

附件 2

《深圳证券交易所非公开发行公司债券 挂牌转让规则》第二章第二节 “转让机制”

第十九条 债券在本所转让的，以现券或者本所认可的其他方式转让。债券回购业务相关规则，由本所另行规定。

第二十条 债券以 100 元面值为 1 张，申报价格最小变动单位为 0.001 元。债券单笔现券转让数量不低于 5000 张或者转让金额不低于 50 万元。

第二十一条 债券采用全价转让的方式，转让价格范围为前收盘价的上下 30%。并实行当日回转。

第二十二条 本所接受债券转让申报的时间为每个交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30，转让申报当日有效。

第二十三条 本所接受下列类型的债券转让申报：

- （一）意向申报；
- （二）定价申报；
- （三）成交申报；
- （四）其他申报。

第二十四条 意向申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向和本方交易单元代码等内容。

意向申报不承担成交义务，意向申报指令可以撤销。

第二十五条 定价申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量和本方交易单元代码等内容。

市场所有参与者可以提交成交申报，按指定的价格与定价申报全部或者部分成交，本所按时间优先顺序进行成交确认。

定价申报的未成交部分可以撤销。定价申报每笔成交的转让数量或者转让金额，应当满足债券转让的最低限额要求。

第二十六条 成交申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量、对手方交易单元代码、约定号等内容。成交申报要求明确指定价格和数量。

成交申报可以撤销，但在对手方提交匹配的申报后不得撤销。本所对约定号、证券代码、买卖方向、价格、数量等各项要素均匹配的成交申报进行成交确认。

第二十七条 本所按照时间先后顺序对债券转让申报进行实时成交确认。转让后同一只债券的合格投资者合计仍不得超过二百人。

符合本规则达成的转让，转让双方应当承认转让结果，并履行交收义务。

第二十八条 本所在交易时间内通过交易系统即时公布债券转让的报价信息。

发布的报价信息包括：证券代码、证券简称、申报类型、买卖方向、数量、价格等。

第二十九条 本所在每个交易日结束后，通过本所网站公布债券转让每笔成交信息，内容包括：证券代码、证券简称、成交数量、成交价格以及买卖双方所在证券公司营业部或者交易单元的名称。

第三十条 债券以当日该证券所有转让的成交量加权平均价为收盘价。当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

第三十一条 本所可以根据市场发展情况，对债券转让安排进行调整。