



# 上海证券交易所 固定收益证券综合电子平台 用户使用手册

文档状态	<input type="checkbox"/> 初稿	文档标识	PROJ-FISP-UG
	<input type="checkbox"/> 评审通过	当前版本	7.8.2
	<input type="checkbox"/> 修改	作者	
	<input checked="" type="checkbox"/> 发布	部门/厂商	上海证券交易所
	<input type="checkbox"/> 作废	完成日期	2023.04.27

©上海证券交易所. 版权所有

## 文档版本历史表

版本号	作者	日期	修订说明
V 1.0	李晓明、胡月	2007-04-20	创建
V 1.1	李晓明、胡月	2007-05-18	根据系统实际情况调整
V 1.2	李晓明、胡月	2007-06-06	根据需求变更进行调整
V 1.3	李晓明、胡月	2007-06-19	根据需求变更进行调整
V 1.4	李晓明、胡月	2007-07-03	根据需求变更进行调整
V 1.5	李晓明、胡月	2007-07-30	新增质押券出入库明细表，转托管明细表
V 1.6	李晓明、胡月	2007-08-05	新增客户质押券出入库明细表
V 1.7	李晓明、胡月	2007-09-17	针对新增公司债现券做相关调整
V 1.8	李晓明、胡月	2007-11-09	针对新增成交申报信息页做相关调整
V 1.9	李晓明、胡月	2008-03-21	针对协议交易信息页做相关调整
V 2.0	陈曼	2009-03-12	新增到期收益率相关说明
V 3.0	李晓明	2010-8-27	新增撮合申报、大宗交易等功能说明
V3.1	周洪华	2012-08-10	中小企业私募债功能说明
V3.6	周洪华	2014-08-04	质押式协议回购功能
V5.0	周洪华	2014-12-19	固定收益轻型化改造
V5.1	周洪华	2015-05-22	信贷资产支持证券
V5.2	周洪华	2015-10-22	可交换公司债券换股
V5.4	陆军	2016-07-07	债券回售
V6.5	乔旭峰	2019-06-10	合并交易
V6.7	乔旭峰	2019-12-06	CDS 凭证
V6.8	乔旭峰	2020-11-06	双人复核
V6.9	乔旭峰	2020-12-12	CDS 凭证、群组管理等
V7.1	乔旭峰, 林建光	2021-03-21	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 非交易改造（换股、转股、回售、出入库，去除辅助代码）；</li> <li>2. 新增公募 REITs 产品及其现券交易功能；公募 REITs 暂不支持协议交易；</li> <li>3. REITs 协议回购（含限售部分）；</li> <li>4. RTGS 交收结果查询-可查询当日交收结果；</li> <li>5. 询价 20 分钟限制去除-当日交易时间内均可确认；</li> <li>6. 冰山订单优化-冰山订单显示数量与全额成交互斥；</li> <li>7. 机构账户名称显示（指定对手方）；</li> <li>8. 授信关注名单-用于设置对手方交易权限，类似黑名单功能；</li> <li>9. 选择潜在投资者（询价）-以提高询价成交概率；</li> </ol>
V7.2.3.4	乔旭峰, 林建光	2021-07-08	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 新增合并申报、竞买（单主体中标）交易；</li> <li>2. 协议回购成交查询中增加交收结果；</li> <li>3. 成交明细查询中增加账户名称；</li> <li>4. 可自选结算方式（指定对手方、竞买、合并申报）；</li> <li>5. 面向部分交易商报价（确定报价、待定报价）；</li> <li>6. 支持信用账户卖出现券（指定对手方）；</li> <li>7. 交易员与证券账户解绑；证券账户与席位改为手工输入；</li> <li>8. 对担保券 RTGS 结算进行持仓控制-总卖出量不可超过日初</li> </ol>

			持仓;
V7.3.2.0	林建光	2021-08-18	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 新增公募可转债产品类型, 支持意向申报、指定对手方申报; 不可在固收转股;</li> <li>2. 利率债、公司债、仅在平台挂牌债券、特定债券均可进行双向报价、询价、意向报价、指定对手方、合并申报、竞买;</li> <li>3. 国债现券产品类型更名为利率债现券;</li> <li>4. 可作为 CDS 合约、CDS 凭证参考债务的产品类型包含利率债现券、公司债现券、仅在平台挂牌债券、特定债券、公募 REITs、公募可转债。</li> <li>5. 竞买最小申报数量 100 手, 步长 1 手;</li> </ol>
V7.5.3.0	林建光	2022-03-30	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 新增 CDX 产品及交易功能;</li> <li>2. 新增债券 ETF 挂牌并可作为协议回购质押券;</li> <li>3. 债券交易新规相关改造;</li> <li>4. 产品信息中增加扩位简称。</li> </ol>
V7.6.3.0	林建光	2022-06-30	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 公募可转债首日波动幅度为发行价上下 30%, 次日起波动幅度为前收盘价 20%; 价格变动单位改为 1 厘;</li> <li>2. 成交明细查询中增加结算方式字段;</li> <li>3. 单位“手”改为“千元面额”;</li> <li>4. 交易商更名为债券交易参与者;</li> <li>5. 指定对手方更名为协商成交;</li> <li>6. 席位更名为交易单元;</li> <li>7. “匿名发送”更名为“是否匿名”;</li> <li>8. “底价”更名为“价格区间”;</li> </ol>
V7.7.1.0	林建光	2022-08-30	1. 修订回售撤销相关描述 (仅文字调整, 不涉及代码修改);
V7.7.3.2	林建光	2022-12-01	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 协议回购, REITs 限售份额作为质押券时增加“限售期(月)”信息;</li> <li>2. CDX 合约意向申报中增加批量导入功能;</li> </ol>
<a href="#">V7.7.3.5</a>	<a href="#">赵文杰</a>	<a href="#">2023-03-23</a>	<a href="#">交易端本方确定报价部分最多显示 100 条数据</a>
<a href="#">V7.8.1.0</a>	<a href="#">赵文杰</a>	<a href="#">2023-03-23</a>	<a href="#">协议回购 REITs 协商成交申报限售期扩增 24 个月选项</a>
<a href="#">V7.8.2.0</a>	<a href="#">赵文杰</a>	<a href="#">2023-04-07</a>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、<a href="#">对协议回购到期确认申报、到期续做申报、换券申报、提前终止申报和解除质押申报增加查询功能</a></li> <li>2、<a href="#">增加“协商成交对手方申报信息查询”</a></li> <li>3、<a href="#">修订协商成交章节持仓处理描述</a></li> </ol>

## 目 录

一、 系统概述 .....	10
1.1 编写目的 .....	10
1.2 背景 .....	10
1.3 系统定位 .....	10
1.4 系统特点 .....	11
1.5 推荐配置 .....	12
二、 用户登录 .....	13
三、 主界面 .....	14
3.1 报价信息窗口 .....	15
3.2 行情信息窗口 .....	18
3.3 行情走势信息窗口 .....	22
3.4 本方确定报价信息窗口 .....	23
3.5 本方成交信息窗口 .....	24
3.6 状态栏 .....	26
四、 交易功能 .....	28
4.1 交易服务介绍 .....	28
4.1.1 交易状态 .....	28
4.1.2 交易类型 .....	29
4.2 双向报价 .....	38
4.2.1 双向报价管理 .....	38
4.2.2 新增双向报价 .....	39
4.3 确定报价 .....	43
4.3.1 确定报价点击成交 .....	43
4.4 待定报价 .....	45
4.4.1 待定报价点击回复 .....	45
4.4.2 待定报价确认成交 .....	46
4.5 询价交易 .....	48
4.5.1 询价管理 .....	48
4.5.2 询价发送 .....	49
4.5.3 被询价管理 .....	54
4.5.4 询价回复 .....	55
4.5.5 询价确认 .....	57
4.5.6 询价撤销 .....	58
4.6 协议交易 .....	59
4.6.1 协议交易录入管理 .....	59
4.6.2 协议交易录入（债券交易参与者） .....	60
4.6.3 协议交易录入（客户） .....	62
4.7 转托管 .....	63
4.8 协商成交报价 .....	66
4.9 意向申报 .....	71
4.10 协议回购意向申报 .....	76
4.11 协议回购成交申报 .....	80



4.11.1 成交申报 .....	80
4.11.2 成交申报撤销 .....	84
4.11.3 成交申报确认 .....	86
4.11.4 成交申报拒绝 .....	88
4.12 REITs 协议回购成交申报 .....	89
4.12.1 成交申报 .....	89
4.12.2 成交申报撤销 .....	94
4.12.3 成交申报确认 .....	96
4.12.4 成交申报拒绝 .....	98
4.13 协议回购到期确认申报 .....	99
4.14 协议回购到期续做申报 .....	101
4.14.1 到期续做申报 .....	101
4.14.2 到期续做申报撤销 .....	104
4.14.3 到期续做申报确认 .....	106
4.14.4 到期续做申报拒绝 .....	109
4.15 协议回购解除质押申报 .....	111
4.15.1 解除质押申报 .....	111
4.15.2 解除质押申报撤销 .....	113
4.15.3 解除质押申报确认 .....	115
4.15.4 解除质押申报拒绝 .....	117
4.16 协议回购换券申报 .....	118
4.16.1 换券申报 .....	118
4.16.2 换券申报撤销 .....	121
4.16.3 换券申报确认 .....	123
4.16.4 换券申报拒绝 .....	126
4.17 协议回购提前终止申报 .....	128
4.17.1 提前终止申报 .....	128
4.17.2 提前终止申报撤销 .....	130
4.17.3 提前终止申报确认 .....	132
4.17.4 提前终止申报拒绝 .....	134
4.18 可转换债换股申报 .....	136
4.19 债券回售申报 .....	138
4.20 债券回售撤销申报 .....	140
4.21 三方回购担保品管理 .....	142
4.21.1 三方回购转入申报 .....	142
4.21.2 三方回购转出申报 .....	144
4.22 三方回购授信管理 .....	147
4.22.1 三方回购授信名单管理 .....	147
4.22.2 三方回购确认授信 .....	149
4.22.3 三方回购拒绝授信 .....	151
4.22.4 三方回购授信获得情况 .....	152
4.23 三方回购交易申报 .....	153
4.23.1 三方回购意向申报 .....	153
4.23.2 三方回购协商成交申报 .....	157
4.23.3 三方回购协商成交撤销 .....	161

4.23.4 三方回购协商成交申报确认 .....	162
4.23.5 三方回购协商成交申报拒绝 .....	164
4.24 三方回购到期申报 .....	166
4.24.1 三方回购到期购回申报 .....	166
4.24.2 三方回购到期续做申报 .....	168
4.24.3 三方回购到期续做申报确认 .....	172
4.24.4 三方回购到期续做申报拒绝 .....	174
4.25 三方回购存续期管理 .....	176
4.25.1 三方回购换券申报 .....	176
4.25.2 三方回购换券申报撤销 .....	178
4.25.3 三方回购换券申报确认 .....	180
4.25.4 三方回购换券申报拒绝 .....	182
4.25.5 三方回购补券申报 .....	183
4.25.6 三方回购提前终止申报 .....	186
4.25.7 三方回购提前终止申报撤销 .....	189
4.25.8 三方回购提前终止申报确认 .....	191
4.25.9 三方回购提前终止申报拒绝 .....	194
4.26 三方回购违约处置 .....	195
4.26.1 解除质押申报 .....	195
4.26.2 解除质押申报撤销 .....	197
4.26.3 解除质押申报确认 .....	199
4.26.4 解除质押申报拒绝 .....	201
4.27 双非可转债转股 .....	203
4.28 合并申报交易 .....	205
4.28.1 合并申报交易 .....	205
4.28.2 合并申报确认 .....	208
4.29 CDS 合约协商成交申报 .....	210
4.29.1 CDS 合约协商成交申报 .....	210
4.29.2 CDS 合约协商成交申报撤销 .....	214
4.29.3 CDS 合约协商成交申报确认 .....	215
4.29.4 CDS 合约协商成交申报拒绝 .....	217
4.30 CDS 合约提前终止申报 .....	218
4.30.1 CDS 合约提前终止申报 .....	218
4.30.2 CDS 合约提前终止申报撤销 .....	221
4.30.3 CDS 合约提前终止申报确认 .....	222
4.30.4 CDS 合约提前终止申报拒绝 .....	224
4.31 CDS 合约信用事件申报 .....	225
4.31.1 CDS 合约信用事件申报 .....	225
4.31.2 CDS 合约信用事件申报撤销 .....	229
4.31.3 CDS 合约信用事件申报确认 .....	230
4.31.4 CDS 合约信用事件申报拒绝 .....	232
4.32 CDS 合约合约了结申报 .....	233
4.32.1 CDS 合约了结申报 .....	233
4.32.2 CDS 合约了结申报撤销 .....	235
4.32.3 CDS 合约了结申报确认 .....	237

4.32.4 CDS 合约了结申报拒绝 .....	239
4.33 CDS 凭证协商成交申报 .....	240
4.34 竞买交易 .....	243
4.34.1 竞买预约申报 .....	243
4.34.2 竞买申报 .....	247
4.34.3 竞买应价申报 .....	249
4.35 CDX 合约交易 .....	252
4.35.1 CDX 意向申报 .....	252
4.35.2 CDX 协商成交申报 .....	254
4.35.3 CDX 协商成交申报确认/拒绝 .....	262
4.35.4 CDX 提前终止申报 .....	264
4.35.5 CDX 提前终止申报确认/拒绝 .....	265
4.35.6 CDX 信用事件结算申报 .....	267
4.35.7 CDX 信用事件结算申报确认/拒绝 .....	269
4.35.8 CDX 合约了结申报 .....	270
4.35.9 CDX 了结申报确认/拒绝 .....	272
五、 查询统计 .....	275
5.1 产品查询 .....	275
5.2 证券查询 .....	280
5.3 收益率查询 .....	284
5.4 基准利率查询 .....	287
5.5 债券交易参与者限额查询 .....	288
5.6 确定报价查询 .....	289
5.7 待定报价查询 .....	292
5.8 询价明细查询 .....	292
5.9 成交明细查询 .....	293
5.10 协议交易查询 .....	294
5.11 转托管查询 .....	295
5.12 日初持仓明细查询 .....	296
5.13 协商成交报价查询 .....	297
5.14 私募债券持有账户数查询 .....	298
5.15 意向申报查询 .....	299
5.16 协议回购意向申报查询 .....	300
5.17 协议回购成交申报查询 .....	301
5.18 协议回购回购到期查询 .....	302
5.19 协议回购换券申报查询 .....	304
5.20 协议回购成交查询 .....	305
5.21 未结算协议回购查询 .....	306
5.22 中债托管账户查询 .....	307
5.23 中债成交明细打印 .....	308
5.24 换股申报查询 .....	308
5.25 回售申报查询 .....	309
5.26 回售撤销申报查询 .....	310
5.27 三方回购数据查询 .....	311
5.27.1 担保品查询 .....	311

5.27.2 备案查询 .....	312
5.27.3 意向申报查询 .....	313
5.27.4 指定对手申报查询 .....	314
5.27.5 到期购回查询 .....	316
5.27.6 到期购回查询 .....	317
5.27.7 换券申报查询 .....	318
5.27.8 补券申报查询 .....	319
5.27.9 提前终止查询 .....	320
5.27.10 解除质押查询 .....	321
5.27.11 三方回购成交查询 .....	322
5.27.12 未结算三方回购查询 .....	323
5.27.13 三方回购交收查询 .....	325
5.28 双非可转债转股申报查询 .....	326
5.29 现券 RTGS 交收结果查询 .....	327
5.30 信用保护（合约）查询 .....	328
5.30.1 协商成交申报查询 .....	328
5.30.2 提前终止申报查询 .....	329
5.30.3 信用事件申报查询 .....	330
5.30.4 合约了结申报查询 .....	331
5.30.5 当日合约成交查询 .....	332
5.30.6 合约汇总查询 .....	333
5.30.7 未结算合约查询 .....	333
5.30.8 成交合约查询 .....	334
5.30.9 核心债券交易参与者查询 .....	335
5.31 信用保护(凭证)查询 .....	336
5.31.1 协商成交申报查询 .....	336
5.32 合并申报查询 .....	337
5.33 竞买预约查询 .....	338
5.34 竞买申报查询 .....	339
5.35 竞买应价申报查询 .....	340
5.36 组合信用保护（合约）查询 .....	341
5.36.1 CDX 意向申报查询 .....	341
5.36.2 CDX 协商成交申报查询 .....	342
5.36.3 CDX 提前终止申报查询 .....	343
5.36.4 CDX 信用事件申报查询 .....	344
5.36.5 CDX 合约了结申报查询 .....	345
5.36.6 CDX 当日合约查询 .....	346
5.36.7 CDX 合约汇总行情 .....	347
5.36.8 CDX 历史合约查询 .....	348
5.36.9 CDX 合约成交查询 .....	349
5.36.10 CDX 核心债券交易参与者查询 .....	350
六、 报表统计 .....	352
6.1. 本方确定报价明细表 .....	352
6.2. 本方待定报价明细表 .....	354
6.3. 本方成交明细表 .....	355

6.4. 本方协议交易明细表 .....	356
6.5. 市场确定报价明细表 .....	357
6.6. 市场待定报价明细表 .....	358
6.7. 一级债券交易参与者做市报价明细表 .....	359
6.8. 转托管明细表 .....	360
七、 服务 .....	362
7.1. 研究报告 .....	362
7.1.1. 研究报告管理 .....	362
7.1.2. 研究报告上传 .....	363
7.1.3. 研究报告修改 .....	364
7.2. 公告信息查看 .....	365
7.3. 在线用户查看 .....	368
7.4. 成交数据下载 .....	368
八、 交易员定制 .....	370
8.1. 询价黑名单设置 .....	370
8.2. 默认账户指定 .....	371
九、 系统管理 .....	372
9.1. 债券交易参与者管理 .....	372
9.1. 托管银行交易单元设置 .....	373
9.2. 债券交易参与者账户管理 .....	375
9.3. 交易员管理 .....	376
9.3.1. 交易员修改 .....	377
9.3.2. 交易限额查询 .....	378
9.3.3. 交易限额设置 .....	379
9.4. 交易员账户管理 .....	380
9.5. 群组管理 .....	381
9.6. 关注名单管理 .....	386
十、 信息商数据下载 .....	388
10.1. 信息商登录 .....	388
10.2. 系统界面 .....	389
10.3. 行情下载 .....	389
十一、 常见问题 .....	391

## 一、 系统概述

### 1.1 编写目的

上海证券交易所固定收益证券综合电子平台（以下简称系统）用户手册的编写目的是根据系统交易端的具体实现，分功能点逐一详细介绍系统的使用方法。并配以相应图片说明，使得交易员可以较为容易的熟悉本系统并在最短的时间内用本系统进行报价，成交，查询统计，生成报表，上传研究报告，系统信息管理等操作。

用户手册的适用读者为：各债券交易参与人旗下交易员，上交所场务管理员也可参考。

### 1.2 背景

90 年代末以来我国证券市场特别是国债市场规模增长迅速，二级市场发展非常快速。2005 年底我国各类证券总存量已经达到 7.2 万亿元，全年证券交易金额达到 24.7 万亿元。虽然每年证券成交金额巨大，但总体而言，我国国债市场的流动性还有待进一步提高，以为其他各种金融工具提供定价基准。

为适应中国固定收益市场快速发展的环境，提高固定收益市场流动性，上海证券交易所决定建设“固定收益电子信息平台”，引入一级债券交易参与人做市机制，提高证券交易的效率和市场流动性，为国债等固定收益产品提供高效、低成本的批发交易平台。系统将更好的满足机构投资者的需要，增强上交所证券市场的吸引力，提升上交所证券交易量和市场份额。

上交所竞价系统与固定收益电子信息平台一起构成证券市场技术支持平台，竞价系统主要用于支持衍生产品市场和小额现券交易；固定收益电子信息平台为大额现券交易和其他非标准化固定收益产品提供更为灵活的交易平台，为国债做市商业务提供技术支持。

### 1.3 系统定位

系统定位于机构间市场，债券交易参与人（经证监会或人民银行批准从事证券自营业务并且交易活跃的证券公司、信托投资公司、基金管理公司、保险公司、财务公司等）作为市场参与主体，可以直接参与证券交易，普通投资者不能直接参与报价系统，债券交易参与人与代理的客户之间现券交易可以通过协议交易直

接将成交结果报告至报价系统。

目前，目标用户约 130 家，其中证券公司约 40 余家（创新类和规范类）、基金公司约 50 余家、持有证券专用交易单元的保险和财务公司约 30 余家。每家债券交易参与人预计不超过 5 个交易员通过报价系统进行交易。

债券交易参与人分为一级债券交易参与人和普通债券交易参与人，一级债券交易参与人向市场提供双边报价（做市），提供流动性。一级债券交易参与人资格由财政部、交易所共同指定。根据国债的剩余期限，将做市券种分为三类，短期（1 年）、中短期（3 年）、中期（7 年），每个一级债券交易参与人必须对三个类别中的一支进行做市，一级债券交易参与人向交易所提出做市券种申请，由交易所复核后，进行登记。报价系统为一级债券交易参与人提供卖空机制，提供做市便利，同时对于一级债券交易参与人的做市行为，定期进行评估。

## 1.4 系统特点

本系统的目标是建立适于机构参与的固定收益市场，多家指定债券交易参与人为市场提供流动性支持。

- 更好地服务各类机构投资者
- 以询价与做市商交易制度丰富交易模式
- 探索建立真正有效的证券市场做市商制度
- 促进证券市场的流动性，产生证券市场的真实，连续的市场公允价格
- 为机构投资者提供创新信息服务

为保证上述目标的实现，系统具备以下关键特征：

- 支持证券现券竞争性做市商制度
- 建立卖空机制，支持做市商提供市场流动性
- 真实报价，即报价反应真实交易意愿，其中确定报价为可执行报价
- 大宗交易更大的灵活性，可以对多个债券交易参与人进行询价
- 交易和结算直通车处理，实行净额担保交收制度
- 未来可以支持多个结算后台

## 1.5 推荐配置

CPU: Pentium 4 以上, 推荐 Pentium 4 3.0GHz

内存: 512MB 以上, 推荐 1024M DDR2

显示器: 支持 1024\*768 以上分辨率, 推荐使用 1024\*768 分辨率

硬盘: 在操作系统安装盘和本平台所在盘各保持 100M 以上的可用空间

操作系统: Windows2000+SP4 以上, 推荐 WindowsXP+SP2

系统自动升级条件: 需使用操作系统管理员权限运行本系统方可进行自动升级



## 二、 用户登录



由于系统通过互联网进行交易，因此，安全性至关重要，仅有用户名、密码的验证体系是不够的。系统采用 CA 证书+用户名、密码的方式进行登录验证。

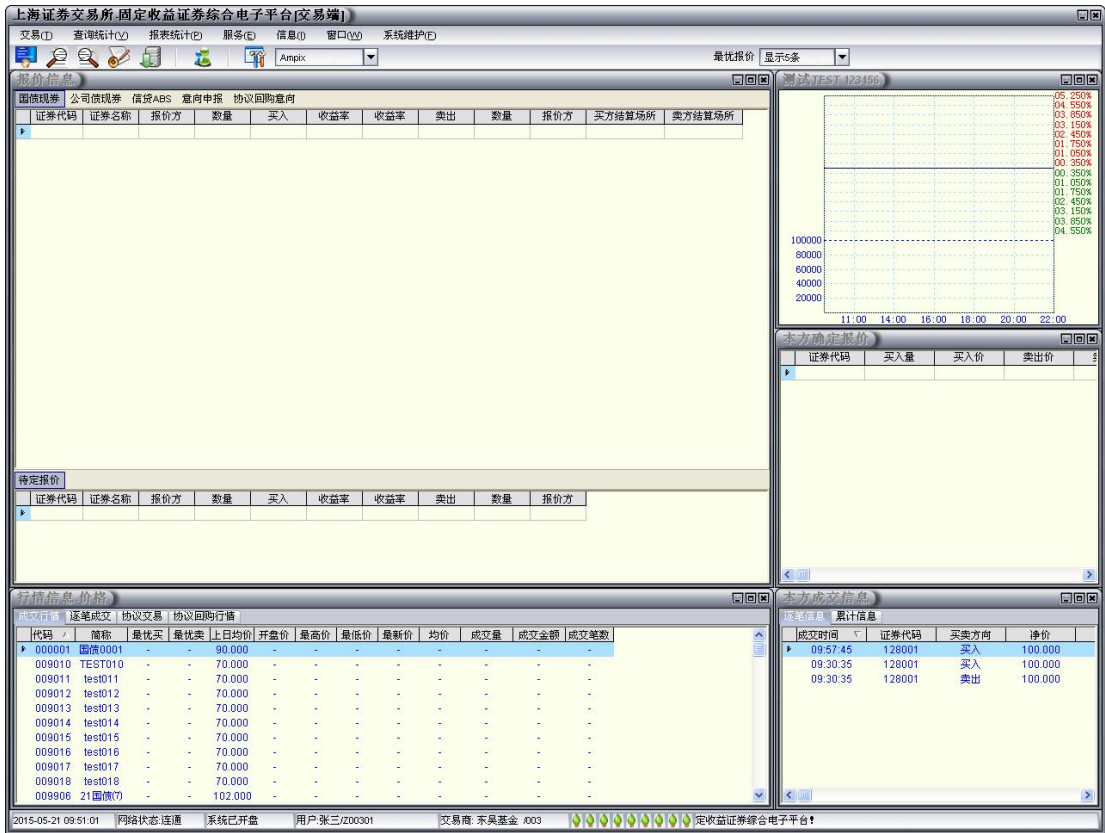
选择“互联网”，证书口令、用户口令都必输，服务器端口默认为 443，选择“专网”只能输入用户口令，服务器端口默认为 80

用户初次使用本系统，应首先设置服务器地址和服务器端口，然后输入用户账号和口令（用户账号为交易员代码，登录口令由 CA 证书给出）。对于首席交易员和普通交易员，应选择使用 CA 证书，并输入 CA 证书的口令；对于信息商，应选择使用数据库口令，并输入用户密码。对于查询用户，应选择使用数据库口令，并输入用户账号（即交易员代码）、用户密码（由场务管理员给定，可在系统中更改）、服务器地址和服务器端口，如果通过代理服务器，则需要输入提供该代理的用户和密码。在一次登录后将记录在本机，以为用户提供最大的方便。

**注：需使用操作系统管理员权限运行本系统方可进行自动升级**

### 三、主界面

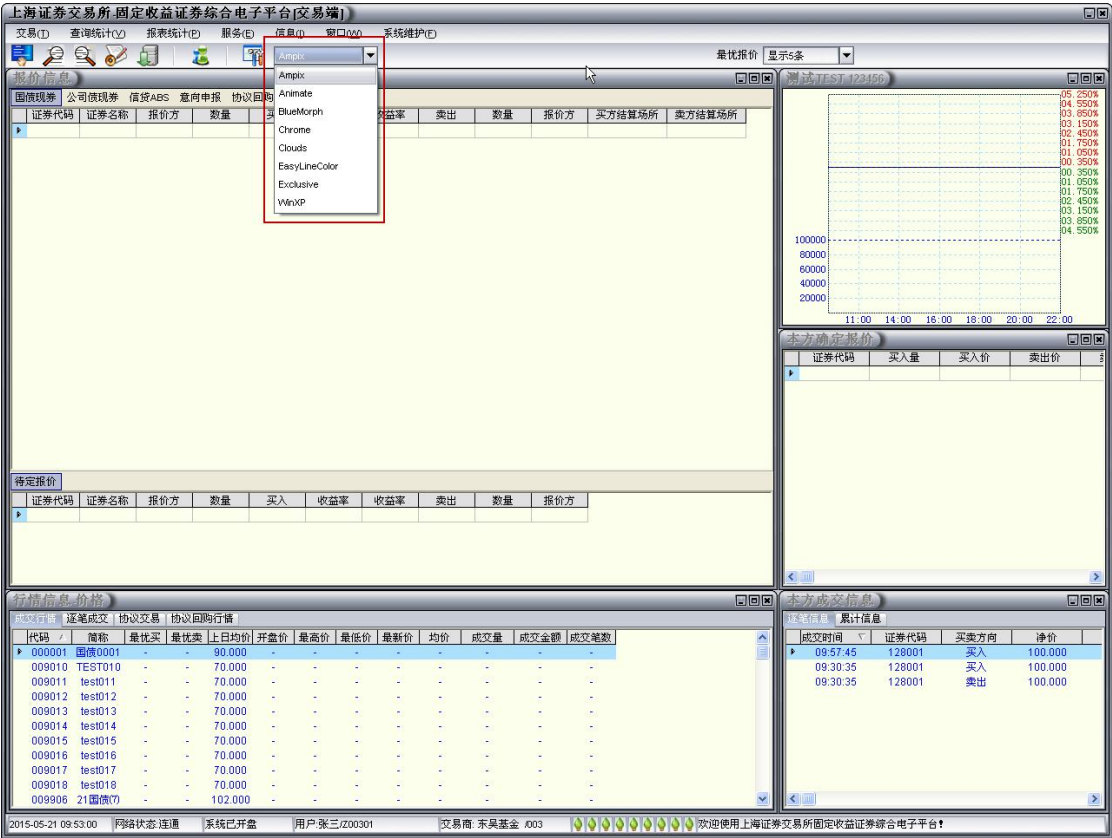
在登录界面通过口令验证后，用户即进入系统的主界面。



系统主界面包含 7 个区域：菜单和工具栏、报价信息区、行情信息区、行情走势信息区、本方确定报价信息区、本方成交信息区和状态栏。

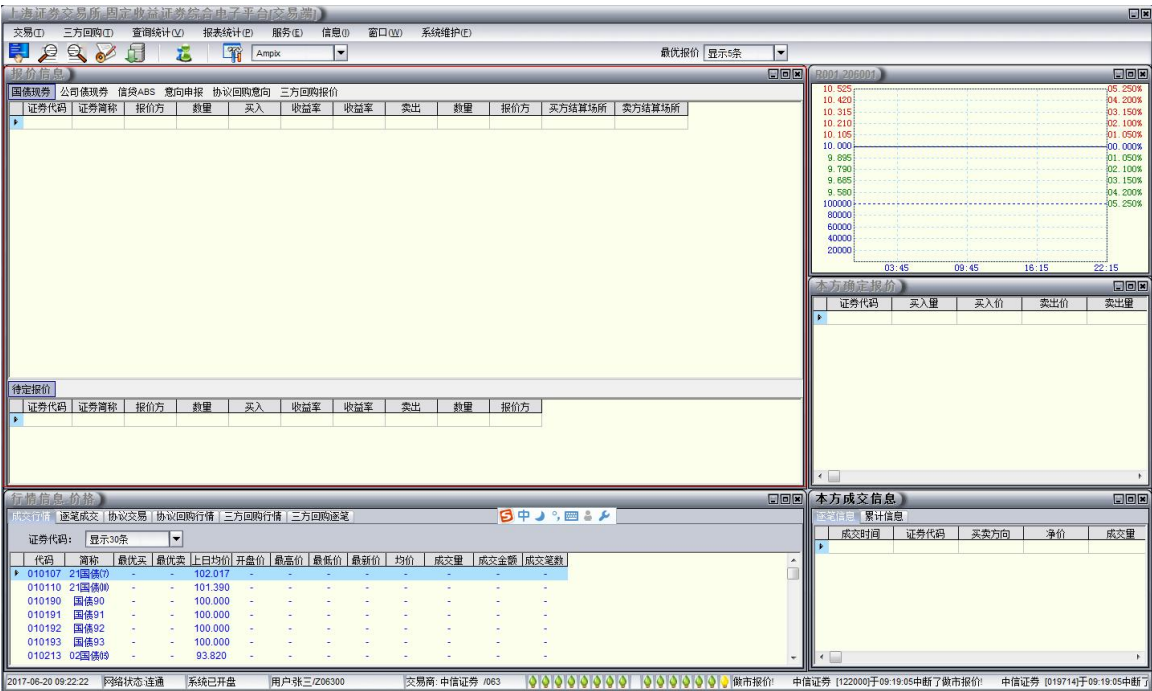
在主界面上的各列表中，凡出现手形图案表示可以双击操作，一般为点击成交、点击回复、或查看详细信息等。用户可以右键点击债券交易参与人或交易员，与其进入洽谈状态。

在工具栏的下拉框中有界面的各种可选择风格，这些风格能影响界面的背景、标题栏颜色和背景等。



### 3.1 报价信息窗口

在屏幕的正中最大的一块区域红框显示部分，是报价信息窗口



报价信息：

报价信息											
国债现券 公司债现券 信贷ABS 意向申报 协议回购意向 三方回购报价											
证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买方结算场所	卖方结算场所
待定报价											
证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方		

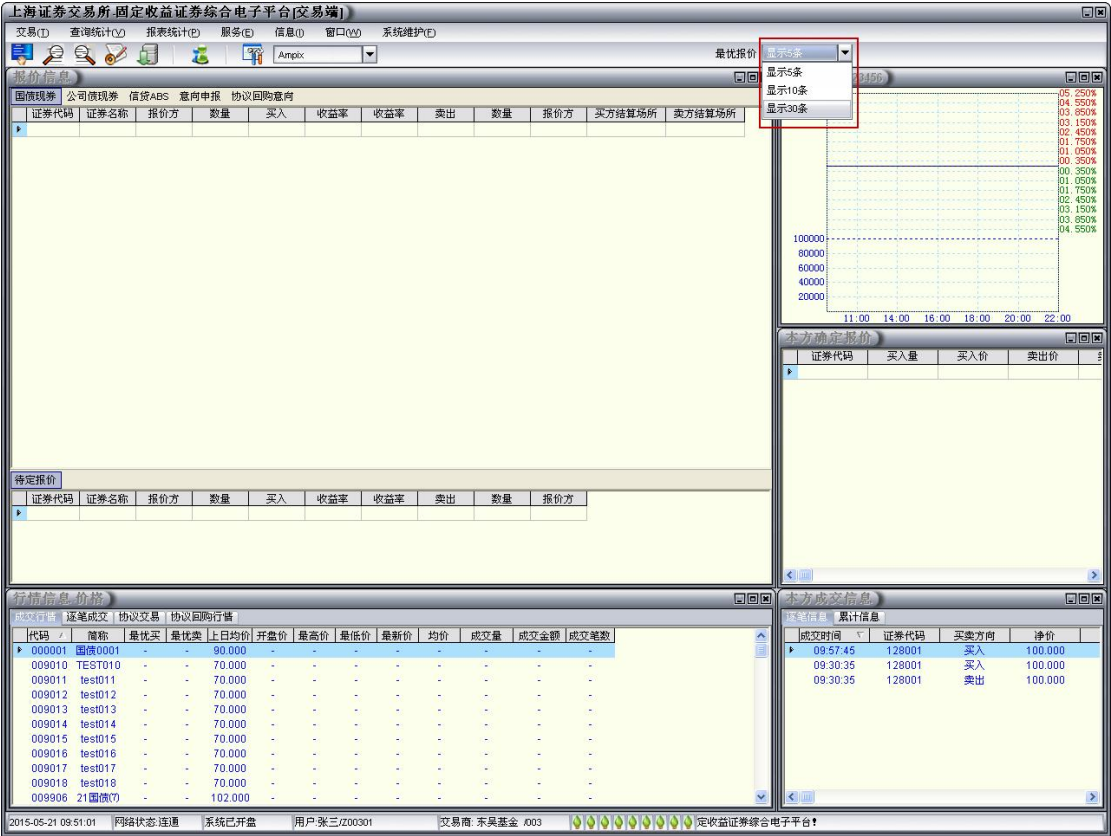
报价信息窗口被中间分隔线一分为二，分别于上部显示全市场的确定报价信息，下部显示全市场的待定报价信息，其中上部的确定报价信息按照交易产品的不同分为利率债（国债）现券区、公司债现券区、信贷 ABS、意向申报区、协议回购意向区、三方回购报价区、特定债券区、公募 REITs 区、仅在平台挂牌债券区、CDX 合约意向申报区、债券 ETF 区。用点击相应的 Tab 页进行报价区的切换。


窗口显示的报价信息包括证券代码、名称，报价方，买方结算场所，卖方结算场所数量，买进/卖出价格，到期收益率。为方便用户查看，买进和卖出信息用不同底色分两个色块显示买入数量，买进价格，收益率；卖出数量，卖出价格，收益率。且买进用红色字体显示、卖出用蓝色字体显示。

对于同一证券代码的交易列表中集中显示，只在第一行标出证券代码和证券名称，之后但凡证券代码和证券名称为空的都是对该证券的交易。

为方便用户交易，系统以当前最优买/卖报价优先极进行排序，保证最优报价在该证券的第一排。同种证券可以双击该证券表格头上的黑色三角符号将该证券收起为一行，这时只显示该证券的第一行报价信息，即当前最优报价信息。再次双击展开该证券的所有报价信息。

用户还可以在主窗口菜单栏上选择报价信息窗口中每种证券显示的报价的数量，包括显示 5 条、显示 10 条、显示 30 条，默认显示 5 条。



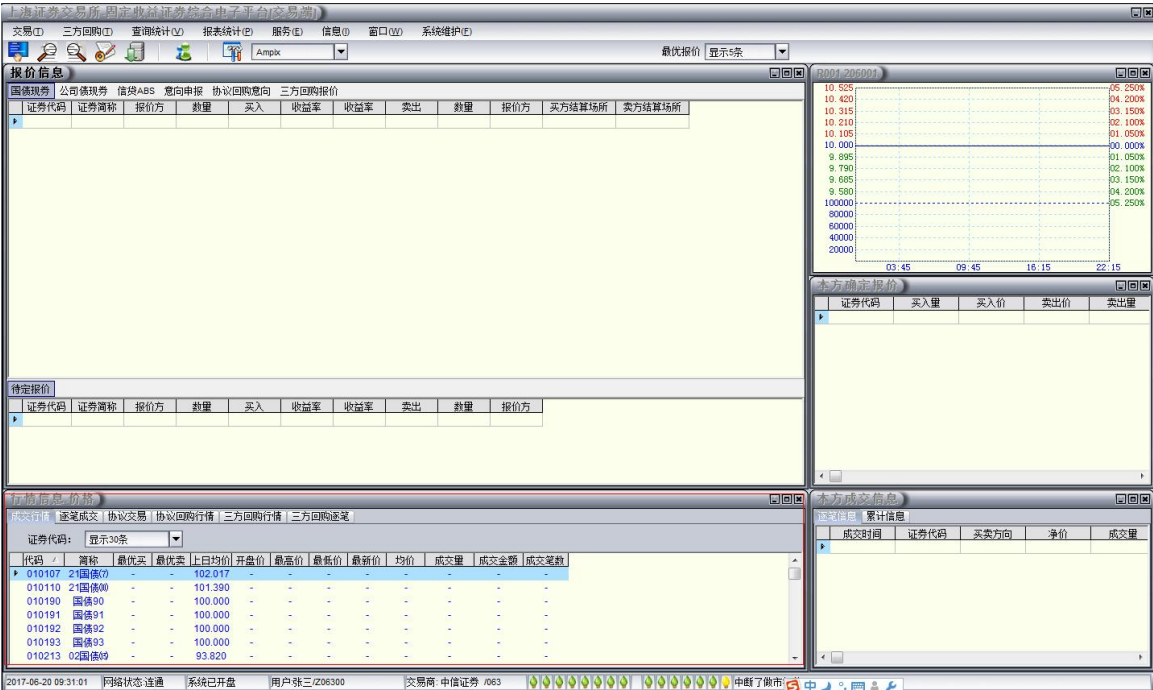
将鼠标移动至证券名称列下，鼠标指针变为型，表示可以查看该证券的相关信息。单击鼠标右键，在弹出的菜单中选择证券信息，点击打开证券信息窗口。窗口中显示证券代码、名称，发行日，到期日，发行量，票面利率，上日加权平均价供用户参考。





### 3.2 行情信息窗口

在屏幕的左下方红框显示部分是全市场的成交行情、逐笔成交、协议交易和协议回购行情信息、三方回购行情、三方回购逐笔



成交行情：



成交行情页显示全市场各个证券的成交情况，包括证券代码、简称，最优买价，最优卖价，上日均价，开盘价，最高价，最低价，最新价，均价，总成交量，总成交金额，总成交笔数。其中“上日均价”是进行报价计算价格波动幅度的参考依据。

如果该证券当日从开盘开始仍未成交一笔，则该行暂时无成交数据，用“—”标识。

在窗口表格内任意位置点击鼠标右键，弹出“按收益率显示”菜单，可以将行情信息中的价格显示成其对应的收益率做参考。

行情信息-价格

成交行情 逐笔成交 协议交易 协议回购行情 三方回购行情 三方回购逐笔

证券代码: 显示30条

代码	简称	最优买	最优卖	上日均价	开盘价	最高价	最低价	最新价	均价	成交量	成交金额	成交笔数
010107	21国债(7)	-	-	102.017	-	-	-	-	-	-	-	-
010110	21国债(10)	-	-	101.390	-	-	-	-	-	-	-	-
010190	国债90	-	-	100.000	-	-	-	-	-	-	-	-
010191	国债91	-	-	100.000	-	-	-	-	-	-	-	-
010192	国债92	-	-	100.000	-	-	-	-	-	-	-	-
010193	国债93	-	-	100.000	-	-	-	-	-	-	-	-
010213	02国债(3)	-	-	93.820	-	-	-	-	-	-	-	-

行情信息-收益率

成交行情 逐笔成交 协议交易 协议回购行情 三方回购行情 三方回购逐笔

证券代码: 显示30条

代码	简称	最优买	最优卖	上日均价	开盘价	最高价	最低价	最新价	均价	成交量	成交金额	成交笔数
010107	21国债(7)	-	-	4.1334	-	-	-	-	-	-	-	-
010110	21国债(10)	-	-	483.4854	-	-	-	-	-	-	-	-
010190	国债90	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
010191	国债91	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
010192	国债92	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
010193	国债93	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
010213	02国债(3)	-	-	6.6987	-	-	-	-	-	-	-	-

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

逐笔成交：

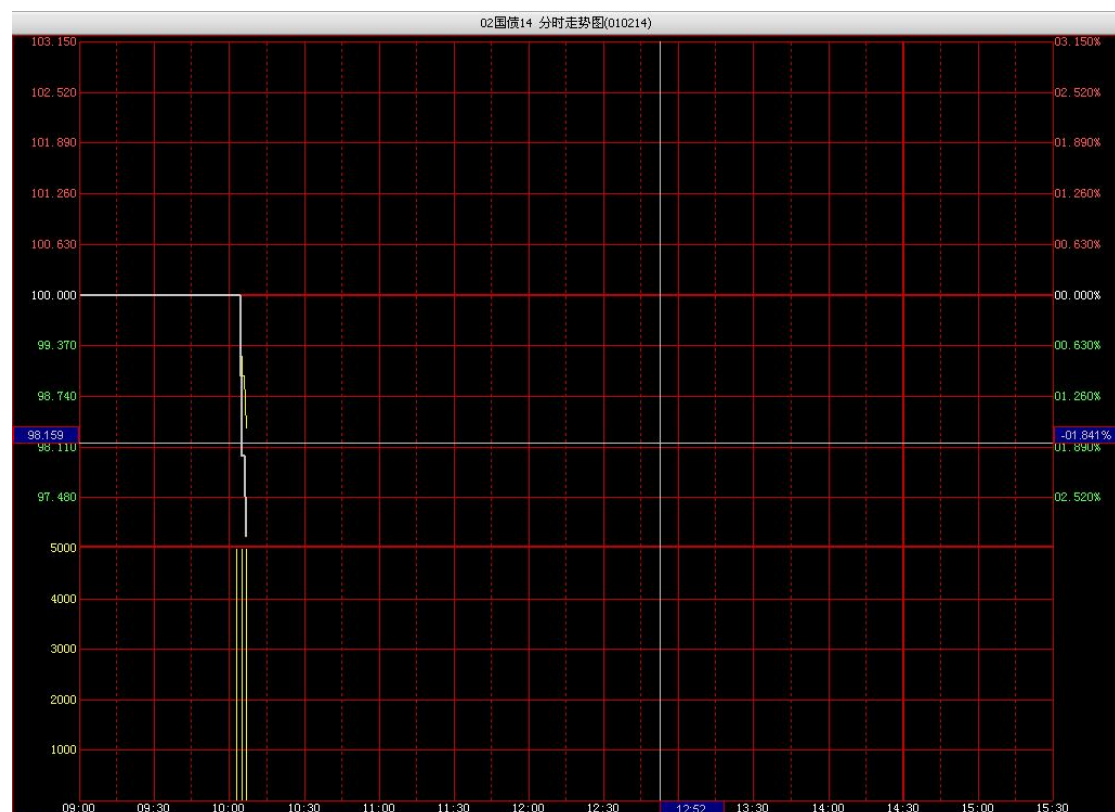
行情信息-价格

成交行情 逐笔成交 协议交易 协议回购行情 三方回购行情 三方回购逐笔

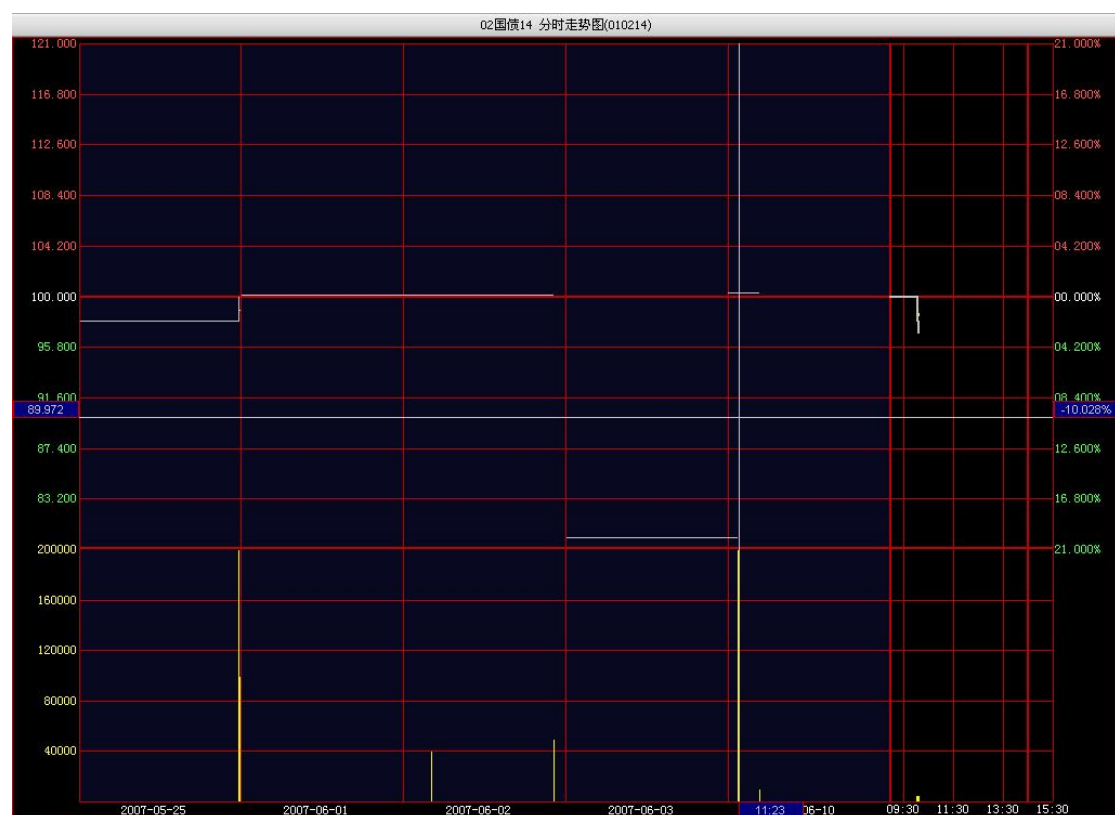
成交时间	证券代码	证券简称	净价	全价	到期收益率	成交量	成交金额	成交方式	结算场所
------	------	------	----	----	-------	-----	------	------	------

逐笔成交页显示每一笔成交的详细信息，包括成交时间，证券代码，证券名称，净价，全价，到期收益率，成交量，成交金额、成交方式、结算场所。鼠标移到证券名称列，也可以右键调出证券信息查询窗口。

在成交行情中，选择一个证券，双击鼠标左键或按 F5 或回车键可以看到该证券的分时走势图。

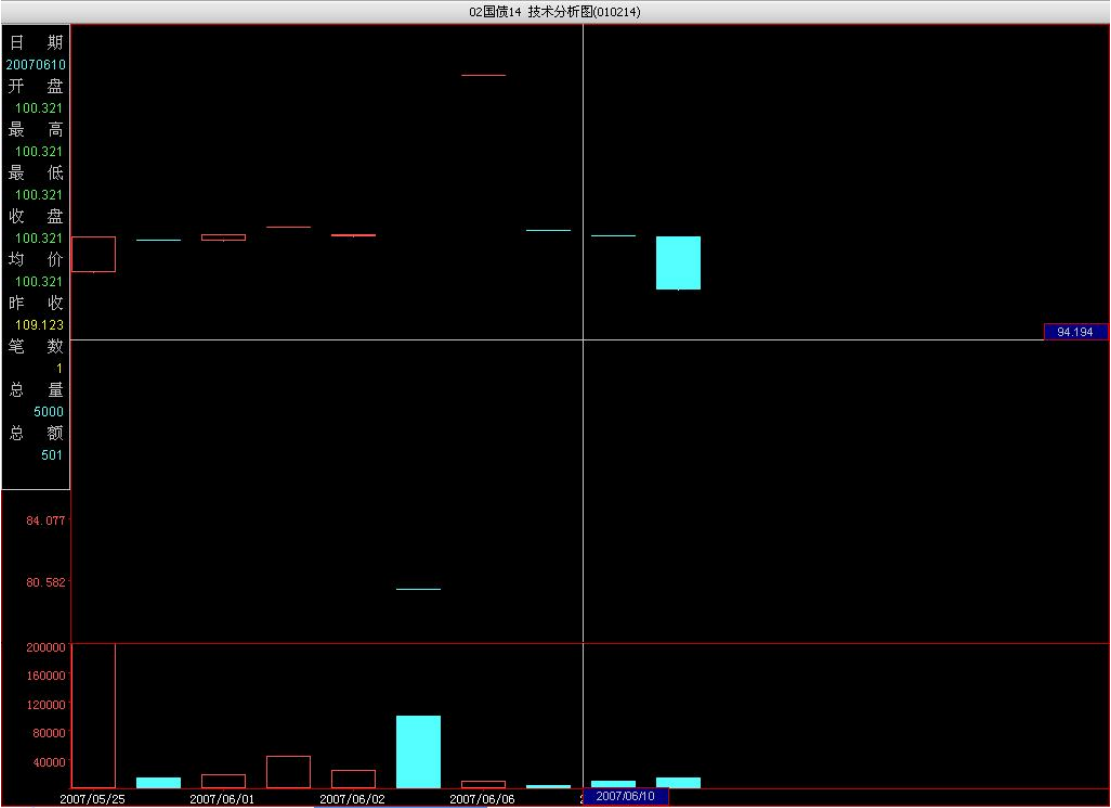


按住方向键向下可以调出最多 5 日的多日分时走势图，

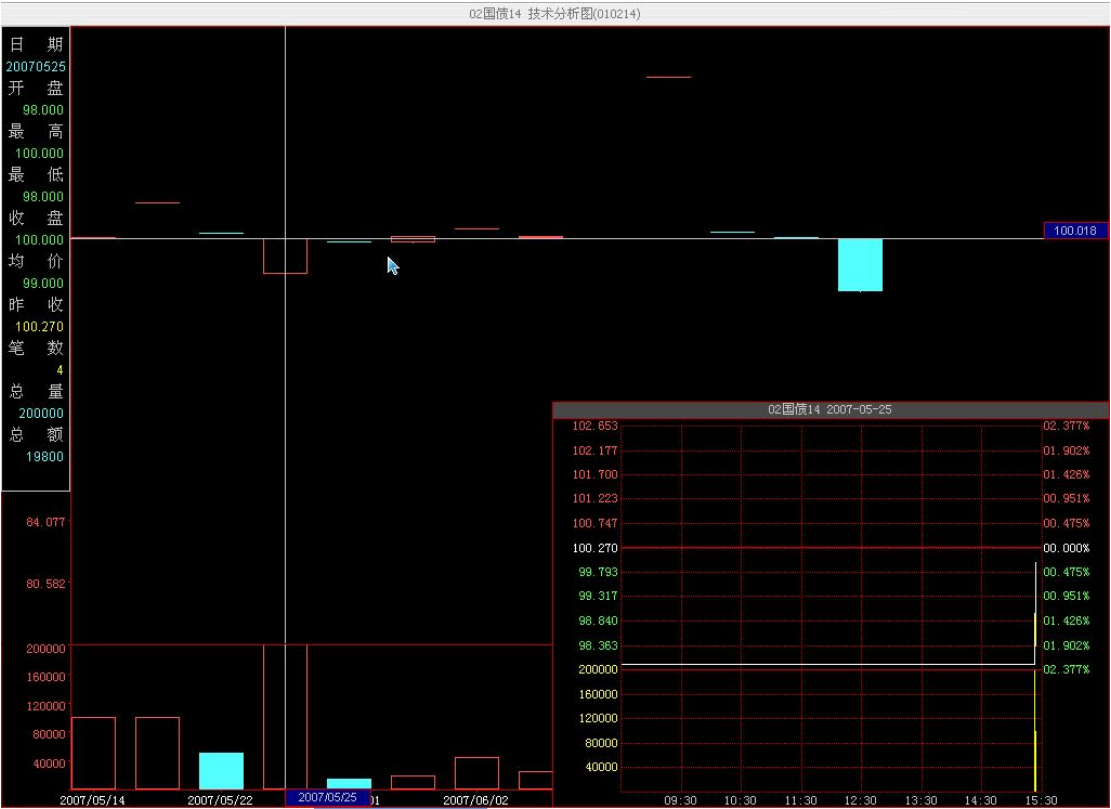


再双击鼠标左键或按 F5 或回车键可以切换到该证券的日 K 线图





按住方向键左右切换不同日期的 K 线，按下空格在右下角弹出窗口显示该日 K 线对应的分时走势图



按 F5 可以在日 K 线和分时走势图窗口来回切换，按下 ESC 切换回主窗体界

面。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

协议交易：

行情信息-价格								
成交行情   逐笔成交   协议交易   协议回购行情   三方回购行情   三方回购逐笔								
成交时间	证券代码	证券简称	净价	全价	到期收益率	成交量	成交金额	

协议交易页显示每一笔协议交易的详细信息，包括成交时间，证券代码，证券名称，净价，全价，到期收益率，成交量，成交金额。鼠标移到证券名称列，也可以用右键调出证券信息查询窗口。

协议回购行情：

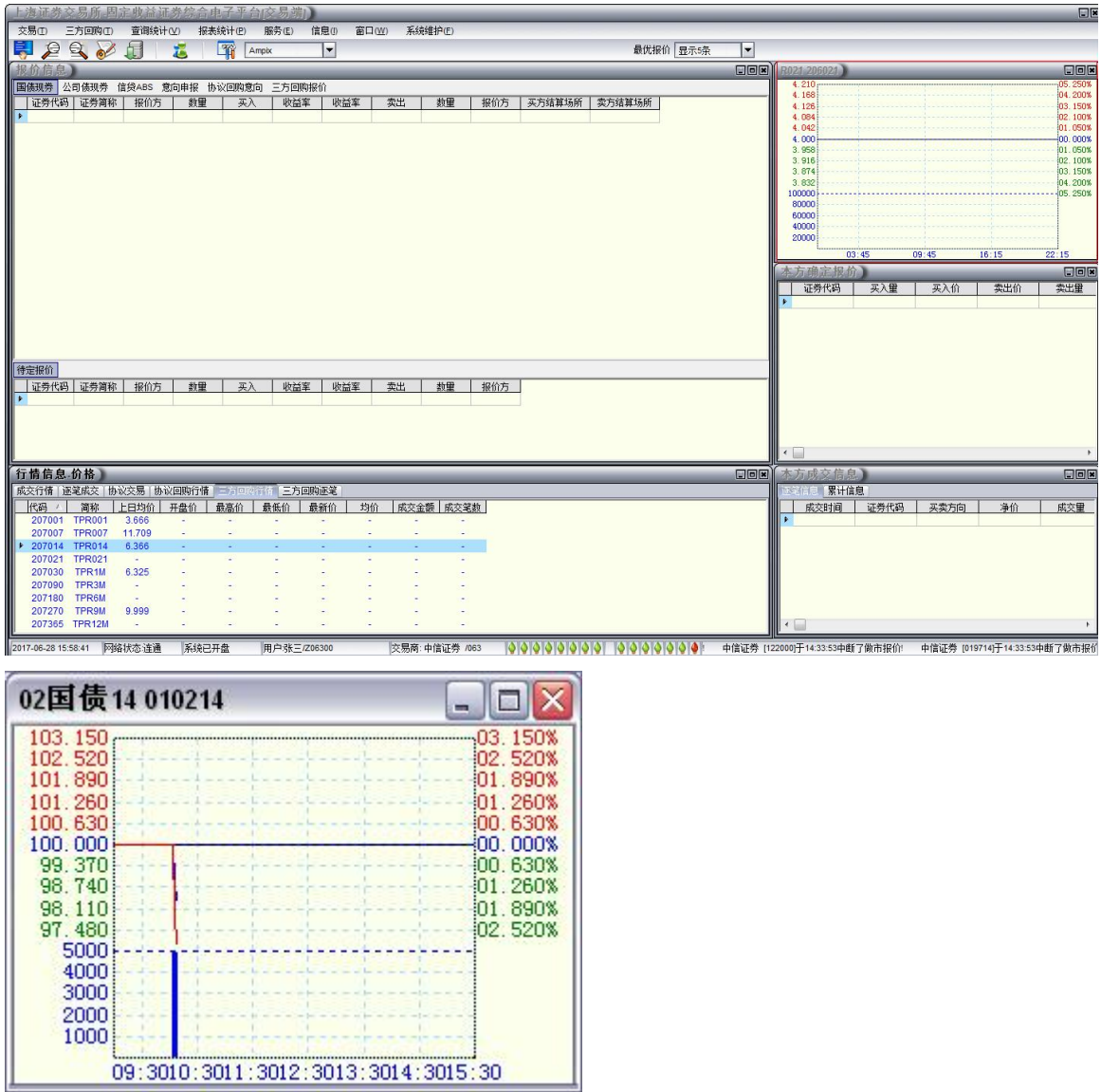
行情信息-价格									
成交行情   逐笔成交   协议交易   协议回购行情   三方回购行情   三方回购逐笔									
代码	简称	上日均价	开盘价	最高价	最低价	最新价	均价	成交金额	成交笔数
206001	R001	10.000	-	-	-	-	-	-	-
206007	R007	3.242	-	-	-	-	-	-	-
206014	R014	6.000	-	-	-	-	-	-	-
206021	R021	4.000	-	-	-	-	-	-	-
206030	R1M	5.000	-	-	-	-	-	-	-
206090	R3M	4.600	-	-	-	-	-	-	-
206180	R6M	5.000	-	-	-	-	-	-	-
206270	R9M	-	-	-	-	-	-	-	-
206365	R1Y	5.000	-	-	-	-	-	-	-

成交行情页显示全市场各个证券的成交情况，包括证券代码、简称，上日均价，开盘价，最高价，最低价，最新价，均价，成交金额，成交笔数。其中“上日均价”是进行报价计算价格波动幅度的参考依据，鼠标移到证券名称列，也可以用右键调出证券信息查询窗口。

如果该证券当日从开盘开始仍未成交一笔，则该行暂时无成交数据，用“—”标识。

### 3.3 行情走势信息窗口

在屏幕的右方上部位置红框显示部分是某证券对应的当日分时走势信息

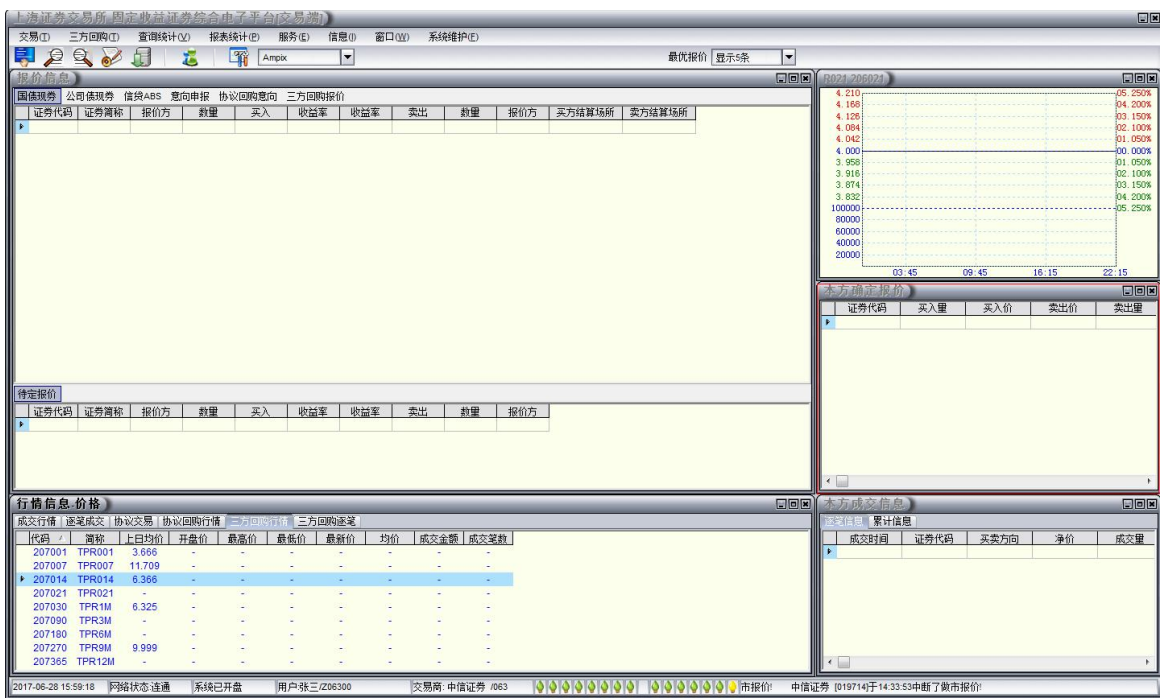


在行情信息窗口中选择一条证券，行情走势信息窗口则对应显示该证券的当日分时走势图。方便用户查看。

### 3.4 本方确定报价信息窗口

在屏幕的右方中部红框显示部分是本方的确定报价信息窗口。

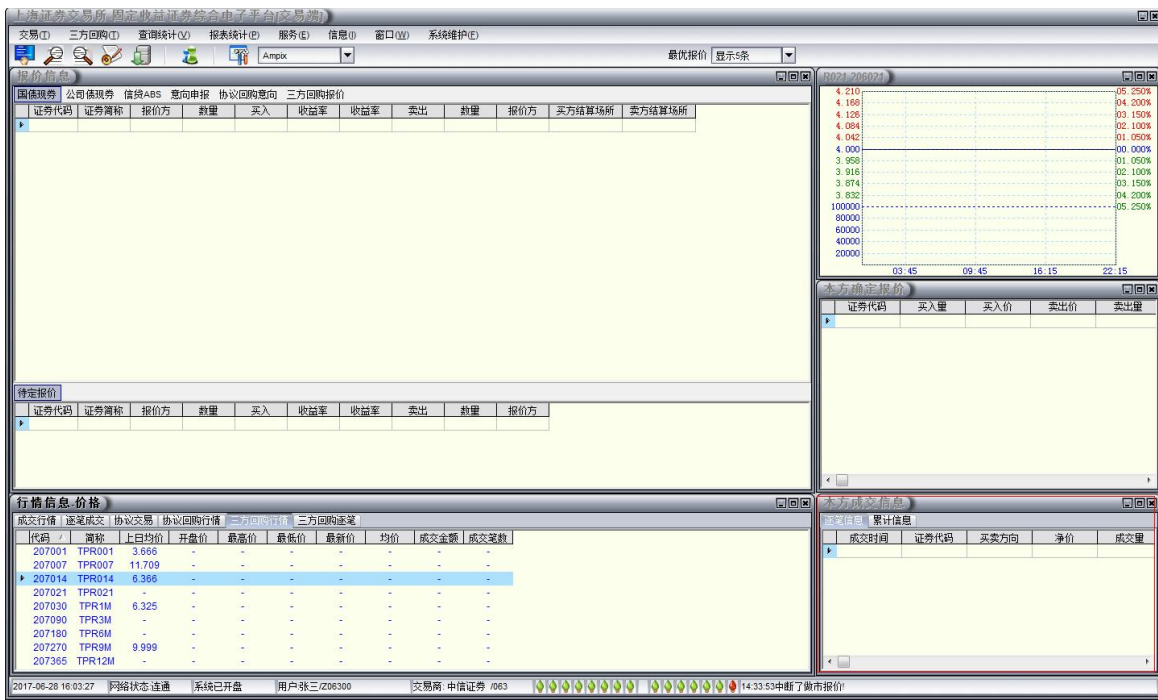
为减少交易端界面操作卡顿，提升用户体验，本方确定报价信息窗口不再展示全量报价数据，仅展示 100 条。如需全量报价数据，可通过确定报价查询窗口查看。



窗口显示本方的确定报价信息，包括证券代码，买入量，买入价，卖出价，卖出量，结算场所。其中买入量和卖出量为当前剩余数量，成交完成后删除该行记录。

### 3.5 本方成交信息窗口

在屏幕的右下方红框显示部分是本方的逐笔信息和累计信息。



本方成交逐笔信息：



本方成交逐笔信息页记录本债券交易参与者做出的每一笔交易信息，包括成交时间，证券代码，证券名称，买卖方向，成交类型，对手方，净价，成交量，全价，到期收益率，应计利息、成交金额，成交编号，结算场所。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

本方成交累计信息：



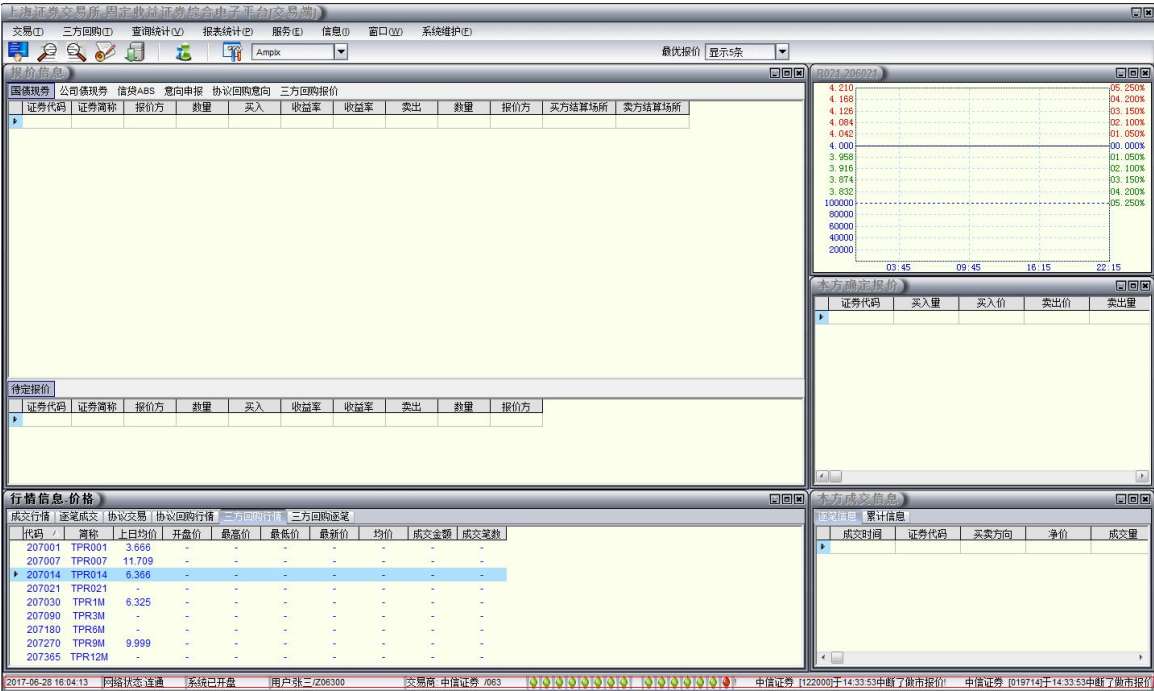
本方成交信息			
逐笔信息			
代码	买入量	卖出量	买卖差
010115	0	5000	-5000
010214	10000	5000	5000

本方成交累计信息页以证券为单位分证券品种统计本方成交信息，包括证券代码、名称，买入成交量，卖出成交量，买卖成交量差。买卖成交量差是买入成交量减去卖出成交量之差，显示正负号可以更明确的看出买入量和卖出量之间的多少关系。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

3.6 状态栏

在屏幕的下方红框显示部分是系统状态栏。



系统状态栏反映了系统的当前状态，从左到右依次为：日期时间栏、网络状态栏、系统交易状态栏、用户信息栏、债券交易参与人信息栏、交易信息回复栏以及做市报价中断提示栏。

日期时间栏：显示当前服务器的日期时间，系统的整个运作以这个时间为准

网络状态栏：网络状态有“连通”和“异常”，方便用户获知目前的网络状态

系统交易状态栏：交易状态有开市、开盘、休盘、收盘、收市。此处显示目前系统交易状态

用户信息栏：显示当前登录用户的用户名和用户代码

债券交易参与人信息栏：显示当前登录用户所属的债券交易参与人简称和债券交易参与人代码

交易信息回复栏：以灯的形式表现询价回复、被询价回复信息和公告发布信息等等。回复信息到来的时候，相应的指示灯会闪烁显示。详见报价、询价和公告信息查看相关章节。

做市报价中断提示栏：如果用户为做市商，且当前没进行做市报价，则此处会显示该做市商于几点几分中断做市报价的信息，提醒用户注意。

## 四、 交易功能

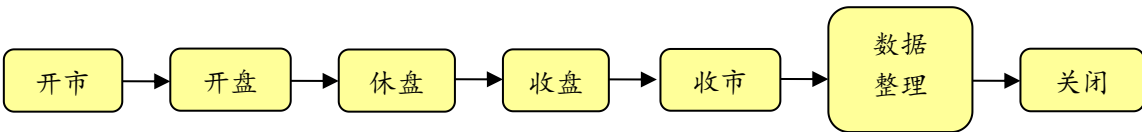
### 4.1 交易服务介绍

#### 4.1.1交易状态

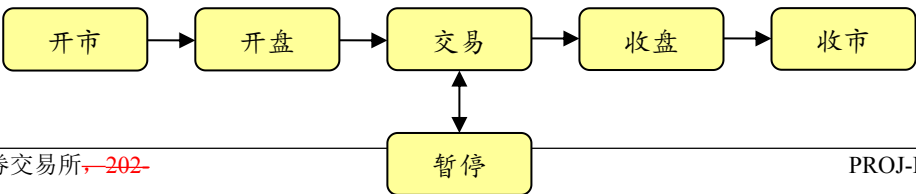
对于系统的交易状态，可以分为如下几类：

- 开市：系统初始化完成，交易员可以登录系统，但无法进行交易。  
（例外：一级债券交易参与人此时可以进行做市报价，此时报价信息不对市场发布，其他债券交易参与人不能在报价信息窗口和行情窗口看到报价，但可以通过确定报价查询查看到一级债券交易参与人的做市报价。直到开盘，其他债券交易参与人才可以在报价信息窗口和行情窗口看到报价信息）
- 开盘：可以开始交易
- 暂停：暂停交易
- 恢复暂停：恢复暂停的交易
- 收盘：交易结束，交易员仍然可以登录系统，进行查询、打印工作
- 收市：系统所有交易结束，生成结算数据。交易员无法登录系统
- 数据整理：为下一交易日作数据准备
- 关闭：系统关闭

系统交易状态的转换如下图所示：

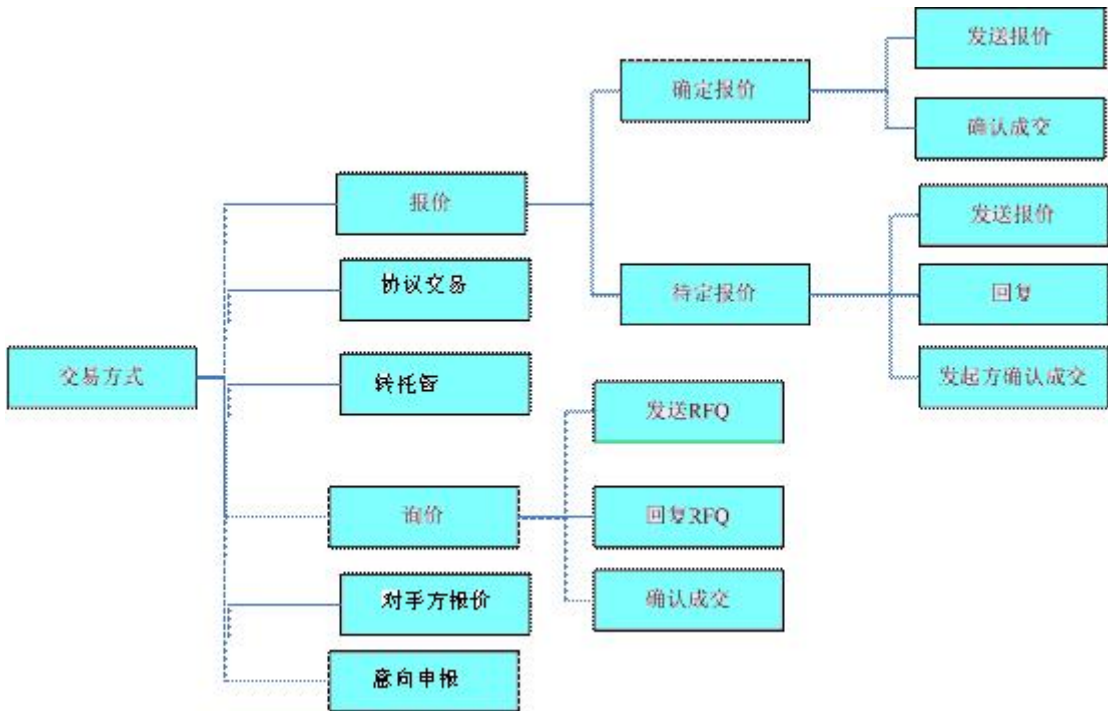


各交易产品的交易状态转换如下图所示：





## 4.1.2 交易类型



证券报价系统为债券交易参与人提供两种交易模式：报价和询价交易。报价又分为确定报价和待定报价。

此外，债券交易参与人可以和自己的客户在场外进行交易，成交结果通过场外成交申报功能进入证券报价系统

协商成交交易更名为协商成交。另，新增竞买、合并申报交易方式。

### 4.1.2.1. 确定报价

确定报价是可执行报价（实价），市场参与者点击确认后即可立即成交。确定报价模式的主要目的是增强证券市场价格的透明性，提高市场参与者信心，为标准规模的交易需求提供流动性支持。

报价方可以选择是否匿名，则报价接收方看不到此报价是哪个债券交易参与人发出。

所有债券交易参与人都可以进行确定报价，但一级债券交易参与人需要对其做市的基准券种进行双边确定报价，履行做市义务，买卖价差需要维持在规定的价差范围内。对于做市行为，需要进行监控和记录，对做市商的行为进行评估。

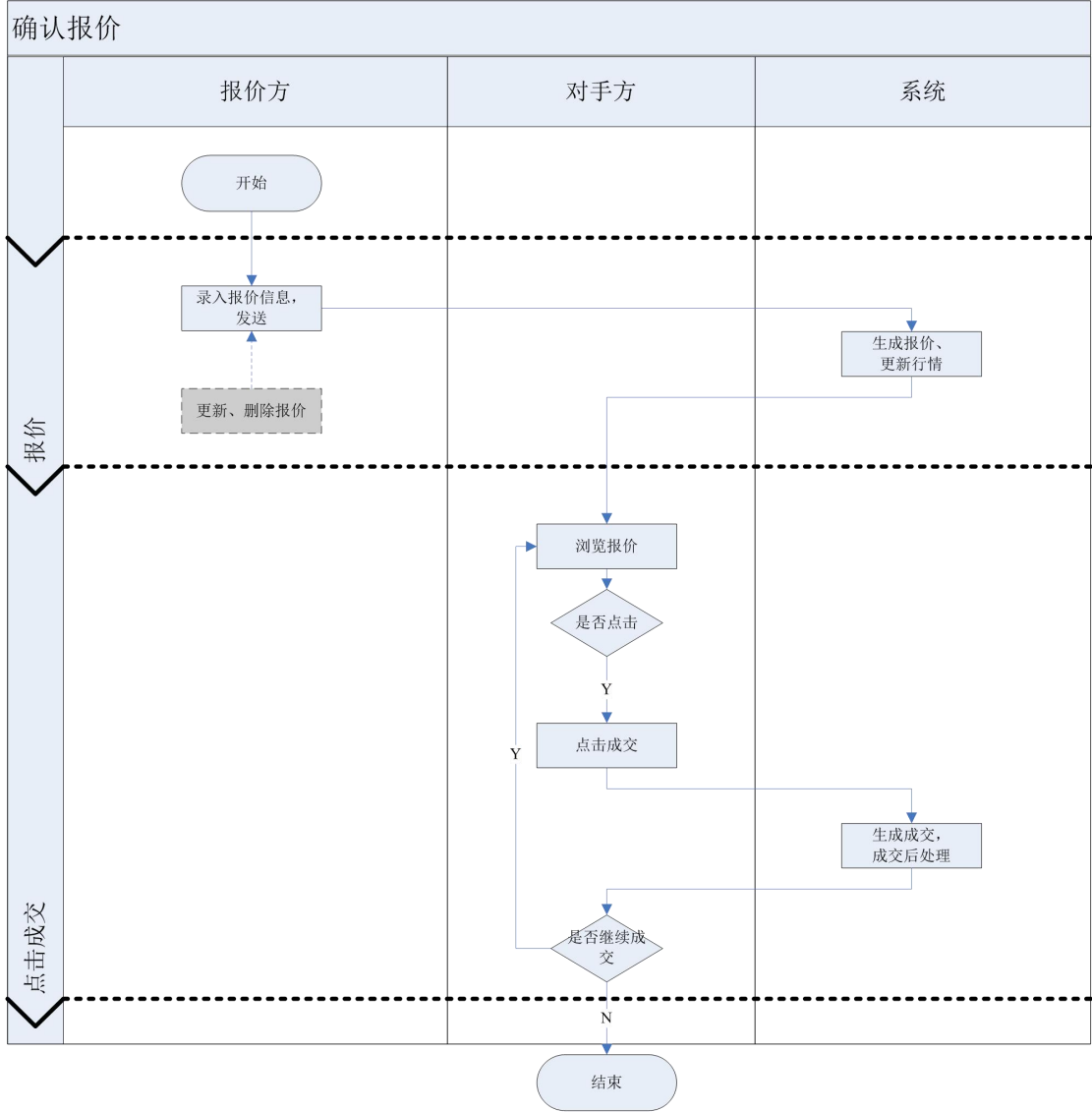
（做市功能已取消）

债券交易参与人在自己的报价尚未成交或完全成交以前，可以修改或撤消原报价指令。确定报价需要报出证券代码、买卖价格、报价数量、股东账户、**报价**

**范围、结算方式**，系统自动计算应计利息、到期收益率、净价金额、全价、全价金额等。

对于债券交易参与人发出的确定报价，对手方点击即可成交。交易对手方对价格不能进行修改，成交数量为系统设定的固定成交单位。成交之后，成交数据发送到中国结算上海分公司进行净额交收。

确定报价概要流程如下图所示：



流程说明：

- 报价方（所有债券交易参与人均可）录入确定报价信息、发送。
  - 如果债券交易参与人为做市商，而且是对做市券种的报价，则必须进行买、卖双边报价，符合对做市商的义务要求。如果为非做市报价，则没有此要求。
  - 债券交易参与人可以选择报价是否发送给全部市场

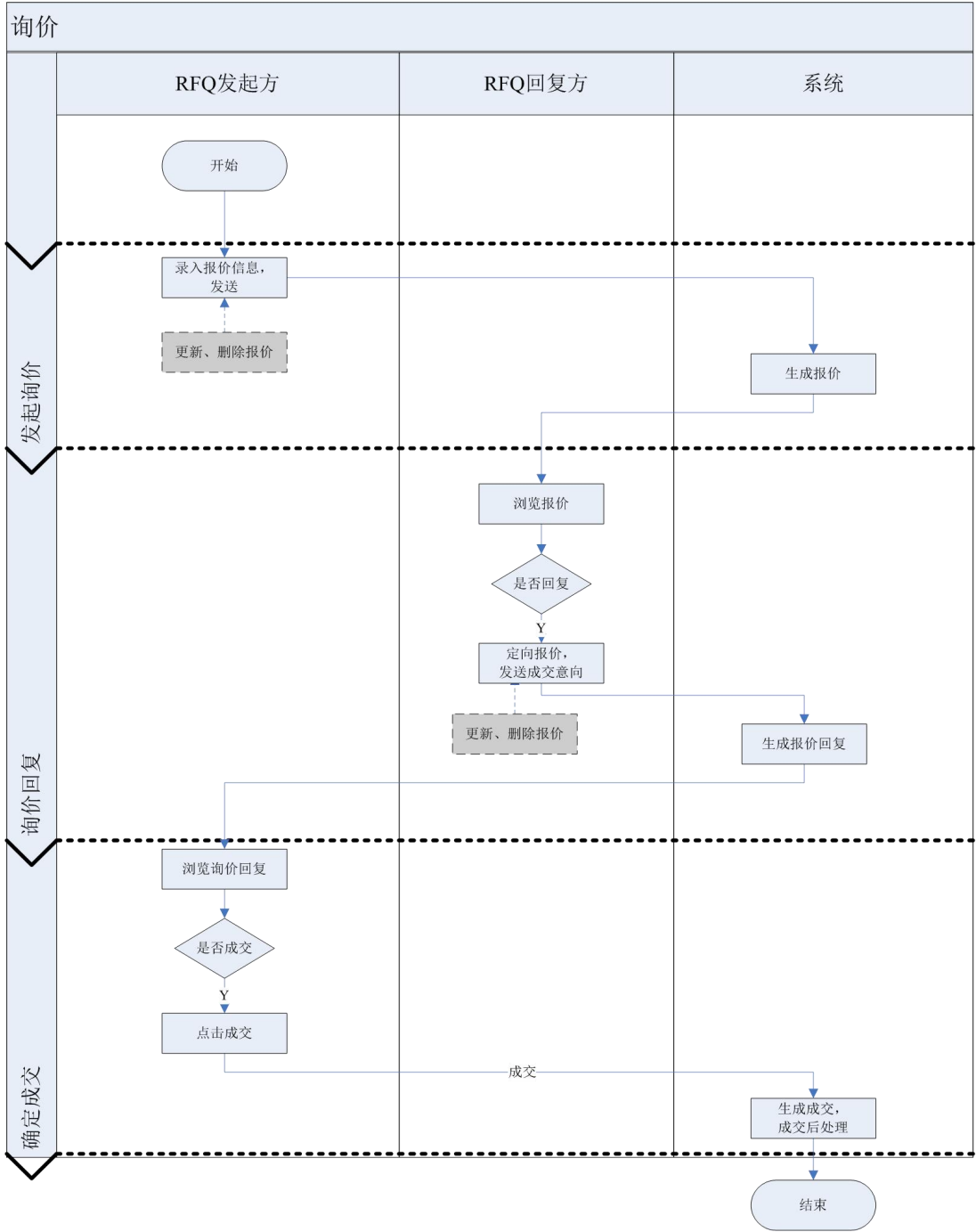
- 债券交易参与人可以设置最大显示量（冰山订单）
- 债券交易参与人可以选择是否匿名
- 确定报价不需设置报价有效时间，直到当日收市或数量全部成交前都有效。
- 系统判断报价各要素是否符合要求，生成报价。
  - 冻结卖方持仓
  - 更新发送方的报价行情界面，
  - 如果向全市场发送的报价，更新市场的报价行情信息
- 发送方在报价数量全部成交前，可以修改或撤销报价
  - 做市报价当数量被完全成交后，必须对报价进行修改
- 报价接收方浏览接收的报价信息，选择与哪笔报价进行成交
  - 最优报价按照价格、时间顺序进行筛选
- 点击，固定数量成交
  - 报价接收方选择某条报价点击成交，需录入股东账号和交易单元，其他均已确定不需录入
  - 更新市场成交行情
  - 更新报价发送方和所有该条报价的报价接收方报价界面，数量减少
- 如果报价接收方需要再次成交，则再次点击。

