

# 2017年10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表	4
二、投保基金债权受偿情况表	8
三、投保基金筹集和使用情况表	9
四、证券公司分类与上缴基金情况表	10
五、投保基金公司发放投保基金情况表	11
六、中国证券市场投资者信心指数月度变化情况表	12
七、中国证券市场投资者信心指数图	13
[指标说明]	14

## 统计概要

### 【客户证券交易结算资金和个人债权收购】

10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10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10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42.614亿元（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】

10月，投保基金市场筹集新增20.541亿元，其中，交易经手费6.238亿元，证券公司上缴14.171亿元，申购冻结资金利息0.133亿元。

1-10月，投保基金累计市场筹集金额为56.561亿元，其中交易经手费22.139亿元，证券公司上缴33.600亿元，申购冻结资金利息0.822亿元。利息收入（包括基金存款及贷款利息）1.587亿元，基金投资收益3.828亿元，有关责任方追偿收入和破产财产清偿收入0.026亿元，其他收入45.002亿

元。

10月，投保基金公司使用投保基金0.001亿元，其中，风险处置支出0.001亿元，剩余为其他支出。

1-10月，投保基金公司累计使用投保基金15.624亿元，其中，风险处置支出0.005亿元，风险监测费用0.161亿元，基金委托管理费0.182亿元，剩余为其他支出。

### 【证券公司分类与上缴基金】

10月证券公司按证监会批准的缴纳比例上缴投保基金14.171亿元，其中，AA类证券公司上缴3.924亿元，A类证券公司上缴3.735亿元，BBB类证券公司上缴2.672亿元，BB类证券公司上缴0.761亿元，B类证券公司上缴0.704亿元，CCC类证券公司上缴0.787亿元，CC类证券公司上缴0.456亿元，C类证券公司上缴1.132亿元。

1-10月，证券公司按证监会批准的缴纳比例上缴投保基金33.600亿元，其中，AA类证券公司上缴6.130亿元，A类证券公司上缴7.712亿元，BBB类证券公司上缴13.035亿元，BB类证券公司上缴1.919亿元，B类证券公司上缴0.978亿元，CCC类证券公司上缴1.138亿元，CC类证券公司上缴0.701亿元，C类证券公司上缴1.986亿元。

### 【发放投保基金情况】

10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10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。

### 【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10月27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1,293名个人投资者和186名一般机构投资者，发放调查问卷共计1,479份。截至2017年11月2日，收回有效问卷1,414份，有效问卷回收率达到95.6%。

调查结果显示，10月份中国证券市场投资者信心指数为53.8，环比下降7.4%，回调至年内平均水平。投资者对国内宏观经济和经济政策的信心有所回落，但仍位于2016年以来较高水平，对海外市场环境的信心连续三个月保持在50中值以上。投资者对股票估值的信心有所上升，对大盘抗跌性的信心依然较强，但对于大盘短期的上涨预期和买入意愿则明显趋于谨慎。

10月各子指数具体表现为：国内方面，继连续两个月上升后，我国制造业PMI回落，但仍稳定在荣枯线以上，投资者对国内经济基本面的信心环比下降5.7%，但仍达到61.1高值，偏向积极；投资者对国内经济政策的信心为59.9，环比下降8.4%，但投资者对经济政策的信心依然位于2016年以来较高水平；国际方面，美联储缩表、加息等因素在一定程度上影响了投资者对海外市场环境的预期，但A股国际化进程不断推进使投资者对国际经济金融环境的信心连续三个月保持在偏乐观区间，本月该指数为52.8，环比下降7.9%；市场方面，10月大盘总体处于震荡调整格局，市场风险偏好有所回落，投资者谨慎情绪增强，大盘乐观和买入指数分别为52.0和45.1，环比下降了12.2%和12.1%；大盘反弹指数为50.9，环比下降2.9%；股票估值指数则实现“三连升”，本月达到49.6，环比上升了1.2%；大盘抗跌指数达到61.1，环比虽下降5.1%，但依然维持高位。

