



中华人民共和国国家标准

GB/T 35964—2023/ISO 10962:2021

代替 GB/T 35964—2018

证券及相关金融工具 金融工具分类 (CFI) 编码

Securities and related financial instruments—Classification of
financial instruments (CFI) code

(ISO 10962:2021, IDT)

2023-08-06 发布

2023-08-06 实施

国家市场监督管理总局
国家标准化管理委员会 发布

目 次

前言	I
引言	II
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
4 原则与规定	2
4.1 概述	2
4.2 类别	4
4.3 分类	4
4.4 属性	4
4.5 CFI 外部编码列表的语义模型	4
5 CFI 编码的分配	6
5.1 通则	6
5.2 现有 CFI 编码和未分配 CFI 编码的金融产品	7
6 维护	7
附录 A (资料性) 分类示例	8
附录 NA (资料性) 国内金融工具 CFI 编码分类示例	9
参考文献	11

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则》的规定起草。

本文件代替 GB/T 35964—2018《证券及相关金融工具 金融工具分类(CFI 编码)》，与 GB/T 35964—2018 相比，除结构调整和编辑性改动外，主要技术变化如下。

- a) 删除了规范性引用文件(见 2018 年版的第 2 章)。
- b) 增加了术语和定义(见第 3 章)。
- c) 增加了第 4 章的图 1 实体关系(见 4.1)、图 2 CFI 元模型(见 4.5)、图 3 CFI 关系模型(见 4.5)。
- d) 删除了编码和定义章节(见 2018 年版的第 5 章)。
- e) 增加了维护章节及维护机构的表述,CFI 外部编码清单由 ISO 10962 维护机构维护和发布,该机构负责管理编码清单、其值和相应描述的修改和完善。维护机构负责发布 CFI 编码清单。CFI 外部编码列表由维护机构自行决定,以人类可读和机器可读的数据格式发布[例如电子表格、PDF、逗号分隔值(CSV)、JSON-LD、简洁的 RDF 三重语言(TTL)](见第 6 章)。

本文件等同采用 ISO 10962:2021《证券及相关金融工具 金融工具分类(CFI 编码)》。本文件做了下列最小限度的编辑性改动：

- 增加了对图 1 要点“TC 68/SC 8”的说明(见 4.1)；
- 增加了注“国内金融工具 CFI 编码示例见附录 NA”(见 5.1)；
- 增加了资料性附录 NA“国内金融工具 CFI 编码分类示例”。

请注意本文件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。

本文件由全国金融标准化技术委员会(SAC/TC 180)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公司、上海证券交易所(中国证券博物馆)、深圳证券交易所、郑州商品交易所、中国证券登记结算有限责任公司、全国中小企业股份转让系统有限责任公司、上海金融期货信息技术有限公司、中证机构间报价系统股份有限公司、华创证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司、深圳市金证科技股份有限公司。

本文件主要起草人：姚前、蒋东兴、周云晖、罗凯、程立、路一、刘彬、张小雨、王海航、宋亦鹰、黄鹏、黄天寿、杨荔雅、邓嘉图、段其国、高上明、马文辉、梁馨宁、刘英、陈宾、刘洋、李镇华、刘玉成、马丽霞、魏成、李心媛、何松洋、余勇。

本文件及其所代替文件的历次版本发布情况为：

- 2018 年首次发布为 GB/T 35964—2018；
- 本次为第一次修订。

引 言

随着跨境交易的增长,提高市场参与者之间信息交流的需求已迫在眉睫。由于缺乏统一的金融工具分类方法,证券业金融机构大多存在获取证券相关信息匮乏的问题。过去二十年间,创新型金融工具的爆发式增长导致信息交流问题愈发严重。金融工具分类(classification of financial instruments,CFI)编码的制定有利于解决金融行业关注的诸多问题。

许多市场参与者使用相似的术语来描述特征显著不同的金融工具。当市场参与者进行跨国交易时,这一问题会更加复杂。对于相同的术语,往往存在着其他国家描述金融工具的特征与我国的描述不同的情况。若使用不同语言描述同一个术语,由于翻译的问题,市场参与者会遇到相同的术语用来描述不同的金融工具,这种情况也会造成误解。

