

北证公告〔2023〕106 号附件

北京证券交易所债券交易业务 指南第 1 号——交易业务

北京证券交易所
二〇二三年十一月

目录

引言	- 5 -
1. 北交所债券交易总体情况	- 6 -
1.1 债券投资者	- 6 -
1.1.1 债券投资者类别	- 6 -
1.1.2 投资者适当性	- 6 -
1.2 参与方式	- 6 -
1.2.1 交易参与	- 6 -
1.2.2 结算参与	- 7 -
1.2.3 各类债券投资者可选用的交易结算参与方式	- 7 -
1.2.4 交易结算方式	- 8 -
2. 债券交易参与人	- 10 -
2.1 申请条件	- 10 -
2.2 申请流程	- 12 -
2.2.1 申请材料	- 12 -
2.2.2 提交申请材料	- 13 -
2.3 建立交易及结算路径	- 13 -
2.3.1 证券账户开立	- 13 -
2.3.2 建立交易路径	- 14 -
2.3.3 建立结算路径	- 18 -
2.4 债券交易参与人管理	- 19 -
2.4.1 债券交易参与人变更	- 19 -
2.4.2 债券交易参与人终止	- 19 -

2.4.3 债券交易业务联络人	- 20 -
2.5 债券交易参与人信息报送	- 21 -
2.5.1 证券账户信息报送	- 21 -
2.5.2 交易员信息报备	- 21 -
3. 债券经纪业务	- 22 -
3.1 投资者适当性	- 22 -
3.1.1 债券投资者分类	- 22 -
3.1.2 债券现券交易投资品种范围	- 22 -
3.1.3 投资者适当性管理	- 24 -
3.1.4 投资者适当性报备	- 25 -
3.2 委托交易	- 26 -
3.2.1 交易前准备	- 26 -
3.2.2 证券账户开立	- 27 -
3.2.3 证券交易委托协议签署	- 27 -
3.2.4 资金账户开立及三方存管建立	- 28 -
3.2.5 委托方式	- 28 -
3.2.6 交易服务提供与交易系统接入	- 28 -
3.2.7 委托指令	- 29 -
3.2.8 委托撤销	- 30 -
3.2.9 交易数据传输	- 31 -
3.3 证券公司结算	- 31 -
4. 债券现券交易	- 33 -
4.1 一般规定	- 33 -
4.1.1 持仓前端控制	- 33 -
4.1.2 交易日和交易时间	- 33 -
4.1.3 交易申报	- 34 -

4.1.4 成交	- 36 -
4.2 交易方式	- 36 -
4.2.1 匹配成交	- 37 -
4.2.2 协商成交	- 40 -
5. 交易信息	- 42 -
5.1 交易申报信息	- 42 -
5.2 成交信息	- 42 -
5.2.1 即时成交行情	- 42 -
5.2.2 逐笔成交行情	- 43 -
5.3 统计信息	- 43 -
6. 价格偏离报备	- 44 -
6.1 价格偏离报备范围	- 44 -
6.2 报备流程	- 44 -
6.3 报备内容	- 44 -
6.4 报备方式	- 45 -
附件 1 债券交易参与者申请表	- 46 -
附件 2 交易单元相关申请表	- 48 -
附件 3 债券交易参与者业务联络基本信息表	- 53 -
附件 4 债券交易价格偏离情况说明表	- 54 -
附件 5 债券交易价格偏离情况说明表（提供 excel 电子表格）	- 55 -

引言

为规范债券市场交易行为，便利债券投资者开展债券交易业务，提升市场服务水平，根据《中华人民共和国证券法》《北京证券交易所债券交易规则》（以下简称《债券交易规则》）、《北京证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》《北京证券交易所会员管理规则（试行）》和其他相关规定，制定《北京证券交易所债券交易业务指南第1号——交易业务》（以下简称本指南）。

在北京证券交易所（以下简称本所或北交所）开展的债券交易适用本指南。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20M的需以超大附件发送。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。

本指南为开放性指南，本所将根据实际情况，对本指南进行不定期修订更新并发布更新版本。本所对本指南保留最终解释权。

1. 北交所债券交易总体情况

现阶段，本所债券交易业务主要包括公司债券（含企业债券）的现券交易，前述债券交易在本所固定收益平台上进行。其他业务品种暂缓实施，推出时间另行通知。

本所依据《债券交易规则》和本所其他相关业务规则对债券交易相关的业务活动进行自律管理。债券交易应当遵循公开、公平、公正以及自愿、有偿、诚实信用等原则。

1.1 债券投资者

1.1.1 债券投资者类别

债券投资者包括债券交易参与人与其他债券投资者两类。债券交易参与人是指直接参与本所债券市场的债券投资者。其他债券投资者可作为经纪客户，通过委托本所会员的方式参与本所债券市场。

债券交易参与人相关规定详见本指南第 2 章。经纪客户相关规定详见本指南第 3 章。

1.1.2 投资者适当性

本所债券市场实行投资者适当性管理制度。投资者适当性相关规定和具体要求，详见本指南第 3 章。

1.2 参与方式

1.2.1 交易参与

本所债券市场交易参与方式分为两种，一是直接入场方式，债券投资者以债券交易参与人身份直接进入本所债券市场进行

交易；二是间接入场方式，债券投资者作为经纪客户通过委托具有本所会员资格的证券公司接入本所债券市场进行交易。

债券交易参与者申请条件及参与流程，详见本指南第2章相关规定。

经纪客户参与本所债券交易的要求与流程，详见本指南第3章相关规定。

1.2.2 结算参与

债券交易的结算，由登记结算机构按照相关规则办理。债券投资者可通过自行结算、托管人结算和证券公司结算三种方式参与结算。

自行结算是指债券投资者与登记结算机构直接进行清算交收的方式，主要是具备结算参与者资格的债券投资者进行的自营交易的结算。

托管人结算是指基金、部分券商资管产品、银行理财产品、保险产品等在交易所市场达成交易后，由产品托管人与登记结算机构进行清算交收。

证券公司结算是指经纪业务模式下，债券投资者委托证券公司进行交易，并委托证券公司进行清算交收的方式。

本指南涉及的结算相关内容，以登记结算机构相关规定为准。

1.2.3 各类债券投资者可选用的交易结算参与方式

总体而言，当前债券投资者可在以下四种交易与结算参与

方式中选择：直接入场交易、自行结算；直接入场交易、托管人结算；间接入场交易、托管人结算；间接入场交易、证券公司结算。

以下为根据不同机构类型建议选用的相关交易结算参与方式¹：

债券投资者类型	直接入场交易		间接入场交易	
	自行结算	托管人结算	托管人结算	证券公司结算
证券公司自营	√			
证券公司资管		√		
证券投资基金		√		√
基金公司专户		√		√
基金子公司专户		√		√
保险公司及其产品		√		√
银行自营	√ ²			√
银行理财产品		√		√
信托产品		√		√
私募基金				√
财务公司				√
QFII/RQFII			√	√
社保/企业年金等		√		√
其他金融机构				√
其他金融机构产品				√
非金融机构				√
个人				√