一 客户证券交易结算资金和个人债权收购进度表

序号	被处置证券公司名称	国务院批准总规模	投资基金发放总额	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		正在申请情况 批次 申请金额	正在申请情况 批次 申请金额	正在申请情况 批次 申请金额	正在申请情况 批次 申请金额	授权监管机构					
					批次	申请金额	已发放情况 批次 申请金额	批次						申请金额	已发放情况 批次 申请金额	批次	申请金额	
																		批次
1	德恒证券	21.620	14.126	65.34%	人行划转	5.0754264978	5.0754264978	5.7254029606	5.7254029606	5.7254029606	5.7254029606	1047	上海专员办					
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	0.1425667691	0.9577729601	0.9577729601	0.9577729601	0.9577729601	69	湖南证监局					
3	中富证券	3.750	0.932	24.84%	人行划转 第一批 第二批 第三批 已垫资收购部分 第四批	0.0251219628	0.0251219628	0.1210005000	0.1210005000	0.1210005000	0.1210005000	3	上海专员办					
4	汉唐证券	27.250	19.259	70.67%	人行划转	17.5200000000	17.5200000000	0.0362200590	0.0362200590	0.0362200590	0.0362200590	2	深圳证监局					

客户证券交易结算资金和个人债权收购进度表(续一)

序号	债券名称	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				接收监管机构
					已发放情况	申请金额	发放金额	正在申请情况	已发放情况	申请金额	发放金额	正在申请情况	
5	闽发证券	21.040	15.328	72.85%	第一批	7.8900230270	4.9653075107	人行划转	8.0213994355	8.0213994355	7578		福建证监局
					第二批	2.6045996259	1.7587200722	第一批	0.0002000000	0.0002000000	1		
					第三批	-	0.2845792409	债券	2.2398191993	2.2398191993	7489		
					第四批及缺口利息	0.2694217690	0.2694217690	第二批	0.6185160000	0.4751910000	50		
					第五批	0.0286362915	0.0286362915	第三批	0.0800550000	0.0117000000	4		
6	大鹏证券	22.210	19.901	89.60%	人行划转	15.9830075479	15.9830075479	第二批	0.0683550000	0.0683550000	8		深圳证监局
					第一批休眠账户、单资金账户	0.265811249	0.265811249	第三批	0.0619200000	0.0701100000	5		
					第二批休眠账户、单资金账户	0.009523591	0.009523591	第四批	0.3240900000	0.3240900000	2		
					第三批	-	-	第五批	0.1298700000	0.1298700000	3		
					第四批	-	-	第六批	0.0597060000	0.0597060000	1		
					第五批	-	-	第七批	0.0009962000	0.0009962000	1		
					第六批	-	-	第八批	0.2388519521	0.2388519521	1		
					第七批	-	-	第九批	0.0240662398	0.0240662398	21		
					第八批	-	-	共27批	0.8097109938	0.8097109938	3452		
					第九批	-	-	详见说明1	4.8111915687	4.8111915687	7260		
7	亚洲证券	39.140	29.081	74.30%	人行划转	17.4999000000	17.4999000000	债券	4.7713667031	4.4667862307	4369		上海专员办
					第一批	1.3067066186	1.0343049793	债券(第二部分)	0.1711876464	0.1711876464	5		
					第二批及缺口利息	0.2172433847	0.2172433847	破产受理公告日后登记第一批	0.0013200000	0.0008500000	2		
					第三批	-	-	破产受理公告日后登记第二批	0.0000600000	0.0000600000	1		
					第四批	-	-	破产受理公告日后登记第三批	0.0082690824	0.0082690824	1		
					第五批	-	-	破产受理公告日后登记第四批	0.0004230000	0.0004230000	1		
					第六批	-	-	已验资收购部分	0.0606366000	0.0606366000	7		
					第七批	-	-	破产受理公告日后第四批	0.0003000000	0.0003000000	2		
					第八批	-	-	沈阳	0.0003708000	0.0003708000	6		
					第九批	-	-	广州地区	0.0004050000	0.0004050000	2		
8	北方证券	13.030	11.138	85.48%	人行划转	11.0700000000	11.0700000000	债券	0.0672964938	0.0672964938	4		上海证监局
					第一批休眠账户、单资金账户	3.0678359437	3.0678359437	武汉第一批	0.1325030410	0.1069833856	155		
9	五洲证券	4.230	3.247	76.77%	第一批休眠账户、单资金账户	0.1793773572	0.1793773572	佛山、肇庆	1.0282563072	1.0129558774	432		河南证监局
					人行划转	4.9500000000	4.9500000000	第三批	1.4684655441	1.4134919532	235		
10	民安证券	6.660	11.846	177.87%	第一批及缺口利息	0.1707443096	0.1707443096	债券	4.1099789439	4.0691736031	4741		广东证监局
					第二批休眠账户、单资金账户	0.0318527296	0.0318527296	第四批个人债权	0.0343980000	0.0602790886	5		
					第三批休眠账户、单资金账户	0.0042085317	0.0042085317	第五批	0.0193425017	0.0193425017	2		
					第四批	5.0000000000	3.1774125531	第六批	0.0070200000	0.0070200000	1		
					第五批	1.7312104210	0.7285579526	第一批	0.0499687205	0.0374146200	24		
11	武汉证券	5.890	5.058	85.87%	第二批、三批	0.5316555675	0.5316555675	第二批	0.0499687205	0.0075541005	7		湖北证监局
					第三批	0.4701783820	0.4701783820	第三批	0.0001845000	0.0001845000	3		
					第四批及缺口利息	0.0695147926	0.0695147926						
					第五批	0.0355039763	0.0355039763						