市场参与者面临的另一个问题是未能采用统一的方法来对证券产品进行分类。市场参与者所持有资产各个分析报告通常出自不同来源,这些来源的报告会将同一金融工具划分至不同类别。这对阅读者不仅在比较金融工具时会产生影响,也会造成信用方面的困扰。当需要衡量金融工具业绩表现时,持有者所拥有的恰当的分类方法的能力对于获得真实的比较结果是至关重要的。

为解决上述问题,我国已于2018年实施GB/T 35964—2018(ISO 10962:2015,IDT)。该文件明确划分了我国含有相似特征的金融工具,并根据国际标准化组织(ISO)制订的金融工具术语词汇表及其常见释义,给出了适用于我国市场的金融工具CFI编码分类示例。

2021年,ISO发布实施了ISO 10962:2021,与2015版相比主要删除了编码和定义章节、资料性附录A中有关国际金融工具CFI编码示例,增加了维护机构等相关内容。为进一步满足我国编码业务需要,提出了等同采用10962:2021,对GB/T 35964—2018进行修订。

采用CFI编码将带来以下益处。

- CFI编码体系提供的编码集合能适用于所有市场参与者在电子数据环境中进行电子通信。例如资产投资组合的持有人在阅读不同来源的分析报告时使用相同的分类体系,提高所属群组与属性相同的金融工具进行比较时的可信度。
- CFI编码的制定有利于提高市场中金融服务交易的效率、可靠性,以及相关数据的一致性和透明度。对金融工具分类使用一致性和结构性的标准分类方法有利于满足管理报告的要求。
- CFI编码范围和覆盖面的扩大也鼓励市场参与者使用其他国际标准,尤其是与CFI编码相关的国际证券识别编码(ISIN)。
- CFI编码将提高对金融工具特性和分类的解读能力,有助于引导投资者更好地了解其所投资的金融工具,有利于活跃市场并提高市场的流动性。同时,这些编码将使用网络技术展示在网站上,有益于互联网金融工具的发行、交易和结算的发展。
- CFI编码系统可以进一步作为金融工具分类的基础,用于汇总和管理行业风险报告。

证券及相关金融工具 金融工具分类 (CFI) 编码

1 范围

本文件规定了金融工具分类(CFI)编码和定义,可应用于国际现行的金融系统中。本文件中金融工具的分类原则既可适用于国际间交易的金融工具分类,也可适用于我国国内的金融工具分类。“金融工具”一词不仅包含了传统的证券,同时也包含了近些年在不同市场上出现的创新型金融产品(而且金融工具创新的趋势未来仍会持续下去)。

本文件为证券行业的管理及交易的实际应用而制定。至今为止,各国证券的管理和交易都是独立进行的,对本国以外并不产生影响。因此,本文件的应用也是由各国相关机构,如各国股票交易所、银行、经纪人、管理机构及其他相关证券机构自行决定的。

原则上,CFI 编码本身反映了发行的金融工具在其不变期内所定义的特征。但是,某些变动也能导致为原来预期的金融工具重新分配新的 CFI 编码,这些变动的情况包括股东大会决议的表决权或所有权的变动等。

2 规范性引用文件

本文件没有规范性引用文件。

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

概念 concept

思维单位,想法或意义。

注:概念使用国际化资源标识符(3.2)作为唯一标识符。

3.2

国际化资源标识符 internationalized resource identifier; IRI

用于标识概念(3.1)的唯一字符串。

注:IRI 取代了通用资源标识符(URI),用于识别资源定义框架(3.3)中的概念。

3.3

资源定义框架 resource definition framework; RDF

概念(3.1)建模的一般方法。

3.4

Web 本体语言 web ontology language; OWL

语义 web 语言旨在表示有关事物、事物组和事物之间关系的丰富而复杂的知识,允许人们表示层次类关系,并捕获属性和约束等。

注 1:更多信息请访问 <https://www.w3.org/OWL/>。OWL 可以通过各种语法约定来表示[参见简洁的 RDF 三重语言(3.6)]。