5.0754264978	5.0754264978	人行划转	5.7254029606	5.7254029606	正在申请情况	1047		上海专员办		
							第二批	0.7090798258	0.7090798258	12批第一部分	5.029640175	5.029640175		15	
							第三批	0.3352891140	0.3352891140	12批第二部分	0.1082847093	0.1082847093		2	
							第四批	0.5556196575	0.5556196575	前期剔除第一批	-	-		10	
							第五批	-	-	上海、湖北、广东、重庆、天津	0.2099360791	0.2099360791		11	
							第六批	-	-	沈阳、烟台	0.0000419223	0.0000419223		-	
							第七批	-	-	十二批第四部分	0.0283518000	0.0283518000		2	
							第八批	-	-	上海、湖北、成都、天津、新疆	0.2174400027	0.2174400027		8	
							第九批	-	-	上海、湖北、广东、吉林地区	0.6447395295	0.6447395295		9	
							第十批	-	-	上海、重庆、深圳、湖北、山西、内蒙古、新疆地区	0.6509156993	0.6509156993		10	
							第十一批	-	-	上海、重庆、湖北、黑龙江、沈阳、大连地区	0.1144209145	0.1144209145		12	
2	恒信证券	2.090	1.551	74.19%	0.2831295279	0.2831295279	第一批	0.1425667691	0.1425667691	正在申请情况	69		湖南证监局		
							第二批	0.0640541097	0.0640541097	人行划转	0.9577729601	0.9577729601		2	
							第三批	0.0708150969	0.0708150969	北京、湖南	0.0214825469	0.0214825469		1	
							第四批	0.0251219628	0.0251219628	江苏	0.0584910000	0.0584910000		1	
							第五批	0.0085706859	0.0085706859	福建	0.1029600000	0.1029600000		1	
							第六批	-	-	第四批	0.1210005000	0.1210005000		3	
							第七批	-	-	人行划转	0.0362200590	0.0362200590		2	
							第八批	-	-	第一批	0.5350743000	0.5350743000		39	
							第九批	-	-	第二批	0.0754128000	0.0754128000		1	
							第十批	-	-	第三批第二部分	-	-		1	
							3	中富证券	3.750	0.932	24.84%	17.5200000000		17.5200000000	上海、浙江、福建
第三批	0.0073800000	0.0073800000	已垫资收购部分	0.0171000000	0.0171000000	1									
第四批	-	-	第四批	0.1907610300	0.1907610300	13									
第五批	-	-	人行划转	0.6685950384	0.6685950384	30									
第六批	-	-	第一批	0.6657480000	0.6657480000	5									
第七批	-	-	第二批第二部分	-	-	5									
第八批	-	-	债券	0.1811910062	0.1811910062	302									
第九批	-	-	第二批第三部分	-	-	1									
第十批	-	-	第三批	0.0405900000	0.0405900000	1									
第十一批	-	-	第二批第四部分	0.0324900000	0.0324900000	1									
4	汉唐证券	27.250	19.259	70.67%	0.0085706859	0.0085706859							第一批休眼账户、单资金账户		0.0085706859
							第二批	-	-	第二批第五部分	0.3894300000	0.3894300000	7		

