

附件

深圳证券交易所债券交易业务指南第4号
——债券交易及配套安排（2023年12月修订）

版本及修订说明

修改日期	版本及主要修订内容
2022/5/12	首次发布
2023/1/6	增加债券参与主体、选择结算方式、交易解除及合并申报等内容
2023/12/26	全面支持交易解除以及合并申报；增加交易对手方管理以及点击成交报价方设置全额成交等内容

二〇二三年十二月

目 录

第一章 债券参与主体	2
一、债券交易参与者.....	2
(一) 申请标准.....	2
(二) 申请流程.....	3
(三) 管理安排.....	4
(四) 进场流程.....	6
二、债券做市商.....	7
三、境外机构投资者.....	7
(一) 交易结算路径建立.....	8
(二) 信息报送.....	9
(三) 交易结算安排.....	10
第二章 交易前准备工作	11
一、投资者适当性报备.....	11
二、债券交易账户信息报备.....	12
三、电子接口系统开发或交易终端配置.....	12
(一) 电子接口系统开发.....	12
(二) 交易终端配置.....	12
四、交易对手方管理.....	15
(一) 业务范围.....	15
(二) 设置途径.....	15
(三) 设置方式.....	15
第三章 债券交易	16

一、债券现券交易.....	16
(一) 匹配成交.....	18
(二) 点击成交.....	19
(三) 询价成交.....	21
(四) 竞买成交.....	23
(五) 协商成交.....	28
(六) 交易解除.....	30
二、债券回购交易.....	31
(一) 通用回购质押券管理.....	33
(二) 通用回购交易申报.....	33
三、信用保护工具.....	35
第四章 交易信息.....	35
(一) 现券交易信息.....	35
(二) 回购交易信息.....	38
(三) 统计信息.....	39
第五章 交易价格偏离报备.....	39
(一) 报备情形.....	39
(二) 报备内容.....	39
(三) 报备方式.....	40
附件 1: 债券交易参与者申请模板.....	41
附件 2: 境外机构投资者信息报送表.....	43
附件 3: 债券交易价格偏离情况报备模板.....	46
附件 4: 业务专区及网站链接一览表.....	47

重要提示

一、本指南仅为办理本所债券、资产支持证券及其他具有固定收益特征产品交易及转让相关业务之用，主要涉及债券参与主体、交易前准备工作、债券交易、交易信息及交易价格偏离报备等内容。如本指南与法律法规以及有关业务规则发生冲突，应当以法律法规以及有关业务规则为准。

二、本指南中涉及要求投资者通过电子邮件形式提交相关文件的，应当根据本指南要求在邮件主题中注明办理事项，附件超过 10M 的需以超大附件或网盘链接发送。如未特别说明，相关文件均需加盖公章，以彩色扫描件方式制作成 PDF 文件。投资者应当保证所提交的文件真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并确保提交的电子文件与原件一致。

三、本所将根据业务需要不定期对本指南作出修订，并保留对本指南的最终解释权。

第一章 债券参与主体

一、债券交易参与人

根据《深圳证券交易所债券交易规则》（以下简称《债券交易规则》）以及《深圳证券交易所债券交易业务指引第1号——债券交易参与人管理》（以下简称《债券参与人指引》）规定，债券交易参与人可以通过设立或者租用债券专用交易单元等方式参与本所债券交易，未成为债券交易参与人的债券投资者可以作为经纪客户委托本所会员参与债券交易。

（一）申请标准

1. 新增债券交易参与人申请标准

根据《债券交易规则》以及《债券参与人指引》规定，本所会员直接成为债券交易参与人，符合以下条件的非会员机构可以申请成为债券交易参与人。

表1-非会员机构申请成为债券交易参与人需满足的条件

条件要求		具体规定
定性条件 《债券参与人指引》 第四条		1. 具备较强资本、资金实力与持续经营能力或者具有参与债券交易的相应功能
		2. 具有独立的交易团队
		3. 具有完善的交易业务管理制度和风险控制制度
		4. 具有能够支持开展债券交易的相关技术系统
		5. 债券投资交易量较大，具有较强的债券交易需求；即年度全市场债券交易量应当达到1,000亿元及以上
		6. 近2年无债券交易结算重大违法违规行为
定量条件	较强资本、资金实力 《债券参与人指引》第五条	银行：最近一个会计年度年末净资产不低于100亿元
		资产管理机构：公募资管资格、或者最近一个会计年度年末管理规模不低于500亿元
		其他机构：最近一个会计年度年末净资产不低于50亿元

本所可以根据市场发展情况调整非会员机构申请成为债券交易参与人的定量条件标准。

2. 存量机构衔接安排

为实现存量已进场机构身份平稳衔接，根据《关于债券交易参与者相关安排的通知》要求，《债券参与者指引》施行前已进场的银行机构、以及交易结算路径处于正常开通状态的存量其他交易参与者¹(期货公司除外)直接成为债券交易参与者，无需另行申请。存量机构直接成为债券交易参与人的，原有身份和进场方式不受影响，可以继续通过原有方式参与本所债券交易。

(二) 申请流程

符合条件的非会员机构申请成为债券交易参与人的，应当通过以下方式提交申请材料，并根据《深圳证券交易所进场业务指南》完成机构进场相关准备工作。

1. 提交预沟通材料

申请机构应当向本所公共邮箱（szsebond@szse.cn）提交《深圳证券交易所债券交易参与者申请书》（以下简称《申请书》，附件1）等材料，进行申请事项预沟通。邮件主题格式统一为“债券交易参与者申请预沟通+机构全称”，预沟通材料可以暂不用印。

2. 提交正式申请材料

经预沟通确认材料齐备后，申请机构应当登录本所会员业务专区（以下简称会员专区）（<https://biz.szse.cn/mbr/index.htm>

¹ 其他交易参与者是指根据《深圳证券交易所会员管理规则》有关规定通过本所相关业务规则规定的方式参与证券交易，接受本所自律管理的机构。

[ml](#))，通过“业务办理/非会员交易参与者资格注册”界面正式提交债券交易参与者申请材料，并根据专区申请界面要求上传《申请书》以及本所要求的其他文件。登录会员专区需使用会员专区数字证书（M类数字证书）。

申请机构符合上述规定条件的，本所自申请材料齐备之日起10个交易日以内接受其成为债券交易参与者，并签发债券交易参与者申请的复函。本所将在官网²披露债券交易参与人名单。

（三）管理安排

本所债券交易参与者应当遵守法律法规以及本所《债券交易规则》《债券参与者指引》《深圳证券交易所会员管理规则》（以下简称《会员管理规则》）等相关规定。

1. 债券专用交易单元管理

债券交易参与者可以设立或者租用债券专用交易单元参与本所债券交易。债券专用交易单元可以用于参与债券、资产支持证券以及其他具有固定收益特征产品的交易、转让以及转股、换股、回售等其他服务事项，以及参与以债券和资产支持证券作为投资标的的基金的认购、申购、赎回与交易，不得用于股票、存托凭证的买入。

2. 债券交易业务等联络人

债券交易参与者应当设置债券交易业务联络人，并向本所提交债券交易业务联络人任职情况以及联络方式等信息。直接成为本所债券交易参与者的会员以及非会员机构，其债券交易

² 官网固定收益信息平台（<http://bond.szse.cn>）“信息披露/交易参与信息/机构名单/债券交易参与者”栏目。

业务联络人默认为其会籍联络人。如需变更，可以登录会员专区“业务办理/会籍业务/会员资料变更”修改债券交易业务联络人信息。

债券交易业务联络人应当根据授权，履行《债券参与人指引》规定的联络职责。债券交易业务联络人发生无法履行职责或者履行职责时出现重大过错并产生严重后果等情形的，本所可以要求债券交易参与人更换联络人。

