附件

深圳证券交易所债券交易业务指南第7号

——债券做市（2024年9月修订）

版本及修订说明

|  |  |
| --- | --- |
| 修改日期 | 版本及主要修订内容 |
| 2022/9/20 | 首次发布 |
| 2023/1/6 | 新增固定收益业务品种专区债券做市功能上线后的业务操作流程及合并申报等内容。 |
| 2024/9/20 | 调整做市品种管理规定 |

二○二四年九月

**目 录**

[第一章 总体要求 4](#_Toc123811066)

[一、概览 4](#_Toc123811067)

[二、做市商岗位设置 4](#_Toc123811068)

[三、做市商风控合规管理 4](#_Toc123811069)

[第二章 债券做市商和做市品种 5](#_Toc123811070)

[一、债券做市商 5](#_Toc123811071)

[二、债券做市品种 6](#_Toc123811072)

[三、做市信息披露 7](#_Toc123811073)

[第三章 债券做市业务申请和管理 8](#_Toc123811074)

[一、申请前的准备 8](#_Toc123811075)

[二、做市业务申请 8](#_Toc123811076)

[三、做市业务变更申请 10](#_Toc123811077)

[四、暂停做市业务 11](#_Toc123811078)

[五、恢复做市业务 11](#_Toc123811079)

[六、终止做市业务 12](#_Toc123811080)

[第四章 债券做市业务 12](#_Toc123811081)

[一、 做市方式 12](#_Toc123811082)

[二、 做市业务评价 14](#_Toc123811083)

[三、 做市支持措施 15](#_Toc123811084)

[四、 监管豁免情形 15](#_Toc123811085)

[附件1：基准做市实施方案 17](#_Toc123811086)

[附件2：关于债券做市业务准备情况的专项说明（参考模板） 20](#_Toc123811087)

[附件3：一般做市业务报备表 22](#_Toc123811088)

[附件4：暂停做市业务申请表 23](#_Toc123811089)

[附件5：恢复做市业务申请表 24](#_Toc123811090)

[附件6：终止做市业务申请表 25](#_Toc123811091)

重要提示

一、为便于深圳证券交易所（以下简称本所）债券做市商规范开展债券做市业务，进一步明确各业务环节操作流程，根据《深圳证券交易所债券交易规则》（以下简称《交易规则》）和《深圳证券交易所债券交易业务指引第3号——债券做市》（以下简称《做市指引》）相关规定，制定本指南。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、做市商应当通过本所固定收益品种业务专区（以下简称固收专区）的债券做市栏目提交相关文件。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。做市商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 总体要求

## 一、概览

债券做市商（以下简称做市商），是指按照《交易规则》《做市指引》的规定，在本所债券市场为债券提供流动性、开展债券做市业务的债券交易参与人，分为主做市商和一般做市商。

债券做市业务是指做市商在本所债券市场持续报出做市品种的双边买卖价格、对本所债券投资者的询价请求进行回复，以及通过本所认可的其他做市方式，为债券提供流动性的行为。

做市商应当具备符合要求的技术系统、风险管理和内部控制制度，加强对市场风险、模型风险、存货风险、做市风险、操作风险等业务风险的识别、监测和控制。

## 二、做市商岗位设置

做市商需配置专门的债券做市业务团队开展做市业务，不得把做市业务外包，或者交由第三方机构开展。

做市商开展债券做市业务需设立交易、风险控制、技术运维等岗位，涉及交易、风控、合规、清算、信息技术等多个业务和功能支持部门，并建立备岗机制。做市业务应和经纪、自营、资产管理等业务进行有效隔离，防止敏感信息的不当流动和使用。

## 三、做市商风控合规管理

做市商应当制定健全的业务制度和完备的业务流程，涵盖做市业务管理、交易管理、结算、风险管理、内部控制、应急等各个业务环节，并明确各相关部门的职责和岗位设置。

做市商应当根据监管部门以及本所相关规定，制定做市业务相关管理办法，保障业务规范开展，内容包括但不限于做市业务实施机制、决策流程、授权体系、风险管理、合规与内部控制等。