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	投保基金 发放总额	已发放额 占批准 额度比例	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	批次		申请金额
12	甘肃证券	0.890	1.778	199.81%	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			第三批	0.0062253626	0.0027153626	15			
					第四批			第四批	-	0.0035100000	1			
					破产公告后新登记第一批			破产公告后新登记第一批	0.0037578500	0.0211087025	33			
					破产公告后新登记第二批			破产公告后新登记第二批	0.0003300000	0.0003300000	2			
					破产公告后新登记第三批			破产公告后新登记第三批	0.0008920000	0.0008920000	3			
					第一批			第一批	0.0001500000	0.0001500000	1			
					深圳第一部分			深圳第一部分	0.3823119000	0.3823119000	673			
					深圳第二部分			深圳第二部分	0.3009897000	0.0348187500	1			
					深圳第三部分			深圳第三部分	-	0.0695232000	1			
					深圳第四部分			深圳第四部分	0.0015480000	0.0015480000	3			
13	昆仑证券	2.600	2.436	93.71%	第一批	1.7549584516	1.7485913206						青海证监局	
					第二批									
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					14	广东证券	21.730	20.867	96.03%	第一批	10.0000000000	10.0000000000		
第二批	6.8000000000	5.0485850793												
第三批	3.2995963400	1.7671291828												
第四批	-	1.0813248694												
第一批														
第二批														
第三批														
第四批														
第一批														
第二批														
第三批														
15	天勤证券	1.900	2.337	123.01%						第一批	0.3181510152	0.3181510152		
					第二批	0.0713657307	0.0600000000							
					第三批	-	0.0286326101							
					第四批	-	2.3436878440							
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					16	西北证券	2.690	2.344	87.13%	第一批	16.3913794235	8.0000000000		
第二批	-	4.7242871529												
第三批														
第四批														
第一批														
第二批														
第三批														
第四批														
第一批														
第二批														
第三批														
17	华夏证券	20.08	20.285	101.02%						第一批	1.7035799900	1.7035799900		
					第二批	-	4.7242871529							
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					18	兴安证券	2.790	0.314	11.25%	第一批	0.0089314111	0.0089314111		
第二批	3.4692715902	1.7577039402												
第三批														
第四批														
第一批														
第二批														
第三批														
第四批														
第一批														
第二批														
第三批														
19	河北证券	3.700	2.532	68.42%						第一批	0.7044909761	0.6755646518		
					第二批	0.0481473914	0.0481473914							
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									
					第四批									
					第一批									
					第二批									
					第三批									

二 投保基金公司债权受偿情况

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			实际受偿率	备注
			下限	上限		股票名称	已受偿股票 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	20.091	43.10%	53.00%	0.166	股票1	18,609,302	1.727	50.16%	确认债权金额中含有我公司让渡债权
						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%	3.584	股票1	14,008,381	3.506	67.01%	确认债权金额中含有我公司让渡债权
6	大鹏证券	20.249	26.51%	30.00%	5.368	股票2	7,559,899	2.695	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%	0.611				15.00%	确认债权金额中含有我公司让渡债权
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%	20.00%	4.037				18.83%	
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%	4.456				21.00%	
18	兴安证券	0.319	100.00%	100.00%	0.315				100.00%	投保基金公司实际拨付收购资金及对应申
19	河北证券	2.242	100.00%	100.00%	2.236				100.00%	报利息获得100%清偿
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%	3.091				31.00%	
22	中科证券	12.998	15.08%	25.00%	3.209				24.69%	
23	天同证券	11.071	12.31%	21.79%	1.873				16.80%	
24	天一证券	3.511	10.00%	50.00%	1.554				44.28%	
其他	南方证券	15.580	62.00%	75.00%	5.660	股票1	8,474,964	2.048	72.40%	代财政部管理的受偿资产
						股票2	32,625,414	3.572		
						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	252.250			42.588				18.867	

注：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：张海宁

三 投保基金筹集和使用情况

单位：亿元

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	0.935	14.594
1、期初再贷款基金存款余额	1	-	-	(1) 风险处置支出	19		
2、本期承贷的再贷款	2	-	-	(2) 风险监测费用	20	0.003	0.046
3、再贷款存款利息净收入	3	-	-	(3) 基金委托管理费	21		0.012
4、本期使用的再贷款（扣除划回数）	4	-	-	(4) 基金管理机构管理费	22		
5、期末再贷款存款余额（5=1+2+3-4）	5	-	-	(5) 基金交易费用	23		
				(6) 基金投资成本支出	24		
				(7) 偿付人民银行再贷款利息	25		
二、公司筹集的基金				(8) 偿付人民银行再贷款本金	26		
1、期初基金存款余额	6	529.434	511.085	(9) 其他支出	27	0.932	14.535
2、本期筹集的基金	7	0.342	32.349	4、期末基金余额（28=6+7-18）	28	528.841	528.841
(1) 交易手续费	8		10.901	三、公司发行债券			
(2) 证券公司上缴基金	9	0.066	19.459	1、期初发行债券存款余额	29		
(3) 申购冻结资金利息	10		0.426	2、发行债券收入	30		
(4) 接受捐赠	11			3、本期使用的发行债券基金	31		
(5) 利息收入（包括基金存款及贷款利息）	12		1.284	4、期末发行债券存款余额（32=29+30-31）	32		
(6) 基金投资收益	13	0.276	0.280	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			1、期初余额（33=1+6+29）	33	529.434	511.085
(8) 受偿资产处置净收入	15			2、本期筹集金额（34=2+3+7+30）	34	0.342	32.349
(9) 收到退回已拨付风险处置基金	16			3、本期使用金额（35=4+18+31）	35	0.935	14.594
(10) 其他收入	17			4、期末余额（36=33+34-35）	36	528.841	528.841