1.2.4 交易结算方式

本所现有债券交易方式包括匹配成交和协商成交，《债券交易规则》中关于点击成交、询价成交、竞买成交等其他交易

¹ 此为根据实践情况推荐的交易结算方式，部分投资者（如符合相关条件的财务公司及其他机构）经申请成为债券交易参与人的，亦可选择直接入场的交易参与方式。

² 仅限具备结算参与人资格的银行。

方式的相关规定暂缓实施。结算方式为 T+1 多边净额结算,《债券交易规则》中关于债券交易逐笔全额结算和可选结算方式、结算周期的相关规定暂缓实施。

2. 债券交易参与人

根据《债券交易规则》及《北京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《债券交易参与人指引》）等规定，债券交易参与人可以通过设立或者租用交易单元等方式直接参与本所债券交易。

2.1 申请条件

根据《债券交易规则》和《债券交易参与人指引》规定，本所会员直接成为债券交易参与人，非会员机构可以按规定申请成为债券交易参与人。

（1）会员机构

本所会员资格申请，按照《北京证券交易所会员管理规则（试行）》相关业务流程办理。

（2）非会员机构

非会员机构符合以下条件的，可以申请成为债券交易参与人：

条件要求	具体规定
《债券交易参与人指引》第四条	1.具备较强的资本、资金实力与持续经营能力，或者具有参与本所债券交易的相应功能
	2.具有独立的债券交易团队
	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.债券投资资金量较大，具有较强的债券交易需求
	6.近2年无债券交易结算重大违法违规行为

第1项所称较强的资本、资金实力，是指非会员机构达到下列标准：

1) 银行最近一个会计年度年末净资产不低于100亿元人民币

币。上文所指银行包括政策性银行和国家开发银行、国有大型商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、在华外资银行、境内上市的其他银行等；

2) 资产管理机构应当具有发行公募资产管理产品资格，或者最近一个会计年度年末管理资产规模不低于 500 亿元人民币；上文所指资产管理机构，包括但不限于银行理财子公司、基金管理公司及其子公司、证券公司及其资产管理子公司、保险及保险资产管理公司、信托公司、期货公司及其子公司、金融资产管理公司等金融机构；

3) 银行、资产管理机构以外的其他机构，包括但不限于保险公司、财务公司、消费金融公司、金融资产管理公司及本所认可的其他机构、法人，最近一个会计年度年末净资产不低于 50 亿元人民币。

第 4 项所指技术系统标准指申请人的交易及相关系统与本所接口部分的建设、运行、维护，应当符合本所或者本所授权机构的规定或者认可的技术管理规范。申请人的交易及相关系统通过了本所相关测试，系统的性能、容量及扩展能力应当与其业务发展及市场需求相适应，能够保障交易及相关业务的持续开展。

第 5 项所指的债券投资交易量的统计范围包括交易所市场及银行间市场的债券现券交易、债券回购交易、债券借贷业务等各类债券交易，最近一个年度各类债券投资交易量合计不低

于 1000 亿元。对于因承接原机构业务分设成立的新机构，按原机构债券投资交易量统计。

本所可依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标准。

2.2 申请流程

2.2.1 申请材料

非会员机构申请成为债券交易参与人，应向本所提交以下材料，申请材料均应加盖机构公章：

（1）《债券交易参与人申请表》（附件 1）；

（2）营业执照复印件；

（3）金融机构营业许可证复印件（如有）；

（4）债券交易情况说明：

1) 机构基本情况；

2) 注册资本、净资产或者管理资产情况；

3) 债券交易业务管理制度及风险控制制度；

4) 债券交易部门设置及业务人员配备情况；

5) 债券交易相关技术系统建设情况；

6) 近 2 年债券投资交易情况（包括交易所市场及银行间市场投资交易情况）；

7) 本所要求说明的其他情况。

（5）本所要求的其他材料。

为了便利投资者参与本所债券市场，已经成为上海证券交

易所或深圳证券交易所债券交易参与人的非会员机构申请时，可简化申请材料，仅向本所提交第（1）、（2）、（3）项基本材料即可。

2.2.2 提交申请材料

申请材料齐备的，具有上海证券交易所或深圳证券交易所债券交易参与人身份的非会员机构申请人应向本所公共邮箱（hyglb@neeq.com.cn）报送申请材料；无沪深债券交易参与人身份的非会员机构申请人应向本所公共邮箱（bond_cyr@bse.cn）报送申请材料。邮件主题格式统一为“债券交易参与者申请+机构全称”。

申请人符合上述规定条件的，本所自申请文件齐备之日起10个交易日以内接受其成为债券交易参与者。

本所将在官网“信息披露/债券信息/债券交易参与者”栏目及时公布债券交易参与者名单及其变更情况。

2.3 建立交易及结算路径

债券交易参与人在参与债券交易前应当按照本所、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）、深圳证券通信有限公司（以下简称深证通）的相关要求建立交易、结算路径。

2.3.1 证券账户开立

开展本所债券交易前，债券投资者需开立深圳市场 A 股证券账户并新增北京市场账户标识。

(1) 证券账户开立

特殊机构及产品证券账户可根据《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》相关规定办理证券账户开立业务。自然人和一般机构可根据《中国证券登记结算有限责任公司证券账户业务指南》相关规定办理证券账户开立业务。

(2) 新增北京市场账户标识

自然人、一般机构、特殊机构可根据《中国证券登记结算有限责任公司证券账户业务指南》相关规定办理新增北京市场账户标识业务。产品账户由中国结算统一添加北京市场账户标识，无需单独申请。

上述指南下载网址：

http://www.chinaclear.cn/zdjs/fzhgl/law_flist.shtml

2.3.2 建立交易路径

(1) 开通通信线路和新建网关

债券交易参与者申请初次开通交易单元前，应当与深证通联系，签署建站合同，完成网关建站及安装调试工作。具体操作根据深证通相关规定进行，网址如下：

深证通统一客户专区：<https://biz.sccc.com>

深证通联系方式如下：

客户服务部（热线电话）：0755-83183333

技术服务热线：0755-83182222

（2）交易单元办理

【业务类别】按照交易单元的业务类别不同，债券交易相关的交易单元分为两大类：

1) 债券专用交易单元：可用于参与债券交易，不得用于股票的买入。其中会员开设的债券专用交易单元包括自营、经纪、资管、做市、其他等类型；非会员债券交易参与者开设的债券专用交易单元包括自营、资管、做市等类型。

2) 普通交易单元：可用于证券公司自营、经纪、资管、做市、融资融券、其他等业务。

现阶段做市交易单元的债券交易权限暂缓开通。

【获取方式】按照交易单元的获取方式不同，债券交易相关的交易单元分为三类：

1) 会员开设的交易单元，包括普通交易单元和债券专用交易单元；

2) 非会员债券交易参与者开设的债券专用交易单元；

3) 非会员债券交易参与人和其他债券交易者从会员租用的交易单元，承租方包括银行、基金、保险公司等。

【开设交易单元】

非会员债券交易参与者向深证通申请开通通信线路后，可向本所邮箱（jiaoyi@neeq.com.cn）提交书面文件申请开设交易单元。会员可以使用统一业务系统（以下简称 UBS 系统）Ukey 登录 UBS 系统办理新增交易单元业务。