做市商应当制定做市业务相关风险管理制度，加强对做市业务的风险管理，有效防范和化解业务风险，内容包括但不限于做市业务风险管理基本原则、风险指标设计、风险识别与评估、风险控制与处置、风险定期报告机制、压力测试的情景设置和分析等。

做市商应当制定做市业务应急预案，以应对做市业务中的突发事件，保障做市业务平稳开展。

# 第二章 债券做市商和做市品种

## 一、债券做市商

本所债券市场的做市商包括主做市商和一般做市商。主做市商对基准做市品种开展持续做市业务（以下简称基准做市业务）；一般做市商对其自行选定的做市品种在一定时期内开展做市业务（以下简称一般做市业务）。主做市商可以参照一般做市业务的要求对自选做市品种开展做市业务。

符合下列条件的债券交易参与人可以成为主做市商，开展基准做市业务：

（一）市场交易活跃，近2年债券交易量排名靠前；

（二）具有专业的做市团队和较强的做市能力；

（三）本所规定的其他条件。

证券公司为债券交易开展做市业务的，应当依据相关法律法规取得相应的经营证券业务许可。对于已取得中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）上市证券做市交易业务资格的证券公司，本所将根据业务报送材料接收其成为本所债券做市商。

## 二、债券做市品种

做市品种包括基准做市品种和自选做市品种。主做市商对基准做市品种开展持续做市业务，一般做市商对其自行选定的做市品种在一定时期内开展做市业务。主做市商可以参照本所对一般做市业务的要求对其自行选定的基准做市品种以外的债券和资产支持证券品种开展一般做市业务。

### （一）基准做市品种

根据《做市指引》相关规定，主做市商应当从政府债券和政策性金融债基准做市债券清单中选择至少5只债券做市，从公司债券基准做市债券清单中选择至少10只债券做市。

本所每月定期更新基准做市债券清单，做市商应当关注基准做市债券清单调整情况，及时对本机构基准做市债券范围进行动态调整，确保有效做市清单应满足《做市指引》要求。若做市商的基准做市债券不再属于本所基准做市债券清单的，相关债券将自动调出该做市商的基准做市债券范围。

### （二）基准做市债券清单

本所将于每月初通过官网“固定收益信息平台-信息披露-交易参与信息-做市品种”栏目披露基准做市债券清单。根据《做市指引》相关要求，本所将选取符合以下要求的债券纳入基准做市债券清单：

1．国债：选取1年期、2年期、3年期、5年期、10年期等期限中最新上市的两期国债；

2．地方政府债以及政策性金融债：本所指定；

3．政府支持债券：选取最新发行的2只铁道债；

4．公司债券：选取债项评级AAA、存续规模大于15亿元、剩余期限大于半年的公募公司债券，暂不纳入可交换公司债券、上市公司公开发行的可转换公司债券等。

针对每月末不再符合要求的债券，本所将对其进行调出处理，并原则上设置1个月的“过渡期”安排，即于次月将相关债券正式调出基准做市债券清单，对处于“过渡期”内的债券开展做市业务计入评价范畴。基准做市债券清单中提前摘牌的债券将于当月末直接从清单中调出，不再设置上述“过渡期”安排。

### （三）一般做市品种

一般做市商可以自行选定的做市品种对其在一定时期内开展做市业务，自选做市品种包含除可转债和可交债以外的债券和资产支持证券。本所鼓励债券承销商为其承销的债券品种做市。

## 三、做市信息披露

本所通过官网“固定收益信息平台-信息披露-交易参与信息-机构名单-做市商”栏目披露本所做市商及其选定的做市债券信息；通过官网“固定收益信息平台-信息披露-交易参与信息-做市品种”栏目披露基准做市债券清单和本所做市商选取的做市债券汇总清单。

