

证券公司场外业务数据统计报表

(2015 年第 1 期, 总第 1 期)

中国证券业协会
中证机构间报价系统股份有限公司

2015 年 1 月 15 日

证券公司场外业务统计报表 (2014 年 12 月)

目 录

本期概要.....	3
一、 报价系统业务开展情况.....	4
(一) 参与人情况.....	4
(二) 产品发行情况.....	5
(三) 产品转让情况.....	5
(四) 衍生品业务情况.....	6
(五) 证券公司短期债备案情况.....	6
二、 证券公司柜台市场试点情况.....	7
(一) 产品发行情况.....	7

(二) 产品转让情况.....	7
(三) 资金融出业务情况.....	8
(四) 账户开立情况.....	8
三、 场外衍生品交易情况	9
四、 区域性市场业务开展情况.....	9
(一) 参与情况.....	9
(二) 推荐挂牌情况.....	10
(三) 融资服务情况.....	10

本期概要

报价系统：2014 年，证券公司通过报价系统发行 361 只私募产品，累计募集资金 185.89 亿元，在多层次资本市场体系中，融资金额仅次于沪深交易所。截至年底，已有证券公司资管计划、收益凭证、私募基金、次级债券等私募产品通过报价系统发行。

柜台市场：2014 年，证券公司通过柜台市场发行（含代销）2338 只私募产品，发行金额 2148.04 亿元；317 只私募产品实现转让，转让金额 73.46 亿元；2 家证券公司开展场外融资业务 1478 笔，融出资金 20.87 亿元。

场外衍生品：2014 年，30 家证券公司开展场外衍生品初始交易 6779 笔，涉及初始名义本金 5,236.74 亿元，截至月底未了结交易 3063 笔，对应初始名义本金 2,983.48 亿元。

注：本报告所称场外业务不包括由其他单位负责备案和报告管理的场外业务，如：资产管理业务、直投基金业务、代销金融产品以及证券公司在交易所和股转系统开展的私募债券业务等。

一、 报价系统业务开展情况

(一) 参与人情况

表 1 报价系统参与人情况表(2014 年 12 月)

单位：家

参与人类型	月初数量	本月新增	本月退出	月末数量
证券公司	87	4	0	91
私募基金	56	27	0	83
银行	3	1	0	4
其他机构	38	13	0	51
合计	184	45	0	229

表 2 报价系统账户开立情况表(2014 年 12 月)

单位：户

	月初账户数量	本月新增	本月销户	月末账户数量	本年累计净增
产品账户	108	34	1	141	141
参与人二级 产品账户	57,975	87,339	53	145,261	145,261
资金结算 账户	182	64	0	246	246

注：参与人二级账户指报价系统参与人为其代理的客户开立的产品账户。

（二）产品发行情况

表 3 报价系统产品发行情况表(2014 年 12 月)

单位：只/亿元

	本月情况		本年累计	
产品类型	数量	金额	数量	金额
资管计划	4	3.26	33	18.87
收益凭证	217	98.97	325	145.82
次级债	0	0.00	1	20.00
私募基金	1	0.00	2	1.20
合计	222	102.23	361	185.89

注：私募债含证券公司短期公司债券、并购重组债券、次级债券等以非公开方式发行的债券。

（三）产品转让情况

表 4 报价系统产品转让情况表(2014 年 12 月)

单位：只/笔/万元

	可转让产品数量				本月情况		本年累计	
产品类型	月初	本月增加	本月终止	月末	笔数	金额	笔数	金额
资管产品	5	0	0	5	3	310.00	3	310.00

（四）衍生品业务情况

表5 报价系统衍生品交易平台签约情况表(2014年12月)

单位：笔/亿元

项目		月初存量	本月新增	本月终止	月末存量	本年累计
主协议签署情况		0	32	0	32	32
名义本金	互换类	0	1.32	1.12	0.20	1.32
	期权类	0	0.22	0.12	0.10	0.22
	合计	0	1.54	1.24	0.30	1.54
合约数量	互换类	0	11	9	2	11
	期权类	0	3	2	1	3
	合计	0	14	11	3	14

注：存量是指尚未完全终止的衍生品交易。

（五）证券公司短期债备案情况

表6 证券公司短期债备案情况表(2014年12月)