客户证券交易结算资金和个人债权收购进度表(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的比例	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	批次	
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		
					第三批及缺口利息	0.0039633771	0.0039633771	第三批	0.0062253626	0.0027153626	15		
								第三批第二部分	-	0.0035100000	1		
								第四批	0.0037578500	0.0211087025	33		
13	昆仑证券	2.600	2.436	93.71%	第一批	1.7549584516	1.7485913206	破产公告后新登记第一批	0.0003300000	0.0003300000	2		青海证监局
					第二批	0.0039633771	0.0039633771	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		
14	广东证券	21.730	20.867	96.03%	第一批	10.0000000000	10.0000000000	深圳第二部分	0.0033262282	0.0033262282	93		深圳专员办
					第二批	6.8000000000	5.0485850793	深圳第三部分	0.1963496700	0.1963496700	8		
					第三批	3.2995963400	1.7671291828	深圳第四部分	0.0033262282	0.0033262282	254		
					第三批第二部分	-	1.0813248694	挪券第一批	1.1285701644	1.1285701644	8		
					第四批	0.3843377331	0.3796275493	挪券第二批	0.0166165330	0.0166165330	102		
15	天勤证券	1.900	2.337	123.01%	第一批	2.4069625672	1.8400000000	第一批	0.8638613517	0.8638613517	8		北京证监局
					第二批	-	0.3181510152	第二批	0.2796993254	0.2796993254	8		
					第三批	0.0713657307	0.0713657307	第三批	0.0100168092	0.0100168092	1		
					第四批	-	0.0600000000	青岛	0.0094995000	0.0094995000	2		
					第五批及缺口利息	0.0286326101	0.0286326101	天津地区	0.0095670000	0.0095670000	1		
16	西北证券	2.690	2.344	87.13%	第一批	16.3913794235	8.0000000000	第一批	0.6469685427	0.2689848851	336		宁夏证监局
					第二批	4.7242871529	4.7242871529	第二批	0.4684962076	0.3935163076	102		
								挪券	3.2389727164	2.7825779379	5264		
								第四批	0.1231614000	0.0469575000	2		
								第四批第二部分	-	0.0686619000	7		
17	华夏证券	20.08	20.285	101.02%	第二批	1.7035799900	1.7035799900	挪券剔除	-	0.1651116318	4		北京证监局
					第三批	-	0.7946742499	第三批和第四批	0.2204410500	0.0294534000	2		
					第四批	0.5791038886	0.5791038886	挪券剔除	-	0.0188000000	1		
					第一批休眠账户、单资金账户	0.0409390112	0.0409390112	上海、陕西和江苏	0.0646088004	0.1177434504	5		
					第二批休眠账户、单资金账户	0.0347014558	0.0347014558	第八批	-	0.1616850000	1		
18	兴安证券	2.790	0.314	11.25%	第一批	0.5736229317	0.2924959502	第九批	0.3257100000	0.3257100000	1		黑龙江证监局
					第二批及缺口利息	0.0089314111	0.0089314111	第十批	0.0244800000	0.0244800000	2		
					第三批	3.4692715902	1.7577039402	黑龙江	0.0125100000	0.0125100000	2		
					第二批	0.7044909761	0.6753646518	第二批	0.0108630495	0.0108629685	2		
					第一批休眠账户、单资金账户	0.0481473914	0.0481473914	第三批	0.0113776632	0.0113776632	4		
19	河北证券	3.700	2.532	68.42%	第二批	0.7044909761	0.6753646518	第三批	0.0280628019	0.0280628019	4		河北证监局
					第一批	0.0481473914	0.0481473914						