# 第三章 债券做市业务申请和管理

## 一、申请前的准备

### （一）登录固收专区

做市商需使用本所会员业务专区数字证书（M类数字证书）通过<https://biz.szse.cn/fic>登录固收专区，通过“债券做市”专栏办理做市业务申请、做市业务变更、做市业务暂停/恢复/终止等业务。做市商需新增、补办、更新数字证书的，应当通过本所官网“市场服务-信息服务-CA服务”栏目根据相关要求进行办理。

### （二）报备做市专用证券账户信息

提交做市业务申请前，做市商应当根据《深圳证券交易所债券交易业务指南第1号——账户信息报备》规定，通过固收专区完成做市专用证券账户的信息报备工作。

## 二、做市业务申请

### （一）做市商报送材料

1．债券交易参与人拟成为主做市商的，应当向本所报送以下材料：

（1）《基准做市实施方案》（附件1），含做市证券账户及拟基准做市品种信息等；

（2）《关于债券做市业务准备情况的专项说明》（附件2），含专项说明附件2-1和附件2-2；

（3）已取得上市证券做市交易业务资格的支持性文件、经营许可证等（证券公司适用）；

（4）本所规定的其他文件。

2．债券交易参与人拟成为一般做市商的，应当向本所报送以下材料：

（1）《一般做市业务报备表》（附件3），含做市证券账户及拟自选做市品种信息等；

（2）《关于债券做市业务准备情况的专项说明》（附件2），含专项说明附件2-1和附件2-2；

（3）已取得上市证券做市交易业务资格的支持性文件、经营许可证等（证券公司适用）；

（4）本所规定的其他文件。

本所将对报送材料进行审慎评估，并将视情况通过要求补充说明、汇报座谈、专家评议、技术验收及测试等方式评估债券交易参与人的债券做市业务准备情况。

### （二）申请提交方式

拟开展做市业务的债券交易参与人应当通过固收专区“债券做市-做市业务申请”栏目提交上述报送材料。

拟申请成为主做市商的，应当在“做市业务类型”中同时选择“基准做市业务”和“一般做市业务”，并从基准做市债券清单中选择至少5只政府债券和政策性金融债、至少10只公司债券作为基准做市品种；主做市商不开展一般做市业务的，无需选择自选做市品种。

拟申请成为一般做市商的，应当在“做市业务类型”中仅选择“一般做市业务”，并选择至少1只证券作为自选做市品种。

一般做市商拟变更为主做市商的，应当符合主做市商相关要求，并通过固收专区“债券做市-做市业务申请”栏目提交报送材料，申请页面中“做市业务类型”增加勾选“基准做市业务”并上传主做市商的相关材料。

本所将于2个交易日内受理做市业务申请，并在受理后5个交易日内反馈主做市商业务申请结果、受理后2个交易日内反馈一般做市商业务申请结果。申请机构可在固收专区“做市业务申请”栏目查看业务申请记录、进度及结果。

## 三、做市业务变更申请

### （一）做市账户、做市证券变更申请

做市商拟变更做市专用证券账户或做市证券的，应当通过固收专区“债券做市-做市变更申请”栏目提交申请。做市账户、做市证券变更的申请需在当日17:00之前提交，变更申请于下一交易日生效。做市商每季度内原则上最多可以进行一次账户变更。

### （二）做市商信息变更申请

债券交易参与人机构信息发生变更的，相应做市商信息同步变更，无需另行报送。做市商拟变更机构信息、证券账户以及做市债券信息以外信息的，应当基于固收专区“债券做市-做市业务申请”栏目的申请记录提交修改申请，同时上传更新后的《基准做市实施方案》（附件1）或者《一般做市业务报备表》（附件3）以及变更情况说明。