交易单元开设参照《北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统交易单元管理细则》《北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统交易单元业务办理指南》等规定办理，交易单元相关申请表单参考本指南附件 2，申请材料中，非会员债券交易参与者应提交金融机构营业许可证复印件（如有），会员应提交经营证券业务许可证复印件。

相关指南下载地址：

https://www.bse.cn/business/jygl_list.html

UBS 系统登录地址：<https://ubs.neeq.com.cn/>

UBS 系统交易单元业务办理用户手册可在上述网址“通知公告”栏目进行下载。

交易单元名称不可重复，自用交易单元命名规则为“机构简称-交易单元类型-特殊用途（如需）-结算模式（-债券专用）序号”³。

【租用交易单元】

租用会员交易单元的债券投资者可以委托本所会员通过 UBS 系统提交出租交易单元业务申请。交易单元名称不可重复，租用交易单元命名规则为“出租方简称-出租-承租方简称-结算模式（-债券专用）序号”⁴。

【普通交易单元债券交易权限变更】

³ 债券专用交易单元名称中需添加“债券专用”。示例：ABC 银行-自营-自行结算-债券专用；ABC 证券-经纪-公募-券商结算-债券专用 3。

⁴ 债券专用交易单元名称中需添加“债券专用”。示例：ABC 证券-出租-DEF 基金-托管人结算-债券专用 2。

普通交易单元可以申请开通或关闭债券交易权限，债券交易权限变更可向本所邮箱（jiaoyi@neeq.com.cn）提交申请。

申请材料包括：

- 1) 经营证券业务许可证复印件；
- 2) 《交易单元变更申请表》；
- 3) 经办人身份证复印件；
- 4) 本所要求的其他材料。

（3）通过上下行电子接口方式接入

本所交易系统目前仅支持通过上下行电子接口方式接入，暂未提供交易客户端。债券交易参与人可自行研发相关系统或通过采购市场金融科技机构提供的集中交易系统进行接入。

（4）交易网关开通或变更

债券交易参与人申请开设或租用交易单元时，应同时申请交易网关的入网开通或配置变更，相关业务申请流程参见《北京证券交易所 全国中小企业股份转让系统交易单元业务办理指南》，其中会员可以通过 UBS 系统申请，非会员债券交易参与人目前需通过邮箱（jiaoyi@neeq.com.cn）申请。会员为存量普通交易单元申请开通债券交易权限时，应同时按上述方式申请开通新网关。

（5）开通行情网关、FDEP 网关

开通交易网关后，会员及非会员债券交易参与人根据业务情况申请开通行情网关和深证通金融数据交换平台（以下简称

FDEP) 网关。申请流程参照深证通相关规定，网址如下：

深证通统一客户专区：<https://biz.sccc.com>

2.3.3 建立结算路径

债券交易参与人在参与债券交易前应当按照登记结算机构相关规定建立结算路径，以履行相应的交收义务。

取得登记结算机构结算参与人资格的债券交易参与人，可自行办理结算业务；未取得结算参与人资格的债券交易参与人，应当委托其他结算参与人办理结算业务。

以下情形视作结算路径已经确定：

(1) 债券交易参与人已经取得登记结算机构的结算资格，在登记结算机构开通了结算业务，开立了各类结算账户，获得了托管单元。

(2) 产品的托管人已经取得登记结算机构的结算资格，在登记结算机构开通了结算业务，开立了各类结算账户，获得了托管单元。

开立结算账户及托管单元，可根据《中国证券登记结算有限责任公司北京分公司证券资金结算业务指南》进行申请及提交材料。

指南下载网址：

http://www.chinaclear.cn/zdjs/qsjszr/law_list.shtml

中国结算北京分公司热线电话：010-50939851

2.4 债券交易参与人管理

2.4.1 债券交易参与人变更

(1) 会员机构

会员类债券交易参与人变更名称的，按照本所《北京证券交易所会员管理规则（试行）》的规定办理名称变更登记。

(2) 非会员机构

非会员债券交易参与人变更名称的，申请机构应当向本所公共邮箱（hyglb@neeq.com.cn）提交变更登记申请及相关证明文件等材料，邮件主题格式为“债券交易参与人变更+机构全称”。

申请材料如下：

- 1) 公司更名申请书（承诺遵守本所业务规则并接受本所监督）；
- 2) 主管机关同意公司变更的批复；
- 3) 变更后的金融许可证；
- 4) 变更后的营业执照；
- 5) 本所要求的其他材料。

本所自申请文件齐备之日起10个交易日以内办理名称变更登记，并在官网“信息披露/债券信息/债券交易参与人”栏目向市场公布。

2.4.2 债券交易参与人终止

债券交易参与人存在下列情形的，本所可以终止其作为债

券交易参与人：

- （1）不再符合本所规定的债券交易参与人条件的；
- （2）主动申请不再作为债券交易参与人的；
- （3）超过 12 个月不参与本所债券交易且无合理理由的；
- （4）本所规定的其他情形。

债券交易参与人不再符合本所规定条件的或者债券交易参与人主动申请终止债券交易参与人身份的，相关机构在明确无相关在途合约后，应及时向本所公共邮箱（hyglb@neeq.com.cn）提交书面报告，邮件主题格式为“债券交易参与人终止+机构全称”。

本所收到相关材料后办理债券交易参与人的注销工作。该债券交易参与人名下的所有交易单元将同步进行注销。

2.4.3 债券交易业务联络人

债券交易参与人应当设置债券交易业务联络人，负责组织、协调债券交易参与人在本所开展的各项债券交易业务，并向本所提交债券交易业务联络人任职情况及联络方式等信息。

债券交易参与人设置、变更债券交易业务联络人，或者债券交易业务联络人信息变更的，应向本所公共邮箱（bond_cyr@bse.cn）提交盖章后（可为部门章）的《债券交易参与人业务联络基本信息表》（附件 3），邮件主题格式为“债券交易业务联络人登记/变更”。

2.5 债券交易参与人信息报送

2.5.1 证券账户信息报送

债券交易参与人在参与本所债券交易前，应当通过 FDEP 向本所报送拟参与债券交易的证券账户信息。报送时间为每个交易日 9:00-16:15，报送内容包括证券账户、账户名称等信息。报送要求参见《北京证券交易所债券现券交易市场参与者系统开发指南》《北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统数据文件接口规范》，文件下载网址：

https://www.bse.cn/rule/Tech_area.html

2.5.2 交易员信息报备

交易员名称及联系方式等身份信息需由债券交易参与人通过 FDEP 向本所事前报备。同一交易商下交易员名称应具有唯一性，若同一交易商下交易员重名，可在交易员名称后添加备注信息加以区分。报备成功后，本所将为每个交易员生成交易员代码，并通过债券市场交易员信息接口对外发布。