#### 4.1.2.2. 询价

普通参与者可以向多个债券交易参与人询价（RFQ），债券交易参与人开价后，债券交易参与人决定是否确定成交，**支持潜在投资者**。

市场参与者通过报价系统最多可以向该证券品种的 5 个（系统可设置）债券交易参与人发出询价请求，要求债券交易参与人就某特定数量的证券的买入或卖出价格进行报价，询价**可以**匿名发送。债券交易参与人在接到询价请求后**报出买卖价格和意愿成交数量（数量不能大于原报价数量）**，并将买卖报价**及数量**发送回原询价方，该报价为可执行报价，**被询价方回复后可以对自己的回复记录做修改和撤销**。如果询价初始发起方愿意就债券交易参与人的回复价格达成交易，即可以确认成交，**与一方成交后，其他询价请求不取消**。如果询价方对所有债券交易参与人的报价均不满意，则可以取消询价请求。

询价概要流程如下图所示：



流程说明：

- 询价发起方录入询价信息、发送。
  - 债券交易参与人可以选择报价是否发送给指定一级债券交易参与人/普通债券交易参与人，最多发送给 5 家债券交易参与人或者选择潜在投资者
  - 债券交易参与人可以选择不匿名
  - 询价交易不需要录入价格。
- 系统判断报价各要素是否符合要求，发送 RFQ。

- 更新发送方和特定接收用户报价行情界面，
- 对于该条报价，发送方的状态为“已发送”，对手方为“待确定”
- 发送方在报价成交前，可以撤销报价；同时已经收到的回复状态变为失效。
- 询价接收方浏览接收的询价信息，判断是否对询价进行回复
- 询价接收方表达成交意向，点击、发送询价回复
  - 报价接收方选择某条报价，发送定向报价，需录入价格、数量、股东账号和交易单元，其他均已确定不需录入
  - 在成交前，可以修改或撤销询价回复
- 系统判断报价各要素是否符合要求，生成询价回复。
  - 更新双方的报价行情，RFQ 发送方的状态为“待确定”，RFQ 接收方为“已发送”
- 最终成交，选择与一条询价回复成交后，其他询价请求仍有效。
  - 更新报价发送方和所有该条报价的报价接收方报价界面
  - 更新市场成交行情

#### 4.1.2.3. 待定报价

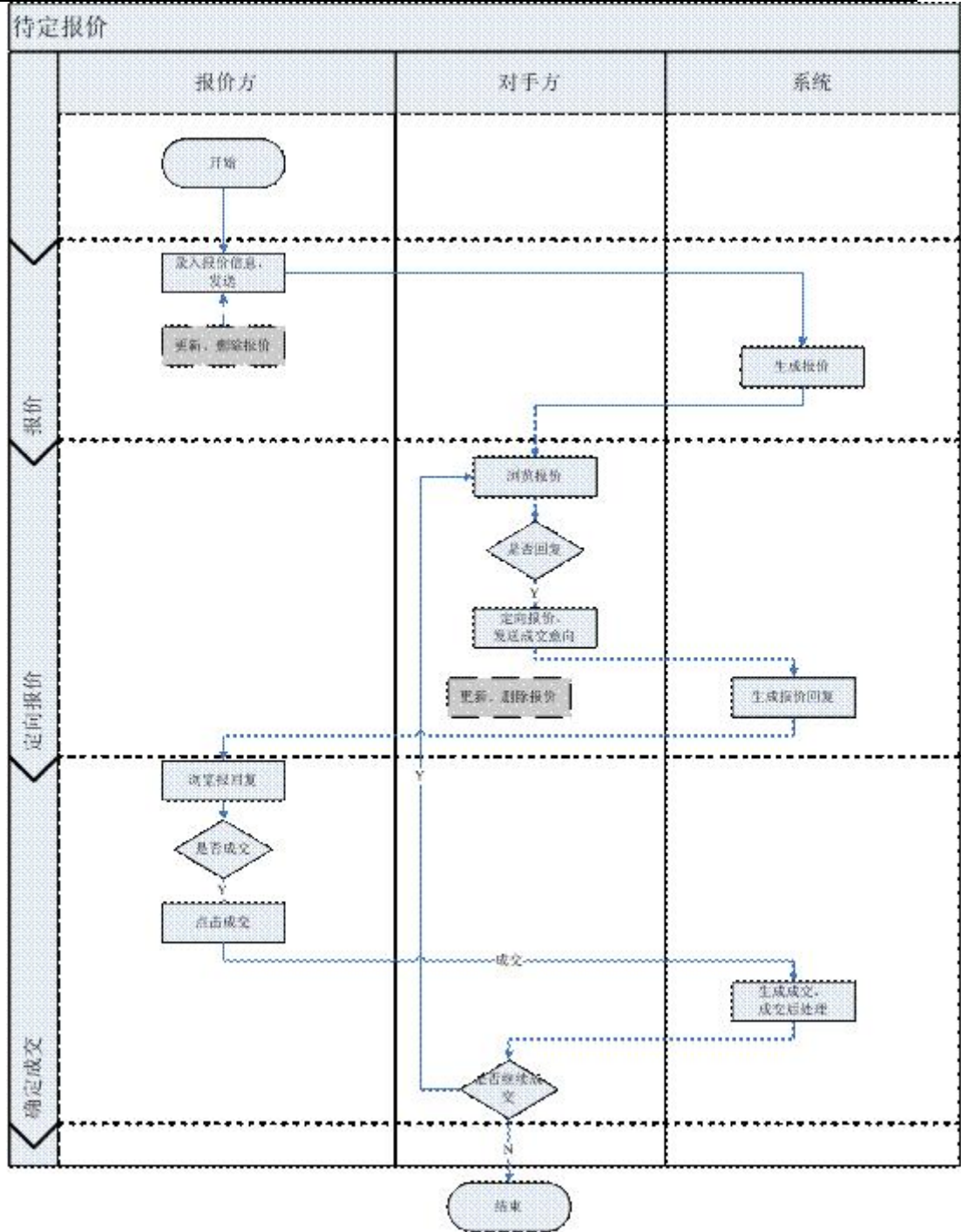
待定报价是意向性报价，市场参与者确认后还需要原报价方确认才能成交。

市场参与者进行待定报价时，需要报出证券代码、买卖价格、报价数量、股东账户、交易单元、**报价范围**、**结算方式**，系统自动计算应计利息、到期收益率、净价金额、全价、全价金额等。债券交易参与人可以选择是否匿名发送。债券交易参与人在自己的报价尚未成交或完全成交以前，可以修改或撤消原报价指令。

参与者对待定报价确认后，填入本方的股东账户，将报价信息发送回原报价方，转变为定向报价，原报价方确认后即成交。成交价格由报价方初始报价时确定，成交数量为固定单位成交。

对于同一条待定报价，报价发送方需要对接收的报价按时间顺序处理，先收到的先处理。对于待定报价回复处理过程有时间限制（系统设置，默认为 20 分钟），即从接收到待定报价的债券交易参与人发出回复报价开始到初始报价方处理完成，需要在规定时间内完成，超过规定时间，债券交易参与人的回复自动失效，同时待定报价本身也失效。

待定报价概要流程如下图所示：



流程说明:

报价方录入待定报价信息、发送。

债券交易参与人可以选择报价是否发送给全部市场

债券交易参与人可以选择是否匿名

系统判断报价各要素是否符合要求, 生成报价。

更新发送方和接收方待定报价显示界面,

对于该条报价, 发送方的状态为“已发送”, 对手方为“待确定”

发送方在报价成交前, 可以修改、撤销报价; 同时已经收到的回复状态变为



失效。

报价接收方浏览接收的报价信息，选择与哪笔报价进行成交

最优报价按照价格、时间顺序进行筛选

默认按券种排列，交易员也可自定义按照其他要素排列

表达成交意向，点击、发送定向报价

报价接收方选择某条报价，发送定向报价，需录入股东账号和交易单元，其他均已确定不需录入，仍按照固定单位作为数量

在报价成交前，可以撤销报价

系统判断报价各要素是否符合要求，生成定向报价。

更新双方的报价行情，初始发送方的状态为“待确定”，对手方为“已发送”最终成交

发送方必须在对手方回复的限定时间内选择是否成交；否则待定报价和回复均失效

更新报价发送方和所有该条报价的报价接收方报价界面

更新市场成交行情

#### 4.1.2.4. 协议交易

债券交易参与人与代理的客户之间的交易采用电话、传真等场外方式进行谈判，双方达成一致后，债券交易参与人通过协议交易功能将成交结果报告至证券报价系统。协议交易输入要素包括债券交易参与人自营账户、客户账号、证券代码、买卖方向、成交价格、成交数量等。

报价系统对协议交易进行代理关系的检查，只有当该客户证券账户指定在该券商时，该笔协议交易才有效。

协议交易录入需录入两次，两条记录的内容，系统匹配一致后，生效。

#### 4.1.2.5. 转托管

交易员通过此功能增加转托管业务数据

- 通过有形报盘进行转托管的新增，后台审核后生效。
- 输入要素包括：证券代码、托管数量、证券账户、银行间托管账号、交易单元。上述证券代码、托管数量、银行间托管账号为必填要素。

#### 4.1.2.6. 协商成交

买卖双方各自通过**协商成交**申报界面录入相关要素，系统根据双方的信息进行匹配成交。

- 通过有形报盘进行**协商成交**申报订单的申报。

- 输入要素包括：证券代码、买卖方向、交易单元（PBU）、账户、成交价格、成交数量、对手方交易员、约定号、**结算方式**，上述输入项均为必填要素。
- 对于每笔申报将进行如下检查：
  - （1）交易时间检查
  - （2）账户、PBU、债券交易参与人、交易员检查
  - （3）价格数量检查
  - （4）对手方有效性检查
  - （5）约定号检查
- 非担保企业债和私募债通过检查后不进行前端余额控制，直接保存到订单簿；利率债（国债）与担保企业债通过检查后发送竞价撮合平台或新债券交易平台进行余额前端控制，余额的处理原则如下：

	冻结	解冻	直接过户	解冻过户
协商成交申报(卖出申报)	√			
协商成交申报撤销(卖出撤销)		√		
协商成交申报匹配成交(本方卖出, 对手方买入)【RTGS】	√			
协商成交申报匹配成交(本方买入, 对手方卖出)【RTGS】	√			
协商成交申报匹配成交(本方卖出, 对手方买入)【净额结算】			√	
协商成交申报匹配成交(本方买入, 对手方卖出)【净额结算】				√

余额检查通过保存到订单簿，否则返回错误给申报交易员。

在订单簿中检查是否有匹配的对手方申报，匹配原则为本方交易员、对手方交易员和约定号一致，且成交数量、成交价格、**结算方式**一致。如果匹配成功对双方账户检查 200 账户数控制（仅限私募债产品，其他产品不进行 200 账户检查），通过账户检查则生成成交，成交方式为“**协商成交**”，未通过账户检查返回错误给申报交易员。

- 成交数据实时更新成交统计行情和逐笔成交行情。
- 成交后该**协商成交**申报的约定号可以再使用



#### 4.1.2.7. 意向申报

交易员通过此功能可增加意向申报，支持利率债、担保公司债、非担保公司债、特定债券、仅在平台挂牌债券、公募可转债产品和托管在中央结算的信贷资产支持证券产品

- 通过有形报盘进行意向申报新增。
- 意向申报可以针对全市场和特定债券交易参与人（最多可选 5 个）发布
- 意向申报可以选择是否匿名发送
- 输入要素包括：证券代码、买卖方向、意向价格、意向数量，上述证券代码、交易单元（PBU）、买卖方向、是否匿名、报价范围为必填要素。
- 对于每笔申报将进行如下检查：
  - （1）交易时间检查，上午 9：00-11：30，下午 13：00-15：30
  - （2）证券代码属于利率债、担保公司债、非担保公司债、特定债券、仅在平台挂牌债券、公募可转债产品和托管在中央结算的信贷资产支持证券产品
  - （3）价格数量检查（输入价格数量时）
  - （4）申报债券交易参与人具有上述券种交易权限
  - （5）申报交易员具有上述券种交易权限
- 通过检查后保存到订单簿，未通过检查返回错误给申报交易员
- 保存成功的申报数据实时更新意向申报行情
- 意向申报数据不进行余额检查和 200 账户控制检查

#### 4.1.2.8. 可交换债换股申报

非公开发行的可交换公司债券进入换股期（自发行结束之日起 6 个月）后可通过固定收益平台发起换股指令，换股指令申报成功则不可撤销。换股申报的最小单位为一手。换股期内，当日买入的可交换债券可当日申报换股。可交换债券实现部分换股后，剩余部分可正常交易。换股申报无需输入换股价格，换股价格由交易所场务人员维护。

交易员通过此功能增加可交换债换股申报

- 通过有形报盘进行可交换债换股申报新增。
- 输入要素包括：交易员代码、证券代码、换股状态、换股价格、换股数量，证券账户、交易单元
- 对于每笔申报将进行如下检查：

- (1) 交易时间检查，上午 9: 00-11: 30，下午 13: 00-15: 30
- (2) 价格数量检查（输入价格数量时）
- (3) 债券交易参与人权限控制
- 可交换公司债券证券代码以 132 开头

通过检查后保存到订单簿，未通过检查返回错误给申报交易员保存成功的申报数据。

## 4.2 双向报价

### 4.2.1 双向报价管理

在这里可以进行确定报价的买卖申报。

播送对象及证券		确定报价区				待定报价区					
播送对象	证券代码	买入数量	买入价格	卖出价格	卖出数量	买入数量	买入价格	卖出价格	卖出数量	中债代码	中债简称

在界面中显示的是该债券交易参与人当前的报价，其中数量字段表示当前剩余可交易的数量。

在列表中包含播送对象、证券代码、确定买入数量、确定买入价格、确定卖出价格、确定卖出数量、中债代码、中债简称、结算场所、结算速度、价格类型、结算日期、**结算方式**。

在此界面上的操作有新增、修改、删除、刷新以及选择报价方。

新增：点击弹出新增双向报价窗口

修改：选择某报价后点击进行报价修改

撤销：选择某报价后点击撤销取消交易

刷新：查看本债券交易参与人报价最新情况

选择报价方：在这里可以选择双向报价列表中的显示类型。可以在本债券交易参与人的所有报价信息和该交易员的所有报价信息中切换。方便交易员了解本方债券交易参与人交易情况和更便捷的修改自己提交的报价信息。

## 4.2.2 新增双向报价

用户点击“新增”按钮，出现报价录入界面。

**新增报价**

证券代码: 762471 国债T+1 证券简称: 国债T+1 结算场所: 中国结算 债券交易参与人: [选择]

证券账户: B880152602 交易单元号: 29997

☐ 是否匿名 价格类型: 净价 发布对象: 全市场

冰山订单: [ ] 千元面额 结算方式: 净额结算 ☐ 全额成交

确定报价区				待定报价区			
买入数量	买入价	卖出价	卖出数量	买入数量	买入价	卖出价	卖出数量
5000	100.2	100.3	3000				

收益率: [ ]

[确定(N)] [关闭(C)]

**新增报价**

证券代码: 761009 私募双边 证券简称: 私募双边 结算场所: 中国结算 债券交易参与人: [选择]

证券账户: B880152602 交易单元号: 29997

☒ 是否匿名 价格类型: 净价 发布对象: 全市场

冰山订单: [ ] 千元面额 结算方式: RTGS ☐ 全额成交

确定报价区				待定报价区			
买入数量	买入价	卖出价	卖出数量	买入数量	买入价	卖出价	卖出数量
3000	101	102	2000				

收益率: [ ]

[确定(N)] [关闭(C)]

界面各输入项说明如下：

证券代码：6 位数字，唯一标识该证券。

交易单元：输入

发布对象：可以选择向全市场发布，或向部分债券交易参与人发布（支持 5 家）

账户：输入。可使用本债券交易参与人的所有交易账户。

结算场所：中国结算或中央结算。对于双边托管的证券默认为中国结算；对于单边托管的证券结算场所只能与托管场所相同

结算速度：仅当结算场所为 "中央结算" 时有效；默认为 T+0，可选择 T+0 或 T+1

中债代码：即中央结算证券代码。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示中债代码

证券简称：即上交所证券简称，根据证券代码自动显示

中债简称：即中央结算证券简称。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示

价格类型：根据证券代码自动显示。

结算日期：根据当前交易日期、结算速度、中债工作日期表，自动显示

结算方式：结算场所为中国结算，若为担保券则可选择净额结算或 RTGS，若为非担保券则为 RTGS。

冰山订单（显示数量）：指冰山订单显示部分的数量。报价中的数量显示为“未成交数量”与“冰山订单显示数量”孰小者。若设置了冰山订单显示数量，则不可使用“全额成交”。

是否匿名：勾选匿名发送，报价后在报价信息窗口显示的报价方为“匿名”

双向报价

新增(N)

修改(M)

撤销(D)

刷新(R)

报价方 本债券交易参与者

播送对象及证券		确定报价区				待定报价区					
播送对象	证券代码	买入数量	买入价格	卖出价格	卖出数量	买入数量	买入价格	卖出价格	卖出数量	中债代码	中
▶ 全市场	662446	5000	100.200	100.300	3000						

报价信息

利率债现券 公司债现券 信贷ABS 意向申报 协议回购意向 三方回购报价 特定债券 公募REITs 仅在平台挂牌债券 CDX合约意向申报 债券ETF

证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买方结算场所	卖方结算场所	买
▶ 662446	19祁经债	交银施罗	5000	100.200	9.5198	9.4718	100.300	3000	交银施罗	中国结算	中国结算	
761009	私募双边	匿名	3000	101.000	-0.0946	-0.1882	102.000	2000	匿名	中国结算	中国结算	

待定报价

证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买入结算方式	卖出结算方式
▶											

做市报价：仅做市商可进行做市报价，确定报价的买卖两个方向的报价信息均填写后方可成功申报。（该功能已取消）

买入数量/卖出数量：必须输入成交单位的整数倍。对于债券，单位为千元面额；对于基金，单位为份；

买入价/卖出价：以系统配置为准。

收益率：输入证券代码、价格，点击“收益率”可计算出到期收益率。

全额成交：若选中则必须一次性全部成交，不可部分成交。不可与冰山订单同时使用。

申报成功以后，可以看到该条报价出现在了双向报价的列表窗口中。用户可以选择后，点击修改按钮改变其数量与价格。

此外，用户可以在选择后，点击撤销该报价，系统会给出确认提示。



点击确定，系统校验通过后弹出撤销成功提示



## 4.3 确定报价

### 4.3.1 确定报价点击成交

用户在报价信息窗口中，双击其他债券交易参与人所发出的某笔确定报价的价格字段，即可与对方点击成交。

报价信息												
利率债券	公司债券	信贷ABS	意向申报	协议回购意向	三方回购报价	特定债券	公募REITs	仅在平台挂牌债券	CDX合约意向申报	债券ETF		
证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买方结算场所	卖方结算场所	买入
662446	19邦经债	交银施罗	5000	100.200	9.5198	9.4718	100.300	3000	交银施罗	中国结算	中国结算	
761009	私募双边	匿名	3000	101.000	-0.0946	-0.1882	102.000	2000	匿名	中国结算	中国结算	
待定价												
证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买入结算方式	卖出结算方式	



为避免用户点错，系统会给出信息提示，其中包括证券代码、买卖方向、价格、数量、**结算方式**以及各类参考信息。

界面如下图：

确定报价买入-对手方[交银施罗]

证券代码

662446

交易单元号

29997

证券名称

19邳经债

账户

B883024675

结算场所

中国结算

对手方

交银施罗

结算方式

RTGS

买卖方向

卖出

价格类型

净价

价格

100.200

元

数量

600

千元面额/份

参考全价价格

100.2

元

参考应计利息

0

参考到期收益率

9.5198

%

参考结算金额

60.12

万元

确定(N)

关闭(C)

成交数量必须为成交单位的整数倍。目前系统配置利率债（国债）、公司债、特定债、仅在平台挂牌债券的成交单位默认为 100 手，信贷资产为 1000 手，REITs 为 1000 份，ETF 为 1 份。

交易员填写证券账户、交易单元、成交数量后，点击确定，系统校验通过后弹出交易成功提示



#### 4.4 待定报价

#### 4.4.1 待定报价点击回复

用户在待定报价信息窗口中

待定价											
证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买入结算方式	卖出结算方式
761008	担保单边	华夏基金	5000	100.000	0	-0.1324	101.000	3000	华夏基金	净额结算	净额结算

双击其他债券交易参与人所发出的某笔待定报价的价格字段,即可回复对方的待定报价。为避免用户点错,系统会给出信息提示,其中包括证券代码、买卖方向、净价价格、数量(对于债券,单位为千元面额;对于基金,单位为份; )、**结算方式**以及各类参考信息。

□ 待定报价(报价编号-36 对手方-华夏基金)				✕
证券代码	<input type="text" value="761008"/>	交易单元号	<input type="text" value="28027"/>	
证券名称	<input type="text" value="担保单边"/>	账户	<input type="text" value="B880155537"/>	
买卖方向	<input type="text" value="卖出"/>	剩余时间:	<span style="color: red;">19:55</span>	
净价价格	<input type="text" value="100.000"/>	元	数量	<input type="text" value="100"/> <span>千元面额</span>
参考全价价格	<input type="text" value="100"/>	元	参考应计利息	<input type="text" value="0"/>
参考到期收益率	<input type="text" value="0"/>	%	参考结算金额	<input type="text" value="10"/> <span>万元</span>
结算方式	<input type="text" value="净额结算"/>			

报价状态: 待确认

交易员选择交易账户和成交数量（对于债券，单位为千元面额；对于基金，单位为份；）后，点击确定，系统校验通过后弹出交易成功提示



则回复生效，并开始计时。

在对方确认前，用户还可撤消自己的回复。

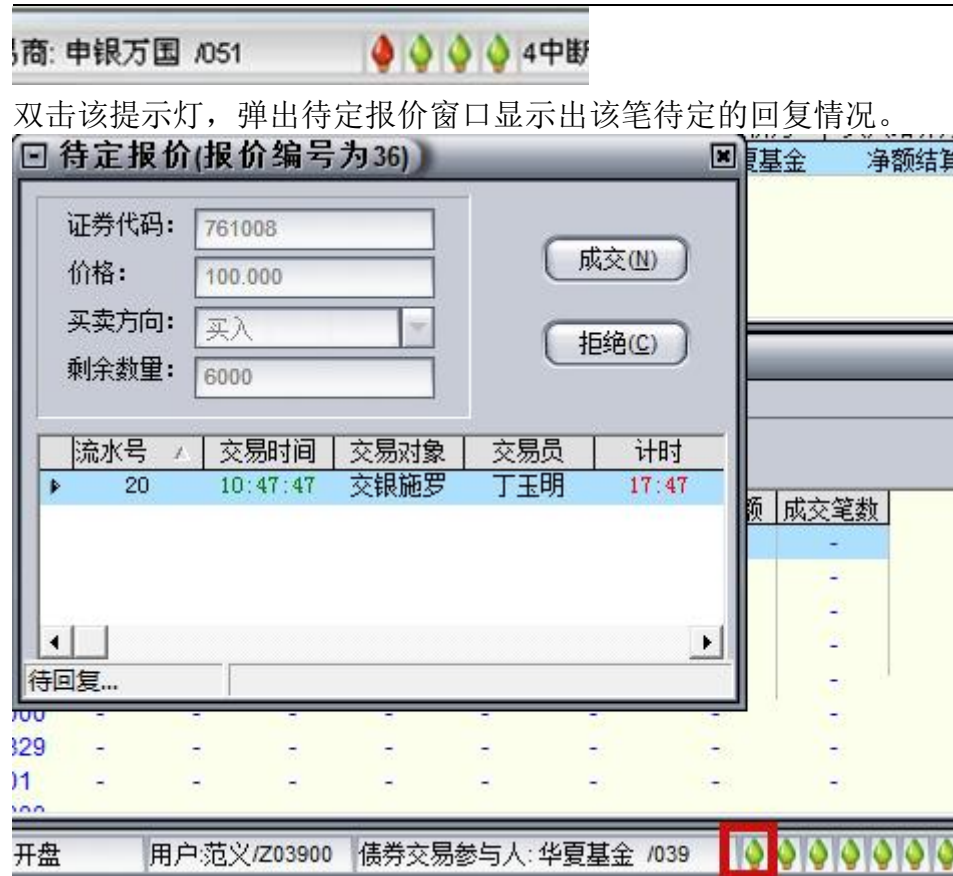
点击确定，系统校验无误后弹出撤销成功提示。



撤销成功后，该待定报价倒计时页面消失。

#### 4.4.2 待定报价确认成交

报价方收到回复后，系统状态栏上的报价状态灯的第一盏灯会不停闪烁以提示用户有新的待定报价回复待确定。

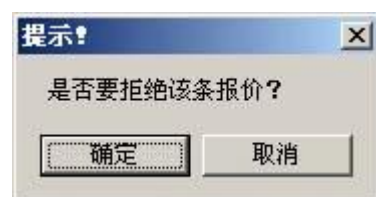


回复按照对手方回复时间先后顺序排列，用户必须从第一条回复开始逐笔处理。决定与其成交还是拒绝。如果用户没有及时处理其中的任何一条回复，则该条待定报价整体被自动撤销。注意：该条报价在自动撤销前已成功的成交不受影响。

如果用户想与当前列表中的第二条回复成交，则操作过程为：

#### 1. 拒绝当前的第一条回复

选中回复列表中的第一条回复，点击拒绝，弹出是否拒绝提示框



点击确定，提交系统校验成功后，弹出拒绝成功提示



点击确定后，该条回复从待定报价回复列表中消失，并将第二条回复置顶。

## 2. 成交第二条回复

选中置顶的回复，点击成交，弹出是否成交提示框



点击确定，提交系统交验成功后，弹出交易成功提示



点击确定成交，该条回复从列表中消失。

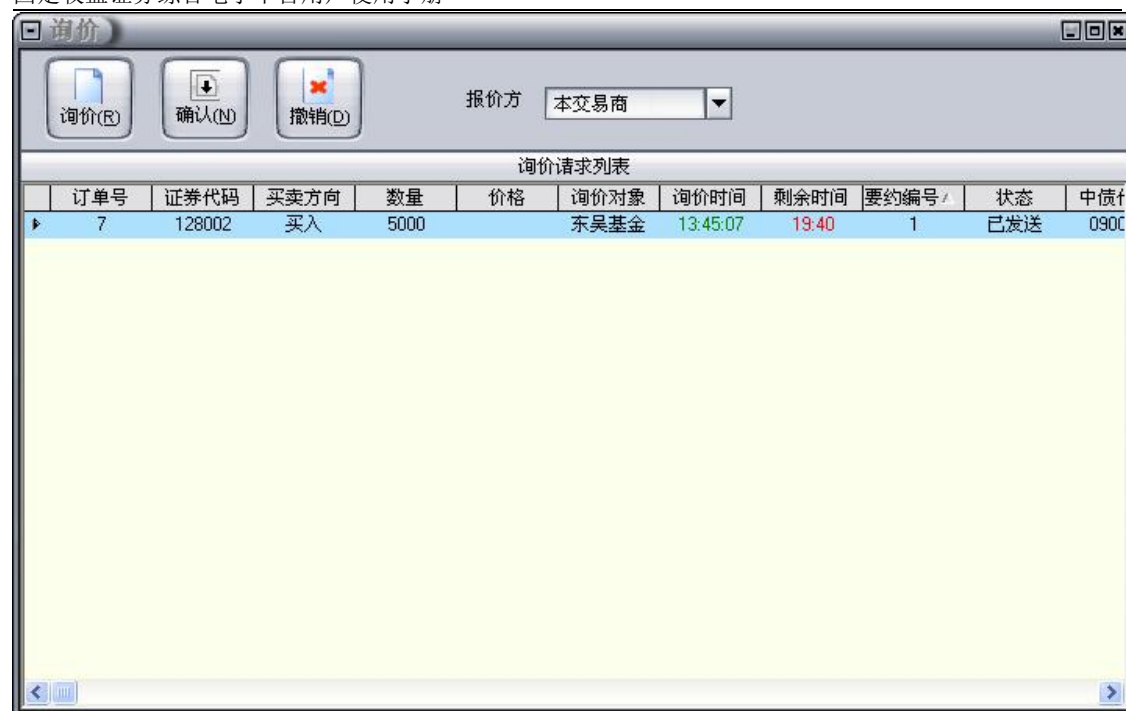
如果用户没处理第一条回复而直接与第二条回复成交，系统会弹出提示



## 4.5 询价交易

### 4.5.1 询价管理

点击交易—>现券交易—>询价弹出询价窗口，在这里进行询价发送和确认



在界面中显示的是该债券交易参与人当前的询价状态。

在列表中包含订单号、证券代码、买卖方向、**询价数量**（对于债券，单位为千元面额；对于基金，单位为份）、价格、询价对象、询价时间、剩余时间、要约编号、状态、中债代码、中债简称、结算场所、结算速度、价格类型、结算日期、**申报数量**（对于债券，单位为千元面额；对于基金，单位为份）、**结算方式**。

在此界面上的操作有发送询价、确认询价、撤销询价和报价方过滤。

询价：点击弹出询价请求对话框

确认：点击成交所选择的已回复询价

撤销：点击撤销某条选中的询价

报价方过滤：在下拉菜单中可选择“本债券交易参与人”和“本交易员”，询价请求列表中将会对应显示相应本债券交易参与人做出的询价信息或者本交易员做出的询价信息，过滤条件方便交易员查看全体询价交易情况和处理个人询价信息。

## 4.5.2 询价发送

点击询价，进入询价请求窗口发送询价



**询价请求**

证券代码:

证券简称:

结算场所:

证券账户:

交易单元号:

数量:

买卖方向:

价格类型:

结算方式:

结算日期:

结算速度 T+:

中债简称:

中债代码:

☐ 是否匿名

**选择一级债券交易参与者**

<input type="checkbox"/> 财通资管2	<input type="checkbox"/> 人保资产
<input type="checkbox"/> 国联安	<input type="checkbox"/> 招商证券
<input type="checkbox"/> 申万宏源	<input type="checkbox"/> 中信证券
<input type="checkbox"/> 国泰君安	<input type="checkbox"/> 华泰证券
<input type="checkbox"/> 长江证券	<input type="checkbox"/> 平安证券
<input type="checkbox"/> 光大证券	<input type="checkbox"/> 兴业证券
<input type="checkbox"/> 广发证券	<input type="checkbox"/> 中原证券
<input type="checkbox"/> 中金公司	<input type="checkbox"/> 国信证券
<input type="checkbox"/> 中银国际	<input type="checkbox"/> 国寿资产
<input type="checkbox"/> 中信建投	<input type="checkbox"/> 南京证券

普通债券交易参与者:

☐ 潜在投资者

结算周期:

界面各输入项说明如下:

证券代码: 6 位数字, 唯一标识该证券。

证券简称: 即上交所证券简称, 根据证券代码自动显示

买卖方向: 买入/卖出

证券账号: 可以选择本交易员有权使用的所有交易账户

交易单元号: 根据选择的账户自动匹配, 无需用户输入

数量 (千元面额/份): 必须不小于最小询价数量。最小询价数量由场务管理人员设置。

结算方式: 结算场所为中国结算, 若为担保券则可选择净额结算或 RTGS, 若为非担保券则为 RTGS。

是否匿名: 可以选择是否匿名发送

结算场所: 中国结算或中央结算。对于双边托管的证券默认为中国结算; 对



于单边托管的证券结算场所只能与托管场所相同

结算速度：仅当结算场所为 "中央结算" 时有效；默认为 T+0，可选择 T+0 或 T+1

中债代码：即中央结算证券代码。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示中债代码

中债简称：即中央结算证券简称。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示

价格类型：当输入证券代码时自动显示价格类型

结算日期：根据当前交易日期、结算速度、中债工作日期表，自动显示

选择一级债券交易参与者：框中列出了所有做市商，可同时勾选多个想对其询价的做市商，但其与普通债券交易参与人数量总和不能大于同时询价对手方数量，该数量由场务管理人员设置。

普通债券交易参与者：下拉列表中列出所有的普通债券交易参与者供选择，用户可以选择一个，也可以不选。但做市商和普通债券交易参与人数量总和不能大于同时询价对手方数量，该数量由场务管理人员设置。

潜在投资者：潜在投资者是根据持仓、成交、申报历史记录统计得出的较有可能对该券有投资交易意向的投资者。若勾选“潜在投资者”，则固收平台将随机选出 1-3 名潜在投资者所挂靠的债券交易参与者作为询价对象。询价成交前潜在投资者及其所挂靠的债券交易参与者保持匿名。

如果结算场所选择中央结算时，报价界面如下图：

询价请求

证券代码

证券简称

结算场所

中央结算

证券账户

数量

买卖方向

买入

价格类型

结算日期

2022-06-29

结算速度 T+

0

中债简称

中债代码

☒ 是否匿名

选择一级债券交易参与者

☐ 财通资管2

☐ 人保资产

☐ 国联安

☐ 招商证券

☐ 申万宏源

☐ 中信证券

☐ 国泰君安

☐ 华泰证券

☐ 长江证券

☐ 平安证券

☐ 光大证券

☐ 兴业证券

☐ 广发证券

☐ 中原证券

☐ 中金公司

☐ 国信证券

☐ 中银国际

☐ 国寿资产

☐ 中信建投

☐ 南京证券

普通债券交易参与者

请选择:

☐ 潜在投资者

结算周期

T+0

确定(N)

关闭(C)

如果结算场所为中国结算时，报价界面如下图：

询价请求

证券代码

证券简称

结算场所

中国结算

证券账户

交易单元号

数量

买卖方向

买入

价格类型

结算方式

选择一级债券交易参与者

财通资管2

人保资产

国联安

招商证券

申万宏源

中信证券

国泰君安

华泰证券

长江证券

平安证券

光大证券

兴业证券

广发证券

中原证券

中金公司

国信证券

中银国际

国寿资产

中信建投

南京证券

普通债券交易参与者

请选择:

潜在投资者

是否匿名

结算周期

T+0

确定(N)

关闭(C)

询价信息设置后，点确定发送询价，



该条询价显示在询价窗口中。

询价

询价(S)

确认(S)

撤销(D)

报价方 本交易商

询价请求列表														
订单号	证券代码	买卖方向	询价数量	价格	询价对象	询价时间	要约编号	状态	中债代码	中债简称	结算场所	结算速度	价格类型	结算日期
1	123050	买入	1000		广发证券	13:23:49	1	已发送			中国结算		净价	RTGS
订单号	证券代码	买卖方向	询价数量	价格	询价对象	询价时间	要约编号	状态	中债代码	中债简称	结算场所	结算速度	价格类型	结算日期
2	123037	卖出	200		长江证券	13:25:47	2	已发送			中国结算		净价	RTGS
	123037	卖出	200		光大证券	13:25:47	3	已发送			中国结算		净价	RTGS
	123037	卖出	200		广发证券	13:25:47	4	已发送			中国结算		净价	RTGS

向几个债券交易参与人询价，就会有相同**询价数量**的询价请求列。询价时间显示询价发送时间，状态表明该条询价的状态。价格显示对手方的报价。

4.5.3被询价管理

当用户看到系统状态栏上右手边第三盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发送询价请求



在该灯上双击，打开被询价窗口

被询价

报价(S)

撤销(D)

询价方	时间	证券代码	买卖方向	价格	询价数量	状态	中债代码	中债简称	结算场所	结算速度	价格类型
匿名	10:54:11	762483	买入	101.000	5000	已发送			中国结算		净价



被询价窗口显示询价方发送的询价信息。

在列表中包含询价方、时间、证券代码、买卖方向、价格、**询价数量**、剩余时间、状态。价格为空，状态，中债代码，中债简称，结算场所，结算速度，价格类型，结算日期，**申报数量**，**结算方式**，状态为待确定时表明用户还未对其报价，**匿名发送显示匿名**。

在此界面上的操作有报价、撤销。

报价：点击弹出报价窗口对其报价

撤销：点击撤销选中询价

#### 4.5.4 询价回复

选中想要对其报价的询价信息，点击报价，弹出报价窗口

如果结算场所为中央结算时，报价界面如下图：



报价界面截图，显示了以下信息：

证券代码	010107	证券简称	21国债(7)
证券账户		买卖方向	卖出
价格		数量	10000
价格类型	净价	结算场所	中央结算
结算日期	2018-05-18	结算速度	T+ 0
中债简称	中债简称	中债代码	101007
对手方账户名称	啊啊所发生非		
账户名称			

底部按钮：确定(N)、关闭(C)

如果结算场所为中国结算时，报价界面如下图：



报价界面截图，显示了以下信息：

证券代码	762483	证券简称	T+1私募C
交易单元号	21273	买卖方向	卖出
证券账户	D890158540	询价数量	5000
价格	101.000 元	结算场所	中国结算
价格类型	净价	结算方式	RTGS
申报数量	100		

底部按钮：确定(N)、关闭(C)

用户确认询价方询价信息后，选择股东账号并输入价格、**申报数量**。点击确定提交报价。



价格：报价浮动以系统配置为准

申报数量：申报数量不大于询价数量。对于债券，单位为千元面额；对于基金，单位为份；

被询价方可以修改报价价格和数量，也可以撤销本次回复

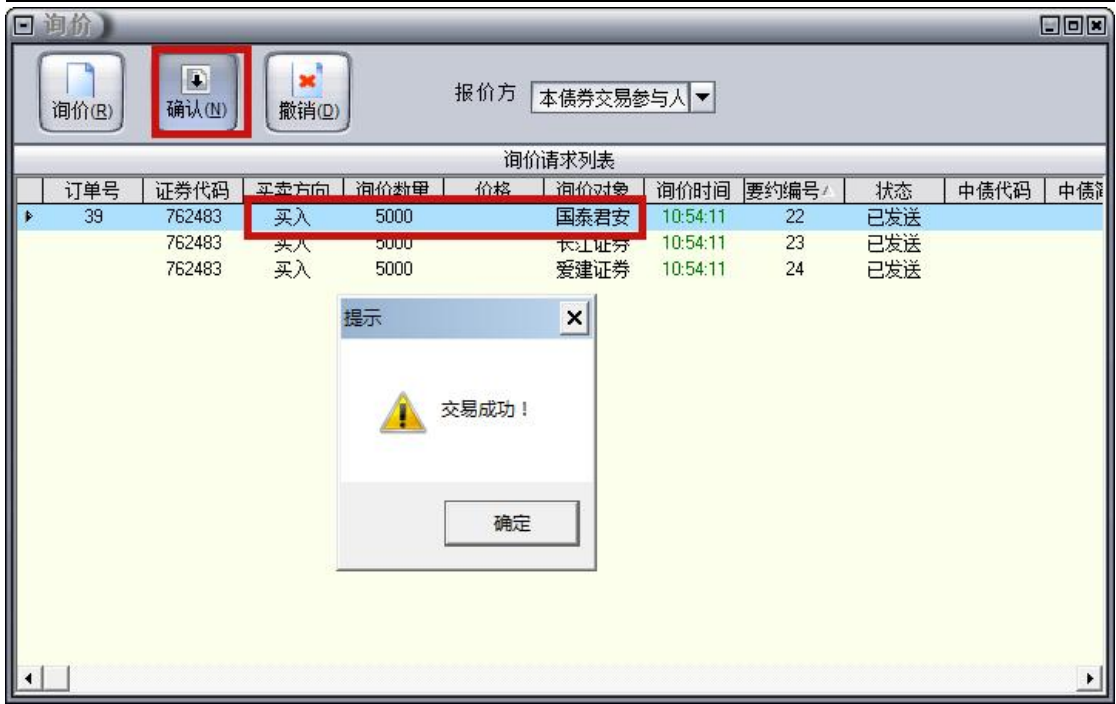


#### 4.5.5 询价确认

询价对手方报价后，询价方的询价窗口中该对手方的询价信息发生改变。如果询价方的询价窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第二盏灯不停的闪动，表明有交易员响应其询价请求。



双击该灯，弹出询价窗口



有对手方报价的询价请求列状态变为待确定，价格上显示的是该对手方的报价。

如果交易员对这个价格满意，选中该条询价请求后，点击确认，弹出交易确认提示



点击确定，提交至系统校验通过后弹出交易成功提示。**本条交易成功，记录消失，其他询价请求仍有效**



### 4.5.6 询价撤销

如果用户想放弃该询价，在询价窗口点击撤销，弹出撤销询价提示框



点击确定，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



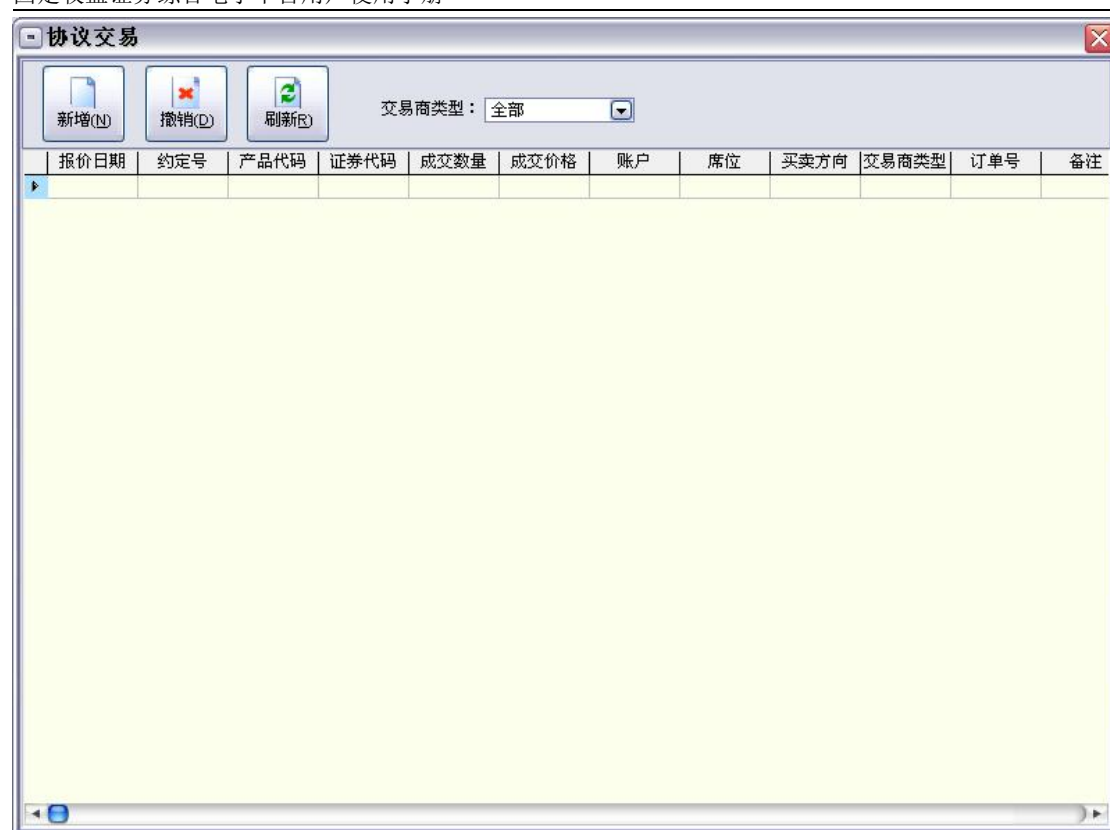
确定后，该询价请求会从本方询价窗口和所有询价对手方被询价窗口消失。

## 4.6 协议交易

### 4.6.1 协议交易录入管理

协议交易不支持 REITs、**债券 ETF** 产品。

点击交易—>现券交易—>协议交易弹出协议交易管理窗口，在这里进行协议交易操作



协议交易管理窗口上方按钮可以新增，撤销和查看协议交易，也可分债券交易参与人类型（券商、客户、全部）查询协议交易信息。下方为协议交易详细信息列表。

新增：点击弹出协议交易录入界面录入协议交易信息

删除：点击删除录入的协议交易

刷新：点击即时刷新协议交易信息列表

用户只有分别以债券交易参与人身份和客户身份录入协议交易后，经系统核对后该协议交易才能成功。

#### 4.6.2 协议交易录入（债券交易参与人）

点击新增，弹出协议交易录入窗口

债券交易参与人选择债券交易参与人录入，此时客户股东账户，客户交易单元，客户名称禁止输入。界面各输入项说明如下：

证券代码：6 位数字，唯一标识该证券。

成交数量（千元面额）：必须不小于协议交易最小数量。协议交易最小数量由场务管理人员设置。

成交价格：**以系统配置为准**

约定号：系统通过约定号匹配协议交易信息，为三位数字

债券交易参与人股东账户：可以选择本债券交易参与人的所有交易账户

自营交易单元：根据选择的账户自动匹配，无需用户输入

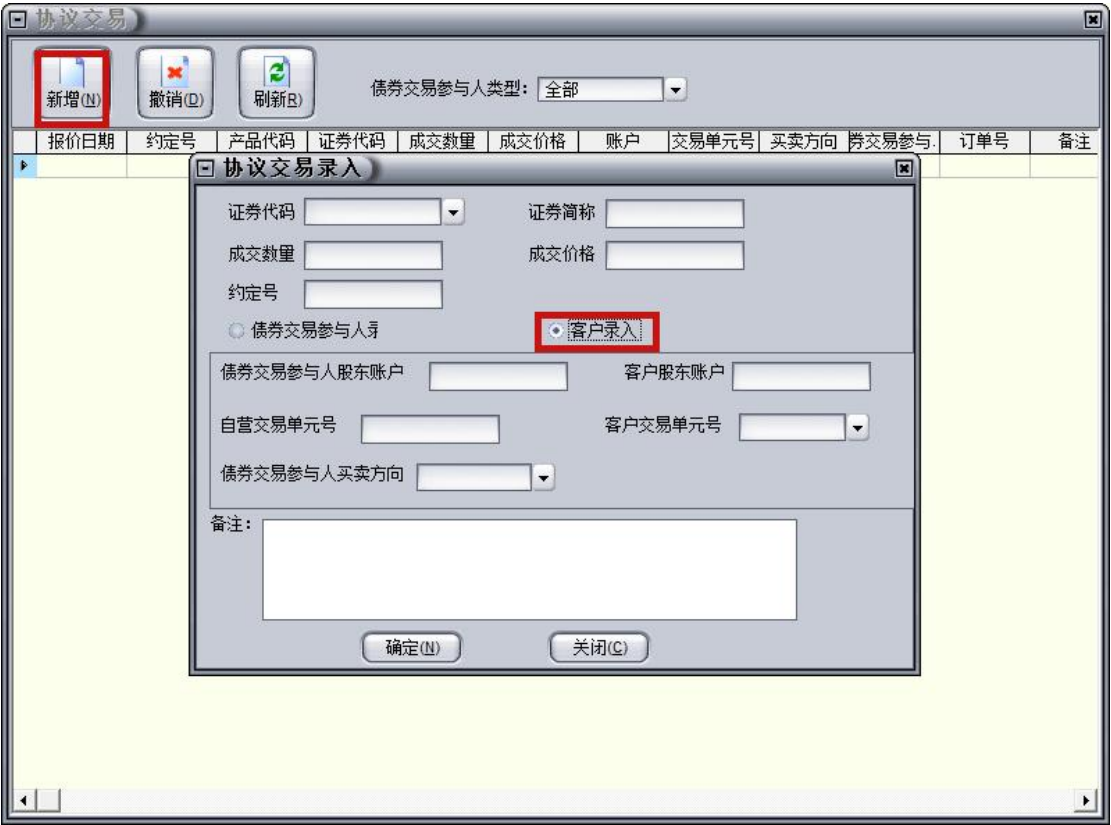
债券交易参与人买卖方向：可以选择买进或卖出。不管是录入债券交易参与人还是客户，选择的交易方向以债券交易参与人为主。

点击确定提交协议交易，后台审核通过后，该条协议交易信息在列表中显示



4.6.3协议交易录入（客户）

点击协议交易管理窗口的新增，弹出协议交易录入窗口





债券交易参与人选择客户录入，此时债券交易参与人股东账户，自营交易单元禁止输入。用户输入成交的证券代码，成交数量（千元面额），成交价格，约定号，客户股东账户，客户交易单元，客户名称和买卖方向（注意：这里的买卖方向同债券交易参与人录入的买卖方向，方便交易员输入），填上备注后，点击确定提交协议交易。

系统后台核对成功后，弹出匹配成功提示框。



确定后，该约定号的协议交易信息从协议交易管理窗口消失，交易成功。要想查看该笔交易，可以在查询统计的协议交易查询窗口查到。

## 4.7 转托管

点击交易—>现券交易—>转托管，进入转托管信息管理界面。



用户在此管理需要转托管信息。

在列表中列出申报的转托管信息，包含申报日期、产品代码、证券代码、证券名称、托管数量、证券账户、交易单元、编号、银行间托管账号和交易员代码。

在此界面上的操作有新增转托管信息、撤销转托管信息和刷新转托管信息。

新增：点击弹出转托管录入对话框



用户在此申报需要转托管的证券信息，完成转托管操作。

界面各输入项说明如下：

证券代码：准备转托管的现券代码。

托管数量：准备转托管的现券数量，以千元面额为单位。

证券账户：准备转托管的账号。输入。

交易单元：输入。

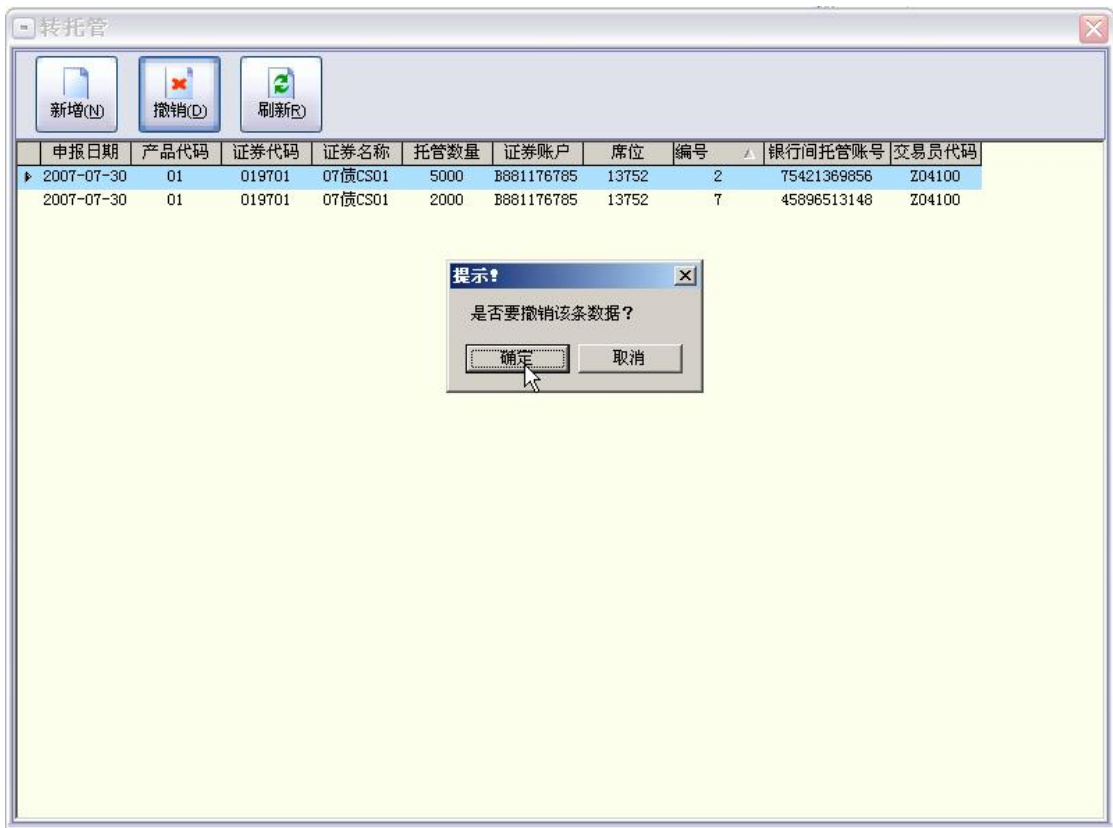
银行间托管账号：11 位托管账号。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即转托管录入成功，弹出提示框



该条转托管信息即出现在转托管界面下方的转托管信息列表中。

撤销：选中转托管信息列表中的某条希望撤销的转托管信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框

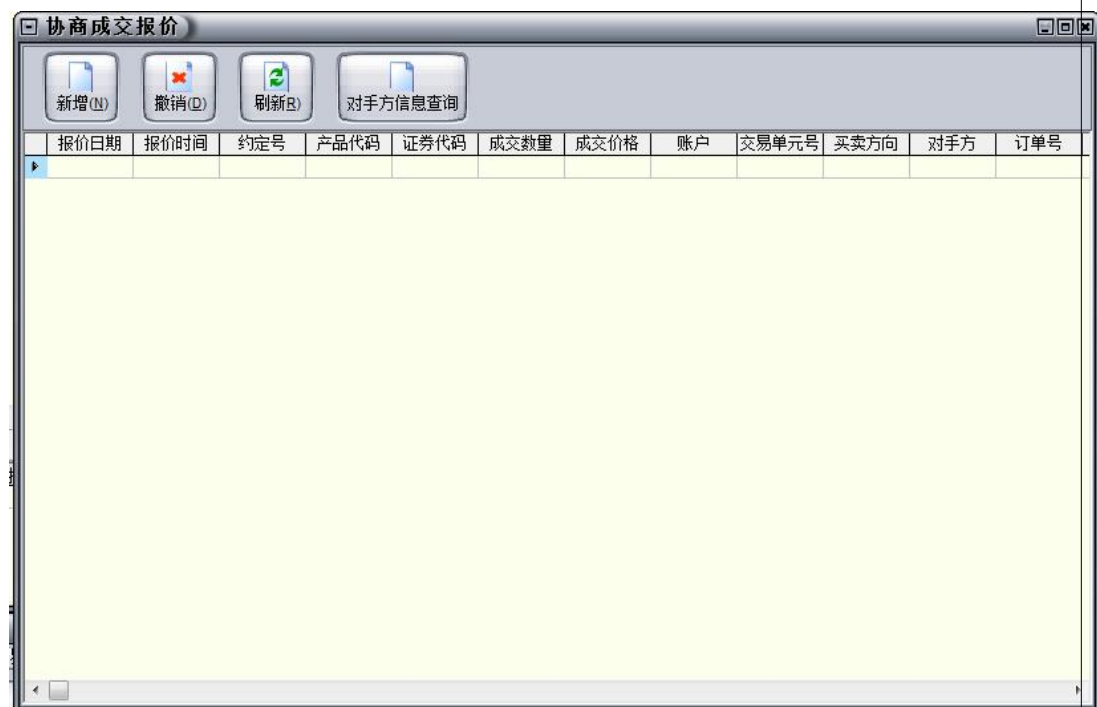


该条转托管信息即在转托管信息列表中消失。

刷新：点击刷新转托管信息列表中的信息。

## 4.8 协商成交报价

点击交易—>现券交易—>协商成交报价，进入协商成交报价信息管理界面。



用户在此管理需要协商成交报价信息。

在列表中列出申报的协商成交报价信息，包含报价日期、报价时间、约定号、产品代码、证券代码、成交数量（千元面额/份）、成交价格、账户、交易单元、买卖方向、对手方、订单号、中债代码、中债简称、结算场所、结算速度、价格类型、结算日期、**结算方式**。

在此界面上的操作有新增协商成交报价信息、撤销协商成交报价信息和刷新协商成交报价信息。

新增：点击弹出协商成交报价录入对话框

用户在此申报需要协商成交报价信息，完成协商成交报价操作。

界面各输入项说明如下：

证券代码：现券代码。

成交数量：协商成交报价的现券数量，债券单位为千元面额，基金单位为份。

成交净价：协商成交报价的净价。

成交全价：协商成交报价的全价。

约定号：双方约定的号码

账号：如果中国结算是 10 位账号，支持信用账户卖出现券；中央结算是 11 位账号。

对手方交易员：对手方交易员

交易单元：交易员自己输入

买卖方向：买入/卖出

结算方式：结算场所为中国结算，若为担保券则可选择净额结算或 RTGS，若为非担保券则为 RTGS；

**结算场所：**中国结算或中央结算。对于双边托管的证券默认为中国结算；对于单边托管的证券结算场所只能与托管场所相同

**结算速度：**仅当结算场所为 "中央结算" 时有效；默认为 T+0，可选择 T+0 或 T+1

**中债代码：**即中央结算证券代码。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示中债代码

**中债简称：**即中央结算证券简称。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示

**价格类型：**当输入证券代码时自动显示价格类型

**账户名称：**本方账户名称

**结算日期：**根据当前交易日期、结算速度、中债工作日期表，自动显示

如果结算场所选择中央结算时，报价界面如下图：

证券代码	<input type="text"/>	证券简称	<input type="text"/>
成交数量	<input type="text"/>	成交净价	<input type="text"/>
约定号	<input type="text"/>	成交全价	<input type="text"/>
证券账户	B071249490	结算场所	中央结算
对手方交易员	<input type="text"/>	买卖方向	<input type="text"/>
价格类型	<input type="text"/>	参考结算金额	<input type="text"/> 万元
中债简称	<input type="text"/>	结算速度	T+ 0
结算日期	2023-05-11	中债代码	<input type="text"/>
账户名称		<input type="text"/>	
确定(O)		关闭(C)	

如果结算场所为中国结算时，报价界面如下图：



该界面为“协商成交报价录入”窗口，包含以下字段：

- 证券代码：010107 21国债(7)
- 证券简称：21国债(7)
- 成交数量：[输入框]
- 成交净价：[输入框]
- 约定号：[输入框]
- 成交全价：[输入框]
- 证券账户：[输入框]
- 结算场所：中国结算
- 对手方交易员：[输入框]
- 席位：[输入框]
- 价格类型：净价
- 买卖方向：[下拉菜单]
- 结算方式：净额结算 (下拉菜单显示选项：净额结算, RTGS, 净额结算)
- 参考结算金额：[输入框] 万元
- 账户名称：[输入框]

底部按钮：确定(O)、关闭(C)

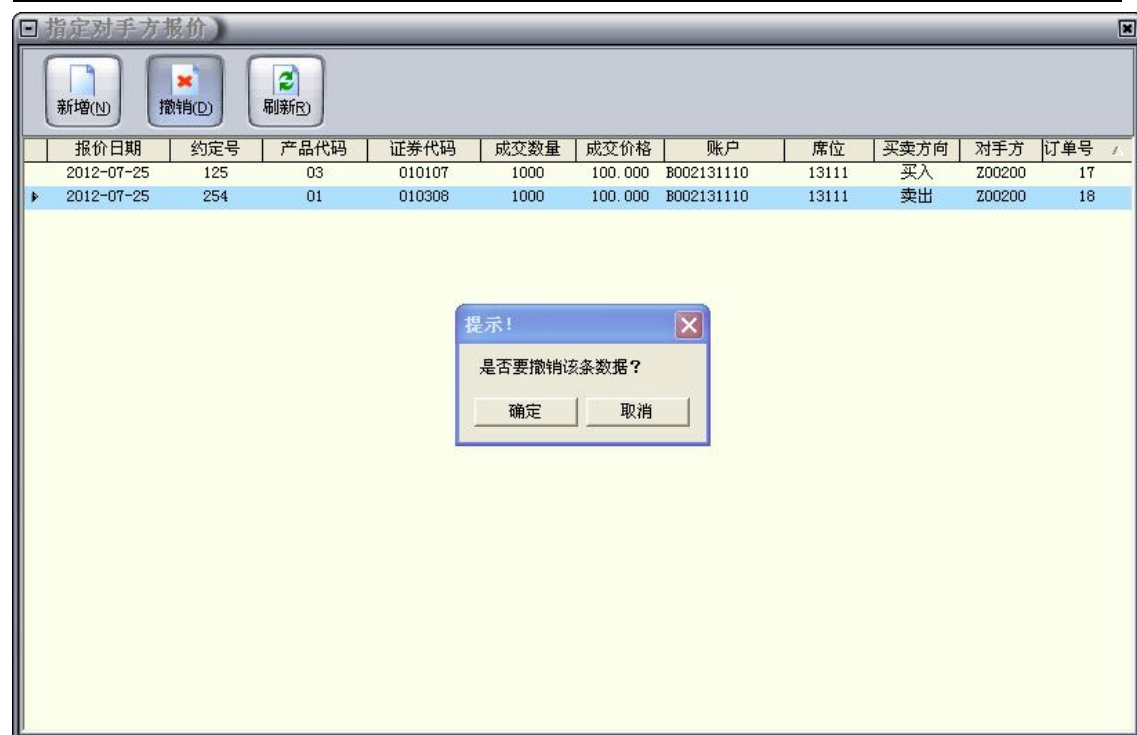
填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即协商成交报价录入成功，弹出提示框



该条协商成交报价信息即出现在协商成交报价界面下方的信息列表中。

撤销：选中协商成交报价信息列表中的某条希望撤销的协商成交报价信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框





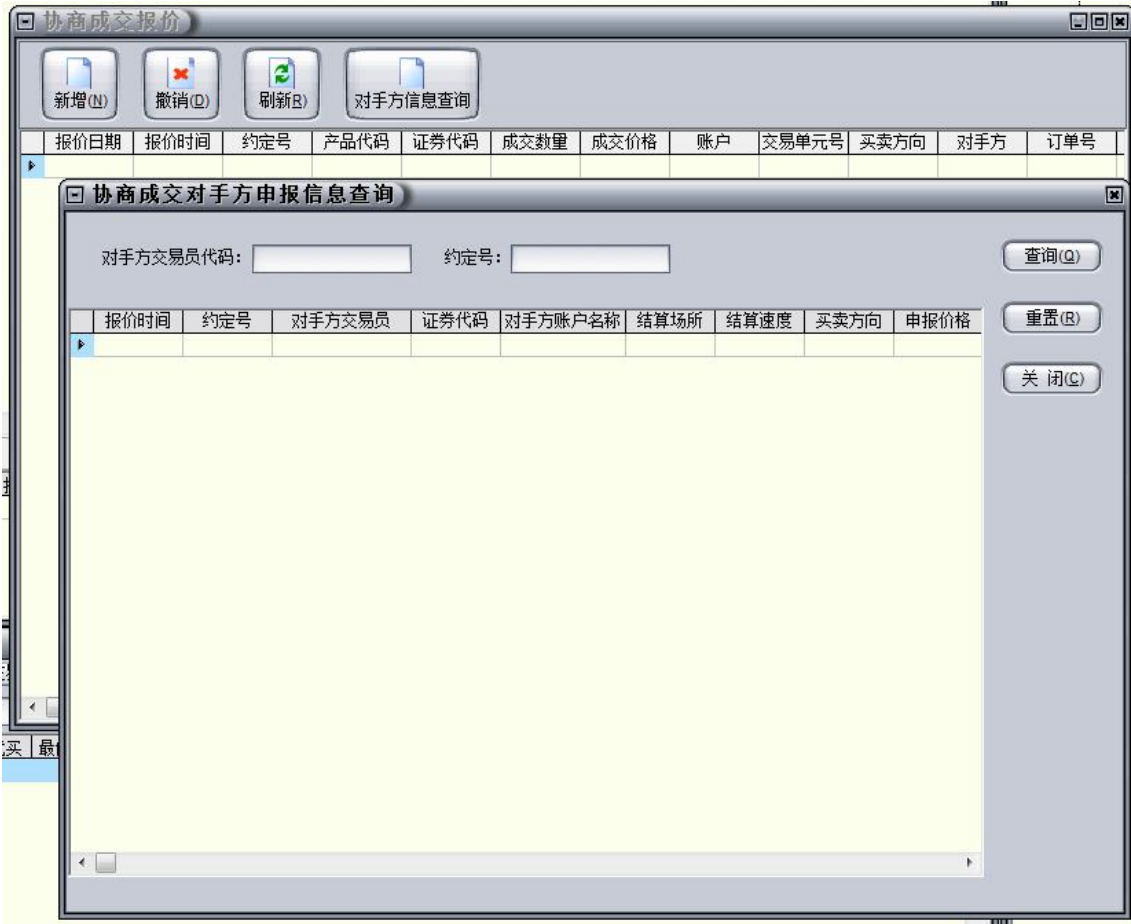
点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条协商成交报价信息即在协商成交报价信息列表中消失。

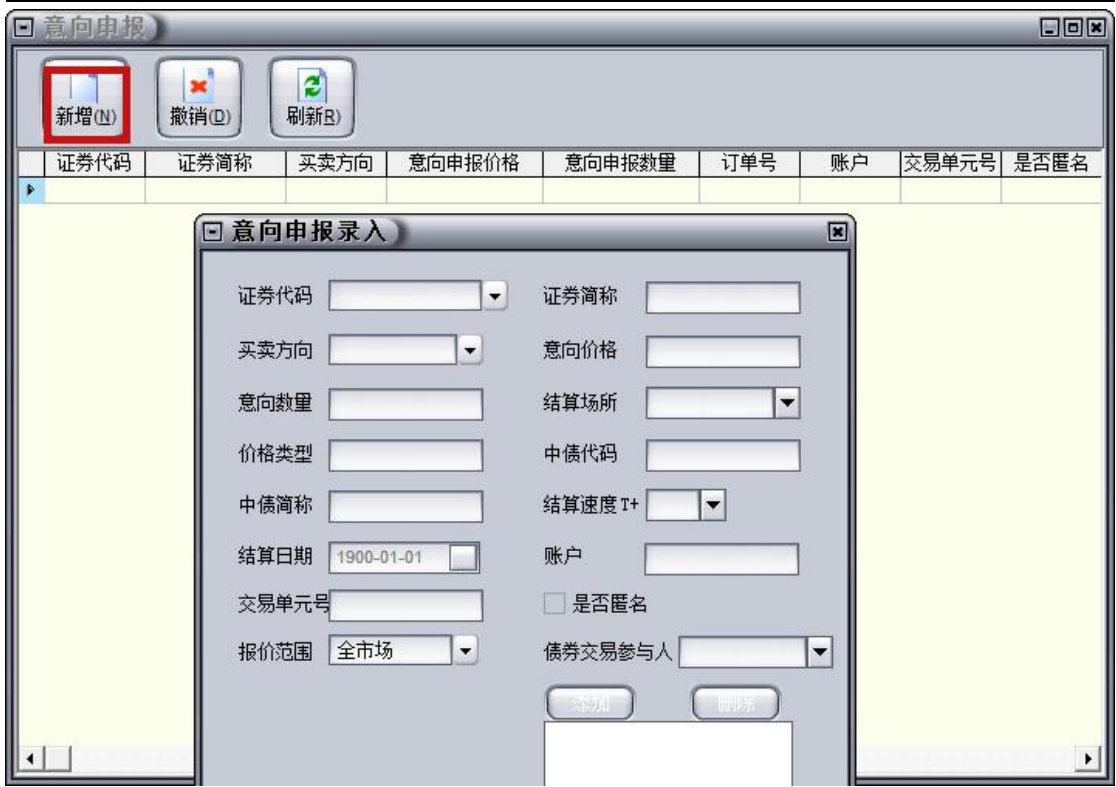
刷新：点击刷新协商成交报价信息列表中的信息。

对手方信息查询：点击查询对手方信息。可以查询当日协商成交对手方申报的明细。仅未成交的申报信息可通过此功能查询。仅当本方已经申报相同的约定号且交易员代码匹配且未成交的协商成交申报时，才可查询到对手方的申报信息。



## 4.9 意向申报

点击交易—>现券交易—>意向申报，进入意向申报信息管理界面。



用户在此管理需要意向申报的信息。

在列表中列出申报的意向申报信息，包含证券代码、证券简称、买卖方向、意向申报价格、意向申报数量、**账户**、**交易单元**、**是否匿名**、**报价范围**和订单号等信息。

在此界面上的操作有新增意向申报信息、撤销意向申报信息和刷新意向申报信息。

新增：点击弹出意向申报对话框

用户在此申报需要意向申报信息，完成意向申报操作。

界面各输入项说明如下：

证券代码：现券代码。

买卖方向：买入/卖出

意向价格：意向申报的价格。

意向数量：意向申报数量，以千元面额为单位。

报价范围：可以选择向全市场发布，或向部分债券交易参与人发布（支持 5 家）

是否匿名：可以选择是否匿名发送

账号：如果中国结算是 10 位账号，支持信用账户卖出现券；中央结算是 11 位账号。

交易单元：准备交易单元，交易员自己输入

结算场所：中国结算或中央结算。对于双边托管的证券默认为中国结算；对于单边托管的证券结算场所只能与托管场所相同

结算速度：仅当结算场所为 "中央结算" 时有效；默认为 T+0，可选择 T+0 或 T+1

中债代码：即中央结算证券代码。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示中债代码

证券简称：即上交所证券简称，根据证券代码自动显示

中债简称：即中央结算证券简称。仅当结算场所为"中央结算"时有效，当输入上交所证券代码时自动显示

价格类型：当输入证券代码时自动显示价格类型

结算日期：根据当前交易日期、结算速度、中债工作日期表，自动显示

如果结算场所选择中央结算时，报价界面如下图：

The screenshot shows a software window titled "意向申报录入" (Intention Declaration Entry). It contains two columns of input fields. The left column includes: "证券代码" (Security Code) with a dropdown arrow, "买卖方向" (Buy/Sell Direction) with a dropdown arrow, "意向数量" (Intention Quantity) as a text box, "价格类型" (Price Type) as a text box, "中债简称" (Central Settlement Short Name) as a text box, "结算日期" (Settlement Date) showing "2022-06-29" with a calendar icon, "交易单元号" (Trading Unit Number) as a text box, and "报价范围" (Quotation Range) with a dropdown arrow set to "全市场" (All Market). The right column includes: "证券简称" (Security Short Name) as a text box, "意向价格" (Intention Price) as a text box, "结算场所" (Settlement Venue) with a dropdown arrow set to "中央结算" (Central Settlement), "中债代码" (Central Settlement Code) as a text box, "结算速度 T+" (Settlement Speed T+) with a dropdown arrow set to "0", "账户" (Account) as a text box, an unchecked checkbox for "是否匿名" (Is Anonymous), and "债券交易参与者" (Bond Trading Participant) with a dropdown arrow. Below these fields are two buttons: "添加" (Add) and "删除" (Delete). At the bottom are two buttons: "确定(Q)" (Confirm) and "关闭(C)" (Close). A large empty rectangular area is located below the "删除" button.