## 四、暂停做市业务

根据《交易规则》《做市指引》相关规定，出现下列第一项或者第二项情形的，做市商可以暂停对应债券品种的做市业务，出现下列第三项或者第四项情形的，做市商可以暂停开展做市业务：

（一）做市品种被停牌的；

（二）做市品种的交易价格出现异常波动的；

（三）因不可抗力或者意外事件而无法正常开展做市业务的；

（四）本所认定的其他难以持续开展做市业务的情形。

出现上述第一项情形的，做市商无需另行提交暂停对应债券品种做市业务的申请。做市商出现除第一项以外的其他情形且确需暂停做市业务的，应当通过固收专区“债券做市-做市暂停申请”栏目提交相关材料，申请页面中“暂停业务类型”需选择“暂停做市业务”或者“暂停特定品种做市业务”，并明确暂停生效时间，同时上传《暂停做市业务申请表》（附件4）。

## 五、恢复做市业务

暂停做市业务的情形消除后，做市商应当及时申请恢复做市业务。做市商拟恢复做市业务的，原则上应当提前2个交易日通过固收专区“债券做市-做市恢复申请”栏目提交相关材料，申请页面中“恢复业务类型”需选择“恢复做市业务”或者“恢复特定品种做市业务”，并明确恢复生效时间，同时上传《恢复做市业务申请表》（附件5）。

## 六、终止做市业务

做市商主动申请终止做市业务的，应当至少提前5个交易日[通过固收专区“债券做市-做市终止申请”栏目提交相关材料，填写终止生效时间并上传《终止做市业务申请表》（附件6](mailto:做市商应当向本所邮箱szsebond@szse.cn发送《终止做市业务申请表》（附件6)）。经本所确认后，做市商方可终止做市业务。做市商主动终止做市业务的，原则上6个月内不得重新开展债券做市业务。

主做市商拟变更为一般做市商的，应当提前5个交易日通过固收专区“债券做市-做市终止申请”栏目提交相关资料，申请页面中“终止做市业务类型”需勾选“终止基准做市业务”，同时上传《终止做市业务申请表》（附件6）。主做市商变更为一般做市商的，原则上3个月内不得重新变更为主做市商。

本所按照《交易规则》《做市指引》等规定对做市商的债券做市业务活动进行自律管理，并根据定期评价结果对做市商进行动态管理。

对于做市商不再符合相关资质要求、未认真履行做市义务、存在严重扰乱债券市场行为或者存在严重违规等情形的，本所可视情况终止其做市业务。

# 第四章 债券做市业务

## 一、做市方式

做市商可以采用匹配成交、点击成交等方式对做市债券进行双边买卖报价，对本所债券投资者就做市债券的询价请求进行回复，以及通过本所认可的其他做市方式为债券提供流动性。

在协商成交方式下，本所做市商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。

### （一）匹配成交

做市商可以使用匹配成交方式面向全市场分别进行双边买卖报价。匹配成交双边报价方式下，买入价格不得高于卖出价格，单笔申报数量应不低于100万元面额。

做市商拟修改双边报价下任一单边价格或者数量的，可以通过撤销原对应单边报价委托并提交新的匹配报价委托实现。若匹配成交报价中的单边申报全部成交或撤销，做市商须补充提交相应申报，确保针对做市债券存在持续双边报价。

### （二）点击成交

做市商可以使用点击成交方式面向全市场分别进行双边买卖报价。点击成交双边报价方式下，买入价格不得高于卖出价格，单笔申报数量应不低于100万元面额。

做市商拟修改双边报价下任一单边价格或者数量的，可以通过撤销原对应单边报价委托并提交新的报价委托实现。若点击成交报价中的单边报价全部成交或撤销，做市商须补充提交相应申报，确保针对做市债券存在持续双边报价。