债券交易参与人应当同时根据《会员管理规则》有关规定，建立并维护技术联络人等联络人，协调与本所相关的交易以及相关系统的建设、改造以及测试工作。

3. 异常情形报告

债券交易参与人出现异常情形的，应当及时根据具体异常情形向本所负责业务、技术、机构管理人员电话报告，并就相关异常情形形成书面报告，通过会员专区“公文及报表上传/公文上传”界面提交。

表 2-异常情形报告联系人

异常情形类型	联系电话
业务异常（重大业务风险等）	0755-88666173
技术异常（交易系统等）	0755-82083510
机构管理(机构进入风险处置等)	0755-88668408

4. 债券交易参与人身份终止

不再符合本所债券交易参与人条件的、主动申请不再作为债券交易参与人的、超过 12 个月不参与本所债券交易且无合理理由的以及本所规定的其他情形下，本所可以终止其作为债

券交易参与者。

不再符合本所债券交易参与者条件的，相关机构应当及时提交书面报告至本所公共邮箱（szsebond@szse.cn）。确需终止或者主动申请终止债券交易参与者身份的机构，相关机构应当在明确无相关在途合约后，通过会员专区上传终止债券交易参与者身份的书面申请材料。

（四）进场流程

新申请成为债券交易参与者的机构，需完成交易结算路径联通、专线铺设、通过电子接口或者交易终端参与交易的技术准备工作等。存量机构直接成为债券交易参与者的，原有身份和交易结算路径不受影响，可以继续通过原有方式参与本所债券交易，也可以作为债券交易参与者向本所申请设立或者租用债券专用交易单元。

1. 交易结算路径联通

新申请成为债券交易参与者的机构应当根据《深圳证券交易所进场业务指南》等³相关要求完成交易单元开设或租用，交易单元与托管单元、结算账户之间的联通等相关工作。

交易路径方面，债券交易参与者可以通过会员专区“业务办理/交易单元业务/自用交易单元开通”办理交易单元开立，或者通过会员专区“业务办理/业务办理查询”向已签署租用协议的会员机构租借交易单元。

结算路径方面，中国证券登记结算有限公司（以下简称中国结算）深圳分公司根据交易单元开设、租用流程中债券交易

³ 《中国证券登记结算有限责任公司结算参与者管理工作指引》《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券资金结算业务指南》等结算相关要求。

参与人以及托管人提供的相关信息，确定该交易单元的交收责任，并维护相应的结算路径，即交易单元与托管单元、结算账户之间的对应关系。

2. 专线铺设

新申请成为债券交易参与人的机构中未铺设专线的，应当向深圳证券通信有限公司（以下简称深证通）申请进行专线铺设。

3. 电子接口或者交易终端接入

债券交易参与人可以通过电子接口或者交易终端等向本所交易主机发送债券交易申报指令。

通过电子接口参与交易的，应当向本所以及深证通申请开通网关、获取网关数字证书等，并完成交易系统搭建；通过交易终端参与交易的，应当向本所以及深证通申请交易终端一级管理员以及交易终端数字证书，并根据《深圳证券交易所交易终端用户手册》（以下简称《用户手册》）完成交易终端配置。《用户手册》可以通过交易终端“帮助”栏目进行查询。

二、债券做市商

根据《债券交易规则》以及《深圳证券交易所债券交易业务指引第3号—债券做市》规定，符合条件的债券交易参与人可以申请成为债券做市商，在本所债券市场为债券提供流动性、开展债券做市业务。做市业务具体安排详见《深圳证券交易所债券交易业务指南第7号—债券做市》。

三、境外机构投资者

根据《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司

境外机构投资者债券交易及登记结算业务实施细则》（以下简称《实施细则》）第二条、第十三条规定，已获准进入银行间债券市场的境外机构投资者可以持中国人民银行或者中国人民银行上海总部出具的有关备案证明文件等材料申请开立证券账户后参与本所债券市场，具体安排如下：

（一）交易结算路径建立

1. 委托以及协议签署

境外机构投资者可以作为经纪客户委托具有本所会员资格的境内证券公司参与债券交易、委托具备合格境外机构投资者托管行资质的境内商业银行作为托管人、委托具有中国结算结算参与人资格的境内证券公司办理结算业务。

具备本所会员资格的境内证券公司名单详见本所官网⁴，具备合格境外机构投资者托管行资质的境内商业银行详见中国证监会官网披露的合格境外机构投资者托管行名录，具备中国结算结算参与人资格的境内证券公司名单详见中国结算官网⁵。

2. 账户开立

境外机构投资者应当持获准进入中国银行间债券市场的备案表向中国结算申请开立深市证券账户。境外机构投资者尚未获准进入银行间债券市场的，应当根据自身机构性质向中国人民银行或其上海总部申请备案。境外机构投资者申请开立直接投资证券账户的具体申请安排详见《中国证券登记结算有限责任公司特殊机构及产品证券账户业务指南》。

⁴ 官网（<http://www.szse.cn>）“关于本所/本所会员”栏目。

⁵ 中国结算官网（<http://www.chinaclear.cn>）“服务支持/机构资料查询/结算参与人”栏目。

（二）信息报送

根据《实施细则》规定，境外机构投资者应当向本所进行基本信息、重点情形报送。

1. 基本信息报送

境外机构投资者应当与境内托管人签署信息报送相关委托书。托管人应当向本所报送境外机构投资者基本信息、托管人基本信息以及交易参与者基本信息，报送材料均应加盖机构公章或由主要负责人签字：

（1）境外机构投资者信息报送表（附件2）；

（2）中国人民银行或中国人民银行上海总部向境外机构投资者出具的备案证明文件复印件；

（3）境外机构投资者委托托管人进行信息报送的委托书复印件。委托书为外文的，需提供中文翻译件；

（4）境外机构投资者的证券账户卡复印件；

（5）托管人营业执照复印件；

（6）本所要求的其他材料。

2. 重点情形报送

境外机构投资者存在下列情形之一的，其托管人应当在该事实发生之日或者客户通知之日起5个交易日内将有关情况报送本所：

（1）指定或者变更托管人；

（2）开立、注销证券账户，指定或者变更交易参与者、结算参与者；

（3）变更机构名称、注册地、业务联系人等基本信息；

- (4) 解散、宣告破产或者被其他机构合并；
- (5) 涉及境内外重大诉讼或者其他重大事件；
- (6) 受到自律监管措施或者纪律处分；
- (7) 受到中国证监会、中国人民银行或者国家外汇管理局等境内行政监管机构处罚或者在境外受到重大处罚；
- (8) 中国证监会、中国人民银行或者国家外汇管理局等行政监管机构以及本所、中国结算规定的其他情形。

3. 信息报送渠道

托管人可以通过（szsebond@szse.cn）向本所报送上述材料的扫描件，邮件标题注明“境外机构投资者信息报送”。

（三）交易结算安排

1. 可投资范围

根据《实施细则》规定，境外机构投资者可以作为专业投资者中的机构投资者参与以下品种的发行认购、交易或者转让：

- (1) 债券（含可转换公司债券和可交换公司债券）；
- (2) 资产支持证券；
- (3) 以债券和资产支持证券作为投资标的的基金；
- (4) 以风险管理为目的的相关衍生产品；
- (5) 债券借贷；
- (6) 中国证监会、中国人民银行或者本所认可的其他具有固定收益特征的产品或者相关衍生产品。

2. 债券双向划转安排

境外机构投资者可以根据投资管理需要，按照中国结算相

关业务规则办理其证券账户与其合格境外投资者项下证券账户之间债券等品种的双向划转，具体安排详见《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司债券登记结算业务指南》。