客户证券交易结算资金和个人债权收购进度表(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	
20	新疆证监局	5.710	4.513	79.03%	第一批	3.4737980151	2.8996839578	第一批	1.15522220000	1.15522220000	3180		
					第二批	-	0.0300924324	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		
					第三批	2.0000000000	2.0000000000	上海第一批	0.0598320000	0.0598320000	29		
					第三批	3.8826468466	3.0486203393	汕头第二批	0.6954417000	0.6954417000	540		
21	中关村证监局	12.190	9.567	78.48%	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	-	0.059232043	挪券	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	-		
22	中科证监局	17.180	12.767	74.31%	第三批	-	0.2826453702	第三批	0.0081240930	0.0081240930	4		
					第四批	0.0919029861	0.0919029861	沈阳第一部分	0.0283038167	0.0283038167	1		
					第一批休眠账户、单资金账户	0.0663257409	0.0663257409	沈阳第二部分	0.0079689510	0.0079689510	1		
					第一批	4.2853662073	2.1761502837	沈阳第三部分	0.0111697899	0.0111697899	1		
					第一部分	-	0.0815433422	挪券	2.5306984367	2.3456071367	1793		
23	天同证监局	16.220	10.509	64.79%	第二批	-	0.0815433422	第二批	2.5767881550	2.5214216550	1505		
					第二部分	-	0.4560000000	第三批	2.2606878146	1.4845159800	2030		
					第一批	-	-	挪券第一部分	0.6511865338	0.3091848932	1916		
					第二部分	-	-	挪券第二部分	0.218396883	0.062173524	36		
					与696国债有关的个人债权	-	-	挪券第三部分	0.2745633696	0.0329058000	503		
24	天一证监局	7.920	3.489	44.06%	第五批	0.0017384322	0.0017384322	第五批	0.0013977000	0.0013977000	19		
					第六批	0.0588741300	0.0588741300	第六批	0.0340568100	0.0340568100	45		
					第六批第二部分	-	-	挪券	0.0248173200	0.0248173200	6		
					挪券	-	-	挪券(济南中油债券)	0.0351016549	0.0351016549	244		
					第三批第二部分	-	-	第三批第二部分	0.0009000000	0.0009000000	1		
合计		282.510	225.205	79.72%	第一批(第三部分)	178.3458784044	162.6498712969	第七批	0.0005850000	0.0005850000	9		
					第一批第五部分	-	0.156072557	宁波	0.2950415145	0.2950415145	49		
					第三批及缺口利息	0.312729629	0.3127296294	上海	0.0093420000	0.0093420000	2		
					第一批休眠账户、单资金账户	0.080781219	0.080781219	破产受理公告日后登记第一批	0.0000782700	0.0000782700	1		
					第二批	3.3400795342	2.8782875874	破产受理公告日后登记第二批	0.0001500000	0.0001500000	1		