如果结算场所为中国结算时，报价界面如下图：



意向申报录入

证券代码  证券简称

买卖方向  意向价格

意向数量  结算场所

价格类型

交易单元号  账户

报价范围  ☐ 是否匿名

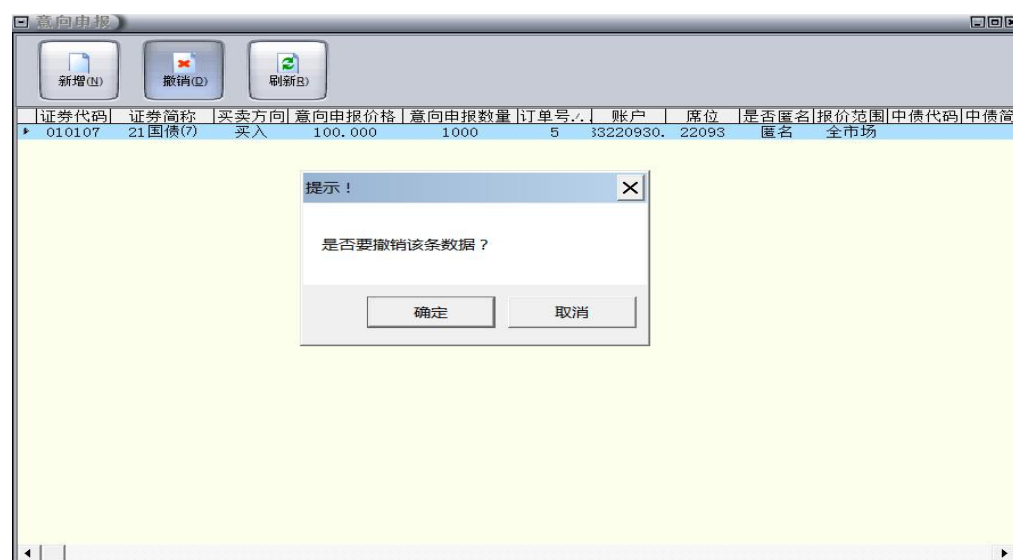
债券交易参与人

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即意向申报录入成功，弹出提示框



该条意向申报信息即出现在意向申报界面下方的信息列表中。

撤销：选中意向申报信息列表中的某条希望撤销的意向申报信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



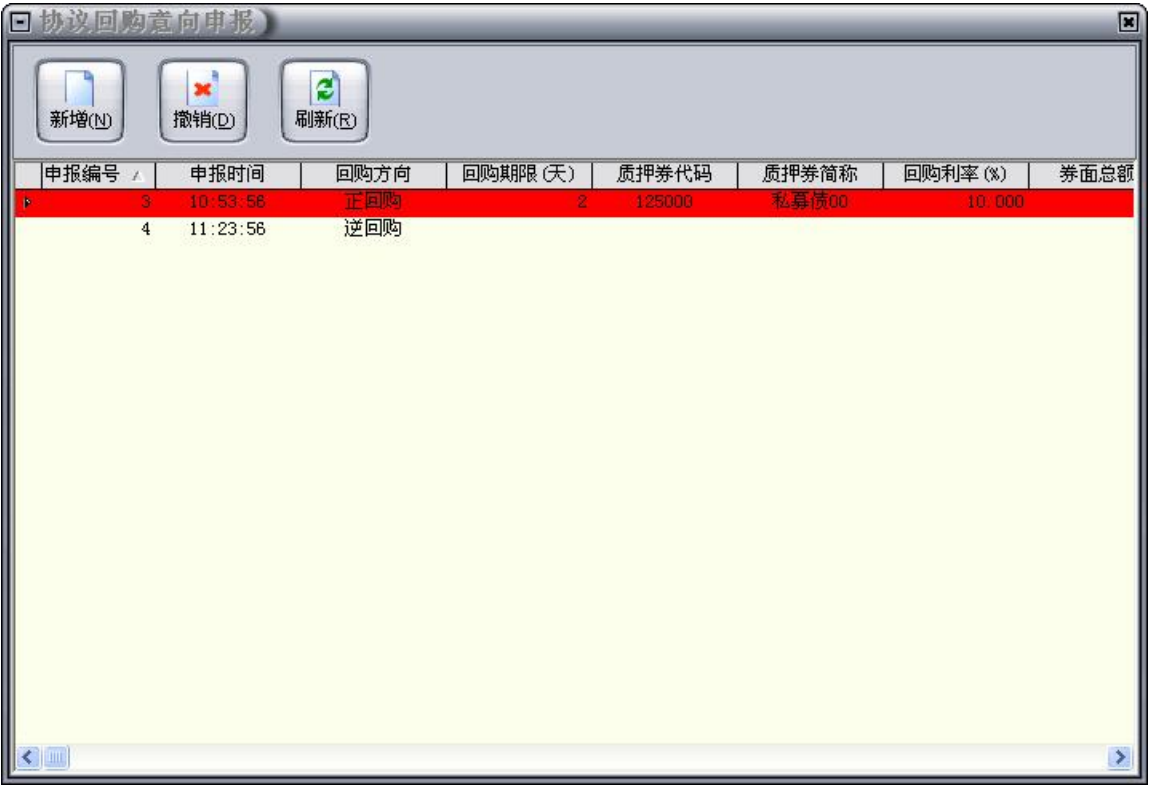
该条意向申报信息即在意向申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新意向申报信息列表中的信息。

## 4.10 协议回购意向申报

点击交易—>协议回购交易—>意向申报，进入协议回购意向申报信息管理平台。





用户在此管理需要意向申报的信息，选中回购方向为正回购时选中的数据背景色为红色，逆回购背景为显示为绿色

在列表中列出申报的意向申报信息，包含申报编号、申报时间、回购方向、回购期限、质押券代码、质押券简称、回购利率、券面总额、质押数量、折算比例、成交金额、首次交收日、回购到期日、到期交收日、申报债券交易参与者简称、申报交易员代码、申报状态、备注。

在此界面上的操作有新增意向申报信息、撤销意向申报信息和刷新意向申报信息。

新增：点击弹出意向申报对话框



**新增协议回购意向申报**

回购方向 *	正回购	回购期限		天
质押券代码		质押券简称		
回购利率		折算比例		%
质押数量		质押券面值总额	0	元
成交金额	0.00	元	回购到期日	1900-01-01
首次结算日	2022-06-29		到期结算日	1900-01-01
申报日期	2022-06-29		交易员代码	Z03900
交易员名称	范义	债券交易参与人	华夏基金	
备注				

确定(O)      关闭(C)

用户在此申报需要意向申报信息，完成意向申报操作。

**说明：**所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

界面各输入项说明如下：

回购方向：正回购/逆回购

回购期限：回购到期日－成交日期

质押券代码：质押债券的代码

质押券简称：质押债券的简称

回购利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

折算比率：折算比率=(成交金额/质押券面值总额)\*100%

质押数量：质押券数量。对于债券，单位为千元面额；对于基金，单位为份。

质押券面值总额：质押债券面值总额=质押数量（千元面额/份）×10×

## 单张质押券面值

成交金额：正回购方融入的资金额度

回购到期日：参与人确定的回购到期日期

首次结算日：等于成交日期

到期结算日：到期结算日

申报日期：交易日期

交易员代码：交易员代码

交易员名称：交易员名称

债券交易参与人：债券交易参与人名称

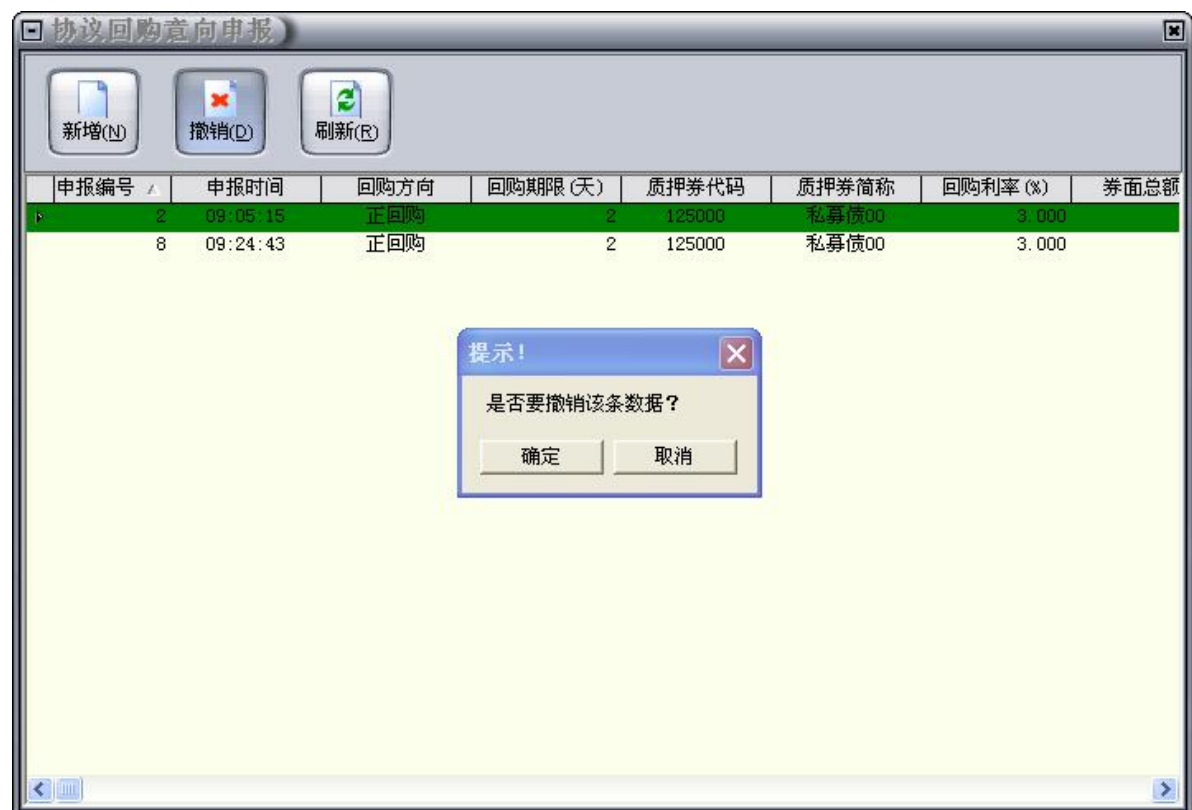
备注：备注，输入一些联系方式

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即意向申报录入成功，弹出提示框



该条意向申报信息即出现在意向申报界面下方的信息列表中。

撤销：选中意向申报信息列表中的某条希望撤销的意向申报信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条意向申报信息即在意向申报信息列表中消失。

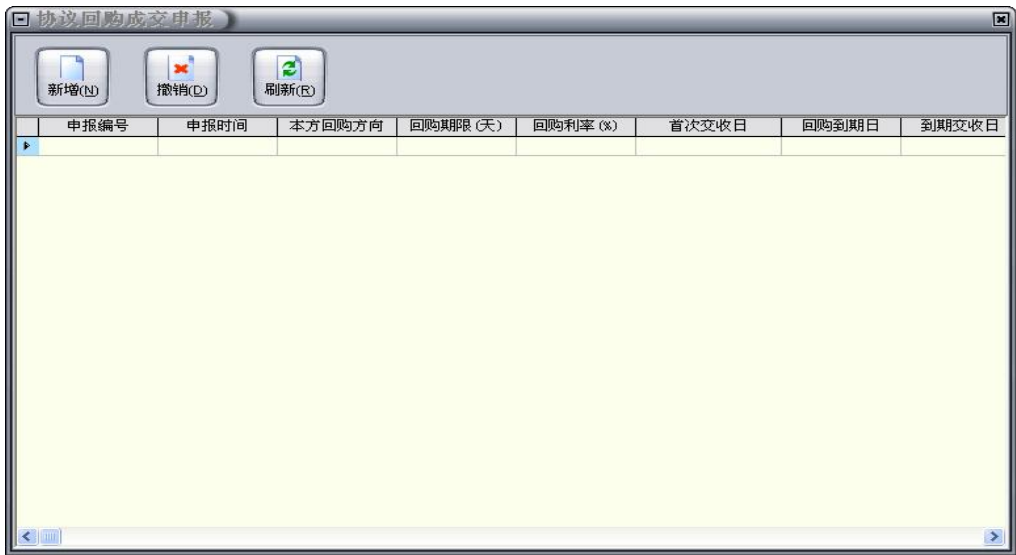
刷新：点击刷新意向申报信息列表中的信息。

## 4.11 协议回购成交申报

### 4.11.1 成交申报

此界面中质押券仅分别选择债券现券产品或**债券 ETF 产品**，不可选择 REITs 产品。

点击交易—>协议回购交易—>成交申报，进入协议回购成交申报信息管理界面。



用户在此管理需要成交申报的信息。

在列表中列出申报的成交申报信息，包含申报编号、申报时间、本方回购方向、回购期限、回购利率、首次交收日、回购到期日、到期交收日、实际占款天数、正回购债券交易参与者简称、正回购交易员代码、正回购证券账号、正回购交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购交易员代码、申报状态、备注。

在此界面上的操作有新增成交申报信息、撤销成交申报信息和刷新成交申报信息。

新增：点击弹出成交申报对话框

新增协议回购成交申报

回购方向

☐ 正回购
☒ 逆回购

交易期限(天)

回购期限 \*

7

天

成交日 \*

2022-06-29

首次结算日 \*

2022-06-29

回购到期日 \*

2022-07-06

到期结算日 \*

2022-07-06

实际占款天数 \*

7

证券账户 \*

B880115545

交易单元号 \*

22180

对手方交易员代码 \*

Z05100

对手方交易员名称

黄辉

对手方债券交易参与人

[051]申万宏源

回购利率(%) \*

2.1

质押券面值总额合计 \*

5,000,000

元

成交金额合计 \*

3,500,000.00

元

回购利息合计 \*

1,409.59

元

到期结算金额合计 \*

3,501,409.59

元

账户名称 \*

华夏基金帐户1

交易员代码 \*

Z03900

交易员名称

范义

债券交易参与人 \*

华夏基金

补充条款

质押券代码 \*

010101 国债77

质押券简称

国债77

质押数量 \*

5000

质押券面值总额 \*

5,000,000

元

折算比例(%) \*

70

成交金额 \*

3,500,000.00

元

回购利息 \*

1409.59

元

到期结算金额 \*

3,501,409.59

元

增加

修改

删除

证券代码	押数量(千元面额)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
010101	5000	70	3500000	1409.59

确定(N)

关闭(C)

用户在此申报需要成交申报信息，完成成交申报操作。

说明：所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

界面各输入项说明如下：

回购方向：正回购/逆回购，默认正回购，成交申报只能正回购方发起

回购期限：回购到期日－成交日期

成交日：当前交易日

首次结算日：等于成交日期

回购到期日：参与人确定的回购到期日期

到期结算日：到期结算日

实际占款天数：到期结算日－首次结算日

证券账户：资金融入方的证券账户

交易单元号：资金融入方证券帐号指定交易单元号

对手方交易员代码：对手方交易员代码

对手方交易员名称：对手方交易员名称

对手方债券交易参与人：对手方债券交易参与人名称

回购利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

质押券面值总额合计：多券申报券面值总额合计

成交金额合计：多券申报正回购方融入的资金额度合计

回购利息合计：多券申报 成交金额×回购利率×实际占款天数/365 合

计

到期结算金额合计：多券申报为到期日正回购方返回的金额合计

交易员代码：交易员代码

交易员名称：交易员名称

债券交易参与人：债券交易参与人名称

补充条款：交易双方的补充约定条款

申报界面支持批量申报，即支持一次性提交针对同一交易对手方、使用同一回购利率与同一回购期限的多个质押券交易申报，申报元素：

质押券代码：质押债券的代码

质押券简称：质押债券的简称

质押券数量：质押券数量，债券单位为千元面额，基金单位为份。



质押券面值总额：质押债券面值总额=质押数量（千元面额/份）×10×  
单张质押券面值

折算比率：折算比率=(成交金额/质押券面值总额)\*100%

成交金额：正回购方融入的资金额度

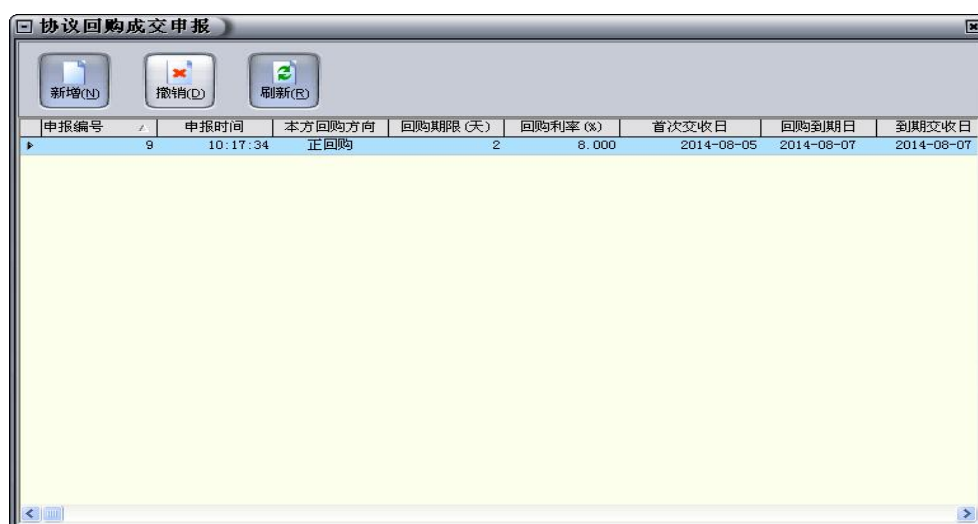
回购利息：成交金额×回购利率×实际占款天数/365

到期结算金额合计：多券申报为到期日正回购方返回的金额

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即成交申报录入成功，弹出提示框



该条成交申报信息即出现在成交申报界面下方的信息列表中。



## 4.11.2 成交申报撤销

如果用户想撤销该笔申报，选中成交申报信息列表中的某条希望撤销的成交申报信息，点击撤销，弹出撤销提示框

新增协议回购成交申报

回购方向

☐ 正回购
☒ 逆回购

交易期限(天)

回购期限 \* 7 天

成交日 \* 2022-06-29

首次结算日 \* 2022-06-29

回购到期日 \* 2022-07-06

到期结算日 \* 2022-07-06

实际占款天数 \* 7

证券账户 \* B880115545

交易单元号 \* 22180

对手方交易员代码 \* Z05100

对手方交易员名称 黄辉

对手方债券交易参与者 [051]申万宏源

回购利率(%) \* 2.1

质押券面值总额合计 \* 5,000,000 元

成交金额合计 \* 3,500,000.00 元

回购利息合计 \* 1,409.59 元

到期结算金额合计 \* 3,501,409.59 元

账户名称 \* 华夏基金帐户1

交易员代码 \* Z03900

债券交易参与者 \* 华夏基金

交易员名称 范义

补充条款

质押券代码 \* 010101 国债77

质押数量 \* 5000

折算比例(%) \* 70

回购利息 \* 1409.59 元

质押券简称 国债77

质押券面值总额 \* 5,000,000 元

成交金额 \* 3,500,000.00 元

到期结算金额 \* 3,501,409.59 元

增加

修改

删除

证券代码	押数量(千元面额)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
010101	5000	70	3500000	1409.59

确定(N)

关闭(C)

点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框

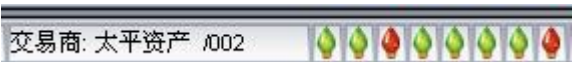


该条成交申报信息即在成交申报信息列表中消失。

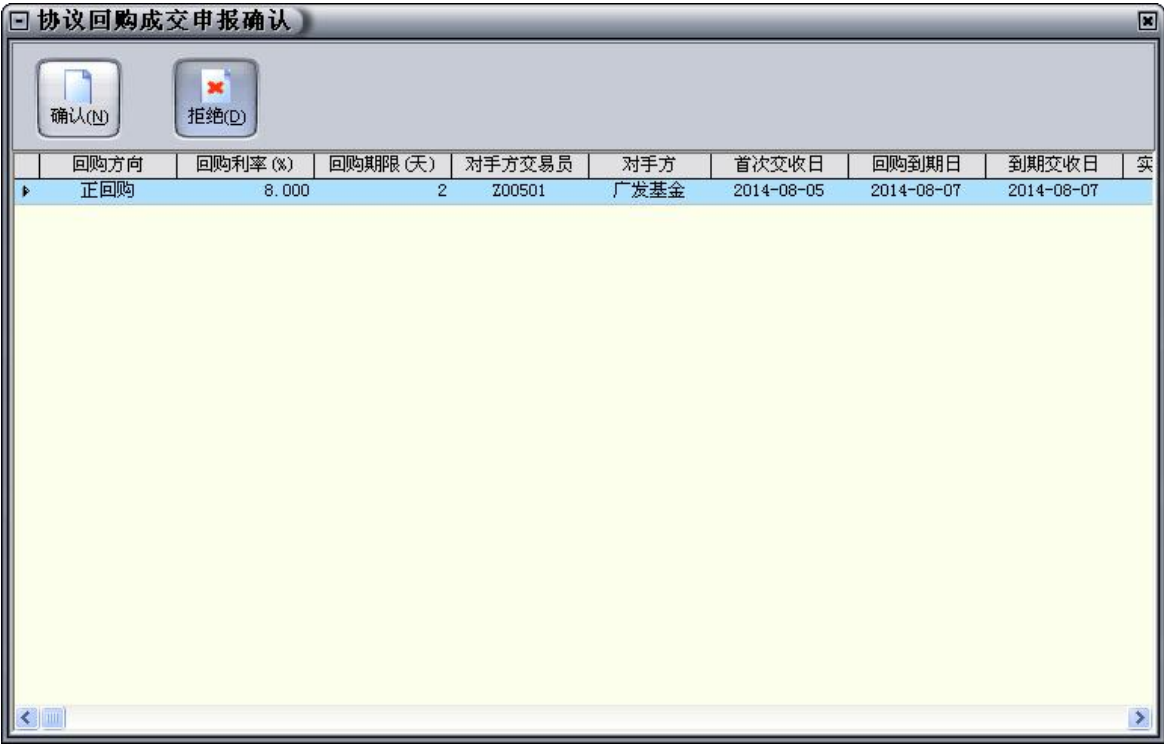
刷新：点击刷新成交申报信息列表中的信息。

### 4.11.3成交申报确认

正回购方申报后，逆回购方的成交申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果逆回购方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第三盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起成交申报请求。



点击该灯，弹出成交申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击确认，弹出协议回购成交申报确认窗口信息提示，逆回购方可以查看申报信息是否无误

说明：将鼠标移动到正回购方账户名称输入框内即显示各账户完整信息

协议回购成交申报确认

回购方向

☒ 正回购

☐ 逆回购

交易期限(天)

回购期限

3

天

成交日

2018-05-18

首次结算日

2018-05-18

到期结算日

2018-05-21

回购到期日

2018-05-21

实际占款天数

3

本方证券账户

B005247410

本方交易单元号

24741

交易员代码

Z00500

交易员名称

张三

回购利率(%)

1.000

质押券面值总额合计

1,000,000

元

成交金额合计

30,000.00

元

回购利息合计

2.47

元

到期结算金额合计

30,002.47

元

质权人名称 \*

广发基金

正回购交易商

东吴基金

正回购交易员代码

Z00300

正回购交易员名称

张三

正回购方账户名称

ASDFASDFASDF

本方账户名称 \*

ADSADFAFWE

证券代码	质押数量(手)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
151000	1000	3.00	30000.00	2.47

确认

关闭(C)

质权人名称默认登录交易员所属债券交易参与人名称  
点击确定，提交至系统校验通过后弹出交易成功提示



4.11.4成交申报拒绝

如果用户想拒绝该笔申报，在成交申报确认窗口点击拒绝，弹出成交申报拒绝提示框

说明：将鼠标移动到正回购方账户名称输入框内即显示各账户完整信息

协议回购成交申报拒绝

回购方向

☒ 正回购

☐ 逆回购

交易期限(天)

回购期限

3

天

成交日

2018-05-18

首次结算日

2018-05-18

到期结算日

2018-05-21

回购到期日

2018-05-21

实际占款天数

3

本方证券账户

B005247410

本方交易单元号

24741

交易员代码

Z00500

交易员名称

张三

回购利率(%)

1.000

质押券面值总额合计

1,000,000

元

成交金额合计

30,000.00

元

回购利息合计

2.47

元

到期结算金额合计

30,002.47

元

质权人名称 \*

广发基金

正回购交易商

东吴基金

正回购交易员代码

Z00300

正回购交易员名称

张三

正回购方账户名称

ASDFASDFASDF

本方账户名称 \*

YPHR徽发生弱

证券代码	质押数量(手)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
151000	1000	3.00	30000.00	2.47

拒绝

关闭(C)

点击拒绝，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



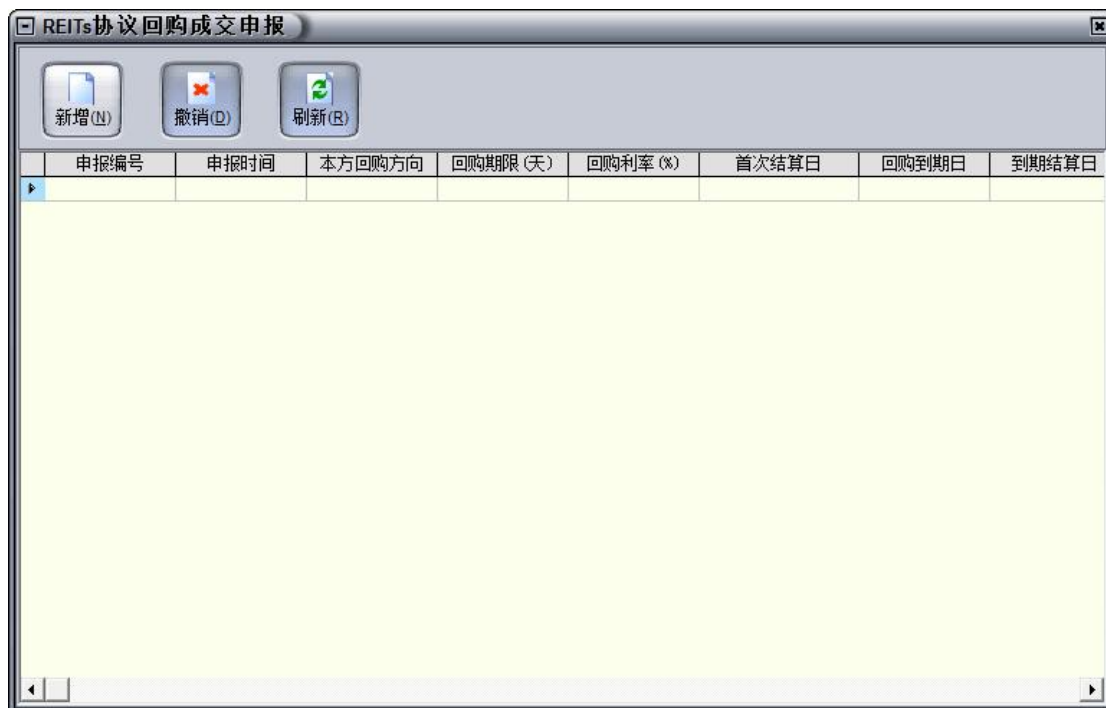
确定后，该成交申报请求会从协议回购成交申报确认窗口中消失。

## 4.12 REITs 协议回购成交申报

### 4.12.1 成交申报

REITs 协议回购中质押券仅可选择 REITs 产品，不可选择债券产品或 ETF。

点击交易—>协议回购交易—>REITs 成交申报，进入协议回购成交申报信息管理界面。



用户在此管理需要成交申报的信息。

在列表中列出申报的成交申报信息，包含申报编号、申报时间、本方回购方向、回购期限、回购利率、首次交收日、回购到期日、到期交收日、实际占款天数、正回购债券交易参与者简称、正回购交易员代码、正回购证券账号、正回购交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购交易员代码、申报状态、备注。



在此界面上的操作有新增成交申报信息、撤销成交申报信息和刷新成交申报信息。

新增：点击弹出成交申报对话框

新增REITs协议回购成交申报

回购方向

正回购

逆回购

交易期限(天)

回购期限 \* 天

成交日 \* 2022-06-29

首次结算日 \* 2022-06-29

回购到期日 \* 1900-01-01

到期结算日 \* 1900-01-01

实际占款天数 \*

证券账户 \*

交易单元号 \*

对手方交易员代码 \*

对手方交易员名称

对手方债券交易参与人

回购利率(%) \*

质押券面值总额合计 \* 0 元

成交金额合计 \* 0.00 元

回购利息合计 \* 0.00 元

到期结算金额合计 \* 0.00 元

限售

非限售

账户名称 \*

交易员代码 \* Z03900

交易员名称 范义

债券交易参与人\* 华夏基金

补充条款

质押券代码 \*

质押数量 \* 份

折算比例(%) \*

回购利息 \* 元

质押券简称

质押券面值总额 \* 0 元

成交金额 \* 0.00 元

到期结算金额 \* 0.00 元

增加

修改

删除

证券代码	质押数量(份)	折算比例(%)	成交金额	回购利息

确定(N)

关闭(C)

用户在此申报需要成交申报信息，完成成交申报操作。

说明：所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框



界面各输入项说明如下：

回购方向：正回购/逆回购，默认正回购，成交申报只能正回购方发起

回购期限：回购到期日一成交日期

成交日：当前交易日

首次结算日：等于成交日期

回购到期日：参与人确定的回购到期日期

到期结算日：到期结算日

实际占款天数：到期结算日一首次结算日

证券账户：资金融入方的证券账户

交易单元号：资金融入方证券帐号指定交易单元号

对手方交易员代码：对手方交易员代码

对手方交易员名称：对手方交易员名称

对手方债券交易参与人：对手方债券交易参与人名称

回购利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

质押券面值总额合计：多券申报券面值总额合计

成交金额合计：多券申报正回购方融入的资金额度合计

回购利息合计：多券申报 成交金额×回购利率×实际占款天数/365 合

计

到期结算金额合计：多券申报为到期日正回购方返回的金额合计

交易员代码：交易员代码

交易员名称：交易员名称

债券交易参与人：债券交易参与人名称

补充条款：交易双方的补充约定条款

申报界面支持批量申报，即支持一次性提交针对同一交易对手方、使用同一回购利率与同一回购期限的多个质押券交易申报，申报元素：

质押券代码：质押债券的代码

质押券简称：质押债券的简称

质押券数量：质押券数量，单位为份。

质押券面值总额：质押债券面值总额=质押数量（份）×上日均价

折算比率：折算比率=(成交金额/质押券面值总额)\*100%

成交金额：正回购方融入的资金额度

回购利息：成交金额×回购利率×实际占款天数/365

到期结算金额合计：多券申报为到期日正回购方返回的金额

当 REITs 限售份额作为质押券时，需选择限售期（月）：6、12、~~或18~~  
~~或24~~。

新增REITs协议回购成交申报

回购方向

☐ 正回购
☒ 逆回购

交易期限(天)

回购期限 \*

天

成交日 \*

2023-03-31

首次结算日 \*

2023-03-31

回购到期日 \*

1900-01-01

到期结算日 \*

1900-01-01

实际占款天数 \*

限售期 \*

6

12

18

24

月

☒ 限 售

账户名称 \*

交易员代码 \*

Z04100

债券交易参与人 \*

招商证券

证券账户 \*

交易单元号 \*

对手方交易员代码 \*

对手方交易员名称

对手方债券交易参与人

回购利率(%) \*

质押券面值总额合计 \*

0

元

成交金额合计 \*

0.00

元

回购利息合计 \*

0.00

元

到期结算金额合计 \*

0.00

元

补充条款

质押券代码 \*

质押券简称

质押数量 \*

份

质押券面值总额 \*

0

元

折算比例(%) \*

成交金额 \*

0.00

元

回购利息 \*

元

到期结算金额 \*

0.00

元

增加

修改

删除

证券代码	质押数量(份)	折算比例(%)	成交金额	回购利息

确定(N)

关闭(C)

新增REITs协议回购成交申报

回购方向

☐ 正回购
☐ 逆回购

交易期限(天)

回购期限 \*  天

成交日 \*

首次结算日 \*

回购到期日 \*

到期结算日 \*

实际占款天数 \*

限售期 \* 

6  
12  
18

 月

☒ 限 售

证券账户 \*

交易单元号 \*

对手方交易员代码 \*

对手方交易员名称

对手方债券交易参与人

回购利率(%) \*

质押券面值总额合计 \*  元

成交金额合计 \*  元

回购利息合计 \*  元

到期结算金额合计 \*  元

账户名称 \*

交易员代码 \*

交易员名称

债券交易参与人 \*

补充条款

质押券代码 \*

质押数量 \*  份

折算比例(%) \*

回购利息 \*  元

质押券简称

质押券面值总额 \*  元

成交金额 \*  元

到期结算金额 \*  元

增加
修改
删除

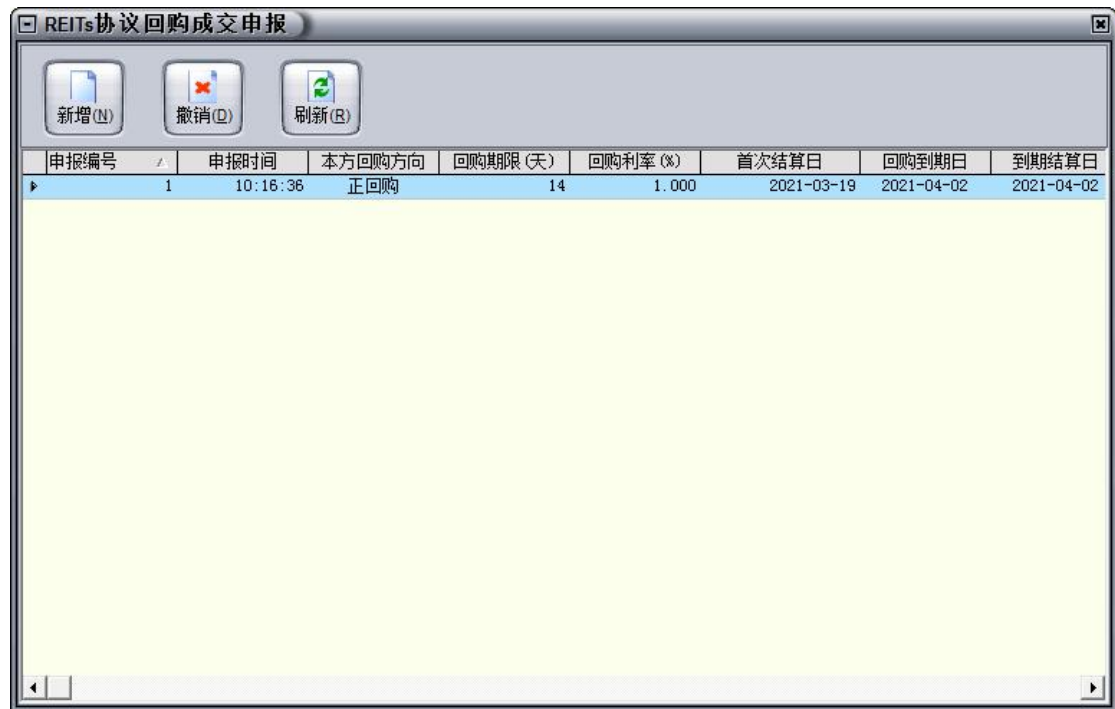
<	证券代码	质押数量(份)	折算比例(%)	成交金额	回购利息	>
▶						

确定(N)
关闭(C)

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即成交申报录入成功，弹出提示框



该条成交申报信息即出现在成交申报界面下方的信息列表中。



### 4.12.2 成交申报撤销

如果用户想撤销该笔申报，选中成交申报信息列表中的某条希望撤销的成交申报信息，点击撤销，弹出撤销提示框

**REITs协议回购成交申报撤销**

回购方向  
☐ 正回购 ☒ 逆回购

交易期限(天)  
 回购期限: 14 天  
 成交日: 2021-03-19  
 首次结算日: 2021-03-19  
 到期结算日: 2021-04-02  
 回购到期日: 2021-04-02  
 实际占款天数: 14

证券账户: B881814914  
 交易单元: 36493  
 对手方交易员代码: Z00500  
 对手方交易员名称: 吴晓芳  
 对手方交易商: 广发基金  
 回购利率(%): 1.000  
 质押券面值总额合计: 11,000 元  
 成交金额合计: 110.00 元  
 回购利息合计: 0.04 元  
 到期结算金额合计: 110.04 元

交易员代码: Z00300 交易员名称: 魏西  
 交易商: 东吴基金 补充条款:

证券代码	质押数量(手)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
508791	10000	1.00	110.00	0.04

确定(Q) 关闭(C)

点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条成交申报信息即在成交申报信息列表中消失。

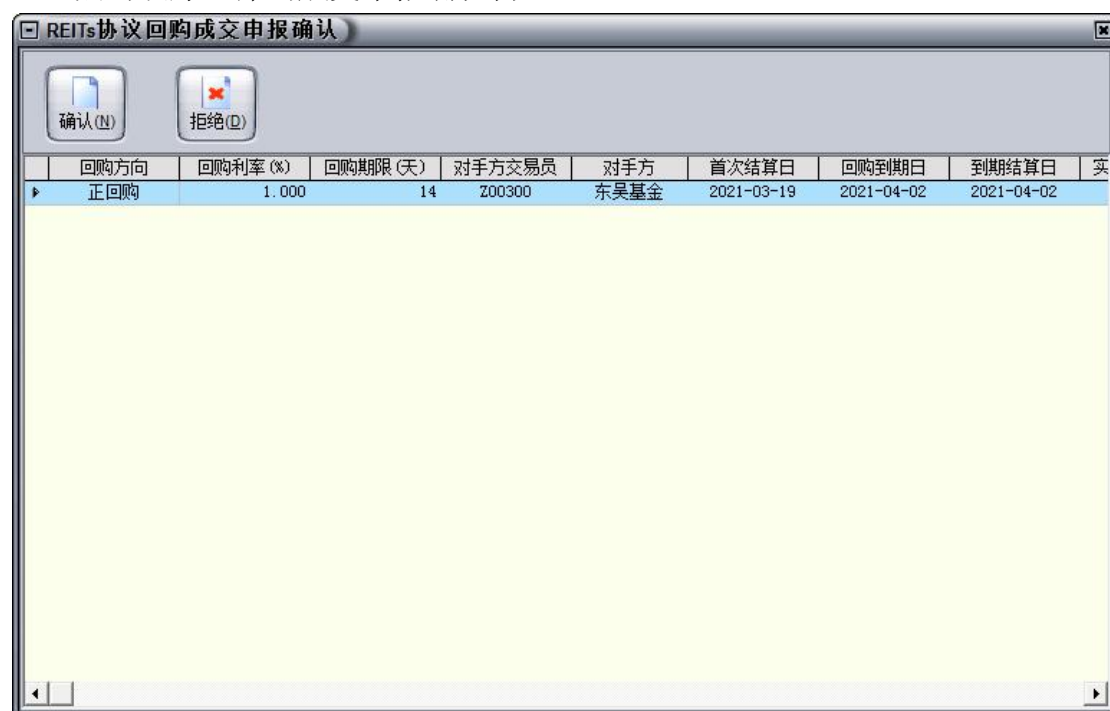
刷新：点击刷新成交申报信息列表中的信息。

### 4.12.3 成交申报确认

正回购方申报后，逆回购方的成交申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果逆回购方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第三盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起成交申报请求。



点击该灯，弹出成交申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击确认，弹出协议回购成交申报确认窗口信息提示，逆回购方可以查看申报信息是否无误

说明：将鼠标移动到正回购方账户名称输入框内即显示各账户完整信息



REITs协议回购成交申报确认

回购方向

☒ 正回购

☐ 逆回购

交易期限(天)

回购期限

14

天

成交日

2021-03-19

首次结算日

2021-03-19

到期结算日

2021-04-02

回购到期日

2021-04-02

实际占款天数

14

本方证券账户

B880014155

本方交易单元号

40042

交易员代码

Z00500

交易员名称

吴晓芳

回购利率(%)

1.000

质押券面值总额合计

11,000

元

成交金额合计

110.00

元

回购利息合计

0.04

元

到期结算金额合计

110.04

元

质权人名称 \*

广发基金

正回购交易商

东吴基金

正回购交易员代码

Z00300

正回购交易员名称

魏西

正回购方账户名称

445

	证券代码	质押数量(手)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
▶	508791	10000	1.00	110.00	0.04

确认

关闭(C)

质权人名称默认登录交易员所属债券交易参与人名称  
点击确定，提交至系统校验通过后弹出交易成功提示



#### 4.12.4 成交申报拒绝

如果用户想拒绝该笔申报，在成交申报确认窗口点击拒绝，弹出成交申报拒绝提示框

说明：将鼠标移动到正回购方账户名称输入框内即显示各账户完整信息

REITs协议回购成交申报拒绝

回购方向

☒ 正回购

☐ 逆回购

交易期限(天)

回购期限

14

天

成交日

2021-03-19

首次结算日

2021-03-19

到期结算日

2021-04-02

回购到期日

2021-04-02

实际占款天数

14

本方证券账户

B880014155

本方交易单元号

40042

交易员代码

Z00500

交易员名称

吴晓芳

回购利率(%)

1.000

质押券面值总额合计

11,000

元

成交金额合计

110.00

元

回购利息合计

0.04

元

到期结算金额合计

110.04

元

质权人名称 \*

广发基金

正回购交易商

东吴基金

正回购交易员名称

魏西

正回购交易员代码

Z00300

正回购方账户名称

445

证券代码	质押数量(手)	折算比例(%)	成交金额	回购利息
508791	10000	1.00	110.00	0.04

拒绝

关闭(C)

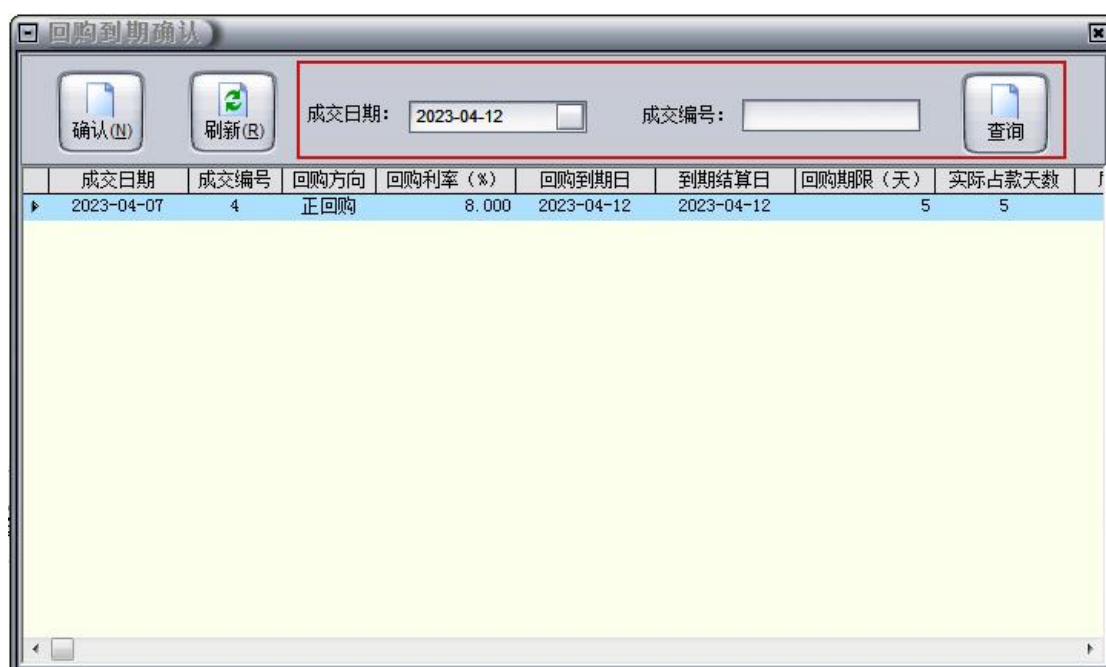
点击拒绝，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该成交申报请求会从协议回购成交申报确认窗口中消失。

## 4.13 协议回购到期确认申报

点击交易一〉协议回购交易一〉到期确认申报，进入协议回购到期确认申报信息管理界面。



在界面列表中显示的是当日到期协议回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，质押券代码，质押券简称，质押券数量，质押券面值总额，实际折算比例，首次成交金额，到期结算金额，参考应计利息，正回购债券交易参与者代码，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者代码，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，到期状态，已操作类型，质权人名称。

可根据成交日期或成交编号对结果进行筛选查询。如未筛选查询，默认最多显示 1000 条数据。

在此界面上的操作有到期结算申报信息确认和刷新到期协议回购信息。

确认：如果用户想确认一笔到期协议回购合约，选中当日到期协议回购合约信息列表中的某条希望确认的协议回购合约记录，点击“确认”按钮，弹出“协议回购到期确认申报”界面，显示协议回购合约的详细要素内容供用户确认其操作。

协议回购到期确认申报			
对手方交易员代码 *	Z00500	对手方交易员名称	吴晓芳
质押券代码	123009	质押券简称	12扬集债
质押数量	999999998	手	回购方向
质押券面值总额	999,999,998,000.0	元	成交编号
实际折算比例	23.00	%	首次结算日
回购利率	1.000	%	回购到期日
实际占款天数	1	天	到期结算日
成交金额	229,999,999,540.0	元	回购期限
回购利息	6,301,369.85	元	首次结算方式
到期结算金额	230,006,300,909.8	元	到期结算方式
正回购方证券账户	B883006300	逆回购方证券账户	
正回购方交易单元号 *	26578	逆回购方交易单元号	
正回购方交易商	东吴基金	逆回购方交易商	广发基金
正回购方交易员代码	Z00300	逆回购方交易员代码	Z00500
正回购方交易员名称	邵笛	逆回购方交易员名称	吴晓芳
质权人名称	广发基金		
补充条款			
确定(O)		关闭(C)	

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

正/逆回购交易单元号：默认显示正/逆回购方证券账号指定交易单元号

补充条款：交易双方的补充约定条款

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认申报成功提示框



该条协议回购合约记录即在到期协议回购合约信息列表中消失。

刷新：点击刷新当日到期协议回购信息列表中的信息。

## 4.14 协议回购到期续做申报

### 4.14.1 到期续做申报

点击交易一〉协议回购交易一〉到期续做申报，进入协议回购到期续做管理界面，下上面红框部分为查询选项，可根据成交日期或成交编号对结果进行筛选，红框下方显示部分为当日到期协议回购信息列表。如未筛选查询，默认最多显示 1000 条数据。

到期续做

成交日期：2023-04-12

成交编号：

查询

续做(N)

刷新(R)

列表中为当日到期协议回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数	质
2023-04-07	4	正回购	8.000	2023-04-12	2023-04-12	5	5	

撤销(D)

列表中为到期续做申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	质押券代码	质押券简称	质押券数量(千元面)	新回购折算比例(%)	本
------	------	--------	-------	-------	------------	------------	---

用户在此管理需要续做的协议回购信息。

在列表中包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，质押券代码，质押券简称，质押券数量，质押券面值总额，实际折算比例，首次成交金额，到期结算金额，参考应计利息，正回购债券交易参与人代码，正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与人代码，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，到期状态，已操作类型，质权人名称。

在此界面上的操作有续做到期合约信息和刷新到期协议回购信息。

续做：如果用户想续做一笔到期协议回购合约，选中当日到期协议回购合约信息列表中的某条希望续做的协议回购合约记录，点击“续做”按钮，弹出“新增协议回购到期续做申报”界面，显示协议回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。



新增协议回购到期续做申报

新续做信息

到期续做类型 \* 原对手方

交易单元号 \* 24685

回购到期日 \* 2018-05-19

对手方交易员代码 \* Z00500

回购期限 \* 1 天

对手方交易员名称 张三

折算比例 \* 3 %

对手方交易商 广发基金

回购利率 \* 2 %

交易商 东吴基金

成交金额 \* 6,000,000.00 元

交易员代码 Z00300

回购利息 328.77 元

交易员名称 张三

到期结算金额 6,000,328.77 元

成交日期 2018-05-18

实际占款天数 1 天

到期结算日 2018-05-19

补充约定 12132

原申报信息

质押券代码 161000

质押券简称 私募00

质押券数量 200000 手

回购方向 正回购

质押券面值总额 200,000,000 元

证券账户 B003246850

利息参考值 986.30 元

原成交日期 2018-05-15

到期结算金额 6,000,986.30 元

原成交编号 46

账户名称 \* 测井埃里克森将打开了圣诞节拉萨的了建军节基金基金

确定(O)

关闭(C)

用户在此填写需要申报的信息，完成续做申报操作。

说明：所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

到期续做类型：默认显示原对手方

回购到期日：参与人确定的回购到期日期

回购利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

成交金额：正回购方融入的资金额度



交易单元号：默认显示正回购方证券账号指定交易单元号

补充条款：交易双方的补充约定条款

账户名称：本方账户名称

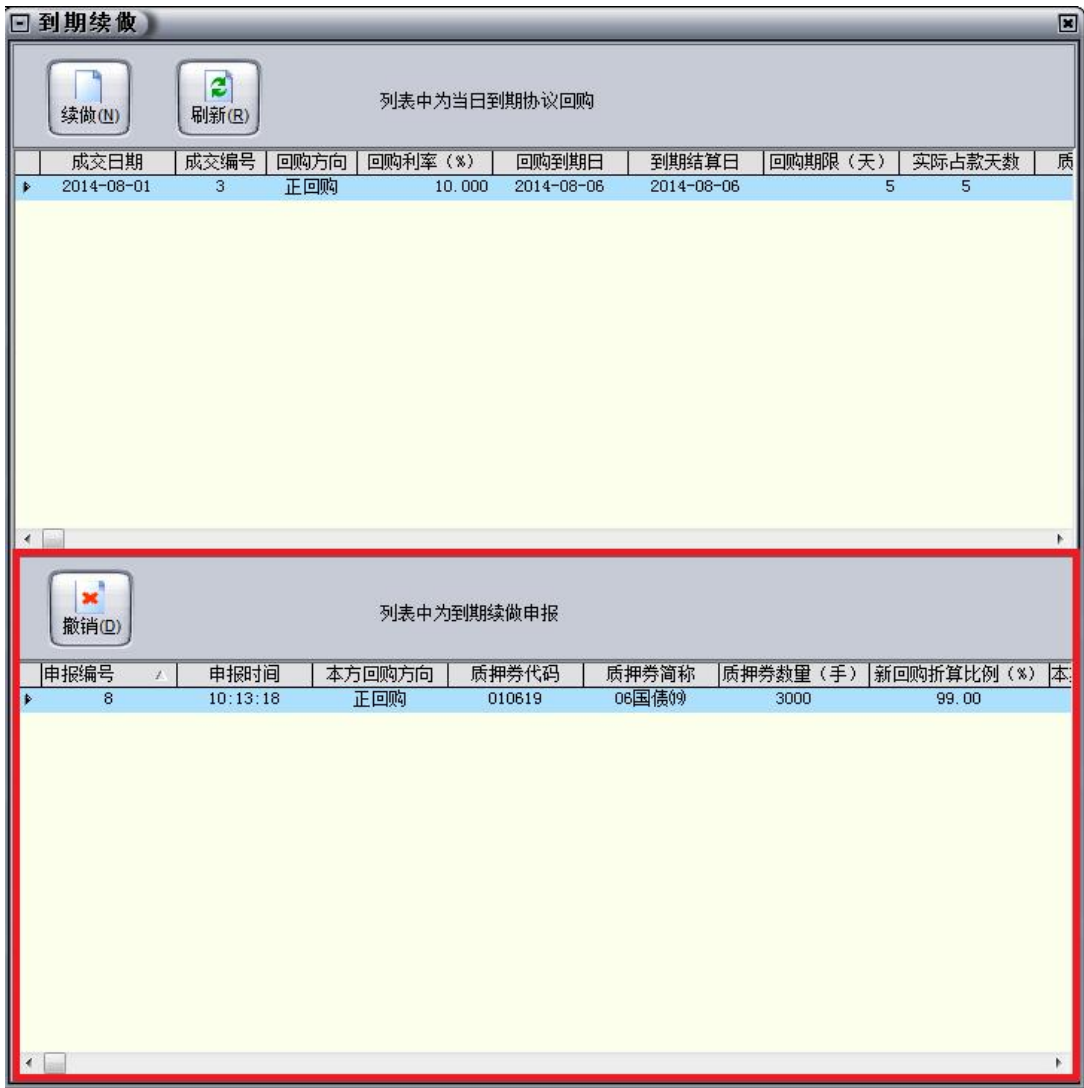
填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出续做申报成功提示框



该条协议回购合约记录即在到期协议回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的到期续做申报信息列表中会出现该条协议回购合约的到期续做申报信息。

#### 4.14.2 到期续做申报撤销

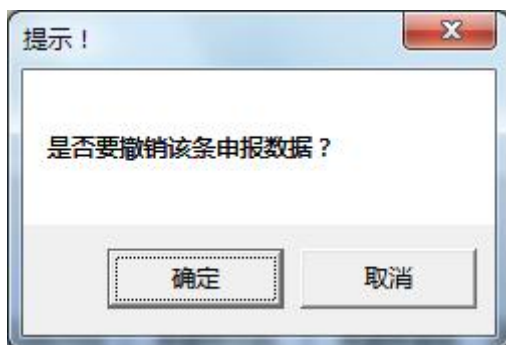
在到期续做管理界面的下面红框显示部分为到期续做申报信息列表，用户在此管理到期续做申报信息。



在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，质押券代码，质押券简称，质押券数量，新回购折算比例，本期结算利息，原回购期限，新回购期限，原回购利率，新回购利率，新回购成交日期，原回购到期日，新回购到期日，原回购到期结算日，新回购到期结算日，原实际占款天数，新回购实际占款天数，新回购首次成交金额，新应计利息（预估），新到期结算金额（预估），正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，新逆回购债券交易参与者简称，新逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，原逆回购债券交易参与者简称，原逆回购交易员代码，申报状态，原成交日期，原成交编号，备注。

在此界面上的操作有撤销到期续作申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔到期续做申报，选中到期续做申报信息列表中的某条希望撤销的续做申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



确定后，该条续做申报记录会从到期续作申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新当日到期协议回购信息列表、到期续做申报信息列表中的信息。

### 4.14.3 到期续做申报确认

正回购方申报后，逆回购方的到期续作申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果逆回购方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第四盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起到期续做申报请求。



点击该灯，弹出到期续做申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出协议回购到期续做申报确认窗口，显示续做的协议回购合约信息，逆回购方可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

协议回购到期续做申报确认			
证券账户 *	B005247410	交易单元号 *	24741
质押券代码	161000	回购方向	逆回购
质押数量	200000 手	新首次结算日	2018-05-18
新折算比例	3.00 %	新回购到期日	2018-05-21
新回购利率	2.000 %	新到期结算日	2018-05-21
新回购期限	3 天	交易员代码	Z00500
新实际占款天数	3 天	交易员名称	张三
新成交金额	6,000,000.00 元	对手方交易商	东吴基金
新回购利息	986.30 元	对手方交易员代码	Z00300
新到期结算金额	6,000,986.30 元	对手方交易员名称	张三
报价编号	4		
质权人名称 *	广发基金		
对手方账户名称	测井埃里克森将打开了圣诞节拉萨的了建军节基金基金		
本方账户名称 *	企鹅企鹅王企鹅完全		
补充条款	12132		
确认		关闭(C)	

界面各输入项说明如下：

证券账户：逆回购方的证券账户（到期续做类型为新对手方时可输入）

交易单元：逆回购方证券帐号指定交易单元号

质权人名称：默认登录交易员所属债券交易参与人名称

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该到期续做申报请求会从协议回购到期续做申报确认窗口中消失。

#### 4.14.4 到期续做申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出协议回购到期续做申报拒绝窗口，显示协议回购合约信息

协议回购到期续做申报拒绝

证券账户

B005247410

交易单元号

24741

质押券代码

161000

回购方向

逆回购

质押数量

200000

手

新首次结算日

2018-05-18

新折算比例

3.00

%

新回购到期日

2018-05-21

新回购利率

2.000

%

新到期结算日

2018-05-21

新回购期限

3

天

交易员代码

Z00500

新实际占款天数

3

天

交易员名称

张三

新成交金额

6,000,000.00

元

对手方交易商

东吴基金

新回购利息

986.30

元

对手方交易员代码

Z00300

新到期结算金额

6,000,986.30

元

对手方交易员名称

张三

报价编号

4

质权人名称

广发基金

对手方账户名称

测井埃里克森将打开了圣诞节拉萨的了建军节基金基金

本方账户名称 \*

如图二月月特瑞

补充条款

12132

拒绝

关闭(C)

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该到期续做申报请求会从协议回购到期续做申报确认窗口中消失。



## 4.15 协议回购解除质押申报

### 4.15.1 解除质押申报

点击交易一〉协议回购交易一〉解除质押申报，进入协议回购解除质押管理界面，下主图上半部分面红框显示部分为已违约质押式协议回购信息列表，可根据成交日期或成交编号对结果进行筛选。如未筛选查询，默认最多显示 1000 条数据。

解除质押申报

成交日期：

2023-04-12

成交编号：

查询

解除(N)

刷新(R)

列表中为已违约质押式协议回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数
2023-04-07	1	正回购	1.000	2023-04-10	2023-04-10	3	5
2023-04-07	2	正回购	1.000	2023-04-11	2023-04-11	4	5
2023-04-07	5	正回购	8.000	2023-04-11	2023-04-11	4	5
2023-04-07	1	逆回购	1.000	2023-04-10	2023-04-10	3	5
2023-04-07	2	逆回购	1.000	2023-04-11	2023-04-11	4	5
2023-04-07	5	逆回购	8.000	2023-04-11	2023-04-11	4	5

撤销(Q)

列表中为解除质押申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	质押券代码	质押券简称	质押券数量(千元面)	折算比例(%)	回购期限
------	------	--------	-------	-------	------------	---------	------

用户在此管理需要解除质押的协议回购信息。

在列表中包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，质押券代码，质押券简称，质押券数量，质押券面值总额，实际折算比例，首次成交金额，到期结算金额，参考应计利息，

正回购债券交易参与人代码，正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与人代码，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，到期状态，已操作类型，质权人名称。

在此界面上的操作有解除已违约回购合约和刷新已违约质押式协议回购信息。

解除：如果用户想解除一笔已违约协议回购合约，选中列表中的某条希望解除的协议回购合约记录，点击“解除”按钮，弹出“协议回购解除质押申报”界面，显示协议回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。

协议回购解除质押申报			
对手方交易员代码 *	Z03800	对手方交易员名称	王元
本方交易单元号 *	24674	回购方向	逆回购
质押券代码	123050	质押券简称	非担保50
质押券数量	999999999	质押券面值总额	999,999,999,000 元
实际折算比例	100.00 %	解除质押日	2022-06-29
回购利率	36.500 %	原成交日期	2022-04-02
成交金额	999,999,999,000.0 元	回购到期日	2022-04-03
参考回购利息	999,999,999.00 元	回购期限	1 天
到期结算金额	1,000,999,998,999 元	实际占款天数	88 天
正回购方证券账户		逆回购方证券账户	A039246740
债券交易参与人代码	038	债券交易参与人代码	039
债券交易参与人简称	国联安	债券交易参与人简称	华夏基金
正回购方交易员代码	Z03800	逆回购方交易员代码	Z03900
正回购方交易员名称	王元	逆回购方交易员名称	范义
原成交编号	11		
补充条款 *			
<div>确定(Q)</div> <div>关闭(C)</div>			

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

正/逆回购交易单元：默认显示正/逆回购方证券账号指定交易单元号

补充约定：交易双方的补充约定条款

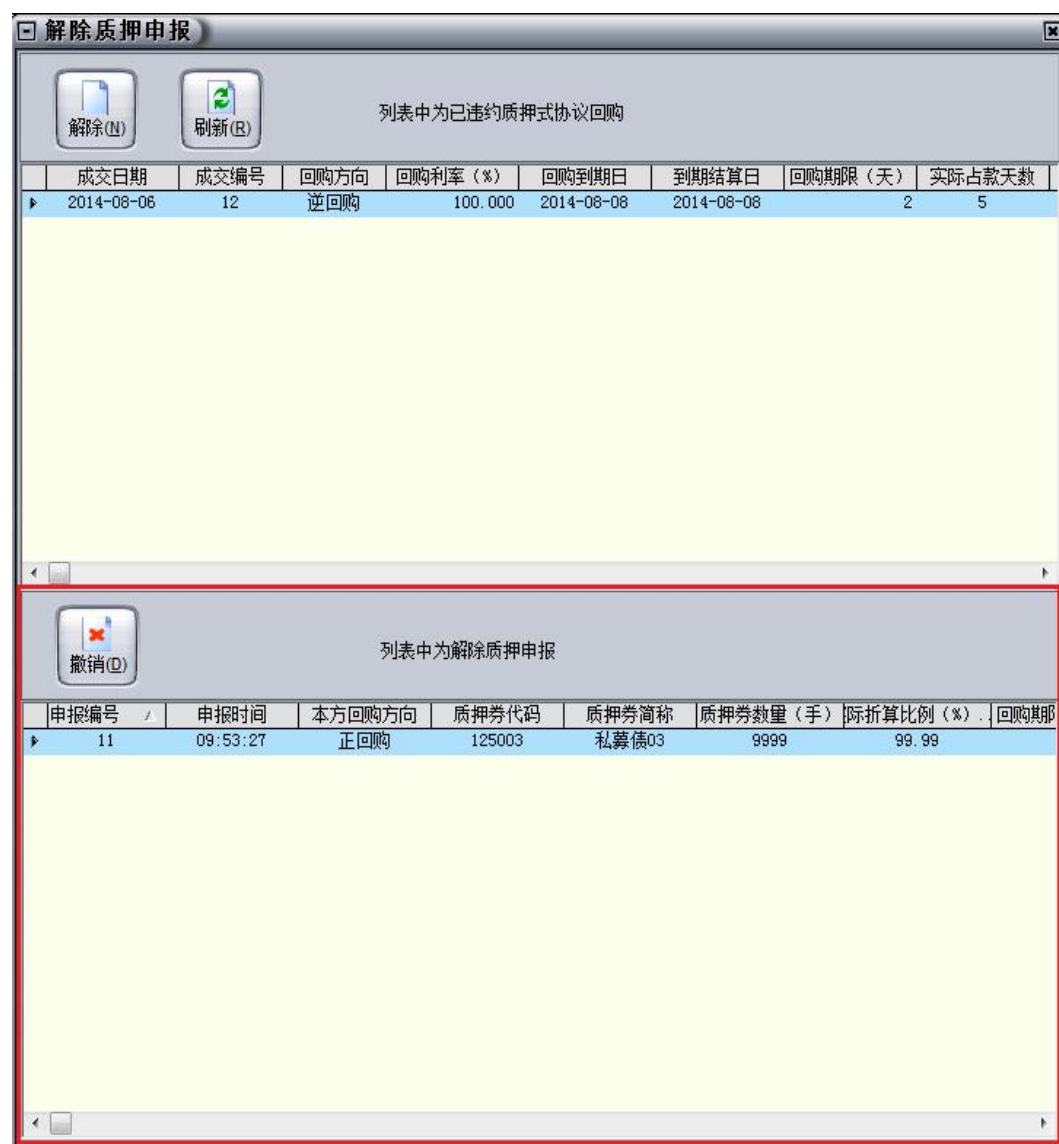
填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出解除质押申报成功提示框



该条协议回购合约记录即在已违约质押式协议回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的解除质押申报信息列表中会出现该条协议回购合约的解除质押申报信息。

#### 4.15.2 解除质押申报撤销

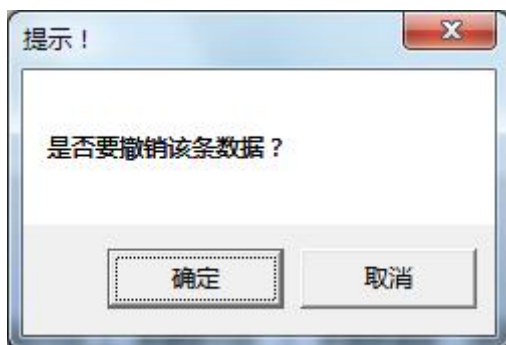
在解除质押管理界面的下面红框显示部分为解除质押申报信息列表，用户在此管理解除质押申报信息。



在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，质押券代码，质押券简称，质押券数量，实际折算比例，回购期限，回购利率，回购到期日，实际占款天数，首次成交金额，参考结算利息，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，原逆回购证券账户，原逆回购交易单元，申报状态，原成交日期，原成交编号，备注。

在此界面上的操作有撤销解除质押申报信息。

**撤销：**如果用户想撤销一笔解除质押申报，选中解除质押申报信息列表中的某条希望撤销的解除质押申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



确定后，该条解除质押申报记录会从解除质押申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新已违约质押式协议回购信息列表、解除质押申报信息列表中的信息。

### 4.15.3 解除质押申报确认

交易员在收到以自己为对手方的解除质押申报后，解除质押申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第五盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起解除质押申报请求。



点击该灯，弹出解除质押申报确认窗口

解除质押确认

确认(N)

拒绝(O)

回购方向	回购利率(%)	回购期限(天)	对手方交易员	对手方	首次交收日	回购到期日
正回购	33.333	1	Z00501	广发基金	2014-08-06	2014-08-07

如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出协议回购解除质押申报确认窗口，显示解除质押的协议回购合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

协议回购解除质押申报确认

本方证券账户

B883006300

本方交易单元号

26578

质押券代码

010213

回购方向

逆回购

质押数量

2000

手

首次结算日

2014- 8-18

折算比例

99.99

%

回购到期日

2014- 8-19

回购利率

12.000

%

到期交收日

2014- 8-19

回购期限

1

天

交易员代码

Z00300

实际占款天数

4

天

交易员名称

邵笛

成交金额

1,999,800.00

元

对手方交易商

东吴基金

回购利息

657.47

元

对手方交易员代码

Z00301

到期结算金额

2,000,457.47

元

对手方交易员名称

陈力晨

报价编号

1

补充条款

tst

确认

关闭(C)

界面各输入项说明如下：

交易单元：证券帐号指定交易单元号

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该解除质押申报请求会从协议回购解除质押申报确认窗口中消失。

#### 4.15.4 解除质押申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出解除质押申报拒绝窗口，显示协议回购合约信息



协议回购解除质押申报拒绝

本方证券账户

B883006300

本方交易单元号

26578

质押券代码

010213

回购方向

逆回购

质押数量

2000

手

首次结算日

2014- 8-18

折算比例

99.99

%

回购到期日

2014- 8-19

回购利率

12.000

%

到期交收日

2014- 8-19

回购期限

1

天

交易员代码

Z00300

实际占款天数

4

天

交易员名称

邵笛

成交金额

1,999,800.00

元

对手方交易商

东吴基金

回购利息

657.47

元

对手方交易员代码

Z00301

到期结算金额

2,000,457.47

元

对手方交易员名称

陈力晨

报价编号

1

补充条款

tst

拒绝

关闭(C)

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该解除质押申报请求会从协议回购解除质押申报确认窗口中消失。

## 4.16 协议回购换券申报

### 4.16.1 换券申报

点击交易—>协议回购交易—>换券申报，进入协议回购换券管理界面，上图上半面红框显示部分为未到期质押式协议回购信息列表，可根据成交日期或成交编号对结果进行筛选。如未筛选查询，默认最多显示 1000 条数据。

换券申报

成交日期：

2023-04-12

成交编号：

查询

换券(N)

刷新(R)

列表中为未到期质押式协议回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数
2023-04-07	3	正回购	1.000	2023-04-14	2023-04-14	7	5
2023-04-07	6	正回购	1.000	2023-04-17	2023-04-17	10	5
2023-04-07	7	正回购	1.000	2023-06-01	2023-06-01	55	5

撤销(D)

列表中为换券申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	新质押券代码	新质押券简称	质押券数量(千元面)	新折算比例(%)	新券成
------	------	--------	--------	--------	------------	----------	-----

用户在此管理需要换券的协议回购信息。

在列表中包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，质押券代码，质押券简称，质押券数量，质押券面值总额，实际折算比例，首次成交金额，到期结算金额，参考应计利息，正回购债券交易参与者代码，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者代码，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，到期状态，已操作类型，质权人名称。

在此界面上的操作有换券和刷新未到期质押式协议回购信息。

换券：如果用户想对一笔未到期协议回购合约进行换券，选中列表中的某条希望换券的协议回购合约记录，点击“换券”按钮，弹出“协议回购换券申报”界面，显示协议回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。

协议回购换券申报			
<b>新券申报信息</b>			
新质押券代码 *	<input type="text" value="010107 21国债(7)"/>	新质押券简称	<input type="text" value="21国债(7)"/>
新质押数量 *	<input type="text" value="10000"/> 手	新质押券面值总额	<input type="text" value="10,000,000"/> 元
新折算比例	<input type="text" value="9"/> %	换券申报日期	<input type="text" value="2018-05-18"/>
对手方交易员代码*	<input type="text" value="Z00500"/>	对手方交易员名称	<input type="text" value="张三"/>
交易单元号 *	<input type="text" value="24685"/>		
补充条款	<input type="text"/>		
<b>原券申报信息</b>			
原质押券代码	<input type="text" value="151001"/>	回购方向	<input type="text" value="正回购"/>
原质押券简称	<input type="text" value="公司A1"/>	原成交日期	<input type="text" value="2018-05-15"/>
原质押券数量	<input type="text" value="30000"/> 手	回购到期日	<input type="text" value="2018-05-22"/>
原实际折算比例	<input type="text" value="3.00"/> %	回购期限	<input type="text" value="7"/> 天
回购利率	<input type="text" value="6.000"/> %	实际占款天数	<input type="text" value="3"/> 天
原质押券面值总额	<input type="text" value="30,000,000"/> 元	到期结算金额	<input type="text" value="901,035.62"/> 元
原成交金额	<input type="text" value="900,000.00"/> 元	原成交编号	<input type="text" value="60"/>
正回购证券账户	<input type="text" value="B003246850"/>	正回购交易单元	<input type="text" value="24685"/>
正回购交易商代码	<input type="text" value="003"/>	逆回购交易商代码	<input type="text" value="005"/>
正回购交易商简称	<input type="text" value="东吴基金"/>	逆回购交易商简称	<input type="text" value="广发基金"/>
正回购交易员代码	<input type="text" value="Z00300"/>	逆回购交易员代码	<input type="text" value="Z00500"/>
正回购交易员名称	<input type="text" value="张三"/>	逆回购交易员名称	<input type="text" value="张三"/>
账户名称 *	<input type="text" value="四谛法四谛法三大发生大声"/>		
确定(O)		关闭(C)	

用户在此填写需要申报的信息，完成换券申报操作。

说明：所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

界面各输入项说明如下:

新质押券代码：新质押债券的代码

新质押券数量：质押券数量，以千元面额为单位。

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

正回购交易单元：默认显示正回购方证券账号指定交易单元号

补充条款：交易双方的补充约定条款

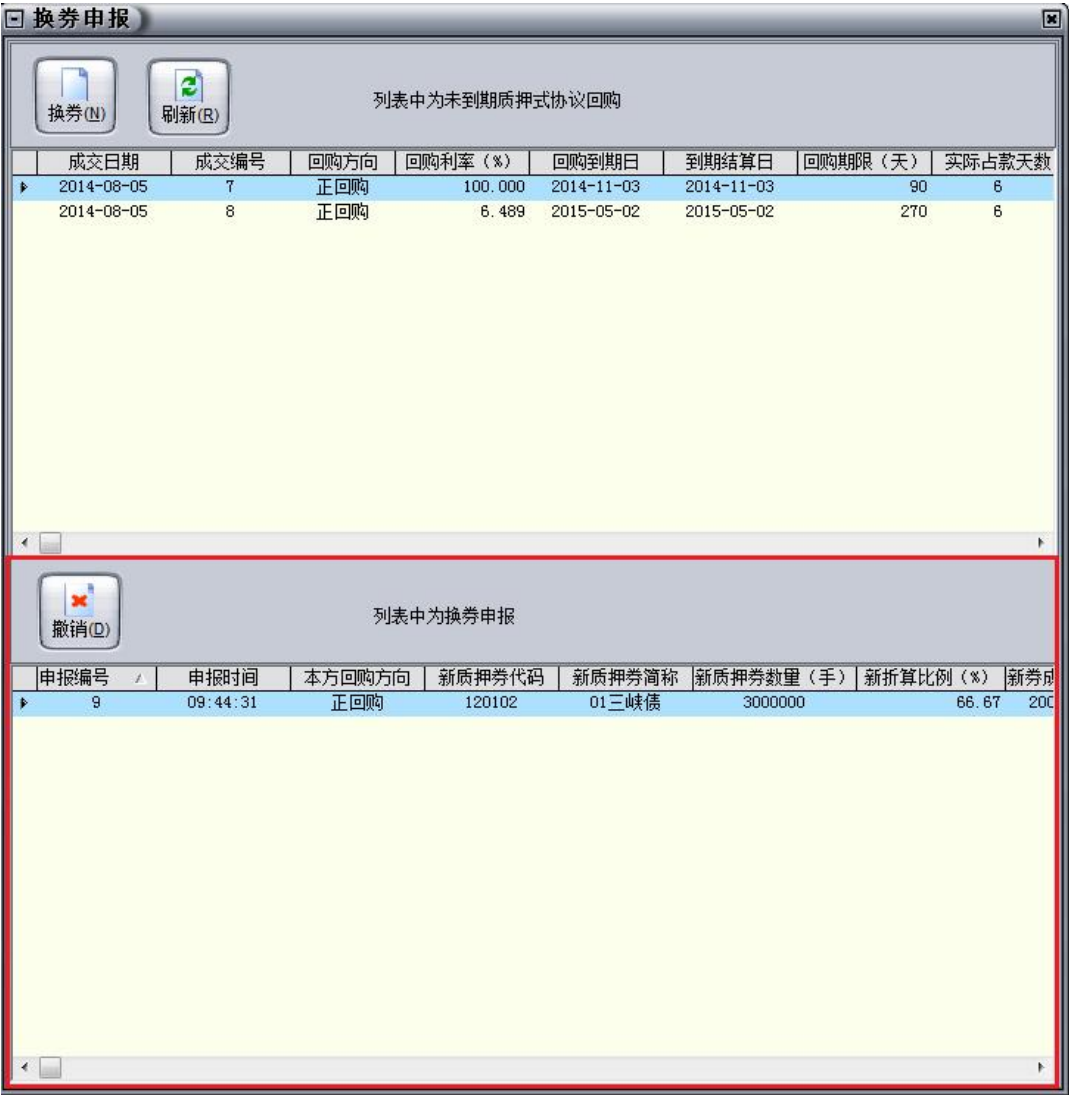
填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出换券申报成功提示框



该条协议回购合约记录即在未到期质押式协议回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的换券申报信息列表中会出现该条协议回购合约的换券申报信息。

#### 4.16.2 换券申报撤销

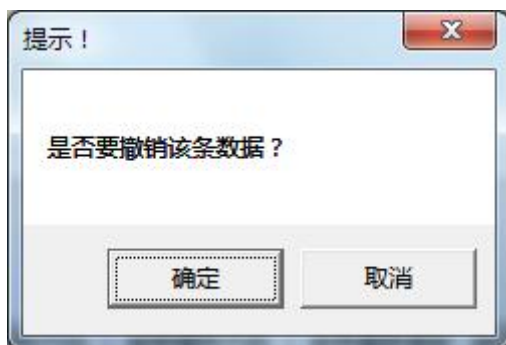
在换券管理界面的下面红框显示部分为换券申报信息列表，用户在此管理换券申报信息。



在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，新质押券代码，新质押券简称，新质押券数量，新折算比例，新券首次成交金额，回购期限，回购利率，回购到期日，到期交收日，原始占款天数，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，备注，申报状态，原成交日期，原成交编号，原质押券代码，原质押券简称，原质押券数量，原首次成交金额。

在此界面上的操作有撤销换券申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔换券申报，选中换券申报信息列表中的某条希望撤销的换券申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

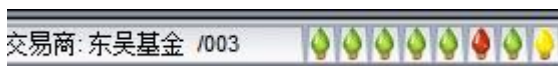


确定后，该条换券申报记录会从换券申报信息列表中消失。

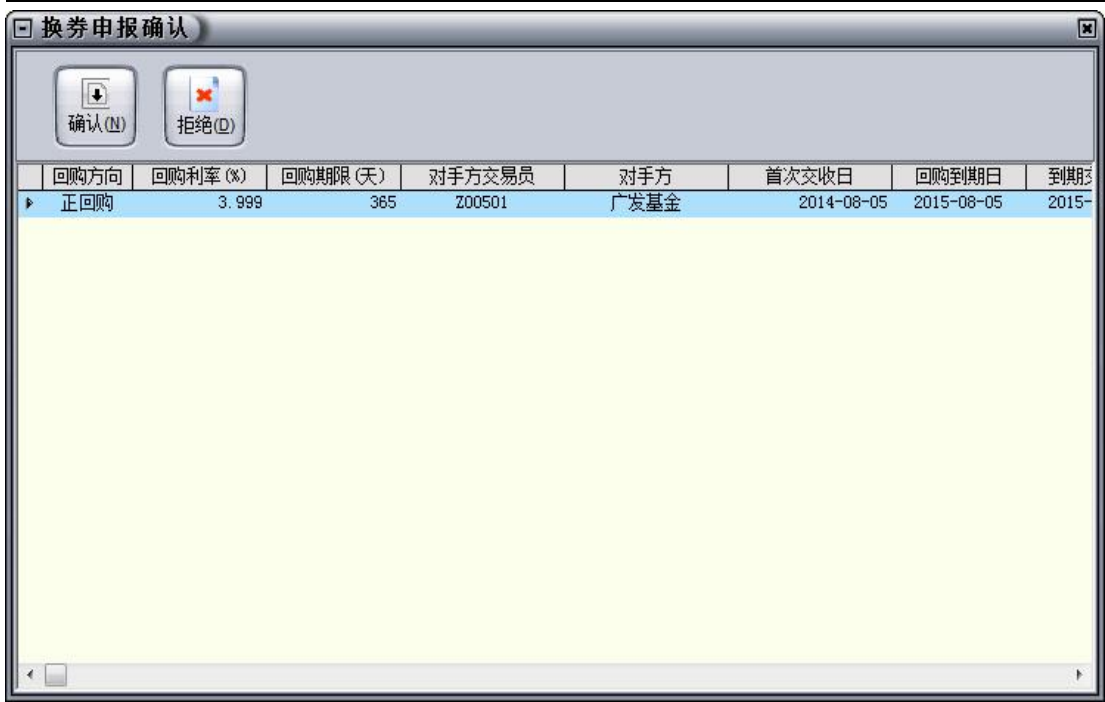
刷新：点击刷新未到期质押式协议回购信息列表、换券申报信息列表中的信息。

### 4.16.3 换券申报确认

交易员在收到以自己为对手方的换券申报后，换券申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第六盏灯不停的闪烁，表明有交易员向其发起换券申报请求。



点击该灯，弹出换券申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出协议回购换券申报确认窗口，显示换券的协议回购合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。



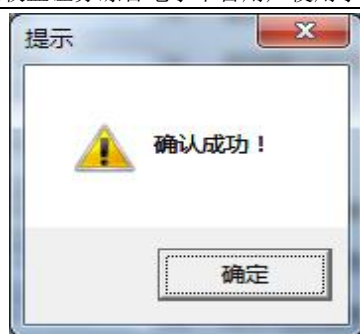
协议回购换券申报确认			
本方证券账户	B005247410	本方交易单元号	24741
原质押券代码	151001	回购方向	逆回购
新质押券代码	151000	交易员代码	Z00500
新质押数量	10000 手	交易员名称	张三
新折算比例	9.00 %	对手方交易商	东吴基金
回购利率	6.000 %	对手方交易员代码	Z00300
原成交金额	900,000.00 元	对手方交易员名称	张三
新成交金额	900,000.00 元	首次结算日	2018-05-15 <input type="checkbox"/>
回购利息	1,035.62 元	回购到期日	2018-05-22 <input type="checkbox"/>
到期结算金额	901,035.62 元	到期结算日	2018-05-22 <input type="checkbox"/>
实际占款天数	3 天	回购期限	7 天
报价编号	5		
对手方账户名称	四谛法四谛法三大发生大声		
账户名称 *	埃索达发生发生大发		
补充条款			
确认		关闭(C)	

界面各输入项说明如下：

交易单元：证券帐号指定交易单元号

账户名称：本方账户名称

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该换券申报请求会从协议回购换券申报确认窗口中消失。

#### 4.16.4 换券申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出换券申报拒绝窗口，显示协议回购合约信息

协议回购换券申报拒绝

本方证券账户

B005247410

原质押券代码

151001

新质押券代码

151000

新质押数量

10000

手

新折算比例

9.00

%

回购利率

6.000

%

原成交金额

900,000.00

元

新成交金额

900,000.00

元

回购利息

1,035.62

元

到期结算金额

901,035.62

元

实际占款天数

3

天

报价编号

5

对手方账户名称

四谛法四谛法三大发生大声

账户名称

\*

埃索达三大

补充条款

本方交易单元号

24741

回购方向

逆回购

交易员代码

Z00500

交易员名称

张三

对手方交易商

东吴基金

对手方交易员代码

Z00300

对手方交易员名称

张三

首次结算日

2018-05-15

回购到期日

2018-05-22

到期结算日

2018-05-22

回购期限

7

天

拒绝

关闭(C)

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该换券申报请求会从协议回购换券申报确认窗口中消失。

## 4.17 协议回购提前终止申报

### 4.17.1 提前终止申报

点击交易一〉协议回购交易一〉提前终止申报，进入协议回购提前终止管理界面，下图上半上面红框显示部分为未到期质押式协议回购信息列表，可根据成交日期或成交编号对结果进行筛选。如未筛选查询，默认最多显示 1000 条数据。

提前终止申报

成交日期：

2023-04-12

成交编号：

查询

申报(N)

刷新(R)

列表中为未到期质押式协议回购

	成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数
▶	2023-04-07	3	正回购	1.000	2023-04-14	2023-04-14	7	5
	2023-04-07	6	正回购	1.000	2023-04-17	2023-04-17	10	5
	2023-04-07	7	正回购	1.000	2023-06-01	2023-06-01	55	5
	2023-04-07	3	逆回购	1.000	2023-04-14	2023-04-14	7	5
	2023-04-07	6	逆回购	1.000	2023-04-17	2023-04-17	10	5
	2023-04-07	7	逆回购	1.000	2023-06-01	2023-06-01	55	5

撤销(D)

列表中为提前终止申报

	申报编号	申报时间	本方回购方向	质押券代码	质押券简称	押券数量(千元面)	标折算比例(%)	原回购期限
▶								

用户在此管理需要提前终止的协议回购信息。

在列表中包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到

期结算日，回购期限，实际占款天数，质押券代码，质押券简称，质押券数量，质押券面值总额，实际折算比例，首次成交金额，到期结算金额，参考应计利息，正回购债券交易参与人代码，正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与人代码，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，到期状态，已操作类型，质权人名称。

在此界面上的操作有申报提前终止回购合约和刷新未到期质押式协议回购信息。

申报：如果用户想提前终止一笔未到期协议回购合约，选中列表中的某条希望提前终止的协议回购合约记录，点击“申报”按钮，弹出“协议回购提前终止申报”界面，显示协议回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。

协议回购提前终止申报

对手方交易员代码 \* Z00200

对手方交易员名称 陈晓华

实际回购利率 \* 10 %

回购方向 逆回购

实际结算金额 \* 0.00 元

质押券代码 125330

实际回购利息 0.00 元

原成交日期 2014- 8-15

成交金额 9,999,999,990.00 元

原回购到期日 2015- 8-15

到期结算金额 10,999,999,989.00 元

原成交编号 19

提前终止日期 2014- 8-22

证券账户 B883006300

提前终止后回购期限 7 天

交易单元号 \* 26578

提前终止后实际占款天数 7 天

补充条款

确定(Q)

关闭(C)

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

说明：所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

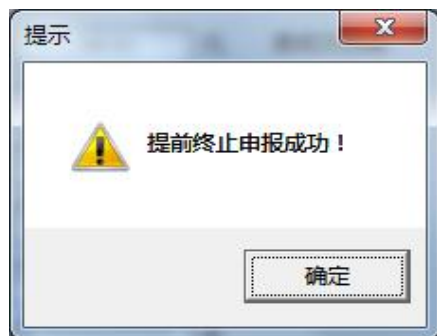
实际回购利率：正回购方实际付给逆回购方的资金价格

实际结算金额：为提前到期日正回购方返回的金额

交易单元：默认显示证券账号指定交易单元号

补充条款：交易双方的补充约定条款

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出提前终止申报成功提示框



该条协议回购合约记录即在未到期质押式协议回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的提前终止申报信息列表中会出现该条协议回购合约的提前终止申报信息。

#### 4.17.2 提前终止申报撤销

在提前终止管理界面的下面红框显示部分为提前终止申报信息列表，用户在此管理提前终止申报信息。

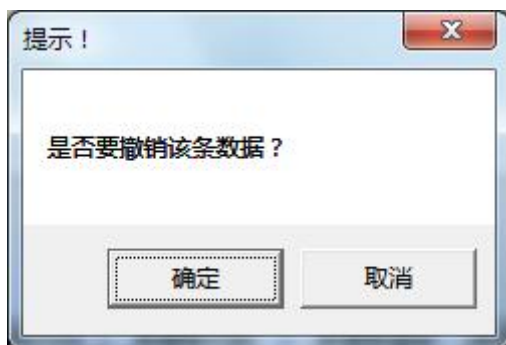


在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，质押券代码，质押券简称，质押券数量，实际折算比例，原回购期限，原回购利率，原回购到期日，原回购首次成交金额，原回购应计利息，实际回购期限，实际回购利率，实际占款天数，实际结算金额，提前终止日期，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，原逆回购证券账户，原逆回购交易单元，申报状态，原成交日期，原成交编号，备注。

在此界面上的操作有撤销提前终止申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔提前终止申报，选中提前终止申报信息列表中的某条希望撤销的提前终止申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框





点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

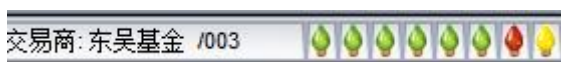


确定后，该条提前终止申报记录会从提前终止申报信息列表中消失。

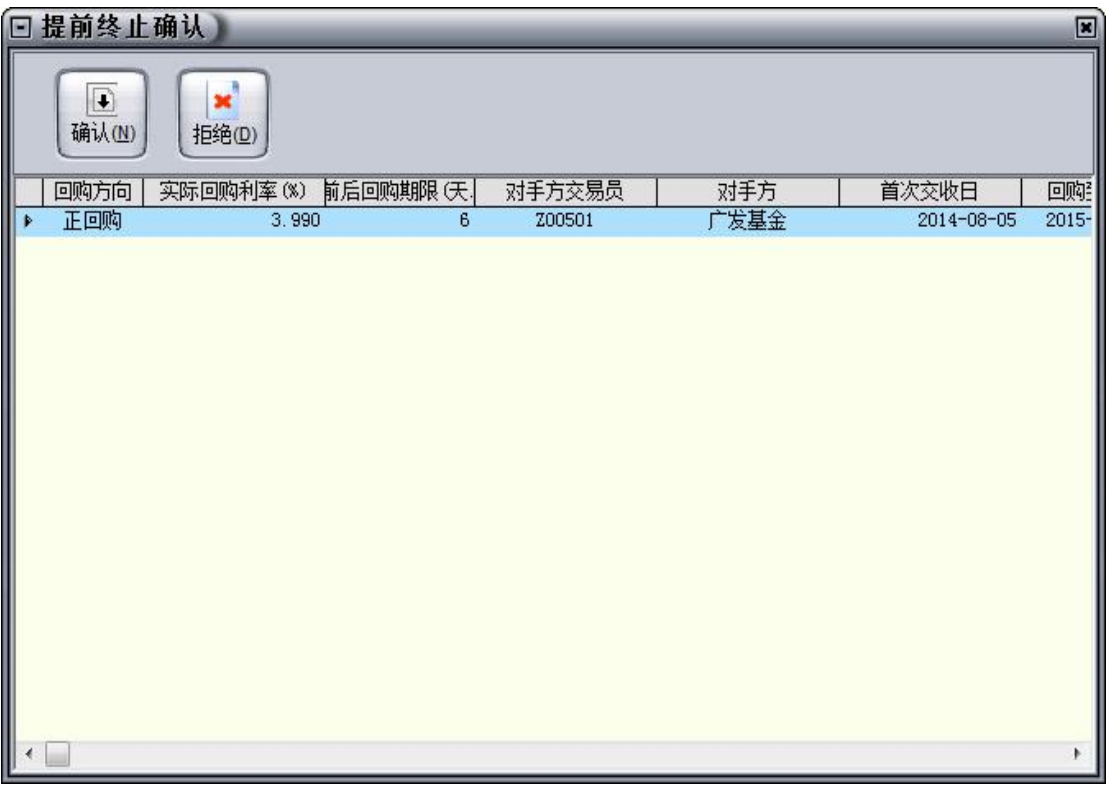
刷新：点击刷新未到期质押式协议回购信息列表、提前终止申报信息列表中的信息。

### 4.17.3 提前终止申报确认

交易员在收到以自己为对手方的提前终止申报后，提前终止申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第七盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起提前终止申报请求。



点击该灯，弹出提前终止申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出协议回购提前终止申报确认窗口，显示提前终止的协议回购合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

协议回购提前终止申报确认			
质押券代码	125330	回购方向	正回购
质押数量	999999999 手	本方证券账户	B880817647
折算比例	1.00 %	本方交易单元号	13111
实际回购利率	10.000 %	首次结算日	2014- 8-15
成交金额	9,999,999,990.00 元	回购到期日	2015- 8-15
实际结算金额	10,019,178,072.1 元	到期交收日	2015- 8-15
提前后实际占款天数	7 天	提前终止日期	2014- 8-22
提前后回购期限	7 天	对手方交易商	东吴基金
对手方交易员代码	Z00300	交易员代码	Z00200
对手方交易员名称	邵笛	交易员名称	陈晓华
质押券代码	12		
补充条款			
确认		关闭(C)	

界面各输入项说明如下：

交易单元：证券帐号指定交易单元号

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该提前终止申报请求会从协议回购提前终止申报确认窗口中消失。

#### 4.17.4 提前终止申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”

按钮，弹出提前终止申报拒绝窗口，显示协议回购合约信息

协议回购提前终止申报拒绝			
质押券代码	125330	回购方向	正回购
质押数量	999999999 手	本方证券账户	B880817647
折算比例	1.00 %	本方交易单元号	13111
实际回购利率	10.000 %	首次结算日	2014- 8-15
成交金额	9,999,999,990.00 元	回购到期日	2015- 8-15
实际结算金额	10,019,178,072.1 元	到期交收日	2015- 8-15
提前后实际占款天数	7 天	提前终止日期	2014- 8-22
提前后回购期限	7 天	对手方交易商	东吴基金
对手方交易员代码	Z00300	交易员代码	Z00200
对手方交易员名称	邵笛	交易员名称	陈晓华
质押券代码	12		
补充条款			
<div>拒绝</div> <div>关闭(C)</div>			