3. 债券转股换股要求

境外机构投资者持有的可转换公司债券或者可交换公司债券如需转股或者换股的，应当提前将相关债券划转至其合格境外机构投资者或者人民币合格境外机构投资者证券账户后，再进行转股或者换股申报。债券划转事项应当遵守法律法规和本所相关业务规则等关于权益变动以及境外机构投资者持股比例等相关规定，并按规定履行信息披露义务。

第二章 交易前准备工作

一、投资者适当性报备

本所债券交易实施投资者适当性管理制度，投资者参与债券交易应当符合《深圳证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》相关要求。

投资者参与本所债券交易前，应当进行投资者适当性报备。本所债券交易参与者无需另行报备，投资者作为证券公司客户参与债券交易的，应当由所在证券公司及时通过本所固定收益品种业务专区（<https://biz.szse.cn/fic>）提交专业投资者名单，需使用本所固定收益品种业务专区数字证书（B类数字证书）。

二、债券交易账户信息报备

债券投资者参与非匹配成交交易的，应当至少在开展相关交易前一个交易日17:00前通过固定收益品种业务专区完成相应债券交易账户信息报备工作，报备信息于次一交易日生效。报备要求详见《深圳证券交易所债券交易业务指南第1号——账户信息报备》。拟仅采用匹配成交方式的，不强制要求报备账户信息。前期已报备生效的账户信息无需重复报备。

自营类及资管类交易主体应当自行报备，经纪类交易主体由所在证券公司统一报备。账户信息报备通过本所固定收益品种业务专区（<https://biz.szse.cn/fic>）进行，需使用会员专区数字证书（M类数字证书）。

三、电子接口系统开发或交易终端配置

（一）电子接口系统开发

使用自建系统或第三方交易系统、通过电子接口接入本所交易系统的债券交易参与者，应当确保相关系统的性能、容量及扩展能力应当与其业务发展以及市场需求相适应，及时做好立项及系统改造工作，保障交易相关系统的持续稳定运行。使用第三方开发商开发系统的债券交易参与者，应当与第三方开发商建立好技术沟通机制，确保相关系统有效稳定。

（二）交易终端配置

交易终端是本所提供的用于交易指令申报的网页报盘系统。本所交易终端分为股基专区和固收专区，交易终端固收专区集成债券现券交易、回购交易等交易功能以及其他债券非交易功能。

通过交易终端参与交易的债券交易参与者，应当在交易前完成专线铺设、交易终端一级管理员申请以及数字证书申请、账户信息设置、交易终端权限配置等工作。

1. 交易终端一级管理员申请以及数字证书申请

通过本所会员专区“业务办理/交易终端一级管理员/用户新增”在线填写申请表，开通交易终端使用权限以及申请交易终端数字证书。本所将为债券交易参与者设立一个一级管理员用户并开通相应的业务权限，并邮寄一级管理员数字证书。债券交易参与者可以按需申请二级管理员以及交易员硬件数字证书。

2. 交易终端登录

债券交易参与者完成权限以及硬件证书申请配置后，可以登录交易终端网站⁶（<https://172.27.0.163:7022/szsett-web/login.html>），登录时应当根据页面要求使用指定浏览器及版本。

3. 交易账户信息设置

债券交易参与者使用交易终端固收专区开展债券相关业务前，应当按《用户手册》要求提前做好交易终端固收专区的权限设置，需使用已报备生效的债券交易账户信息，权限设置实时生效。

4. 交易终端权限设置

交易终端提供管理功能，包含固收用户组管理、固收交易员管理。交易终端各类用户支持的功能如下图所示：

⁶ 亦可使用备用链接登录（<https://172.27.128.163:7022/szsett-web/login.html>），详见交易终端硬件数字证书随附《交易终端用户须知》。



图 1-交易终端各类用户支持的功能

一级管理员可以创建二级管理员用户，为其分配其可使用的交易单元、业务类型、交易主体（及对应证券账户）以及其所管理的交易员（已报备账户信息中的交易员）等。一级管理员可通过交易终端固收专区“管理/固收用户组管理”新增或编辑用户组，为二级管理员批量设置相关权限。

二级管理员可以为自己管理的交易员绑定交易终端账号，并为其分配可使用的交易单元、业务类型、交易主体（及对应证券账户）等。二级管理员可以为交易用户创建用户组，批量分配权限。

交易员可以通过交易终端固收专区“设置/交易设置”菜单，根据个人偏好进行个性化交易设置。此外，交易员可以自定义交易终端的显示、参数和默认交易主体、证券账户等。

四、交易对手方管理

（一）业务范围

债券交易参与人可以设置债券交易对手范围，对于采用逐笔全额结算方式的债券现券交易、债券质押式协议回购初始交易及到期续做、债券借贷初始交易及到期续做，交易一方不在交易对手范围内的交易申报，交易系统不予确认。

（二）设置途径

债券交易对手范围可以通过本所固定收益品种业务专区（<https://biz.szse.cn/fic>）下“交易商报备-交易对手方管理”栏目进行设置，需使用会员专区数字证书（M类数字证书）登录。交易日 17:00 前完成设置的，次一交易日生效。固收专区交易对手方管理栏目图示如下：

交易商报备 / 交易对手方管理

对手方交易商名称: 查询 重置

查看历史 导出

<input checked="" type="checkbox"/>	对手方黑名单 (适用于本方为自营类交易主体)	最近经办人:	编辑
<input checked="" type="checkbox"/>	对手方黑名单 (适用于本方为资管类交易主体)	最近经办人:	编辑
<input checked="" type="checkbox"/>	对手方黑名单 (适用于本方为机构经纪类交易主体)	最近经办人:	编辑
<input checked="" type="checkbox"/>	对手方黑名单 (适用于本方为个人经纪类交易主体)	最近经办人:	编辑

图 2-固收专区交易对手方管理栏目

（三）设置方式

债券交易参与人可以对其自营类（如有）、资管类（如有）、机构经纪类（如有）、个人经纪类（如有）交易主体类型分别设置相应的债券交易对手范围。在前述业务范围内的债券交易，交易系统根据交易申报的具体交易主体类型，适用对应设置的交易对手范围进行控制。

债券交易对手范围支持通过设置黑名单的方式进行管理，可管理的对象为除本交易商以外的其他债券交易参与人。对于黑名单中交易对手的交易申报，交易系统不予确认成交。债券交易参与人可以将交易对手的一种、多种或者全部交易主体类型添加入黑名单。交易对手方管理设置页面如图 3 示：

编辑对手方黑名单

经办人信息

*经办人: *电话区号: *电话号码:
 *手机号码: *传真号码: *电子邮箱:

交易对手方管理

本方交易主体类型: 交易对手方: 不设置 设置黑名单

交易对手方黑名单 + 新增

序号	对手方交易商名称	黑名单层级	操作
1	<input type="text"/> <input type="button" value="□"/>	<input type="radio"/> 交易商 <input type="radio"/> 交易主体类型	<input type="button" value="删除"/>

图 3-交易对手方管理设置页面

第三章 债券交易

本章主要介绍债券现券、债券回购以及信用保护工具相关交易安排。

一、债券现券交易

在本所开展的债券现券交易可以采用匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交以及本所认可的其他交易方式。