说明: 1、亚洲证券个人债权发放明细如下: 天津第三批0.2033500483亿元(32户); 天津第二批0.601416亿元(1010户); 武汉第三批0.18072亿元(1004户); 武汉第四批0.19791亿元(733户); 武汉第五批0.20304亿元(564户); 武汉第六批0.20655亿元(459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0.021123亿元(62户); 哈尔滨第三批0.00819亿元(1户); 天津第三批0.00819亿元(151户); 武汉第十一批0.1359亿元(151户); 武汉第十二批0.74481237亿元(903户); 成都第一批0.00081亿元(223户); 天津第四批0.2904566643亿元(4户); 武汉第十四批0.4286439亿元(903户); 安徽六安第五批0.000216亿元(1户); 安徽1户、天津1户共0.07075440亿元(2户); 武汉第十五批0.109843961亿元(41户); 深圳、上海、四川(第二批)0.094068亿元(5户); 武汉、宁波地区4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	已受偿股票			实际受偿率	备注
			下限	上限		股票名称	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%	3.53%	0.048				2.81%	
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
						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%	0.611				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%	确认债权金额中含有我公司让渡债权
15	天勤证券	2.349	3.56%	3.56%	0.084				3.56%	
						股票1	2,708,541	0.290		
						股票2	285,549	0.021		
16	西北证券	2.241	23.30%	35.00%	0.322	基金	1,186,400	0.014	28.86%	
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报利息获得100%清偿
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%	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			42.614					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，我部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表

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	0.001	15.624
1、期初再贷款基金存款余额	1	-	-	(1) 风险处置支出	19	0.001	0.005
2、本期承贷的再贷款	2	-	-	(2) 风险监测费用	20		0.161
3、再贷款存款利息净收入	3	-	-	(3) 基金委托管理费	21		0.182
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	591.954	521.115	(9) 其他支出	27	0.000	15.276
2、本期筹集的基金	7	20.541	107.004	4、期末基金余额（28=6+7-18）	28	612.495	612.495
(1) 交易经手费	8	6.238	22.139	三、公司发行债券			
(2) 证券公司上缴基金	9	14.171	33.600	1、期初发行债券存款余额	29		
(3) 申购冻结资金利息	10	0.133	0.822	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	0.000	1.587	4、期末发行债券存款余额（32=29+30-31）	32		
(6) 基金投资收益	13		3.828	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		0.026	1、期初余额（33=1+6+29）	33	591.954	521.115
(8) 受偿资产处置净收入	15			2、本期筹集金额（34=2+3+7+30）	34	20.541	107.004
(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	0.001	15.624
(10) 其他收入	17		45.002	4、期末余额（36=33+34-35）	36	612.495	612.495

说明：本表基金余额仅限为银行存款形式，“其他收入”主要为到期后收回的交易性金融资产。

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%	3.924	6.130
	A	1.00%	3.735	7.712
B	BBB	1.50%	2.672	13.035
	BB	1.75%	0.761	1.919
	B	2.00%	0.704	0.978
C	CCC	2.50%	0.787	1.138
	CC	2.75%	0.456	0.701
	C	3.00%	1.132	1.986
D	D			
合计	129		14.171	33.600