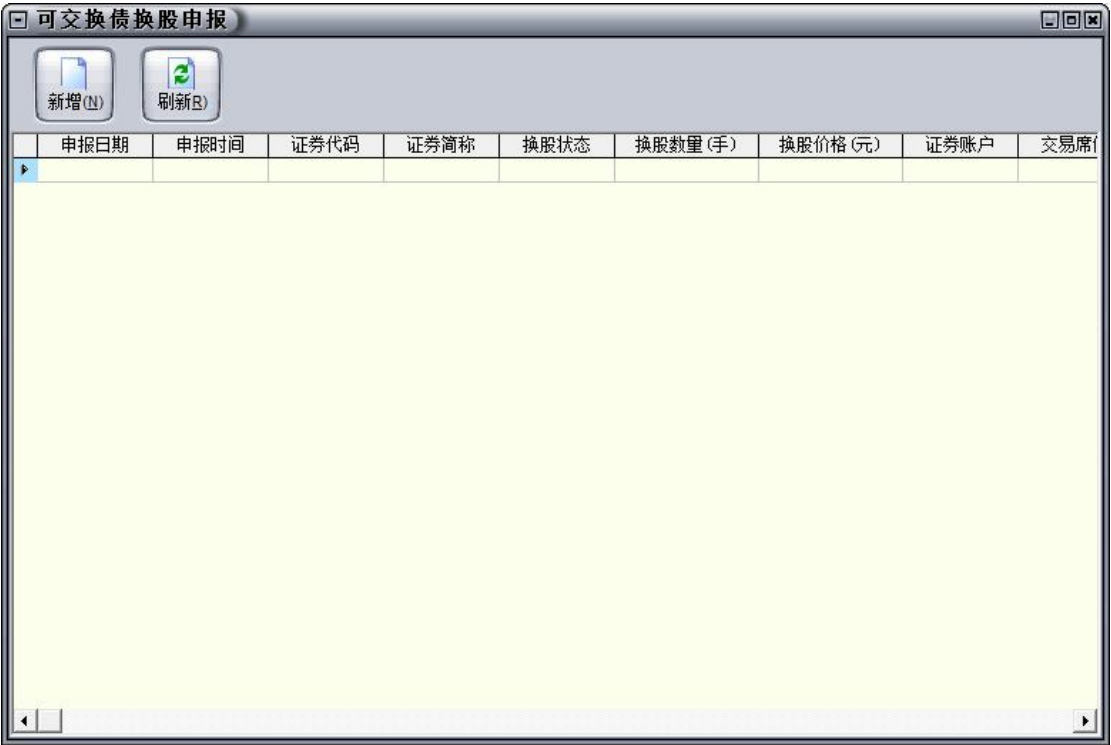
点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该提前终止申报请求会从协议回购提前终止申报确认窗口中消失。

### 4.18 可转换债换股申报

点击交易—>现券交易—>可交换债换股申报，进入换股申报信息管理界面。



用户在此管理需要可交换债换股申报的信息。

在列表中列出申报的换股申报信息，包含申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、换股状态、换股数量、换股价格、证券账户、交易交易单元、交易员代码和申报编号。

在此界面上的操作有新增可交换债换股申报信息和刷新申报信息。

新增：点击弹出可交换债换股申报录入对话框



用户在此申报需要可交换债换股申报信息，完成申报操作。

界面各输入项说明如下：

证券账户：如果中国结算是 10 位账号

证券代码：现券代码。

证券账号：可以选择本交易员有权使用的所有交易账户

交易单元号：根据选择的账户自动匹配，无需用户输入

换股数量：可交换债换股的现券数量，以千元面额为单位

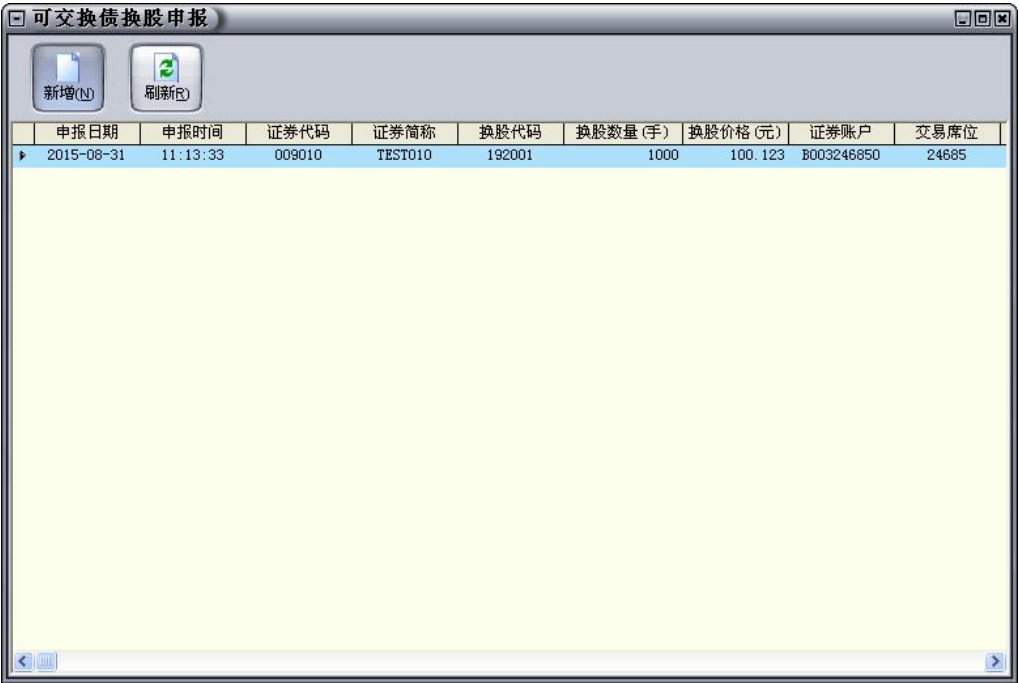
换股状态：自动匹配，无需用户输入

换股价格：自动匹配，无需用户输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即换股申报录入成功，弹出提示框



该条换股申报信息即出现在可交换债换股申报界面下方的信息列表中。



刷新：点击刷新换股申报信息列表中的信息。

### 4.19 债券回售申报

点击交易—>现券交易—>债券回售申报，进入回售申报信息管理界面。

申报日期	申报时间	证券代码	证券简称	回售数量(手)	回售价格(元)	证券账户	交易席位	交易员
------	------	------	------	---------	---------	------	------	-----

用户在此管理债券回售申报的相关信息。

在列表中列出申报的债券回售申报信息，包含申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、回售数量、回售价格、证券账户、交易交易单元、交易员代码和申报编号。

在此界面上的操作有新增债券回售申报信息、撤销债券回售申报信息和刷新申报信息。

新增：点击弹出债券回售申报录入对话框

交易员代码: Z03900

交易单元号:

证券简称:

证券账户:

证券代码:

回售数量: 千元面额

回售价格:

确定(O)      关闭(C)



用户在此申报需要申报的债券回售信息，完成申报操作。

界面各输入项说明如下：

证券账户：如果中国结算是 10 位账号

证券代码：现券代码。

证券账号：可以选择本交易员有权使用的所有交易账户

交易单元号：根据选择的账户自动匹配，无需用户输入

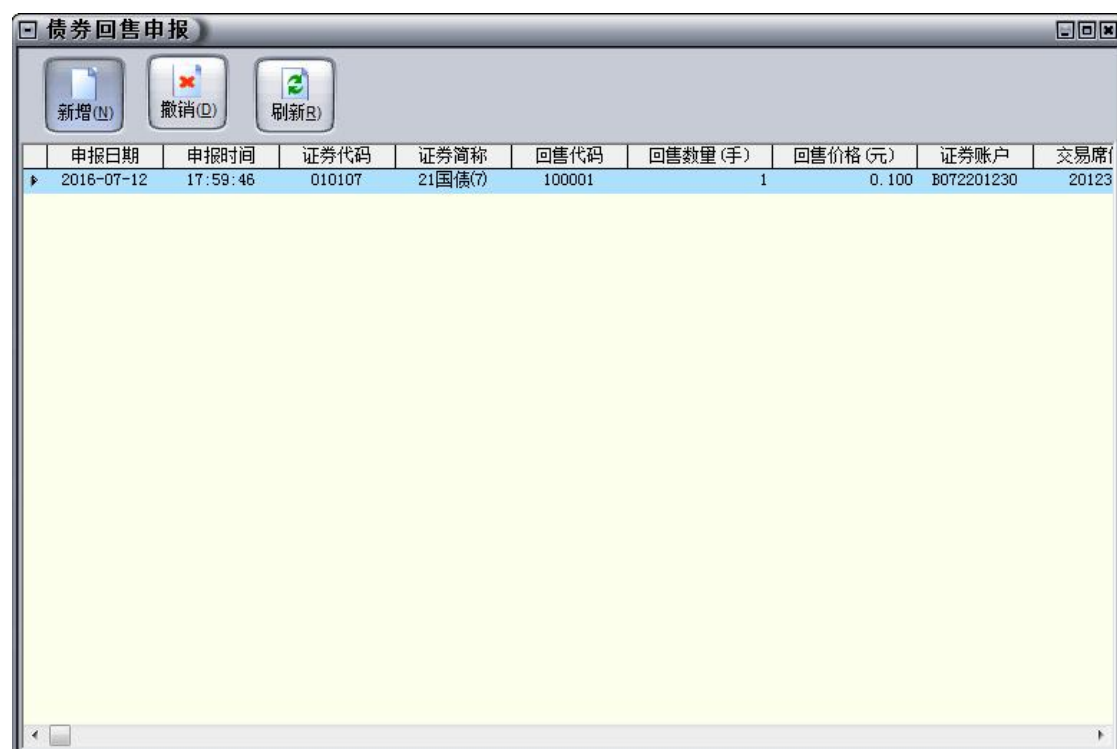
回售数量：回售的现券数量，以千元面额为单位

回售价格：自动匹配，无需用户输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即债券回售申报录入成功，弹出提示框



该条债券回售申报信息即出现在债券回售申报界面下方的信息列表中。



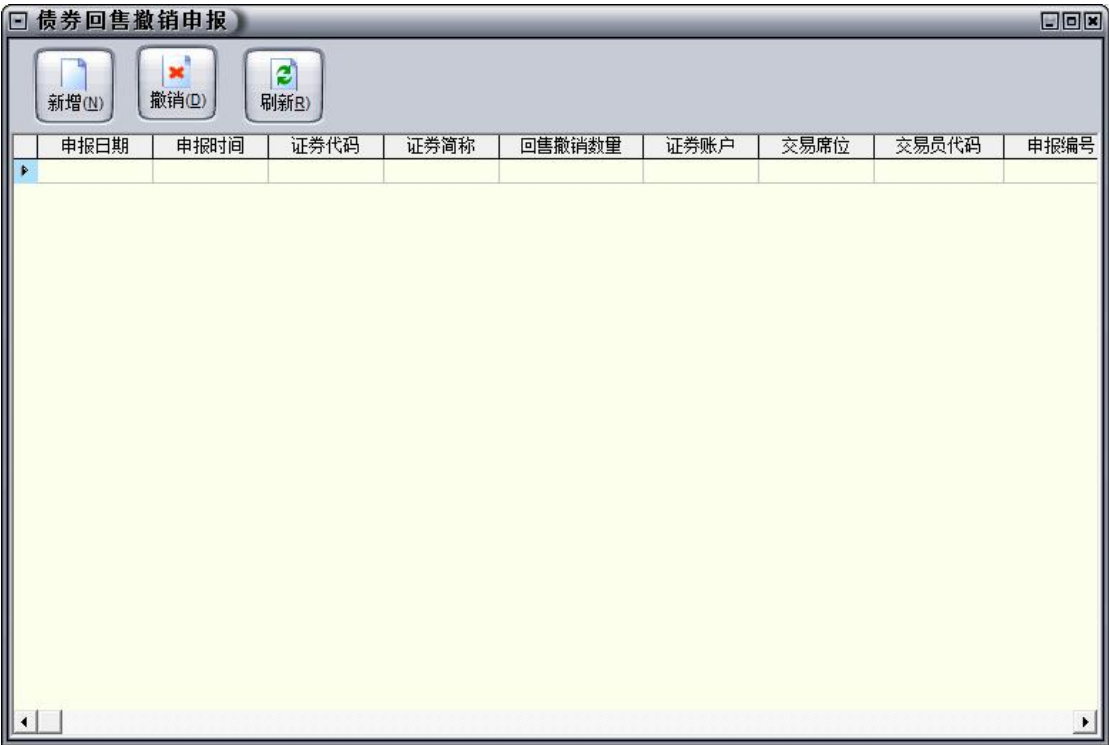
撤销：先在债券回售申报界面中选择需要撤销的的申报信息，点击撤销按钮，

即取消该条记录，仅原回售申报的操作交易员可以撤单。

刷新：点击刷新债券回售申报信息列表中的信息。

## 4.20 债券回售撤销申报

点击交易—>现券交易—>债券回售撤销回售申报，进入回售申报信息管理界面。



用户在此管理债券撤销回售撤销申报的相关信息。

在列表中列出申报的债券回售撤销申报信息，包含申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、回售数量、证券账户、交易交易单元、交易员代码和申报编号。

在此界面上的操作有新增债券回售撤销申报信息、撤销债券回售撤销申报信息和刷新申报信息。

新增：点击弹出债券回售撤销申报录入对话框



该界面为“债券回售撤销录入”窗口，包含以下输入项：

- 交易员代码：Z03900
- 交易单元号：[输入框]
- 证券简称：[输入框]
- 证券账户：[输入框]
- 证券代码：[下拉菜单]
- 回售撤销数量：[输入框] 千元面额

底部有两个按钮：“确定(O)”和“关闭(C)”。

用户在此申报需要申报的债券回售撤销信息，完成申报操作。

界面各输入项说明如下：

证券账户：如果中国结算是 10 位账号

证券代码：现券代码。

证券账户：可以填写本交易商所有交易账户

交易单元号：根据选择的账户自动匹配，无需用户输入

回售撤销数量：回售的现券数量，以千元面额为单

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即债券回售申报录入成功，弹出提示框



该条债券回售撤销申报信息即出现在债券回售撤销申报界面下方的信息列表中。

撤销：先在债券回售撤销申报界面中选择需要撤销的的申报信息，点击撤销按钮，即取消该条记录，仅原回售申报的操作交易员可以撤单。

刷新：点击刷新债券回售撤销申报信息列表中的信息。

## 4.21 三方回购担保品管理

### 4.21.1 三方回购转入申报

点击三方回购—>担保品管理—>三方回购转入申报，进入三方回购专户转入申报管理界面。

申报日期	申报时间	证券账户	交易单元	质押券代码	质押券数量	三方回购专用交易单元	三方
------	------	------	------	-------	-------	------------	----

用户在此管理三方回购转入申报的相关信息。

在列表中列出申报的债券转入申报信息，包含申报日期、申报时间、证券账户、交易单元、质押券代码、质押券数量、三方回购专用交易单元和三方回购专用账户。

在此界面上的操作有新增三方回购转入申报和刷新申报信息。

新增：点击新增三方回购转入申报录入对话框。



三方回购转入申报

债券交易参与人代码	039	债券交易参与人名称	华夏基金
证券代码 *		证券简称	
债券所属篮子		数 量 *	千元面额
三方回购专用账户 *		证券账户	
专用账户交易单元		交易单元	
三方回购专用账户名称		账户名称	

确定(O)      关闭(C)

用户在此申报需要申报的三方回购转入信息，完成申报操作。

说明：输入三方回购专用账户后将鼠标分别移动到三方回购专用账户名称、账户名称输入框内即显示各账户完整信息。

界面各输入项说明如下：

证券代码：现券代码。

三方回购专用账户：选择三方回购专用账号。

数量：转入的现券数量，以千元面额为单位。

三方回购专用交易单元：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

三方回购专用账户名称：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

证券账户：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

债券所属篮子：根据选择的证券代码自动匹配，无需用户输入。

证券简称：根据选择的证券代码自动匹配，无需用户输入。

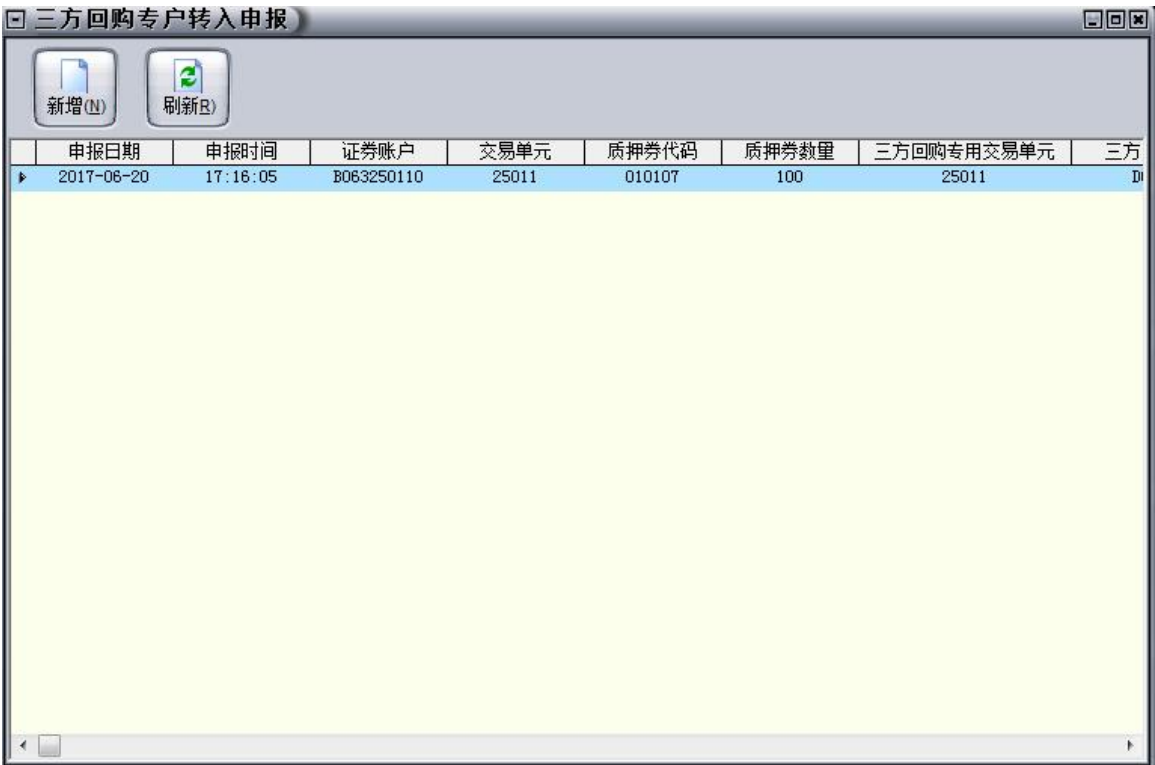
交易单元：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

账户名称：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即三方回购转入录入成功，弹出提示框。



该条三方回购转入信息即出现在三方回购转入申报界面下方的信息列表中。



刷新：点击刷新三方回购转入申报信息列表中的信息。

4.21.2 三方回购转出申报

点击三方回购—>担保品管理—>三方回购转出申报，进入三方回购专户转出申报管理界面。



用户在此管理三方回购转出申报的相关信息。

在列表中列出申报的债券转出申报信息，包含申报日期、申报时间、证券账户、交易单元、质押券代码、质押券数量、三方回购专用交易单元和三方回购专用账户。

在此界面上的操作有新增三方回购转出申报和刷新申报信息。

新增：点击新增三方回购转出申报录入对话框。



用户在此申报需要申报的三方回购转出信息，完成申报操作。



说明：输入三方回购专用账户后将鼠标分别移动到三方回购专用账户名称、账户名称输入框内即显示各账户完整信息

界面各输出项说明如下：

证券代码：现券代码。

三方回购专用账户：选择三方回购专用账号。

数量：转出的现券数量，以千元面额为单位。

三方回购专用交易单元：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

三方回购专用账户名称：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

证券账户：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

债券所属篮子：根据选择的证券代码自动匹配，无需用户输入。

证券简称：根据选择的证券代码自动匹配，无需用户输入。

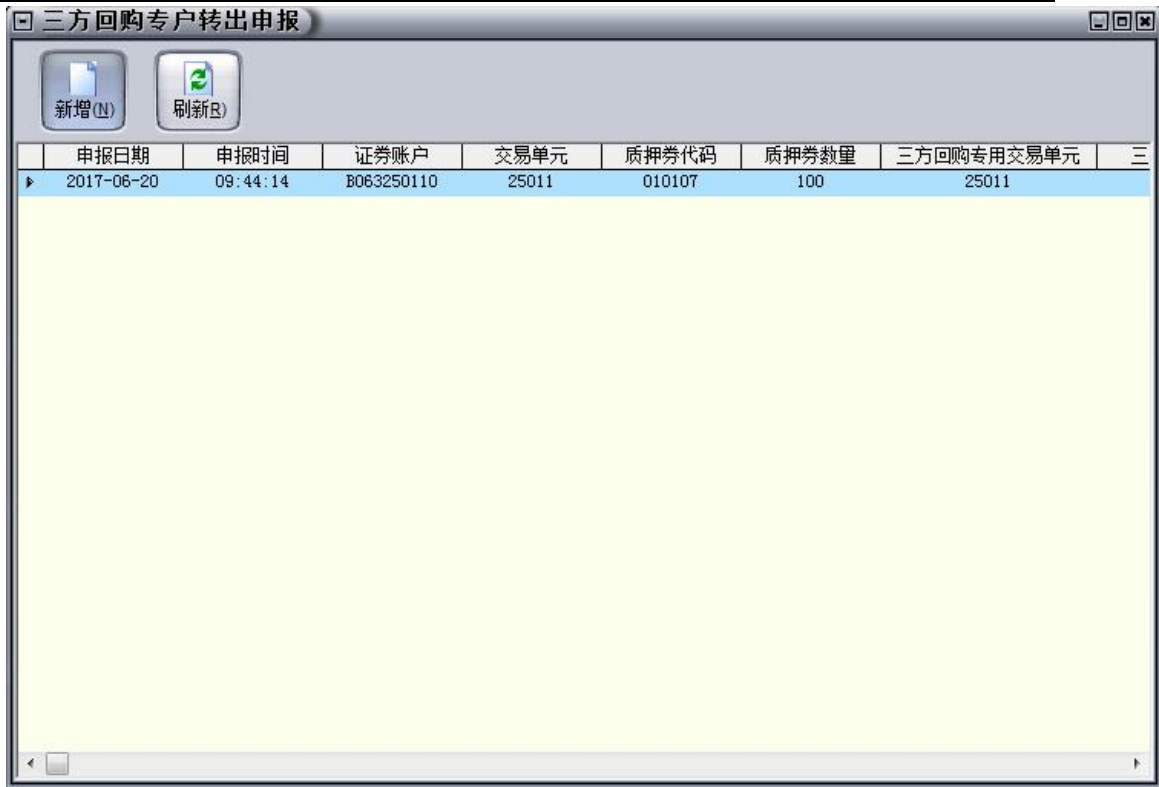
交易单元：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

账户名称：根据选择的三方回购专用账户自动匹配，无需用户输入。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即三方回购转出录入成功，弹出提示框。



该条三方回购转出信息即出现在三方回购转出申报界面下方的信息列表中。



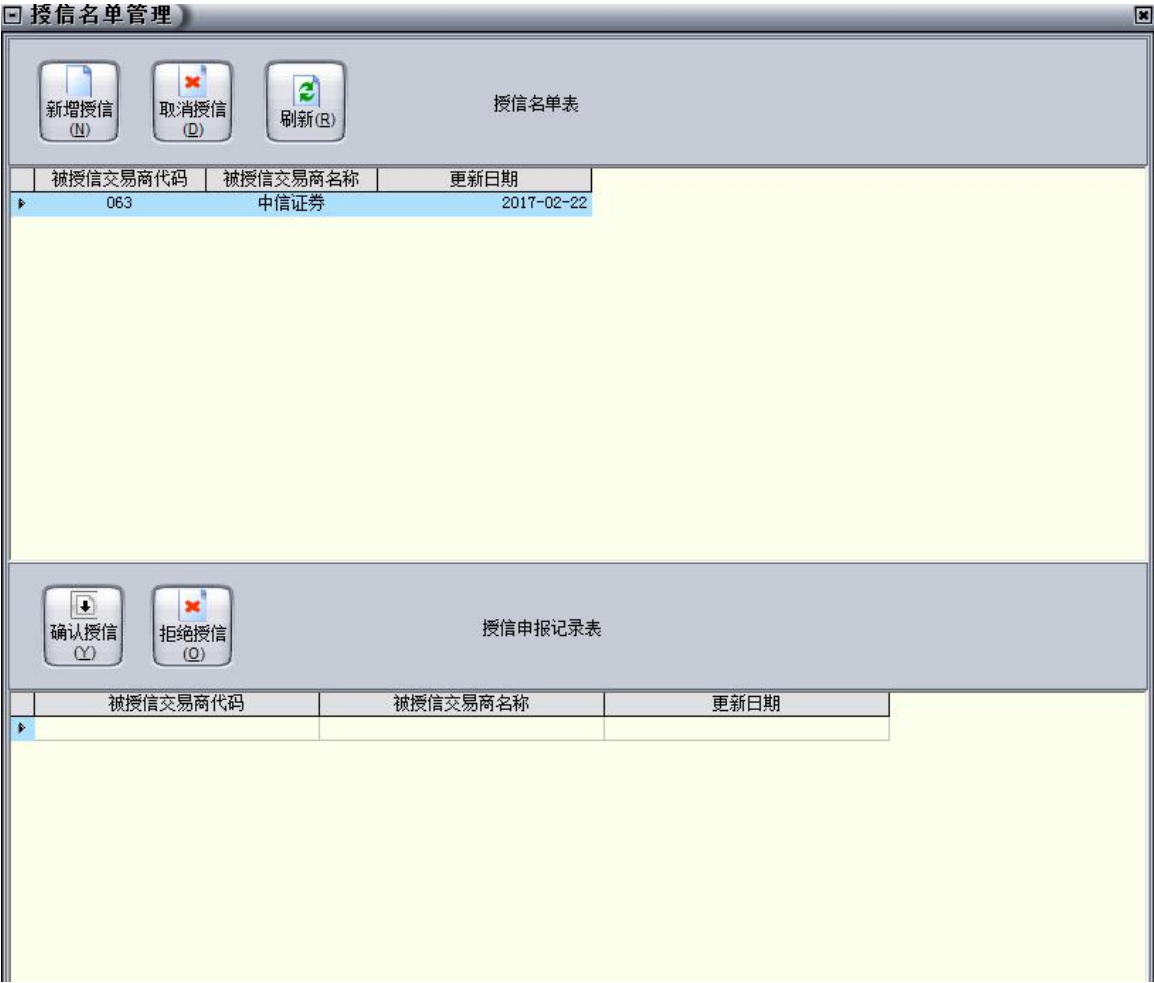
刷新：点击刷新三方回购转出申报信息列表中的信息。

## 4.22 三方回购授信管理

### 4.22.1 三方回购授信名单管理

点击三方回购—>授信管理，进入三方回购授信名单管理界面。

界面上半部为授信名单表



用户在此管理三方回购授信的相关信息。

在列表中列出在此界面上的操作有新增授信、取消授信和刷新授信名单表。

新增授信：点击新增授信弹出新增授信录入对话框。



用户在此申报需要的三方回购授信信息，完成授信操作。

界面各输出项说明如下：

被授信债券交易参与人代码：被授信的债券交易参与人代码。

被授信债券交易参与人名称：根据输入的被授信的债券交易参与人代码自动匹配，无需用户输入。

更新日期：授信申报日期，自动匹配，无需用户输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即三方回购授信录入成功，弹出提示框。



该条三方回购授信信息即出现在授信名单管理界面下方的授信名单表中。

取消授信：先在三方回购授信申报界面中选择一条需要取消的的授信信息，点击取消授信，即取消该条记录。

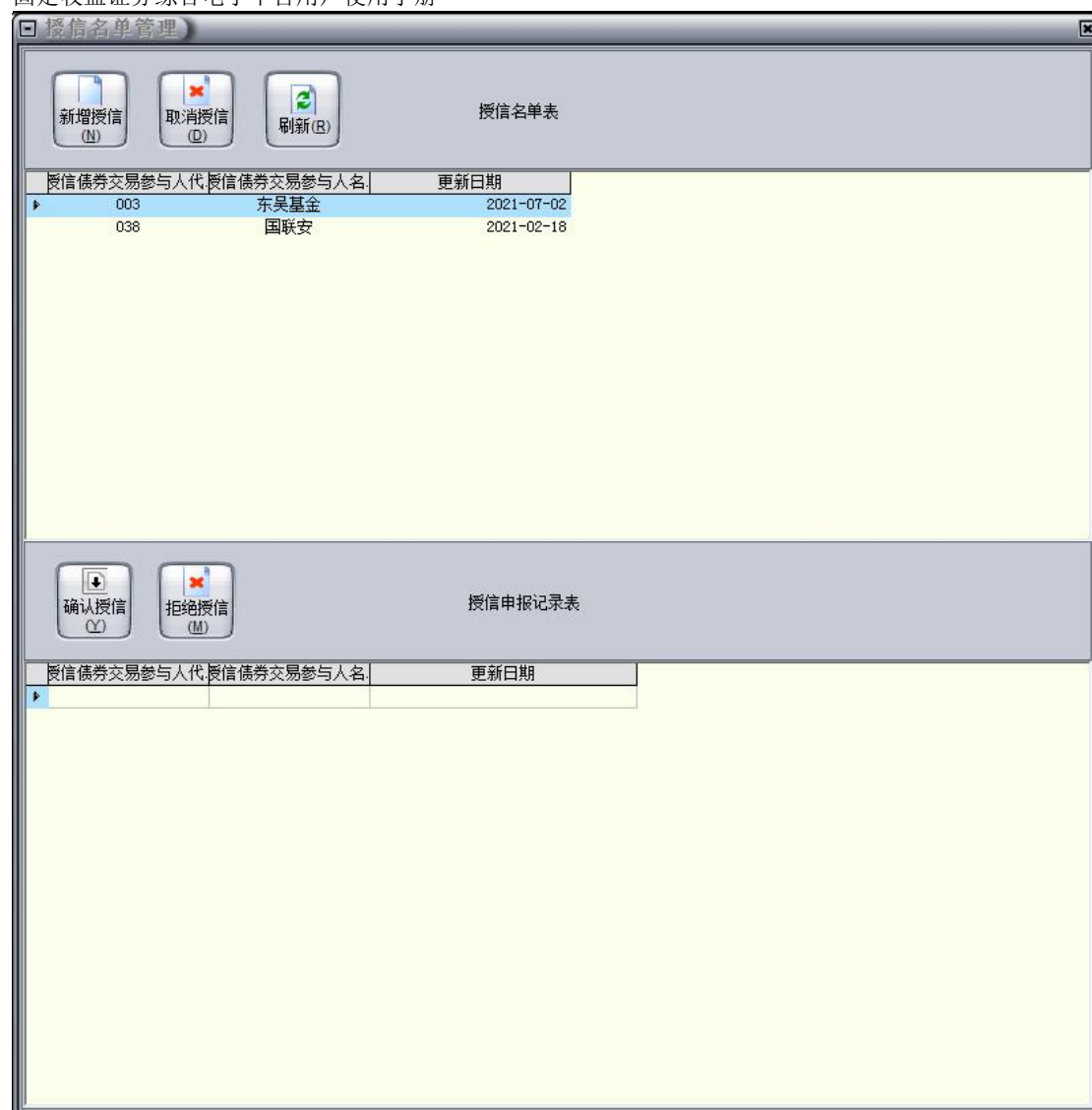
刷新：点击刷新三方回购授信名单表中的信息。

## 4.22.2 三方回购确认授信

交易员在收到以自己为对手方的授信申请后，授信管理确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第九盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起授信申请。



点击该灯，弹出授信名单管理窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认授信”按钮，弹出三方回购确认授信窗口，显示三方回购确认授信信息。



确认授信给该债券交易参与人后，点击“确认”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该授信申请会从授信管理窗口中消失。

### 4.22.3 三方回购拒绝授信

如果用户想拒绝一笔授信申请，在授信名单管理界面的授信申报记录表中选中该条申报记录后，点击“拒绝授信”按钮，弹出三方回购拒绝授信窗口，显示被授信债券交易参与人信息



点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该授信申请会从授信名单管理窗口中消失。

### 4.22.4 三方回购授信获得情况

点击三方回购—>授信管理，进入三方回购授信获得情况界面。

界面上半部为授信获得情况表

授信获得情况

刷新(R)

授信获得情况表

授信交易商代码	授信交易商名称	更新日期
063	中信证券	2017-10-23
064	东吴证券	2017-11-25
065	海通证券	2017-09-20
005	广发基金	2017-08-24

申请授信(N)

撤销申请(Q)

刷新(R)

授信申报记录表

授信交易商代码	授信交易商名称	更新日期	编号
---------	---------	------	----

在此界面上的操作有申请授信、撤销授信和刷新授信名单表。

申请授信：点击申请授信弹出申请授信录入对话框。





三方回购申请授信

授信交易商代码

授信交易商名称

更新日期 2017-06-28

确定(O) 关闭(C)

用户在此申报需要的三方回购申请授信信息，完成申请授信操作。

界面各输出项说明如下：

授信债券交易参与人代码：授信的债券交易参与人代码。

授信债券交易参与人名称：根据输入的授信的债券交易参与人代码自动匹配，无需用户输入。

更新日期：申请授信申报日期，自动匹配，无需用户输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即三方回购授信录入成功，弹出提示框。



该条三方回购申请授信信息即出现在授信获得情况界面下方的授信申报记录表中。

撤销申请：先在三方回购授信申报记录表中选择一条需要撤销的的授信申请信息，点击撤销申请，即撤销该条记录。

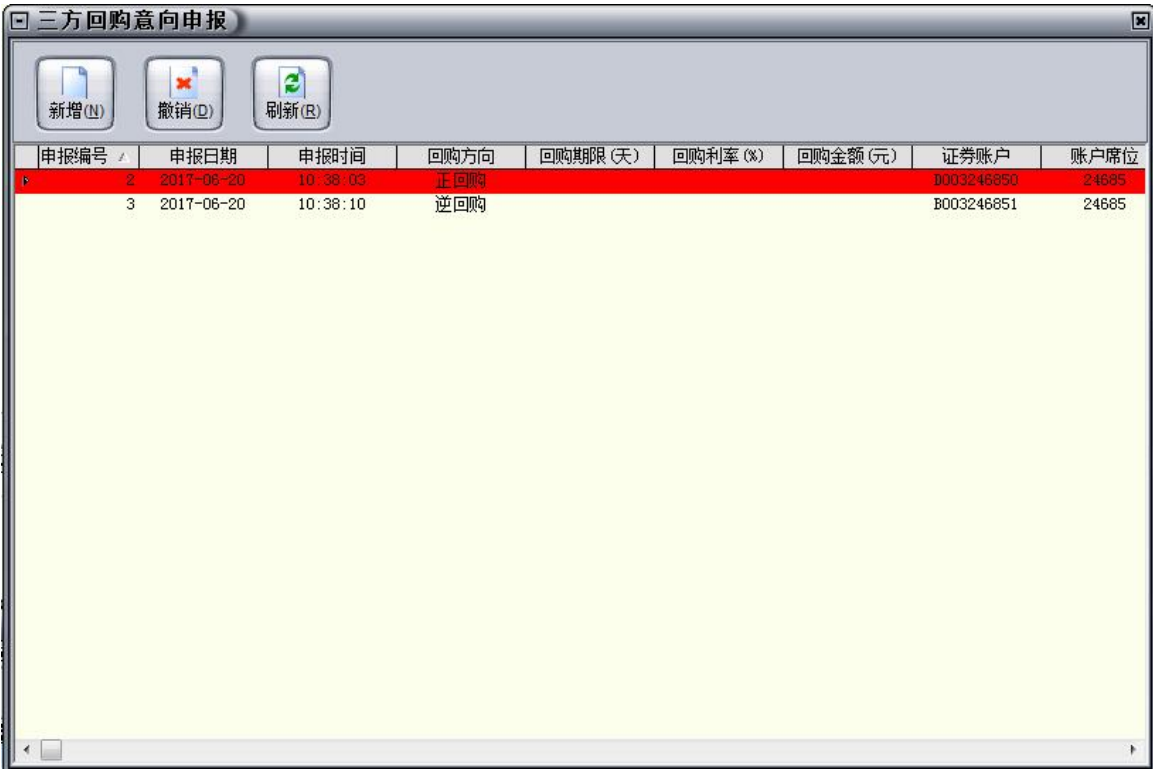
刷新：点击刷新三方回购授信申请记录表中的信息。

## 4.23 三方回购交易申报

### 4.23.1 三方回购意向申报

点击三方回购—>交易申报—>意向申报，进入三方回购意向申报信息管理界

面。



用户在此管理需要意向申报的信息，选中回购方向为正回购时选中的数据背景色为红色，逆回购背景为显示为绿色

在列表中列出申报的意向申报信息，包含申报编号、申报日期、申报时间、回购方向、回购期限、回购利率、金额、证券账户、账户交易单元、篮子编码、债券交易参与人简称、交易员代码、申报状态。

在此界面上的操作有新增意向申报信息、撤销意向申报信息和刷新意向申报信息。

新增：点击弹出意向申报对话框

**新增三方回购意向申报**

回购方向 \*

三方回购专用账户 \*

三方回购专用账户名称

交易单元

回购利率  %

回购期限  天

金 额  元

交易员名称

交易员代码

质押券篮子

- ☐ B001-利率
- ☐ B002-AAA (公)
- ☐ B003-AA+ (公)
- ☐ B004-AA (公)
- ☐ B005-AAA (私)
- ☐ B006-AA+ (私)
- ☐ B007-AA (私)
- ☐ B008-其他

债券交易参与人

投资者名称

用户在此申报需要意向申报信息，完成意向申报操作。

说明：

- 1、所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框；
- 2、选择账户后将光标移动到三方回购专用账户名称输入框内即显示账户名称完整信息。

界面各输入项说明如下：

回购方向：正回购/逆回购

三方回购专用账户：正回购方账户

三方回购专用账户名称：正回购方账户名称，自动匹配，无需输入

交易单元：自动匹配，无需输入

回购期限：质押券质押天数

回购利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

金额：正回购方融入的资金额度

交易员代码：自动匹配，无需输入

交易员名称：交易员名称，自动匹配，无需输入

债券交易参与人：债券交易参与人名称，自动匹配，不需输入

投资者名称：投资者名称，自动匹配，不需输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即意向申报录入成功，弹出提示框



该条意向申报信息即出现在意向申报界面下方的信息列表中。

撤销：选中意向申报信息列表中的某条希望撤销的意向申报信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条意向申报信息即在意向申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新意向申报信息列表中的信息。

4.23.2 三方回购协商成交申报

点击三方回购—>交易申报—>协商成交申报，进入三方回购协商成交申报信息管理界面。



用户在此管理需要协商成交申报的信息。

在列表中列出申报的协商成交申报信息，包含申报编号、申报时间、回购方向、回购期限、回购利率、首次结算日、回购到期日、到期结算日、违约后担保品是否由质权人处置、正回购方债券交易参与人简称、正回购方交易员代码、正回购方证券账号、正回购方交易单元、正回购方账户名称、投资者名称、产品委

托人、杠杆运作限制、逆回购方债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、补充约定、回购金额、到期结算金额、回购利息、申报状态。

在此界面上的操作有新增协商成交申报信息、撤销协商成交申报信息和刷新协商成交申报信息。

新增：点击弹出协商成交申报对话框

用户在此申报需要协商成交申报信息，完成协商成交申报操作。

说明：

- 1、所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框
- 2、输入三方回购专用账户后将鼠标分别移动到三方回购专用账户名称、投资者名称、产品委托人输入框内即显示完整信息

界面各输入项说明如下：

回购方向：正回购/逆回购，自动匹配，无需输入

债券交易参与人：债券交易参与人名称，自动匹配，无需输入

交易员代码：交易员代码，自动匹配，无需输入

交易员名称：交易员名称，自动匹配，无需输入

三方回购专用账户：资金融入方的证券账户

三方回购专用账户名称：自动匹配，无需输入

专用账户交易单元：自动匹配，无需输入

投资者名称：自动匹配，无需输入

产品委托人：自动匹配，无需输入

杠杆运作限制：自动匹配，无需输入

对手方债券交易参与人：自动匹配，无需输入

对手方交易员代码：对手方交易员代码

对手方交易员名称：自动匹配，无需输入

回购期限：回购到期日一成交日期

成交日：当前交易日，自动匹配，无需输入

首次结算日：自动匹配，无需输入

回购到期日：参与人确定的回购到期日期

到期结算日：自动匹配，无需输入

实际占款天数：到期结算日一首次结算日，自动匹配，无需输入

回购利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

回购金额：多券申报正回购方融入的资金额度

回购利息： $\text{成交金额} \times \text{回购利率} \times \text{实际占款天数} / 365$  合计，自动匹配，无需输入

到期结算金额：到期日正回购方返回的金额合计，自动匹配，无需输入

补充约定：交易双方的补充约定



违约后担保品是否由职权人处置：违约后担保品是否由职权人处置

质押券篮子：自动匹配，无需输入

申报界面支持批量申报，即支持一次性提交针对同一交易对手方、使用同一回购利率与同一回购期限的多个质押券交易申报，申报元素：

质押券代码：质押债券的代码

质押券简称：自动匹配，无需输入

质押券数量：质押券数量，以千元面额为单位。

质押券所属篮子：质押券所属篮子

全价估值：自动匹配，无需输入

折扣率：自动匹配，无需输入

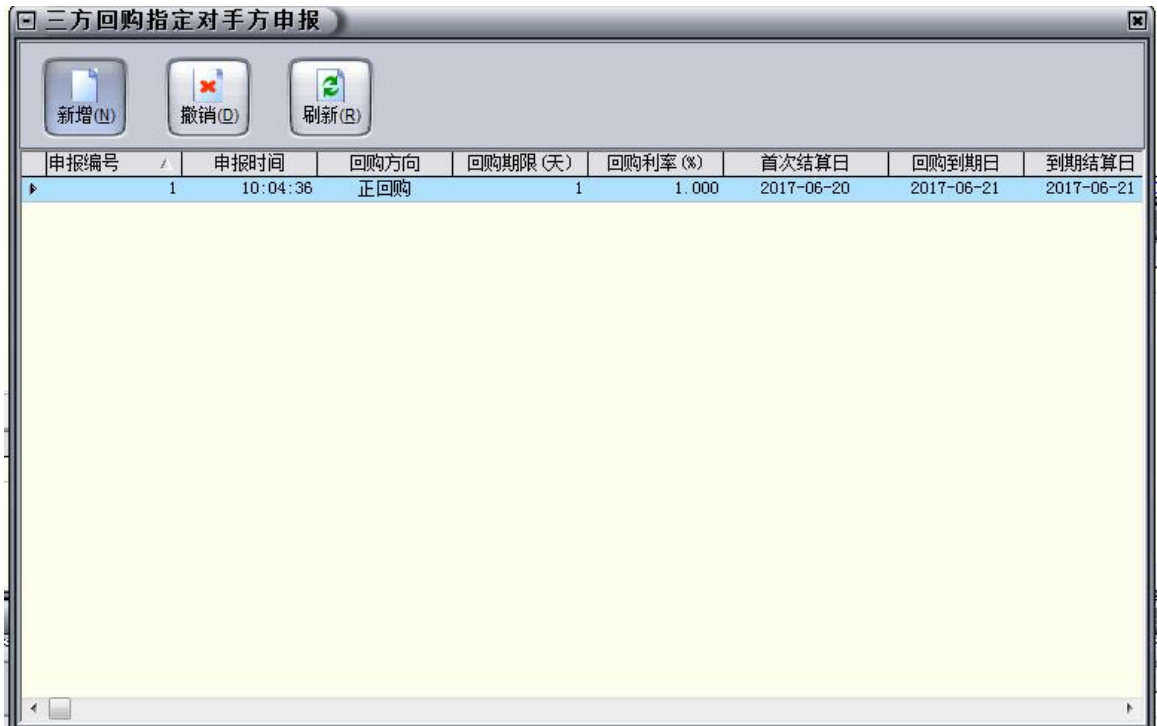
担保价值：全价估值\*数量\*10\*（1-折扣率/100），自动匹配，无需输入

担保价值合计：多券申报质押券的合计担保价值，自动匹配，无需输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即成交申报录入成功，弹出提示框



该条协商成交申报信息即出现在成交申报界面下方的信息列表中。



### 4.23.3 三方回购协商成交撤销

如果用户想撤销该笔申报，选中三方回购协商成交申报信息列表中的某条希望撤销的成交申报信息，点击撤销，弹出撤销提示框

三方回购指定对手方申报撤销

回购方向

正回购

逆回购

交易商

东吴基金

交易员代码

Z00301

交易员名称

张三

三方回购专用账户

D003246850

三方回购专用帐户名称

003专用账户1玩J

专用账户交易单元

24685

投资者名称

申请人名称1 bbb

产品委托人

产品委托人1 aaa

杠杆运作限制

杠杆运作限制1  
aaaaaaaaaaaaaaaa  
aaaaaaaaaaaaaaaa  
aaaaaaaaaaaaaaaa

对手方交易员代码

Z00500

对手方交易员名称

张三

对手方交易商名称

广发基金

交易信息

回购期限

3

天

成交日

2017-06-30

首次结算日

2017-06-30

回购到期日

2017-07-03

到期结算日

2017-07-03

实际占款天数

3

回购利率(%)

1.000

回购金额

1,000,000.00

元

回购利息

82.19

元

到期结算金额

1,000,082.19

元

质押券篮子

☐ B001-利率

☐ B002-AAA(公)

☒ B003-AA+(公)

☐ B004-AA(公)

☐ B005-AAA(私)

☒ B006-AA+(私)

☒ B007-AA(私)

☐ B008-其他

担保价值合计

2,667,755.88

元

违约后担保品是否由质权人处置

是

补充约定

质押券代码	质押券简称	质押数量(手)	全价估值(元)	担保价值(元)
151001	公司A1	1000	97.500	831382.50
141000	公司00	1000	105.458	983588.11
151002	公司A2	1000	100.010	852785.27

确定(N)

关闭(C)

点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框

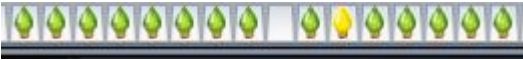


该条协商成交申报信息即在三方回购协商成交申报信息列表中消失。

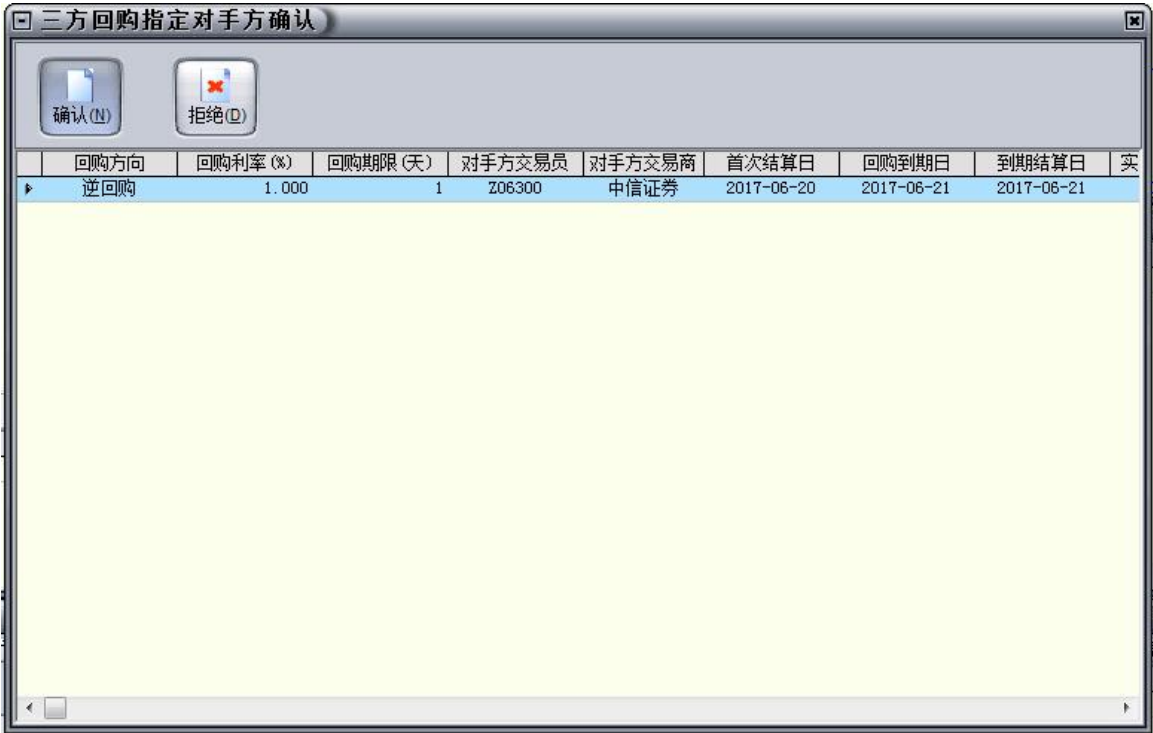
刷新：点击刷新成交申报信息列表中的信息。

4.23.4 三方回购协商成交申报确认

正回购方申报后，逆回购方的三方回购协商成交申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果逆回购方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第十盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起协商成交申报请求。



点击该灯，弹出协商成交确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击确认，弹出三方回购协商成交申报确认窗口信息提示，逆回购方可以查看申报信息是否无误

说明：将鼠标分别移动到账户名称、投资者名称、对手方账户名称、对手方投资者名称、对手方产品委托人输入框内即显示完整信息

三方回购指定对手方确认

回购方向

正回购

逆回购

交易商

广发基金

交易员代码

Z00500

交易员名称

张三

证券账户\*

B005247412

账户名称

005普通账户7 aa

交易单元

24741

投资者名称

申请人名称7 bbb

对手方交易商

东吴基金

对手方交易员代码

Z00301

对手方交易员名称

张三

对手方账户名称

003专用账户1玩/

对手方投资者名称

申请人名称1 bbb

对手方产品委托人

产品委托人1 aaa

对手方杠杆运作限制

杠杆运作限制1  
aaaaaaaaaaaaaaaa  
aaaaaaaaaaaaaaaa  
aaaaaaaaaaaaaaaa

质权人名称\*

质权人7 aaaaaaaaaaaaaaaaaaaaaa

交易信息

回购期限

3

天

成交日

2017-06-30

首次结算日

2017-06-30

到期结算日

2017-07-03

回购到期日

2017-07-03

实际占款天数

3

回购利率(%)

4.000

回购金额

1,000,000.00

元

回购利息

328.77

元

到期结算金额

1,000,328.77

元

担保价值合计(元)

831,382.50

质押券篮子

B001-利率

B002-AAA(公)

B003-AA+(公)

B004-AA(公)

B005-AAA(私)

B006-AA+(私)

☒ B007-AA(私)

B008-其他

违约后担保品是否由质权人处置

是

补充约定

证券代码	证券简称	质押数量(手)	全价估值(元)	担保价值(元)
151001	公司A1	1000	97.500	831382.50

确认

关闭(C)

说明：将光标分别移动到账户名称、投资者名称、对手方账户名称、对手方投资者名称、对手方产品委托人输入框内即显示完整信息

点击确定，提交至系统校验通过后弹出交易成功提示



4.23.5 三方回购协商成交申报拒绝

如果用户想拒绝该笔申报，在三方回购协商成交确认窗口点击拒绝，弹出三

方回购协商成交拒绝提示框

**三方回购指定对手方拒绝**

回购方向  
☒ 正回购 ☐ 逆回购

交易商: 广发基金  
交易员代码: Z00500  
交易员名称: 张三  
证券账户\*: B005247412  
账户名称: 005普通账户7 aa  
交易单元: 24741  
投资者名称: 申请人名称7 bbb  
对手方交易商: 东吴基金  
对手方交易员代码: Z00301  
对手方交易员名称: 张三  
对手方账户名称: 003专用账户1玩J  
对手方投资者名称: 申请人名称1 bbb  
对手方产品委托人: 产品委托人1 aaa  
对手方杠杆运作限制: 杠杆运作限制1  
质权人名称\*: 质权人7 aaaaaaaaaaaaaaaaaaaaaa

交易信息

回购期限: 3 天  
成交日: 2017-06-30  
首次结算日: 2017-06-30  
到期结算日: 2017-07-03  
回购到期日: 2017-07-03  
实际占款天数: 3  
回购利率(%): 4.000  
回购金额: 1,000,000.00 元  
回购利息: 328.77 元  
到期结算金额: 1,000,328.77 元  
担保价值合计(元): 831,382.50

质押券篮子

☐ B001-利率  
☐ B002-AAA(公)  
☐ B003-AA+(公)  
☐ B004-AA(公)  
☐ B005-AAA(私)  
☐ B006-AA+(私)  
☒ B007-AA(私)  
☐ B008-其他

违约后担保品是否由质权人处置: 是

补充约定

证券代码	证券简称	质押数量(手)	全价估值(元)	担保价值(元)
151001	公司A1	1000	97.500	831382.50

拒绝 关闭(C)

说明: 将光标分别移动到账户名称、投资者名称、对手方账户名称、对手方投资者名称、对手方产品委托人输入框内即显示完整信息

点击拒绝, 提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



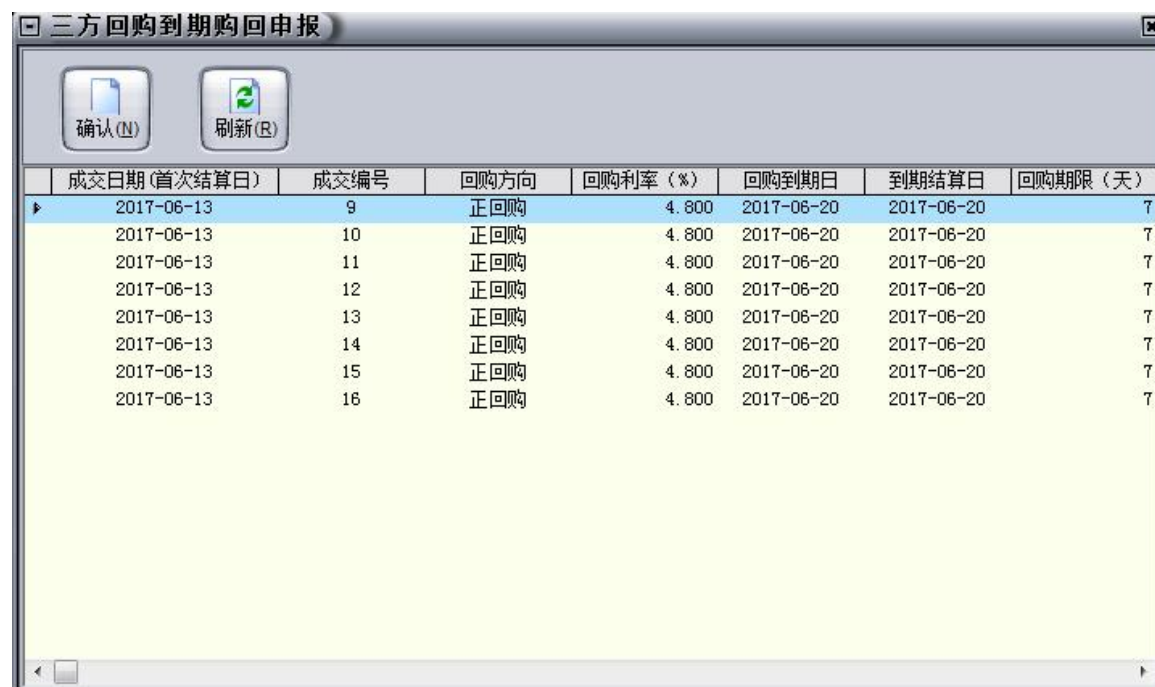
确定后, 该协商成交申报请求会从三方回购协商成交确认窗口中消失。



## 4.24 三方回购到期申报

### 4.24.1 三方回购到期购回申报

点击三方回购—>到期申报—>到期购回申报，进入三方回购到期购回申报信息管理界面。



成交日期(首次结算日)	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	
2017-06-13	9	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	10	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	11	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	12	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	13	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	14	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	15	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	
2017-06-13	16	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	

在界面列表中显示的是当日到期三方回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，回购金额，到期结算金额，回购利息，正回购债券交易参与者代码，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，正回购账户名称，正回购投资者名称，正回购产品名称，正回购杠杆运作限制，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，逆回购账户名称，质权人名称，违约后担保品是否由质权人处置，交收编号，篮子编码，质押券担保价值合计，到期状态，已操作类型。

在此界面上的操作有到期购回申报信息确认和刷新到期三方回购信息。

**确认：**如果用户想购回一笔到期三方回购合约，选中当日到期三方回购合约信息列表中的某条希望购回的三方回购合约记录，点击“确认”按钮，弹出“三方回购到期购回申报新增”界面，显示三方回购合约的详细要素内容供用户确认其操作。



三方回购到期购回申报新增

交易商

中信证券

交易员代码

Z06300

交易员名称

张三

三方回购专用账户

D063250110

三方回购专用账户名称

063专用账户9

专用账户交易单元

25011

投资者名称

申请人名称9

产品委托人

产品委托人9

杠杆运作限制

杠杆运作限制9

对手方交易商

联合证券

对手方交易员代码\*

Z07300

对手方交易员名称

张三

对手方账户名称

073普通账户12

交易信息

回购期限

3

天

成交编号

16

成交日

2017-06-27

回购到期日

2017-06-30

首次结算日

2017-06-27

到期结算日

2017-06-30

实际占款天数

3

天

回购利率

7.300

%

回购金额

60,000,000.00

元

回购利息

12,000.00

元

到期结算金额

60,036,000.00

元

担保价值合计(元)

0.00

质押券篮子

☐ B001-利率

☐ B002-AAA(公)

☐ B003-AA+(公)

☐ B004-AA(公)

☐ B005-AAA(私)

☐ B006-AA+(私)

☒ B007-AA(私)

☒ B008-其他

	质押券代码	质押数量(手)	三方专户	担保价值(元)
▶				

确定(Q)

关闭(C)

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

说明：将光标分别移动到三方回购专用账户名称、投资者名称、对手方账户名称、产品委托人输入框内即显示完整信息

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认申报成功提示框



该条三方回购合约记录即在到期三方回购合约信息列表中消失。

刷新：点击刷新当日到期三方回购信息列表中的信息。

4.24.2 三方回购到期续做申报

点击三方回购一〉到期申报一〉到期续做申报，进入三方回购到期续做管理界面，上面红框显示部分为当日到期三方回购信息列表。

三方回购到期续做

续做(N)

刷新(R)

列表中为当日到期三方回购

	成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数(天)	回购金
▶	2017-06-13	9	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
	2017-06-13	10	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
	2017-06-13	11	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
	2017-06-13	13	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
	2017-06-13	14	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
	2017-06-13	15	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
	2017-06-13	16	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300

撤销(Q)

列表中为到期续做申报

	申报编号	申报时间	本方回购方向	本期结算利息(元)	原回购期限(天)	续做期限(天)	原回购利率(%)
▶							

用户在此管理需要续做的三方回购信息。

在界面列表中显示的是当日到期三方回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，回购金额，到期结算金额，回购利息，正回购债券交易参与者代码，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，正回

购账户名称，正回购投资者名称，正回购产品名称，正回购杠杆运作限制，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购账户名称，质权人名称，违约后担保品是否由质权人处置，交收编号，篮子编码，质押券担保价值合计，到期状态，已操作类型。

在此界面上的操作有续做到期合约信息和刷新到期三方回购信息。

续做：如果用户想续做一笔到期三方回购合约，选中当日到期三方回购合约信息列表中的某条希望续做的三方回购合约记录，点击“续做”按钮，弹出“三方回购到期续做申报新增”界面，显示三方回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。

三方回购到期续做申报新增			
新续做信息			
交易商	中信证券	续做交易信息	
交易员代码	Z06300	续做期限 *	1 天
交易员名称	张三	续做日期	2017-06-30
三方回购专用账户	D063250110	续做回购到期日 *	2017-07-01
三方回购专用账户名称	063专用账户9	续做到期结算日	2017-07-01
专用账户交易单元	25011	续做实际占款天数	1 天
投资者名称	申请人名称9	续做利率 *	%
产品委托人	产品委托人9	续做金额 *	元
杠杆运作限制	杠杆运作限制9	续做利息	0.00 元
		续做到期结算金额	0.00 元
对手方交易商	联合证券	质押券篮子	
对手方交易员代码 *	Z07300	<input type="checkbox"/> B001-利率 <input type="checkbox"/> B002-AAA(公) <input type="checkbox"/> B003-AA+(公) <input type="checkbox"/> B004-AA(公) <input type="checkbox"/> B005-AAA(私) <input type="checkbox"/> B006-AA+(私) <input checked="" type="checkbox"/> B007-AA(私) <input checked="" type="checkbox"/> B008-其他	
对手方交易员名称	张三	回购方向	正回购
对手方账户名称	073普通账户12	补充约定	
		补充约定5	
原申报信息			
原回购利率	7.300 %	原回购期限	3 天
原回购金额	60,000,000 元	原成交编号	16
原回购利息	12,000.00 元	担保价值合计(元)	0.00
原到期结算金额	60,036,000.00 元	违约后担保品是否由质权人处置	是
		原成交日期	2017-06-27
		原回购到期日	2017-06-30
		原到期结算日	2017-06-30
		原实际占款天数	3 天
<div>确定(Q)</div> <div>关闭(C)</div>			

用户在此填写需要申报的信息，完成续做申报操作。

说明：

1、所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

2、将光标分别移动到三方回购专用账户名称、投资者名称、产品委托人、对手方账户名称输入框内即显示完整信息

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

续做期限：续做到期日-续做成交日

续做回购到期日：参与人确定的回购到期日期

续做利率：正回购方付给逆回购方的资金价格

续做金额：正回购方融入的资金额度

补充约定：交易双方的补充约定

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出续做申报成功提示框



该条三方回购合约记录即在到期三方回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的到期续做申报信息列表中会出现该条三方回购合约的到期续做申报信息。

#### 4.22.2.1.到期续做申报撤销

在到期续做管理界面的下面红框显示部分为到期续做申报信息列表，用户在此管理到期续做申报信息。

三方回购到期续做

续做(N)

刷新(R)

列表中为当日到期三方回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数(天)	回购金
2017-06-13	9	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
2017-06-13	11	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
2017-06-13	13	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
2017-06-13	15	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300
2017-06-13	16	正回购	4.800	2017-06-20	2017-06-20	7	7	3300

撤销(D)

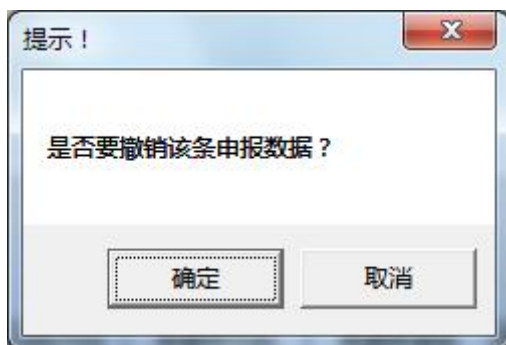
列表中为到期续做申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	本期结算利息(元)	原回购期限(天)	续做期限(天)	原回购利率(%)
5	13:30:56	正回购	433.97	7	1	4.800
6	13:31:07	正回购	433.97	7	1	4.800

在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，本期结算利息，原回购期限，续做期限，原回购利率，续做利率，续做日期，原回购到期日，续做回购到期日，原回购到期结算日，续做回购到期结算日，原实际占款天数，续做实际占款天数，续做金额，续做利息（预估），续做到期结算金额（预估），正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，篮子编码，申报状态，原成交日期，原成交编号，补充约定。

在此界面上的操作有撤销到期续做申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔到期续做申报，选中到期续做申报信息列表中的某条希望撤销的续做申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



确定后，该条续做申报记录会从到期续作申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新当日到期三方回购信息列表、到期续做申报信息列表中的信息。

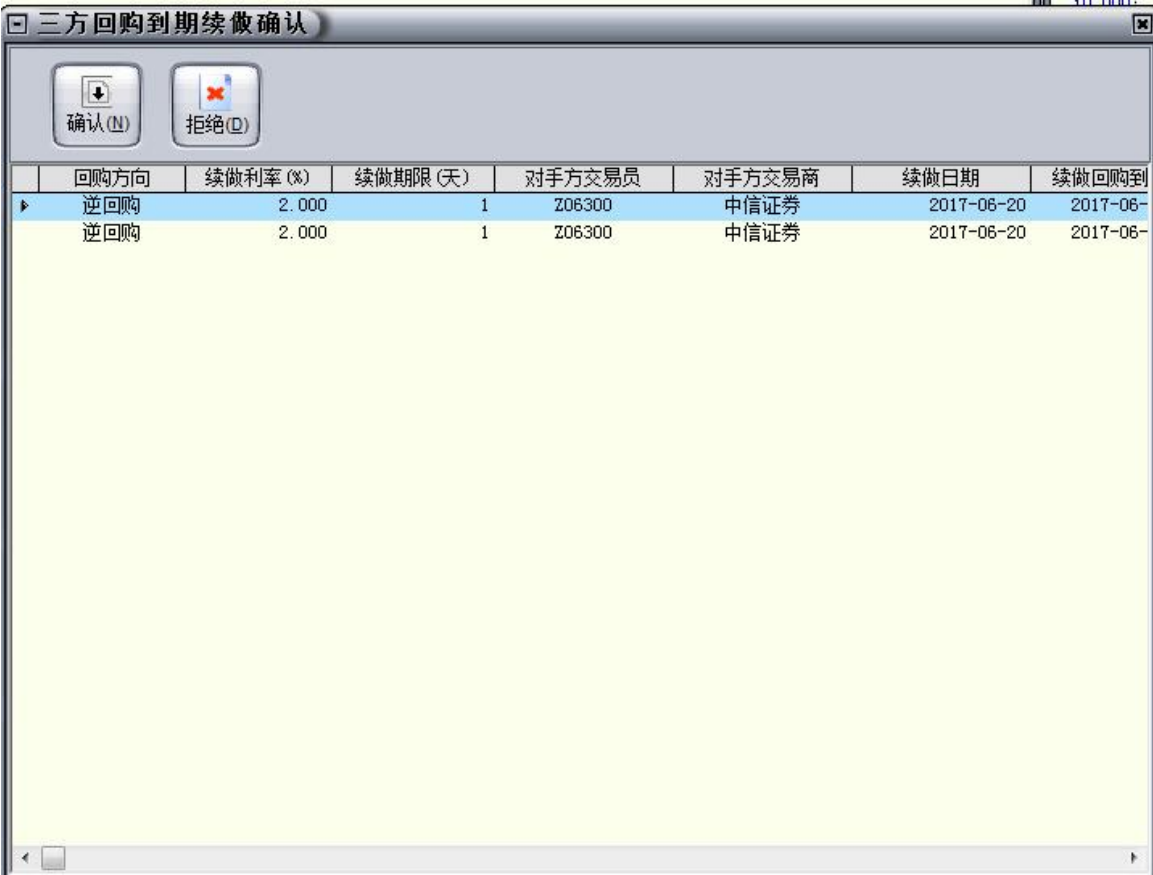
### 4.24.3 三方回购到期续做申报确认

正回购方申报后，逆回购方的到期续作申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果逆回购方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第十三盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起到期续做申报请求。



点击该灯，弹出到期续做申报确认窗口





如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出三方回购到期续做申报确认窗口，显示续做的三方回购合约信息，逆回购方可以查看申报信息是否无误。

说明：将光标分别移动到账户名称、投资者名称、对手方账户名称、对手方投资者名称、对手方产品委托人输入框内即显示完整信息



三方回购到期续做申报确认		
本方信息	对手方信息	质押券篮子
交易员代码: Z07300	交易商: 中信证券	<input checked="" type="checkbox"/> B001-利率
交易员名称: 张三	交易员代码: Z06300	<input checked="" type="checkbox"/> B002-AAA(公)
证券账户*: B073250441	交易员名称: 张三	<input type="checkbox"/> B003-AA+(公)
账户名称: 073普通账户12	账户名称: 063专用账户9	<input type="checkbox"/> B004-AA(公)
投资者名称: 申请人名称12	投资者名称: 申请人名称9	<input type="checkbox"/> B005-AAA(私)
交易单元*: 25044	产品委托人: 产品委托人9	<input checked="" type="checkbox"/> B006-AA+(私)
回购方向: 逆回购	杠杆运作限制: 杠杆运作限制9	<input type="checkbox"/> B007-AA(私)
质权人名称*: 质权人12		<input type="checkbox"/> B008-其他
交易信息		
续做利率: 2.300 %	续做期限: 3 天	原成交编号*: 15
续做金额: 4,000,000.00 元	续做日期: 2017-06-30	原成交日期: 2017-06-27
续做利息: 756.16 元	续做回购到期日: 2017-07-03	补充约定
续做到期结算金额: 4,000,756.16 元	续做到期结算日: 2017-07-03	补充约定4
担保价值合计(元): 0.00	违约后担保品是否由质权人处置: 是	
<div>确认</div> <div>关闭(C)</div>		

核对好相应数据后，点击“确认”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该到期续做申报请求会从三方回购到期续做申报确认窗口中消失。

#### 4.24.4 三方回购到期续做申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出三方回购到期续做申报拒绝窗口，显示三方回购合约信息

三方回购到期续做申报拒绝

本方信息

交易员代码  
Z07300

交易员名称  
张三

证券账户  
B073250441

账户名称  
073普通账户12

投资者名称  
申请人名称12

交易单元  
25044

回购方向  
逆回购

质权人名称 \*  
质权人12

对手方信息

交易商  
中信证券

交易员代码  
Z06300

交易员名称  
张三

账户名称  
063专用账户9

投资者名称  
申请人名称9

产品委托人  
产品委托人9

杠杆运作限制  
杠杆运作限制9

质押券篮子

☒ B001-利率

☒ B002-AAA(公)

☐ B003-AA+(公)

☐ B004-AA(公)

☐ B005-AAA(私)

☒ B006-AA+(私)

☐ B007-AA(私)

☐ B008-其他

交易信息

续做利率  
2.300 %

续做期限  
3 天

原成交编号  
15

续做金额  
4,000,000.00 元

续做日期  
2017-06-30

原成交日期  
2017-06-27

续做利息  
756.16 元

续做回购到期日  
2017-07-03

补充约定

续做到期结算金额  
4,000,756.16 元

续做到期结算日  
2017-07-03

补充约定4

担保价值合计(元)  
0.00

违约后担保品是否由质权人处置  
是

拒绝

关闭(C)

说明：将光标分别移动到账户名称、投资者名称、对手方账户名称、对手方投资者名称、对手方产品委托人输入框内即显示完整信息

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该到期续做申报请求会从三方回购到期续做申报确认窗口中消失。

## 4.25 三方回购存续期管理

### 4.25.1 三方回购换券申报

点击三方回购—>存续期管理—>换券申报，进入三方回购换券管理界面，上面红框显示部分为未到期三方回购信息列表。

换券(N)

刷新(R)

列表中为未到期三方回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数	回
2017-06-13	17	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	18	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	19	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	20	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	21	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	22	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	23	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	
2017-06-13	24	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	

撤销(D)

列表中为换券申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	换入质押券代码	换入质押券简称	换入质押券数量(手)	回购金额(元)

用户在此管理需要换券的三方回购信息。

在界面列表中显示的是未到期三方回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，回

购金额，到期结算金额，回购利息，正回购债券交易参与人代码，正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，正回购账户名称，正回购投资者名称，正回购产品名称，正回购杠杆运作限制，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购账户名称，质权人名称，违约后担保品是否由质权人处置，交收编号，篮子编码，质押券担保价值合计，到期状态，已操作类型。

在此界面上的操作有换券和刷新未到期三方回购信息。

换券：如果用户想对一笔未到期三方回购合约进行换券，选中列表中的某条希望换券的三方回购合约记录，点击“换券”按钮，弹出“三方回购换券申报新增”界面，显示三方回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。

三方回购换券申报新增

新券申报信息

换出质押券代码\*

010107 21国债(7)

换入质押券代码\*

010107 21国债(7)

换出质押券简称

21国债(7)

换入质押券简称

21国债(7)

换出质押券数量\*

1000

手

换入质押券数量\*

100

手

换出质押券所属篮子

B001

换入质押券所属篮子

B001

换出折扣率

0

%

换入折扣率

0

%

换出全价估值

100.280

元

换入全价估值

100.280

元

换出债券担保价值

1,002,800.00

元

换入债券担保价值

0.00

元

换出担保价值合计

3,000,000,000.00

元

换入担保价值合计

0.00

元

对手方交易商

联合证券

对手方交易员代码\*

Z07301

对手方交易员名称

张三

质押券篮子

☒ B001-利率

☐ B002-AAA(公)

☐ B003-AA+(公)

☐ B004-AA(公)

☐ B005-AAA(私)

☐ B006-AA+(私)

☐ B007-AA(私)

☐ B008-其他

原券申报信息

交易商

中信证券

回购期限

14

天

原成交编号

4

交易员代码

Z06301

回购利率

5.623

%

原成交日期

2017-06-20

交易员名称

张三

回购金额

6,000,000.00

元

回购到期日

2017-07-04

证券账户

D063250110

回购利息

12940.60

元

换券申报日期

2017-06-30

账户名称

063专用账户9

到期结算金额

6,012,940.60

元

实际占款天数

14

天

交易单元

25011

确定(O)

关闭(C)

用户在此填写需要申报的信息，完成换券申报操作。

说明：

1、所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

2、将光标移动到账户名称输入框内即显示完整信息

界面各输入项说明如下：

换出质押券代码：换出质押券代码

换出质押券数量：质押券数量，以千元面额为单位。

换入质押券代码：换入质押券代码

换入质押券数量：质押券数量，以千元面额为单位。

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出换券申报成功提示框

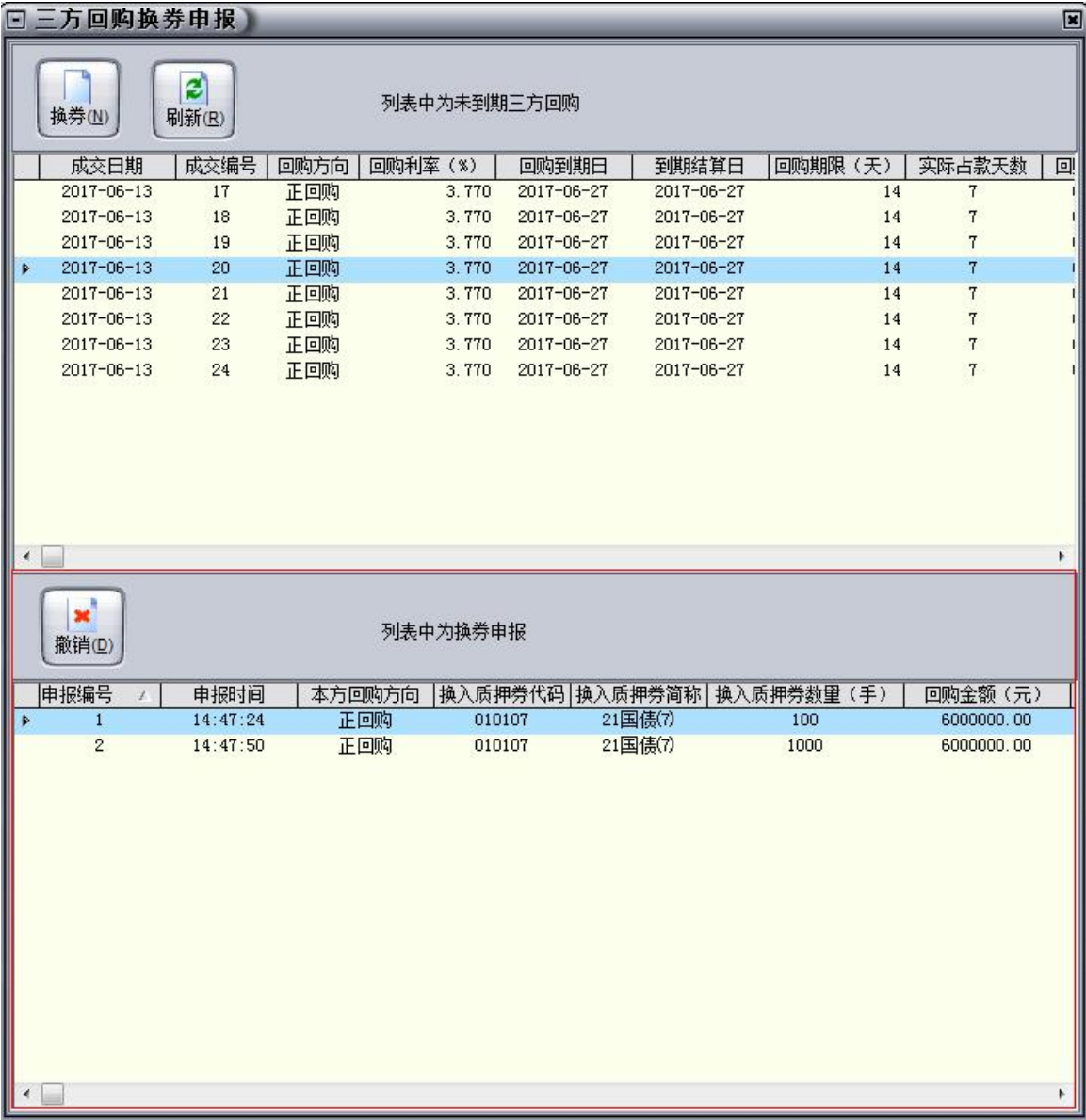


下面部分界面的换券申报信息列表中会出现该条三方回购合约的换券申报信息。

#### 4.25.2 三方回购换券申报撤销

在换券管理界面的下面红框显示部分为换券申报信息列表，用户在此管理换券申报信息。

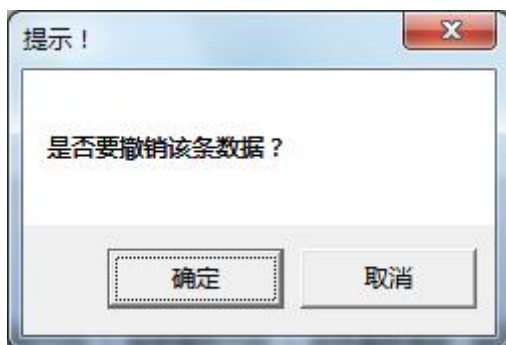




在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，换入质押券代码，换入质押券简称，换入质押券数量，回购金额，回购期限，回购利率，回购到期日，到期交收日，原始占款天数，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，逆回购证券账户，逆回购交易单元，篮子编码，申报状态，原成交日期，原成交编号，换出质押券代码，换出质押券简称，换出质押券数量。

在此界面上的操作有撤销换券申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔换券申报，选中换券申报信息列表中的某条希望撤销的换券申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

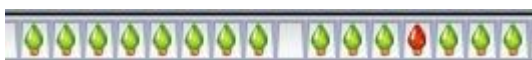


确定后，该条换券申报记录会从换券申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新未到期三方购信息列表、换券申报信息列表中的信息。

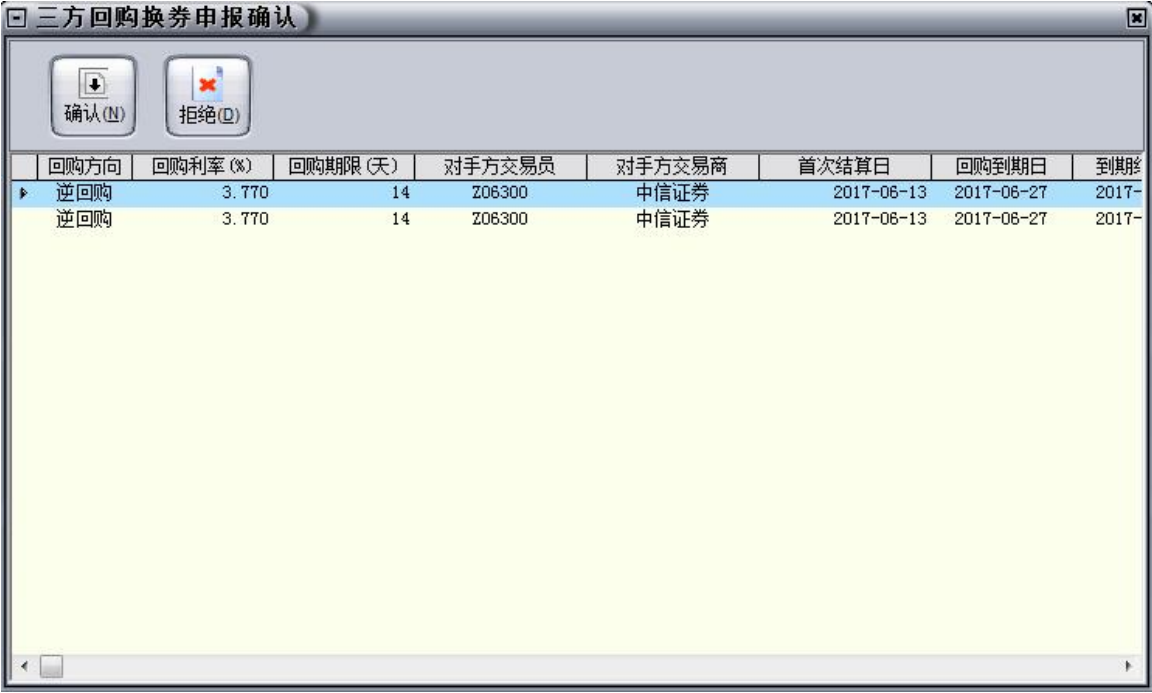
### 4.25.3 三方回购换券申报确认

交易员在收到以自己为对手方的换券申报后，换券申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第十二盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起换券申报请求。



点击该灯，弹出换券申报确认窗口





如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出三方回购换券申报确认窗口，显示换券的三方回购合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误。

说明：将光标移动到账户名称输入框内即显示完整信息

三方回购换券申报确认			
换出质押券代码	151000	换入质押券代码	161001
换出质押券数量	1000 手	换入质押券数量	1000 手
换出折扣率	11.730 %	换入折扣率	100.000 %
换出全价估值	99.365 元	换入全价估值	106.000 元
换出债券担保价值	877,094.85 元	换入担保价值	0.00 元
换出担保价值合计	110,000,000.00 元	换入担保价值合计	0.00 元

交易员信息	交易信息	
交易商	联合证券	证券账户
交易员代码	Z07300	账户名称
交易员名称	张三	交易单元
对手方交易商	中信证券	回购金额
对手方交易员代码	Z06300	成交编号
对手方交易员名称	张三	成交日期

质押券篮子	
<input type="checkbox"/>	B001-利率
<input type="checkbox"/>	B002-AAA(公)
<input checked="" type="checkbox"/>	B003-AA+(公)
<input type="checkbox"/>	B004-AA(公)
<input type="checkbox"/>	B005-AAA(私)
<input checked="" type="checkbox"/>	B006-AA+(私)
<input type="checkbox"/>	B007-AA(私)
<input checked="" type="checkbox"/>	B008-其他

回购期限	14 天
首次结算日	2017-06-20
回购到期日	2017-07-04
到期结算日	2017-07-04
实际占款天数	10 天

确认
关闭(C)

核对好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该换券申报请求会从三方回购换券申报确认窗口中消失。

#### 4.25.4 三方回购换券申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出换券申报拒绝窗口，显示三方回购合约信息

三方回购换券申报拒绝			
换出质押券代码	151000	换入质押券代码	161001
换出质押券数量	1000 手	换入质押券数量	1000 手
换出折扣率	11.730 %	换入折扣率	100.000 %
换出全价估值	99.365 元	换入全价估值	106.000 元
换出债券担保价值	877,094.85 元	换入担保价值	0.00 元
换出担保价值合计	110,000,000.00 元	换入担保价值合计	0.00 元