表3-现券交易方式安排概览

	匹配成交	点击成交	询价成交	协商成交	竞买成交
特点	按价格优先、时间优先的原则自动匹配成交	报价方发出报价，受价方点击成交	询价方发送询价请求，并选择一个或者多个询价回复确认成交	买卖双方协商达成交易意向	卖方在限定时间按竞买成交规则将债券出售给最优应价的单个或者多个应价方
交易时间	开盘集合匹配 09:15-09:25 连续匹配 09:30-11:30 13:00-15:30		09:00-11:30 13:00-15:30		竞买预约申报 9:00-11:30 13:00-15:30 竞买发起申报 09:00 - 10:00 应价申报 10:00-11:30
交易品种 ^⑥	公开发行债券	公开发行债券、非公开发行债券以及资产支持证券			
结算方式 ^④	多边净额结算（担保）	公开发行债券：多边净额结算或者逐笔全额结算 非公开发行债券以及资产支持证券：逐笔全额结算（非担保）			
现券申报数量	10万元面额或者其整数倍，卖出余额不足10万元面额的应一次性申报卖出	10万元面额或者其整数倍	不低于10万元面额，且为1,000元面额整数倍	不低于1,000元面额，且为100元面额整数倍	不低于10万元面额，且为1,000元面额整数倍
显名/匿名申报	匿名	可选显名/匿名	可选显名/匿名	显名	可选显名/匿名
发送范围	全市场	可选，目前仅支持全市场	选定询价方	指定对手方	全市场
交易对手范围	不支持设置	采用逐笔全额结算方式的，债券交易参与人可以设置债券交易对手范围			
停牌情形处理	全天停牌：不接受交易申报； 临时停牌：可以申报或撤销申报	全天停牌：不接受交易申报； 临时停牌：不接受交易申报，但接受符合条要求的撤销申报			全天停牌：仅可进行竞买预约以及撤销； 临时停牌：若竞买时间内停牌则取消本场竞买；可以进行竞买预约以及撤销
价格最小变动单位	0.001元	0.0001元			

有效申报价格范围	<p>开盘集合匹配： 前收盘价上下30%；</p> <p>连续匹配、复牌集合匹配：利率债为匹配成交最近成交价上下10%，其他债券为匹配成交最近成交价上下20%</p>	不设置有效申报价格范围，超过估值一定幅度的需进行交易价格偏离报备，具体安排详见本指南第五章相关规定	
交易解除	不支持	采用点击成交、询价成交、协商成交方式并以逐笔全额结算方式结算，符合《债券交易规则》第3.4.3条第二款规定的，可以解除相关交易	不支持
计价方式	除次级资产支持证券以及特定债券外，债券现券交易均采用净价价格进行申报		
单笔最大申报数量	不超过100亿元面额		

注：①“面额”均指发行面额。

②特定债券交易特殊安排详见《深圳证券交易所中国证券登记结算有限责任公司关于完善为上市期间特定债券提供转让服务有关事项的通知》等特定债券相关业务通知。

③《深圳证券交易所公司债券上市规则（2022年修订）》施行前（即2022年4月22日之前）已上市并仅采用大宗交易方式的公开发行公司债券，可以采用点击成交、询价成交、竞买成交以及协商成交交易方式；非公开发行债券以及资产支持证券的现券交易可采用点击成交、询价成交、竞买成交以及协商成交交易方式。

④不支持匹配成交的公开发行债券（即交易方式仅支持点击成交、询价成交、竞买成交以及协商成交交易方式的公开发行债券），仅支持逐笔全额结算方式。

⑤投资者可以通过本所官网固定收益信息平台(<http://bond.szse.cn>)“信息披露/产品基本信息”栏目下的“交易方式”以及“是否可担保”列查询相关债券支持的交易方式以及结算方式。

（一）匹配成交

匹配成交是指交易系统按价格优先、时间优先的原则和《债券交易规则》相关规定，对债券交易申报自动匹配成交的交易方式。匹配成交方式可以采用限价申报或者本所认可的其他申报类型，不可以采用市价申报。限价申报按照优于或者等于限定的价格进行交易。

1. 申报要素以及信息

匹配成交申报要素以及信息包括证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向、数量、价格等。其中：“申报价格”单位为每百元面额债券的价格，最小变动单位为0.001元，且必须满足有效申报价格范围的要求，超过有效申报价格范围的申报为无效申报，交易系统将对这类申报拒单。

2. 有效申报价格范围调整安排

债券在集合匹配阶段没有达成成交的，继续交易时，按照下列方式调整有效申报价格范围：最高买入申报价高于即时行情显示的前收盘价或者匹配成交最近成交价，以最高买入申报价为基准调整有效申报价格范围；最低卖出申报价低于即时行情显示的前收盘价或者匹配成交最近成交价，以最低卖出申报价为基准调整有效申报价格范围。

3. 申报有效期

当日提交的匹配成交申报当日有效。匹配成交申报不能一次全部成交时，未成交的部分当日继续有效。

4. 申报撤销

每个交易日9:20至9:25的开盘集合匹配阶段，该段时间内，本所交易系统不接受匹配成交的撤销申报。除此之外，其他接受申报的时间内，未成交的申报可以撤销；部分成交的，未成交的部分可以撤销。

（二）点击成交

点击成交是指报价方发出报价，受价方点击该报价后由交易系统确认成交的交易方式。

1. 报价申报要素以及信息（报价方）

报价方发出报价的申报要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向、数量、价格、全额成交、是否匿名和结算方式等内容。其中：

“交易商、交易主体类型、交易主体、交易员”为投资者已报备账户信息相关内容，定义详见《深圳证券交易所债券交易业务指南第1号——账户信息报备》；

“全额成交”包括“是”和“否”两个选项。选项为“是”的，相关报价仅在全部申报数量经受价方一次性点击接受的情形下方可确认成交，不接受部分成交。选项为“否”的，接受部分成交。

“是否匿名”即可选择匿名申报或者显名申报，选择显名申报的，将展示本方交易商以及本方交易主体类型等信息；无论选择匿名或显名，成交后将向成交双方展示对手方身份信息；

“结算方式”即可指定采用“多边净额结算”或者“逐笔全额结算”，支持匹配成交的公开发行债券采用点击成交、询价成交、竞买成交以及协商成交方式进行现券交易申报时可以选填。

2. 点击申报要素以及信息（受价方）

受价方按照报价方报出交易方向的相反方向，输入拟接受的申报数量，申报要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪

类交易主体时必须填写)、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、交易方向、数量和结算方式等内容。其中,“申报数量”应当不超过报价方报价申报的数量。

3. 申报有效期

报价方当日提交的报价当日有效,报价不能一次性全部成交时,未成交的部分当日继续有效。

4. 申报撤销安排

交易时间内,报价方未成交的点击报价申报可以撤销,报价申报部分成交的,未成交的部分可以撤销。

5. 成交原则

点击成交按受价方输入的数量,按报价方所报价格等其他申报要素以及信息成交。

(三) 询价成交

询价成交是指债券投资者作为询价方向做市商或者其他债券交易参与者发送询价请求,并选择一个或者多个询价回复确认成交的交易方式。

1. 询价请求申报要素以及信息(询价方)

询价方可以向做市商或者其他债券交易参与者发送询价请求。询价请求申报要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称(本方为机构经纪类交易主体时必须填写)、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向、数量、发送范围、是否匿名和结算方式等内容。其中:“发送范围”即询价方询价请求的发送对象,以“对手方交易商+对手方交易主体

类型”为 1 个发送对象，至多可以选择 20 个不同的发送对象，不支持向全市场发布询价，询价请求仅可以指定到交易主体类型层级，不支持指定到具体的交易主体。

2. 询价回复申报要素以及信息（被询价方）

被询价方根据询价请求要素以及信息，按照询价请求交易方向的相反方向，对询价请求进行回复。询价回复的要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、价格、数量和结算方式等内容。其中：“申报数量”应当不超过询价方询价请求申报数量，若被询价方的询价回复数量超过询价请求申报数量，交易系统将会撤单。