制表人：杨旗

说明：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		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)	个人债权 额度 (4)=(3)*90%	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		个人债权		客户证券 交易结算 资金 (9)=(2)+(5)+(7)	个人债权 (10)=(3)+(6)+(8)
								本期新增	累计 (7)	本期新增	累计 (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

制表人: 杨旌

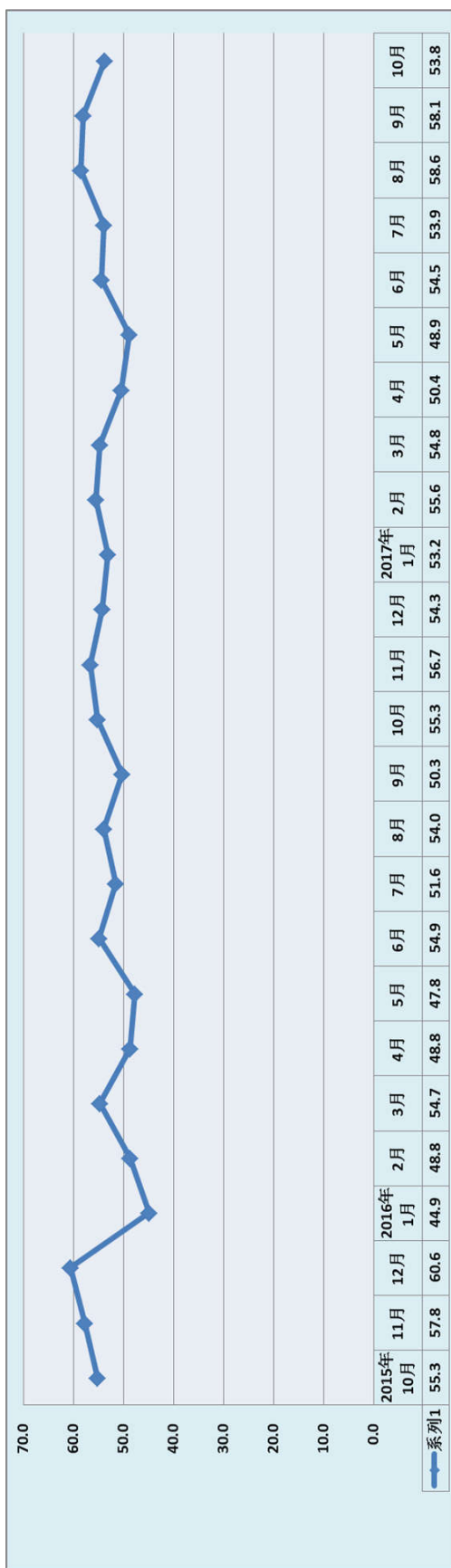
说明: 我公司自2008年7月3日起使用市场筹集基金收购被处置证券公司个人债权和弥补客户证券交易结算资金缺口。

## 六 中国证券市场投资者信心指数月度变化情况

	2017年9月	2017年10月	环比变化
投资者信心指数	58.1	53.8	-7.4%
国内经济基本面	64.8	61.1	-5.7%
国内经济政策	65.4	59.9	-8.4%
国际经济金融环境	57.3	52.8	-7.9%
股票估值	49.0	49.6	1.2%
大盘乐观	59.2	52.0	-12.2%
大盘反弹	52.4	50.9	-2.9%
大盘抗跌	64.4	61.1	-5.1%
买入指数	51.3	45.1	-12.1%

## 七 中国证券市场投资者信心指数图

2015年10月-2017年10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:**是指投保基金公司为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.统计截止日期:**2017年10月31日。

**说明:**因数据调整,系统维护改造,“证券及股票期权投资者的资金余额及变动情况”相关数据暂停发布。

**投保基金公司编印**

**统计截止日期:2017年10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：100033

电话：010-66580883

传真：010-66580616

网址：[www.sipf.com.cn](http://www.sipf.com.cn)