注：1.表中第1、6、29、33行列报的“本年数据”指填报年度期初余额，即2017年1月1日余额。
 2.自2016年12月1日起，根据《投资者保障基金管理办法》有关内容，相应增加“三、本期使用的基金”项下增加“风险监测支出”、“基金委托管理费”、“基金管理机构管理费”统计科目；将“发行债券费用”、“偿付应付债券本金、利息”合并并在“基金交易费用”科目统计；将“二、本期筹集的基金”项下“运用基金投资债券的转让及利息收入”调整为“基金投资收益”。
 3.本月对“其他支出”作出调整，将当期缴纳的增值税及附加并入“其他支出”。

制表人：李中奇、杨旗

四 证券公司分类与上缴基金情况表

单位：亿元

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	0.75%		2.213
	A	1.00%	0.020	3.984
B	BBB	1.50%	0.037	10.375
	BB	1.75%		1.162
	B	2.00%	0.007	0.274
	CCC	2.50%		0.351
C	CC	2.75%	0.001	0.245
	C	3.00%		0.854
	D			
合计	125		0.066	19.459

制表人：杨旗

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。

五 投保基金公司发放投保基金情况表

单位: 亿元

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 (4) = (3)*90%	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 (1)=(2)+(3)	客户证券交易 结算资金 (2)		个人债权 (3)	客户证券交易 结算资金 (5)	个人债权 (6)	客户证券交易 结算资金 本期新增	个人债权 本期新增	累计 (7)	客户证券 交易结算 资金 (9)=(2)+(5)+(7)	个人债权 (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		-0.311	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	国发证券	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	大同证券	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

制表人: 杨旗

注: 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。

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
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%
2016年08月31日	证券交易结算资金	180,144,242	3,896,184	2.21%	14,898.87	-281.46	-1.85%
	股票期权保证金	155,528	12,886	9.03%	42.39	4.11	10.74%
2016年09月30日	证券交易结算资金	183,529,050	3,384,808	1.88%	12,223.38	-2,675.48	-17.96%
	股票期权保证金	166,787	11,259	7.24%	42.44	0.05	0.12%
2016年10月31日	证券交易结算资金	185,885,530	2,356,480	1.28%	14,271.35	2,047.97	16.75%
	股票期权保证金	173,793	7,006	4.20%	46.29	3.85	9.07%
2016年11月30日	证券交易结算资金	189,237,289	3,351,759	1.80%	14,396.17	124.82	0.87%
	股票期权保证金	186,125	12,332	7.10%	51.39	5.10	11.02%
2016年12月31日	证券交易结算资金	191,979,846	2,742,557	1.45%	12,678.46	-1,717.71	-11.93%
	股票期权保证金	202,171	16,046	8.62%	47.56	-3.83	-7.45%
2017年01月31日	证券交易结算资金	193,774,886	1,795,040	0.94%	10,886.81	-1,791.65	-14.13%
	股票期权保证金	205,431	3,260	1.61%	46.47	-1.09	-2.29%
2017年02月28日	证券交易结算资金	196,564,681	2,789,795	1.44%	13,177.52	2,290.71	21.04%
	股票期权保证金	209,037	3,606	1.76%	54.60	8.13	17.50%
2017年03月31日	证券交易结算资金	200,894,849	4,330,168	2.20%	11,531.97	-1,645.56	-12.49%
	股票期权保证金	216,310	7,273	3.48%	55.22	0.62	1.14%
2017年04月30日	证券交易结算资金	203,109,872	2,215,023	1.10%	12,055.20	523.23	4.54%
	股票期权保证金	220,613	4,303	1.99%	58.02	2.80	5.07%