3. 询价回复确认申报要素以及信息（询价方）

询价方询价回复确认申报要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码以及指定询价回复组，其中，“指定询价回复组”包含询价回复编号、对应的数量、价格和结算方式等内容。

询价方选定的询价回复组中的债券总数量可以超过询价请求申报数量。询价方在同一笔询价请求中对多笔询价回复进行确认，还应当指定具体询价回复的成交顺序。

4. 申报有效期

当日提交的询价请求申报在 2 个小时内有效，跨越午间休

市时间的，申报有效期顺延，申报有效期最晚不超过 15:30。询价请求申报有效期满自动撤销，针对该询价的回复也随之自动撤销。若债券盘中临时停牌，询价申报有效期不顺延。

5. 申报撤销安排

询价请求申报有效期内，询价请求未成交的，询价方可以撤销其询价请求，对应的询价回复也自动撤销；被询价方也可以撤销其询价回复。询价请求选择部分对手询价回复成交的，未成交的询价回复自动撤销。

6. 特殊安排

在任意时点，同一交易商同一交易主体的同一个证券账户对同一证券在相同的交易方向上只能发起一笔有效的询价请求申报。同一交易商同一交易主体的同一个证券账户对同一个询价请求申报只能发起一笔有效的询价回复。

7. 成交原则

询价方选择询价回复并确认后，交易按询价方确认的数量、价格等要素成交。在询价方账户债券足额情况下，询价方选定询价回复以及后续实际成交债券数量可以超过询价请求申报数量。

（四）竞买成交

竞买成交是指卖方在限定的时间内按照确定的竞买成交规则，将债券出售给最优应价的单个或者多个应价方的交易方式。竞买方式包括单一主体中标、多主体单一价格中标、多主体多重价格中标。

1. 竞买预约申报（卖方）

（1）申报安排

对于采用竞买成交方式的，至多提前5个交易日进行预约，确定竞买日；竞买日当天不可以预约。对于每一笔竞买预约申报，交易系统将生成唯一的竞买场次编号。

竞买预约的信息通过本所交易系统或官网⁷披露。

（2）预约要素以及信息

竞买预约要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方交易员、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向（限定为卖出）、竞买方式、数量、价格区间上限（如有）、价格区间下限、最低成交总量（如有）、是否匿名、竞买时间（即竞买日）和结算方式等内容。其中：

“竞买方式”可选“单一主体中标”、“多主体单一价格中标”与“多主体多重价格中标”三种方式；

“价格区间下限”应当大于0，且不高于价格区间上限（如有）；

“价格区间上限（如有）”应当不低于价格区间下限；

“最低成交总量（如有）”仅在竞买成交方式为“多主体单一价格中标”或者“多主体多重价格中标”时必须填写，最低成交数量应当不高于申报数量；

“竞买时间”应为当前交易日的后5个交易日之一，同一证券账户针对同一证券在同一竞买日仅允许存在一笔有效竞

⁷ 官网固定收益信息平台（<http://bond.szse.cn>）“信息披露/交易参与信息/竞买预约”栏目。

买预约申报。

（3）申报撤销

在指定的竞买日前（不含竞买日），卖方可以撤销竞买预约申报，同笔竞买预约以及其对应的撤销申报必须通过同一个交易单元提交。

若债券摘牌，则该债券所有存量竞买预约均自动撤销。若出现债券实际面额调整、计价方式调整或派息等情形，对应竞买的价格区间上下限不做调整。

投资者如需更改竞买预约要素的，可以至少在竞买日前一交易日撤销原预约后重新发起竞买预约，重新确定相关预约要素。

2. 竞买发起申报（卖方）

（1）申报要素以及信息

竞买发起申报要素以及信息包括竞买场次编号、本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方交易员、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向、竞买方式、数量、价格区间上限（如有）、价格区间下限、最低成交总量（如有）、是否匿名和结算方式等内容。相关申报要素以及信息应当与竞买预约申报中对应部分相同。

（2）申报撤销

在应价方提交有效的应价申报前，确有需要的，卖方可以撤销竞买发起申报。卖方在撤销竞买发起申报前，应当通过公共邮箱（szsebond@szse.cn）提交撤销申请，邮件应当说明拟

撤销的竞买发起申报对应的竞买场次编号、证券代码、证券简称以及撤销理由，卖方不得无故撤销竞买发起申报。邮件主题格式统一为“竞买申报撤销申请+证券代码”。

应价申报结束后，未达成成交的竞买发起申报、以及竞买发起申报的未成交部分自动撤销。

3. 应价申报（应价方）

（1）申报要素以及信息

应价申报要素以及信息包括竞买场次编号、本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方交易员、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向（限定为买入）、竞买方式、数量、价格、是否匿名和结算方式等内容。其中：

“数量”要求方面，采用“单一主体中标”的，应价申报数量为对应竞买发起申报的申报数量；采用“多主体单一价格中标”或者“多主体多重价格中标”的，应价申报数量应当不高于对应竞买发起申报中的申报数量；

“价格”应当处于竞买发起申报的价格区间上下限范围之内。

（2）申报撤销

采用“单一主体中标”的，应价申报不可以主动撤销，低于或等于当前最优应价的应价申报将自动撤销。

采用“多主体单一价格中标”或者“多主体多重价格中标”的，应价申报可以在应价申报时间截止前撤销。

应价申报结束后，未达成成交的应价申报、以及应价申报的未成交部分将自动撤销。

4. 成交原则

采用“单一主体中标”的，由最优出价的应价方按该笔竞买的全部数量成交。

采用“多主体单一价格中标”或者“多主体多重价格中标”的，交易系统将各有效应价申报按价格从高到低排序，并汇总应价申报累计数量，分以下三种情形处理：

(1) 应价申报累计数量小于最低成交数量的，所有应价申报均不能达成成交；

(2) 应价申报累计数量大于或等于最低成交数量、但小于竞买数量的，最低有效应价申报价格为边际价格，全部应价申报均按其申报数量达成成交；

(3) 应价申报累计数量大于或等于竞买数量的，以应价申报累计数量达到竞买总量的价格为边际价格。价格优于边际价格的应价申报全部成交，成交数量为相应的应价申报数量；价格等于边际价格的应价申报部分或者全部成交，成交数量以各应价申报数量为权重按舍去法（向下取整为 10 万元整数倍）进行边际中标量的初次分配，若有剩余尾量，遵循时间优先原则顺序进行尾量分配。

5. 应价申报转发安排

采用“多主体单一价格中标”或者“多主体多重价格中标”的，在应价申报阶段结束后，交易系统将该场竞买当天达成与未达成成交的所有有效应价申报委托（已撤销的除外）转发给

该场竞买的卖方。

（五）协商成交

协商成交是指债券投资者之间通过协商等方式达成债券交易意向，并向交易系统申报，经交易系统确认成交的交易方式。交易任意一方可将协商一致的交易要素通过交易系统发送给交易对手方，经交易对手方确认后，由交易系统确认成交。

1. 申报要素以及信息

协商成交申报要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、证券代码、交易方向、数量、价格、对手方交易商、对手方交易主体类型、对手方交易主体、对手方交易员、约定号、备注和结算方式等内容。

交易一方进行申报时，若对手方为经纪类（含机构经纪和个人经纪）交易主体，则申报时必须填写“约定号”，此外还可以通过在“备注”要素中填写对手方名称等信息，供对手方证券公司对其客户进行定位；若对手方为非经纪客户，则申报时无需填写“约定号”。“约定号”为8位UTF-8字符，交易系统不对约定号重复性进行检查。