交易员信息	交易信息
交易商	联合证券
交易员代码	Z07300
交易员名称	张三
对手方交易商	中信证券
对手方交易员代码	Z06300
对手方交易员名称	张三

交易信息	
证券账户	B073250441
账户名称	073普通账户12€
交易单元	25044
回购金额	56,000,000.00 元
成交编号	15
成交日期	2017-06-20
回购期限	14 天
首次结算日	2017-06-20
回购到期日	2017-07-04
到期结算日	2017-07-04
实际占款天数	10 天

说明：将光标分别移动到账户名称输入框内即显示完整信息

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该换券申报请求会从三方回购换券申报确认窗口中消失。

#### 4.25.5 三方回购补券申报

点击三方回购—〉存续期管理—〉补券申报，进入三方回购补券管理界面，上面红框显示部分为未到期三方回购信息列表。



用户在此管理需要补券的三方回购信息。

在界面列表中显示的是未到期三方回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，回购金额，到期结算金额，回购利息，正回购债券交易参与者代码，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，正回购账户名称，正回购投资者名称，正回购产品名称，正回购杠杆运作限制，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，逆回购账户名称，质权人名称，违约后担保品是否由质权人处置，交收编号，篮子编码，质押券担保价值合计，到期状态。

在此界面上的操作有补券和刷新未到期三方回购信息。

补券：如果用户想对一笔未到期三方回购合约进行补券，选中列表中的某条希望补券的三方回购合约记录，点击“补券”按钮，弹出“三方回购补券申报新增”界面，显示三方回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。

三方回购补券申报新增

新券申报信息

质押券代码 \*

010107 21国债(7)

折扣率

0

%

质押券数量 \*

1000

手

担保价值

0.00

元

对手方交易商

联合证券

对手方交易员代码 \*

Z07301

对手方交易员名称

张三

质押券简称

21国债(7)

质押券所属篮子

B001

全价估值

100.280

元

原合计担保值

3,000,000,000.00

元

新合计担保值

0.00

元

担保值差额

0.00

元

补券申报日期

2017-06-30

质押券篮子

☒ B001-利率
 ☐ B002-AAA(公)
 ☐ B003-AA+(公)
 ☐ B004-AA(公)
 ☐ B005-AAA(私)
 ☐ B006-AA+(私)
 ☐ B007-AA(私)
 ☐ B008-其他

原券申报信息

交易商

中信证券

交易员代码

Z06301

交易员名称

张三

证券账户

D063250110

账户名称

063专用账户9

交易单元

25011

回购利率

5.623

%

回购金额

6,000,000.00

元

回购利息

12940.60

元

到期结算金额

6,012,940.60

元

回购期限

14

天

回购到期日

2017-07-04

原成交日期

2017-06-20

原成交编号

4

实际占款天数

14

天

确定(O)

关闭(C)

用户在此填写需要申报的信息，完成补券申报操作。

说明：1、所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框  
2、将光标分别移动到账户名称输入框内即显示完整信息

界面各输入项说明如下：

质押券代码：质押券代码

质押券数量：质押券数量，以千元面额为单位。

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出补券申报成功提示框



#### 4.25.6 三方回购提前终止申报

点击三方回购—〉存续期管理—〉提前终止申报，进入三方回购提前终止管理界面，上面红框显示部分为未到期三方回购信息列表。



三方回购提前终止申报

提前终止(N)

刷新(R)

列表中为未到期三方回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数(天)	回
2017-06-13	17	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	18	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	19	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	20	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	21	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	22	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	23	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	24	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6

撤销(D)

列表中为提前终止申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	原回购期限(天)	原回购利率(%)	原回购到期日	回购金额(元)	回
------	------	--------	----------	----------	--------	---------	---

用户在此管理需要提前终止的三方回购信息。

在界面列表中显示的是未到期三方回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，回购金额，到期结算金额，回购利息，正回购债券交易参与人代码，正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，正回购账户名称，正回购投资者名称，正回购产品名称，正回购杠杆运作限制，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购账户名称，质权人名称，违约后担保品是否由质权人处置，交收编号，篮子编码，质押券担保价值合计，到期状态，已操作类型。

在此界面上的操作有申报提前终止回购合约和刷新未到期质押式三方回购信息。



申报：如果用户想提前终止一笔未到期三方回购合约，选中列表中的某条希望提前终止的三方回购合约记录，点击“提前终止”按钮，弹出“三方回购提前终止申报新增”界面，显示三方回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。



三方回购提前终止申报新增

交易商	中信证券	质押券篮子	
交易员代码	Z06301	<input checked="" type="checkbox"/> B001-利率	
交易员名称	张三	<input type="checkbox"/> B002-AAA(公)	
三方回购专用账户	D063250110	<input type="checkbox"/> B003-AA+(公)	
三方回购专用账户名称	063专用账户9	<input checked="" type="checkbox"/> B004-AA(公)	
专用账户交易单元	25011	<input type="checkbox"/> B005-AAA(私)	
对手方交易商	联合证券	<input checked="" type="checkbox"/> B006-AA+(私)	
对手方交易员代码 *	Z07301	<input type="checkbox"/> B007-AA(私)	
对手方交易员名称	张三	<input checked="" type="checkbox"/> B008-其他	
提前终止回购利率 *	5 %	提前终止后回购期限	10 天
回购金额	9,000,000.00 元	原成交编号	16
提前终止回购利息	0.00 元	原成交日期	2017-06-20
到期结算金额	9,047,024.38 元	原回购到期日	2017-07-20
提前终止结算金额 *	0.00 元	提前终止日期	2017-06-30
		终止后实际占款天数	10 天
确定(O)		关闭(C)	

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

**说明：**所有用公式计算的事件触发必须焦点移开输入框

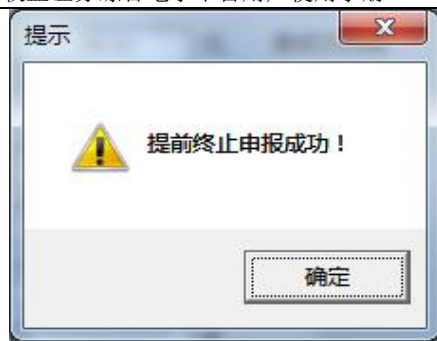
界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

提前终止回购利率：正回购方实际付给逆回购方的资金价格

**说明：**将光标分别移动到三方回购专用账户名称输入框内即可显示完整信息

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出提前终止申报成功提示框



该条三方回购合约记录即在未到期三方回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的提前终止申报信息列表中会出现该条三方回购合约的提前终止申报信息。

#### 4.25.7 三方回购提前终止申报撤销

在提前终止管理界面的下面红框显示部分为提前终止申报信息列表，用户在此管理提前终止申报信息。

三方回购提前终止申报

提前终止(N)

刷新(R)

列表中为未到期三方回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数(天)	回
2017-06-13	18	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	19	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	20	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	21	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	22	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6
2017-06-13	24	正回购	3.770	2017-06-27	2017-06-27	14	7	6

撤销(D)

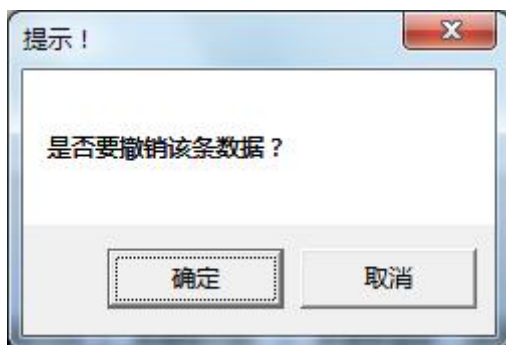
列表中为提前终止申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	原回购期限(天)	原回购利率(%)	原回购到期日	回购金额(元)
3	15:00:54	正回购	14	3.770	2017-06-27	6000000.00
4	15:00:59	正回购	14	3.770	2017-06-27	6000000.00

在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，原回购期限，原回购利率，原回购到期日，回购金额，提前终止回顾利息，提前终止回购期限，提前终止回购利率，实际占款天数，提前终止结算金额，提前终止日期，正回购债券交易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，原逆回购证券账户，原逆回购交易单元，原成交日期，原成交编号，篮子编码，申报状态。

在此界面上的操作有撤销提前终止申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔提前终止申报，选中提前终止申报信息列表中的某条希望撤销的提前终止申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



确定后，该条提前终止申报记录会从提前终止申报信息列表中消失。

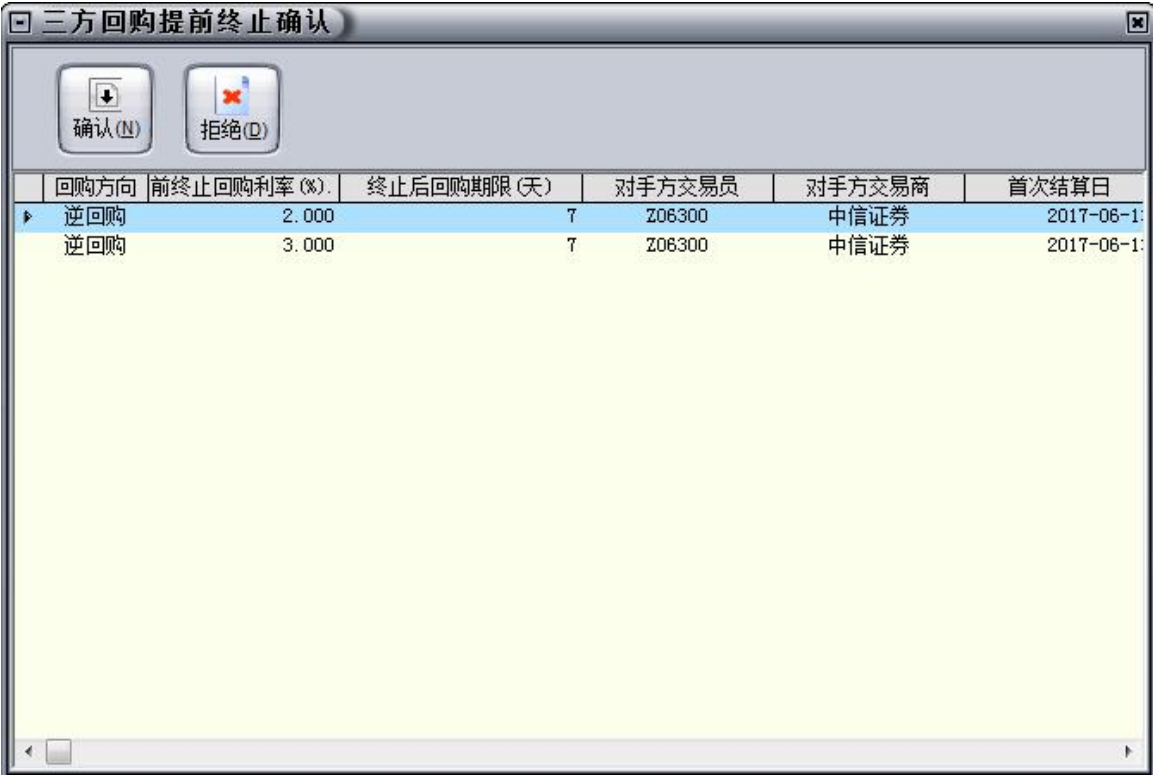
刷新：点击刷新未到期三方回购信息列表、提前终止申报信息列表中的信息。

#### 4.25.8 三方回购提前终止申报确认

交易员在收到以自己为对手方的提前终止申报后，提前终止申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第十一盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起提前终止申报请求。



点击该灯，弹出提前终止申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出三方回购提前终止申报确认窗口，显示提前终止的三方回购合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误。

三方回购提前终止申报确认	
交易员代码	Z07300
交易员名称	张三
证券账户	B073250441
账户名称	073普通账户12
交易单元 *	25044
对手方交易商	中信证券
对手方交易员代码	Z06300
对手方交易员名称	张三
投资者名称	申请人名称12
产品委托人	产品委托人9
杠杆运作限制	杠杆运作限制9
提前终止回购利率	2.300 %
回购金额	6,000,000.00 元
提前终止结算金额	6,001,134.25 元
成交编号	18
<div> <div>质押券篮子</div> <div> <input type="checkbox"/> B001-利率  <input checked="" type="checkbox"/> B002-AAA(公)  <input checked="" type="checkbox"/> B003-AA+(公)  <input type="checkbox"/> B004-AA(公)  <input type="checkbox"/> B005-AAA(私)  <input type="checkbox"/> B006-AA+(私)  <input checked="" type="checkbox"/> B007-AA(私)  <input checked="" type="checkbox"/> B008-其他 </div> </div>	
提前终止后回购期限	3 天
首次结算日	2017-06-27
回购到期日	2017-07-04
到期结算日	2017-07-04
提前终止日期	2017-06-30
终止后实际占款天数	3 天
成交日期	2017-06-27
<div> <div>确认</div> <div>关闭(C)</div> </div>	

说明：将光标分别移动到账户名称、投资者名称、产品委托人输入框内即可显示完整信息

查看无误后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示

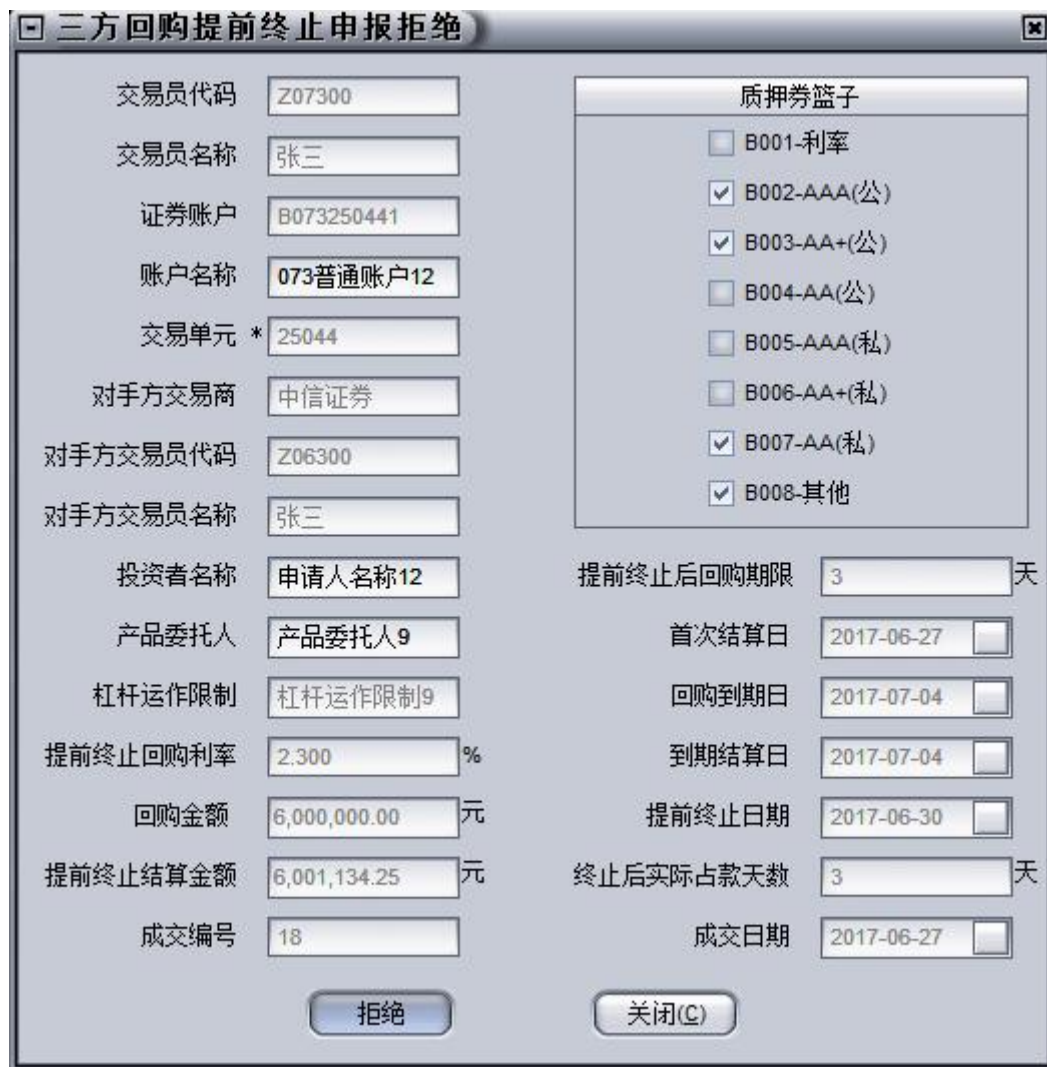


确定后，该提前终止申报请求会从是否回购提前终止申报确认窗口中消失。



### 4.25.9 三方回购提前终止申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出提前终止申报拒绝窗口，显示三方回购合约信息



三方回购提前终止申报拒绝窗口包含以下信息：

交易员代码	Z07300	<b>质押券篮子</b>	
交易员名称	张三	<input type="checkbox"/> B001-利率 <input checked="" type="checkbox"/> B002-AAA(公) <input checked="" type="checkbox"/> B003-AA+(公) <input type="checkbox"/> B004-AA(公) <input type="checkbox"/> B005-AAA(私) <input type="checkbox"/> B006-AA+(私) <input checked="" type="checkbox"/> B007-AA(私) <input checked="" type="checkbox"/> B008-其他	
证券账户	B073250441	提前终止后回购期限	3 天
账户名称	073普通账户12	首次结算日	2017-06-27
交易单元 *	25044	回购到期日	2017-07-04
对手方交易商	中信证券	到期结算日	2017-07-04
对手方交易员代码	Z06300	提前终止日期	2017-06-30
对手方交易员名称	张三	终止后实际占款天数	3 天
投资者名称	申请人名称12	成交日期	2017-06-27
产品委托人	产品委托人9		
杠杆运作限制	杠杆运作限制9		
提前终止回购利率	2.300 %		
回购金额	6,000,000.00 元		
提前终止结算金额	6,001,134.25 元		
成交编号	18		

窗口底部有两个按钮：拒绝、关闭(C)

说明：将光标分别移动到账户名称、投资者名称输入框内即可显示完整信息

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示





确定后，该提前终止申报请求会从三方回购提前终止申报确认窗口中消失。

## 4.26 三方回购违约处置

### 4.26.1 解除质押申报

点击三方回购—〉违约处置—〉解除质押申报，进入三方回购解除质押管理界面，上面红框显示部分为已违约三方回购信息列表。

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数(天)	回购金额
2017-06-13	1	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	2	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	3	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	4	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	5	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	6	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	7	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	8	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000

申报编号	申报时间	本方回购方向	回购期限(天)	回购利率(%)	回购到期日	实际占款天数(天)	回购金额(元)

用户在此管理需要解除质押的三方回购信息。

在界面列表中显示的是未到期三方回购合约信息。包含成交日期，成交编号，回购方向，回购利率，回购到期日，到期结算日，回购期限，实际占款天数，回购金额，到期结算金额，回购利息，正回购债券交易参与者代码，正回购债券交

易参与人简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，正回购账户名称，正回购投资者名称，正回购产品名称，正回购杠杆运作限制，逆回购债券交易参与人简称，逆回购交易员代码，逆回购账户名称，质权人名称，违约后担保品是否由质权人处置，交收编号，篮子编码，质押券担保价值合计，到期状态，已操作类型。

在此界面上的操作有解除已违约回购合约和刷新已违约三方回购信息。

解除：如果用户想解除一笔已违约三方回购合约，选中列表中的某条希望解除的三方回购合约记录，点击“解除质押券质押”按钮，弹出“三方回购解除质押申报新增”界面，显示三方回购合约的详细要素内容供用户确认及输入。



三方回购解除质押申报新增

交易商	中信证券	质押券篮子	
交易员代码	Z06300	<input checked="" type="checkbox"/> B001-利率	
交易员名称	张三	<input checked="" type="checkbox"/> B002-AAA(公)	
三方回购专用账户	D063250110	<input checked="" type="checkbox"/> B003-AA+(公)	
三方回购专用账户名称	063专用账户9	<input type="checkbox"/> B004-AA(公)	
专用账户交易单元 *	25011	<input type="checkbox"/> B005-AAA(私)	
对手方交易商	联合证券	<input type="checkbox"/> B006-AA+(私)	
对手方交易员代码 *	Z07300	<input type="checkbox"/> B007-AA(私)	
对手方交易员名称	张三	<input type="checkbox"/> B008-其他	
回购利率	3.580 %	回购期限	1 天
回购金额	1,100,000.00 元	原成交编号	1
回购利息	107.89 元	原成交日期	2017-06-13
到期结算金额	1,100,107.89 元	回购到期日	2017-06-14
		解除质押日	2017-06-30
		实际占款天数	1 天
<input type="button" value="确定(Q)"/> <input type="button" value="关闭(C)"/>			

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

界面各输入项说明如下：

对手方交易员代码：默认显示原始申报的对手方交易员代码

说明：将光标移动到账户名称输入框内即可显示完整信息

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出解除质押申报成功提示框



该条三方回购合约记录即在已违约三方回购合约信息列表中消失，在下面部分界面的解除质押申报信息列表中会出现该条三方回购合约的解除质押申报信息。

#### 4.26.2 解除质押申报撤销

在解除质押管理界面的下面红框显示部分为解除质押申报信息列表，用户在此管理解除质押申报信息。

三方回购解除质押申报

解除质押券质押(N) 刷新(R)

列表中为已违约三方回购

成交日期	成交编号	回购方向	回购利率(%)	回购到期日	到期结算日	回购期限(天)	实际占款天数(天)	回购金额
2017-06-13	1	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	3	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	4	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	6	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000
2017-06-13	7	正回购	3.580	2017-06-14	2017-06-14	1	7	110000

撤销(D)

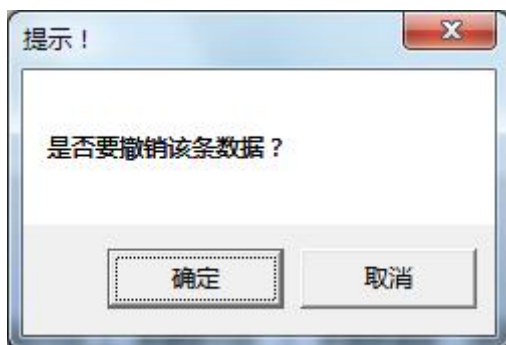
列表中为解除质押申报

申报编号	申报时间	本方回购方向	回购期限(天)	回购利率(%)	回购到期日	实际占款天数(天)	回购金额(元)
6	15:30:33	正回购	1	3.580	2017-06-14	7	1100000.00
7	15:30:36	正回购	1	3.580	2017-06-14	7	1100000.00
8	15:30:41	正回购	1	3.580	2017-06-14	7	1100000.00

在列表中包含申报编号，申报时间，本方回购方向，回购期限，回购利率，回购到期日，实际占款天数，回购金额，回购利息，正回购债券交易参与者简称，正回购交易员代码，正回购证券账户，正回购交易单元，逆回购债券交易参与者简称，逆回购交易员代码，原逆回购证券账户，原逆回购交易单元，原成交日期，原成交编号，篮子编码，申报状态。

在此界面上的操作有撤销解除质押申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔解除质押申报，选中解除质押申报信息列表中的某条希望撤销的解除质押申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



确定后，该条解除质押申报记录会从解除质押申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新已违约三方回购信息列表、解除质押申报信息列表中的信息。

### 4.26.3 解除质押申报确认

交易员在收到以自己为对手方的解除质押申报后，解除质押申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边第十四盏灯不停的闪动，表明有交易员向其发起解除质押申报请求。



点击该灯，弹出三方回购解除质押确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认解除质押”按钮，弹出三方回购解除质押申报确认窗口，显示解除质押的三方回购合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误。

三方回购解除质押申报确认	
交易商	联合证券
交易员代码	Z07300
交易员名称	张三
证券账户	B073250441
账户名称	073普通账户12
交易单元	25044
对手方交易商	中信证券
对手方交易员代码	Z06300
对手方交易员名称	张三
回购利率	8.880 %
回购金额	80,000,000.00 元
回购利息	19,463.01 元
到期结算金额	80,019,463.01 元
成交编号	2
<div> <div>质押券篮子</div> <div> <input checked="" type="checkbox"/> B001-利率  <input checked="" type="checkbox"/> B002-AAA(公)  <input checked="" type="checkbox"/> B003-AA+(公)  <input type="checkbox"/> B004-AA(公)  <input type="checkbox"/> B005-AAA(私)  <input type="checkbox"/> B006-AA+(私)  <input type="checkbox"/> B007-AA(私)  <input type="checkbox"/> B008-其他 </div> </div>	
回购期限	1 天
首次结算日	2017-06-27
回购到期日	2017-06-28
到期结算日	2017-06-28
实际占款天数	3 天
成交日期	2017-06-27
<div> <div>确认</div> <div>关闭(C)</div> </div>	

说明：将光标移动到账户名称输入框内即可显示完整信息

确认无误后，点击“确认”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确认后，该解除质押申报请求会从三方回购解除质押申报确认窗口中消失。

#### 4.26.4 解除质押申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”



按钮，弹出解除质押申报拒绝窗口，显示三方回购合约信息

三方回购解除质押申报拒绝	
交易商	联合证券
交易员代码	Z07300
交易员名称	张三
证券账户	B073250441
账户名称	073普通账户12
交易单元	25044
对手方交易商	中信证券
对手方交易员代码	Z06300
对手方交易员名称	张三
回购利率	8.880 %
回购金额	80,000,000.00 元
回购利息	19,463.01 元
到期结算金额	80,019,463.01 元
成交编号	2
<div> <div>质押券篮子</div> <div> <input checked="" type="checkbox"/> B001-利率  <input checked="" type="checkbox"/> B002-AAA(公)  <input checked="" type="checkbox"/> B003-AA+(公)  <input type="checkbox"/> B004-AA(公)  <input type="checkbox"/> B005-AAA(私)  <input type="checkbox"/> B006-AA+(私)  <input type="checkbox"/> B007-AA(私)  <input type="checkbox"/> B008-其他 </div> </div>	
回购期限	1 天
首次结算日	2017-06-27
回购到期日	2017-06-28
到期结算日	2017-06-28
实际占款天数	3 天
成交日期	2017-06-27
<div>拒绝</div> <div>关闭(C)</div>	

说明：将光标移动到账户名称输入框内即可显示完整信息

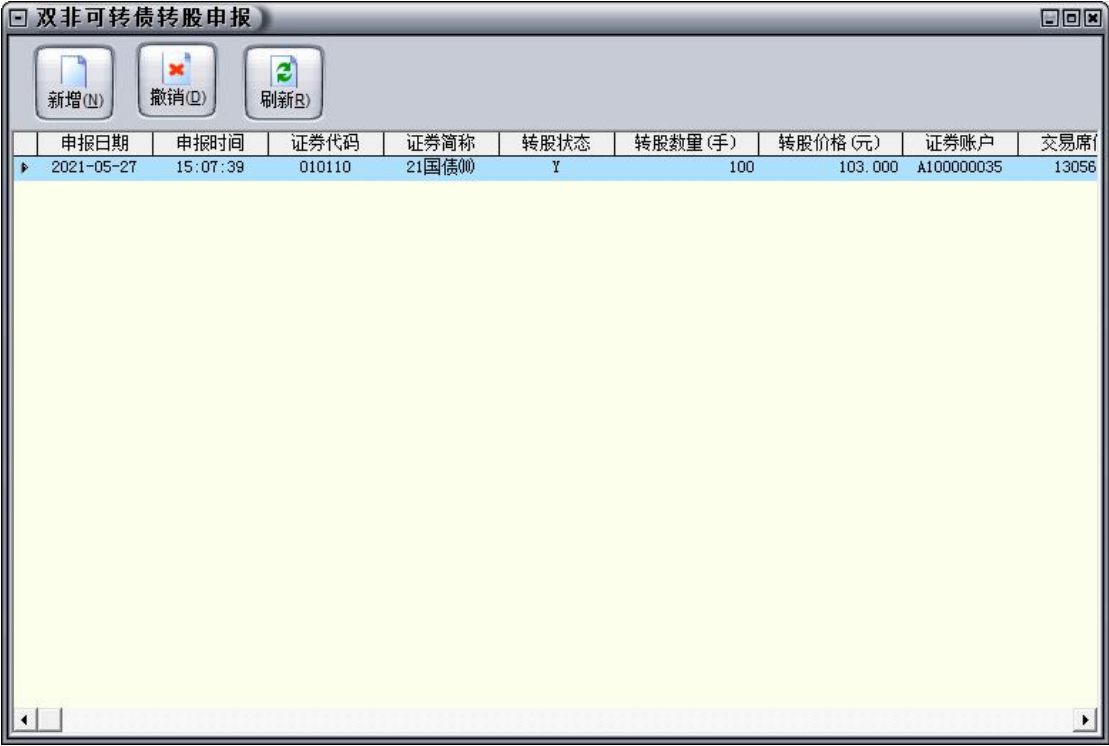
点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该解除质押申报请求会从三方回购解除质押申报确认窗口中消失。

## 4.27 双非可转债转股

点击交易一〉现券交易一〉双非可转债转股申报，进入双非可转债转股申报界面。



- 用户在此管理双非可转债转股申报的相关信息。
- 在列表中列出申报的双非可转债转股申报信息，包含申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、转股状态、转股数量、转股价格、证券账户、交易交易单元、交易员代码、申报编号和申报状态。
- 在此界面上的操作有新增双非可转债转股申报信息、撤销双非可转债转股申报信息和刷新申报信息。
- 新增：点击弹出双非可转债转股申报录入对话框

用户在此申报需要申报的债转股信息，完成申报操作。

界面各输入项说明如下：

申报类型：交易端只能申报冻结。

证券账户：中国结算是 10 位账号

证券代码：

交易交易单元：账户对应的交易交易单元。

转股数量：转股的现券数量，以千元面额为单位

转股状态：自动匹配，无需用户输入

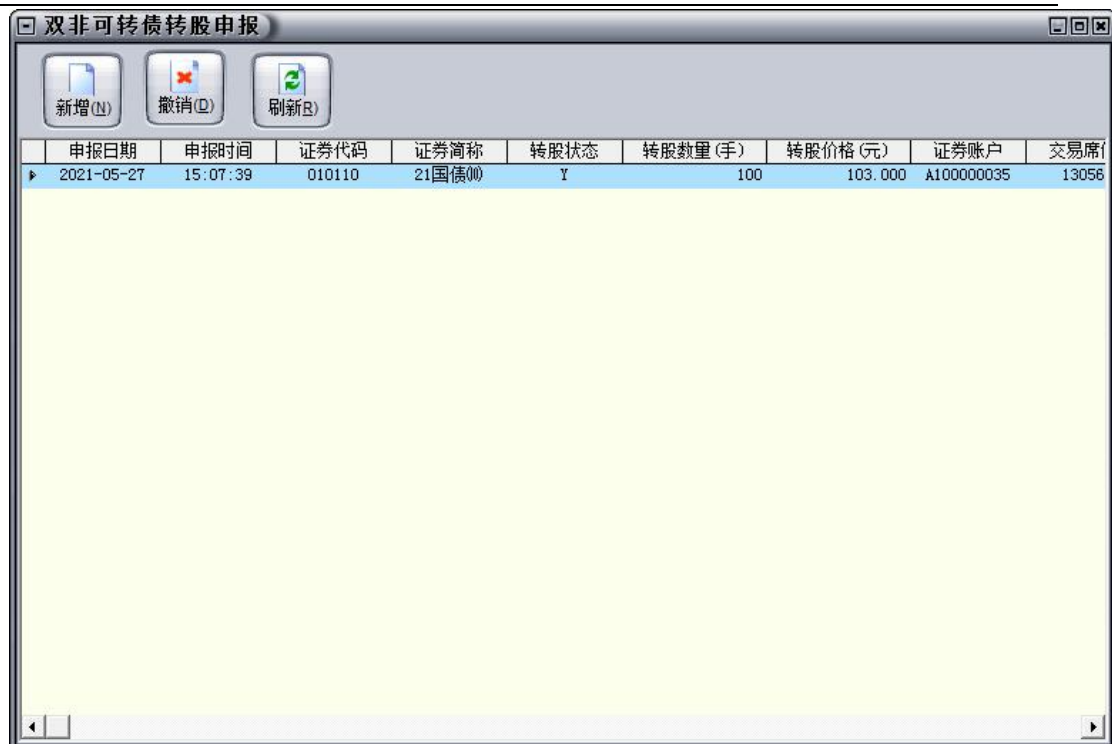
转股价格：自动匹配，无需用户输入

交易员代码：自动匹配，无需用户输入

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即债转股申报录入成功，弹出提示框



该条债转股申报信息即出现在债转股申报界面下方的信息列表中。



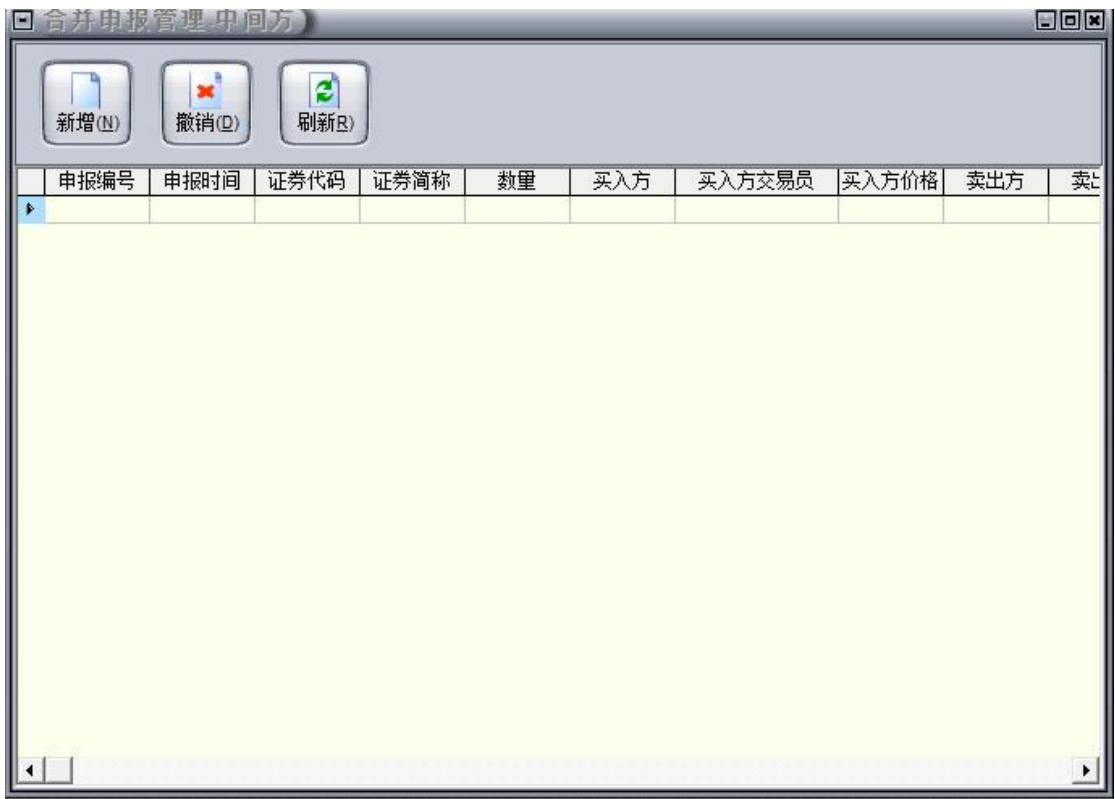
撤销：先在双非可转债申报界面中选择需要撤销的申报信息，点击撤销按钮，即取消该条记录，仅原转股申报的操作交易员可以撤单。

刷新：点击刷新双非可转债转股申报信息列表中的信息。

## 4.28 合并申报交易

### 4.28.1 合并申报交易

点击交易一〉现券交易一〉合并申报交易，进入合并申报申报界面。



用户在此管理合并申报申报的相关信息。

在列表中列出申报的合并申报申报信息，包含申报编号、申报时间、证券代码、证券简称、数量、买入方、买入方交易员、买入方价格、卖出方、卖出方交易员、卖出方价格、价格类型、结算速度、结算方式、结算日期。

在此界面上的操作有新增合并申报信息、撤销合并申报信息和刷新申报信息。

新增：点击弹出合并申报录入对话框

用户在此申报需要申报的债转股信息，完成申报操作。

界面各输入项说明如下：

证券代码：证券代码。

证券账户：证券账户

交易单元：交易单元

成交数量：现券数量，以千元面额为单位

买入价格：自行输入，以元为单位

卖出价格：自行输入，以元为单位

结算方式：结算场所为中国结算，若为担保券则可选择净额结算或 RTGS，若为非担保券则为 RTGS；

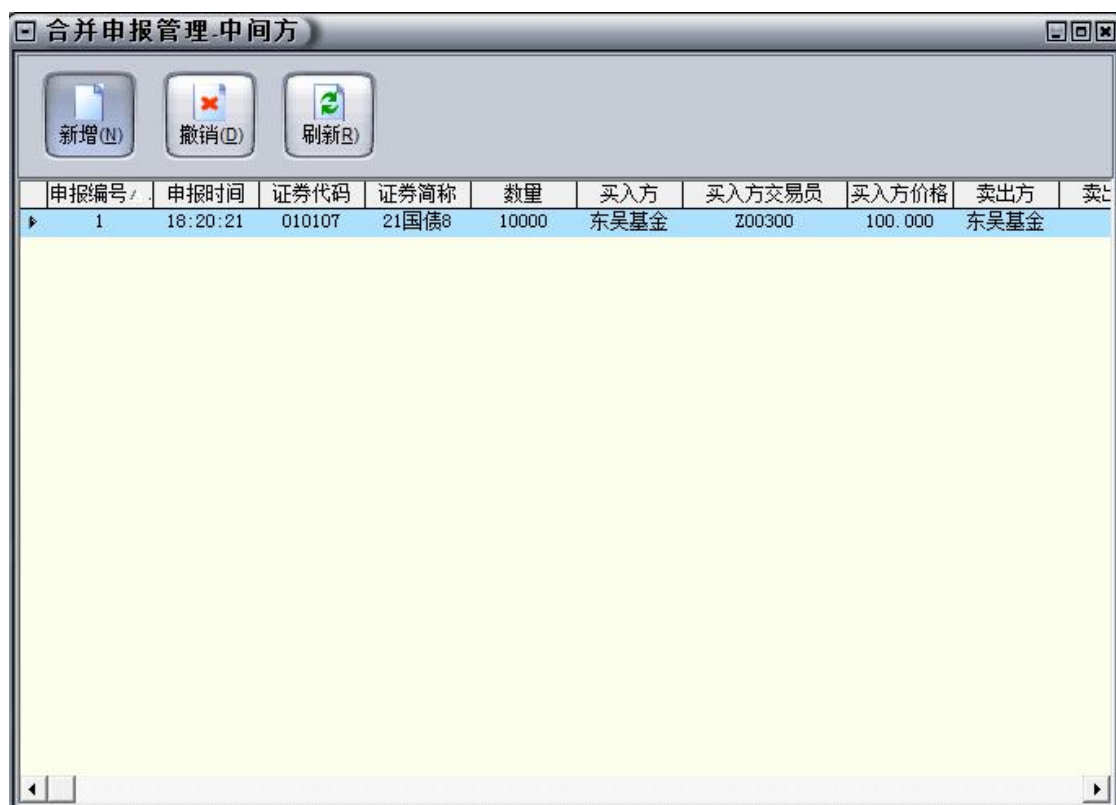
买入方交易员：交易员代码

卖出方交易员：交易员代码

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即合并申报录入成功，弹出提示框



该条合并申报信息即出现在合并申报申报界面下方的信息列表中。



**撤销:** 先在合并申报申报界面中选择需要撤销的的申报信息, 点击撤销按钮, 即取消该条记录, 仅原合并申报的操作交易员可以撤单。

**刷新:** 点击刷新合并申报申报信息列表中的信息。

## 4.28.2 合并申报确认

交易员在收到以自己为对手方的配对交易后, 合并申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态, 系统状态栏上右手边倒数第二盏灯不停的闪动, 表明有交易员向其发起配对交易请求。





点击该灯，弹出配对交易确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出合并申报确认窗口，显示合并申报信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改证券账户。



界面各输入项说明如下：

证券账户：证券账户

交易单元：证券帐户指定交易交易单元

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该配对交易请求会从合并申报确认窗口中消失。

## 4.29 CDS 合约协商成交申报

### 4.29.1 CDS 合约协商成交申报

点击交易—>信用保护工具（合约）—>协商成交申报，进入 CDS 协商成交申报管理界面。



用户在此管理需要成交申报的信息。

在列表中列出申报的成交申报信息，包含申报编号、申报时间、对手方交易员、对手方债券交易参与人、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有新增协商成交申报信息、撤销协商成交申报信息和刷新协商成交申报信息。

新增：点击弹出协商成交申报对话框

**CDS协商成交申报**

申明 | 交易方基本信息 | 基本条款 | 信用事件 | 结算信息 | 申明承诺定义文件

☒ 本方买入 ☐ 本方卖出

债券交易参与人  对手方债券交易参与人

交易员代码  对手方交易员代码

交易员名称  对手方交易员名称

证券账户  证券账户名称

交易单元  开户行

银行账户名称  大额支付系统行号

银行账户

起始日  到期日  保护期限(年)

名义本金(万元)  保护费支付方式  保护费支付途径

年化保护费率(bps)  计息基准  计息天数调整

首次保护费支付日

确定(O) 关闭(C)

用户在此申报需要协商成交申报的信息，完成协商成交申报操作。

界面各输入项说明如下：

债券交易参与人：自动显示

交易员代码：自动显示

交易员名称：自动显示

对手方债券交易参与人：

交易员代码：

交易员名称：

证券账户：

证券账户名称：

交易单元：

开户行：

银行账户名称：

大额支付系统行号：

银行账户：

起始日：

到期日：

保护期（年）：

名义本金（万元）：

保护费支付方式：

保护 费支付途径：

年化保护费率（bps）：

计息基准：

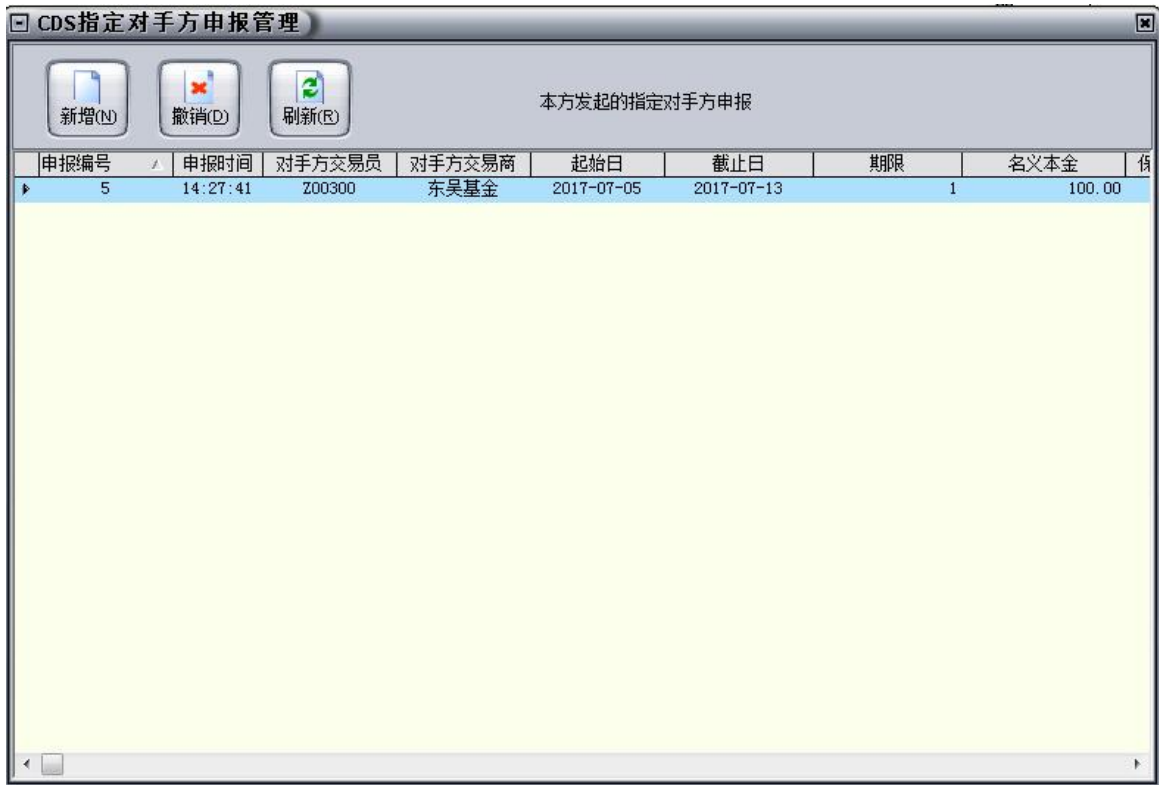
计息天数调整：

首次保护费支付日：

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即协商成交申报录入成功，弹出提示框



该条协商成交申报信息即出现在协商成交申报界面下方的信息列表中。



#### 4.29.2 CDS 合约协商成交申报撤销

如果用户想撤销该笔申报，选中协商成交申报信息列表中的某条希望撤销的协商成交申报信息，点击撤销，弹出撤销提示框

**CDS协商成交申报**

申明 | 交易方基本信息 | 基本条款 | 信用事件 | 结算信息 | 申明承诺定义文件

☒ 本方买入 ☐ 本方卖出

债券交易参与人  对手方债券交易参与人

交易员代码  对手方交易员代码

交易员名称  对手方交易员名称

证券账户  证券账户名称

交易单元  开户行

银行账户名称  大额支付系统行号

银行账户

起始日  到期日  保护期限(年)

名义本金(万元)  保护费支付方式  保护费支付途径

年化保护费率(bps)  计息基准  计息天数调整

首次保护费支付日

点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条协商成交申报信息即在协商成交申报信息列表中消失。

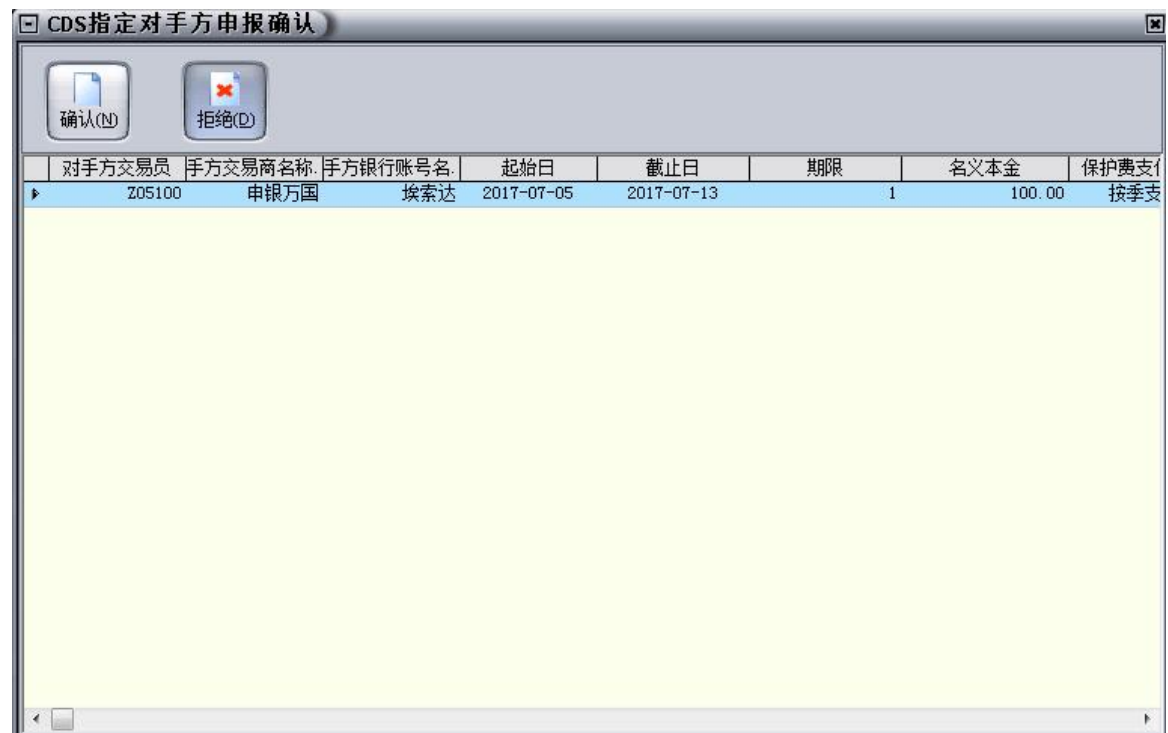
刷新：点击刷新协商成交申报信息列表中的信息。

### 4.29.3 CDS 合约协商成交申报确认

交易员申报后，对手方申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果对手方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边对应的提示灯不停的闪动，表明有交易员向其发起协商成交申报请求。



点击该灯，弹出成交申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击确认，弹出CDS 协商成交申报确认窗口，对手方可以查看申报信息是否无误。

**CDS指定对手方申报确认**

申明 | 交易方基本信息 | **基本条款** | 信用事件 | 结算信息 | 申明承诺定义文件

☒ 本方买入
 ☐ 本方卖出

交易商	中信证券	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z06300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户		对手方证券账户	B063250110
交易单元		对手方交易单元	25011
账户名称		对手方账户名称	要替换
银行账户名称		对手方银行账户名称	埃索达
银行账户		对手方银行账户	4
开户行		对手方开户行	vsdf
大额支付系统行号		对手方大额支付系统行号	埃索达

起始日	2017-07-04	到期日	2017-07-12	保护期限(年)	1
名义本金(万元)	100.00	保护费支付方式	按季支付	保护费用支付途径	双方自行协商支付
保护费率(bps)	6	计息基准	实际/365	计息天数调整	按实际天数调整

点击确定，提交至系统校验通过后弹出交易成功提示



#### 4.29.4 CDS 合约协商成交申报拒绝

如果用户想拒绝该笔申报，在协商成交申报确认窗口点击拒绝，弹出协商成交申报拒绝提示框

**CDS指定对手方申报拒绝**

申明 交易方基本信息 基本条款 信用事件 结算信息 申明承诺定义文件

☒ 本方买入 ☐ 本方卖出

交易商	中信证券	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z06300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户		对手方证券账户	B063250110
交易单元		对手方交易单元	25011
账户名称		对手方账户名称	要替换
银行账户名称		对手方银行账户名称	埃索达
银行账户		对手方银行账户	4
开户行		对手方开户行	vsdf
大额支付系统行号		对手方大额支付系统行号	埃索达

起始日	2017-07-04	到期日	2017-07-12	保护期限(年)	1
名义本金(万元)	100.00	保护费支付方式	按季支付	保护费用支付途径	双方自行协商支付
保护费率(bps)	6	计息基准	实际/365	计息天数调整	按实际天数调整

拒绝 关闭(C)

点击拒绝，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该协商成交申报请求会从协商成交申报确认窗口中消失。

## 4.30 CDS 合约提前终止申报

### 4.30.1 CDS 合约提前终止申报

点击交易—信用保护（合约）—提前终止申报，进入 CDS 提前终止管

理界面，上面红框显示部分为 CDS 合约信息列表。

CDS提前终止申报

申报(N)

刷新(R)

列表中为CDS合约信息

原成交日期	原成交编号	买方交易员	买方交易员名称	方债券交易参与	买方证券账户	买方交易单元号	方银行
2020-08-04	1	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	
2020-08-04	2	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	
2020-08-04	15	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	000011
2020-08-04	64	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	66	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	68	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	70	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	73	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	75	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	77	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	79	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	82	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
2020-08-04	84	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	1
2020-08-04	18	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	
----	--	-----	----	-----	-----	-----	

撤销(D)

列表中为提前终止申报

申报编号	申报时间	对手方交易员	手方债券交易参与	银行账号名称	银行账号	开户行	大额支付系
------	------	--------	----------	--------	------	-----	-------

用户在此管理需要提前终止的 CDS 合约。

在列表中包含原成交日期，原成交编号，买方交易员，买方债券交易参与人，卖方交易员，卖方债券交易参与人，起始日，截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有申报提前终止合约和刷新 CDS 合约信息。

申报：如果用户想提前终止一笔 CDS 合约，选中列表中的某条希望提前终止的合约记录，点击“申报”按钮，弹出“CDS 提前终止申报”界面，显示 CDS 合约的详细要素内容供用户确认及输入。

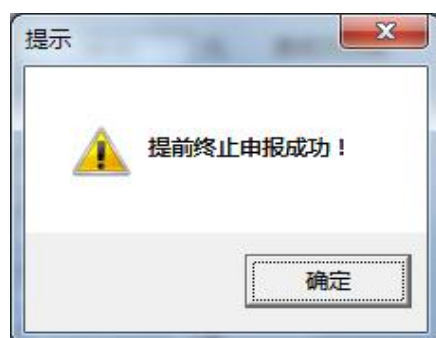
CDS提前终止申报			
债券交易参与人	华夏基金	对手方债券交易参与人	国联安
交易员代码	Z03900	对手方交易员代码	Z03800
交易员名称	范义	对手方交易员名称	王元
证券账户	A039246740	本方交易单元	24674
证券账户名称	1	开户行	1
银行账户名称	1	大额支付系统行号	1
银行账户	1		
起始日	2020-08-04	到期日	2020-08-06
名义本金(万元)	10,000,000,000	保护费支付方式	按季支付
年化保护费率(bps)	1	计息基准	实际/365
参考实体	123050	参考实体主体评级	AAA
保护期限(年)	1	结算方式	实物结算
		计息天数调整	按实际天数调整
首次保护费支付日	2020-08-04		
提前终止支付日	2022-06-29	支付途径	双方自行协商
提前终止结算金额(万元)		支付方向	买方向卖方
确定(O)		关闭(C)	

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

界面各输入项说明如下：

提前终止结算金额：提前终止双方约定的结算金额

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出提前终止申报成功提示框



该条合约记录即在 CDS 合约信息列表中消失，在下面部分界面的提前终止申报信息列表中会出现该条 CDS 合约的提前终止申报信息。

### 4.30.2 CDS 合约提前终止申报撤销

在提前终止管理界面的下面红框显示部分为提前终止申报信息列表，用户在此管理提前终止申报信息。

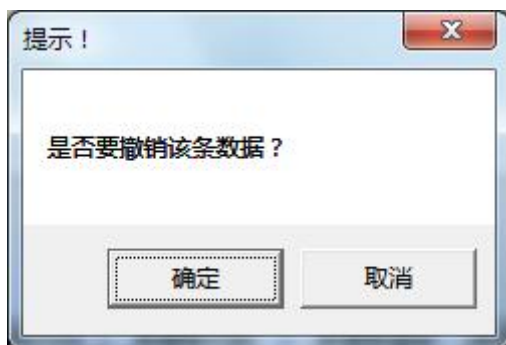


在列表中包含申报编号、申报时间、对手方交易员、对手方债券交易参与人、银行账户名称、银行账户、开户行，起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有撤销提前终止申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔提前终止申报，选中提前终止申报信息列表中的某条希望撤销的提前终止申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框





点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



确定后，该条提前终止申报记录会从提前终止申报信息列表中消失。

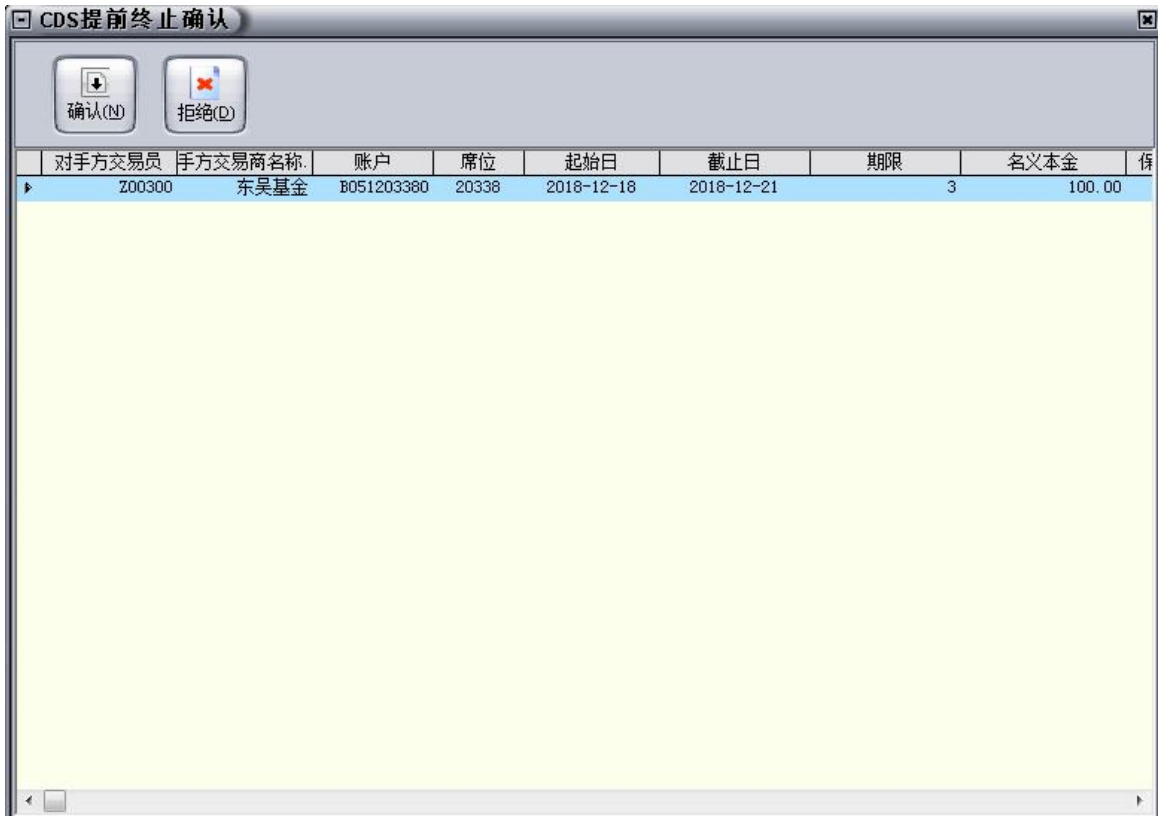
刷新：点击刷新 CDS 合约信息列表、提前终止申报信息列表中的信息。

### 4.30.3 CDS 合约提前终止申报确认

交易员在收到以自己为对手方的提前终止申报后，提前终止申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边提示灯不停的闪动，表明有交易员向其发起提前终止申报请求。

点击该灯，弹出提前终止申报确认窗口





如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出提前终止申报确认窗口，显示提前终止的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

CDS提前终止申报确认			
交易商	东吴基金	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z00300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户	B003244150	本方交易单元	24415
账户名称	乙方证券账号名称	开户行	卖方开户行
银行账户名称	卖方银行账号名称	大额支付系统行号	BB9876543210
银行账户	9876543210		
起始日	2018-12-18	到期日	2018-12-21
名义本金(万元)	100	保护费支付方式	按季支付
年度保护费率(bps)	333	计息基准	实际/实际
参考实体	参考实体	参考实体主体评级	A,A,A
提前终止支付日	2017-07-04	支付途径	双方自行协商支付
提前终止结算金额(万元)	100.00	支付方向	买方向卖方
确认		关闭(C)	

点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该提前终止申报请求会从 CDS 提前终止申报确认窗口中消失。

#### 4.30.4 CDS 合约提前终止申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出提前终止申报拒绝窗口，显示 CDS 合约信息

CDS提前终止申报拒绝			
交易商	东吴基金	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z00300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户	B003244150	本方交易单元	24415
账户名称	乙方证券账号名称	开户行	卖方开户行
银行账户名称	卖方银行账号名称	大额支付系统行号	BB9876543210
银行账户	9876543210		
起始日	2018-12-18	到期日	2018-12-21
名义本金(万元)	100	保护费支付方式	按季支付
年度保护费率(bps)	333	计息基准	实际/实际
参考实体	参考实体	参考实体主体评级	AAA
提前终止支付日	2017-07-04	支付途径	双方自行协商支付
提前终止结算金额(万元)	100.00	支付方向	买方向卖方
<div>拒绝</div> <div>关闭(C)</div>			

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该提前终止申报请求会从 CDS 提前终止申报确认窗口中消失。

## 4.31 CDS 合约信用事件申报

### 4.31.1 CDS 合约信用事件申报

点击交易一〉信用保护（合约）一〉信用事件申报，进入 CDS 信用事件管理界面，上面红框显示部分为 CDS 合约信息列表。



用户在此管理需要信用事件的 CDS 合约。

在列表中包含原成交日期，原成交编号，买方交易员，买方债券交易参与人，卖方交易员，卖方债券交易参与人，起始日，截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有申报信用事件合约和刷新 CDS 合约信息。

申报：如果用户想信用事件一笔 CDS 合约，选中列表中的某条希望信用事件的合约记录，点击“申报”按钮，弹出“CDS 信用事件申报”界面，显示 CDS 合约的详细要素内容供用户确认及输入。

CDS信用事件申报			
基本条款 信用事件			
债券交易参与人	华夏基金	对手方债券交易参与人	国联安
交易员代码	Z03900	对手方交易员代码	Z03800
交易员名称	范义	对手方交易员名称	王元
证券账户	A039246740	本方交易单元	24674
证券账户名称	1	开户行	1
银行账户名称	1	大额支付系统行号	1
银行账户	1		
起始日	2020-08-04	到期日	2020-08-06
名义本金(万元)	10,000,000,000	保护费支付方式	按季支付
年化保护费率(bps)	1	计息基准	实际/365
参考实体	123050	参考实体主体评级	AAA
首次保护费支付日	2020-08-04	保护期限(年)	1
		结算方式	实物结算
		计息天数调整	按实际天数调整
信用事件支付日	2022-06-29	信用事件结算金额(元)	
支付途径	双方自行协商		
确定(Q)		关闭(C)	

CDS信用事件申报

基本条款

信用事件

可交付债务种类

☐ 付款义务

☐ 借贷款项

☐ 债券

☐ 贷款

☐ 公司债

☐ 可转债

☐ 仅为参考债务

☐ 资产支持证券

☐ 企业债

可交付债务特征

☐ 一般债务

☐ 次级债务

☐ 证券交易所挂牌流通

☐ 本币

☐ 外币

☐ 无扣减债务

☐ 可转让贷款

☐ 转让受限贷款

☐ 最长待偿期10年

☐ 其他

可交付债务的应计未计利息

不计入

支付债务面值合计(万元)

证券代码

新增

数量

删除

结算债券

债券代码	债券简称	数量

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

界面各输入项说明如下：

信用事件结算金额：信用事件双方约定的结算金额

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功，弹出信用事件申报成功提示框

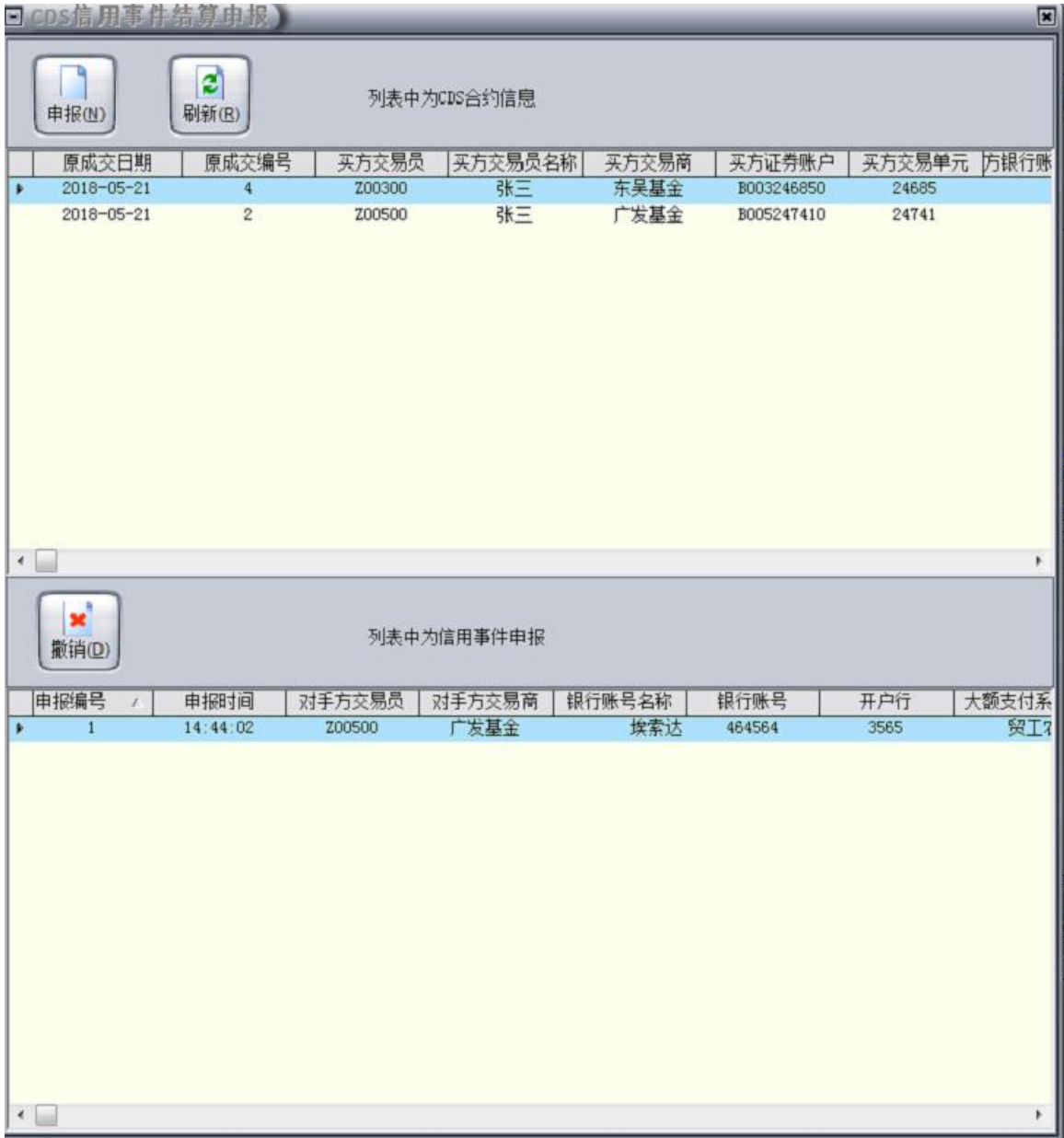


该条合约记录即在 CDS 合约信息列表中消失，在下面部分界面的信用事件申报信息列表中会出现该条 CDS 合约的信用事件申报信息。



4.31.2 CDS 合约信用事件申报撤销

在信用事件管理界面的下面红框显示部分为信用事件申报信息列表，用户在此管理信用事件申报信息。



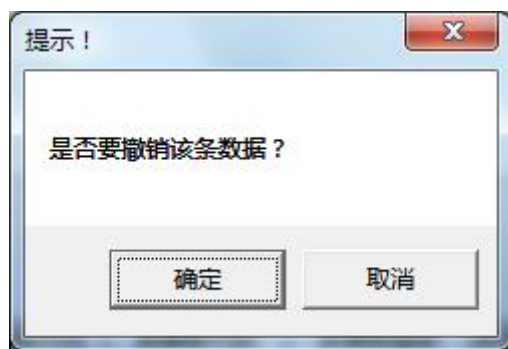
在列表中包含申报编号、申报时间、对手方交易员、对手方债券交易参与人、银行账户名称、银行账户、开户行，起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有撤销信用事件申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔信用事件申报，选中信用事件申报信息列表中的



某条希望撤销的信用事件申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



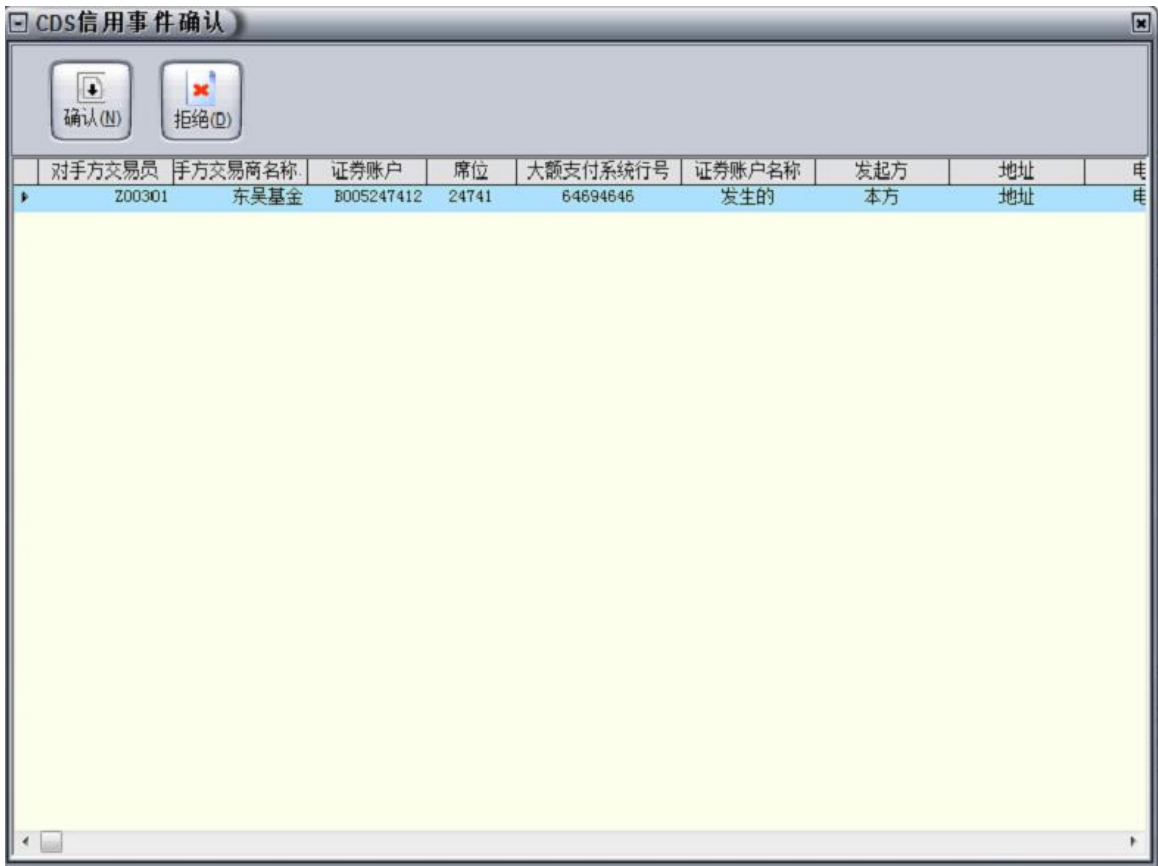
确定后，该条信用事件申报记录会从信用事件申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新 CDS 合约信息列表、信用事件申报信息列表中的信息。

### 4.31.3 CDS 合约信用事件申报确认

交易员在收到以自己为对手方的信用事件申报后，信用事件申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边提示灯不停的闪动，表明有交易员向其发起信用事件申报请求。

点击该灯，弹出信用事件申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出信用事件申报确认窗口，显示信用事件的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

CDS信用事件申报确认			
基本条款		信用事件	
交易商	东吴基金	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z00300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户	B003244150	本方交易单元	24415
账户名称	甲方证券账号名称	开户行	卖方开户行
银行账户名称	卖方银行账号名称	大额支付系统行号	AA1234567890
银行账户	1234567890		
起始日	2018-12-18	到期日	2018-12-21
名义本金(万元)	100	保护费支付方式	按季支付
年化保护费率(bps)	333	计息基准	实际/365
参考实体	参考实体	参考主体评级	AAA
保护期限(年)	3	结算方式	实物结算
		计息天数调整	按名义天数调整
信用事件支付日	2017-07-04	信用事件结算金额(元)	10.00
支付途径	双方自行协商支付		
确定(O)		关闭(C)	

点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该信用事件申报请求会从 CDS 信用事件申报确认窗口中消失。

#### 4.31.4 CDS 合约信用事件申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出信用事件申报拒绝窗口，显示 CDS 合约信息

CDS信用事件申报拒绝			
基本条款		信用事件	
交易商	东吴基金	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z00300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户	B003244150	本方交易单元	24415
账户名称	甲方证券账号名称	开户行	卖方开户行
银行账户名称	卖方银行账号名称	大额支付系统行号	AA1234567890
银行账户	1234567890		
起始日	2018-12-18	到期日	2018-12-21
名义本金(万元)	100	保护费支付方式	按季支付
年化保护费率(bps)	333	计息基准	实际/365
参考实体	参考实体	参考实体主体评级	AAA
保护期限(年)	3	结算方式	实物结算
		计息天数调整	按名义天数调整
信用事件支付日	2017-07-04	信用事件结算金额(元)	10.00
支付途径	双方自行协商支付		
确定(O)		关闭(C)	

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该信用事件申报请求会从 CDS 信用事件申报确认窗口中消失。

## 4.32 CDS 合约合约了结申报

### 4.32.1 CDS 合约了结申报

点击交易一〉信用保护（合约）一〉合约了结申报，进入 CDS 合约了结管理界面，上面红框显示部分为 CDS 合约信息列表。

申报(N)

刷新(R)

列表中为CDS合约信息

	原成交日期	原成交编号	买方交易员	买方交易员名称	卖方债券交易参与	买方证券账户	买方交易单元号	方银行
	2020-08-04	1	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	
	2020-08-04	2	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	
	2020-08-04	15	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	100011
	2020-08-04	64	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	66	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	68	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	70	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	73	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	75	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	77	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	79	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	82	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	
	2020-08-04	84	Z03800	王元	国联安	D899905017	25213	1
	2020-08-04	18	Z03900	范义	华夏基金	A039246740	24674	
	----	--	-----	-----	-----	-----	-----	

撤销(D)

列表中为合约了结申报

	申报编号	申报时间	对手方交易员	手方债券交易参与	银行账号名称	银行账号	开户行	大额支付系

用户在此管理需要合约了结的 CDS 合约。

在列表中包含原成交日期，原成交编号，买方交易员，买方债券交易参与人，卖方交易员，卖方债券交易参与人，起始日，截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有申报合约了结合约和刷新 CDS 合约信息。

申报：如果用户想合约了结一笔 CDS 合约，选中列表中的某条希望合约了结的合约记录，点击“申报”按钮，弹出“CDS 合约了结申报”界面，显示 CDS 合约的详细要素内容供用户确认及输入。

CDS合约了结申报			
债券交易参与人	华夏基金	对手方债券交易参与人	国联安
交易员代码	Z03900	对手方交易员代码	Z03800
交易员名称	范义	对手方交易员名称	王元
证券账户	A039246740	本方交易单元号	24674
证券账户名称	1	开户行	1
银行账户名称	1	大额支付系统行号	1
银行账户	1		
起始日	2020-08-04	到期日	2020-08-06
名义本金(万元)	10,000,000,000	保护费支付方式	按季支付
年化保护费率(bps)	1	计息基准	实际/365
参考实体	123050	参考实体主体评级	AAA
首次保护费支付日	2020-08-04	保护期限(年)	1
		结算方式	实物结算
		计息天数调整	按实际天数调整
合约了结日	2022-06-29		
<div>确定(O)</div> <div>关闭(C)</div>			

用户在此填写需要申报的信息，完成解除质押申报操作。

界面各输入项说明如下：

合约了结结算金额：合约了结双方约定的结算金额

填写好相应数据后，点击“确定”按钮，提交至后台审核无误，即申报成功。

该条合约记录即在 CDS 合约信息列表中消失，在下面部分界面的合约了结申报信息列表中会出现该条 CDS 合约的合约了结申报信息。

#### 4.32.2 CDS 合约了结申报撤销

在合约了结管理界面的下面红框显示部分为合约了结申报信息列表，用户在此管理合约了结申报信息。



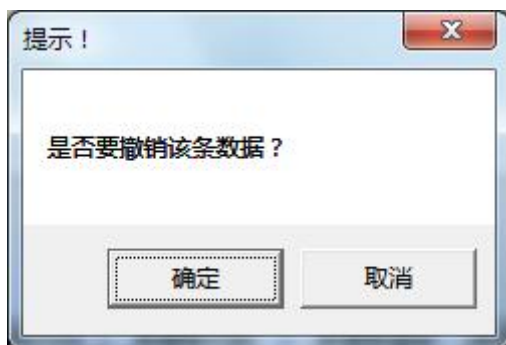


在列表中包含申报编号、申报时间、对手方交易员、对手方债券交易参与人、银行账户名称、银行账户、开户行，起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、补充约定。

在此界面上的操作有撤销合约了结申报信息。

撤销：如果用户想撤销一笔合约了结申报，选中合约了结申报信息列表中的某条希望撤销的合约了结申报记录，点击“撤销”按钮，弹出撤销提示框





点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



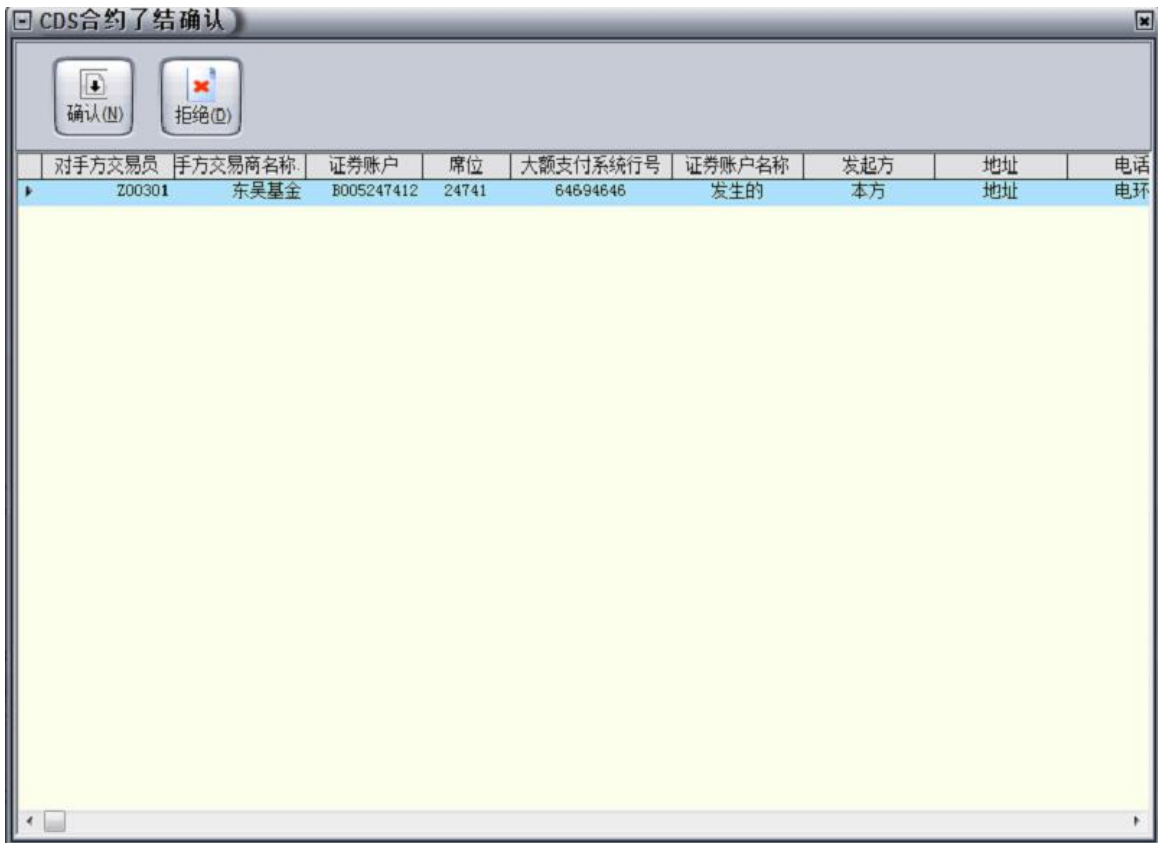
确定后，该条合约了结申报记录会从合约了结申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新 CDS 合约信息列表、合约了结申报信息列表中的信息。

### 4.32.3 CDS 合约了结申报确认

交易员在收到以自己为对手方的合约了结申报后，合约了结申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边提示灯不停的闪动，表明有交易员向其发起合约了结申报请求。

点击该灯，弹出合约了结申报确认窗口



如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出合约了结申报确认窗口，显示合约了结的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

CDS合约了结申报确认

交易商

东吴基金

交易员代码

Z00300

交易员名称

张三

对手方交易商

中信证券

对手方交易员代码

Z06300

对手方交易员名称

张三

证券账户

B003244150

账户名称

乙方证券账号名称

银行账户名称

买方银行账号名称

银行账户

9876543210

本方交易单元

24415

开户行

买方开户行

大额支付系统行号

BB9876543210

起始日

2018-12-18

到期日

2018-12-21

保护期限(年)

3

名义本金(万元)

100

保护费支付方式

按季支付

结算方式

实物结算

年化保护费率(bps)

333

计息基准

实际/365

计息天数调整

按名义天数调整

参考实体

参考实体

参考实体主体评级

AAA

合约了结日

2017-07-04

确认

关闭(C)

点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该合约了结申报请求会从 CDS 合约了结申报确认窗口中消失。

4.32.4 CDS 合约了结申报拒绝

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出合约了结申报拒绝窗口，显示 CDS 合约信息

CDS合约了结申报拒绝			
交易商	东吴基金	对手方交易商	中信证券
交易员代码	Z00300	对手方交易员代码	Z06300
交易员名称	张三	对手方交易员名称	张三
证券账户	B003244150	本方交易单元	24415
账户名称	乙方证券账号名称	开户行	买方开户行
银行账户名称	买方银行账号名称	大额支付系统行号	BB9876543210
银行账户	9876543210		
起始日	2018-12-18	到期日	2018-12-21
名义本金(万元)	100	保护费支付方式	按季支付
年化保护费率(bps)	333	计息基准	实际/365
参考实体	参考实体	参考实体主体评级	AAA
保护期限(年)	3	结算方式	实物结算
		计息天数调整	按名义天数不调整
合约了结日	2017-07-04		
<input type="button" value="拒绝"/> <input type="button" value="关闭(C)"/>			

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该合约了结申报请求会从 CDS 合约了结申报确认窗口中消失。