### （三）询价成交

做市商应当基于其做市债券对债券投资者的询价请求进行回复。做市商应当在询价请求有效期内进行询价回复。

## 二、做市业务评价

### （一）评价周期

为协助做市商了解最新做市表现，适时优化调整做市策略，根据《做市指引》相关规定，本所对做市商的做市情况进行季度评价及年度评价，评价结果定期向做市商反馈。季度评价周期分别为12月21日（上一年度）-3月20日、3月21日-6月20日、6月21日-9月20日、9月21日-12月20日。

季度评价周期内开展对应做市业务的天数少于20个交易日的，本所不对其进行季度评价；年度评价周期内做市商未参与过季度评价的，本所不对其进行年度评价。

### （二）评价指标

做市业务评价指标体系包括做市报价质量、报价时长、询价成交比例及成交量等指标。

本所将做市商对评级为AA级及以下的债券的做市成交量、对手方数量等指标作为进一步评价依据。本所鼓励做市商发挥积极作用，主动参与维护债券市场稳定运行、平抑市场异常波动，并将上述情况纳入业务评价考量。

### （三）评价范围

考虑做市义务差异以及利率债与信用债报价策略、报价难易程度不一，本所将分别对基准做市、一般做市、利率债做市以及信用债（含资产支持证券）做市业务分别进行评价。

做市商通过匹配成交、点击成交方式对做市债券面向全市场进行的双边买卖报价，以及基于其做市债券对债券投资者的询价请求进行的回复纳入评价范围；通过各类交易方式达成的做市成交量均纳入评价范围。做市商对做市债券进行双边报价的，日均加权双边报价时长不得低于3小时。

做市商报价及成交应当以真实交易意愿为基础，不得以任何方式虚增做市成交量。评价指标计算时做市商做市账户之间的成交量不纳入。

### （四）评价结果

做市商可以通过固收专区“债券做市-做市评价结果查看”栏目查询季度及年度评价结果。本所将根据做市商年度评价结果分别评定年度优秀做市机构，并向市场公布。

## 三、做市支持措施

根据年度评价结果，对各类排名靠前的做市商颁发“优秀做市商”等奖项。

做市商开展做市业务，本所还将向做市商提供以下支持措施：获得债券回购等便利、优先开展债券创新产品和业务、获得本所实时提供的债券报价以及成交数据、以及本所提供的其他支持等。根据《关于暂免债券、基金相关收费的通知》相关安排，本所自2022年7月1日起至2025年6月30日免收债券（不含可转换公司债券）及资产支持证券的流量费、交易经手费，相关安排同样适用于债券做市。

## 四、监管豁免情形

根据中国证监会《证券公司风险控制指标计算标准规定》相关条款，做市商在深市开展做市业务，可以豁免其所持单只债券的集中度要求。

根据《交易规则》和《做市指引》相关规定，做市商因开展做市业务发生《交易规则》第7.2条第二项、第三项与第八项规定的异常交易行为，属于做市业务合理范围且未影响正常交易秩序的，本所不采取自律监管措施。上述异常交易行为包括：