2. 申报有效期

当日提交的协商成交申报当日有效。

3. 申报撤销安排

在对手方确认前，协商成交申报可以撤销。

4. 成交原则

协商成交按双方协商一致的价格、数量等要素进行成交。

5. 合并申报

做市商或者本所认可的其他机构与不同对手方针对同一交易品种达成两笔数量相同但交易方向相反的交易意向的，可以将两笔交易合并向交易系统申报。合并申报经前述两笔交易的买卖对手方分别确认后，由交易系统确认成交。

(1) 合并申报要素以及信息（发起方）

合并申报发起方的申报要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、买方交易商、买方交易主体类型、买方交易主体、买方交易员、买方价格、买方数量、卖方交易商、卖方交易主体类型、卖方交易主体、卖方交易员、卖方价格、卖方数量、证券代码、买方约定号、卖方约定号、买方备注、卖方备注和结算方式等内容。其中，“买方数量”应当等于“卖方数量”。

(2) 合并申报确认要素以及信息（确认方）

合并申报确认方（即买方或者卖方）的确认要素以及信息包括本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方经纪客户名称（本方为机构经纪类交易主体时必须填写）、本方交易员、本方证券账户号码、发起方交易商、发起方交易主体类型、发起方交易主体、发起方交易员、证券代码、数量、价格、约定号和结算方式等内容。

(3) 申报有效期

当日提交的合并申报当日有效。

（4）申报撤销安排

交易时间内，买卖对手方未全部确认前，发起方可以主动撤销申报。

（5）成交原则

经合并申报买卖对手方分别确认后，由交易系统确认成交。通过合并申报达成的成交视为发起方与买方以及发起方与卖方分别达成的两笔独立的成交，两笔交易成交的先后顺序与合并申报买卖对手方最终确认的顺序保持一致。

（六）交易解除

采用点击成交、询价成交、协商成交方式并以逐笔全额结算方式结算，出现因不可抗力、预期违约、延迟履行等情形导致交易目的无法实现或者交易不能继续履行的，在交收开始前，经交易双方协商一致后，可以解除相关交易。

证券公司通过交易系统申报交易解除的，视为已取得客户委托，本所不对委托的真实性、有效性进行审查。

1. 申报要素以及信息

交易解除申报要素以及信息包括拟解除交易的成交编号、本方交易商、本方交易主体类型、本方交易主体、本方交易员、本方证券账户号码、本方申报交易单元代码、对方交易商、对方交易主体类型、对方交易主体、对方交易员、证券代码、交易方向、成交数量、成交价格、结算方式、约定号、交易解除原因等内容。其中，交易解除原因由发起方在解除申报时填写，由交易系统转发至对手方确认。解除原因应当明确解除事由发

生方以及交易解除理由。拟解除交易发起方的本方交易主体类型为“机构经纪”的，交易系统将该发起方的“本方经纪客户名称”同步转发至对手方确认。

2. 申报撤销安排

交易时间内，对手方未确认交易解除申报的，发起方可以撤销交易解除申报。

3. 交易解除状态

交易双方通过交易系统提交解除申报并确认后，中国结算根据拟解除交易的交收状态进行处理。最终的交易解除状态可以通过中国结算深圳分公司综合结算通信系统（D-COM 系统）查看。

4. 其他安排

临时停牌期间，本所接受交易解除申报以及交易解除撤销申报。

采用协商成交合并申报成交的，不支持交易解除。

二、债券回购交易

在本所开展的债券回购交易⁸包括债券通用质押式回购（以下简称通用回购）、债券质押式协议回购（以下简称协议回购）和债券质押式三方回购（以下简称三方回购）等。

⁸ 详情可以参见《深圳证券交易所债券交易业务指引第2号—债券通用质押式回购》《深圳证券交易所债券质押式协议回购交易业务办法》和《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司债券质押式三方回购交易以及结算暂行办法》《深圳证券交易所债券交易业务指南第2号——债券质押式协议回购》《深圳证券交易所债券质押式三方回购交易业务指南》等。

表 4-债券回购交易安排概览

	通用回购	协议回购	三方回购
特点	以相应折算率计算出的质押券价值为融资额度进行质押融资	按双方约定的债券出质给资金融出方以融入资金	基于协议回购模式的基础上，由本所以及中国结算提供担保品管理服务，质押券基于质押券篮子确定
交易方式	匹配成交	资金融入方发起申报，除到期购回申报外均需资金融出方确认后成交	资金融入方发起申报，除到期购回申报、补券申报以及质押券篮子出入库外，均需资金融出方确认后成交
交易时间	开盘集合匹配 09:15-09:25 连续匹配 09:30-11:30；13:00-15:30 质押及解除质押申报 09:15-11:30；13:00-15:30	每个交易日 09:15-11:30 13:00-15:30	每个交易日 09:15-11:30 13:00-15:30
质押券种类	通过交易系统或官网 ⁹ 转发中国结算公布的质押券品种以及折算率	各类债券、符合条件的资产支持证券、公募 REITs（限售期内的定向可转换公司债券除外）	各类债券、资产支持证券（次级除外）以及本所认可的其他债券品种（可转换公司债券暂不纳入）；质押券分不同的质押券篮子，同一篮子内的质押券折扣率相同
回购规模	折算后质押券价值对应的融资额度内	不得超过质押券实际金额，基础设施基金作为质押券的，不得超过基础设施基金质押份数与基础设施基金前收盘价或者面值（取较大值）的乘积	不超过担保品价值
结算方式	多边净额结算（担保）	逐笔全额结算（非担保）	
回购期限	1 天、2 天、3 天、4 天、7 天、14 天、28 天、91 天、182 天	不超过 365 天，且不得超过质押券的存续期间，其中续做购回期限从续做日起计算	不超过 365 天，且不得超过质押券的存续期间，其中续做新旧合约期限总和不得超过 365 天
投资者适当性要求	资金融入方应当为专业机构投资者	回购双方均应当为专业机构投资者	资金融入方须为具有三方回购正回购业务资格的金融机构及其理财产品、社保基金、养老基金、QFII、RQFII 等机构投资者，资金融出方须为专业机构投资者

⁹ 官网固定收益信息平台（<http://bond.szse.cn>）“信息披露/交易参与信息/回购质押券及折算率”栏目。

（一）通用回购质押券管理

1. 质押、解除质押申报

资金融入方在进行通用回购交易申报前，应当通过本所提交质押券的质押申报。质押券对应的融资额度有剩余的，资金融入方可以通过本所申报解除相应质押券的质押。质押、解除质押申报要素以及信息包括证券代码、数量、证券账户号码、本方申报交易单元代码等内容。申报数量应当为 100 元面额或者其整数倍。

2. 受信用保护债券入库安排

符合《中国证券登记有限责任公司受信用保护债券质押式回购管理暂行办法》等相关规定的合格受信用保护债券，允许投资者将相关债券及对应的为其提供信用风险保护的合格信用保护凭证一并提交入质押库开展融资回购交易。

（二）通用回购交易申报

目前通用回购交易可采用匹配成交方式达成交易，仅支持限价申报委托。申报要素以及信息包括证券代码、交易方向、价格、数量、证券账户号码、本方申报交易单元代码等内容。其中：

“通用回购的证券代码”为“1318**”，证券简称为“R-***”，证券简称后三位是以天数表示的通用回购期限，详见下表。通用回购交易的期限按自然日计算，到期日为非交易日的，顺延至下一个交易日；

表 5-通用回购证券代码以及简称

通用回购期限	证券简称	证券代码
1 天	R-001	131810
2 天	R-002	131811
3 天	R-003	131800
4 天	R-004	131809
7 天	R-007	131801
14 天	R-014	131802
28 天	R-028	131003
91 天	R-091	131805
182 天	R-182	131806