3. 债券经纪业务

债券经纪业务，是指债券交易参与人以外的债券投资者作为经纪客户委托具有本所会员资格的证券公司参与本所债券交易。证券公司按照债券投资者的要求，接受其委托代理进行债券交易，并代理其办理交易结算。

3.1 投资者适当性

本所债券市场实行投资者适当性管理制度。经纪客户需符合本所投资者适当性的相关规定。

3.1.1 债券投资者分类

债券市场债券投资者按照财产状况、金融资产状况、投资知识和经验、专业能力等因素，分为专业投资者和普通投资者。专业投资者之外的债券投资者为普通投资者。专业投资者应当符合《北京证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》规定的条件。

3.1.2 债券现券交易投资品种范围

(1) 专业投资者投资品种范围

专业投资者可以交易在本所上市交易的全部债券，但下列债券仅限专业投资者中的机构投资者交易：依据《公司债券发行与交易管理办法》第十六条面向普通投资者公开发行的公司债券以外的其他公司债券、本所规定的其他仅限专业投资者中的机构投资者交易的债券。

在本所上市交易的债券，发生下列情形之一的，发行人、

受托管理人或者具有同等职责的机构应当及时发布公告提示投资风险，自该情形披露之日起，仅专业投资者中的机构投资者可以买入该债券：

1) 发行人最近一个会计年度经审计的财务报告显示为亏损或者经更正的财务报告显示为亏损；

2) 发行人发生严重违反法律法规或者合同约定的行为，或者被证券监督管理部门立案调查，严重影响其偿债能力；

3) 发行人发生债务违约或者延迟支付本息；

4) 发行人发生严重影响其偿债能力的其他重大事项，导致债券还本付息存在重大不确定性；

5) 发行人发生其他影响投资者权益保护的负面情形。

(2) 普通投资者投资品种范围

普通投资者可以交易在本所上市交易的资信状况符合《公司债券发行与交易管理办法》第十六条规定标准的面向普通投资者公开发行的公司债券及本所认可的其他债券品种。本所另有规定的，从其规定。

其中，《公司债券发行与交易管理办法》第十六条规定的标准是指：

1) 发行人最近三年无债务违约或者延迟支付本息的事实；

2) 发行人最近三年平均可分配利润不少于债券一年利息的1.5 倍；

3) 发行人最近一期末净资产规模不少于 250 亿元；

4) 发行人最近 36 个月内累计公开发行债券不少于 3 期，发行规模不少于 100 亿元；

5) 中国证监会根据投资者保护的需要规定的其他条件。

(3) 特殊情形

发行人的董事、监事、高级管理人员以及持股比例超过 5% 的股东交易该发行人发行的债券，不受专业投资者条件的限制。

承销机构可以参与其承销的债券的交易，但其自营、资产管理以及投资顾问等不同业务类型下的债券业务应当按照相关规定分开办理，实行严格分离，切实防范利益冲突。

3.1.3 投资者适当性管理

(1) 一般规定

证券公司应当建立完善的投资者适当性管理制度。经纪业务模式下，由证券公司根据债券市场投资者适当性管理制度，明确债券投资者是否满足专业投资者条件，为专业投资者开通相关的交易权限，并于当日按要求向本所报送专业投资者账户名单。

证券公司接受经纪客户委托前，应当按照规定充分了解经纪客户的基本情况、财产状况、金融资产状况、投资知识和经验、专业能力等相关信息，向经纪客户如实说明相关债券交易品种性质、特征等，充分揭示投资风险，确保经纪客户符合相关的投资者适当性管理规定。

经纪客户应当按照证券公司明示的要求提供前款所列真实

信息。拒绝提供或者未按照要求提供信息的，证券公司应当告知其后果，并按照规定拒绝接受委托。

（2）专业投资者资格跟踪评估

通过经纪业务模式接入本所债券交易的，证券公司应当动态跟踪和持续了解专业投资者条件，至少每两年对债券投资者进行一次后续资格评估，根据评估情况更新专业投资者名单，并于当日按要求向本所报送更新的专业投资者账户名单。

已具有上海证券交易所或者深圳证券交易所债券市场专业投资者交易权限的投资者，可直接取得本所债券市场专业投资者资格。如相关投资者在沪深交易所的后续资格跟踪评估中被调出沪深交易所债券市场专业投资者名单，则前述投资者也应相应调出本所债券市场专业投资者名单。

3.1.4 投资者适当性报备

（1）投资者适当性报备范围

会员应当向本所报备专业投资者账户名单。租用本所交易单元的专业投资者（债券交易参与者除外）在参与本所债券交易前，应当通过出租交易单元的会员向本所报备证券账户信息。

（2）投资者适当性报备方式

1）报备要求

会员应于每个交易日 9:00-16:15，按照技术数据接口规范要求，通过 FDEP 向本所报送当日新增专业投资者账户信息。报送的内容应当包括：专业投资者业务开通流水号、证券账户、

账户名称、签署日期、申请日期、类别标识等。

会员未按时报送的，本所按其当日无新增专业投资者进行处理；当日多次报送的，本所以最后一次报送的证券账户信息为准；若同一报送文件中存在同一证券账户重复报送的情形，则以流水号最小的证券账户信息为准。当日无新增专业投资者的，会员应当报送空表。

会员向本所报送专业投资者账户信息当日，即可以为该投资者开通交易权限，允许其交易本所债券。

2) 专业投资者证券账户信息的处理流程

每个交易日，本所对各会员上报的专业投资者证券账户信息进行汇总，生成《当日新增专业投资者汇总信息库》，随后通过 FDEP 向各会员下发《当日新增专业投资者汇总信息库》。

3) 报送错误信息的反馈与处理

会员报送专业投资者账户信息后，本所即时反馈报送信息的格式类错误校验结果，会员应当于当日更正后重新报送。

本所于每个交易日生成投资者适当性管理证券账户信息后，向各会员反馈对其当日报送专业投资者数据的处理结果。对于报送失败的专业投资者账户信息，会员应当于次一交易日重新报送。

3.2 委托交易

3.2.1 交易前准备

债券投资者通过债券经纪业务模式参与交易所债券市场投

资交易的，应当提前完成以下工作：

（1）在登记结算机构开立证券账户及添加北京市场账户标识；

（2）与证券公司签署证券交易委托协议；

（3）在证券公司开立资金账户，用于证券资金结算；

（4）签署三方存管协议，建立三方存管关系；

（5）开通由证券公司提供的主经纪商系统（以下简称 PB 系统）权限（可选）。

3.2.2 证券账户开立

相关内容详见 2.3.1 节。

3.2.3 证券交易委托协议签署

证券交易委托协议是经纪客户与证券公司签订的证券买卖代理协议。经纪客户通过债券经纪业务模式开展债券交易，应当与证券公司签订证券交易委托协议。经纪客户可选择一家或多家证券公司进行委托。

证券公司应当在证券交易委托协议中与经纪客户明确双方的权利与义务，并对经纪客户资料提供、账户交易权限管理、资金存管、委托交易指令核查、异常交易行为处理、拒绝经纪客户委托以及委托关系解除等事项作出约定。