### 4.33 CDS 凭证协商成交申报

点击交易—>信用保护工具(凭证)—>协商成交申报,进入 CDS 凭证协商成交申报管理界面。



用户在此管理需要协商成交报价信息。

在列表中列出申报的协商成交报价信息，包含报价日期、申报时间、约定号、证券代码、数量、价格、账户、交易单元、买卖方向、对手方、订单号、结算速度、结算速度、结算日期。

在此界面上的操作有新增协商成交报价信息、撤销协商成交报价信息和刷新协商成交报价信息。

新增：点击弹出凭证协商成交报价录入对话框



用户在此申报需要协商成交报价信息，完成协商成交报价操作。

界面各输入项说明如下：

证券代码：凭证代码。

证券简称：系统带出。

约定号：双方约定的号码

买卖方向：买入/卖出

证券账户：中国结算是 10 位账号。

交易单元：输入。

数量：协商成交报价数量，以千元面额为单位。

价格：协商成交报价的价格。

对手方交易员：对手方交易员。

名义本金：系统计算。

保护费：系统计算。

结算速度：默认为 T+0。

清算方式：RTGS

结算日期：当前交易日期

账户名称：本方账户名称

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即协商成交报价录入成功，弹出提示框



该条协商成交报价信息即出现在协商成交报价界面下方的信息列表中。

撤销：选中协商成交报价信息列表中的某条希望撤销的协商成交报价信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条协商成交报价信息即在协商成交报价信息列表中消失。

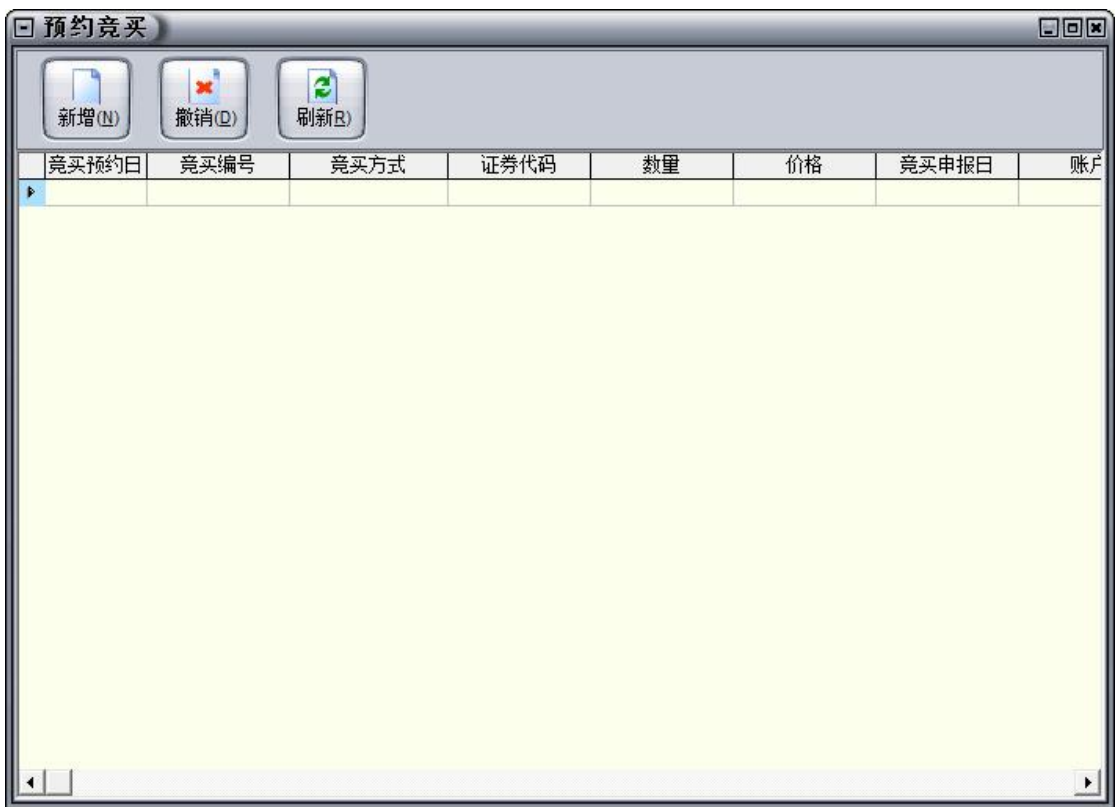
刷新：点击刷新协商成交报价信息列表中的信息。

## 4.34 竞买交易

### 4.34.1 竞买预约申报

点击交易—>现券交易—>竞买预约申报，进入竞买预约申报信息管理界面。





用户在此管理竞买预约申报信息。

在列表中列出申报的竞买预约申报信息，包含竞买发起日、竞买编号、竞买方式、证券代码、数量、价格、申报日期、账户、交易单元、状态、是否匿名、是否自动、结算方式。

在此界面上的操作有新增竞买预约申报信息、撤销竞买预约申报信息和刷新竞买预约申报信息。

新增：点击弹竞买预约申报对话框

**新增竞买**

证券代码  证券简称

证券账户  交易单元号

竞买方式 ☒ 单一主体竞标 价格区间  元

数量  千元面额

结算方式  ☒ 自动发起

竞买申报日  ☐ 是否匿名

账户名称

确定(Q) 关闭(C)

用户在此申报需要竞买预约申报信息，完成竞买预约申报操作。

界面各输入项说明如下：

证券代码：现券代码。

数量：竞买预约申报的现券数量，以千元面额为单位。

价格区间：竞买预约申报应价最小价格。

证券账户：

交易单元：输入。

结算方式：结算场所为中国结算，若为担保券则可选择净额结算或 RTGS，若为非担保券则为 RTGS；

预约日期：预约未来 5 个交易日内的某一天发起竞买

是否匿名：

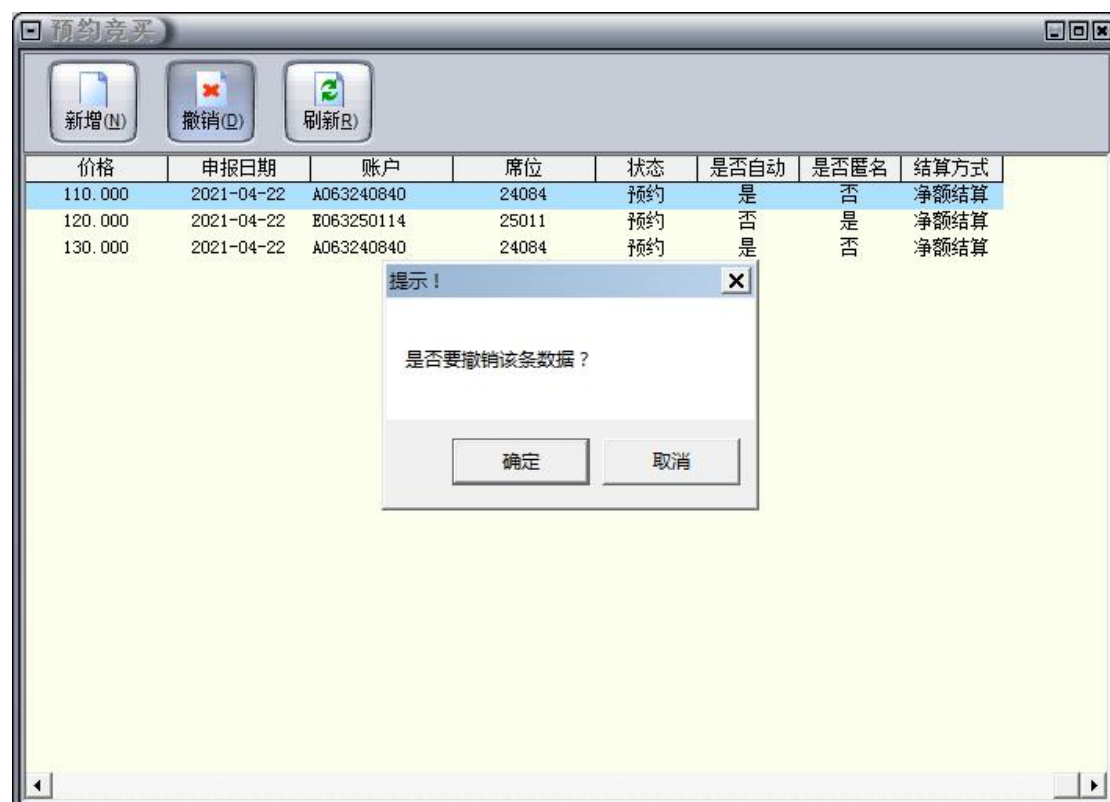
是否自动：勾选则预约日期当天自动转申报

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即竞买预约申报录入成功，弹出提示框



该条竞买预约申报信息即出现在竞买预约申报界面下方的信息列表中。

撤销：选中竞买预约申报信息列表中的某条希望撤销的竞买预约申报信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条竞买预约申报信息即在竞买预约申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新竞买预约申报信息列表中的信息。

### 4.34.2 竞买申报

点击交易—>现券交易—>竞买申报，进入竞买申报信息管理界面。

转申报(N)

刷新(R)

列表中为预约当日竞买

竞买发起日	竞买编号	竞买方式	证券代码	数量	价格	申报日期	账户
2021-04-15	2	单一主体中标	010103	15000	110.000	2021-04-22	A06324084
2021-04-15	3	单一主体中标	010103	25000	120.000	2021-04-22	E06325011
2021-04-15	4	单一主体中标	010103	15000	130.000	2021-04-22	A06324084

撤销(D)

列表中为当日竞买申报

竞买发起日	竞买编号	竞买方式	证券代码	数量	价格	申报日期	账户
-------	------	------	------	----	----	------	----

用户在此管理竞买申报信息。

在列表中列出申报的竞买申报信息，包含竞买发起日、竞买编号、竞买方式、证券代码、数量、价格、申报日期、账户、交易单元、状态、是否匿名、是否自动、结算方式。

在此界面上的操作有新增竞买申报信息和刷新竞买申报信息。

转申报：点击弹出竞买申报对话框



该界面为“竞买申报”窗口，包含以下输入项：

输入项	输入内容	输入项	输入内容
证券代码	010103	证券简称	21国债8
证券账户	A063240840	席位	24084
竞买方式	单一主体竞标	底价	110.000 元
结算方式	净额结算	数量	15000 手

底部有两个按钮：“确定(Q)”和“关闭(C)”。

用户在此申报需要竞买申报信息，完成竞买申报操作。

界面各输入项说明如下：

数量：竞买申报的现券数量，以千元面额为单位。

价格区间：竞买申报应价最小价格。

证券账户：输入。

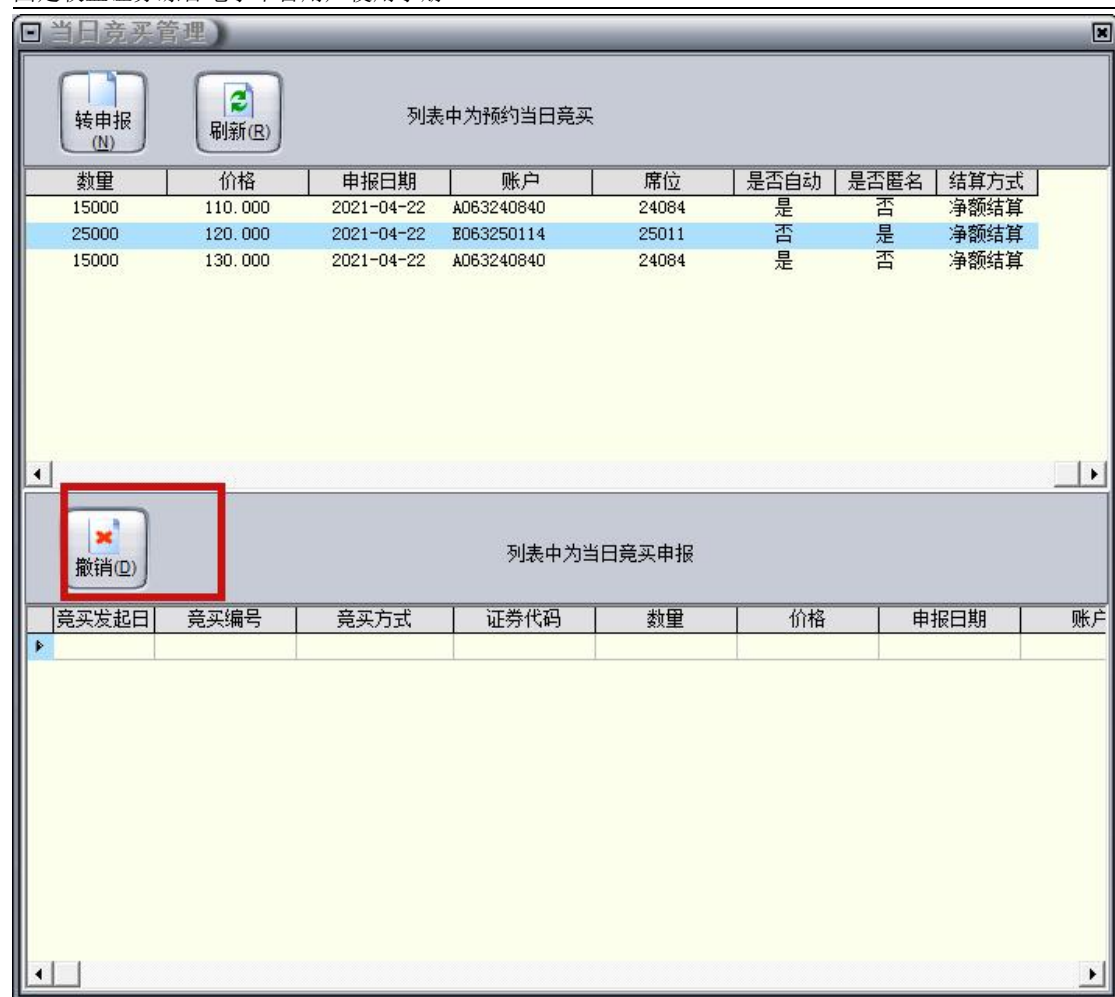
交易单元：输入。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即竞买申报录入成功，弹出提示框



该条竞买申报信息即出现在竞买申报界面下方的信息列表中。

撤销：选中竞买申报信息列表中的某条希望撤销的竞买申报信息，点击撤销，弹出是否撤销提示框



点击确定，提交至后台审核无误，即撤销成功，弹出提示框



该条竞买预约申报信息即在竞买预约申报信息列表中消失。

刷新：点击刷新竞买申报信息列表中的信息。

### 4.34.3 竞买应价申报

点击交易—>现券交易—>竞买应价申报，进入竞买应价申报信息管理界面。

竞买应价申报-单主体中标

申报(N)

刷新(R)

列表中为当日市场发起的竞买

竞买发起日	竞买编号	竞买方式	证券代码	证券名称	数量	价格	申报日期
-------	------	------	------	------	----	----	------

列表中为竞买应价申报

竞买发起日	竞买编号	申报时间	证券代码	证券名称	价格	数量	账户
-------	------	------	------	------	----	----	----

用户在此管理竞买应价申报信息。

在列表中列出申报的竞买应价申报信息，包含竞买发起日、竞买编号、竞买方式、证券代码、数量、价格、申报日期、账户、交易单元、状态、是否匿名、是否自动、结算方式。

在此界面上的操作有新增竞买应价申报信息和刷新竞买应价申报信息。

申报：点击弹出竞买应价申报对话框



**竞买应价申报-单主体**

证券代码	010107	证券简称	21国债8	竞买行情	单一主体中标
证券账户	A100000035	席位代码	13056	应价申报:	笔
价 格	170.000	数 量	22000	底价:	170.000
竞买方式	单一主体中标	<input type="checkbox"/> 是否匿名		最优价:	
结算方式	净额结算	竞买编号	8	竞买记录:	

账户名称:

确定(O)      关闭(C)

参与人	净价	时间

用户在此申报需要竞买应价申报信息，完成竞买应价申报操作。

界面各输入项说明如下：

数量：竞买应价申报的现券数量，以千元面额为单位。

价格区间：竞买应价申报应价最小价格。

证券账户：输入。

交易单元：输入。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即竞买应价申报录入成功，弹出提示框



该条竞买应价申报信息即出现在竞买应价申报界面下方的信息列表中。

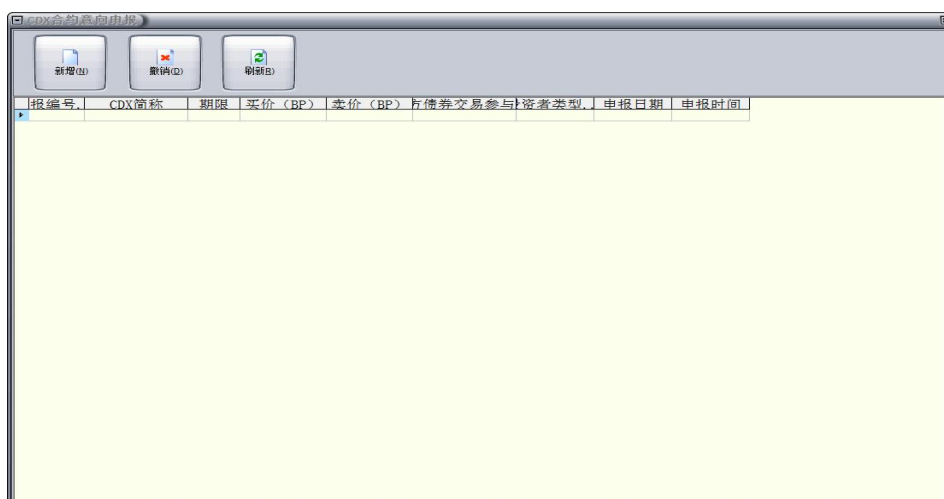
刷新：点击刷新竞买应价申报信息列表中的信息。

## 4.35 CDX 合约交易

组合型信用保护合约（以下简称 CDX）是 CDS 合约的一种子类型。有以下相关操作。

### 4.35.1 CDX 意向申报

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>意向申报。



可以逐个录入：

也可批量导入：

CDX合约意向申报录入

CDX简称

交易所大型发行/

买价 (BP)

期限

3M

卖价 (BP)

投资者类型

证券公司

本方债券交易参与人

人保资产

Excel批量导入

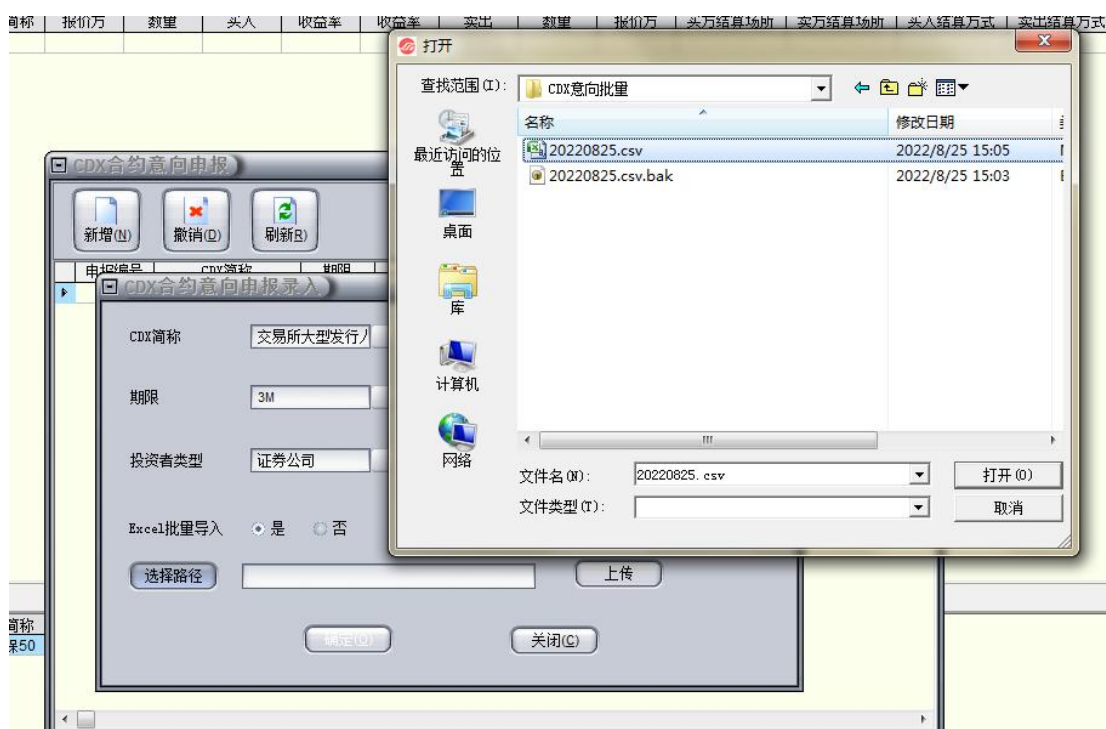
☒ 是 ☐ 否

选择路径

上传

确定(O)

关闭(C)

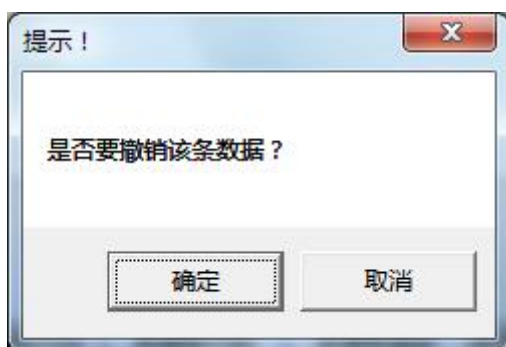


在此可新增 CDX 意向申报信息。新增成功，管理界面和行情界面显示该新增记录

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即录入成功，弹出提示框



列表中选择一条记录，点击撤销，撤销成功，管理界面和行情界面该记录消失

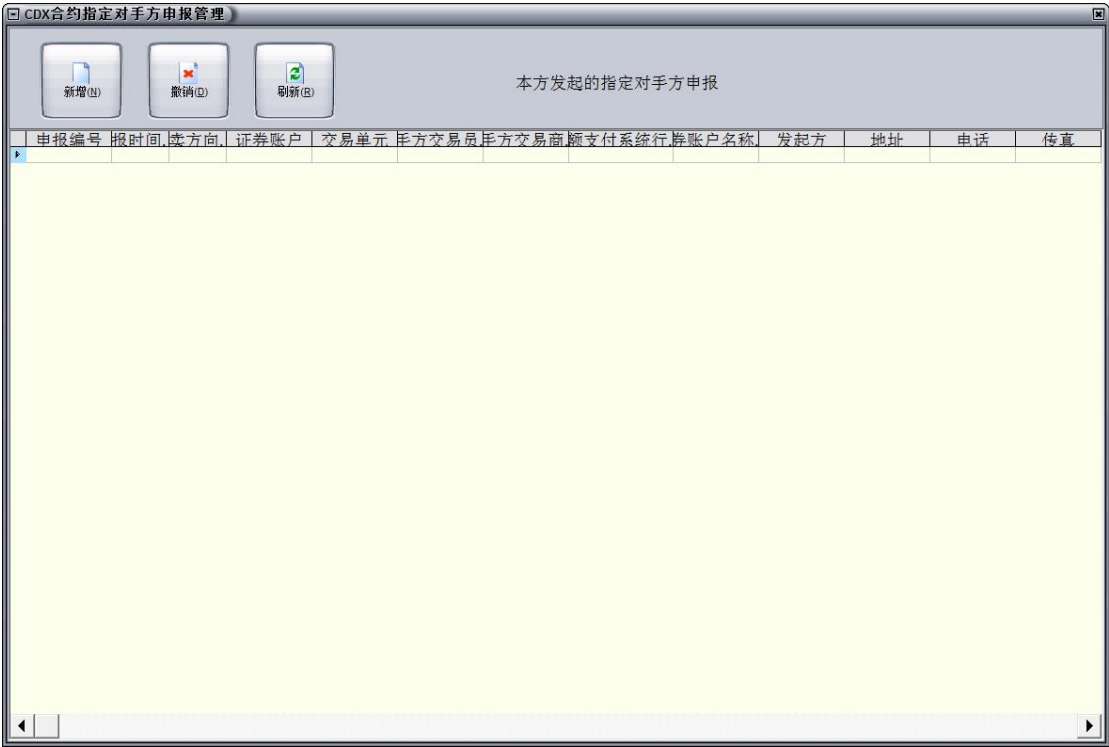


点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示



#### 4.35.2 CDX 协商成交申报

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>协商成交申报。



在此可新增 CDX 合约协商成交申报信息。新增成功，管理界面显示该新增记录

CDX合约指定对手方申报

申明

交易方基本信息

基本条款

信用事件

结算信息

申明承诺定义文件

甲方(信用保护卖方)

乙方(信用保护买方)

本《信用保护合约交易确认书》(以下简称“本确认书”)旨在明确甲方和乙方在下文指明的签署日达成的信用保护合约交易(以下简称“交易”)的条款与条件。

在本确认书中,甲方(信用保护卖方)与乙方(信用保护买方)合称为“交易双方”,分别称为“交易一方”。

鉴于交易双方已经签署了《中国证券期货市场衍生品交易主协议(信用保护合约专用版)》(以下简称“主协议”)和《中国证券期货市场衍生品交易主协议(信用保护合约专用版)补充协议》(若有,以下简称“补充协议”),本确认书构成主协议所称的“交易确认书”,主协议和补充协议(如有)中的全部条款,除上海证券交易所、交易双方另有特别规定或约定,适用于本确认书。

本确认书与主协议、补充协议以及交易双方认可的确认交易双方之间信用保护合约交易的所有援引了主协议的其他文件(以下简称“其他文件”),共同构成交易双方之间单一和完整的协议。就本确认书项下的交易而言,若本确认书的约定与主协议、补充协议或其他文件(如有)的约定有冲突,在不违反上海证券交易所相关规定的条件下,应以本确认书的约定为准。

本确认书取代交易双方在本确认书的签署日之前就本确认书项下的该项交易所作出的任何其他确认(包括但不限于其他书面确认、电话及口头确认)。

本确认书中的未明确的定义,参照《上海证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司信用保护工具业务管理试点办法》、《上海证券交易所信用保护工具交易业务指引》、主协议及其补充协议中的定义。

确定(D)

关闭(C)

CDX合约指定对手方申报

申明

交易对手基本信息

基本条款

信用事件

结算信息

申明承诺定义文件

本方

电话

传真

收件人

地址

是否代表产品

否

本确认为甲方/乙方作为以下金融产品的管理人代表该金融产品与乙方/甲方达成的，因此交易双方达成的本确认书所涉及的甲方/乙方的权利和义务，除不适用于该金融产品的以外，均指该金融产品的权利和义务由甲方/乙方代表该金融产品行使或作出。

确定(D)

关闭(C)



CDX合约指定对手方申报

申明

交易方基本信息

交易事件

结算信息

申明承诺定义文件

本方买入

交易商

交银施罗

交易员代码

Z03600

交易员名称

丁玉明

本方卖出

对手方交易商

对手方交易员代码

对手方交易员名称

证券账户

交易单元

银行账户名称

银行账号

证券账户名称

开户行

大额支付系统行号

起始日

2022-04-07

到期日

2022-04-07

保护期限(年)

名义本金(万元)

保护费支付方式

按季支付

保护费支付途径

双方自行协商支付

年化保护费率(bps)

计息基准

实际/365

计息天数调整

按实际天数调整

首期保护费支付日

2022-04-07

确定(D)

关闭(C)

©上海证券交易所-202-

- 259 -

PROJ-FISP-UG

CDX合约指定对手方申报

申明交易方基本信息基本条款信用事件结算信息申明承诺定义文件

参考实体CSI-SSE交易所大型发行人CDX组合

S V

受保护债券范围：参考实体在中国境内发行并在沪深交易所上市交易或者挂牌转让的以人民币计价的公司债券和可转换公司债券

信用事件类型

☐ 破产

☐ 支付违约

起点金额(万元)

宽限期(天)

☐ 宽限期顺延

确定(D)

关闭(C)

CDX合约指定对手方申报

申明交易方基本信息基本条款信用事件结算信息申明承诺定义文件

参考实体

CSI-SSE交易所大型发行人CDX组合

CSI-SSE交易所大型发行人CDX组合

CSI-SSE交易所民企CDX组合

S

CDX合约指定对手方申报

申明

交易方基本信息

基本条款

信用事件

结算信息

申明承诺定义文件

信用事件通知方

买方

☐ 是否适用公共信息通知

买方

实物交割期间(天)

结算方式

实物结算

实物结算:

计算机构

买方

可交付债务种类

☐ 付款义务

☐ 借贷款项

☐ 债券

☐ 贷款

☐ 公司债

☐ 可转债

☐ 仅为参考债务

☐ 资产支持证券

☐ 企业债

可交付债务特征

☐ 一般债务

☐ 次级债务

☐ 证券交易所挂牌流通

☐ 本币

☐ 外币

☐ 无扣减债务

☐ 可转让贷款

☐ 转让受限贷款

☐ 最长待偿期10年

☐ 其他

可交付债务的应计未计利息

计入

补充条款

确定(D)

关闭(C)

CDX合约指定对手方申报

申明

交易方基本信息

基本条款

信用事件

结算信息

申明承诺定义文件

八、与交易有关的申明与承诺条款

(一) 一般的申明与承诺:

1、交易一方(包括其关联方)未向另一方就参考实体、债务、参考债务、可交付债务作出任何的申明或陈述。

2、交易一方(包括其关联方)均有权就债务、参考债务或可交付债务进行任何交易,或接受参考实体的存款、向其放款或与其进行任何金融或商业业务活动,不受本确认书项下的交易的影响,即使上述交易或业务活动可能对参考实体或另一方在本确认书项下的交易所涉及的权利义务产生不利影响(包括但不限于任何可能构成或产生一项信用事件的行为)。

3、交易一方(包括其关联方)均有权在签署日后获取或掌握与参考实体有关的信息,该信息可能与交易有关且不为公众或另一方所知悉,但对方没有义务向另一方披露该信息(无论其是否为保密信息)。

(二) 与实物结算有关的申明与承诺:

1、若信用保护买方向信用保护卖方可交付债务在所有权方面存在瑕疵,或受限于任何担保物权、请求权、其他权利负担或第三方权益(但参考实体享有的或可行使的抵销权除外),则应赔偿由此给信用保护卖方面造成的直接损失,除非信用保护买方能证明其已采取合理可行的措施对该可交付债务进行了调查与核实。该赔偿义务在本确认书项下的交易的到期日之后仍然有效。但是,信用保护买方向未能满足上述要求不视为构成了其在本确认书项下的一个违约事件。

2、信用保护买方向交割给信用保护卖方的可交付债务不得要求信用保护卖方向参考实体承诺提供任何后续资金(包括或有的资金承诺),或对参考实体负有任何支付款项的义务。

3、信用保护买方向交割给信用保护卖方可交付债务交割给信用保护卖方不构成其在本确认书项下的一个违约事件。

4、如信用保护买方向未在本确认书项下向信用保护卖方向交付可交付债务,则上述实物交割期间结束之日为本信用保护合约交易的到期日,信用保护买方向将因此自动丧失未交付的可交付债务对应额度的向信用保护卖方向请求获得本信用保护合约交易项下结算赔付的权利。

5、交易双方需按照适用于有关参考债务或可交付债务的法律规定各自承担应付的印花税或其他相关税费。除非交易双方另行约定,交割可交付债务产生的费用(包括但不限于需支付给贷款代理、债券受托人或登记托管结算机构的费用)由信用保护买方向负担。

九、定义

签署日 在一笔信用保护合约交易下,指交易双方达成该交易的日期。

起始日 在一笔信用保护合约交易下,指该交易的信用保护开始生效的日期。

约定到期日 在一笔信用保护合约交易下,指交易双方在本确认书中约定的信用保护到期之日。

计算机构 指交易双方在本确认书中指定为“计算机构”的实体,可由交易一方或交易双方担任,也可由第三方机构担任。

名义本金 指一笔信用保护合约交易提供信用风险保护的金额,各项支付和结算以此金额为计算基准。

保护费率 保护费率=保护费/名义本金\*100%。

前端费率 前端费率=前端费用/名义本金\*100%。

期初交付金额 在期初交付金额支付日支付的前端费用和期初返还金额的轧差。

首期交付日 本确认书的生效日之后的第一个支付日,并依照上海证券交易所相关的交易日准则调整。

债务 指参考实体作为主债务人有的债务。

参考债务 指交易双方在本确认书中列明或描述的一个或多个参考实体的一项或多项债务(或一类或多类债务)。

债务种类 指参考实体所负债务的类别,包括但不限于:

(1) 付款义务,即任何支付或偿还款项的义务;

(2) 借贷款项,即基于贷款或债务融资法律关系产生的一种付款义务;

(3) 贷款,即根据相关贷款协议、授信安排、保险资金间接投资基础设施、债权投资计划或信托安排已经发放的贷款;

(4) 债券,即各类公开发行、非公开发行或定向发行的债券或债务工具,包括但不限于公司债和可转债;

(5) 公司债;

(6) 可转债;

(7) 企业债;

(8) 资产支持证券;

(9) 仅为参考债务。

债务特征 指参考实体所负债务的一项或多项特征,包括但不限于一般债务、次级债务、交易流通、本币或外币等特征。

一般债务 指该债务在获得参考实体清偿时的受偿顺序优先于其他同类型借款款项,或其他同类型借款款项平等受偿。在判断债务受偿顺序时,应以相关债务发生时的状态为准,但在本确认书的生效日晚于该债务的发生日时,则以其在本确认书的生效日的状态为准。

次级债务 指该债务在获得参考实体清偿时的受偿顺序在一般债务受偿后方可受偿,或在参考实体于一般债务项下尚有欠款或仍处于违约状态时,无权就该债务获得或保留参考实体支付的任何款项。

交易流通 指该债务可以在中国境内或境外的合法交易场所转让或买卖。(即使果非公开发行或定向发行的债券在交易流通方面可能受到某些限制,仍应视为其具有“交易流通”的债务特征。)

本币 指该债务的面值为人民币。

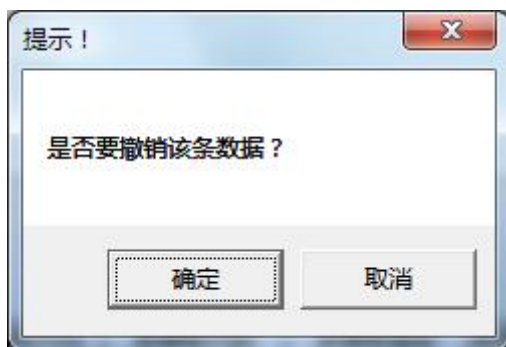
确定(D)

关闭(C)

填写好相应数据后,点击确定提交至后台审核无误,即录入成功,弹出提示框



列表中选择一条记录,点击撤销,撤销成功,管理界面该记录消失



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

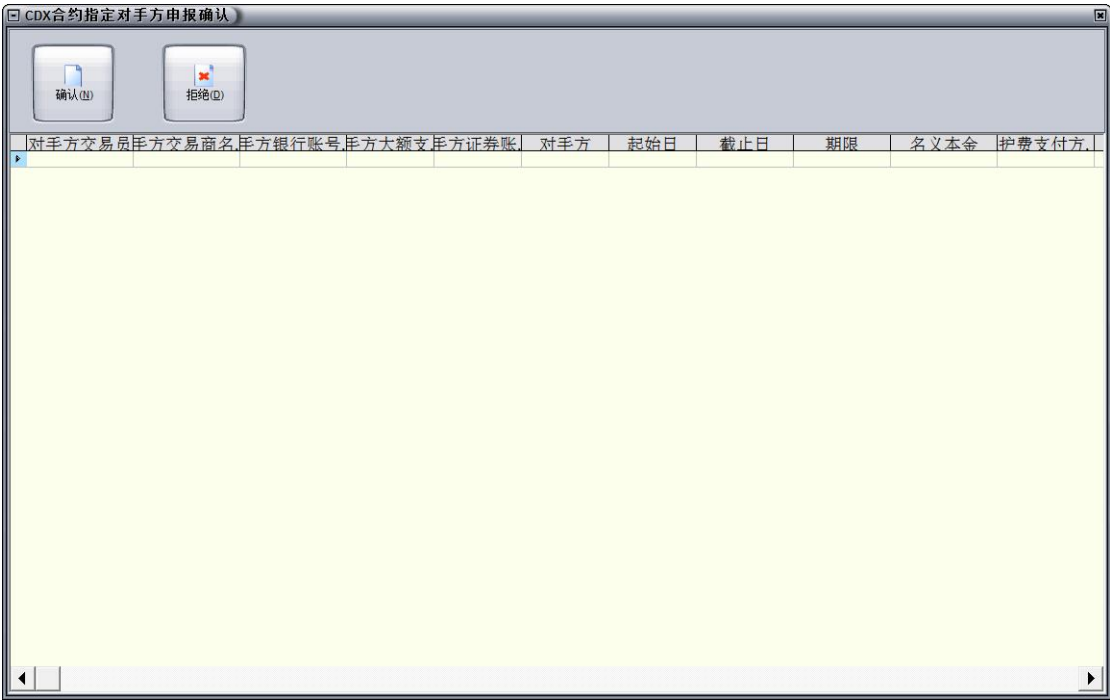


### 4.35.3 CDX 协商成交申报确认/拒绝

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>协商成交申报确认。

交易员申报后，对手方申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果对手方的窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边对应的提示灯不停的闪动，表明有交易员向其发起协商成交申报请求。

点击该灯，弹出成交申报确认窗口



在此可针对对手方申报提交的 CDX 合约协商成交申报进行确认或拒绝。

如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出信用事件申报确认窗口，显示信用事件的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。确认成功后，记录消失

点击确定，提交至系统校验通过后弹出交易成功提示



如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出提前终止申报拒绝窗口，显示 CDS 合约信息。拒绝成功后，记录消失



### 4.35.4 CDX 提前终止申报

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>提前终止申报。

在此可新增或撤销 CDX 合约提前终止申报。

申报：如果用户想提前终止一笔 CDX 合约，选中列表中的某条希望提前终止的合约记录，点击“申报”按钮，弹出“CDX 提前终止申报”界面，显示 CDX 合约的详细要素内容供用户确认及输入。确认成功后，在下方列表中生成一条申报记录，上方原合约记录消失。

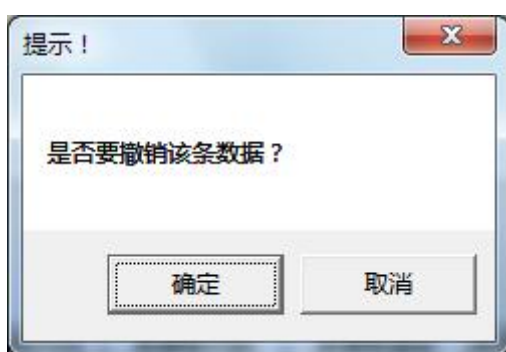
填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即录入成功，弹出提示框





如果用户想撤销提前终止申报，选择该记录点击撤销，下方申报记录消失，上方申报记录恢复。

列表中选择一条记录，点击撤销，撤销成功，管理界面该记录消失



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

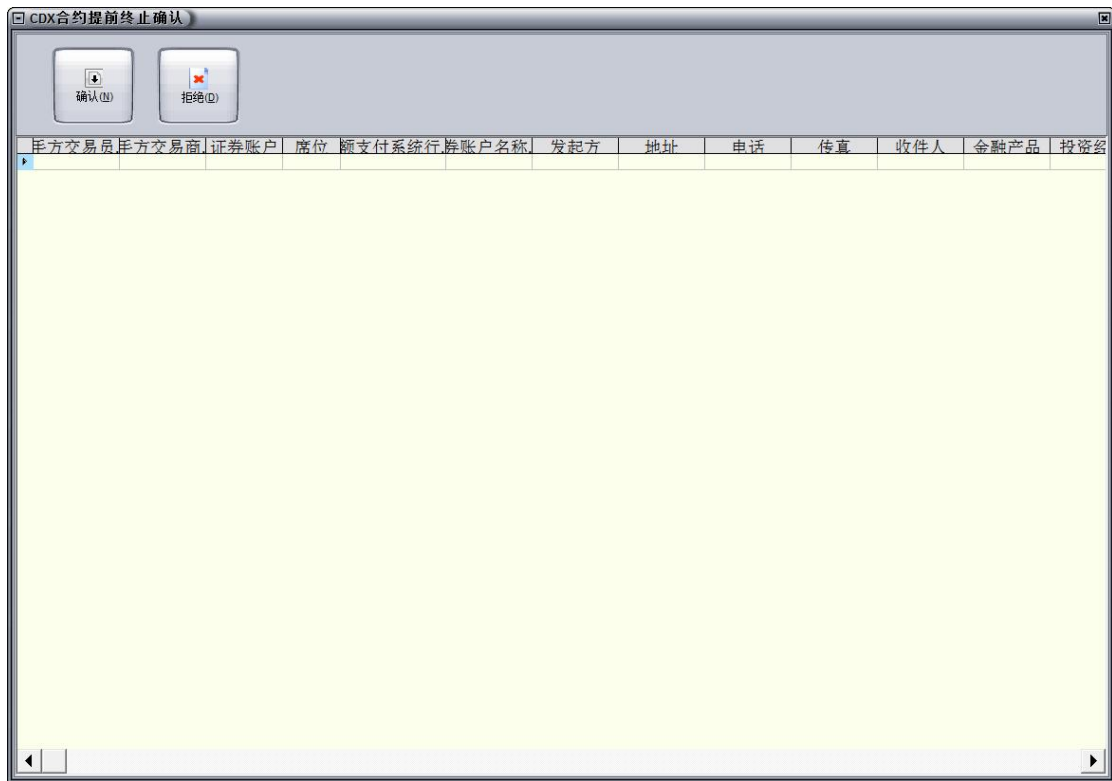


#### 4.35.5 CDX 提前终止申报确认/拒绝

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>提前终止申报确认。

交易员在收到以自己为对手方的提前终止申报后，提前终止申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边提示灯不停的闪烁，表明有交易员向其发起提前终止申报请求。

点击该灯，弹出提前终止申报确认窗口



在此可针对对手方提交的 CDX 合约提前终止申报进行确认或拒绝。

如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出提前终止申报确认窗口，显示提前终止的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。记录消失，合约终止。

点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



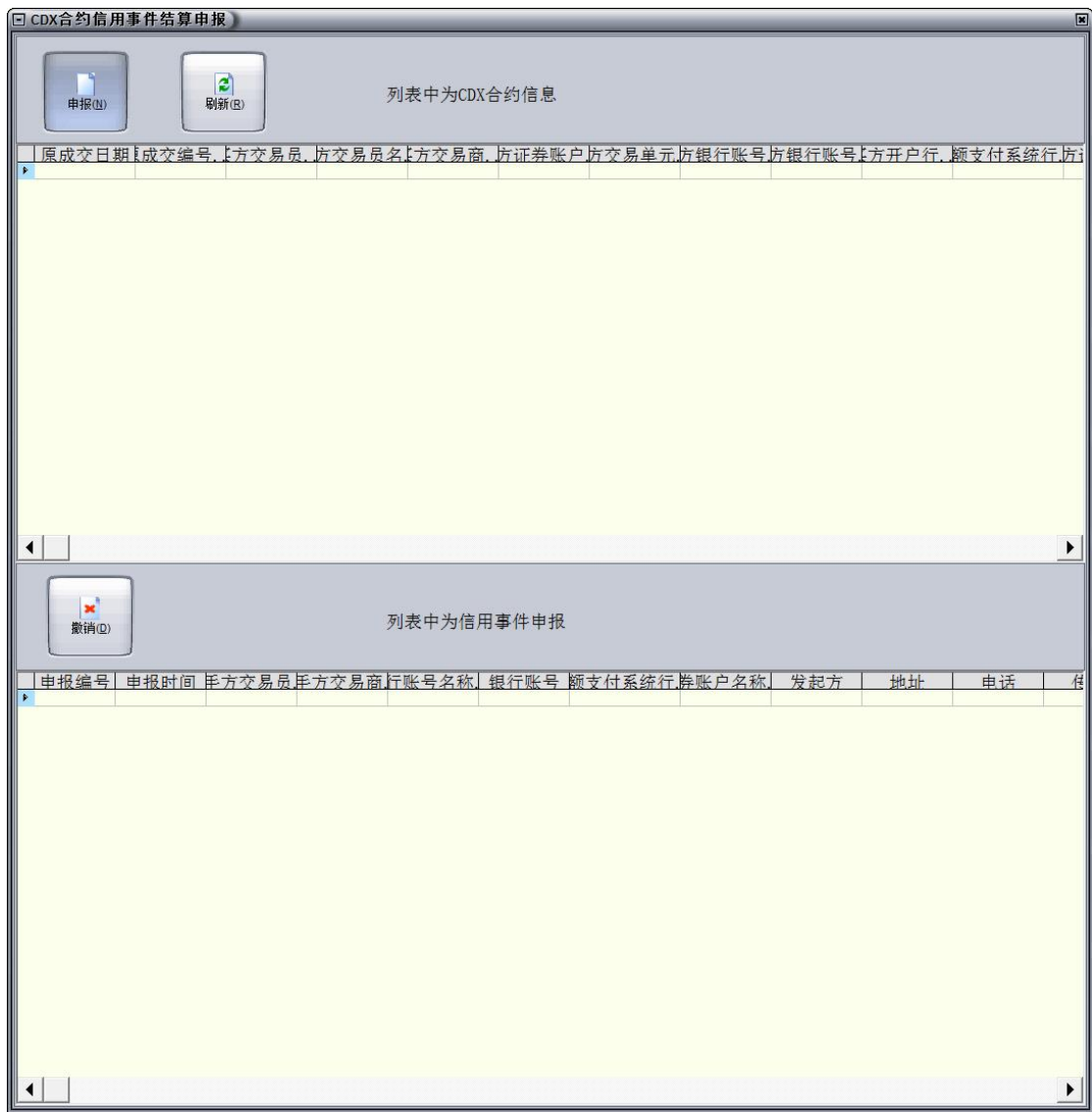
如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出提前终止申报拒绝窗口，显示 CDX 合约信息。记录消失，申报撤销。

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



### 4.35.6 CDX 信用事件结算申报

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>信用事件申报。



在此可新增或撤销 CDX 合约信用事件结算申报。

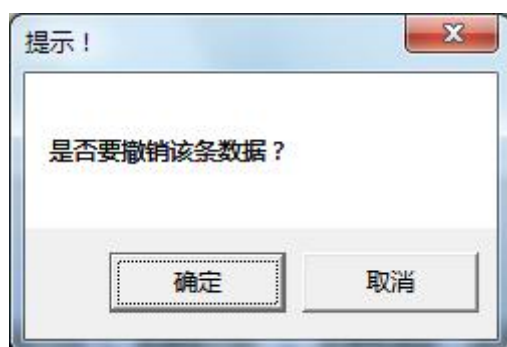
申报：如果用户想信用事件一笔 CDX 合约，选中列表中的某条希望信用事件的合约记录，点击“申报”按钮，弹出“CDX 信用事件申报”界面，显示 CDX 合约的详细要素内容供用户确认及输入。申报成功，该条合约记录在 CDX 合约信息列表中仍存在，在下面部分界面的信用事件申报信息列表中会出现该条 CDX 合约的信用事件申报信息。同一笔合约可以多次重复申报。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即录入成功，弹出提示框



如果用户想撤销信用事件申报，选择一条记录，点击撤销，成功后，在下面部分界面的信用事件申报信息列表中申报记录消失。

列表中选择一条记录，点击撤销，撤销成功，管理界面该记录消失



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

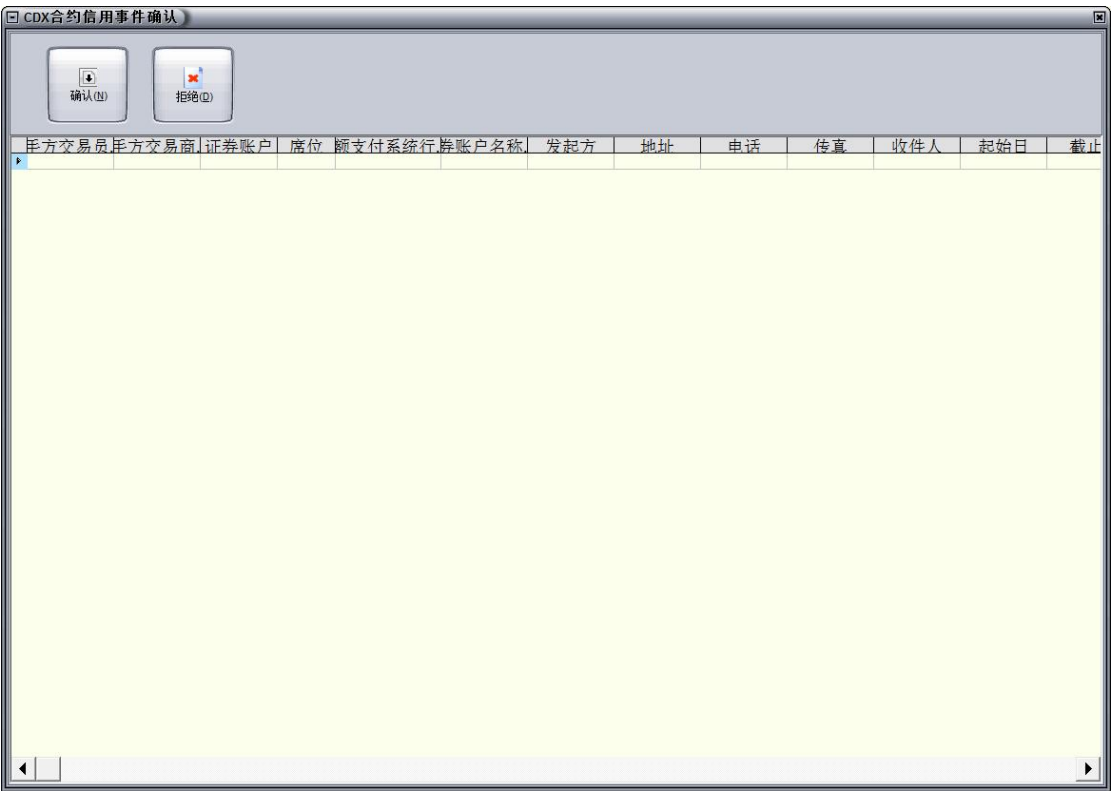


### 4.35.7 CDX 信用事件结算申报确认/拒绝

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>信用事件申报确认。

交易员在收到以自己为对手方的信用事件申报后，信用事件申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边提示灯不停的闪烁，表明有交易员向其发起信用事件申报请求。

点击该灯，弹出信用事件申报确认窗口



在此可针对对手方提交的 CDX 合约信用事件结算申报进行确认或拒绝。

如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出信用事件申报确认窗口，显示信用事件的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该信用事件申报请求会从 CDX 信用事件申报确认窗口中消失。合约不终止。

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出信用事件申报拒绝窗口，显示 CDX 合约信息

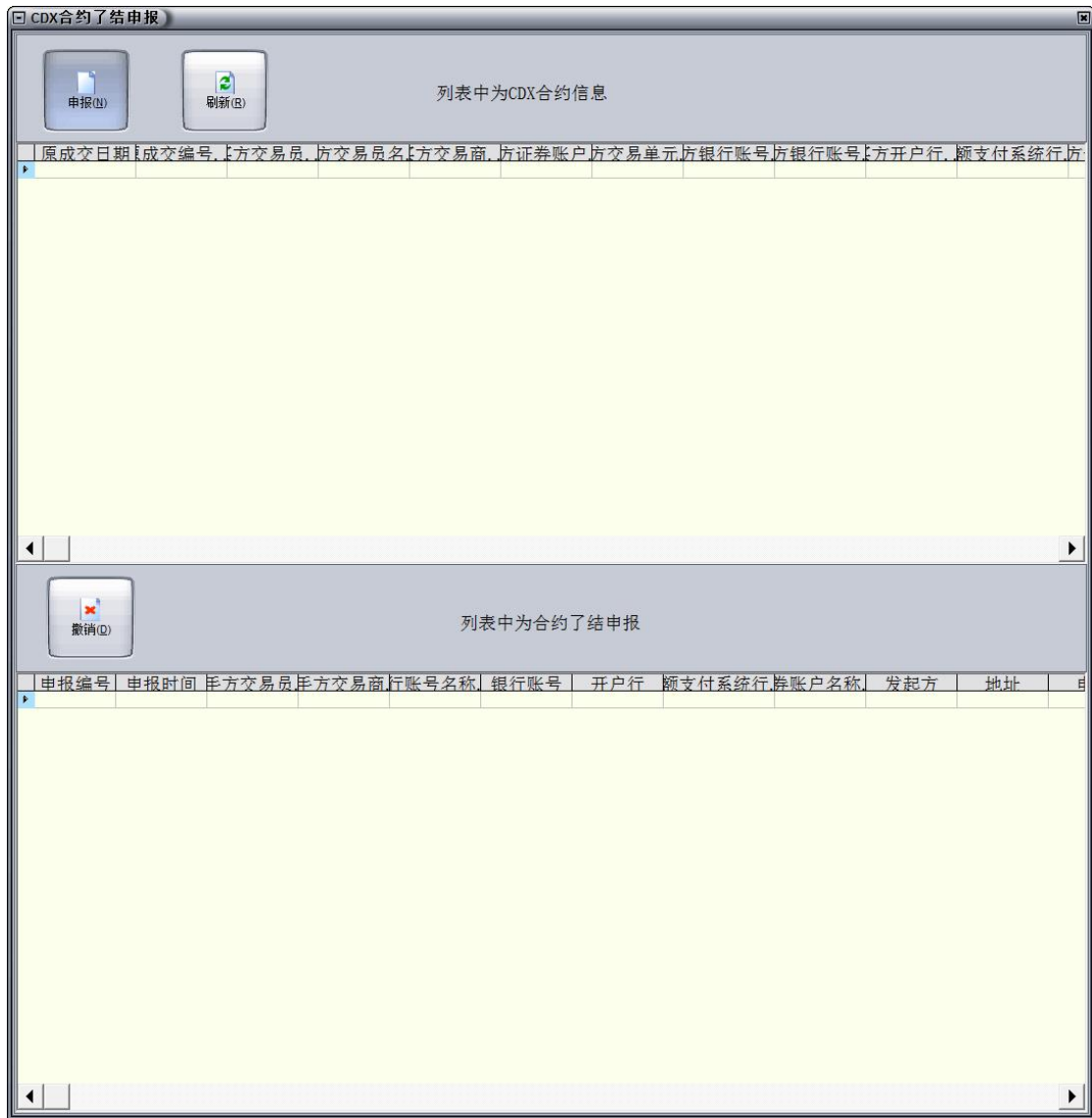
点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该信用事件申报请求会从 CDX 信用事件申报确认窗口中消失。

#### 4.35.8 CDX 合约了结申报

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>合约了结申报。



在此可新增或撤销 CDX 合约了结申报。

申报：如果用户想合约了结一笔 CDX 合约，选中列表中的某条希望合约了结的合约记录，点击“申报”按钮，弹出“CDX 合约了结申报”界面，显示 CDX 合约的详细要素内容供用户确认及输入。

填写好相应数据后，点击确定提交至后台审核无误，即录入成功，弹出提示框

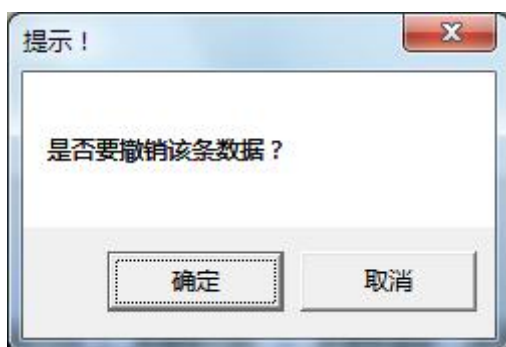


申报成功后，该条合约记录即在 CDX 合约信息列表中消失，在下面部分界



面的合约了结申报信息列表中会出现该条 CDX 合约的合约了结申报信息。

列表中选择一条记录，点击撤销，撤销成功，管理界面该记录消失



点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出撤销成功提示

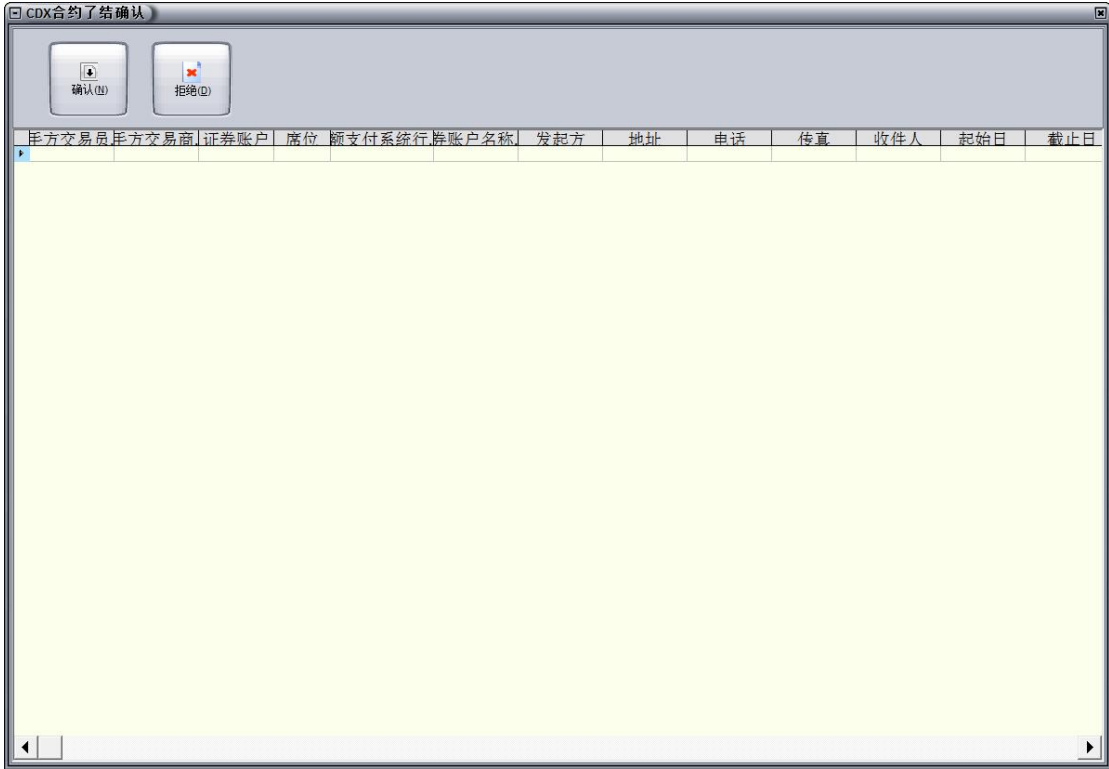


#### 4.35.9 CDX 了结申报确认/拒绝

菜单路径：点击交易—>组合信用保护合约—>合约了结申报确认。

交易员在收到以自己为对手方的合约了结申报后，合约了结申报确认窗口中的申报信息会发生改变。如果申报确认窗口处于关闭状态，系统状态栏上右手边提示灯不停的闪动，表明有交易员向其发起合约了结申报请求。

点击该灯，弹出合约了结申报确认窗口



在此可针对对手方提交的 CDX 合约了结申报进行确认或拒绝。

如果交易员对这个申报信息满意，选中该条申报请求后，点击“确认”按钮，弹出合约了结申报确认窗口，显示合约了结的合约信息，交易员可以查看申报信息是否无误，并修改相关合约要素。

点击“确定”按钮，提交至系统校验通过后弹出确认成功提示



确定后，该合约了结申报请求会从 CDX 合约了结申报确认窗口中消失。该合约终止。

如果用户想拒绝一笔申报，在界面列表中选中该条申报记录后，点击“拒绝”按钮，弹出合约了结申报拒绝窗口，显示 CDX 合约信息

点击“拒绝”按钮，提交至系统校验通过后弹出拒绝成功提示



确定后，该合约了结申报请求会从 CDX 合约了结申报确认窗口中消失。

## 五、 查询统计

这里为用户提供了各种方便的按条件检索方式。

### 5.1 产品查询

点击查询统计—>产品查询，进入产品查询界面。

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

01

债券交易参与人买卖净额(千元面额):

100000000

\*交易产品名称:

利率债现券

最小询价数量(千元面额):

100

\*状态:

正常

\*做空额度(千元面额):

100000000

报价成交单位(千元面额):

100

场外成交录入价格波动幅度限制:

0

协议交易最小数量(千元面额):

1

质押券出入库最小数量(千元面额):

1

报价价格变动单位(厘):

1

做市报价时间间隔(分钟):

60

价格波动限制:

0

%

做市报价最低报价单位(千元面额):

100

开盘时间:

09:00:00

做市报价价差(收益率基点):

10

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

02

\*交易产品名称:

隔夜回购

\*状态:

正常

融券业务时间:

15:30:15

是否允许债券登记日进行融券:

否

查询全部(Q)

关闭(C)

**产品查询**

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码: 03      债券交易参与人买卖净额(千元面额): 100000000

\*交易产品名称: 公司债现券      最小询价数量(千元面额): 100

\*状态: 正常      \*做空额度(千元面额): 10000000

报价成交单位(千元面额): 100      场外成交录入价格波动幅度限制: 0

协议交易最小数量(千元面额): 1      质押券出入库最小数量(千元面额): 1

报价价格变动单位(厘): 1      做市报价时间间隔(分钟): 60

价格波动限制: 0 %      做市报价最低报价单位(千元面额): 100

开盘时间: 09:00:00      做市报价价差(收益率基点): 20

收盘时间: 15:30:00

查询全部(Q)      关闭(C)

**产品查询**

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码: 05

\*交易产品名称: 质押式协议回购

\*状态: 正常

质押债券数量单位(千元面额): 1

质押债券数量最小总额(千元面额): 1

开盘时间: 09:00:00

收盘时间: 15:30:00

查询全部(Q)      关闭(C)

**产品查询**

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码: 05

\*交易产品名称: 质押式协议回购

\*状态: 正常

质押债券数量单位(千元面额): 1

质押债券数量最小总额(千元面额): 1

开盘时间: 09:00:00

收盘时间: 15:30:00

查询全部(Q)      关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

06

\*交易产品名称:

仅在平台挂牌债券

\*状态:

正常

最小询价数量(千元面额):

100

报价价格变动单位(厘):

1

价格波动限制:

0

%

开盘时间:

09:00:00

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

09

债券交易参与人买卖净限额(千元面额):

100000000

\*交易产品名称:

信贷资产支持证券

最小询价数量(千元面额):

100

\*状态:

正常

\*做空额度(千元面额):

100000000

报价成交单位(千元面额):

1000

场外成交录入价格波动幅度限制:

0

协议交易最小数量(千元面额):

1

质押券出入库最小数量(千元面额):

1

报价价格变动单位(厘):

1

做市报价时间间隔(分钟):

10

价格波动限制:

0

%

做市报价最低报价单位(千元面额):

5000

开盘时间:

09:30:00

做市报价价差(收益率基点):

10

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

10

价格提示阈值:

10

\*交易产品名称:

三方回购

补券提示阈值:

5

\*状态:

正常

成交金额最小变动单位(万元):

100

质押券交易单位(千元面额):

1

最小申报金额(万元):

100

质押数量最小值(千元面额):

1

回购利率下限:

0

%

回购利率上限:

24

%

开盘时间:

09:00:00

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

11

\*交易产品名称:

CDS合约

\*状态:

正常

最小交易金额 (万元):

50

最小交易步长 (万元):

50

开盘时间:

09:00:00

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

12

\*交易产品名称:

CDS信用凭证

\*状态:

正常

最小交易金额 (万元):

50

最小交易步长 (万元):

50

开盘时间:

09:00:00

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)

产品查询

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码:

15

最小询价数量 (份):

100000

\*交易产品名称:

公募REITs

上市首日价格波动限制:

30 %

\*状态:

正常

报价成交单位 (份):

1000

协议交易最小数量 (份):

1000

报价价格变动单位 (厘):

1

非上市首日价格波动限制:

11 %

开盘时间:

09:30:00

收盘时间:

15:30:00

查询全部(Q)

关闭(C)



产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码: 21      债券交易参与人买卖净额(千元面额): 100000000

\*交易产品名称: 特定债券      最小询价数量(千元面额): 100

\*状态: 正常      \*做空额度(千元面额): 10000000

报价成交单位(千元面额): 100      场外成交录入价格波动幅度限制: 0

协议交易最小数量(千元面额): 1      质押券出入库最小数量(份): 1

报价价格变动单位(厘): 1      做市报价时间间隔(分钟): 60

价格波动限制: 0 %      做市报价最低报价单位(千元面额): 100

开盘时间: 09:00:00      做市报价价差(收益率基点): 10

收盘时间: 15:30:00

查询全部(Q)      关闭(C)

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码: 22      上市首日价格波动限制: 30 %

\*交易产品名称: 公募可转债

\*状态: 正常

成交单位(千元面额): 1

最小申报数量(千元面额): 1000

报价价格变动单位(厘): 1

非上市首日价格波动限制: 20 %

开盘时间: 15:00:00

收盘时间: 15:30:00

查询全部(Q)      关闭(C)

产品代码	产品名称
01	利率债现券
02	隔夜回购
03	公司债现券
05	质押式协议回购
06	仅在平台挂牌债券
09	信贷资产支持证券
10	三方回购
11	CDS合约
12	CDS信用凭证
15	公募REITs
21	特定债券
22	公募可转债
23	CDX合约
24	债券ETF

\*交易产品代码: 23

\*交易产品名称: CDX合约

\*状态: 正常

最小交易金额(万元): 50

最小交易步长(万元): 50

开盘时间: 09:00:00

收盘时间: 15:30:00

查询全部(Q)      关闭(C)



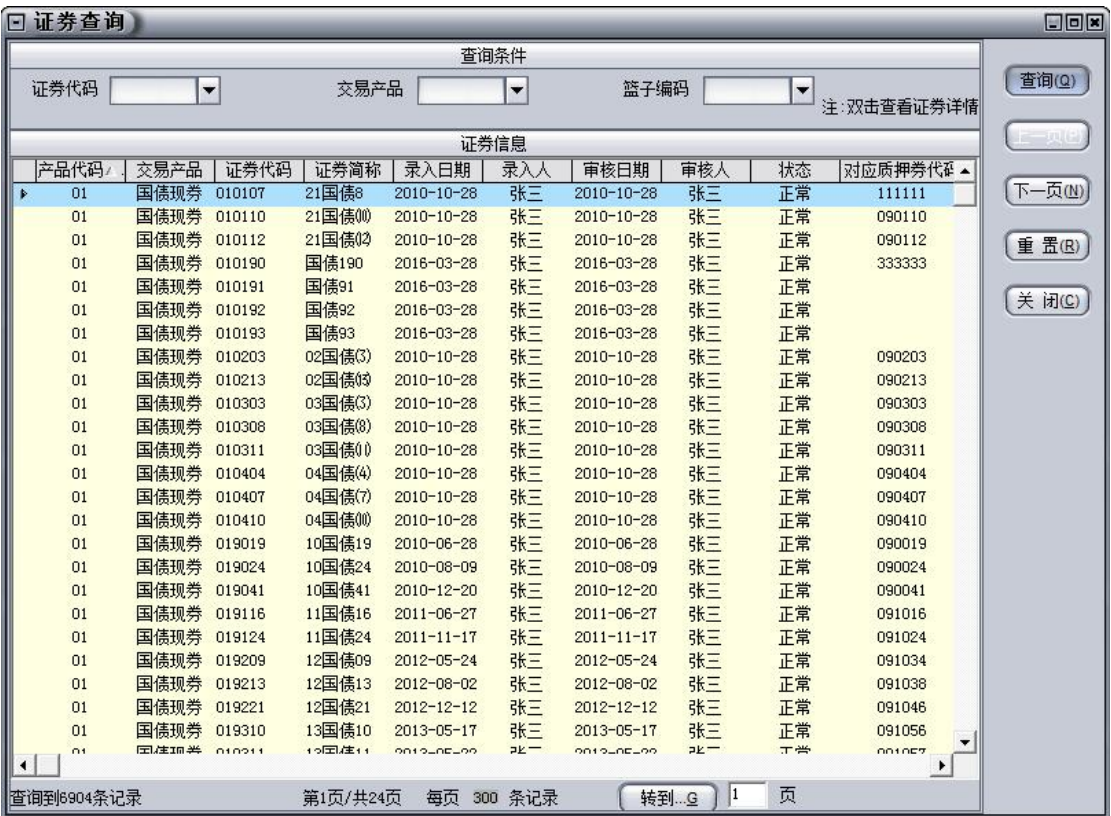
产品查询窗口可以查询到系统中存在的品种类。

点击查询，列表框中列出系统中存在的产品信息，包括产品代码，产品名称。选择列表中不同的产品，在右侧的产品详细信息中可以查看该类产品的详细信息。

注：债券 ETF 在固收平台目前仅可作为协议回购质押券，不可进行现券交易。

## 5.2 证券查询

点击查询统计—>证券查询，进入证券查询界面。



证券查询窗口可以对系统中的所有证券信息进行条件查询，可以选择交易产品分类查询，输入证券代码精确查询。

查询条件框下方的证券信息列表列出了所查的证券信息，包括产品代码，产品名称，证券代码，证券简称，扩位简称，状态，对应质押券代码，是否基准，能否做空，总做空额度，已用做空额度，债券交易参与者做空额度，中债代码，中债简称，托管场所，价格类型，换股状态，换股价格，回售批次号，回售价格，转股状态，转股价格，所属篮子，估值，折扣率。

做市商可通过查看证券的做空额度信息，把握对该证券的交易情况。  
如果交易产品为质押式协议回购，双击一行证券信息，弹出如下详情

协议回购详情

交易产品

质押式协议回购

证券状态

正常

证券代码

206001

证券简称

R001

开盘时间

09:30:00

收盘时间

22:00:00

关闭(C)

可以在某一证券信息行上双击鼠标，弹出该证券的详细信息窗口

证券详情

交易品种基本数据 证券信息1 证券信息2

交易产品

利率债现券

证券状态

正常

录入人

徐惠

证券代码

010101

开盘时间

09:00:00

扩位简称

国债77

证券简称

国债77

收盘时间

15:30:00

证券属性

利率债

证券发行方式

附息

上日加权平均价

200.000元

上日收盘价

200.000元

能否回购

否

是否非担保

否

是否基准品种

是

能否做空

否

回售批次号

0101010707

回售价格

100.000

转股状态

Y

转股价格

100.000

所属篮子

估值

折扣率

回售撤销开始日

2020-01-01

回售撤销结束日

2025-01-01

是否竞价挂牌

是

托管场所

中国结算

中债代码

中债简称

价格类型

净价

换股状态

Y

换股价格

100.000

注:证券详情,不能做任何修改

关闭(C)

这一页列出了该证券的基本数据

**证券详情**

交易品种基本数据 | 债券信息1 | 债券信息2

证券代码	010001	国债类型	记账式	证券面额	50,000 元
上市日期	2012-11-27	到期登记日期	2020-11-27	到期日期	2020-11-27
利息类型	固定利率	付息频率	每年	票面利率	10.0000 %
				应计利息算法	实际/365
实际发行总量	0 亿元	标准券折算比例	1.0000	发行方法	包销
计划发行总量	0 亿元	发行价格	100.000 元		

关闭(C)

这一页列出了包括证券面额，票面利率，上市日期等利率债（国债）详细信息

**证券详情**

交易品种基本数据 | 债券信息1 | 债券信息2

分销价格上限	100.000 元	招标方式	利率	期限	0 年
分销价格下限	100.000 元	招标日期	1900-1-1	是否跨市场	是
发行开始日期	2012-11-27	分销开始日期	1900-1-1	上市公告日期	1900-1-1
发行结束日期	1900-1-1	分销结束日期	1900-1-1	回购开始日期	2012-11-27
应计利息生成日期	2012-11-26	财政部文件编号			
招标地点					
描述					

关闭(C)

这一页列出了包括招标方式，期限，发行日期等在内的利率债（国债）详细信息。

通过这些信息，用户可以更全面的了解该证券，详细信息中的参数也是计算标准到期收益率和应记利息的必要条件。

## 5.3 收益率查询

点击查询统计—>收益率查询，进入收益率查询界面。

收益率查询窗口可以对系统中的所有证券进行不同报价的收益率查询，可以选择证券代码，并输入价格，点击查询后系统给出该价格下的收益率，供交易员参考。

收益率相关说明：

- 1、各界面系统提供的到期收益率均为参考数据；
- 2、计算时依据的应计利息为 T+0 的利息值；
- 3、其他涉及到期收益率的部分相关界面如下面各图所示：

主界面上确定报价窗口。



报价信息											
国债现券		公司债现券		信贷ABS		意向申报		协议回购意向			
证券代码	证券简称	报价方	数量	买入	收益率	收益率	卖出	数量	报价方	买方结算场所	卖方结算场所
▶ 131799	信支799	银河证券	100000	100.000	77.6490	77.6490	100.000	10000	银河证券	中央结算	中央结算

主界面上逐笔成交 Tab 页。

[illegible]

主界面上本方成交信息逐笔信息 Tab 页。

买卖方向	净价	成交量	证券名称	对手方	全价	到期收益率	应计利息	成交金额	成交类型	成交编号
卖出	98.000	5000	中移动	招商证券	98.000	1.5513	0	490.00	确定	1

新增确定报价窗口。



**新增报价**

证券代码: 128002    证券简称: 中债登02    结算场所: 中央结算  
 中债代码: 090002    中债简称: 中债登02    结算速度: T+ 0  
 证券账户:    匿名发送: ☐    做市报价: ☐    价格类型: 净价    发布对象: 全市场  
 冰山订单:    手

确定报价区    待定报价区

买入数量	买入价	卖出价	卖出数量	买入数量	买入价	卖出价	卖出数量
5000	100	80	5000	5000	88	89	5000
收益率: 3.5978		9.2201	6.7744		6.4889		

确定(N)    关闭(C)

成交确认窗口。

**确定报价买入**

证券代码: 131799    证券名称: 信支799    账户:    对手方: 银河证券  
 结算场所: 中央结算    中债代码: 131799    中债简称: 信贷专用支持券  
 结算速度: T+ 1    结算日期: 2015-6-15

买卖方向: 卖出    价格类型: 净价  
 价格: 100.000 元    数量: 1000 手  
 参考全价价格: 107.1222 元    参考应计利息: 7.1222  
 参考到期收益率: 77.6490 %    参考结算金额: 107.1222 万元

确定(N)    关闭(C)

确定报价查询界面。

确定报价查询

证券类别：

全部

交易商类型：

全部

起始日期：

2010- 2-23

证券代码：

全部证券

交易商代码：

全部交易商

结束日期：

2010- 2-23

交易员代码：

查询(Q)

重置(R)

上一页(B)

下一页(N)

导出(X)

关闭(C)

买入到期收益率	卖出报价方	卖出价（净价）	卖出数量（手）	卖出成交数量	卖出全价	卖出到期收益率	应计利息
8.8564	招商证券	99.000	5000	0	101.157	6.0298	2.15
1.5513	招商证券	99.000	5000	0	99.000	0.7687	

查询到2条记录

第1页/共1页

每页 30 条记录

转到..Q

1

页

成交明细查询界面。

成交明细查询

证券类别：

全部

证券代码：

全部证券

成交账户：

请输入查询条件

交易员：

全部交易员

起始日期：

2010- 2-23

结束日期：

2010- 2-23

对方交易商：

全部交易商

查询(Q)

重置(R)

上一页(B)

下一页(N)

导出(X)

关闭(C)

成交净价	成交全价	到期收益率	应计利息	成交量(手)	成交金额	交易员	报价类别
98.000	98.000	1.5513	0	5000	490.00	Z11400	确定

查询到1条记录

第1页/共1页

每页 30 条记录

转到..Q

1

页

5.4 基准利率查询

点击查询统计—>基准利率查询，进入基准利率查询界面。

基准利率查询				
	利率类型	利率值	起始日期	结束日期
▶	一年期存款利率	11.2222%	20070425	20070427
共查询到1条记录				

基准利率列表中显示不同时间段不同类型利率的利率值，作为浮动利率计算的基准

基准利率信息包括利率类型，利率值，起始日期，结束日期。当该利率类型的利率值还在当前日期适用，且结束日期未定的情况下，该条信息的结束日期显示为一个极大值。

### 5.5 债券交易参与者限额查询

点击查询统计一>债券交易参与者限额查询，进入限额查询界面。



债券交易参与人限额查询窗口可以对系统中的所有产品对债券交易参与人设置的交易限额进行查询。

限额信息列表列出了所查的产品限额信息，包括产品名称，买卖净限额，已用买卖差限额。

### 5.6 确定报价查询

点击查询统计—>确定报价查询，进入市场确定报价查询界面。

**确定报价查询**

证券类别:  债券交易参与人类型:  起始日期:

证券代码:  债券交易参与人代码:  结束日期:

交易员代码:

报价日期	报价时间	证券代码	证券简称	买入报价方	买入价(净价)	数量(千元面额/份)	买入成交数量	买
2022-06-29	10:21:40	662446	19邳经债	交银施罗	100.200	5000	0	
2022-06-29	10:25:54	761009	私募双边	匿名	101.000	3000	0	

查询到2条记录 第1页/共1页 每页 30 条记录 转到 1 页

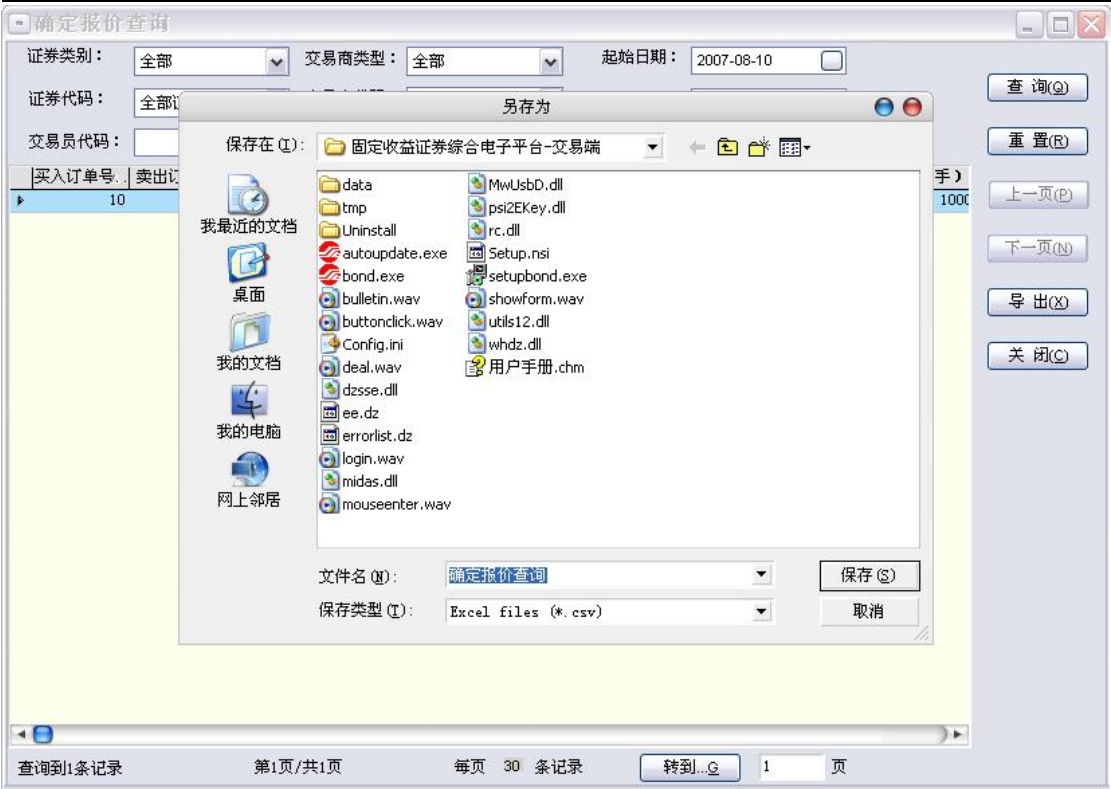
在确定报价查询中可以对全市场参与确定报价交易的信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，起始日期，结束日期，债券交易参与人类型，债券交易参与人代码，交易员代码。点查询后符合相应条件的确定报价交易信息在下方的确定报价信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括买入订单号，卖出订单号，报价日期时间，证券代码、名称，买入和卖出报价方、数量、成交数量、到期收益率，应计利息，中债代码、中债简称、结算场所、结算速度、价格类型、结算日期。将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息。

点击导出可以把查询到的报价信息导出为 EXCEL 文档方便交易员使用。



Microsoft Excel - 确定报价查询.csv

键入需要帮助的问题

文件(F) 编辑(E) 视图(V) 插入(I) 格式(O) 工具(T) 数据(D) 窗口(W) Student Tools 帮助(H)

100%

宋体 12 B I U

A1 买入订单号

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	
1	买入订单号	卖出订单号	报价日期	报价时间	证券代码	证券名称	买入报价	买入价 (元)	买入数量	买入成交价	买入全价	买入到期日	卖出
2	10	11	2007-08-10	09:25:52	019701	招商证券		100	10000	5000	106.556	2.2586	招商
3													
4													
5													
6													
7													
8													
9													
10													
11													
12													
13													
14													
15													
16													
17													
18													
19													
20													
21													
22													
23													
24													
25													
26													
27													
28													
29													
30													

K \确定报价查询/

就绪

数字

## 5.7 待定报价查询

点击查询统计—>待定报价查询，进入市场待定报价查询界面。

在待定报价查询中可以对全市场参与待定报价交易的信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，起始日期，结束日期，债券交易参与人代码，债券交易参与人类型，交易员代码。点查询后符合相应条件的待定报价交易信息在下方的待定报价信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括买入订单号，卖出订单号，报价日期时间，证券代码、名称，买入和卖出报价方、数量、成交数量、到期收益率，应计利息，报价处理状态。

