

关于关键期限国债开展预发行（试点） 交易有关事项的通知

（上证发〔2014〕46号）

各市场参与者、各结算参与者：

根据财政部、中国人民银行和中国证券监督管理委员会《关于关键期限国债开展预发行试点的通知》（财库〔2014〕72号），国债预发行券种由7年期记账式国债扩大至全部关键期限记账式国债（1、3、5、7、10年期）。上海证券交易所（以下简称“上交所”）与中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）现就有关事项通知如下：

一、自2014年7月31日起，全部关键期限记账式国债（1、3、5、7、10年期）将均开展国债预发行交易。

二、各关键期限国债预发行交易的证券代码如下：采用利率招标的，1、3、5、7、10年期关键期限国债预发行交易的证券代码分别为751801、751803、751805、751807和751800；采用价格招标的，1、3、5、7、10年期关键期限国债预发行交易的证券代码分别为751811、751813、751815、751817和751810。

三、各关键期限国债预发行交易的履约保证金比例如下：

| 期限 | 履约保证金比例 |
|------|---------|
| 1年期 | 1% |
| 3年期 | 2% |
| 5年期 | 3% |
| 7年期 | 4% |
| 10年期 | 5% |

请各市场参与者及结算参与者积极做好相关业务和技术准备，确保国债预发行交易及登记结算业务顺利开展。

上海证券交易所

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一四年七月十八日