（一）拉抬打压，即大笔申报、连续申报、密集申报或者以明显偏离债券最新成交价或者合理价值的价格申报成交，期间债券交易价格明显上涨或者下跌；

（二）单个账户、自己实际控制的账户之间或者关联账户之间大量或者频繁进行自买自卖、互为对手方的交易或者反向交易，影响债券交易价格或者交易量；

（三）对单一债券在一段时期内进行大量且连续的交易。

## 附件1

XX公司基准做市实施方案

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 一、基本情况 | | | | | | | | | | | | | |
| 机构名称 | | | |  | | | | | | | | | |
| 注册地 | | | |  | | | | 注册资本 | | | |  | |
| 成立时间 | | | |  | | | | 法定代表人 | | | |  | |
| 主要股东及其持股情况 | | | |  | | | | | | | | | |
| 通讯地址 | | | |  | | | | | | | | | |
| 机构类型 | | | | □证券公司 □银行 □证券公司资产管理子公司  □银行理财子公司 □证券投资基金管理公司  □保险公司 □保险资产管理公司 □信托公司  □财务公司 □期货公司 □金融资产管理公司  □私募基金管理人 □其他机构 （注明） | | | | | | | | | |
| 是否已为债券交易  参与人 | | | |  | | | | | | | | | |
| 最近一个会计年度注册资本（万元） | | | |  | | | | 最近一个会计年度净资本（万元） | | | |  | |
| 最近2年交易所市场债券现券年交易量（亿元） | | | | X年度： | | | | 最近2年交易所市场债券现券年日均持仓量（亿元） | | | | X年度： | |
| X年度： | | | | X年度： | |
| 最近2年银行间市场债券现券年交易量（亿元） | | | | X年度： | | | | 最近2年银行间市场债券现券年日均持仓量（亿元） | | | | X年度： | |
| X年度： | | | | X年度： | |
| 证券或资金违约情况说明 | | 近两年是否发生过监管机构关注的证券或资金交收违约事件（包括交易所及银行间债券市场）。如有，请说明相关情况。 | | | | | | | | | | | |
| 合规情况说明 | | 近两年是否因为违法或重大违规受到处罚（包括交易所及银行间债券市场）。如有，请说明相关情况。 | | | | | | | | | | | |
| 做市业务负责人 | | 部门及职务 | | | | 座机号码 | | 手机号码 | | 传真 | | | 邮件地址 |
|  | |  | | | |  | |  | |  | | |  |
| 业务申请联络人 | | 部门及职务 | | | | 座机号码 | | 手机号码 | | 传真 | | | 邮件地址 |
|  | |  | | | |  | |  | |  | | |  |
| 二、做市债券及账户信息  自选做市品种暂不纳入可交换公司债券和上市公司公开发行的可转换公司债券 | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | 证券代码 | | | 证券简称 | | 开始做市时间 | | | 结束做市时间（选填） | | |
| 基准做市品种  （可增添行） | | |  | | |  | |  | | |  | | |
|  | | |  | |  | | |  | | |
| 一般做市品种  （选填，可增添行） | | |  | | |  | |  | | |  | | |
|  | | |  | |  | | |  | | |
| 做市专用证券账户 | | |  | | | | | | | | | | |
| 三、做市业务部门与岗位设置  说明包括但不限于做市业务团队整体情况，说明部门相关设置及分工职责，前、中、后台业务人员的个人岗位、职责描述、联系方式及工作履历等 | | | | | | | | | | | | | |
| （部门名称1）工作职责包括：  （1）  （2） | | | | | | | | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | | | | 职责描述 | | 联系方式 | | 工作履历 | | | | |
| （部门负责人） |  | | | |  | | （座机）  （手机）  （邮件） | | （年份-单位-职责） | | | | |
|  |  | | | |  | |  | |  | | | | |
|  |  | | | |  | |  | |  | | | | |
| （部门名称2）工作职责包括：  （1）  （2） | | | | | | | | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | | | | 职责描述 | | 联系方式 | | 工作履历 | | | | |
|  |  | | | |  | |  | |  | | | | |
|  |  | | | |  | |  | |  | | | | |
| （部门名称3）工作职责包括：  （1）  （2） | | | | | | | | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | | | | 职责描述 | | 联系方式 | | 工作履历 | | | | |
|  |  | | | |  | |  | |  | | | | |
|  |  | | | |  | |  | |  | | | | |
| 四、债券做市业务评估说明  若涉及内容较多，可将相关情况作为本实施方案材料的附件提交 | | | | | | | | | | | | | |
| （一）本机构基本情况  包括但不限于公司及做市相关部门基本情况、公司治理机制、金融市场投资交易经验，近两个会计年度及最近一期主要财务指标和风险监管指标情况。 | | | | | | | | | | | | | |
| （二）业务开展情况及规划  包括但不限于近两年全市场债券业务开展情况，近两年在各市场开展债券做市业务的情况。 | | | | | | | | | | | | | |
| （三）内部管理制度  包括但不限于做市内部管理制度、合规及内部控制制度、员工行为规范等业务管理制度列表及内容说明。 | | | | | | | | | | | | | |
| （四）信息技术情况  包括但不限于做市业务相关的信息技术设施、支持人员信息、系统管理制度等情况说明。拟通过自动化定价、报价系统开展做市业务的，应就系统自动报价策略、交易前后风险控制措施、业务持续性保障措施、系统应急预案做出说明。 | | | | | | | | | | | | | |
| （五）风险控制制度  包括但不限于风险体系架构，操作风险、市场风险、流动性风险等风险管理安排、异常交易的监控及应对措施，以及相关制度列表及内容说明。 | | | | | | | | | | | | | |
| 五、承诺事项 | | | | | | | | | | | | | |
| 本机构承诺提交的报送材料内容真实、准确、完整，如存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担相关法律责任。本公司保证所提供的书面和电子材料一致，且真实、准确、完整、合法。 | | | | | | | | | | | | | |