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
2017年05月31日	证券交易结算资金	205,260,461	2,150,589	1.06%	12,055.01	-0.19	0.00%
	股票期权保证金	225,561	4,948	2.24%	60.17	2.15	3.71%

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。

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
2016.12.05-12.09	证券交易结算资金	14,098	14,590	4,962	5,199	-237
	股票期权保证金	53.61	52.77	6.85	4.52	2.33
2016.12.12-12.16	证券交易结算资金	13,650	14,178	5,968	5,088	880
	股票期权保证金	53.21	53.52	6.72	6.44	0.28
2016.12.19-12.23	证券交易结算资金	13,372	13,721	5,787	5,134	653
	股票期权保证金	52.00	52.84	5.00	5.72	-0.72
2016.12.26-12.30	证券交易结算资金	12,678	13,232	6,164	6,608	-444
	股票期权保证金	47.56	50.53	6.26	9.76	-3.50
2017.01.03-01.06	证券交易结算资金	13,341	13,227	4,139	4,326	-187
	股票期权保证金	48.49	48.70	5.09	4.15	0.94
2017.01.09-01.13	证券交易结算资金	13,153	13,632	4,835	5,204	-369
	股票期权保证金	49.94	49.51	5.34	3.80	1.54
2017.01.16-01.20	证券交易结算资金	12,631	12,832	5,602	5,146	456
	股票期权保证金	49.26	49.82	5.58	6.42	-0.84
2017.01.23-01.26	证券交易结算资金	10,887	12,021	3,544	4,608	-1,064
	股票期权保证金	46.47	48.57	5.26	8.35	-3.09
2017.02.03-02.03	证券交易结算资金	11,813	11,813	949	455	494
	股票期权保证金	47.15	47.15	1.77	1.00	0.77
2017.02.06-02.10	证券交易结算资金	12,936	13,058	4,352	4,043	309
	股票期权保证金	51.16	50.10	7.53	3.54	3.99
2017.02.13-02.17	证券交易结算资金	12,792	13,148	4,511	4,316	195
	股票期权保证金	52.70	52.43	5.74	4.17	1.57
2017.02.20-02.24	证券交易结算资金	13,029	13,115	4,653	4,332	321
	股票期权保证金	53.96	53.90	7.23	5.97	1.26
2017.02.27-03.03	证券交易结算资金	13,596	13,420	4,824	4,715	109
	股票期权保证金	55.37	54.74	5.91	3.91	2.00
2017.03.06-03.10	证券交易结算资金	13,365	13,589	4,462	4,648	-186
	股票期权保证金	57.49	57.00	5.54	3.19	2.35
2017.03.13-03.17	证券交易结算资金	13,213	13,595	5,314	4,851	463
	股票期权保证金	58.41	58.55	5.11	4.21	0.90
2017.03.20-03.24	证券交易结算资金	12,875	13,235	5,269	5,119	150
	股票期权保证金	55.42	57.74	6.75	8.83	-2.08
2017.03.27-03.31	证券交易结算资金	11,532	12,410	5,478	5,569	-91
	股票期权保证金	55.22	55.38	4.93	4.87	0.06
2017.04.05-04.07	证券交易结算资金	13,944	13,633	3,896	3,070	826
	股票期权保证金	56.73	56.35	3.77	2.48	1.29