单位：笔/亿元

数据类型	月初	本月新增	本月发行	本月到期	月末	本年累计备案
备案笔数	0	2	0	0	2	2
备案额度	0.00	202.00	0.00	0.00	202.00	202.00

二、 证券公司柜台市场试点情况

(一) 产品发行情况

表7 柜台市场产品发行情况表(2014年12月)

单位：只/亿元

产品类型	本月情况						本年累计	
	自销		代销		合计			
	数量	金额	数量	金额	数量	金额	数量	金额
资管计划	16	11.80	398	116.48	414	128.28	2,338	2,148.04
基金专户	0	0.00	52	3.97	52	3.97		
私募基金	0	0.00	4	0.68	4	0.68		
收益凭证	624	307.92	0	0.00	624	307.92		
合计	640	319.72	454	121.13	1094	440.85		

(二) 产品转让情况

表8 柜台市场产品转让情况表(2014年12月)

单位：笔/亿元

产品类型	可转让产品数量			本月情况			本年累计	
	月初	本月增加	本月终止	月末	笔数	金额	笔数	金额
资管计划	416	97	56	457	107	9.32	317	73.46
基金专户	6	3	5	4	3	0.62		
收益凭证	274	424	258	440	0	0.00		
合计	696	524	319	901	110	9.94		

(三) 资金融出业务情况

表9 柜台融资业务开展情况表(2014年12月)

单位: 笔/亿元

业务类型	本月情况		本年累计	
	数量	金额	数量	金额
股票协议逆回购	0	0.00	7	12.30
证券质押融资	766	2.87	1,471	8.57
合计	766	2.87	1,478	20.87

(四) 账户开立情况

表10 柜台市场账户开立情况表(2014年12月)

单位: 万户

	月初账户数量	本月新增	本月销户	月末账户数量	本年累计净增
机构投资者开户	0.26	0.04	0	0.3	0.20
个人投资者开户	34.89	11.7	0.20	46.39	36.01
合计	35.15	11.74	0.20	46.69	36.21

表11 客户专用资金存款账户开立情况表(2014年12月)

单位: 万元

	月初金额	当月增加金额	当月减少金额	月末金额	证券公司数量	账户数量
客户专用资金存管账户	2,174.25	481,516.79	480,329.01	3,362.03	6	6

三、 场外衍生品交易情况

表 12 证券公司场外衍生品交易情况表(2014 年 12 月)

单位：笔/亿元

业务类型	项目	月初存量	本月新增	本月终止	月末存量	本年累计 初始交易
互换	交易笔数	2,169	1,054	716	2,507	5,833
	初始名义 本金	2,361.73	272.16	269.68	2,364.21	4,121.99
期权	交易笔数	403	277	124	556	946
	初始名义 本金	550.97	213.46	145.16	619.27	1,114.75
合计	交易笔数	2,572	1,331	840	3,063	6,779
	初始名义 本金	2,912.70	485.62	414.84	2,983.48	5,236.74

注：1. 含证券公司在柜台及报价系统开展的场外衍生品交易。

2. 存量是指尚未完全终止的衍生品交易。

四、 区域性市场业务开展情况

(一) 参与情况

表 13 证券公司参与区域性股权市场情况表(2014 年 12 月)

单位：家

月初参加区域市场 证券公司数量	本月增加 数量	本月减少 数量	月末参加区域市场 证券公司数量	涉及区域性 市场数量
49	0	0	49	30

（二）推荐挂牌情况

表 14 区域性市场挂牌推荐情况表(2014 年 12 月)

单位：只/家

挂牌类型	本月情况		本年累计	
	推荐挂牌数量	涉及区域性市场数量	推荐挂牌数量	涉及区域性市场数量
股权	13	1	530	11
私募债	0	0	17	2
合计	13	1	547	12

注：存在同一区域性市场涉及股权及债权挂牌的情形，本年累计涉及区域性市场数量为 12。

（三）融资服务情况

表 15 证券公司区域性市场融资服务情况表(2014 年 12 月)

单位：笔/亿元

融资方式	本月情况		本年累计	
	笔数	金额	笔数	金额
股权	0	0.00	5	0.52
股权质押	0	0.00	1	0.25
债权	2	3.23	22	24.84
收益权融资	0	0.00	4	0.64
合计	2	3.23	32	26.25