拟做市机构名称：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_（加盖公章）

法定代表人或授权代表（签字）：

申请日期：

## 附件2

关于债券做市业务准备情况的

专项说明（参考模板）

一、拟做市机构概况

本部分内容应包括但不限于拟做市机构基本情况、取得经营证券业务许可情况、近两年全市场债券交易情况。

二、债券做市业务实施方案

本部分内容应包括债券做市业务实施方案制定情况、业务开展计划及发展规划、做市策略及压力测试情况、系统功能实现情况及应急处置措施。

三、团队和人员配备情况

本部分内容应包括但不限于拟做市机构公司组织架构说明、债券做市业务涉及部门职责与岗位设置情况、是否具有专业的做市团队以及团队人员配备情况、是否具有较强的做市及风险控制能力的说明。

四、制度准备情况

本部分内容应包括但不限于拟做市机构管理制度和内部操作规程制定情况、风险控制制度制定情况、风险管理措施、相关人员配备情况、相关系统准备情况、异常交易的监控与应对安排、突发事件应对安排。

五、技术系统准备情况

本部分内容应包括但不限于拟做市机构债券做市业务系统准备情况、是否支持做市相关交易设置的说明、技术系统配置及部署情况、系统运维及团队情况、系统管理规范。

六、其他补充说明

其他拟做市机构认为需予以说明的债券做市业务准备情况。

附件2-1：制度文件扫描件及支持性材料（包含汇总清单）

附件2-2：[债券做市业务准备情况自查表](file:///C:\\Users\\xding\\AppData\\Local\\Microsoft\\Windows\\Temporary%20Internet%20Files\\Content.Outlook\\WKYFDI61\\债券做市业务准备情况自查表.xlsx)



拟做市机构：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ （加盖公章）

日期：

## 附件3

XX公司一般做市业务报备表

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 一、基本情况 | | | | | | | | | |
| 机构名称 | |  | | | | | | | |
| 注册地 | |  | | 注册资本 | |  | | | |
| 成立时间 | |  | | 法定代表人 | |  | | | |
| 主要股东及其持股情况 | |  | | | | | | | |
| 通讯地址 | |  | | | | | | | |
| 机构类型 | | □证券公司 □银行 □证券公司资产管理子公司  □银行理财子公司 □证券投资基金管理公司  □保险公司 □保险资产管理公司 □信托公司  □财务公司 □期货公司 □金融资产管理公司  □私募基金管理人 □其他机构 （注明） | | | | | | | |
| 是否已为债券交易  参与人 | |  | | | | | | | |
| 二、做市债券及账户信息 | | | | | | | | | |
|  | 证券代码 | | 证券简称 | | 开始做市时间 | | | 结束做市时间（选填） | |
| 一般做市品种  （可增添行） |  | |  | |  | | |  | |
|  | |  | |  | | |  | |
| 做市专用证券账户 |  | | | | | | | | |
| 三、做市业务人员信息 | | | | | | | | | |
| 做市业务负责部门 | 部门名称 | |  | 所在地 | | |  | | |
| 部门职能 | |  | | | | | | |
| 做市业务负责人 | 部门及职务 | | 座机号码 | 手机号码 | | | 传真 | | 邮件地址 |
|  | |  |  | | |  | |  |
| 业务申请联络人 | 部门及职务 | | 座机号码 | 手机号码 | | | 传真 | | 邮件地址 |
|  | |  |  | | |  | |  |