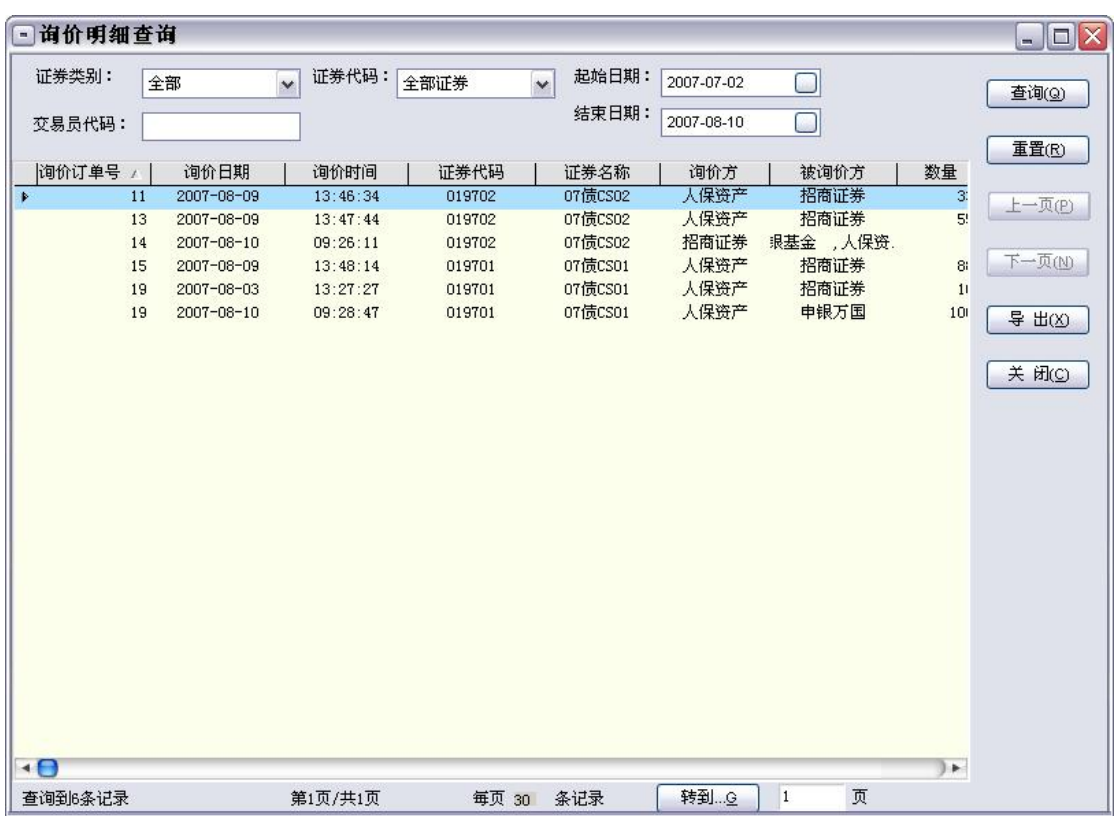
将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击导出可以把查询到的报价信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.8 询价明细查询

点击查询统计—>询价明细查询，进入本方询价查询界面。





在询价明细查询中可以对本方参与询价交易的信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券代码，起始日期，结束日期。点查询后符合相应条件的询价交易信息在下方的询价信息列表中列出。

可以查到的询价信息包括询价订单号，询价日期时间，证券代码、名称，询价方，被询价方，数量，询价处理状态，中债代码，中债简称，结算场所，结算速度，价格类型，结算日期。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.9 成交明细查询

点击查询统计—>成交明细查询，进入本方逐笔成交查询界面。

**成交明细查询**

证券类别: 全部 证券代码: 全部证券 成交账户: 请输入查询条件 查询(Q)

交易员: 全部交易员 起始日期: 2022-06-29 结束日期: 2022-06-29 重置(R)

对方债券交易参与人: 全部债券交易参与人

成交编号	买入订单号	卖出订单号	成交日期	成交时间	证券代码	证券简称	成交账户	买方账户名称	卖方
14	39	43	2022-06-29	11:20:12	762483	T+1私募C	D890158540	无	

上一页 下一页 导出(X) 关闭(C)

查询到1条记录 第1页/共1页 每页 30 条记录 转到...G 1 页

在本方成交明细查询中可以对本方参与的所有成交信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，成交账户，交易员，起始日期，结束日期，对方债券交易参与人。点查询后符合相应条件的本方成交信息在下方的本方成交明细列表中列出。

可以查到的成交信息包括成交编号，买入订单号，卖出订单号，成交日期时间，证券代码、简称，成交账户，买方账户名称，卖方账户名称，买卖方向，对手方，成交净价、全价，到期收益率，应计利息，成交量，成交金额，交易员，报价类型，中债代码，中债简称，结算场所，结算速度，价格类型，结算日期，结算方式。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.10 协议交易查询

点击查询统计—>协议交易查询，进入本方协议交易查询界面。

在协议交易查询中可以对本方参与的协议交易信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券代码，起始日期，结束日期。点查询后符合相应条件的协议交易信息在下方的协议交易信息列表中列出。

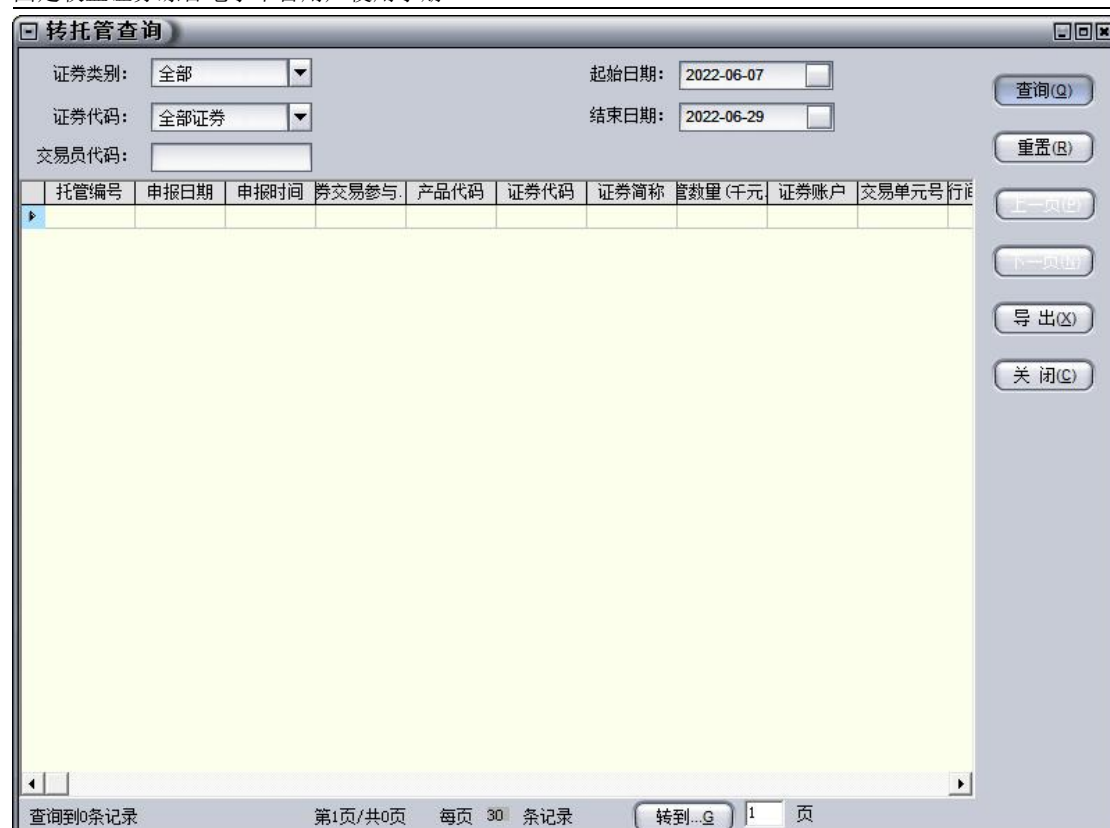
可以查到的协议交易信息包括成交编号，买入订单号，卖出订单号，成交日期，本方账户交易单元，客户账户交易单元，证券代码、名称，买卖方向，成交价格，成交数量，成交金额。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.11 转托管查询

点击查询统计—>转托管查询，进入转托管查询界面。



在转托管查询中可以对本债券交易参与人做的转托管信息做条件查询

在条件查询框中可以设置起始和结束日期、证券类别、证券代码以及交易员代码。点查询后符合相应条件的转托管信息在下方的转托管信息列表中列出。

可以查到的转托管信息包括托管编号，申报日期，产品代码，证券代码、名称，托管数量，证券账户，交易单元，银行间托管账户，状态。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.12 日初持仓明细查询

点击查询统计—>日初持仓明细查询，进入日初持仓明细查询界面。



在日初持仓明细查询中可以对本债券交易参与人的日初持仓信息做条件查询

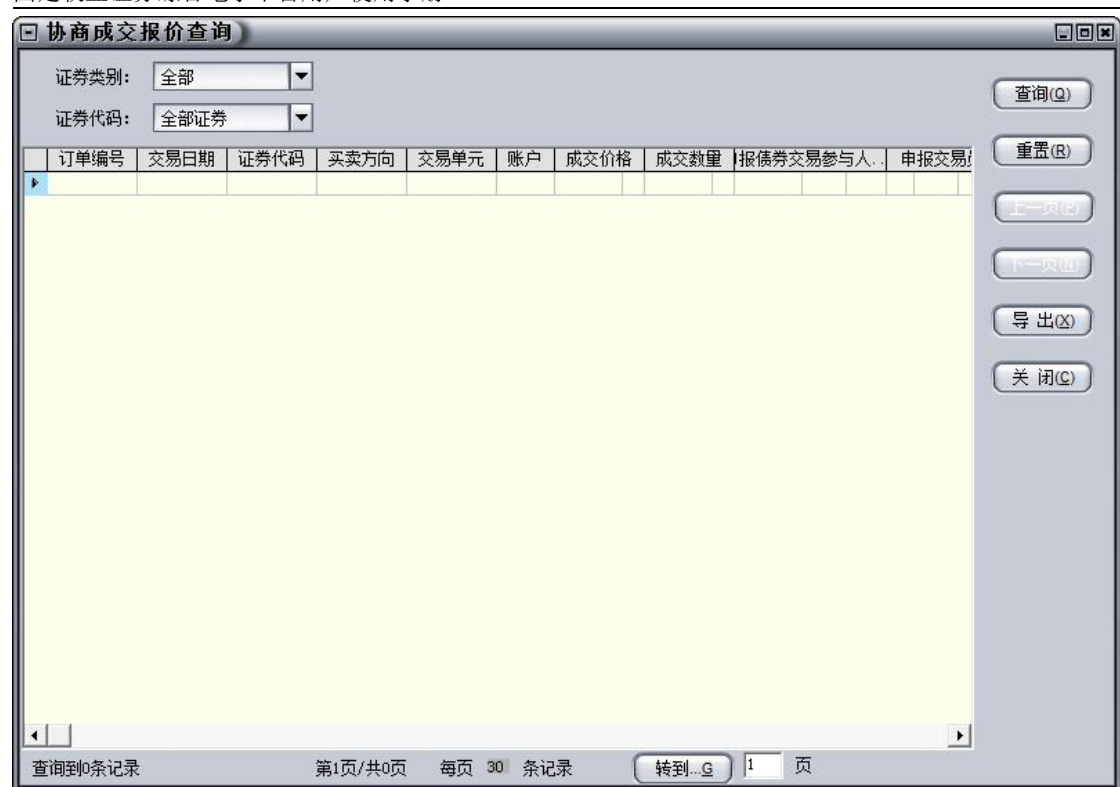
在条件查询框中可以设置证券类别，账户代码。点查询后符合相应条件的日初持仓信息在下方的日初持仓明细信息列表中列出。

可以查到的日初持仓信息包括债券交易参与人，账户，证券代码，日初持仓(手)，现券冻结(手)，卖空额度(手)。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.13 协商成交报价查询

点击查询统计—>协商成交报价查询，进入协商成交报价查询界面。



在协商成交报价查询中可以对本债券交易参与人做的协商成交报价信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码。点查询后符合相应条件的协商成交报价信息在下方的协商成交报价信息列表中列出。

可以查到的协商成交报价信息包括订单编号，交易日期，证券代码，买卖方向、交易单元、账户、成交价格、成交数量、申报债券交易参与人、申报交易员、对手方交易员、约定号、成交状态，中债代码，中债简称，结算场所，结算速度，价格类型，结算日期。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.14 私募债券持有账户数查询

点击查询统计—>私募债券持有账户数查询，进入私募债券持有账户数查询界面。



场务人员和交易人员根据输入的条件查询当日私募债券持有账户数。  
查询条件有：债券代码（只支持私募债，可选择全部或者具体的债券代码）  
显示的属性有：债券代码、持有账户数

### 5.15 意向申报查询

点击查询统计—>意向申报查询，进入意向申报查询界面。



在意向申报查询中可以对本债券交易参与人做的意向申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码。点查询后符合相应条件的意向申报信息在下方的意向申报信息列表中列出。

可以查到的意向申报信息包括订单编号，申报日期，证券代码，买卖方向、意向价格、意向数量、申报债券交易参与人、申报交易员、状态，中债代码，中债简称，结算场所，结算速度，价格类型，结算日期。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.16 协议回购意向申报查询

点击查询统计—>协议回购查询—>意向申报查询，进入协议回购意向申报查询界面。



在协议回购意向申报查询中可以对本债券交易参与者做的协议回购意向申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置质押券代码、状态、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的协议回购意向申报信息在下方的协议回购意向申报信息列表中列出。

可以查到的协议回购意向申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、回购方向、回购期限、质押券代码、质押券简称、回购利率、券面总额、质押数量、折算比例、成交金额、首次交收日、回购到期日、到期交收日、申报债券交易参与者简称、申报交易员代码、申报状态、备注。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.17 协议回购成交申报查询

点击查询统计—>协议回购查询—>成交申报查询，进入协议回购成交申报查询界面。

在协议回购成交申报查询中可以对本债券交易参与人做的协议回购成交申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置质押券代码、状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的协议回购成交申报信息在下方的协议回购成交申报信息列表中列出。

可以查到的协议回购成交申报信息包括回购方向、回购期限、回购利率、回购到期日、质押券代码、质押券简称、质押券数量、折算比例、成交金额、资金利息、到期结算金额、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、申报状态、备注。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.18 协议回购回购到期查询

点击查询统计—>协议回购查询—>回购到期查询，进入协议回购回购到期查询界面。

协议回购回购到期查询

质押券代码：

全部证券

对手方交易商代码：

全部交易商

申报类型：

全部

状态：

全部

开始日期：

2014- 8- 1

结束日期：

2014- 8- 1

查询(Q)

重置(R)

上一步(B)

下一步(N)

导出(X)

关闭(C)

申报编号	申报日期	申报时间	申报类型	回购方向	质押券代码	质押券简称	质押券数量
------	------	------	------	------	-------	-------	-------

查询到0条记录

第1页/共0页 每页 30 条记录

转到...G 1 页

在协议回购回购到期查询中可以对本债券交易参与人做的协议回购回购到期信息做条件查询

在条件查询框中可以设置质押券代码、状态、对手方债券交易参与人代码、申报类型、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的协议回购回购到期信息在下方的协议回购回购到期信息列表中列出。

可以查到的协议回购回购到期信息包括申报编号、申报日期、申报时间、申报类型、回购方向、质押券代码、质押券简称、质押券数量、质押券面值总额、折算比例、到期结算/续做回购利息、原回购利率、续做回购利率、原回购到期日、续做回购到期日、原回购实际占款天数、到期结算金额、提前终止日期、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、申报状态、原成交日期、原成交编号、备注。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.19 协议回购换券申报查询

点击查询统计—>协议回购查询—>换券申报查询，进入协议回购换券申报查询界面。

The screenshot displays the '协议回购换券申报查询' window. At the top, there are search filters: '原质押券现券代码' (Original collateral code) set to '全部证券' (All securities), '对手方交易商代码' (Counterparty code) set to '全部交易商' (All counterparties), '状态' (Status) set to '全部' (All), '新质押券现券代码' (New collateral code) set to '全部证券', '开始日期' (Start date) set to '2014- 8- 1', and '结束日期' (End date) set to '2014- 8- 1'. On the right, there are buttons for '查询(Q)' (Search), '重置(R)' (Reset), '上一张(P)' (Previous), '下一张(N)' (Next), '导出(X)' (Export), and '关闭(C)' (Close). Below the filters is a table with the following columns: '申报订单号' (Declaration order number), '申报日期' (Declaration date), '申报时间' (Declaration time), '回购方向' (Repurchase direction), '新质押券现券代码' (New collateral code), '新质押券现券简称' (New collateral name), and '新质押券质押数量' (New collateral quantity). The table is currently empty. At the bottom, the status bar shows '查询到0条记录' (0 records found), '第1页/共0页' (Page 1 of 0), '每页 30 条记录' (30 records per page), and a '转到...G' (Go to...) button with '1' in the page number field.

在协议回购换券申报查询中可以对本债券交易参与者做的协议回购换券申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置原质押券现券代码、新质押券现券代码、状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的协议回购换券申报信息在下方的协议回购换券申报信息列表中列出。

可以查到的协议回购换券申报信息包括申报订单号、申报日期、申报时间、回购方向、新质押券现券代码、新质押券现券简称、新质押券质押数量、换券质押券面值总额、新质押券折算比例、新成交金额、原回购利率、原回购到期日、正回购债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、备注、申报状态、原成交日期、原成交编号、原质押券现券代码、原质押券现券简称、原质押数量、原质押券面值总额、原折算比例、原实际折算比例、成交金额。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.20 协议回购成交查询

点击查询统计—>协议回购查询—>协议回购成交查询，进入协议回购成交查询界面。

The screenshot shows the '协议回购成交查询' (Agreement Repurchase Transaction Query) window. It features a search area with the following fields:

- 质押券代码: 全部证券 (dropdown)
- 对手方交易商代码: 全部交易商 (dropdown)
- 开始日期: 2014-8-1 (calendar icon)
- 成交类型: 全部 (dropdown)
- 成交编号: (text input)
- 结束日期: 2014-8-1 (calendar icon)

Buttons on the right include: 查询(Q), 重置(R), 上一页(P), 下一页(N), 导出(X), and 关闭(C).

成交类型	成交编号	成交日期	成交时间	回购利率(%)	回购期限(天)	回购到期日	首次交收
成交申报	1	2014-08-01	10:33:44	10.000	5	2014-08-06	2014-08-
成交申报	2	2014-08-01	10:33:44	10.000	5	2014-08-06	2014-08-
成交申报	3	2014-08-01	10:33:44	10.000	5	2014-08-06	2014-08-

At the bottom, it shows '查询到3条记录' (Found 3 records), '第1页/共1页' (Page 1 of 1), '每页 30 条记录' (30 records per page), and a '转到' (Go to) field with '1' and '页' (Page).

在协议回购成交查询中可以对本债券交易参与者做的协议回购成交信息做条件查询

在条件查询框中可以设置质押券代码、成交类型、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期、成交编号。点查询后符合相应条件的协议回购成交信息在下方的协议回购成交信息列表中列出。

可以查到的协议回购成交信息包括成交类型、成交编号、成交日期、成交时间、回购利率、回购期限、回购到期日、首次交收日、到期交收日、质押券现券代码、质押券现券简称、质押数量、质押券面值总额、实际折算比例、成交金额、本期结算利息、到期结算金额、正回购方债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、实际占款天数、补充条款、交收结果、交收结果说明。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按



钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.21 未结算协议回购查询

点击查询统计—>协议回购查询—>未结算协议回购查询，进入未结算协议回购查询界面。



在协议回购未结算协议回购查询中可以对本债券交易参与人做的协议回购未结算协议回购信息做条件查询

在条件查询框中可以设置质押券代码、对手方债券交易参与人代码、未结算类型。点查询后符合相应条件的协议回购未结算协议回购信息在下方的协议回购未结算协议回购信息列表中列出。



在列表中右键鼠标弹出 菜单，选择对应菜单进入对应申报界面中。

可以查到的协议回购未结算协议回购信息包括成交日期、成交编号、回购方向、回购利率、回购到期日、到期结算日、回购期限、实际占款天数、质押券代



码、质押券简称、质押券数量、质押券面值总额、实际折算比例、成交金额、到期结算金额、参考应计利息、正回购债券交易参与人代码、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、逆回购债券交易参与人代码、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、到期状态、已操作类型、质权人名称。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.22 中债托管账户查询

点击查询统计—>中债托管账户查询，进入中债托管账户查询界面。

中债托管账号	中债托管账户名称	投资者类型	管理人名称	托管行名称	交易商代码	交易商名称
00000000031	托管账户简称1	证券公司	管理账户简称1	托管行账户简称1	003	交易商名称
00000000043	托管账户简称1	证券公司	管理账户简称1	托管行账户简称1	003	交易商名称

在中债托管账户查询中可以查询有效的中债托管账户信息做条件查询

在条件查询框中可以设置中债托管账号、债券交易参与人代码。点查询后符合相应条件的有效中债托管账户信息在下方的信息列表中列出。

可以查到的中债托管账号信息包括中债托管账号、中债托管账户名称、投资者类型、管理人名称、托管行名称、债券交易参与人代码、债券交易参与人名称。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.23 中债成交明细打印

点击查询统计—>中债成交明细打印，进入中债成交明细查询打印界面。



可以查到的成交明细信息包括成交日期、成交编号、证券全称、证券代码、证券名称、中债代码、中债简称、净价价格(元)、成交数量(手)、到期收益率(%)、全价(元)、参考应计利息(元)、参考应计利息总额(元)、交易金额(万元)、券面总额(万元)、参考结算金额(万元)、结算速度、结算方式、结算日、买入方名称、卖出方名称、买方债券账户、卖方债券账户、买方资金账户户名、卖方资金账户户名、买方资金开户行、卖方资金开户行、买方资金帐号、卖方资金帐号、买方交易员、卖方交易员、买方联系电话、卖方联系电话。

选择一条数据，点击 打印成交单 按钮可打印成交明细单数据

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.24 换股申报查询

点击查询统计—>换股申报查询，进入换股申报查询界面。



在换股申报查询中可以对本债券交易参与人做的换股申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码、交易员代码。点查询后符合相应条件的换股申报信息在下方的换股申报信息列表中列出。

可以查到的换股申报信息包括申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、换股状态、换股数量、换股价格、证券账户、交易交易单元、交易员代码、债券交易参与人代码、债券交易参与人简称、申报编号。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.25 回售申报查询

点击查询统计—>回售申报查询，进入回售申报查询界面。



在回售申报查询中可以对本债券交易参与人做的回售申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码、交易员代码。点查询后符合相应条件的回售申报信息在下方的回售申报信息列表中列出。

可以查到的回售申报信息包括申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、回售批次号、回售数量、回售价格、证券账户、交易交易单元、交易员代码、债券交易参与人代码、债券交易参与人简称、申报编号、状态。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.26 回售撤销申报查询

点击查询统计—>回售撤销申报查询，进入回售撤销申报查询界面。

在回售撤销申报查询中可以对本债券交易参与者做的回售申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码、交易员代码。点查询后符合相应条件的回售撤销申报信息在下方的回售申报信息列表中列出。

可以查到的回售撤销申报信息包括申报日期、申报时间、证券代码、证券简称、回售批次号、回售数量、证券账户、交易交易单元、交易员代码、债券交易参与者代码、债券交易参与者简称、申报编号、状态。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.27 三方回购数据查询

### 5.27.1 担保品查询

点击三方回购—>数据查询—>担保品查询，进入三方回购担保品申报查询界面。

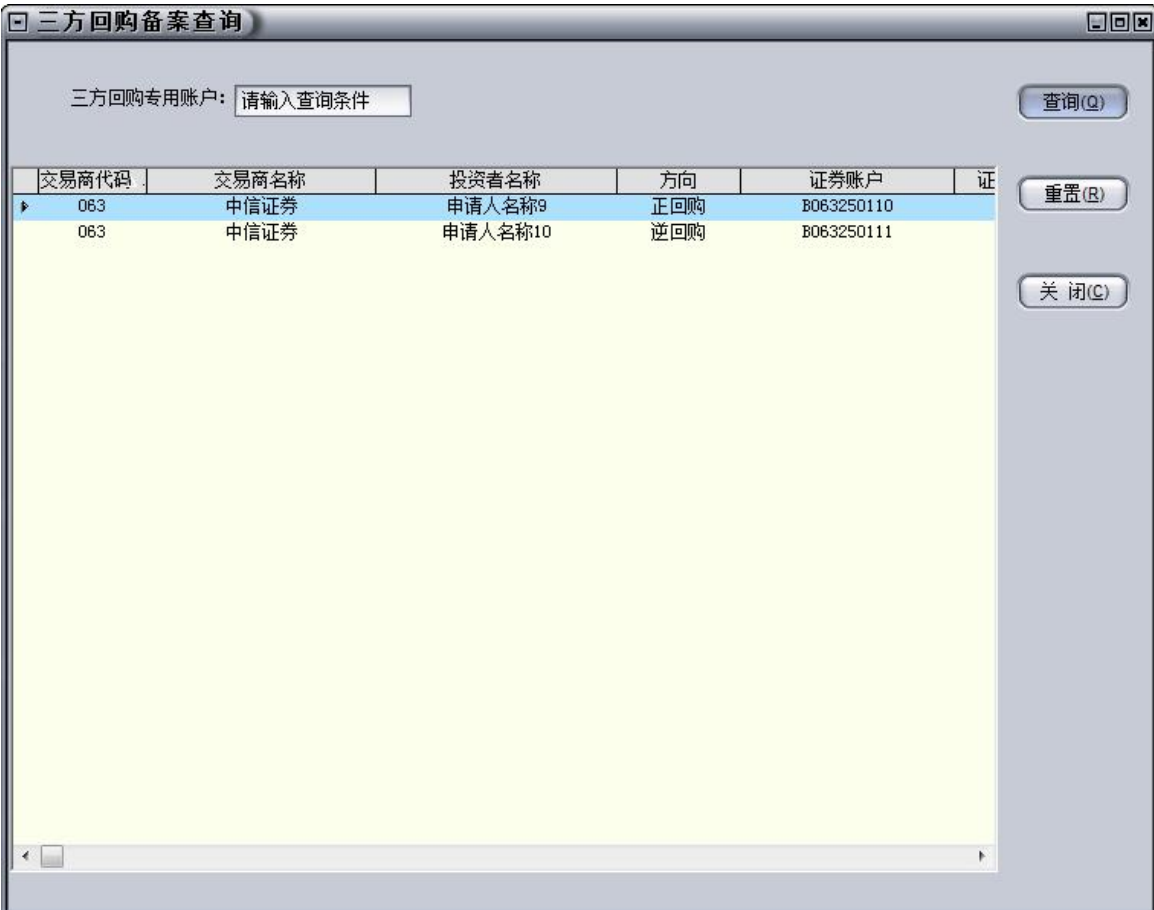


在三方回购担保品查询中可以对本债券交易参与人的担保品按三方回购专用账户条件查询

可以查到的担保品信息包括债券交易参与人代码，债券交易参与人名称，证券账户，证券账户名称，三方回购专用账户，三方回购专用账户名称，投资者名称，质押券代码，质押券名称，数量，已质押登记数量，质押券篮子，折扣率，全价估值，担保价值，已质押登记价值。

### 5.27.2 备案查询

点击三方回购—>数据查询—>备案查询，进入三方回购备案查询界面。



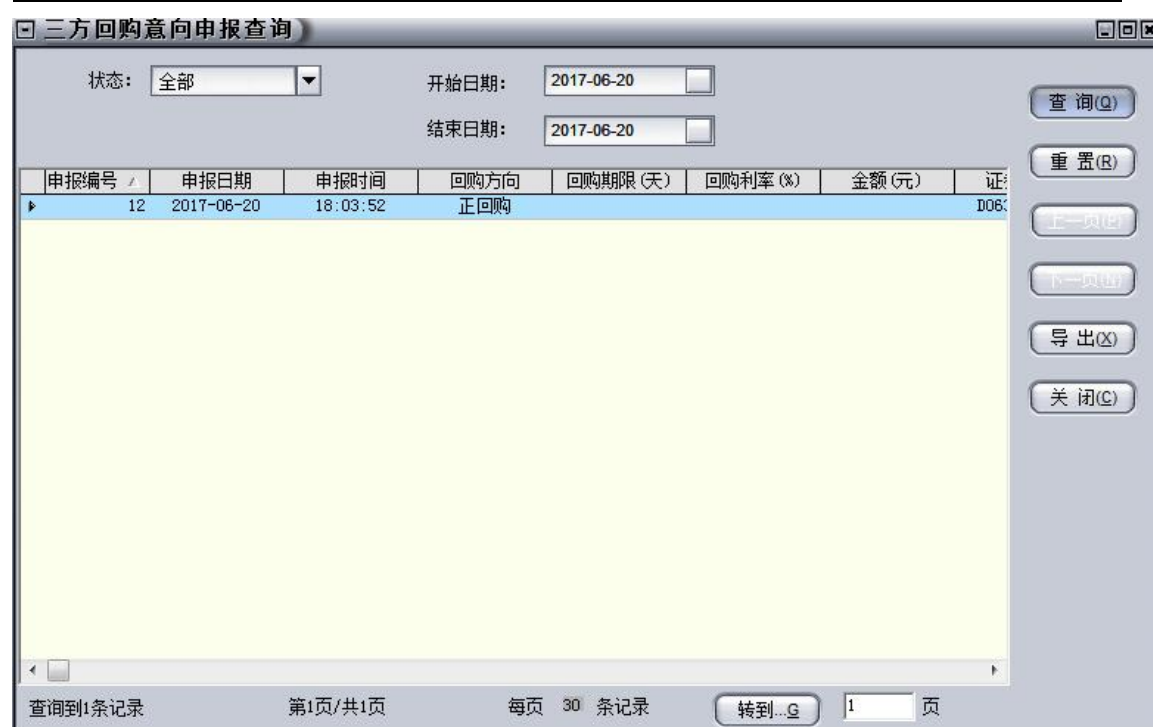
在三方回购备案查询中可以对本债券交易参与人的账户相关备案按三方回购专用账户条件查询

可以查到的备案信息包括债券交易参与人代码，债券交易参与人名称，投资者名称，方向，证券账户，交易单元，证券账户名称，三方回购专用账户，专用账户交易单元，三方回购专用账户名称，三方回购负责人，三方回购日常联络人，三方回购日常联络人联系方式，三方回购日常联络人联系地址，杠杆运作限制，质权人名称，产品委托人，产品管理人，资产托管人。

5.27.3 意向申报查询

点击三方回购—>数据查询—>意向申报查询，进入三方回购意向申报查询界面。





在三方回购意向申报查询中可以对本债券交易参与者做的三方回购意向申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购意向申报信息在下方的三方回购意向申报信息列表中列出。

可以查到的三方回购意向申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、回购方向、回购期限、回购利率、金额、证券账户、账户名称、篮子编码、申报债券交易参与者简称、申报交易员代码、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.27.4 指定对手申报查询

点击三方回购—>数据查询—>协商成交申报查询，进入三方回购指定对手申报查询界面。

在三方回购协商成交申报查询中可以对本债券交易参与人做的三方回购协商成交申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购协商成交申报信息在下方的三方回购成交申报信息列表中列出，双击选中的一条记录可查看该订单的质押券信息。

可以查到的三方回购协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、回购方向、回购期限、回购利率、回购到期日、实际占款天数、违约后担保品是否由质权人处置、回购金额、到期结算金额、回购利息、篮子编码、质押券代码、质押券简称、质押券数量、全价估值、担保价值、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、正回购账户名称、正回购投资者名称、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、逆回购账户名称、逆回购投资者名称、产品委托人、杠杆运作限制、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.27.5 到期购回查询

点击三方回购—>数据查询—>到期购回查询，进入三方回购到期购回查询界面。

在三方回购到期购回查询中可以对本债券交易参与人做的三方回购到期购回信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、申报类型、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购到期购回信息在下方的三方回购到期购回信息列表中列出。

可以查到的三方回购到期购回信息包括申报编号、申报日期、申报时间、申报类型、回购方向、到期结算利息、回购利率、回购到期日、实际占款天数、到期结算金额、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、原成交日期、原成交编号、篮子编码、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.27.6 到期回购查询

点击三方回购—>数据查询—>到期续做查询，进入三方回购到期续做查询界面。

在三方回购到期续做查询中可以对本债券交易参与人做的三方回购到期续做信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购到期续做信息在下方的三方回购到期续做信息列表中列出。

可以查到的三方回购到期续做信息包括申报编号、申报日期、申报时间、申报类型、回购方向、到期结算利息、回购利率、续做回购利率、原回购到期日、续做回购到期日、原回购实际占款天数、到期结算金额、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、原成交日期、原成交编号、篮子编码、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.27.7 换券申报查询

点击三方回购—>数据查询—>换券申报查询，进入三方回购换券申报查询界面。

在三方回购换券申报查询中可以对本债券交易参与者做的三方回购换券申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置换出质押券代码、换入质押券代码、状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购换券申报信息在下方的三方回购换券申报信息列表中列出。

可以查到的三方回购换券申报信息包括申报订单号、申报日期、申报时间、回购方向、换入质押券代码、换入质押券简称、换入质押券数量、回购金额、回购利率、回购到期日、正回购债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、篮子编码、申报状态、原成交日期、原成交编号、换出质押券代码、换出质押券简称、换出质押数量。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.27.8 补券申报查询

点击三方回购—>数据查询—>补券申报查询，进入三方回购补券申报查询界面。

在三方回购补券申报查询中可以对本债券交易参与者做的三方回购补券申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置新质押券代码、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购补券申报信息在下方的三方回购补 券申报信息列表中列出。

可以查到的三方回购补券申报信息包括申报订单号、申报日期、申报时间、回购方向、质押券代码、质押券简称、质押券数量、回购金额、回购利率、回购到期日、正回购债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、篮子编码、申报状态、原成交日期、原成交编号。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.27.9 提前终止查询

点击三方回购—>数据查询—>提前终止查询，进入三方回购提前终止查询界面。

在三方回购提前终止查询中可以对本债券交易参与者做的三方回购提前终止信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购提前终止信息在下方的三方回购提前终止信息列表中列出。

可以查到的三方回购提前终止信息包括申报订单号、申报日期、申报时间、回购方向、到期结算利息、回购利率、回购到期日、实际占款天数、到期结算金额、提前终止日期、正回购债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、原成交日期、原成交编号、篮子编码、申报状态。



查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.27.10 解除质押查询

点击三方回购—>数据查询—>解除质押查询，进入三方回购解除质押查询界面。

在三方回购解除质押查询中可以对本债券交易参与者做的三方回购解除质押信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的三方回购解除质押信息在下方的三方回购解除质押信息列表中列出。

可以查到的三方回购解除质押信息包括申报订单号、申报日期、申报时间、申报类型、回购方向、到期结算利息、回购利率、回购到期日、实际占款天数、到期结算金额、正回购债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、原成交日期、原成交编号、篮子编码、申报状

态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.27.11 三方回购成交查询

点击三方回购—>数据查询—>三方回购成交查询，进入三方回购成交查询界面。

在三方回购成交查询中可以对本债券交易参与人做的三方回购成交信息做条件查询

在条件查询框中可以设置成交类型、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期、成交编号。点查询后符合相应条件的三方回购成交信息在下方的三方回购成交信息列表中列出。

可以查到的三方回购成交信息包括成交类型、成交编号、成交日期、成交时

间、回购利率、回购期限、回购到期日、首次结算日、到期结算日、回购金额、回购利息、到期结算金额、正回购方债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、实际占款天数、补充约定、篮子编码。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.27.12 未结算三方回购查询

点击三方回购—>数据查询—>未结算三方回购查询，进入未结算三方回购查询界面。

在未结算三方回购查询中可以对本债券交易参与者做的未结算三方回购信息做条件查询，双击选中的一条记录可查看详细信息。

三方回购未结算查看

正回购交易商  
中信证券

正回购交易员代码  
Z06300

正回购证券账户  
D063250110

正回购账户名称  
063专用账户9

正回购交易单元  
25011

正回购投资者名称  
申请人名称9

正回购产品委托人  
产品委托人9

正回购杠杆运作限制  
杠杆运作限制9

交易信息

回购期限  
7天

成交日  
2017-06-13

回购到期日  
2017-06-20

到期结算日  
2017-06-20

实际占款天数  
7天

回购利率(%)  
4.800

回购金额  
3,300,000.00元

回购利息  
3037.81元

到期结算金额  
3,303,037.81元

逆回购交易商  
联合证券

逆回购交易员代码  
Z07300

逆回购证券账户

逆回购账户名称  
073普通账户12

逆回购交易单元

逆回购投资者名称

逆回购产品委托人

逆回购杠杆运作限制

质押券篮子

☒ B001-利率利率类

☒ B002-AAA(公)

☐ B003-AA+(公)

☐ B004-AA(公)

☐ B005-AAA(私)

☒ B006-AA+(私)

☒ B007-AA(私)

☐ B008-其他

违约后担保品是否由质权人处置  
是

担保价值合计(元)  
3,000,000.00

已操作类型  
未操作

到期状态  
当日到期

成交编号  
13

质权人名称  
质权人名称28

交收编号  
2017061300000013

补充约定

质押券代码	质押数量(手)	专户账号	担保价值(元)
010107	1000	D063250110	1000000.000
151000	2000	D063250110	2000000.000

在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与人代码、未结算类型。点查询后符合相应条件的未结算三方回购信息在下方的未结算三方回购信息列表中列出。

在列表中右键鼠标弹出菜单，选择对应菜单进入对应申报界面中。

可以查到的未结算三方回购信息包括成交日期、成交编号、回购方向、回购利率、回购到期日、到期结算日、回购期限、实际占款天数、回购金额、到期结算金额、参考回购利息、正回购债券交易参与人代码、正回购债券交易参与人简称、正回购交易员代码、正回购证券账户、正回购交易单元、正回购账户名称、正回购投资者名称、正回购产品委托人、正回购杠杆运作限制、逆回购债券交易参与人代码、逆回购债券交易参与人简称、逆回购交易员代码、逆回购证券账户、逆回购交易单元、逆回购账户名称、逆回购投资者名称、逆回购产品委托人、逆回购杠杆运作限制、质权人名称、违约后担保品是否由质权人处置、交收编号、

©上海证券交易所-202-

- 325 -

PROJ-FISP-UG

篮子编码、质押券合计担保价值、质押券代码、质押数量、专户账号、估值、到期状态、原补充约定、已操作类型。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.27.13 三方回购交收查询

点击三方回购—>数据查询—>三方回购交收查询，进入三方回购交收查询界面。

交收类型	成交编号	成交日期	成交时间	回购利率(%)	回购期限(天)	回购到期日	首次结算
1		2017-06-30	14:54:29	2.600	3	2017-07-03	2017-06-30

在三方回购交收查询中可以对本债券交易参与者做的三方回购交收信息做条件查询

在条件查询框中可以设置交收类型、对手方债券交易参与者代码、成交编号。点查询后符合相应条件的三方回购交收信息在下方的三方回购交收信息列表中列出。

可以查到的三方回购交收信息包括交收类型、成交编号、成交日期、成交时间、回购利率、回购期限、回购到期日、首次结算日、到期结算日、回购金额、

回购利息、到期结算金额、正回购方债券交易参与者简称、正回购方交易员代码、正回购方账户、正回购方交易单元、逆回购债券交易参与者简称、逆回购方交易员代码、逆回购方账户、逆回购方交易单元、买方实际交收金额、卖方实际交收金额、实际占款天数、交收结果、交收说明。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.28 双非可转债转股申报查询

点击查询统计—>双非可转债转股申报查询，进入双非可转债转股申报查询界面。

在双非可转债转股申报查询中可以对本债券交易参与者做的双非可转债转股申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码、交易员代码。点查询后符合相应条件的双非可转债转股申报信息在下方的双非可转债转股申报信息列表中列出。

可以查到的双非可转债转股申报信息包括申报日期，申报时间、证券代码，



证券简称、转股状态、转股数量、转股价格、证券账户、交易交易单元、交易员代码、债券交易参与人代码、债券交易参与人简称、申报编号、申报类型、状态。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.29 现券 RTGS 交收结果查询

查询结果中包含 RTGS 结算方式的现券及信用保护凭证协商成交成交及交收结果信息。

点击查询统计一>现券 RTGS 交收结果查询，进入现券 RTGS 交收结果查询界面。

现券RTGS交收结果查询

证券类别：

全部

证券代码：

全部证券

成交账户：

请输入查询条件

交易员：

全部交易员

对方交易商：

全部交易商

查询(Q)

重置(R)

上一页(U)

下一页(N)

导出(X)

关闭(C)

成交编号	买入订单号	卖出订单号	成交日期	成交时间	证券代码	证券简称	成交账户	买卖方向	对手方
------	-------	-------	------	------	------	------	------	------	-----

第1页/共0页 每页 30 条记录 转到...G 1 页

在现券 RTGS 交收结果查询中可以对本债券交易参与人做的现券 RTGS 交收结果信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券类别、证券代码、交易员代码。点查询后符合相应条件的现券 RTGS 交收结果信息在下方的现券 RTGS 交收结果信息列表中列出。

可以查到的现券 RTGS 交收结果信息包括申报日期，成交编号、买入订单编号、卖出订单编号、成交日期、成交时间、证券代码、证券简称、成交账户、买卖方向、状态等。



点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.30 信用保护（合约）查询

### 5.30.1 协商成交申报查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>协商成交申报查询，进入 CDS 协商成交申报查询界面。

在协商成交申报查询中可以对本债券交易参与者做的协商成交申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与者、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与者、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

5.30.2 提前终止申报查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>提前终止申报查询，进入 CDS 提前终止申报查询界面。

CDS指定申报查询

状态：

全部

对手方交易商代码：

全部交易商

开始日期：

2015-07-05

结束日期：

2017-07-05

查询(Q)

重置(R)

上一页(B)

下一页(N)

导出(X)

关闭(C)

前端费用	前端费用支付日	参考实体	参考实体主体评级	约定回收率	补充约定	申报状态
1600.123	2018-10-10	参考实体	AAA	25.000	补充约定	成交
1600.123	2018-10-10	参考实体	AAA	25.000	补充约定	成交
100000	2017-07-01	重工	AAA	0	ssssss	成交
-999999999999	2017-07-01	SDNFSN	AA+	0	lgareaaaaaa.	成交
651651651	2017-07-01	POS	AAA	0	noininddns.	成交
555541	2017-07-20	东方人2	AA+	25.000	里扩大农if.	成交
651411561651	2017-07-18	是的发送给	AAA	23.120	打的费	成交
561552600	2017-07-01	收到没	AA	25.000	地杆傻大个.	成交

查询到8条记录

第1页/共1页

每页 30 条记录

转到...G

1

页

在提前终止申报查询中可以对本债券交易参与人做的提前终止申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日，截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.30.3 信用事件申报查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>信用事件申报查询，进入 CDS 信用事件申报查询界面。

在信用事件申报查询中可以对本债券交易参与者做的信用事件申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与者、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与者、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.30.4 合约了结申报查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>合约了结申报查询，进入 CDS 合约了结申报查询界面。

在合约了结申报查询中可以对本债券交易参与者做的合约了结申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与者代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与者、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与者、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、申报状态。

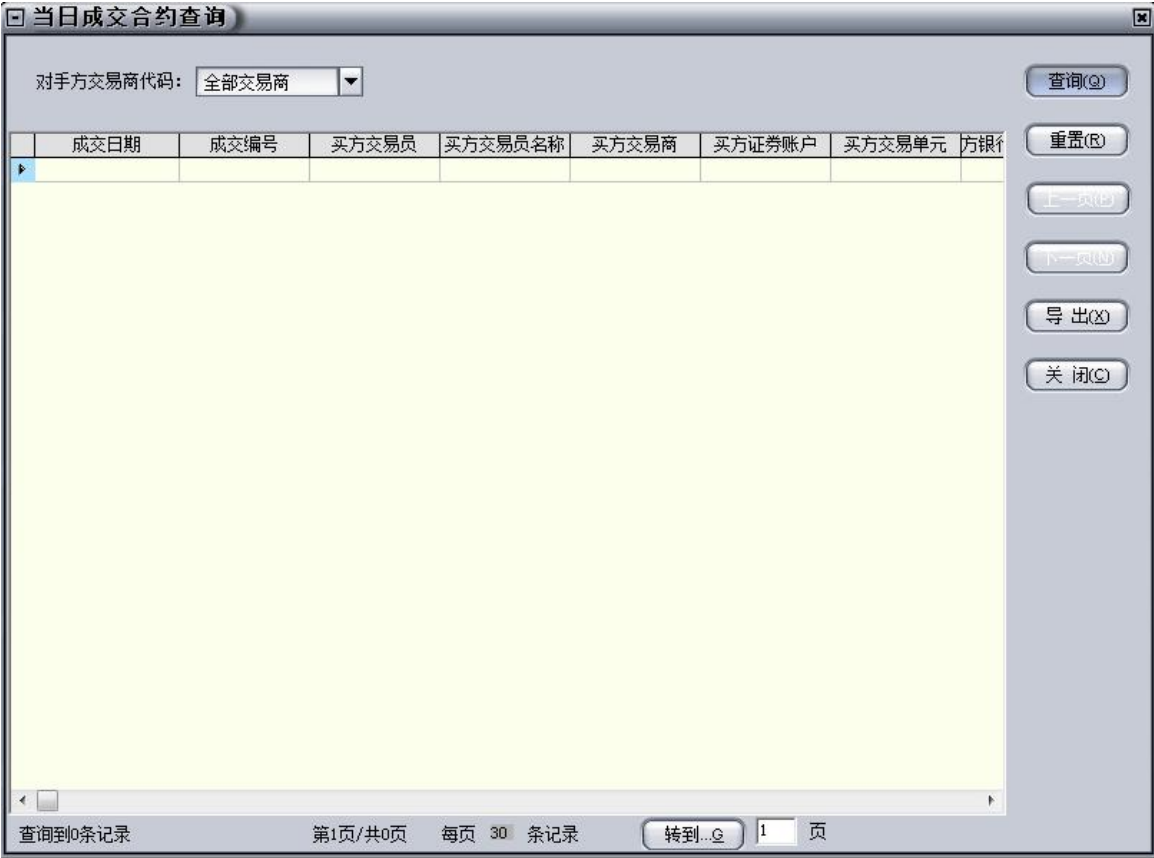
查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按

钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

5.30.5 当日合约成交查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>当日合约成交查询，进入 CDS 合约了结申报查询界面。



在当日成交合约查询中可以对本债券交易参与者做的成交合约申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与者代码。点击查询按钮可以查到的成交信息包括成交日期、成交编号、买方交易员、买方交易员名称、买方债券交易参与者、买方债券交易参与者、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与者、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、合约状态、当日使用标志。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.30.6 合约汇总查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>合约汇总查询，进入 CDS 合约汇总查询界面。

成交日期	信用等级AAA	AAA名义本金	AAA加权平均价	信用等级AA	AA名义本金	AA加权平均价
2017-06-30	AAA	400.00	333.00	AA+	0	0
2017-07-01	AAA	63612657600.00	6.00	AA+	100000004900.00	148.00
2017-07-03	AAA	65485419900.00	353.00	AA+	100.00	0.00

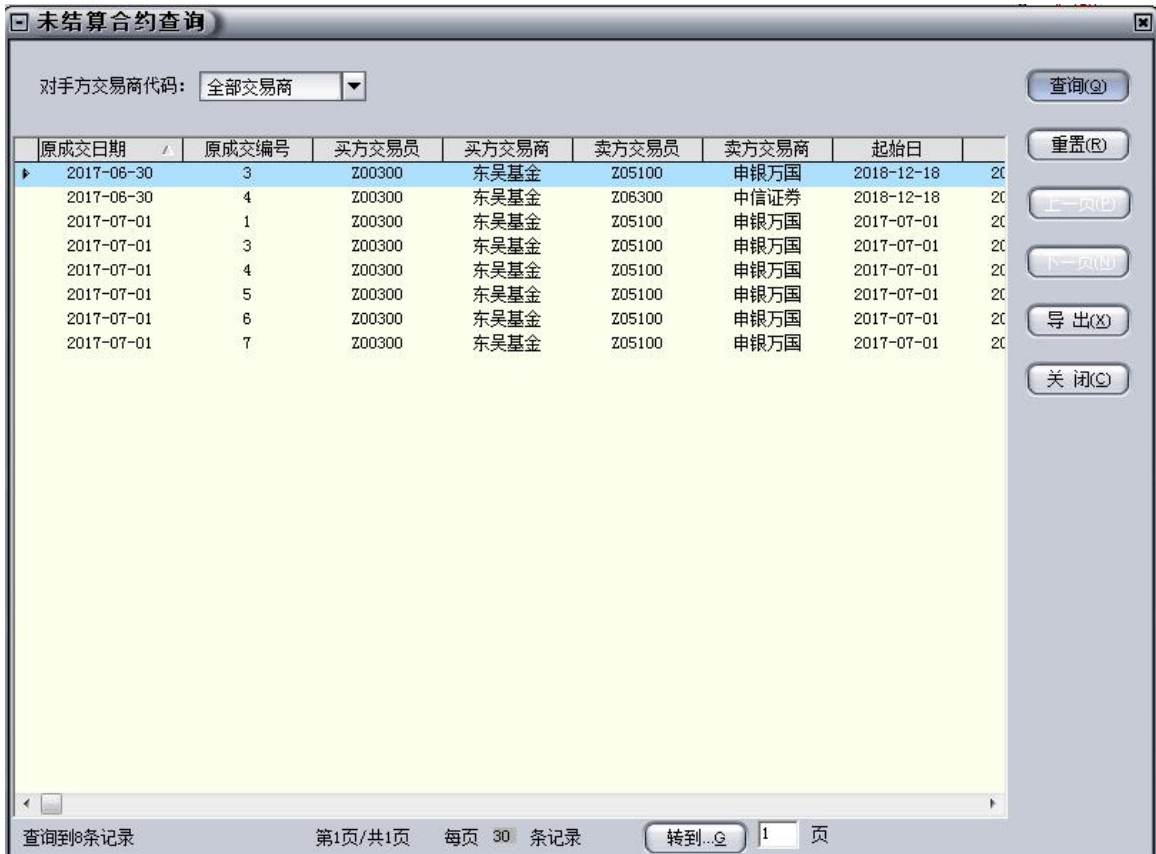
在条件查询框中可以设置开始日期、结束日期。

点击查询按钮可以查到的合约汇总的信息包括成交日期、信用等级 AAA、AAA 名义本金、AAA 加权平均价、信用等级 AA、AA 名义本金、AA 加权平均价、信用等级 A、A 名义本金、A 加权平均价、当日总成交名义本金。

### 5.30.7 未结算合约查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>未结算合约查询，进入 CDS 未结算合约查询界面。





在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与人代码。

点击查询按钮可以查到的未结算合约的信息包括原成交日期、原成交编号、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日，截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、合约状态、当日使用标志。

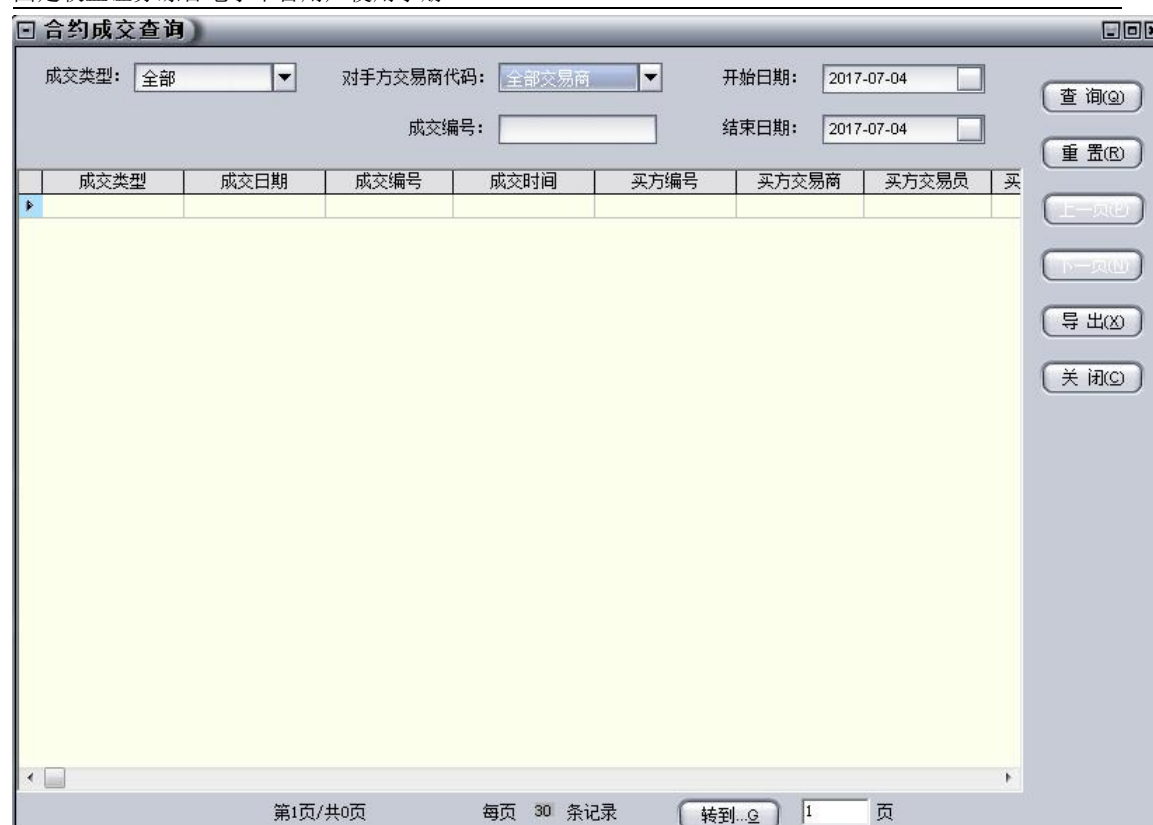
查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.30.8 成交合约查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>成交合约查询，进入 CDS 成交合约查询界面。





在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与人代码。

点击查询按钮可以查到的未结算合约的信息包括成交类型、成交日期、成交编号、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、原成交日期、原成交编号。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.30.9 核心债券交易参与人查询

点击查询统计—>信用保护（合约）查询—>核心债券交易参与人查询，进入 CDS 核心债券交易参与人查询界面。



在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与人代码。

点击查询按钮可以查到的核心债券交易参与人的信息包括债券交易参与人、债券交易参与人简称。

## 5.31 信用保护(凭证)查询

### 5.31.1 协商成交申报查询

击查询统计—>信用保护（凭证）查询—>协商成交申报查询，进入指定对手申报查询界面。

在协商成交申报查询中可以对本债券交易参与者做的协商成交申报信息做条件查询

在条件查询框中可以对证券代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、订单号、约定号、证券代码、买卖方向、数量、价格、账户、账户名称、名义本金、保护费、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.32 合并申报查询

点击查询统计—>合并申报查询，进入合并申报查询界面。

在合并申报查询中可以对本债券交易参与者做的合并申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的合并申报信息在下方的列表中列出。

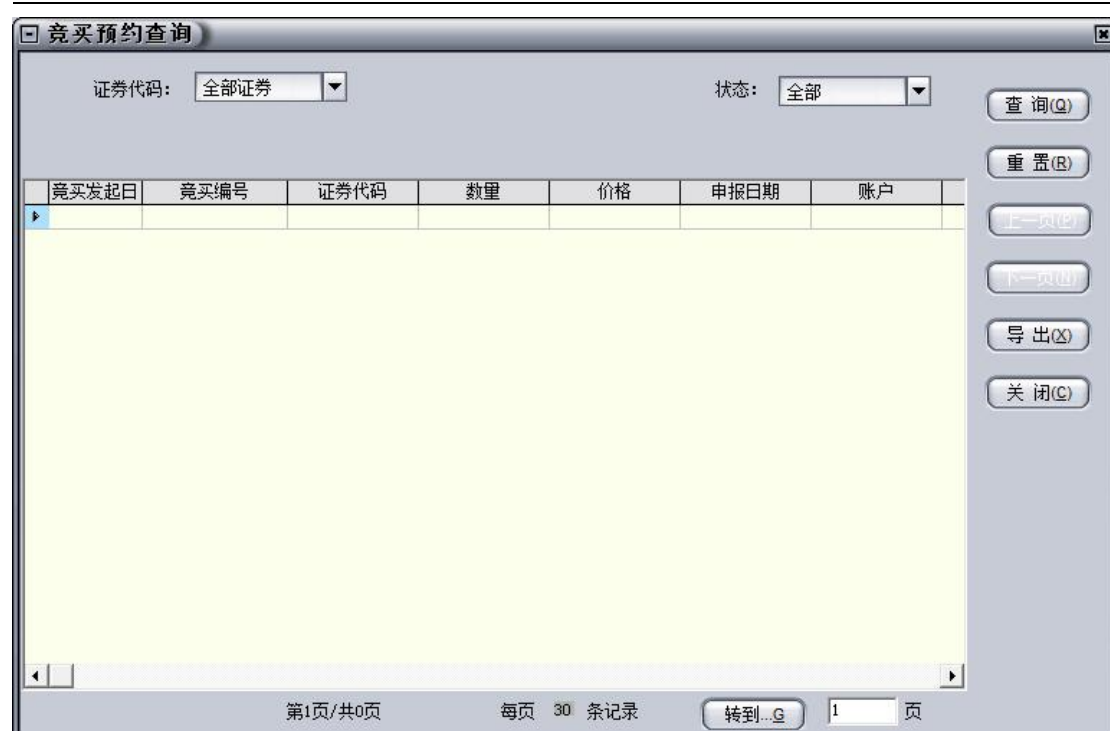
可以查到的合并申报信息包括申报编号、订单编号、申报日期、时间、证券代码、证券简称、数量、价格、方向、账户、交易单元、订单状态、结算方式。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.33 竞买预约查询

点击查询统计—>竞买预约查询，进入竞买预约查询界面。



在竞买预约查询中可以对本债券交易参与者做的竞买预约信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券代码、状态。点查询后符合相应条件的竞买预约信息在下方的列表中列出。

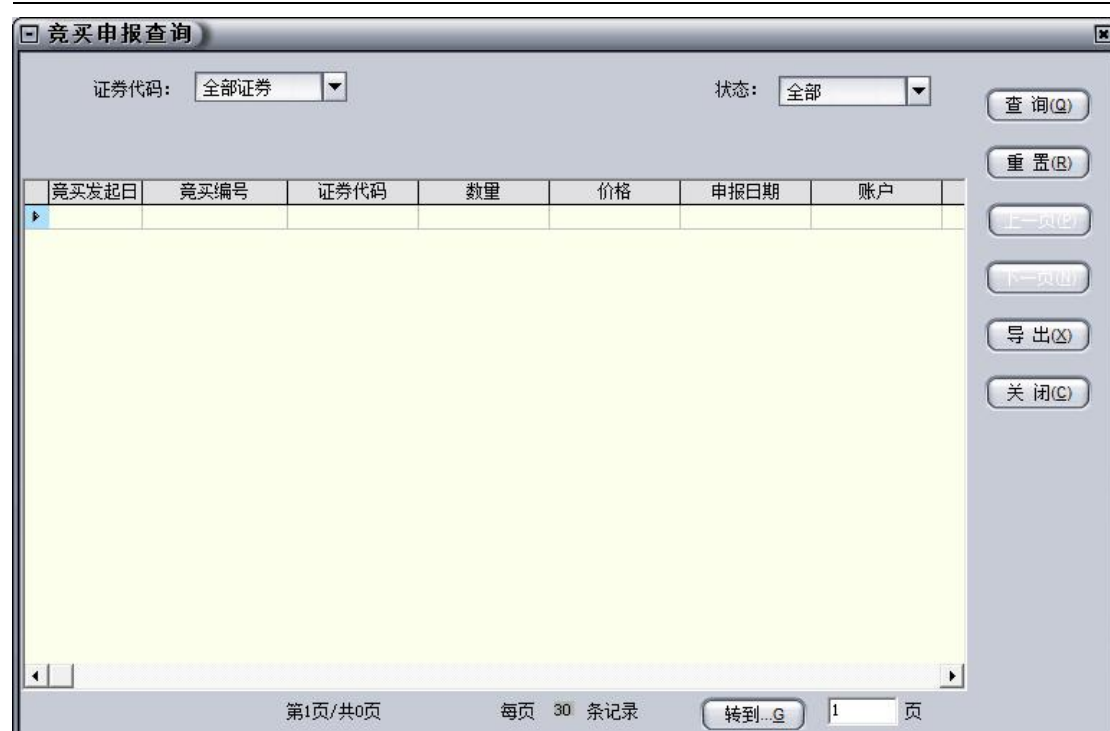
可以查到的竞买预约信息包括竞买发起日、竞买编号、证券代码、数量、价格、方向、账户、交易单元、状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.34 竞买申报查询

点击查询统计—>竞买申报查询，进入竞买申报查询界面。



在竞买申报查询中可以对本债券交易参与者做的竞买申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券代码、状态。点查询后符合相应条件的竞买申报信息在下方的列表中列出。

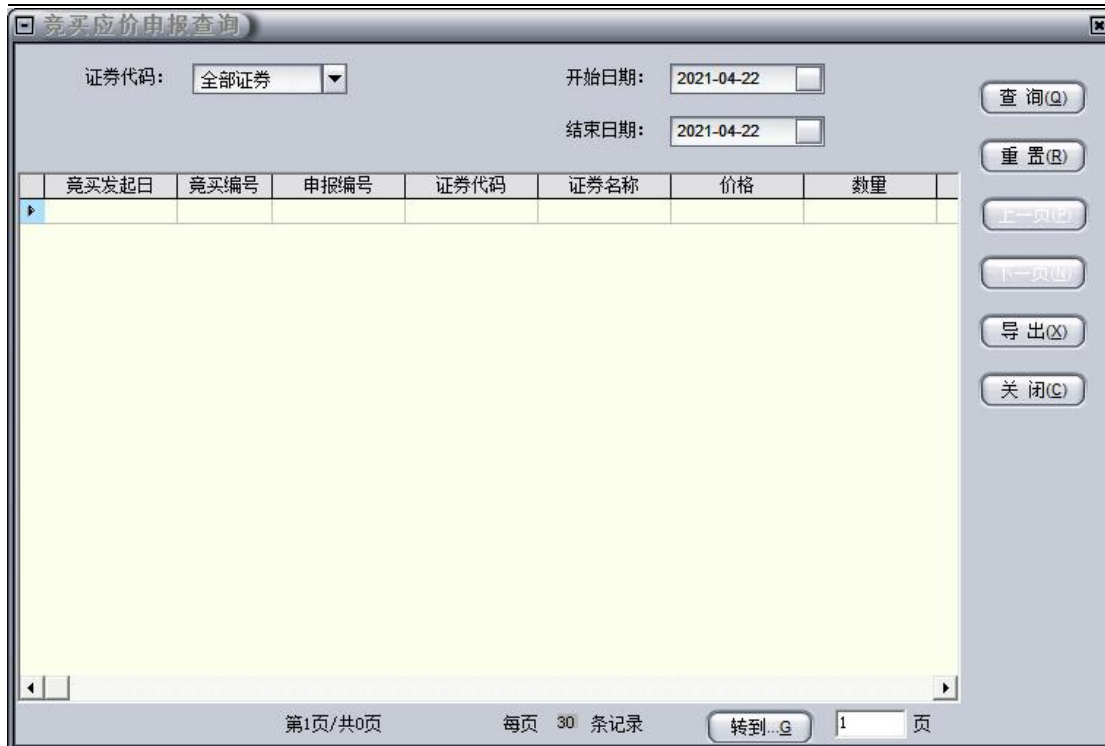
可以查到的竞买申报信息包括竞买发起日、竞买编号、申报日期、证券代码、数量、价格、账户、交易单元、状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 5.35 竞买应价申报查询

点击查询统计—>竞买应价申报查询，进入竞买应价申报查询界面。



在竞买应价申报查询中可以对本债券交易参与者做的竞买应价申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置证券代码、开始日期、结束日期。点查询后符合相应条件的竞买应价申报信息在下方的列表中列出。

可以查到的竞买应价申报信息包括竞买发起日、竞买编号、申报编号、证券代码、证券名称、数量、价格、账户、交易单元、状态、结算方式。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

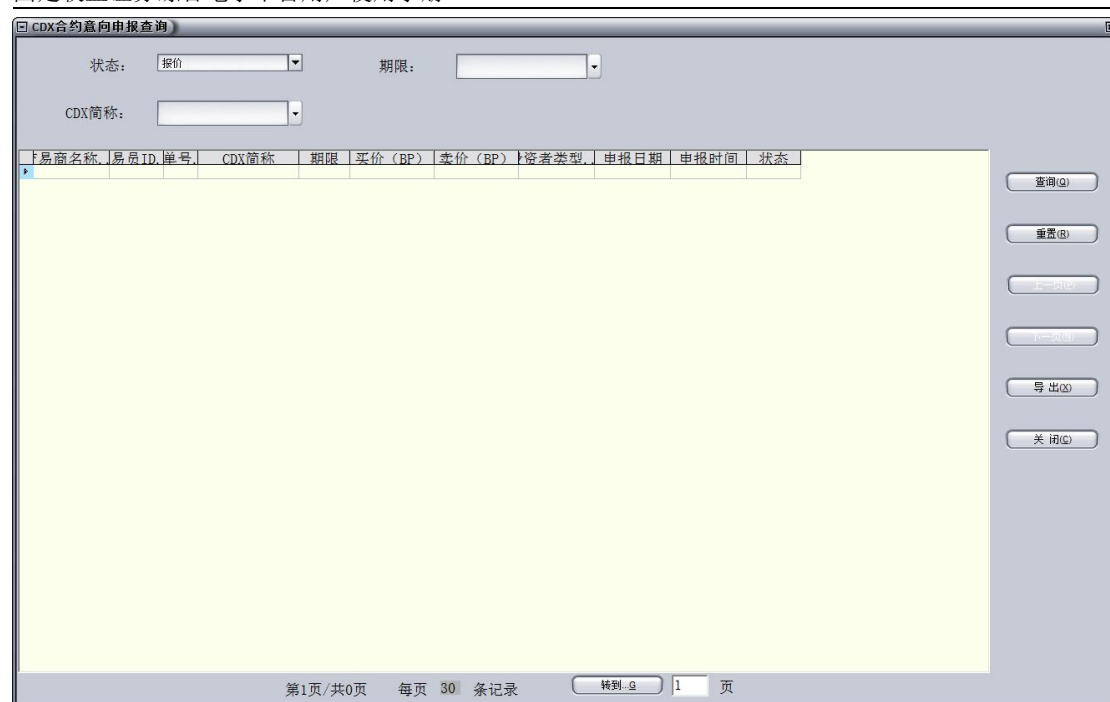
点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36 组合信用保护（合约）查询

### 5.36.1 CDX 意向申报查询

菜单路径: 查询统计—>组合信用保护合约查询—>CDX 合约意向申报查询。





在意向申报查询中可以对本债券交易参与人当天做的意向申报信息做条件查询

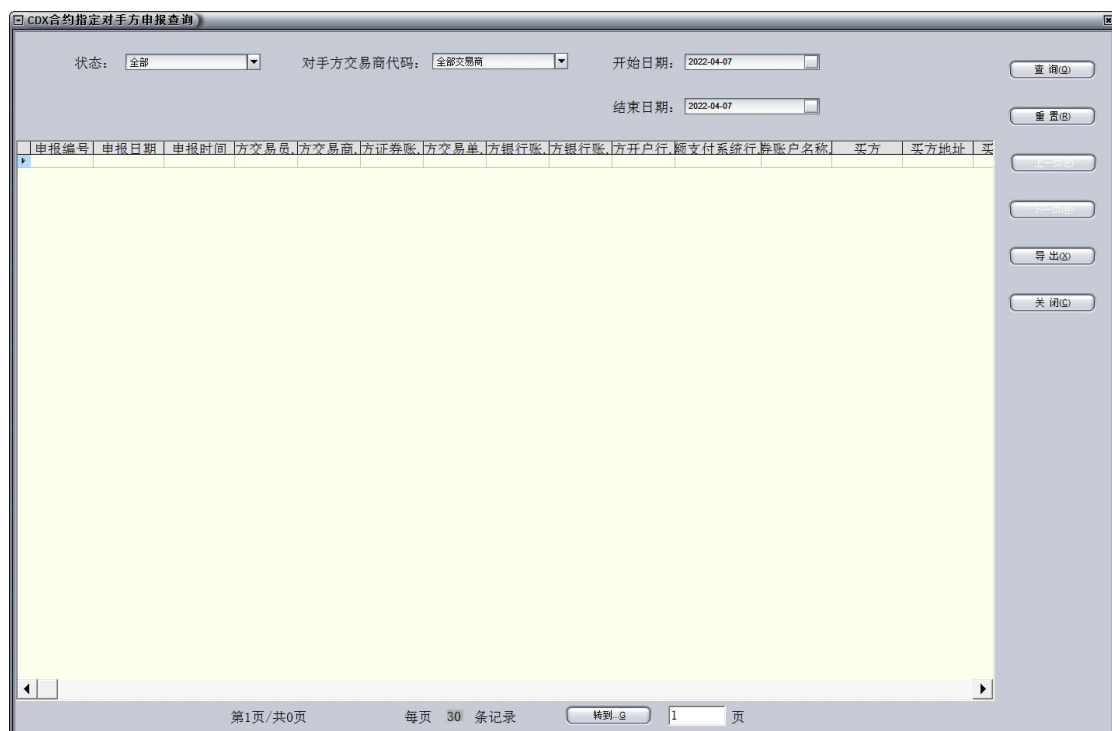
在条件查询框中可以设置状态、期限、CDX 简称。点击查询按钮可以查到的意向申报信息包括债券交易参与人名称、交易员、账户、CDX 简称、期限、买价、卖价、投资者类型、申报日期、申报时间、状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36.2 CDX 协商成交申报查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>协商成交申报查询。



在协商成交申报查询中可以对本债券交易参与人做的协商成交申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36.3 CDX 提前终止申报查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>提前终止申报查询。

提前终止申报查询

状态: 全部 对手方交易商代码: 全部交易商 开始日期: 2022-04-07 结束日期: 2022-04-07

查询(Q) 重置(R) 导出(O) 关闭(C)

申报编号	申报日期	申报时间	方交易员	方交易商	方证券账	方交易单	方银行账	方银行账	方开户行	额支付系统行	券账户名称
------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	--------	-------

第1页/共0页 每页 30 条记录 转到 1 页

在提前终止申报查询中可以对本债券交易参与人做的提前终止申报信息做条件查询

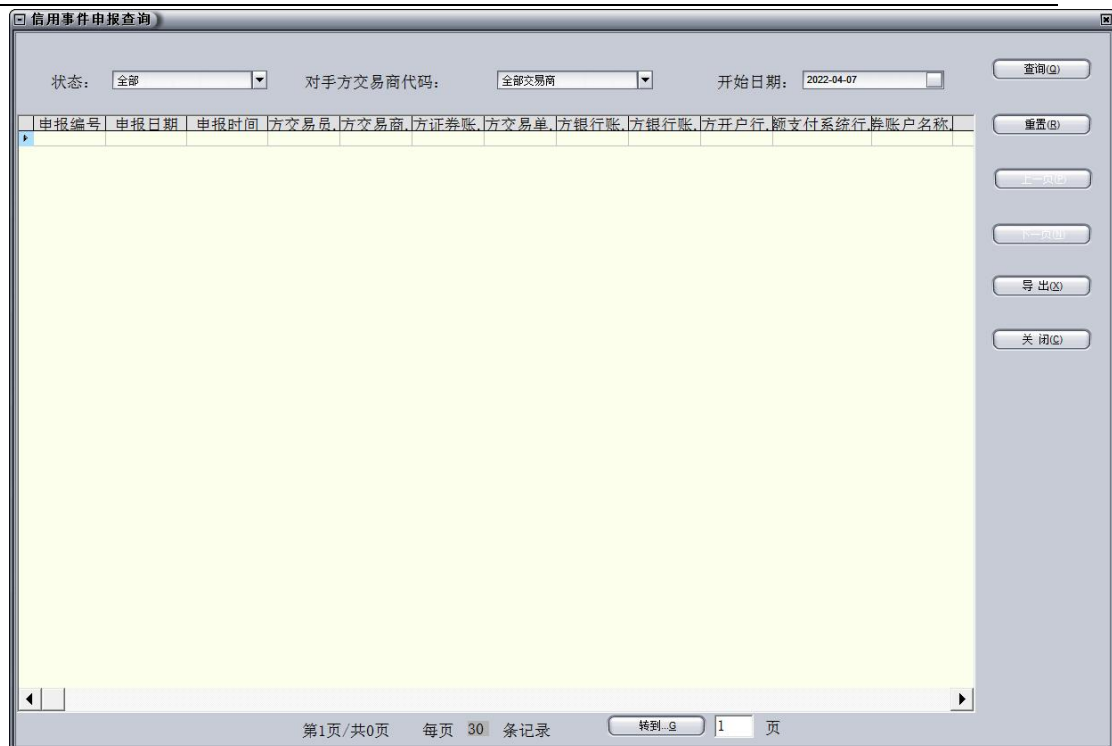
在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

#### 5.36.4 CDX 信用事件申报查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>信用事件申报查询。



在信用事件申报查询中可以对本债券交易参与人做的信用事件申报信息做条件查询

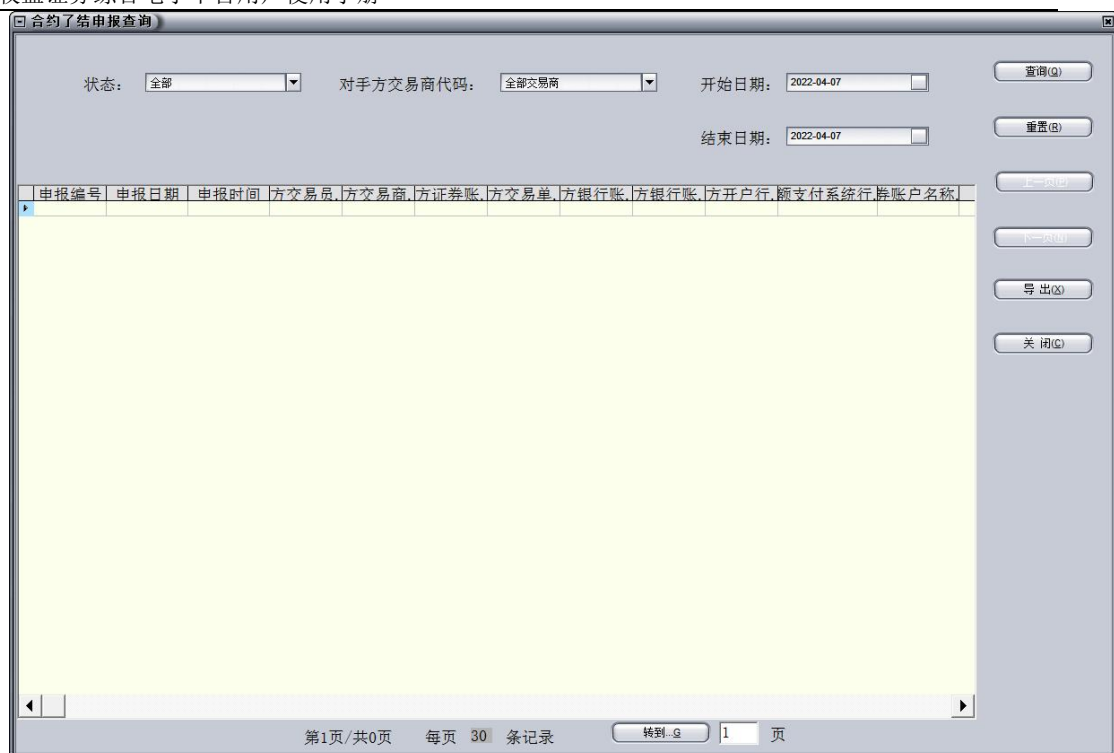
在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36.5 CDX 合约了结申报查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>合约了结申报查询。



在合约了结申报查询中可以对本债券交易参与人做的合约了结申报信息做条件查询

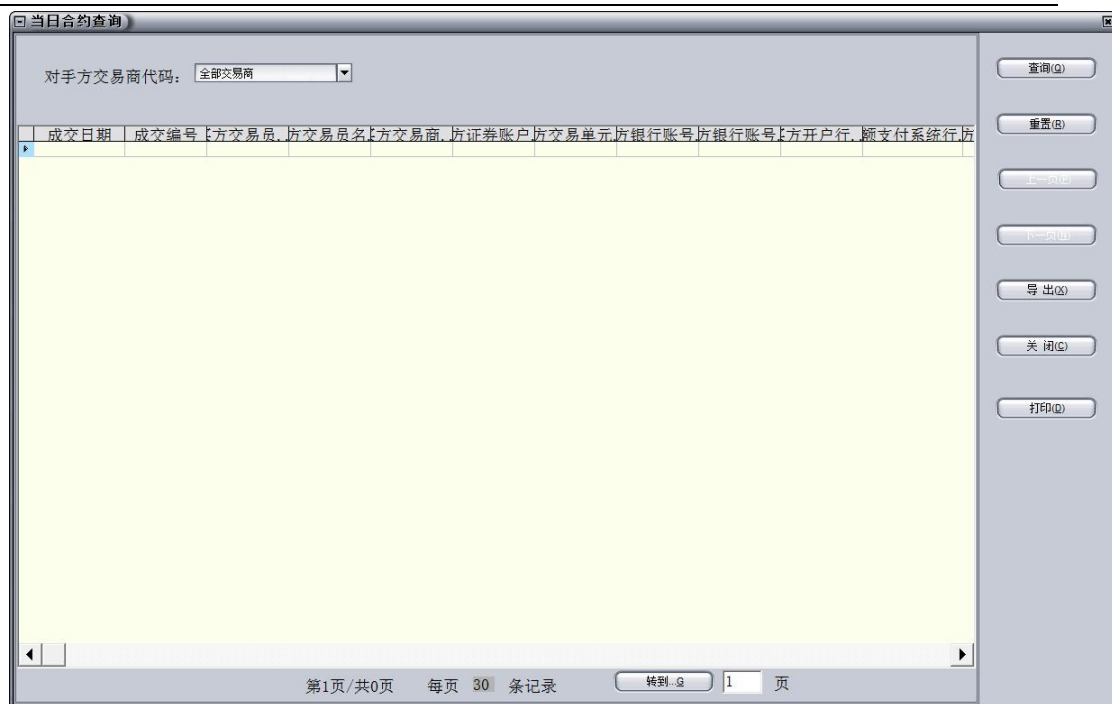
在条件查询框中可以设置状态、对手方债券交易参与人代码、开始日期、结束日期。点击查询按钮可以查到的协商成交申报信息包括申报编号、申报日期、申报时间、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、申报状态。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档

### 5.36.6 CDX 当日合约查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>当日合约查询。



在当日成交合约查询中可以对本债券交易参与者做的成交合约申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与者代码。点击查询按钮可以查到的成交信息包括成交日期、成交编号、买方交易员、买方交易员名称、买方债券交易参与者、买方债券交易参与者、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与者、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、合约状态、当日使用标志。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36.7 CDX 合约汇总行情

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>合约汇总行情。

合约汇总行情

开始日期：

2022-04-07

结束日期：

2022-04-07

查询(Q)

成交日期	信用等级AAA	A名义本金	A加权平均	信用等级AA+	+名义本金	+加权平均	信用等级AA-	/其他名义	/其他加权	日

<

共查询到0条记录

>

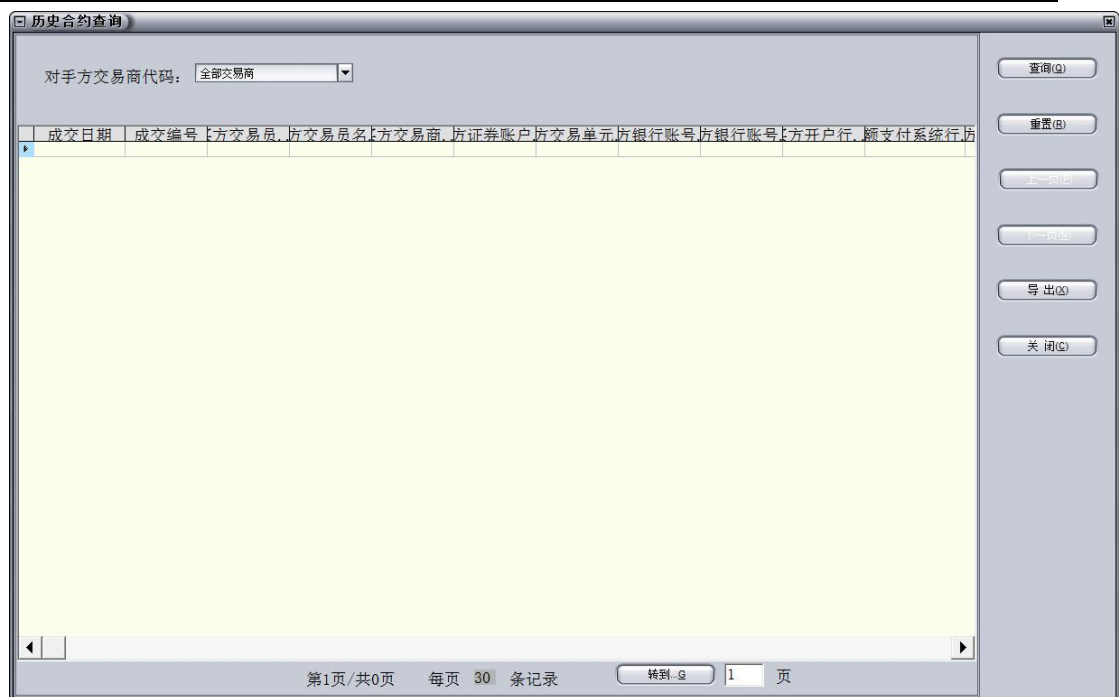
在条件查询框中可以设置开始日期、结束日期。

点击查询按钮可以查到的合约汇总的信息包括成交日期、信用等级 AAA、AAA 名义本金、AAA 加权平均价、信用等级 AA、AA 名义本金、AA 加权平均价、信用等级 A、A 名义本金、A 加权平均价、当日总成交名义本金。

### 5.36.8 CDX 历史合约查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>历史合约查询。





在历史合约查询中可以对本债券交易参与人做的历史合约申报信息做条件查询

在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与人代码。点击查询按钮可以查到的成交信息包括成交日期、成交编号、买方交易员、买方交易员名称、买方债券交易参与人、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、合约状态、当日使用标志。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36.9 CDX 合约成交查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>合约成交查询。