“交易方向”可填写买入或者卖出，资金融入方申报的交易方向为买入，资金融出方申报的交易方向为卖出；

“数量”可填写 1,000 元面额或者其整数倍，单笔最大申报数量不得超过 100 亿元面额。正回购方可以在其质押券对应的融资额度内进行融资回购交易申报，质押券余额不足的，通用回购融资交易的申报无效；

“价格”单位为“每百元资金到期年收益”，采用匹配成交申报价格最小变动单位为 0.005 元（即年化收益率 0.005%），且必须满足有效申报价格范围的要求。开盘集合匹配阶段，通用回购的有效申报价格范围为前收盘价格的上下 100%；连续匹配、盘中临时停牌复牌集合匹配阶段，通用回购的有效申报价格不得高于匹配成交最新成交价格的 100 个基点（即百元资金到期年收益 1 元）。

三、信用保护工具

信用保护工具¹⁰，是指信用保护卖方和信用保护买方达成的，约定在未来一定期限内，买方按照约定的标准和方式向卖方支付信用保护费用，由卖方就约定的一个或者多个参考实体或者其符合特定债务种类和债务特征的一个或者多个、一类或者多类债务向买方提供信用风险保护的金融工具。信用保护工具包括信用保护合约（含组合型信用保护合约，即 CDX 合约）和信用保护凭证。

表 6-信用保护合约以及凭证概览

	信用保护合约	信用保护凭证
产品特性	一对一达成，其中必须至少有一方为核心交易商	由创设机构创设，创设时以及转让后的投资者合计不得超过 200 人
是否可转让	否	是
是否需签署主协议	合约达成前应当签署主协议	不需签署
保护费支付方式	按季支付约定保护费、季度标准保护费和前端费用相结合、或者前端一次性支付保护费	由买方在凭证创设时一次性向创设机构支付

第四章 交易信息

本所将通过交易系统和官网发布债券交易以及统计信息。

（一）现券交易信息

1. 交易申报信息

¹⁰ 详情可以参见《深圳证券交易所信用保护合约业务指引》《深圳证券交易所信用保护工具业务指南第 1 号——信用保护合约》《深圳证券交易所交易业务指南第 3 号——信用保护凭证》。

本所向全市场发布匹配成交、点击成交以及竞买成交相关申报信息，具体安排如下：

（1）匹配成交

本所通过交易系统和官网在集合匹配阶段发布参考价格、匹配量、未匹配量等信息，在连续匹配阶段发布最优五档买卖申报价格、数量等信息。债券临时停牌期间不揭示集合匹配参考价、匹配量和未匹配量。

本所通过交易系统发布成交数量100万元及以上的逐笔交易申报信息，包括证券代码、价格、数量、买卖方向、申报时间等。

（2）点击成交

本所通过交易系统发布面向全市场的点击成交申报信息，包括交易商、交易主体类型、交易员、证券代码、价格、数量、买卖方向、申报时间等。

（3）竞买成交

①竞买预约信息：本所通过交易系统发布逐笔竞买预约信息，包括竞买场次编号、证券代码、交易商、交易主体类型、竞买方式、价格区间、数量、最低成交总量（如有）、竞买时间（即竞买日）、申报时间等。同时，本所还将通过官网¹¹发布竞买预约信息。

②竞买发起申报信息：本所通过交易系统发布逐笔竞买发起申报信息，包括竞买场次编号、证券代码、交易商、交易主体类型、竞买方式、价格区间、数量、最低成交总量（如有）、

¹¹ 官网固定收益信息平台（<http://bond.szse.cn>）“信息披露/交易参与信息/竞买预约”栏目。

申报时间、备注等。

③应价申报信息：本所通过交易系统发布单一主体中标方式下的逐笔应价申报信息，包括竞买场次编号、证券代码、交易商、交易主体类型、竞买方式、数量、价格、申报时间等。

2. 成交信息

(1) 即时成交行情

本所通过交易系统以及官网发布每只债券的即时成交行情，具体信息包括证券代码、前收盘价、开盘价、最近成交价、最近成交方式、当日最高价、当日最低价、当日累计成交数量、当日累计成交金额等。交易系统发布的即时成交行情还包括当日加权均价、当日累计成交笔数等。

上述指标采用的成交数据为五种交易方式达成的成交数据。其中，开盘价为当日第一笔成交价格。收盘价为当日 15:30（含）前最后一笔交易（含）前一小时内的成交量加权均价。当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

此外，即时成交行情还提供了个券匹配成交信息，包括匹配最近成交价、匹配累计成交数量、匹配累计成交金额等。

(2) 逐笔成交行情

本所通过交易系统实时发布债券现券的逐笔成交行情。本所于收市后在官网¹²发布逐笔成交信息。

逐笔成交信息包括证券代码、交易方式、成交价格、成交数量、成交金额等。其中，匹配成交仅发布成交数量为 100 万元面额及以上的逐笔成交信息；竞买成交除前述逐笔成交信息

¹² 官网固定收益信息平台（<http://bond.szse.cn>）“市场数据/市场统计/交易明细/现券/现券交易信息（逐笔）”栏目。

外，还发布竞买成交结果¹³信息，包括竞买场次编号、竞买方式以及边际价格（适用于多主体中标）。

3. 特定债交易信息

对于特定债券，本所通过交易系统实时发布面向全市场成交方式下的特定债逐笔成交行情，收市后发布汇总成交行情。其中，竞买多主体中标方式下的逐笔成交行情中暂不包含成交价格以及成交金额等信息。

（二）回购交易信息

对于通用质押式回购，本所通过交易系统以及官网发布各期限品种的即时行情。即时行情包括证券代码、前收盘价、开盘价、最近成交价、当日最高价、当日最低价、当日加权平均利率、当日累计成交金额、最优五档买卖盘等。其中，开盘价为当日第一笔成交价格。收盘价为当日 15:30（含）前最后一笔交易（含）前一小时内的成交量加权均价。当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

对于质押式协议回购业务，本所通过官网发布当日交易汇总信息，包括最高利率、最低利率、加权平均利率、加权涨跌幅度、初始交易以及续做成交金额、购回交易金额以及续做对应的购回金额等信息。详见《深圳证券交易所交易业务指南第2号—债券质押式协议回购》第四章“信息披露”相关安排。

对于质押式三方回购业务，本所通过官网发布实时成交行情、上一交易日逐笔行情和汇总行情。详见《深圳证券交易所债券质押式三方回购交易业务指南》第七章“行情及信息披露”

¹³ 官网固定收益信息平台（<http://bond.szse.cn>）“市场数据/市场统计/交易明细/现券/竞买成交结果”栏目。

相关安排。

（三）统计信息

本所通过官网定期发布债券交易的统计信息，包括各类债券托管情况、各类债券现券交易情况、个券当日交易汇总以及交易排名情况等。

第五章 交易价格偏离报备

根据《债券交易规则》相关规定，债券交易价格偏离比较基准超过本所规定范围的，债券交易参与者应当向本所提交说明。

（一）报备情形

通过点击成交、询价成交、协商成交参与本所债券现券交易（特定债除外），交易价格同时偏离当日日终中债估值和中证估值的幅度大于或者等于 2% 的，债券交易参与者应当不晚于次一交易日向本所报告该笔交易，并说明价格偏离的原因及其合理性。债券上市的两个交易日内发生上述价格偏离的，可以豁免报告义务。经纪客户由所在证券公司统一报备。