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
2017.04.10-04.14	证券交易结算资金	13,401	14,054	4,995	5,677	-682
	股票期权保证金	59.07	58.43	5.94	3.26	2.68
2017.04.17-04.21	证券交易结算资金	12,833	13,353	4,910	4,976	-66
	股票期权保证金	60.91	60.25	6.36	4.00	2.36
2017.04.24-04.28	证券交易结算资金	12,055	12,669	5,046	5,286	-240
	股票期权保证金	58.02	60.20	5.48	6.89	-1.41
2017.05.02-05.05	证券交易结算资金	12,264	12,354	3,596	3,361	235
	股票期权保证金	59.11	58.84	5.22	3.82	1.40
2017.05.08-05.12	证券交易结算资金	12,467	12,755	4,499	4,708	-209
	股票期权保证金	60.39	59.90	5.00	4.09	0.91
2017.05.15-05.19	证券交易结算资金	12,333	12,638	4,400	4,415	-15
	股票期权保证金	59.72	60.04	4.77	5.44	-0.67
2017.05.22-05.26	证券交易结算资金	12,228	12,815	4,498	5,393	-895
	股票期权保证金	60.85	61.37	9.24	8.63	0.61
2017.05.31-06.02	证券交易结算资金	12,069	12,175	3,058	2,813	245
	股票期权保证金	58.84	59.48	3.26	5.11	-1.85

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（2017年5月31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	2,572.00	21.34%
2	上海辖区	13	2,376.75	19.72%
3	北京辖区	15	1,776.31	14.74%
4	江苏辖区	5	921.86	7.65%
5	广东辖区	5	827.16	6.86%
6	湖南辖区	3	331.15	2.75%
7	四川辖区	4	293.49	2.43%
8	山东辖区	1	277.73	2.30%
9	福建辖区	2	263.51	2.19%
10	浙江辖区	3	256.47	2.13%
11	湖北辖区	2	242.86	2.01%
12	安徽辖区	2	182.39	1.51%
13	新疆辖区	1	144.42	1.20%
14	陕西辖区	3	128.11	1.06%
15	内蒙古辖区	2	126.04	1.05%
16	西藏辖区	2	124.09	1.03%
17	江西辖区	2	113.39	0.94%
18	吉林辖区	1	110.28	0.91%
19	山西辖区	2	105.97	0.88%
20	重庆辖区	1	99.40	0.82%
21	河北辖区	1	96.13	0.80%
22	广西辖区	1	89.97	0.75%
23	天津辖区	1	82.06	0.68%
24	河南辖区	1	80.40	0.67%
25	青岛辖区	1	68.88	0.57%
26	云南辖区	2	66.83	0.55%
27	海南辖区	2	62.75	0.52%
28	黑龙江辖区	1	62.75	0.42%
29	甘肃辖区	1	62.75	0.34%
30	贵州辖区	1	62.75	0.30%
31	辽宁辖区	2	62.75	0.30%
32	大连辖区	1	62.75	0.29%
33	厦门辖区	1	62.75	0.16%
34	青海辖区	1	62.75	0.13%
35	宁波辖区	0	62.75	0.00%
36	宁夏辖区	0	62.75	0.00%
合计		101	62.75	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 (20170430)		本期末 (20170531)		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	432	1,141.55	456	1,203.10	24	61.56
5000万-1亿	558	376.92	563	382.06	5	5.14
1000万-5000万	4,838	946.64	4,957	977.18	119	30.54
500万-1000万	6,971	471.37	7,176	483.26	205	11.89
200万-500万	25,367	753.05	25,834	766.83	467	13.78
100万-200万	55,323	743.44	55,126	740.01	-197	-3.43
50万-100万	144,860	980.45	143,854	974.00	-1,006	-6.45
20万-50万	550,098	1,645.02	543,114	1,625.04	-6,984	-19.98
10万-20万	994,518	1,360.40	967,529	1,323.64	-26,989	-36.75
5万-10万	1,855,282	1,286.64	1,814,110	1,256.49	-41,172	-30.15
0-5万元	199,471,347	2,350.64	201,697,446	2,324.30	2,226,099	-26.33