注：可交换公司债券和上市公司公开发行的可转换公司债券暂不纳入自选做市品种。

拟做市机构名称：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_（加盖公章）

经办人（签字）：

申请日期：

## 附件4

暂停做市业务申请表

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 机构名称 |  | | | |
| 通讯地址 |  | | | |
| 机构类型 | □证券公司 □银行 □证券公司资产管理子公司  □银行理财子公司 □证券投资基金管理公司  □保险公司 □保险资产管理公司 □信托公司  □财务公司 □期货公司 □金融资产管理公司  □私募基金管理人 □其他机构（注明） | | | |
| 业务申请联络人 | 姓名 |  | 部门及职务 |  |
| 座机号码 |  | 手机号码 |  |
| 邮件地址 |  | | |
| 暂停特定品种做市业务  （可选填） | 证券信息 | 证券代码 |  | |
| 证券简称 |  | |
| 暂停生效时间 | YYYY-MM-DD  （暂停生效时间可选范围为申请提交日的前1交易日至后5个交易日） | | |
| 暂停原因 |  | | |
| 暂停做市业务（可选填） | 暂停生效时间 | YYYY-MM-DD | | |
| 暂停原因 |  | | |

做市商名称：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_（加盖部门章）

经办人（签字）： 申请日期：

## 附件5

恢复做市业务申请表

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 机构名称 |  | | | |
| 通讯地址 |  | | | |
| 机构类型 | □证券公司 □银行 □证券公司资产管理子公司  □银行理财子公司 □证券投资基金管理公司  □保险公司 □保险资产管理公司 □信托公司  □财务公司 □期货公司 □金融资产管理公司  □私募基金管理人 □其他机构（注明） | | | |
| 业务申请联络人 | 姓名 |  | 部门及职务 |  |
| 座机号码 |  | 手机号码 |  |
| 邮件地址 |  | | |
| 恢复特定品种做市业务  （可选填） | 证券信息 | 证券代码 |  | |
| 证券简称 |  | |
| 恢复生效时间 | YYYY-MM-DD  （恢复生效时间可选范围为申请提交日当日至后4个交易日） | | |
| 恢复原因 |  | | |
| 恢复做市业务（可选填） | 恢复生效时间 | YYYY-MM-DD | | |
| 恢复原因 |  | | |

做市商名称：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_（加盖部门章）

经办人（签字）： 申请日期：

## 附件6

终止做市业务申请表（基准/一般）

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 机构名称 |  | | | |
| 通讯地址 |  | | | |
| 机构类型 | □证券公司 □银行 □证券公司资产管理子公司  □银行理财子公司 □证券投资基金管理公司  □保险公司 □保险资产管理公司 □信托公司  □财务公司 □期货公司 □金融资产管理公司  □私募基金管理人 □其他机构（注明） | | | |
| 业务申请联络人 | 姓名 |  | 部门及职务 |  |
| 座机号码 |  | 手机号码 |  |
| 邮件地址 |  | | |
| 终止业务类型 | 一般做市业务/基准做市业务 | | | |
| 终止时间 |  | | | |
| 终止原因 |  | | | |

做市商名称：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_（加盖部门章）

经办人（签字）：

申请日期：