除本指南与其他相关文件规定的必备条款外，证券交易委托协议的格式及具体内容可由各证券公司根据自身业务需求与内控要求自行规定。

3.2.4 资金账户开立及三方存管建立

三方存管是指经纪客户的证券交易结算资金交由银行统一存管。经纪客户开立证券账户的同时，应当同步在证券公司开立资金账户，在具备三方存管资质的银行指定或开立三方存管账户，并由证券公司建立三方存管账户与资金账户的对应关系，形成经纪客户在场内交易结算资金的划转通道。经纪客户需与存管银行、受托证券公司签署三方存管协议，并将资金账户、三方存管账户及证券账户进行一一对应的关联绑定。开立资金账户所需材料、三方存管具体办理流程可咨询证券公司。

3.2.5 委托方式

经纪客户按照与证券公司的协定，可通过书面或者电话、自助终端、互联网等自助委托方式委托会员参与债券交易。证券公司对经纪客户的交易委托进行资券足额验证。

实时完成验资验券后，证券公司根据经纪客户的委托交易指令及时向本所相关交易系统发送各种交易方式的申报指令。证券公司应当对其向交易系统发送的债券交易申报指令的合法性、真实性、准确性及完整性承担相应的法律责任。

3.2.6 交易服务提供与交易系统接入

经纪客户参与场内交易，原则上应当使用证券公司提供的交易终端进行证券交易业务，通常需联系证券公司安装其提供的交易终端或 PB 系统客户端，部分投资机构也可视实际情况，经证券公司评估同意其使用自身投资管理系统接入交易。

（1）使用交易终端、PB 系统参与交易

交易终端是指会员传统证券集中交易平台的申报通道，包括但不限于网上交易、移动端交易等，可有效支持交易所债券市场的现券匹配成交等业务。

PB 系统是指证券公司为机构客户提供的，集合了投资决策、交易下单、流程审批、风险监控、成交确认、资金处理、投资清算、数据统计等功能的综合金融交易服务系统。目前市场上使用较为普遍的 PB 系统主要由相关软件供应商开发，也有少部分证券公司的 PB 系统为自主研发。债券投资者通过 PB 系统可实现各类债券业务功能。

（2）使用自身投资管理系统接入交易

公募基金、保险公司及保险资产管理公司、商业银行及商业银行理财机构、期货公司资产管理子公司等金融机构及其管理的各类产品，若证券公司交易终端、PB 系统无法满足其正常交易需求的，证券公司可在确保合规与风险可控的前提下允许前述债券投资者的相关系统接入。

在前述情况下，相关债券投资者不得将相关系统转让、出借给第三方使用或为第三方提供接入服务，不得借助证券公司提供的接入服务违规出借账户或者违法从事相关业务活动。

3.2.7 委托指令

经纪客户要确保本方发出的交易指令所载明的相关内容真实、完整、准确，采用匹配成交方式的委托指令应当包括下列

内容：

- （1）证券账户号码；
- （2）证券代码；
- （3）交易方向；
- （4）委托数量；
- （5）委托价格；
- （6）本所及会员要求的其他内容

采用匹配成交方式的，经纪客户仅允许采用限价委托的方式委托证券公司下达委托指令。

经纪客户采用协商成交交易方式的委托指令内容，应当包含本指南第4章中协商成交交易方式所对应的申报要素。

经纪客户可通过交易终端、证券公司PB系统客户端或向证券公司书面报单等方式下达债券交易委托。经纪客户委托证券公司申报并达成债券交易的，应当及时向证券公司交付相应的债券或者资金。

证券公司应当建立完善的投资者适当性管理制度和债券交易监测监控系统，按照本所会员管理相关规则，对其经纪客户的债券交易委托指令进行核查，完成验资或验券操作后，冻结该客户账户资金或相应的债券。对不符合相关规定或可能严重影响正常交易秩序的委托指令应当拒绝接受。

3.2.8 委托撤销

经纪客户按照与证券公司的协定，可通过交易终端、证券

公司 PB 系统客户端或向证券公司书面报单等方式撤销委托指令的未成交部分。

经纪客户若通过交易终端、证券公司 PB 系统客户端下达债券交易委托的，对于未成交部分，客户可通过原方式下达撤销原委托的指令；经纪客户若以书面方式向证券公司进行债券交易委托的，对于未成交部分，同样以书面方式向证券公司下达撤销原委托的指令。证券公司在收到经纪客户撤销委托后，应准确及时地执行撤销委托指令的提交。

被撤销和失效的委托，证券公司应当在确认后及时向经纪客户返还相应的资金或者债券。

3.2.9 交易数据传输

经纪客户如采用证券公司 PB 系统客户终端或自有系统接入证券公司柜台系统提交委托指令时，可在日间实时或日终获取导出委托记录、成交回报、交易流水、资金头寸等数据。

经纪客户可与证券公司约定交易结算数据的接收方式及接收时点，证券公司应当保证如实向其经纪客户转发交易结算数据（可根据实际情况一次或多次转发交易结算数据）。证券公司还需按照约定时间，在其交易系统清算后，及时将资金账户电子对账单按约定方式发送给经纪客户，若经纪客户对电子对账单数据有疑义，证券公司应当协助排查问题原因，错误方应及时修正。

3.3 证券公司结算

证券公司接受经纪客户的债券交易委托后，应当按照委托的内容向本所申报，并承担相应的交易、结算责任。

证券公司接受经纪客户买卖委托达成交易的，经纪客户应当向证券公司交付其委托证券公司卖出的债券或其委托证券公司买入债券的款项，证券公司应当向经纪客户交付卖出债券所得款项或买入的债券。

通过证券公司结算的经纪客户的证券和资金适用分级结算原则，即登记结算机构负责办理登记结算机构与证券公司之间的集中清算交收，证券公司负责按照登记结算机构的结算规则与证券交易委托协议约定，办理其与经纪客户之间的清算交收。

4. 债券现券交易

在本所开展的债券现券交易应当遵循本所对前端控制、交易时间、申报成交、交易方式等事项的规定。

4.1 一般规定

4.1.1 持仓前端控制

（1）持仓前端控制定义

本指南所称持仓前端控制，是指本所对债券交易参与人证券账户卖出债券持仓进行检查，并对债券交易参与人所提交的申报实施前端控制的制度。

（2）持仓前端控制范围

本所对可以采用多边净额结算方式的债券实施持仓前端控制。

（3）持仓前端控制实施方式

对于符合净额结算标准的公募公司债券（含企业债券），债券申报卖出时，本所对卖出方证券账户进行持仓检查，并预冻结其申报数量（申报撤销后予以解冻）。交易达成后，本所对卖出方证券账户实时扣减持仓，买入方所在证券账户实时增加持仓。

4.1.2 交易日和交易时间

本所债券交易日为每周一至周五。国家法定假日和本所公告的休市日，本所债券市场休市。本所另有规定的除外。

现券交易采用匹配成交方式的，每个交易日的 9:15 至 9:25

为开盘集合匹配时间，9:30 至 11:30、13:00 至 15:30 为连续匹配时间；本所另有规定的除外。

采用协商成交方式的，每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 15:30 为交易时间，本所另有规定的除外。（《债券交易规则》中有关 15:30-20:00 夜盘交易相关规定暂缓实施。）