本所可以视情况要求债券交易参与者以及相关主体就价格偏离的其他特殊情形提交相应说明。

（二）报备内容

债券交易参与者应当填写《债券交易价格偏离情况说明表》（详见附件 3），报告内容包括交易方的基本信息、交易要素、交易情况以及偏离原因等。债券交易参与者应当确保其

报告的信息真实、准确、完整、及时。

（三）报备方式

债券交易参与者应当将《债券交易价格偏离情况说明表》扫描件发送至邮箱（bond_report@szse.cn），邮件以及文件统一命名为“机构名称+交易日期+证券代码+账户名称”，报备文件需加盖公司公章或经公司授权的业务专用章。

附件 1：债券交易参与者申请模板

深圳证券交易所债券交易参与者申请书 (模版, 以红头文件提供)

深圳证券交易所：

根据《深圳证券交易所债券交易规则》及《深圳证券交易所债券交易业务指引第 1 号—债券交易参与者管理》，现特向贵所申请成为债券交易参与者。我公司承诺：

- 一、具备较强的资本、资金实力与持续经营能力，具有参与本所债券交易的相应功能。具有独立的债券交易团队、完善的交易业务管理制度和风险控制制度以及能够支持开展债券交易的相关技术系统。
- 二、债券投资交易量较大，具有较强的债券交易需求。
- 三、具有较好的持续经营能力，近两年债券交易结算未发生重大违法违规事件。
- 四、申请材料真实准确完整。
- 五、严格按照相关法律法规、自律规则要求，合规开展交易所业务，不将交易单元提供他人使用，不超越权限违规代理其他投资者从事债券交易。
- 六、遵守深圳证券交易所自律规则并接受自律监管，如违反法律、法规、规章、深圳证券交易所相关业务规则，接受深圳证券交易所作出的包括但不限于暂停或者限制参与债券市场业务等决定，并承担由此产生的一切法律责任。

特此申请

附件：债券交易参与者基本信息登记表

申请方单位公章

法定代表人签字（或盖章）

年 月 日

债券交易参与者基本信息登记表

机构信息	机构简称		机构全称			
	机构类别	<input type="checkbox"/> 政策性银行 <input type="checkbox"/> 商业银行 <input type="checkbox"/> 银行理财子公司 <input type="checkbox"/> 保险公司 <input type="checkbox"/> 保险资管机构 <input type="checkbox"/> 养老金管理公司 <input type="checkbox"/> 基金管理公司 <input type="checkbox"/> 其他：				
	机构地区		省		市	
	注册资本		法定代表人		统一社会信用 代码	
	最近一年申请人 债券交易情况	债券交易量 亿元， 其中，现券交易量 亿元、回购交易量 亿元。				
	机构通信地址					
	资本 资金 情况	最近一个会计年度年末净资产 (资产管理机构以外的其他机构填写)			资本情况 (资产管理机构填写)	
亿元			具备发行公募资 管产品资格	(是/否) 若否，填写下一行		
			最近一个会计年 末管理资产规模	亿元		
联络 人信息	债券业务负责人					
	姓名		部门		职务	
	是否法定代表人		手机号码		电子邮件	
	传真		电话区号		电话	
	债券交易业务联络人					
	姓名		部门		职务	
	是否法定代表人		手机号码		电子邮件	
	传真		电话区号		电话	
	技术联络人					
	姓名		部门		职务	
	是否法定代表人		手机号码		电子邮件	
	传真		电话区号		电话	

附件 2：境外机构投资者信息报送表

境外机构投资者信息报送表 Information Form For Foreign Institutional Investors

申报类别 Types	法人/非法人产品的资产管理人 Incorporated Entity/Asset Management Company of Unincorporated Fund Products	
机构全称 Full Name of Applicant Institution		
机构类别 Type of Institution	<input type="checkbox"/> 主权机构 Sovereign Fund <input type="checkbox"/> 商业银行 Commercial Bank <input type="checkbox"/> 保险公司 Insurance Company <input type="checkbox"/> 证券公司 Securities Company <input type="checkbox"/> 基金管理公司 Fund management Company <input type="checkbox"/> 期货公司 Futures Company <input type="checkbox"/> 信托公司 Trust Company <input type="checkbox"/> 其他机构(请说明) Other (Please Specify)	
所在国家/地区 Country/Region		
证券账户 Security Account(s)	(可填多项)	
账户名称 Account Name(s)	(可填多项)	
报送内容 Contents	<input type="checkbox"/> 初始报送 Initial Registration <input type="checkbox"/> 信息变更 Information Update	
	变更事项 (可添加多项) Update Item(s):	
法人/管理人/合规联络人	部门名称 Department Name	

等联系方式 Contact of Incorporated Entity / Asset Management Company	负责人职务 Title of Person in Charge		负责人姓名 Name of Person in Charge		联系电话 Tel.	
	合规联络人 职务 Title of Compliance Person		合规联络人 姓名 Name of Compliance Person		联系电话 Tel.	
	经办人职务 Title of Handling Person		经办人姓名 Name of Handling Person		联系电话 Tel.	
	传真 Fax			邮件 Email		
	详细地址 Address					
托管人联系方式 Contact of Main Custodian	机构名称 Company Name					
	部门名称 Department Name					
	负责人职务 Title of Person in Charge		负责人姓名 Name of Person in Charge		联系电 话 Tel.	
	合规联络人 职务 Title of Compliance Person		合规联络人 姓名 Name of Compliance Person		联系电 话 Tel.	
	经办人职务 Title of Handling Person		经办人姓名 Name of Handling Person		联系电 话 Tel.	
	传真 Fax			邮 件 Email		
交易参与者 联系方式 Contact of Trading Participant	机构名称 Company Name					
	部门名称 Department Name					

	负责人职务 Title of Person in Charge		负责人姓名 Name of Person in Charge		联系电话 Tel.	
	合规联络人职务 Title of Compliance Person		合规联络人姓名 Name of Compliance Person		联系电话 Tel.	
	经办人职务 Title of Handling Person		经办人姓名 Name of Handling Person		联系电话 Tel.	
	传真 Fax			邮件 Email		
	详细地址 Address					
报送机构 Name of Submitting Institution						
提交人及联系方式 Name and Contact of Submitter				报送日期 Submission Date	年月日 Year/Month/Date	

盖章/签字(Official Seal/Signature):

附件 3：债券交易价格偏离情况报备模板

债券交易价格偏离情况说明表 (样张)

机构名称：

填表人：

联系电话：

填表日期：

证券简称		证券代码	
账户名称		账户代码	
交易日期		交易方式	
申报时间		申报方向	
申报面额（万元）		申报价格	
成交时间		成交面额（万元）	
成交价格		成交价格与比较基准（中债估值/中证估值）偏离（%）	向上偏离： % 向下偏离： %
交易情况及偏离原因			

说明：1、交易价格同时偏离当日日终中债估值和中证估值的幅度大于或者等于 2%的，交易参与人应填报本表。交易参与人在填写本表时应当明确所使用的比较基准。

2、本表扫描版应当不晚于次一交易日发送至 bond_report@szse.cn，邮件及文件命名为“机构名称+交易日期+证券代码+账户名称”，例如“××证券+2022 年 4 月 18 日+102100+XXX（账户名称）”。

机构名称（盖章）：

年 月 日

附件 4：业务专区及网站链接一览表

专区/系统名称	登录链接地址
会员业务专区	https://biz.szse.cn/mbr/index.html
固定收益品种业务专区	https://biz.szse.cn/fic
交易终端网站	https://172.27.0.163:7022/szsett-web/login.html ; https://172.27.128.163:7022/szsett-web/login.html (备用)
官网	http://www.szse.cn
官网固定收益信息平台	http://bond.szse.cn
中国结算官网	http://www.chinaclear.cn