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
20160531	13,169.94	84.59%
20160630	13,343.43	86.20%
20160729	12,821.95	84.23%
20160831	12,576.80	83.94%
20160930	9,979.02	83.56%
20161031	11,788.39	83.90%
20161130	12,369.43	83.52%
20161230	10,179.14	80.29%
20170131	8,895.73	81.13%
20170228	11,233.44	84.09%
20170331	9,360.30	82.70%
20170430	9,819.43	82.07%
20170531	10,127.25	80.48%

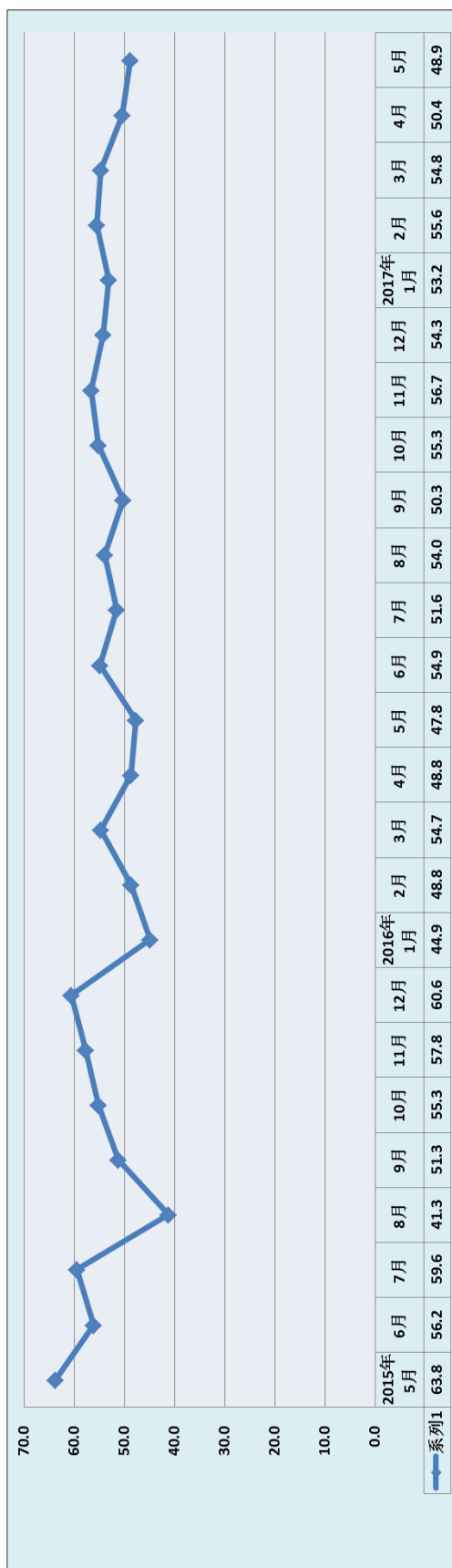
注：客户交易结算资金存放占比=月末银行实际存放客户资金/(月末银行实际存放客户资金+月末客户结算备付金余额)

十一 中国证券市场投资者信心指数月度变化情况

	2017年4月	2017年5月	环比变化
信心指数	50.4	48.9	-3.0%
国内经济基本面	50.8	50.2	-1.2%
国内经济政策	49.5	47.9	-3.2%
国际经济金融环境	44.1	43.4	-1.6%
股票估值	48.0	48.9	1.9%
大盘乐观	47.9	46.0	-4.0%
大盘反弹	49.5	47.3	-4.4%
大盘抗跌	59.4	58.5	-1.5%
买入	44.4	43.5	-2.0%

十二 中国证券市场投资者信心指数图

2015年5月-2017年5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:**在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用以弥补客户证券交易结算资金缺口及收购个人债权的证券公司共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相关的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。

处置南方证券使用了15亿元中央财政专项资金。2003年12月25日处置新华证券使用了2.596亿证券市场专项补偿基金。24家以外被处置证券公司的统计数据可参见相关表格的“其他”项。
- ◆ **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,增强与投资者的互动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:**2017年5月31日。

投保基金公司编印

统计截止日期:2017年5月31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