交易时间内因故停市，交易时间不作顺延。根据市场发展需要，本所可以调整债券交易时间。

4.1.3 交易申报

（1）申报数量要求

采用匹配成交方式的，债券现券的申报数量应当为 10 万元面额或者其整数倍，卖出时不足 10 万元面额部分，应当一次性申报；采用协商成交方式的，债券现券申报数量应当不低于 1000 元面额，且为 100 元面额整数倍。本所可以根据市场情况调整相关申报数量要求。

债券现券交易单笔最大申报数量不超过 100 亿元面额。

（2）申报价格最小变动单位及价格限制

债券现券交易申报的价格单位为“每百元面额债券的价格”，本所另有规定的除外。

债券交易设置申报价格最小变动单位及价格限制。

1) 价格最小变动单位

采用匹配成交方式的，债券现券的申报价格最小变动单位为 0.001 元；采用协商成交方式的，债券交易的申报价格最小变

动单位为 0.0001 元。本所另有规定的除外。本所可以根据市场发展需要，调整申报价格最小变动单位。

2) 价格限制

债券现券交易申报中，申报价格应符合一定的要求。不符合申报价格范围要求的，交易系统不接受相关申报。有效申报价格范围的确定，详见本指南第 4.2 节相关内容。

有效申报价格范围不在价格最小变动单位范围内的，按照四舍五入原则取至相应的价格最小变动单位。

(3) 涨跌幅限制

债券交易不设价格涨跌幅限制，本所另有规定的除外。

(4) 价格类型

债券现券实行净价交易。

(5) 申报有效期及申报撤销

1) 申报撤销

当日提交的债券交易申报当日有效，未成交的申报可以撤销，本所另有规定的情形除外。每个交易日 9:20 至 9:25 的开盘集合匹配阶段，交易系统不接受匹配成交的撤销申报。

其他接受申报的时间内，未成交的申报可以撤销；若原申报订单已部分成交，则未成交的部分可以撤销；若原申报订单已经撤销成功，则撤销申报作废。若原申报订单也是撤销申报，则撤销申报作废。

撤销指令经本所确认方为有效。债券临时停牌期间，本所

接受符合要求的撤销申报。

撤销指令经本所交易系统确认后实时生效。

2) 撤销申报的要素及要求

撤销申报要素包括证券代码、证券账户、原申报编号等，相关要素应与原交易申报匹配。

4.1.4 成交

(1) 成交原则

债券交易申报依据法律法规和本所业务规则的相关规定以及债券投资者的风险控制要求和交易需求，按照价格竞争性、数量匹配性、时间优先性等原则达成交易。

价格竞争性：较高价格买入申报优先于较低价格买入申报，较低价格卖出申报优先于较高价格卖出申报。

数量匹配性：在买卖双方确认的数量范围内达成交易。

时间优先性：买卖方向、价格相同的，先申报者优先于后申报者。先后顺序按本所接受申报的时间确定。

(2) 回转交易

债券现券交易实行当日回转交易，债券投资者当日买入的债券可以在当日卖出。本所另有规定的除外。

4.2 交易方式

本所现阶段推出债券现券匹配成交和协商成交交易方式。其他交易方式暂缓实施，推出时间另行通知。

本所根据债券的信用资质、发行方式和投资者适当性等不

同特点安排差异化的交易方式。本所可根据市场情况和债券资信状况的变化，在债券上市交易期间动态调整债券交易机制、投资者适当性及信息披露安排，并向市场及时公布。

4.2.1 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并实行多边净额结算的交易方式。

(1) 申报要求

1) 集合匹配与连续匹配

匹配成交采用集合匹配和连续匹配两种方式。集合匹配是对规定时间内接受的交易申报一次性集中匹配的成交方式。连续匹配是对接受的交易申报逐笔连续匹配的成交方式。

集合匹配期间未成交的交易申报，自动进入连续匹配。

2) 申报类型

采用匹配成交方式的，采用限价申报。

限价申报按照优于或者等于限定的价格进行债券交易，即按限定的价格或低于限定的价格申报买入证券，按限定的价格或高于限定的价格申报卖出证券。

3) 申报要素

限价申报要素应当包括证券代码、交易方向、价格、数量、证券账户号码等内容。

4) 开盘集合匹配有效申报价格范围

开盘集合匹配阶段，债券的有效申报价格范围为前收盘价的上下 30%。本所另有规定的除外。

债券上市首日，以该债券的发行价格作为前收盘价。

5) 连续匹配、盘中临时停牌复牌集合匹配有效申报价格范围

连续匹配、盘中临时停牌复牌集合匹配阶段，债券的有效申报价格范围为匹配成交最近成交价格的上下 20%。本所另有规定的除外。

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：最高买入申报价格高于前收盘价或者匹配成交最近成交价的，以最高买入申报价格为基准调整有效申报价格范围；最低卖出申报价格低于前收盘价或者匹配成交最近成交价的，以最低卖出申报价格为基准调整有效申报价格范围。

当日无交易的，以前收盘价作为最近成交价。

根据市场发展需要，本所可以调整有效申报价格范围。

(2) 成交规则

匹配成交遵循价格优先、时间优先的成交原则。

1) 集合匹配时，成交价格确定原则为：

可实现最大成交量的价格；高于该价格的买入申报与低于该价格的卖出申报全部成交；与该价格相同的买方或者卖方至少有一方全部成交。

两个以上价格符合上述条件的，取在该价格以上的买入申报累计数量与在该价格以下的卖出申报累计数量之差最小的价格为成交价；买卖申报累计数量之差仍存在相等情况的，开盘集合匹配时取最接近前收盘价的价格为成交价，盘中临时停牌复牌集合匹配时取最接近最近成交价的价格为成交价。

集合匹配阶段的所有交易以同一价格成交。

2) 连续匹配时，成交价格确定原则为：

最高买入申报价格与最低卖出申报价格相同，以该价格为成交价格；买入申报价格高于集中申报簿当时最低卖出申报价格时，以集中申报簿当时的最低卖出申报价格为成交价；卖出申报价格低于集中申报簿当时最高买入申报价格时，以集中申报簿当时的最高买入申报价格为成交价。

连续匹配的申报可以部分成交。

(3) 成交数据发送

成交后，交易系统将逐笔成交数据分别发送给交易对应的买卖双方，债券投资者仅能收到与自己相关的成交数据。

(4) 临时停牌

债券现券交易匹配成交出现以下异常波动情形之一的，本所可以对其实施盘中临时停牌：

1) 公司债券（含企业债券）盘中成交价格较前收盘价首次上涨或下跌达到或超过 20% 的，临时停牌持续时间为 30 分钟，临时停牌时间跨越 15:27 的，于当日 15:27 复牌；较前收盘价首