在条件查询框中可以设置成交类型、对手方债券交易参与人代码、成交编号、开始日期、结束日期。

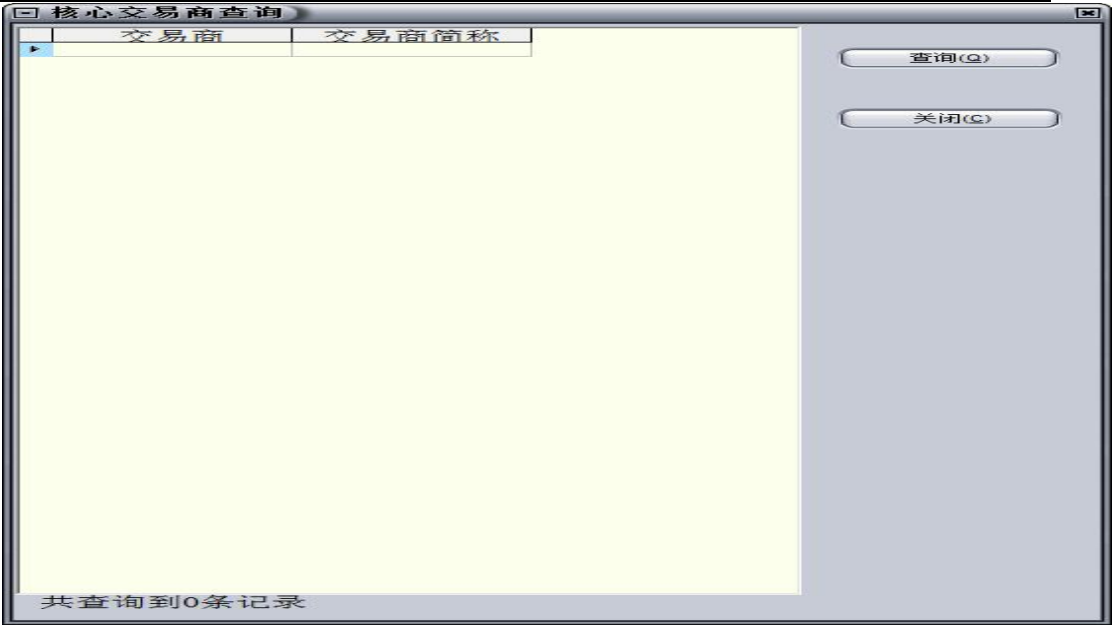
点击查询按钮可以查到的成交合约的信息包括成交类型、成交日期、成交编号、成交时间、买方编号、买方交易员、买方债券交易参与人、买方证券账户、买方交易单元、买方银行账户名称、买方银行账户、买方开户行、卖方交易员、卖方债券交易参与人、卖方证券账户、卖方交易单元、卖方银行账户名称、卖方银行账户、卖方开户行、起始日、截止日、期限、名义本金、保护费支付方式、结算方式、保护费率、标准保护费率、前端费用、前端费用支付日、参考实体、参考实体评级、约定回收率、补充约定、原成交日期、原成交编号。

查询到的结果分页显示，每页显示 30 条记录，可以点击上一页和下一页按钮翻页，也可在窗口底部的跳转页面框中输入页数，点击转到按钮可以显示该指定页信息

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 5.36.10 CDX 核心债券交易参与人查询

菜单路径：查询统计—>组合信用保护合约查询—>核心债券交易参与人查询。



在条件查询框中可以设置对手方债券交易参与人代码。

点击查询按钮可以查到的核心债券交易参与人的信息包括债券交易参与人、债券交易参与人简称。

## 六、 报表统计

这里为用户提供了各种方便的按条件生成打印报表方式。

### 6.1. 本方确定报价明细表

点击报表统计—>本方确定报价明细表，进入本方确定报价报表界面。

证券代码	证券简称	买入报价	买入报价数量	买入成交数量	买入报价交易员	卖出报价
019701	07债CS01	100.010	5000	0	Z05100	100.020
019701	07债CS01	97.000	10000	10000	Z05100	103.000
019701	07债CS01	100.000	5000	0	Z05100	101.000

在本方确定报价明细表中可以对本方参与确定报价交易的信息做条件查询并打印成报表。

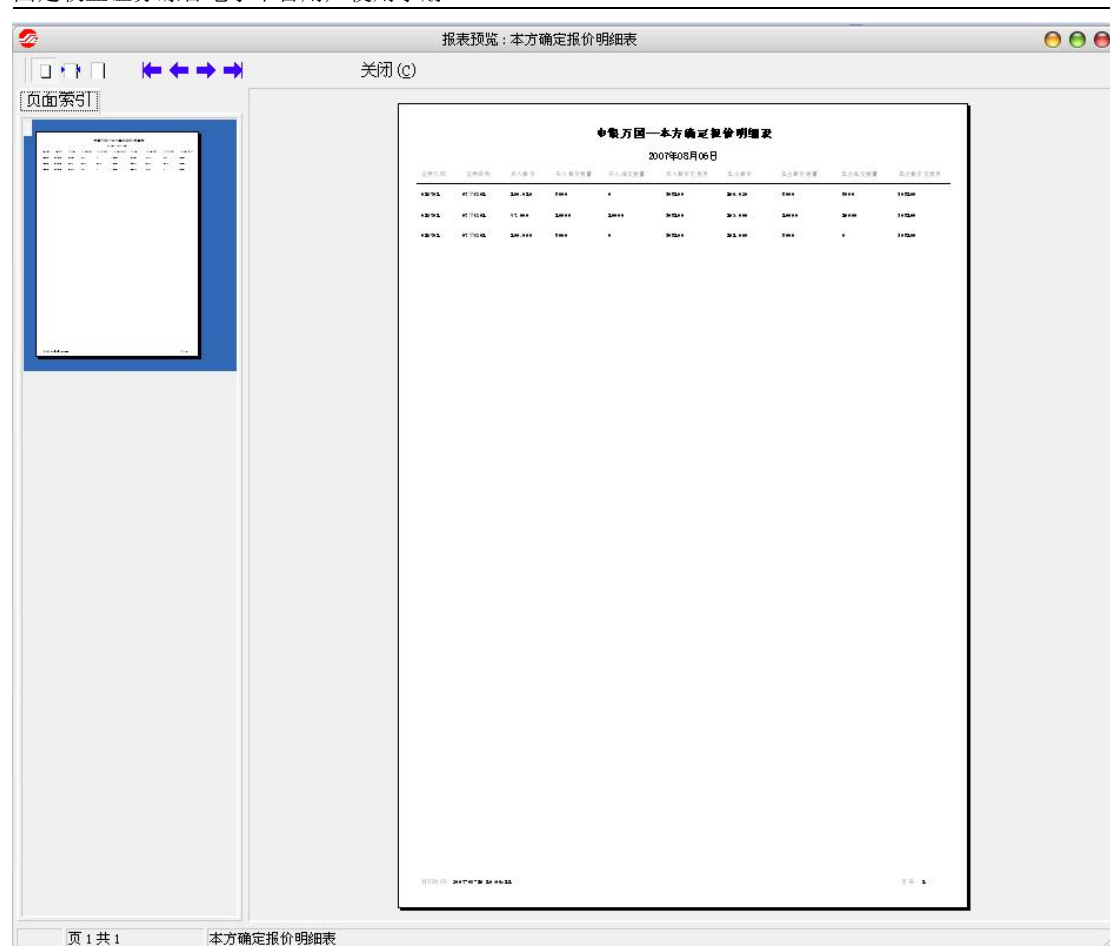
在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，日期。点查询后符合相应条件的确定报价交易信息在下方的本方确定报价信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括证券代码、证券简称，买入和卖出报价、买入报价数量、买入成交数量、买入报价交易员、卖出报价数量、卖出成交数量、卖出报价交易员、中债代码、中债简称、结算场所、结算速度、价格类型、结算日期。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

点击打印预览，弹出报表预览窗口




打印预览窗口上方为工具栏，左侧是对所要打印的报表的页面索引，右侧预览框中的页面即是要打印出的报表效果。


工具栏从左到右依次为：

页面调整



调整适合页面 ：点击使预览框内以最适合的尺寸显示一整页的报表


调整适合宽度 ：点击使预览框内以最适合的页面宽度显示报表

调整至 100% 大小 ：点击使预览框内按打印实际大小显示报表

翻页



首页 ：点击使预览框显示报表第一页内容

上一页 ：点击使预览框显示报表上一页内容

下一页 : 点击使预览框显示报表下一页内容

尾页 : 点击使预览框显示报表最后一页内容

关闭: 点击关闭窗口, 不做任何修改

用户预览报表页面后, 觉得满意, 即可点击打印, 将报表打印出来。

点击打印, 弹出打印设置对话框



选择好输出打印机, 打印范围, 份数后, 点击确定, 即可将报表打印出来。

## 6.2. 本方待定报价明细表

点击报表统计—>本方待定报价明细表, 进入本方待定报价报表界面。

在本方待定报价明细表中可以对本方参与待定报价交易的信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，日期。点查询后符合相应条件的待定报价交易信息在下方的本方待定报价信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括证券代码、简称，买入和卖出报价、报价数量、成交量、交易员。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

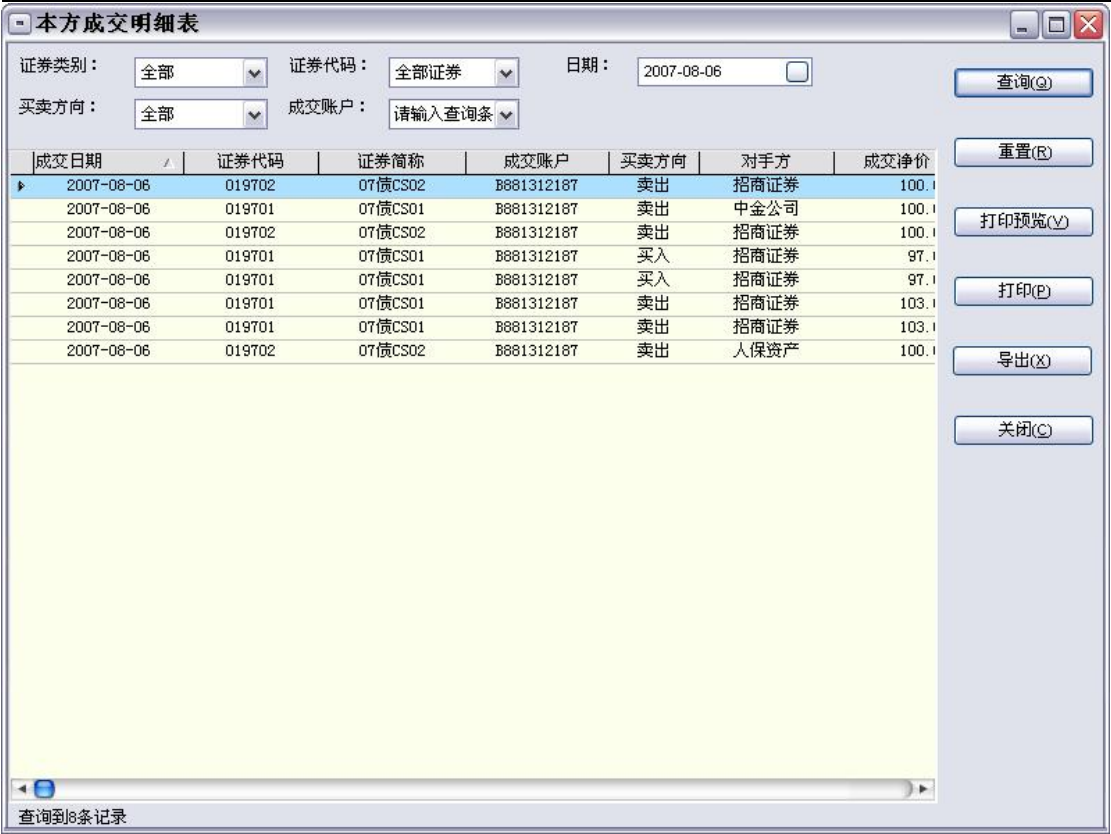
点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 6.3. 本方成交明细表

点击报表统计—>本方成交明细表，进入本方成交明细报表界面。





在本方成交明细表中可以对本方参与的所有成交信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，成交账户，买卖方向，日期。点查询后符合相应条件的本方成交信息在下方的本方成交明细列表中列出。

可以查到的成交信息包括成交日期，证券代码、证券简称，成交账户，买卖方向，对手方，成交净价，到期收益率，成交量，交易员，中债代码，中债简称，结算场所，结算速度，价格类型，结算日期。

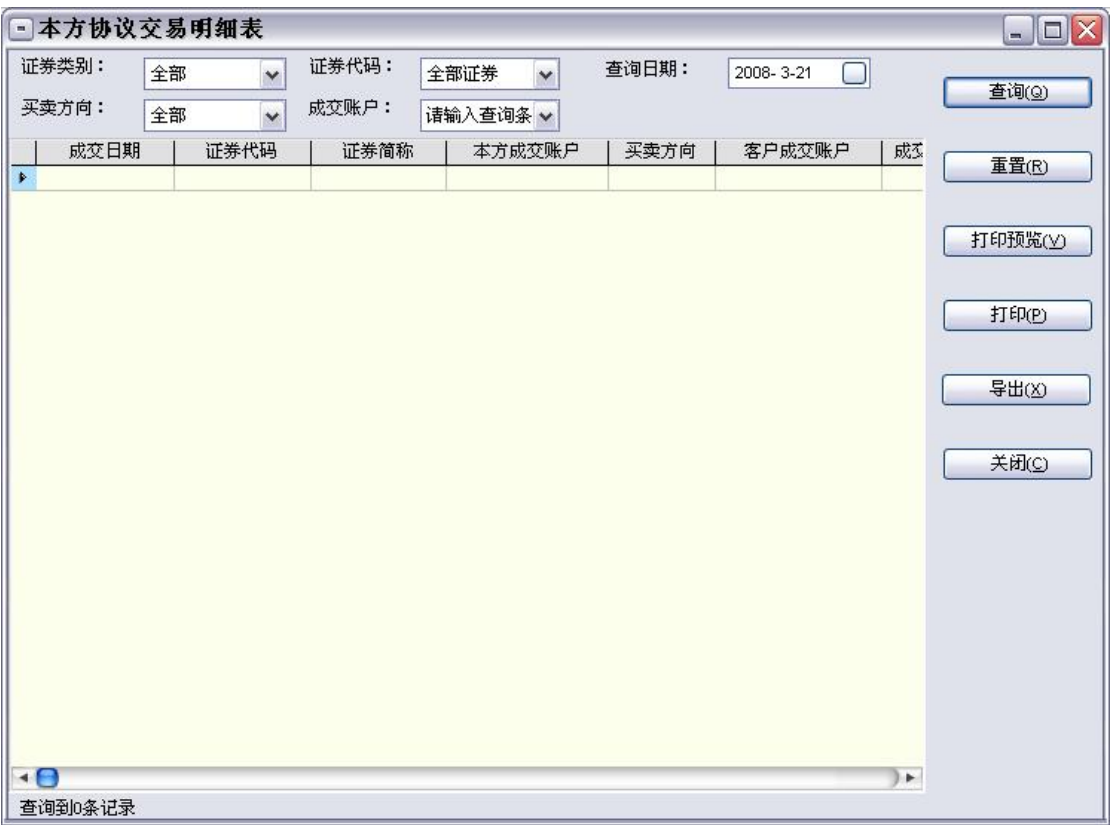
将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

### 6.4. 本方协议交易明细表

点击报表统计—>本方协议交易明细表，进入本方协议交易报表界面。



在场外协议交易明细表中可以对本方参与的协议交易信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，买卖方向，成交账户，日期。点查询后符合相应条件的协议交易信息在下方的协议交易信息列表中列出。

可以查到的协议交易信息包括成交日期，证券代码、简称，本方成交账户，买卖方向，客户成交账户，成交净价，到期收益率，成交量，交易员。

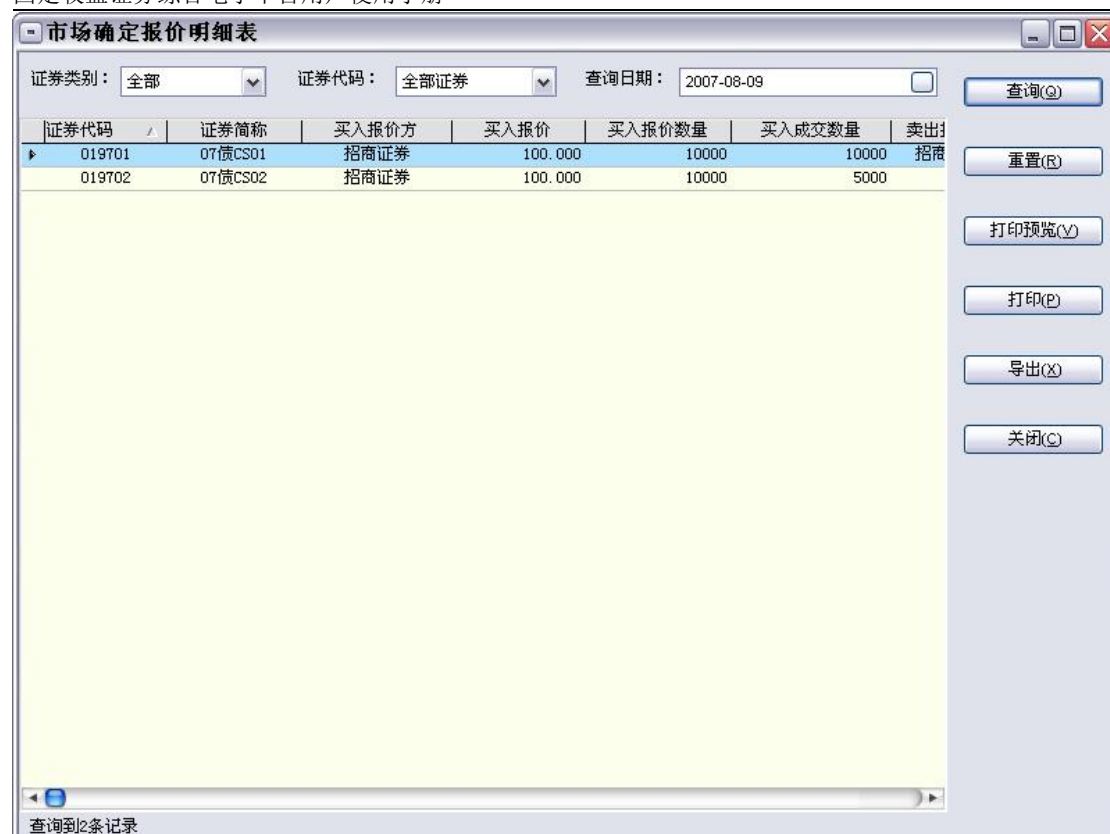
将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 6.5. 市场确定报价明细表

点击报表统计—>市场确定报价明细表，进入市场确定报价报表界面。



在市场确定报价明细表中可以对全市场的确定报价信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券类别，证券代码，查询日期。点查询后符合相应条件的市场确定报价信息在下方的市场确定报价信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括证券代码、证券简称，买入报价方，买方报价，买入报价数量、买入成交数量、卖出报价方，卖出报价，卖出报价数量，卖出成交数量，中债代码、中债简称、结算场所、结算速度、价格类型、结算日期。

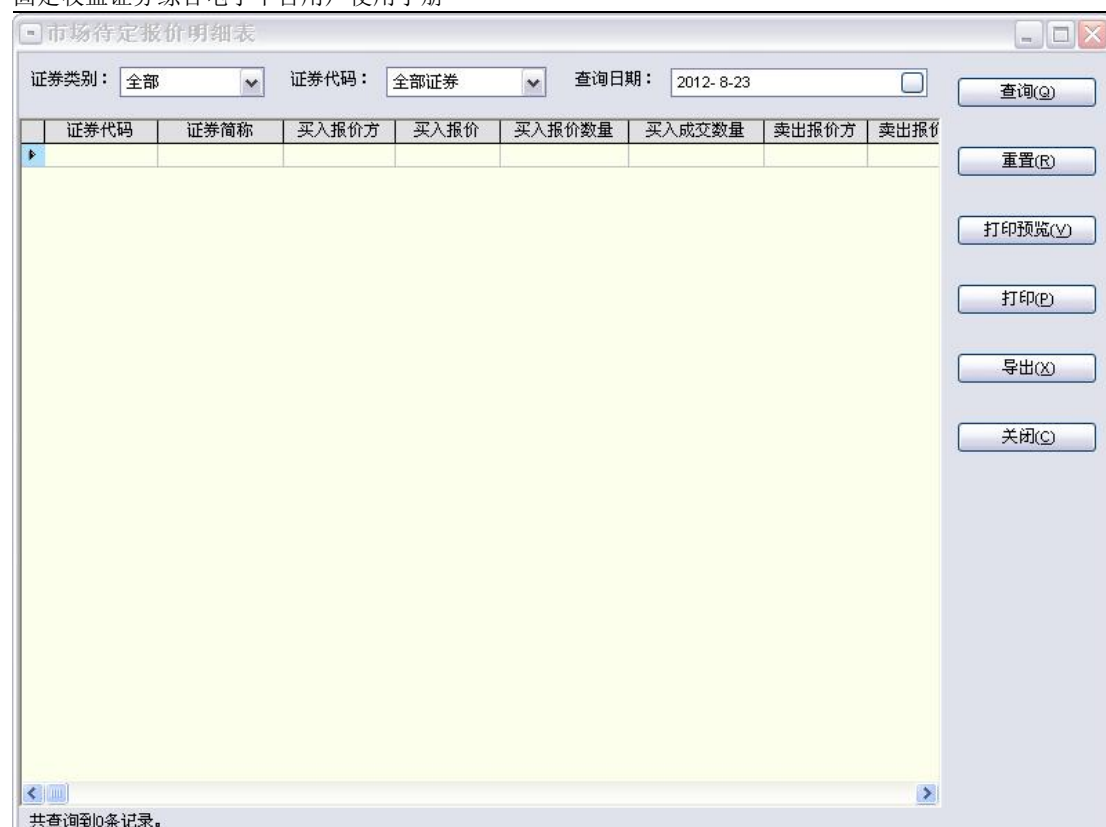
将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 6.6. 市场待定报价明细表

点击报价统计—>市场待定报价明细表，进入市场待定报价报表界面。



在市场待申报明细表中可以对全市场的待申报交易信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券类型，证券代码，日期。点查询后符合相应条件的待申报交易信息在下方的市场待申报信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括证券代码、简称，买入和卖出报价、报价数量、成交数量、交易员。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 6.7. 一级债券交易参与人做市报价明细表

点击报表统计—>一级债券交易参与人做市报价明细表，进入做市商做市报价报表界面。



在一级债券交易参与者做市报价明细表中可以对全市场的一级债券交易参与者做市报价信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券代码，日期。点查询后符合相应条件的一级债券交易参与者做市报价信息在下方的一级债券交易参与者做市报价信息列表中列出。

可以查到的报价信息包括证券代码、证券简称，一级债券交易参与者名称，买入和卖出报价、买入和卖出报价数量、买入和卖出成交数量。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 6.8. 转托管明细表

点击报表统计—>转托管明细表，进入转托管报表界面。



在转托管明细表中可以对本债券交易参与人的转托管信息做条件查询并打印成报表。

在条件查询框中可以设置证券类别、代码，查询日期以及申报证券账户。点查询后符合相应条件的转托管信息在下方的转托管信息列表中列出。

可以查到的转托管信息包括申报日期，证券代码、简称，证券账户，银行间托管账户，托管数量，交易员以及产品代码。

将鼠标移至证券名称列，用右键可以调出证券信息窗口。

点击打印预览预览报表，满意后打印出表。

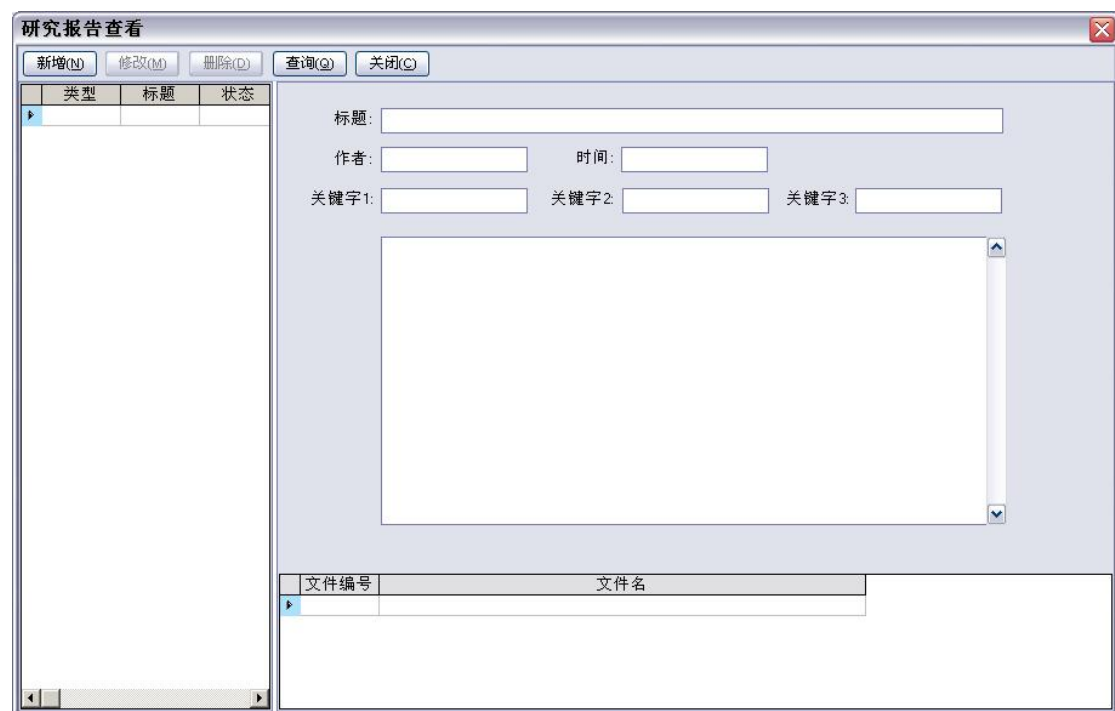
点击导出可以把查询到的信息导出为 EXCEL 文档。

## 七、 服务

### 7.1. 研究报告

#### 7.1.1. 研究报告管理

点击服务—>研究报告管理，进入研究报告的管理界面。



研究报告是提供各债券交易参与人发表自己看法并与其他债券交易参与人交流的渠道。

在界面的左侧是用户已经上传但尚未经过审核的研究报告列表，右侧是研究报告的详细信息展示。通过双击左侧的研究报告列表中的某一条记录，可以在右侧的详情窗口中看到该报告的所有信息。

在本界面上提供以下操作按钮：新增、修改、删除、查询。

**新增：**点击新增按钮，可以打开研究报告的录入界面。

**修改：**在左侧列表中选择某一条研究报告记录，点击修改按钮，可以打开研究报告的修改界面，用户可以在场务审核前修改自己的研究报告内容。

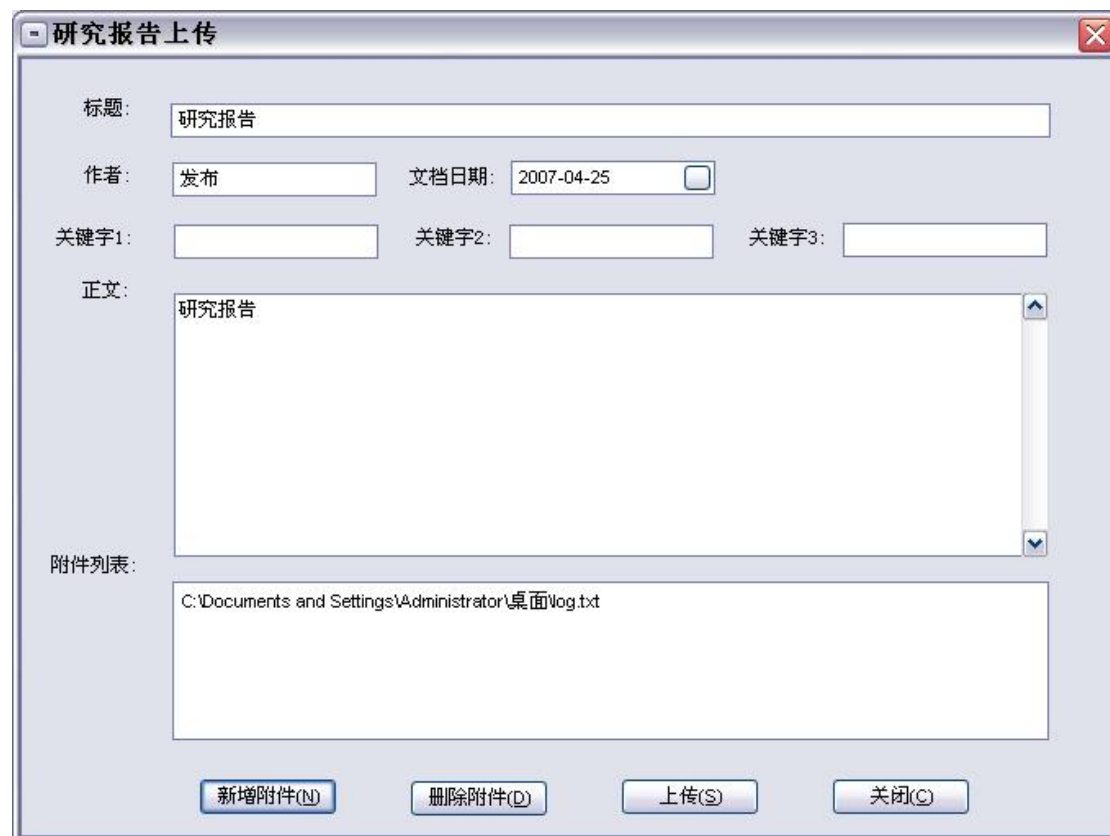
**删除：**在左侧列表中选择某一条研究报告记录，点击删除按钮，经过确认后，可以删除自己提交，但尚未审核发布的研究报告。



查询：刷新本债券交易参与者提交的研究报告列表。

### 7.1.2. 研究报告上传

在研究报告管理中，点击新增按钮，打开研究报告的录入上传界面。



研究报告上传

标题: 研究报告

作者: 发布 文档日期: 2007-04-25 ☐

关键字1: 关键字2: 关键字3:

正文: 研究报告

附件列表: C:\Documents and Settings\Administrator\桌面\log.txt

新增附件(N) 删除附件(D) 上传(S) 关闭(C)

用户在此录入自己研究报告的内容，并上传到服务器上，待场务审核。

界面各输入项说明如下：

标题：报告的标题内容，在审核通过后，会显示在主界面的公告信息窗口中。

作者：报告的撰写人，长度不超过 15 个汉字，或 30 个英文字母。

文档日期：可以点击  图标，在日历中选择该研究报告的撰写日期。

关键字：为检索方便，可以在此输入最多三个关键字单词。

正文：对于不超过四百字的短文，可以直接在此录入；一般建议以附件的方式提交，以便于统一整理和维护。在此可以输入研究报告的摘要，便于浏览者对该报告有一个整体了解。

附件列表：这里显示已经通过“新增附件”按钮提交上传的文件名称。

界面各操作按钮说明如下：

新增附件：点击按钮，系统会弹出文件浏览窗口，供用户选择需要上传的文件，确认后该文件会出现在附件列表中。

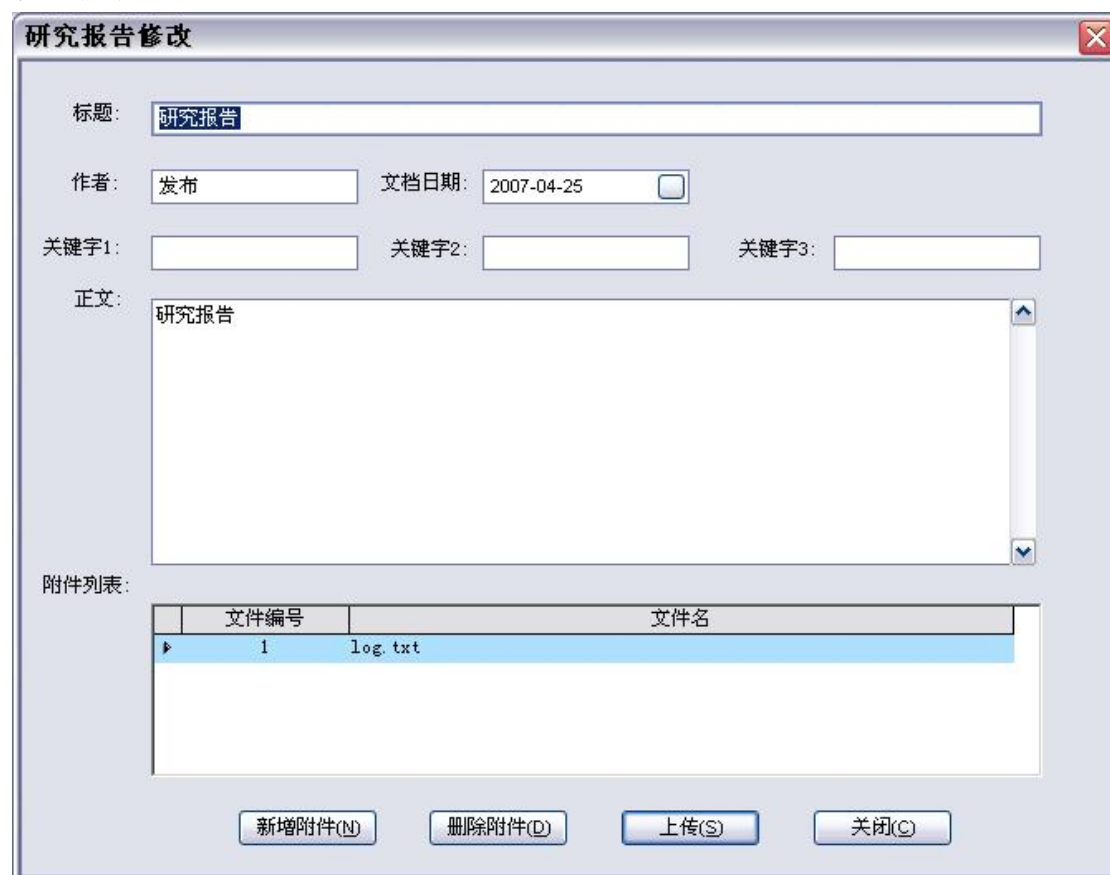
删除附件：在附件列表中选择一条记录，点击按钮，经过确认后，该条记录从列表中删除。

上传：点击按钮后，该研究报告的内容及附件将上传到服务器上，待场务人员审核。

关闭：关闭窗口，不做任何保存操作。

### 7.1.3. 研究报告修改

在研究报告管理中，选择某一条研究报告记录，点击修改按钮，打开研究报告的修改界面。



研究报告修改

标题: 研究报告

作者: 发布 文档日期: 2007-04-25

关键字1: 关键字2: 关键字3:

正文: 研究报告

附件列表:

文件编号	文件名
1	log.txt

新增附件(N) 删除附件(D) 上传(S) 关闭(C)

用户在此修改已录入的研究报告的内容，并重新上传到服务器，待场务审核。

界面各输入项说明如下：

标题：报告的标题内容，在审核通过后，会显示在主界面的公告信息窗口中。

作者：报告的撰写人，长度不超过 15 个汉字，或 30 个英文字母。

文档日期：可以点击图标，在日历中选择该研究报告的撰写日期。

关键字：为检索方便，可以在此输入最多三个关键字单词。

正文：对于不超过四百字的短文，可以直接在此录入；一般建议以附件的方式提交，以便于统一整理和维护。在此可以输入研究报告的摘要，便于浏览者对该报告有一个整体了解。

附件列表：这里显示已经上传的文件名称。

界面各操作按钮说明如下：

新增附件：点击按钮，系统会弹出文件浏览窗口，供用户选择需要上传的文件，确认后该文件会出现在附件列表中。

删除附件：在附件列表中选择一条记录，点击按钮，经过确认后，该条记录从列表中删除。

上传：点击按钮后，该研究报告的最新内容及附件将更新到服务器上，待场务人员审核。

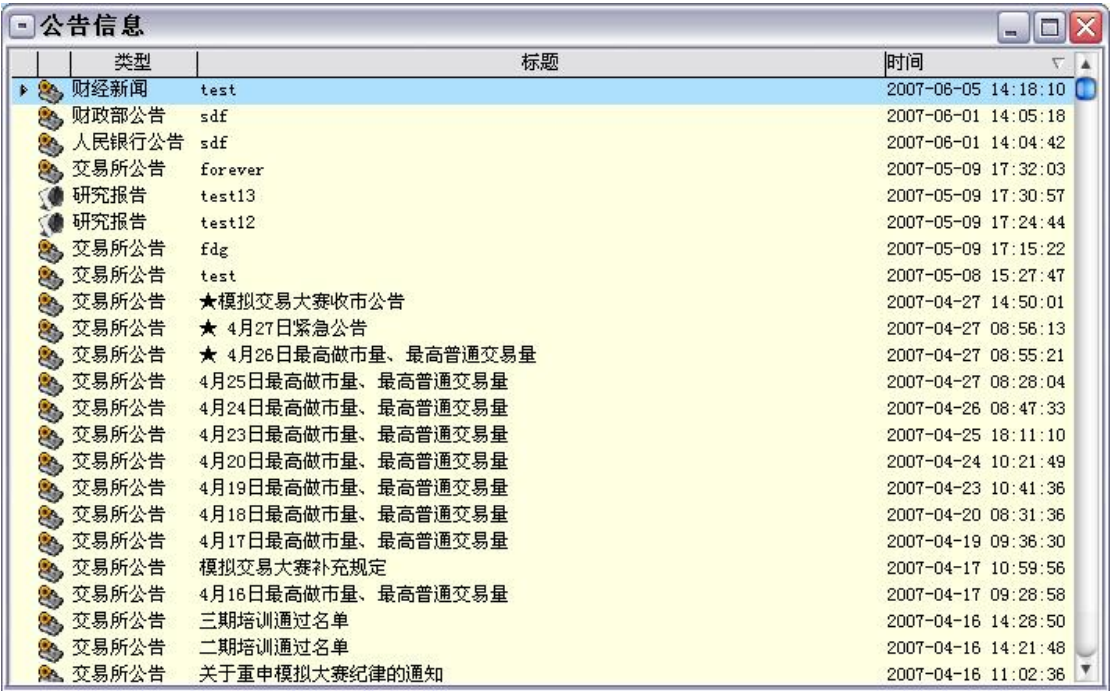
关闭：关闭窗口，不做任何保存操作。

## 7.2. 公告信息查看

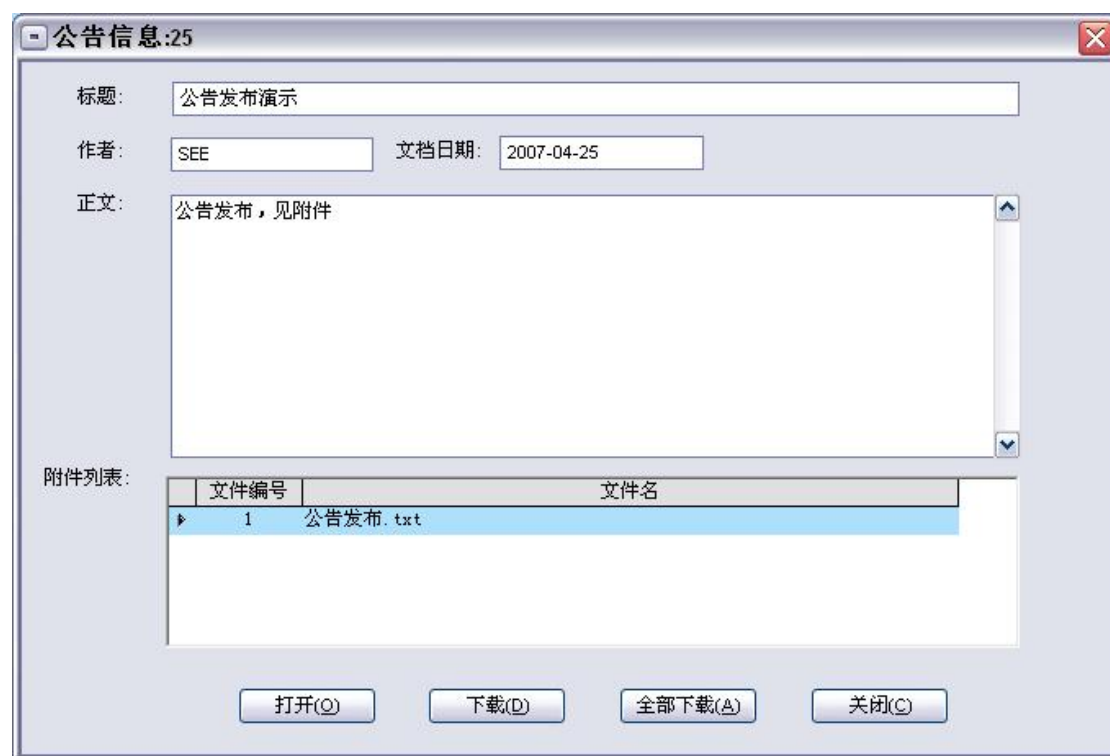
当状态栏上第四盏灯闪烁时，表明有新的公告发布



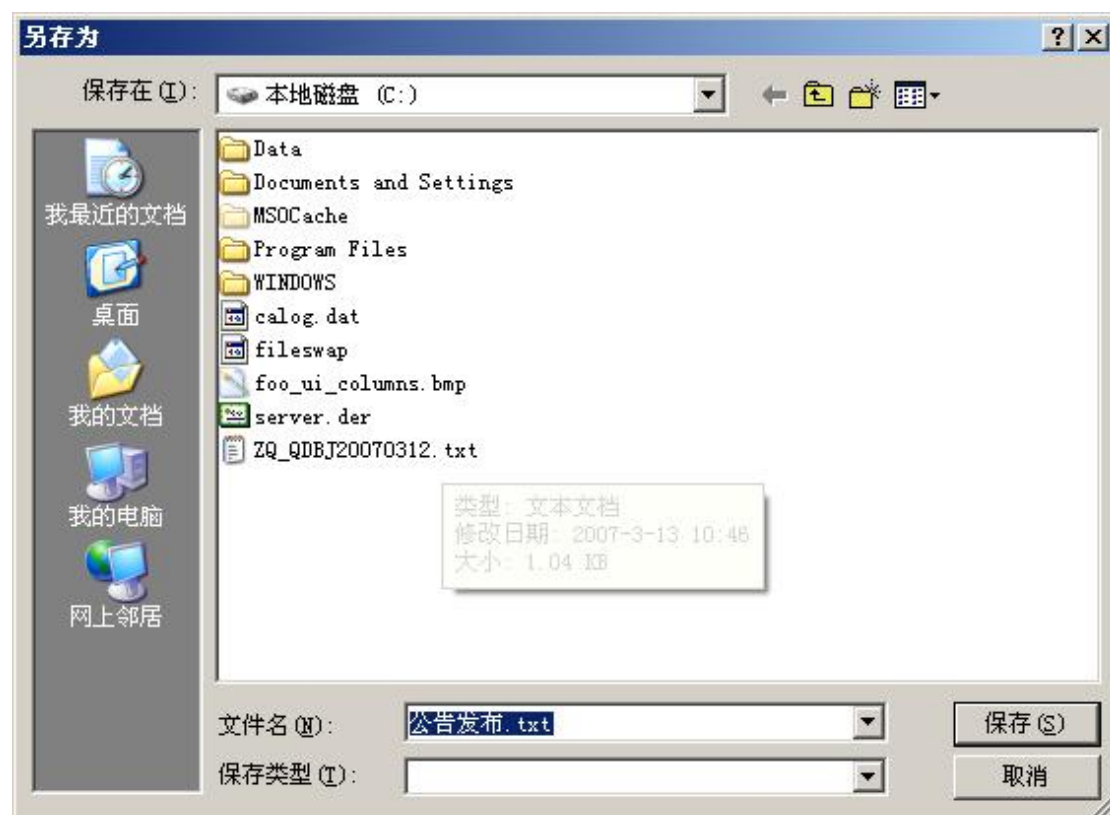
在灯上单击鼠标左键，弹出公告信息窗口



选中待查看公告，双击弹出公告详细信息



如果附件列表中有用户上传的附件，可以选取该附件后点击下载，弹出选择下载路径窗口



选择好后点击保存，文件即保存到本机。

如果用户不想保存到本机，也可选择该附件后点击打开，即可打开此附件在线查看。

如果该公告有多个附件，可点击全部下载，一次将所有附件都下载至本机查看。

### 7.3. 在线用户查看

用户可以点击服务—>在线用户查看，查看在线用户信息。



用户ID	用户名	用户状态	机构名称
▶ Z00201	Trader1	在线	测试商一
Z10200	VIP	在线	东方证券
Z10500	VIP	在线	广发证券
Z10501	VIP	在线	广发证券
Z10700	VIP	在线	国泰君安
Z10900	VIP	在线	国元证券
Z11300	VIP	在线	招商证券
Z11400	VIP	在线	中金公司
Z11800	VIP	在线	申银万国
Z11900	VIP	在线	广发华福
Z13300	VIP	在线	第一创业
Z20400	VIP	在线	人保资产
Z20500	VIP	在线	人寿资产

共查询到13条记录

在此可以看到所有当前在线的交易员代码、交易员名称、以及其所属债券交易参与人名称。点击查询能够刷新到最新的用户在线情况。

### 7.4. 成交数据下载

用户可以点击服务—>成交数据下载，下载当日成交数据。





在此可以选择数据想要下载到的目录。点击确定将当日成交数据下载到本地。



## 八、 交易员定制

点击系统维护—>交易员定制菜单，可以设置各种个性化内容，包括：询价黑名单、默认账户指定等。

### 8.1. 询价黑名单设置



黑名单是指交易员可以自己定义不希望与之进行交易的对手方。设置了黑名单后，交易员就不会收到处于交易员黑名单上的债券交易参与者发来的询价信息。

在设置界面的左侧是所有债券交易参与人的列表，用户可以选择其中的一个，点击添加按钮，将其放入右侧的黑名单列表。也可以选择目前位于黑名单中的某一个，点击删除按钮，将其移出黑名单。完成调整以后，可以点击应用按钮，保存黑名单设置。

## 8.2. 默认账户指定



交易员可以指定自己的默认交易账户。这样，他在交易时，可以不录入账户的信息，而采用默认账户。一个交易员的默认账户只能有一个。

在界面的左侧是该交易员可操作的所有账户交易单元，选择其中的一条，点击“选定默认账户”，经确认后，该账户将出现在“当前的默认账户”输入框中。

## 九、 系统管理

交易所场务设置每个债券交易参与人的首席交易员后，首席交易员拥有一定的管理权限，可以对本债券交易参与人的内部信息进行管理，并可以对下属普通交易员进行授权、授信操作。对于系统管理，只能由首席交易员来设置，普通交易员无法做修改。

### 9.1. 债券交易参与人管理

点击系统维护—>债券交易参与人管理，进入债券交易参与人管理界面。在这里可以设置本债券交易参与人的基本信息并查看本债券交易参与人可进行做市的券种

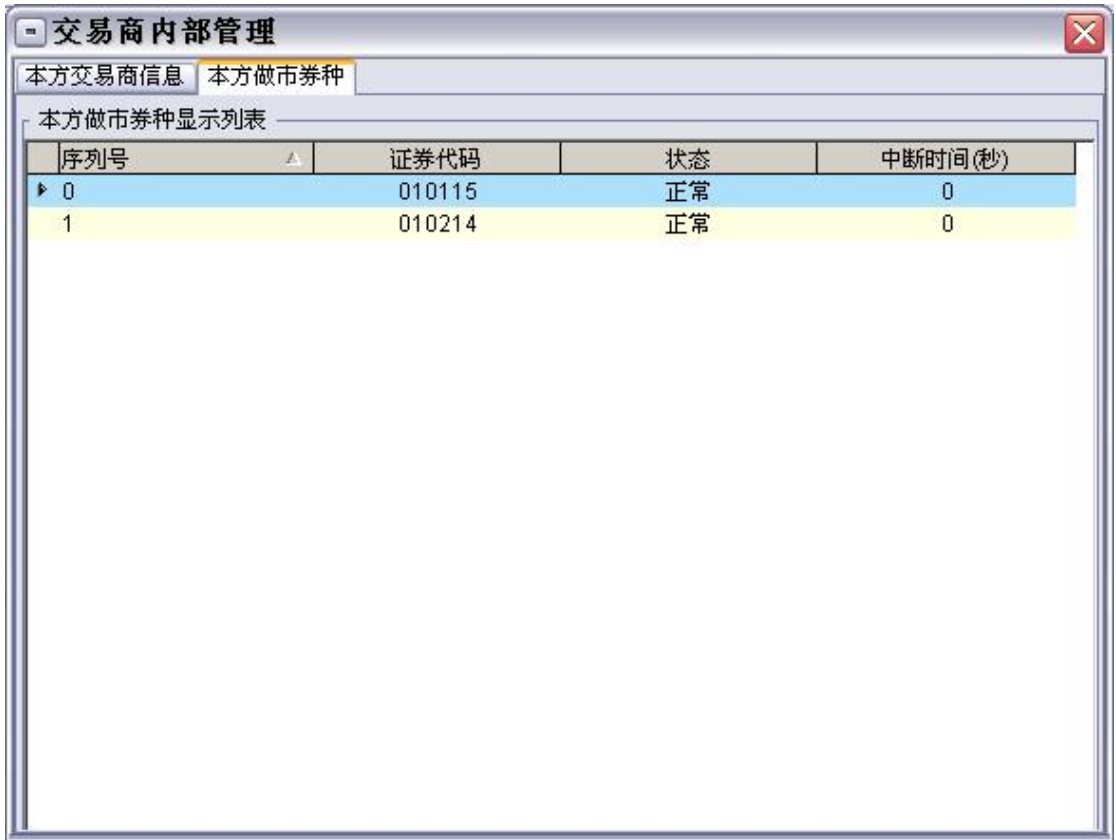
债券交易参与人代码：	036	*债券交易参与人全称：	交银施罗德基金管理有限公司
*英文简称：	jysld	债券交易参与人简称：	交银施罗
邮编：	200120	*状态：	正常
总经理：		*是否做市商：	普通债券交易参与人
联系电话：	021-61055055	*经营机构代码：	J900051
联系人：	迟鑫	*做市账户：	
电子邮件：	chixin@jysld.com	*做市账户席位：	
传真：	021-61055024	*当前资金：	0.00
地址：	上海市世纪大道201号渣打银行大厦10楼		

注：带\*号标识的字段不可更改

修 改(M)      关 闭(C)

点击本方债券交易参与人信息页，窗口显示本方债券交易参与人信息。其中红色带\*号字段为基础信息用户不可修改，与该字段相应的输入框字体也为灰色。黑色字段可修改，与该字段相应的输入框字体也为黑色。用户在相应输入框中输入信息后点击修改，即可改变本方债券交易参与人信息。

点击本方做市券种页，可以查看场务管理员为本债券交易参与人设置了哪些做市券种以及其状态。



### 9.1. 托管银行交易单元设置

点击系统维护—>托管银行交易单元设置，进入托管银行交易单元设置界面。

序号	席位号

这里可以为不同的托管银行添加需要接收成交记录的交易单元。在此界面上的操作有增加、删除和查询。

**增加：**在托管银行下拉选择框中，选择一个托管银行，在交易单元号录入框中，输入交易单元号，点击“增加”按钮，提交后台审核通过后增加成功。此时该交易单元号会在下面的交易单元号信息列表中显示。

**删除：**在托管银行下拉选择框中，选择一个托管银行，在交易单元号录入框中，输入要删除的交易单元号，点击“删除”按钮，提交后台审核通过后删除成功。此时该交易单元号会在下面的交易单元号信息列表中删除。

**查询：**在托管银行下拉选择框中，选择一个托管银行，点击“查询”按钮，可以查询到该托管银行下的所有交易单元号。

**注意：**一个交易单元只能属于一家托管银行，当选择另一家托管银行增加相同的交易单元号时，系统会提示交易单元已经存在 XX 银行中，是否覆盖。选择是，则覆盖，交易单元号从原托管银行删除，同时增加到新的托管银行中。选择否，则交易单元号仍属于原托管银行。

## 9.2. 债券交易参与人账户管理

点击系统维护—>债券交易参与人账户管理，进入债券交易参与人账户管理界面。在这里可以管理本债券交易参与人的可用普通账户并与其相应交易单元匹配



窗口左侧为账户交易单元信息栏，列出了本债券交易参与人拥有的账户极其对应的交易单元。右侧是其对应账户交易单元的详细信息，可以查看到该账户的类型。

我们可以对本债券交易参与人的账户进行查询，新增和删除操作。注意做市账户不可删除。

查询：点击可查出该债券交易参与人的所有交易单元及其对应账户

新增：点击弹出账户交易单元新增窗口可以增加新的账户交易单元

删除：点击删除选中账户交易单元（注意做市账户不可删除）

点击新增，弹出账户交易单元新增窗口，在这里可以新增本债券交易参与人的普通账户并与交易单元对应

在此界面上的操作有保存、重置和关闭。

保存：点击增加设定的账户交易单元

重置：点击将输入框重置回初始状况

关闭：点击关闭窗口，不做任何修改

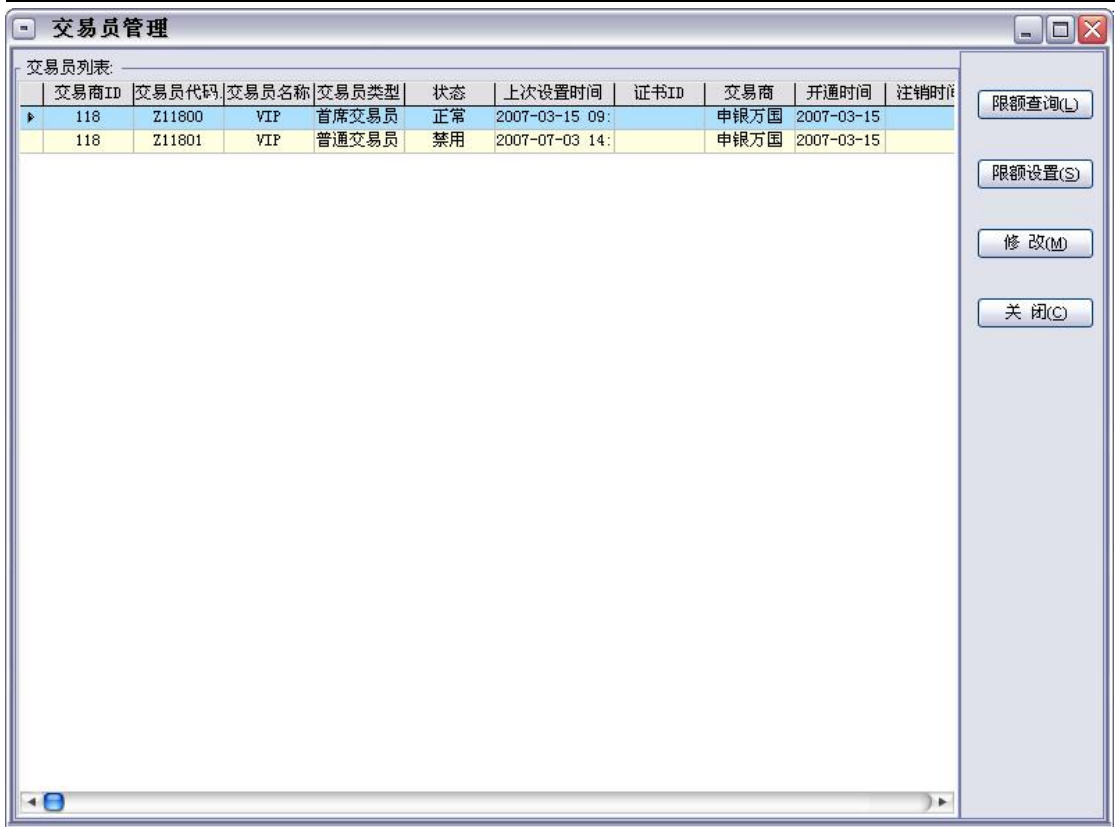
在交易单元代码下拉列表中选择所需设定交易单元，并在账户代码中输入欲添加的账户，点击保存。系统核对交易单元与账户匹配无误，弹出新增成功提示框，该账户交易单元即在账户交易单元信息栏中列出。

欲删除某一账户交易单元，只需在账户交易单元信息栏中选中该账户后点击删除，该账户交易单元即会在列表中消失。

### 9.3. 交易员管理

点击系统维护—>交易员管理，进入交易员管理界面。在这里可以管理本债券交易参与人的所有交易员的基本信息以及交易限额。





交易员列表中列出了本债券交易参与人旗下所有交易员的信息。

在此界面上的操作有修改、账户交易单元、限额查询、限额设置和关闭。

修改：点击弹出交易员修改窗口，对选定交易员信息进行修改

限额查询：点击弹出限额查询窗口，可以对所设交易员限额做条件查询

限额设置：点击对选定交易员分配交易限额

关闭：点击关闭窗口不做任何修改

9.3.1. 交易员修改

欲更改某交易员信息，选中该交易员后，点击修改，弹出交易员修改窗口

交易员修改

必填项：

交易员代码

Z11801

交易员类型

普通交易员

状态

正常

交易商名称

申银万国

交易员名称

VIP

设置权限

设置密码

选填项：

联系电话

传真

电子邮件

地址

确定

取消

修改窗口分必填项和选填项，输入框为灰表示该信息为基础信息，由场务管理员控制，不可修改。做出修改后，点击确定即可保存该交易员信息。

9.3.2. 交易限额查询

欲查询某交易员的交易限额，在交易员列表中选中该交易员后，点击限额查询或则直接双击该交易员，弹出交易员限额查询窗口

交易员限额查询

查询条件

交易员代码

Z11801

交易产品

查询

重置

关闭

信息列表

交易员代码	交易员名称	产品代码	产品名称	买入限额	已用买入限额	卖出限额	已用卖出限额	净限额	已用净
Z11801	VIP	01	现券	50000	0	50000	0	20000	0

在上方的选择信息栏中列出了该交易员代码，用户可以选择交易产品种类来为不同产品设置交易限额，注意一个产品对于一个交易员只能设置一条限额。下方的信息列表中列出了该交易员的限额信息。如果列表为空表明还未对该交易员设置限额。

交易员限额信息包括交易员代码、交易员名称、产品代码、产品名称、买入限额、已用买入限额、卖出限额、已用卖出限额、净限额、已用净限额。

9.3.3. 交易限额设置

欲设置某交易员的交易限额，在交易员列表中选中该交易员后，点击限额设置，弹出交易员限额管理窗口

交易员限额管理

选择信息

交易员代码Z11801交易产品

信息列表

交易员代码	交易员名称	产品代码	产品名称	买入限额	已用买入限额	卖出限额	已用卖出限额	净限额	已用
-------	-------	------	------	------	--------	------	--------	-----	----

添加(N)

删除(D)

修改(M)

保存(S)

关闭(C)

在上方的选择信息栏中列出了该交易员代码，用户可以选择交易产品种类来为不同产品设置交易限额，注意一个产品对于一个交易员只能设置一条限额。下方的信息列表中列出了该交易员的限额信息。如果列表为空表明还未对该交易员设置限额，此时可点击添加对其设置限额。如果列表中有记录则表明已经对该交易员设置了限额，此时可点击删除解除对其交易的限制或点击修改改变其交易限额。

点击添加或修改，弹出交易员限额添加窗口或修改窗口



交易员限额添加

交易员限额信息

交易员代码: Z11801

产品名称: 现券

买入限额: (手)

卖出限额: (手)

买卖净限额: (手)

确定(O) 关闭(C)

在交易员限额信息中列出了交易员代码和产品名称，用户设置该交易员的买入限额，卖出限额，买卖净限额。设置完毕后点击确定保存该交易员限额信息。

注意：所有设置完成后，点击保存，才能使之前所作的设置生效。

## 9.4. 交易员账户管理

点击系统维护—>交易员账户管理，进入交易员账户管理界面。在这里可以管理本债券交易参与人旗下的所有交易员可操作的账户交易单元



窗口上方为本债券交易参与人旗下的所有交易员列表，列出的交易员信息包括债券交易参与人代码，交易员代码，交易员名称，交易员类型和状态。窗口下方左端是本债券交易参与人可以操作的账户和对应交易单元列表，且标明了账户种类。右端为交易员账户交易单元框，列出了该交易员可操作的账户交易单元，利用中间的添加和删除按钮，为该交易员分配账户交易单元。

点击窗口上方的交易员列表中的某一交易员信息，窗口下方的账户列表中则针对该交易员相应的账户交易单元进行设置。配置好后点击确定保存。

### 9.5.群组管理

首席用户登录交易端，点击系统维护->群组管理，进入群组管理界面



1. 填写群组名称点击新增按钮进入新增群组成员界面，如下图



左侧列表为债券交易参与人下所有交易员，右侧列表为新增群组成员列表。  
添加债券交易参与人下交易员到群组成员列表中，点击确定按钮，跳转到群组管理界面，  
如下图



点击确定，添加群组完成。



2., 打开群组管理，可以看到当前首席交易员维护的群组





选中想要修改的群组，点击修改按钮，可添加或删除群组成员。



点击确定跳转到群组管理界面，



点击确定，修改完成。



3、首席交易员进入群组管理界面，选中想要删除的群组，点击删除按钮



列表更新，编号为2的群组就不在群组管理列表里了。

注:若债券交易参与人创建了群组，债券交易参与人的信息就开始隔离，群组内的成员看不到群组外交易员的交易信息，群组外的交易员也看不到群组成员的交易信息，群组外的交易员只能看到自己的交易信息。

## 9.6.关注名单管理

首席交易员可设置授信关注名单（债券交易参与人名单），设置后，若交易一方在对手方关注名单内，则 RTGS 结算方式下的交易（除三方回购以外），固收平台不予达成成交。

点击系统维护—>关注名单管理，进入关注名单管理界面。在这里可以管理本债券交易参与人旗下的关注名单



## 十、 信息商数据下载

行情提供商可以登录系统实时查看和下载最新的行情到本地。

### 10.1. 信息商登录

上证所为每个行情提供商提供一个独立的用户账号，以及初始登录口令。行情商使用该账号和口令登录固定收益平台的交易端，用户可以在登录后更改口令。



用户在指定网站上下载并安装了固定收益证券综合电子平台的交易端软件后，运行该软件，能够看到上述登录画面。在界面上输入上证所提供的用户账号和系统口令，点击“登录”后可以进入固定收益证券综合电子平台系统。

初次使用系统时，还需要在界面上的“服务器设置”区域输入上证所提供的服务器地址和端口。如果使用 HTTP 代理访问外网，并且该代理需要每次连接时都输入用户名和密码的话，需要选中“使用 HTTP 代理”，并预先输入用户和密码。

除系统口令之外，其它设置会记录在本地计算机上，不必每次重复输入。

注：行情提供商的用户账号信息由上证所统一维护和管理，其类型为“行情

提供商”，并以大写字母“I”为首字母。信息提供商的账号只能在交易时段登录系统。

## 10.2. 系统界面

行情提供商用户登录系统后，能看到如下界面。



在界面的上方为系统的报价信息区，其中包括：确定报价和意向报价等。

在界面的下方为系统的行情信息窗口，可以看到实时的成交行情和逐笔成交。

行情提供商可以通过这些内容了解固定收益平台的当前交易情况。

关于界面的详细介绍可参考第三章主界面。

## 10.3. 行情下载

行情提供商用户登录系统后，系统会定时（5 秒）检查有无最新行情更新。如果有新行情信息，则及时以文件形式保存到行情提供商的本地文件系统中。用户可以设置下载文件的本地目录。

点击信息提供商—>数据存放路径，进入下载文件的本地存放目录的设置界

面。



系统默认将行情信息保存在系统所在安装路径下，在存放路径中选择用户想要保存的文件夹，点击确定改变行情信息在本地存放的路径到指定文件夹下。这样，在修改数据存放路径时间点之后的新的行情信息就会保存在该文件夹下



## 十一、 常见问题

1、在增加报价时，为什么系统提示：“可用余额不足，无法报价”？



答：这是由于您要卖出的证券数量大于您目前可交易的证券数量，所以无法进行报价。

2、在报价、询价回复或协议交易时，系统为什么提示：“价格超过价格波动幅度”，无法进行正常的报价或询价回复操作？



答：对于普通的报价、询价和协议交易，系统规定了当天的报价范围不能超过该证券前日加权平均价的一个百分比范围，您的报价必须在其上下百分比之内才能得到确认。该参数由场务管理人员设置，在查询统计—>产品查询里可以查到。系统默认价格波动幅度为 10%，假如目前系统前日加权平均价为 100，则您的报价可以在 90.00 到 110.00 范围内波动。

4、在报价操作时，系统为什么提示：“报价数量不对”？



答：这是由于您在报价时输入的数量小于最小成交单位或不是成交单位的整数倍。该参数由场务管理人员设置，，在查询统计—>产品查询里可以查到。目前系统默认报价的最小成交单位为 5000 千元面额。若您输入的报价数量小于 5000 千元面额或不是 5000 千元面额的整数倍就会出现该提示。

5、在报价和询价操作时，系统为什么提示：“做市商已超过该品种的卖空额度，无法报价”？



答：做市商在其做市证券上，可以使用做市账号进行做空操作，但系统规定了每个做市商可以做空的额度，以及该证券的总的做空额度。当该交易成交后会超过这两个额度中的任意一个时，系统会拒绝成交。

6、在做市报价操作中，系统为什么提示：“买卖收益率价差超过做市

报价收益率价差”，无法进行做市报价？



答：对于做市报价，系统规定了该笔做市报价中买报价和卖报价的收益率之差不能超过一个额度，您的做市报价买卖价收益率之差必须在该额度内才能得到确认。该参数由场务管理人员设置。

7、在交易过程中，确认成交时，为什么系统提示：“超过债券交易参与人买卖净限额，无法成交”？



答：这是提交成交后系统校验发现您的买卖净限额（即买入量与卖出量的差）超过了上交所为您设置的限额，可以在查询统计—>债券交易参与人限额查询处查询本债券交易参与人的买卖限额以及已用买卖差限额。

8、在交易过程中，确认成交时，为什么系统提示：“超过交易员买卖净限额，无法成交”或“超过交易员买入限额，无法成交”或“超过

交易员卖出限额，无法成交”？



答：这是提交成交后系统校验发现您的买卖净限额/买入限额/卖出限额超过了您的首席交易员为您设置的限额，可以联系本债券交易参与人的首席交易员获取具体信息。首席交易员可以在系统维护—>交易员管理中点击限额查询，查出该债券交易参与人下属所有交易员的买卖净限额，已用买卖净限额，买入限额，已用买入限额,卖出限额，已用卖出限额。并可对其设置。具体方法详见 9.3.2

9、在做一些报价，设置的操作时候，为什么系统提示“错误的角色类型”？



答：不同的用户角色能对系统进行不同级别的操作，目前系统交易端分首席交易员，普通交易员，交易查询员三种角色，首席交易员可以操作系统的所有功能，普通交易员对本债券交易参与人内部信息只能查询，不可修改，而交易查询员则只能查询，无法交易。所以如果弹出此对话框，则请您查看下自己的角色，看看你想进行的操作是否在角色类型允许的范围之内。

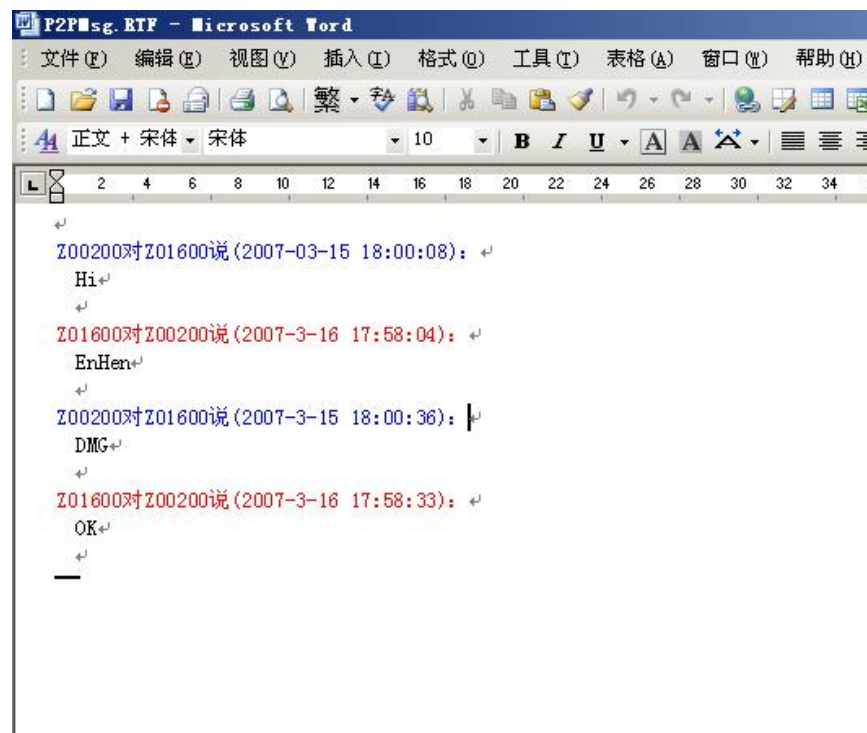
10、我收到一条询价请求，但询价的剩余时间为 0，现在无法进行报价回复怎么办？

答：在被询价页面，您可以通过转洽谈的功能和询价方取得联系，让询价方重新发送一个询价请求，再进行报价回复。

11、我把洽谈的内容保存了下来，怎么打开的是一堆乱符号啊？



答：你所看到的是洽谈内容的格式信息，下载的信息默认为 RTF 格式，这种格式的文档推荐用 Windows 下的 Word 或者 Mac 下的 TextEdit 打开，可以看到正常的聊天记录。



12、为什么我成交报价的时候账户的选择列表是空的？



答：交易员必须由首席交易员为其设置了可操作的账户交易单元后才能使用该账户进行交易。

首先，由首席交易员在系统维护—>债券交易参与人账户管理中添加您所需要的账户到本债券交易参与人所辖账户交易单元的列表中；然后，在系统维护—>交易员账户管理中选中您的交易员记录，在左侧的可用账户交易单元列表中点击添加，将其添加到您的交易员账户交易单元列表中，点击确定保存设置。在重新登录后，您就可以使用刚才设置的账户进行交易了。

### 13、在账户交易单元设置对话框中，交易单元一栏为空怎么办？



答：该债券交易参与人可操作的交易单元串来自会籍系统，如果下拉框为空，请联系会员部，在会籍系统中添加您可操作的交易单元。

### 14、为什么我在研究报告管理里新增了研究报告，但在公告信息窗口不显示？

答：新增了研究报告后，需提交到场务端待审核通过后才能在公告信



息窗口显示，如果你还没能看到你的研究报告，则请刷新一次研究报告管理页面后，查看你所发的研究报告是否仍然存在。如果仍在则表明你的研究报告仍在审核中；如果已消失，则表明你的研究报告未被审核通过，已被场务管理人员删除。

15、为什么“窗口”菜单下的打开窗口列表中，有的窗口关闭后，该窗口名从列表中消失，有的窗口关闭后，该窗口名仍然在菜单中存在？

答：对于洽谈室来说，由于其过程不因窗口的关闭而结束，因此在菜单中保留该窗口名，作为下次进入的入口。其他窗口在关闭后会从列表中消失。

16、当某债券交易参与者频繁向我询价，而我不想接收其询价请求时怎么办？

答：在系统维护—>交易员定制下找到“黑名单设置”，将您不想接收其询价请求的债券交易参与者选中并添加到右侧的黑名单列表中。在确认后，就不会再收到该债券交易参与者发来的询价请求。

17、我在本方双向报价窗口选中一条报价想做修改或撤销，怎么有时能成功，有时提示“必须是同一操作员”啊？

答：系统规定，交易员只能修改和撤销自己报的报价。询价也只能自己成交自己的报价。如果想过滤掉其他交易员的报价，可以点击双向报价窗口中的交易方下拉菜单，选中交易员，则窗口中将只显示本交易员所报的价，方便交易员更改报价信息。

18、我想交易，但发现有太多种类的限额限制住我，我想知道到底有哪几类限额存在，并且余额都怎么样查到呢？

答：为了规范金融市场，规避金融风险，系统设置了一定种类的交易限额限制交易员的交易，力图把交易维持在一个可控的环境下，目前交易员受到的限额限制来自：

交易产品的债券交易参与人净限额：即所有债券交易参与人对某种产品的买卖差之和，不能大于某设定值。该值由场务管理人员设置。在查询统计—>债券交易参与人限额查询里可以查询到该产品的净限额和已用净限额。

交易员买入限额：即某个交易员能买入的数量，不能大于某设定值。该值由本债券交易参与人的首席交易员设置。在系统维护—>交易员管理—>限额查询里可以查询到指定交易员的买入限额和已用买入限额。

交易员卖出限额：即某个交易员能卖出的数量，不能大于某设定值。该值由本债券交易参与人的首席交易员设置。在系统维护—>交易员管理—>限额查询里可以查询到指定交易员的卖出限额和已用卖出限额。

出限额。

交易员净限额：即某个交易员的买卖差的数量，不能大于某设定值。该值由本债券交易参与人的首席交易员设置。在系统维护—>交易员管理—>限额查询里可以查询到指定交易员的净限额和已用净限额。

如果您是做市商下属的交易员，则可以进行做空。此时还有各种做空额度会限制您的做空交易：

交易产品做空额度：即所有做市商做空量之和，不能大于某设定值。该值由场务管理人员设置。在查询统计—>产品查询中可以查询到做空额度和已用做空额度。

交易品种做空额度：即所有做市商对某一种证券的做空量之和，不能大于某设定值。该值由场务管理人员设置。在查询统计—>证券查询中可以查询到总做空额度和已用总做空额度。

交易品种债券交易参与者做空额度：即某单个债券交易参与人对某一种证券的做空不能大于某设定值。该值由场务管理人员设置。在查询统计—>证券查询中可以查询到债券交易参与者做空额度，并结合查询统计—>库存明细查询针对该证券的余额判断其可做空数量。

19、为什么有的时候在开盘的时间内交易，仍然提示已经收盘，导致不能交易？

答：系统的开收盘时间设置了三个级别，对于整个系统有一个统一的开收盘时间；对与交易产品，每一个交易产品可以设置自己的开收盘时间；对于交易品种，每一个证券可以设置自己的开收盘时间。

这样当系统在开盘状态下，有可能该交易产品已经收盘。此时会弹出提示“该产品已经收盘”



也有可能此时您正想交易的证券已经收盘。此时会弹出提示“该证券已经收盘”

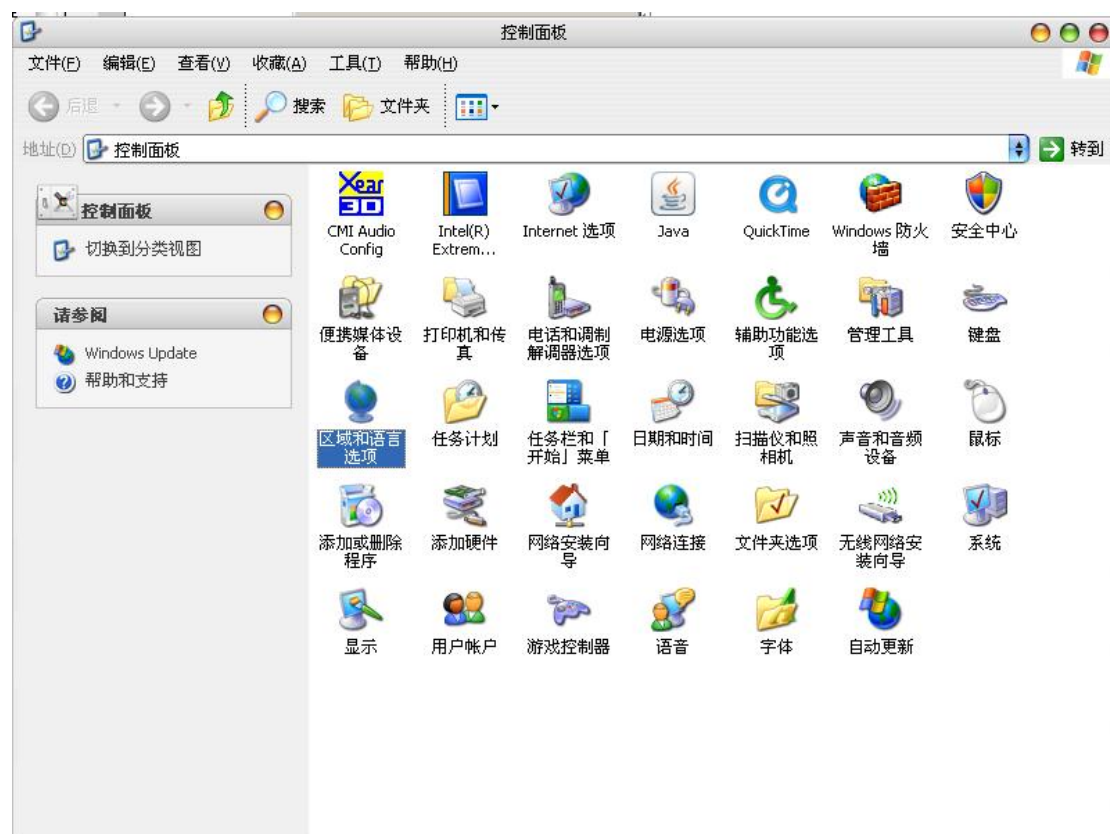


20、为什么有的时候从别的程序切换回系统后，系统就像死机一样不能操作了？

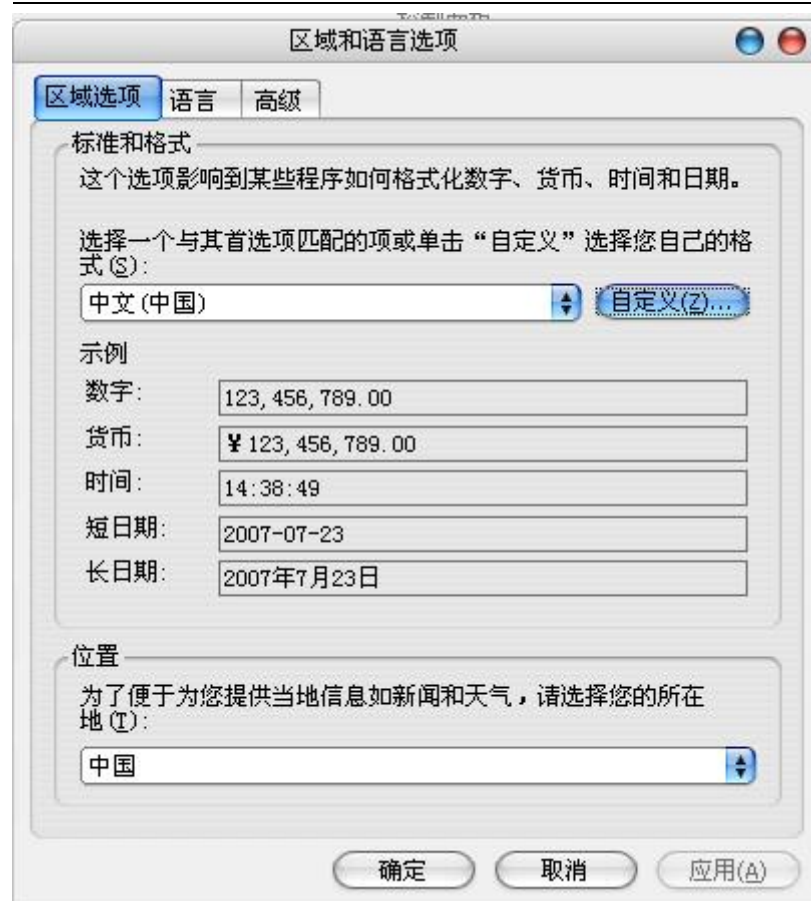
答：由于系统是多窗口模式，故少数弹出窗口有可能在用户切换应用程序的时候被系统主窗口遮挡住，导致用户不可见以至误认为无法操作。此时可按键盘 Esc 键先使当前操作焦点回到主窗口，再继续操作。

21、为什么进入系统会不断弹出“时间格式不正确”的错误提示？为什么询价后时间计时直接为 0:00？

答：这是由于您的 windows 系统区域和语言设置没有设置正确。如果您出现以上问题，请进入 windows 控制面板—>区域和语言选项



在弹出的区域和语言选项的区域选项 tab 页中做如下设置



将其中的时间，短日期，长日期设置成上图格式即可。

22、该系统何时出现行情信息？

答：系统开盘后即有实时行情显示，直到系统收市。

23、债券交易参与者客户端是否需要修改系统时间？

答：本系统用服务器时间，不需要债券交易参与者客户端做时间调整。

25、插上 CA 证书但是无法登录系统如何解决？

答：CA 证书无法登录有以下几种原因：

1. CA 证书密码连续输入错误次数已经超过 6 次，此时 CA 证书会自动锁死。请联系 CA 证书提供商重新激活。
2. CA 证书驱动未按装正确。请到交易所官方网站下载驱动安装。
3. CA 证书损坏。请联系 CA 证书提供商掉换。

26、在交易时为什么提示“交易员没有产品执行权限”？



答：这表明交易员的操作权限受到了场务管理员或者是首席交易员的限制，如果想增加权限，可以尝试要求首席交易员对齐进行设置。

27、未开市状态能否登录系统？

答：不可。对于交易员，可以在系统开市之后，收市之前登录系统。其中一级债券交易参与人可以在系统开市之后开盘之前进行做市报价。



## 28、确定报价只能逐条撤销吗？

答：是的。

## 29、首席交易员已经给本方交易员分配了账户，但报价或成交时为什么仍然无交易单元账户显示？

答：首席交易员为本方交易员分配账户成功后，该交易员需要退出系统然后再次登录才能生效。

## 30、首席交易员与普通交易员的主要区别在哪里？

答：首席交易员可以对该债券交易参与人信息以及下属的所有交易员信息进行管理，包括债券交易参与人基本信息设置、添加债券交易参与人的普通账户、给交易员分配交易单元账户、交易员基本信息设置、交易员操作权限设置、交易员交易限额设置、隔日回购账户设置等。而普通交易员只能查看自己的状态和限额，无法进行设置管理。

## 31、债券交易参与人代码是什么，需要维护么？

答：债券交易参与人代码是添加债券交易参与人时系统自动生成的唯一码，不需要维护。

32、登录时，用户账户是否为 CA 账户？

答：登录的用户账户不是 CA 账户，应该是交易员代码。登录的时候需要配置好服务器地址和端口。

33、报单显示为 10000，交易员成交了 5000，为什么还是显示 10000？

答：出现这种情况，表明报价方报价时选择了使用冰山订单。

34、匿名报价成交后能否通过盘后下载成交数据看出匿名对手方的真实身份？

答：不能。匿名就是为了避免暴露真实身份采取的措施。