次上涨或下跌达到或超过 30%的，临时停牌时间持续至当日 15:27。

2) 本所认为可以实施盘中临时停牌的其他情形。

盘中临时停牌和复牌的具体时间以本所公告为准。本所可以视盘中交易情况调整相关指标阈值，或采取进一步的盘中风险控制措施。

投资者可以在盘中临时停牌期间撤销未成交的申报。临时停牌结束后，交易系统对已收到的买卖申报实行盘中临时停牌复牌集中匹配，复牌后继续当日交易。

实施盘中临时停牌后，本所将通过官网（www.bse.cn）和行情数据接口对外发布公告。

临时停牌期间，交易系统对协商成交申报照常接收和处理。

4.2.2 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。

（1）协商方式与流程

债券投资者可以按照相关规则、本指南规定及内部风险控制要求，委托中介服务机构或者自行寻找交易对手，按照债券交易成交原则就债券交易要素协商达成一致。

（2）申报要素

协商成交的申报要素应当包括交易品种、交易方向、价格、数量、证券账户号码、本方及对手方信息、结算方式、结算周

期、约定号等内容。

（3）成交原则

交易要素协商确定之后，由交易双方分别填妥申报要素后各自提交申报。申报约定号相同的情况下，通过证券代码、本方交易商、本方交易员、对手方交易商、对手方交易员等匹配要素查找对手方订单。

按上述方式找到对手方后，在满足价格、申报数量、结算周期、结算方式等要素一致以及交易方向相反的情况下进行成交。

5. 交易信息

本所向市场发布债券交易申报信息、成交信息及统计信息。

5.1 交易申报信息

集合匹配阶段，本所向市场实时发布参考价格、匹配量、未匹配量等信息；若未产生集合匹配参考价的，则发布实时最优一档买卖申报价格、数量。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。

连续匹配阶段，本所向市场发布最优五档买卖申报价格、数量等信息。

此外，本所向市场发布申报数量 100 万元面额及以上的匹配成交逐笔交易申报信息，发布内容包括证券代码、行情类别、申报时间、价格、数量、买卖方向、结算方式等。

5.2 成交信息

5.2.1 即时成交行情

本所向市场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、当日最高成交价、当日最低成交价、当日加权平均价、当日累计成交数量、当日累计成交金额、当日累计成交笔数、匹配成交最近成交价、匹配成交累计成交数量、匹配成交累计成交金额等。

开盘价和收盘价计算所采用的成交数据为各类交易方式达成的成交数据。本所另有规定的除外。

当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

5.2.2 逐笔成交行情

本所向市场发布每只债券的逐笔成交行情，具体信息包括证券代码、交易方式、成交时间、成交价格、成交数量、成交金额等。其中，匹配成交仅发布单笔成交数量为 100 万元面额及以上的逐笔成交信息。

5.3 统计信息

本所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等。

6. 价格偏离报备

6.1 价格偏离报备范围

通过协商成交参与本所债券现券交易（特定债券除外），交易价格（净价）同时偏离交易当日日终中债估值和中证估值的幅度大于或者等于 2%。

6.2 报备流程

交易双方的债券交易参与人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，可豁免报告义务。

若涉及价格偏离的交易一方或双方为经纪客户的，会员应当及时向相关经纪客户了解情况并按前款规定向本所报告该笔交易。

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

6.3 报备内容

债券交易参与人应当填写《债券交易价格偏离情况说明表》（详见附件 4、附件 5，其中附件 4 提供盖章扫描件，附件 5 提供 excel 电子表格），报告内容包括交易方的基本信息、交易要素、交易情况及偏离原因等。债券交易参与人应当确保其报告的信息真实、准确、完整、及时。

6.4 报备方式

债券交易参与者应当将包含相关内容的《债券交易价格偏离情况说明表》（扫描件和 excel 电子表格）发送至本所公共邮箱（report_bond@bse.cn），邮件主题格式统一为“机构名称+交易日期+证券代码+账户名称”。其中扫描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表

债券交易参与者申请表

北京证券交易所：

经我公司研究决定，特向贵所申请成为债券交易参与者，现将有关事项申请如下：

债券交易参与者基本信息登记表				
机 构 信 息	机构名称			
	机构类型	☐ 政策性银行 ☐ 商业银行 ☐ 银行理财子公司 ☐ 保险公司 ☐ 保险资管机构 ☐ 养老金管理公司 ☐ 基金管理公司 ☐ 其他：		
	统一社会信用代码			
	联系地址			
	法定代表人		注册资本	
	注册地址			
机 构 要 求	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） 亿元	具有发行公募资产管理产品 资格（资产管理机构填写）	是 ☐ 否 ☐	
		以上如选否，最近一个会计年 度年末管理资产（资产管理机 构填写） ⁵	亿元	
	最近一年全市场债券交易量		亿元	
	是否具有独立的债券交易团队		是 ☐ 否 ☐	

⁵ 如果资产管理机构具有公募资格，本项无需填写。

	是否具有完善的交易业务管理制度和风险控制制度			是□ 否□
	是否具有能够支持开展债券交易的相关技术系统			是□ 否□
	是否近 2 年无债券交易结算重大违法违规行为			是□ 否□
	是否为上海证券交易所或深圳证券交易所债券交易参与人			是□ 否□
经 办 人	姓名		部门	
	职务		电子邮箱	
	手机		固话（带区号）	

我公司在此郑重承诺：

一、遵守法律、法规、规章及北京证券交易所相关业务规则，依法参与北京证券交易所债券业务。

二、诚实守信、自觉遵守商业道德，维护北京证券交易所债券市场秩序。

三、同意遵守北京证券交易所关于债券交易参与人的相关规定，接受北京证券交易所的自律管理。

四、如违反法律法规规章及北京证券交易所相关业务规则，接受北京证券交易所做出的监管措施，并对此承担一切法律责任。

我公司承诺符合《北京证券交易所债券交易规则》等规则文件中规定的债券交易参与人条件，并保证向北京证券交易所提供的书面和电子申请资料真实、准确、完整与合法。

申请人（加盖公章）：

经办人（签字）：

年 月 日

附件 2 交易单元相关申请表

交易单元开通申请表

申请类型	☐ 初次开通交易单元 ☐ 新增交易单元				
交易参与人名称		交易参与人代码			
交易单元编号		交易单元名称		(注: XX 证券-类型-特殊用途-结算模式(-债券专用))	
交易网关号		交易单元开通日期		(注: 由北交所、全国股转公司填写)	
交易单元用途					
交易单元交易权限	☐ 普通股 ☐ 优先股 ☐ 可转债 ☐ 公司债券(含企业债券)*不含可转债 ☐ 两网及退市 A 类股票 ☐ 退市 B 类股票(勾选前请确保: ①交易单元类型为“经纪” ②申请人已向中国结算北京分公司申请开通 B 类股份转让结算业务并交纳 B 类保证金) ☐ 其他: _____				
交易单元类型	☐ 经纪交易单元 ☐ 自营交易单元 ☐ 做市交易单元 ☐ 资管交易单元 ☐ 融资融券交易单元 ☐ 其他: _____				
是否为机构专用单元	☐ 是 ☐ 否				
是否债券专用交易单元	☐ 是 ☐ 否				
经办人		电话		E-mail	
为在贵所(司)开展交易业务, 本公司拟申请开通交易单元, 同时承诺: 理解并遵守北交所和全国股转系统相关业务规则、中国结算北京分公司有关业务规则以及其它相关法律、法规、规则的规定, 依法合规开展业务。 申请单位盖章:					
交易运行管理部意见(盖章) ☐ 同意办理 经办人: 负责人: 日期:					
中国结算北分结算业务部意见(盖章) ☐ 同意办理 经办人: 负责人: 日期:					

深证通业务审核	
☐ 审核无误	
经办人：	日期：
深证通技术操作（盖章）	
☐ 已操作	
操作人：	日期：

交易单元出租申请表

出租方名称		出租方交易参与人代码	
承租方名称			
交易单元名称	(注: XX 证券-出租-承租方简称-托管(-债券专用))	交易单元编号	
交易单元开通生效日期	(注: 由北交所、全国股转公司填写)	托管银行	
交易单元交易权限	☐ 普通股 ☐ 优先股 ☐ 可转债 ☐ 公司债券(含企业债券)*不含可转债 ☐ 两网及退市 A 类股票 ☐ 退市 B 类股票(勾选前请确保: ①交易单元类型为“经纪”②申请人已向中国结算北京分公司申请开通 B 类股份转让结算业务并交纳 B 类保证金) ☐ 其他:_____		
是否债券专用交易单元	☐ 是 ☐ 否		
交易单元用途	☐ 基金 ☐ 保险 ☐ 其他_____		
经办人		电话	E-mail
出租方盖章:		承租方盖章:	
交易运行管理部意见(盖章) ☐ 同意办理 经办人: _____ 负责人: _____ 日期: _____			
中国结算北分结算业务部意见(盖章) ☐ 同意办理 经办人: _____ 负责人: _____ 日期: _____			
深证通业务审核 ☐ 审核无误 经办人: _____ 日期: _____			
深证通技术操作(盖章) ☐ 已操作 操作人: _____ 日期: _____			

交易单元变更申请表

交易单元编号					
交易单元变更原因					
变更前 (未变更项无需填写)	交易单元名称				
	交易单元 交易权限	☐ 普通股 ☐ 优先股 ☐ 可转债 ☐ 公司债券(含企业债券)*不含可转债 ☐ 两网及退市 A 类股票 ☐ 退市 B 类股票 ☐ 其他: _____			
	交易参与人名称				
	交易参与人代码				
变更后 (未变更项无需填写)	交易单元名称				
	交易单元 交易权限	☐ 普通股 ☐ 优先股 ☐ 可转债 ☐ 公司债券(含企业债券)*不含可转债 ☐ 两网及退市 A 类股票 ☐ 退市 B 类股票 ☐ 其他: _____			
	交易参与人名称				
	交易参与人代码				
经办人		电话		E-mail	
申请单位盖章:					
交易运行管理部意见(盖章) ☐ 同意办理 经办人: _____ 负责人: _____ 日期: _____					
中国结算北分结算业务部意见(盖章) ☐ 同意办理 经办人: _____ 负责人: _____ 日期: _____					

交易单元撤销申请表

交易单元名称		交易单元编号	
交易单元撤销原因			
撤销生效日期	(注：由北交所、全国股转公司填写)		
交易单元类别	☐ 经纪交易单元 ☐ 自营交易单元 ☐ 做市交易单元 ☐ 资管交易单元 ☐ 融资融券交易单元 ☐ 其他：_____		
交易单元撤销承诺	一、 本公司撤销上述交易单元后，仍承担该交易单元在撤销前因交易产生的责任。 二、 本公司上述交易单元同时满足以下条件： 1. 该交易单元无卖空，无挂帐，证券余额为零； 2. 该交易单元无透支，无拖欠交易单元使用费及其它费用； 3. 该交易单元未涉及与本公司的法律纠纷案件； 4. 如该交易单元参加股份合并清算，将办理停用股份合并清算手续； 5. 如该交易单元已开通 B 股交易，其交易将一并撤销。 三、自申请交易单元撤销之日起，在办理交易单元撤销手续期间，不再使用上述交易单元，否则因交易、清算等所产生的一切法律关系及法律后果，由本公司完全承担责任，并协助贵公司进行处理。		
经办人		电话	E-mail
申请单位盖章：			
交易运行管理部意见（盖章） ☐ 同意办理 经办人：_____ 负责人：_____ 日期：_____			
中国结算北分结算业务部意见（盖章） ☐ 同意办理 经办人：_____ 负责人：_____ 日期：_____			
深证通业务审核 ☐ 审核无误 经办人：_____ 日期：_____			
深证通技术操作（盖章） ☐ 已操作 操作人：_____ 日期：_____			

附件 3 债券交易参与人业务联络基本信息表

债券交易参与人业务联络基本信息表

公司名称		
债券交易业务 条线负责人	姓名	
	部门	
	手机	
	电话	
	电子邮件	
债券交易业务 联络人	姓名	
	部门	
	手机	
	电话	
	电子邮件	
债券交易业务 联络人 (非必填)	姓名	
	部门	
	手机	
	电话	
	电子邮件	
债券交易业务 联络人 (非必填)	姓名	
	部门	
	手机	
	电话	
	电子邮件	

附件 4 债券交易价格偏离情况说明表

债券交易价格偏离情况说明表

机构名称：

填表人：

联系电话：

填表日期：

债券简称		债券代码	
账户名称		证券账户	
委托/申报时间		委托/申报方向	
委托/申报数量 (百元面额/张)		委托/申报价格 (元)	
成交时间		成交数量(百元面额/张)	
成交价格(元)		成交价格较中债估值偏离(%)	向上偏离： % 向下偏离： %
		成交价格较中证估值偏离(%)	向上偏离： % 向下偏离： %
交易情况及偏离原因			

说明：成交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，债券交易参与人应填本表。

机构名称（盖章）：

年 月 日

附件 5 债券交易价格偏离情况说明表（提供 excel 电子表格）

债券交易价格偏离情况说明表

填表日期	机构名称	填表人	联系电话	债券简称	债券代码	账户名称	证券账户	委托/申报时间	委托/申报方向	委托/申报数量（百元面额/张）	委托/申报价格（元）	成交时间	成交数量（百元面额/张）	成交价格（元）	成交价格较中债估值的偏离（%）	成交价格较中证估值的偏离（%）	交易情况及偏离原因

填写说明：

- 1. “填表日期”：按照“YYYY/MM/DD”的格式填写，使用文本格式。示例“2024/01/01”。
- 2. “委托/申报时间”“成交时间”：精确到秒，使用文本格式。示例“10:11:23”。
- 3. “委托/申报方向”：填写“买入”或者“卖出”。
- 4. “成交价格较中债估值的偏离（%）”“成交价格较中证估值的偏离（%）”：向上偏离是指成交价格大于相应估值，填写正值，示例“3.5%”；向下偏离是指成交价格低于相应估值，填写负值，示例“-3.5%”。