

关于发布《中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所债券质押式回购融资主体数据报送指引》的通知

中国结算发字〔2017〕153号

各市场参与人：

为加强债券质押式回购交易风险管理，促进债券市场稳定健康发展，根据《中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所债券质押式回购交易结算风险控制指引》的规定，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）、上海证券交易所、深圳证券交易所（以下简称“证券交易所”）共同制定了《债券质押式回购融资主体数据报送指引》（以下简称《指引》，见附件），现予发布。

请各相关结算参与人、托管人等参与机构按照《指引》及中国结算和证券交易所的要求，尽快开展并完成业务和技术系统的各项准备工作。

特此通知。

附件：中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所债券质押式回购融资主体数据报送指引

中国证券登记结算有限责任公司

上海证券交易所

深圳证券交易所

二〇一七年十一月十七日

附件：

中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所债券质押式回购融资主体数据报送指引

第一条 为了加强债券质押式回购交易风险管理，促进债券市场稳定健康发展，建立债券质押式回购融资主体（以下简称回购融资主体）的数据报送与监测机制，提高市场透明度，根据《公司债券发行与交易管理办法》和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）、上海证券交易所、深圳证券交易所（以下简称证券交易所）《债券质押式回购交易结算风险控制指引》等相关规定，制定本指引。

第二条 回购融资主体及其结算参与人，产品类回购融资主体的托管人和管理人按照规定开展证券交易所债券质押式融资回购交易（以下简称融资回购交易）及结算相关业务的，其数据报送适用本指引。

第三条 回购融资主体应当按照本指引要求定期向中国结算、证券交易所报送其主体信息及相关业务数据，以便中国结算、证券交易所监测和评估交易所债券回购市场风险。对于产品类回购融资主体，由其管理人负责报送。

第四条 回购融资主体为结算参与人的，由其直接向中国结算、证券交易所报送数据。

回购融资主体为非结算参与人的，应授权和委托其结算参与人代为向中国结算、证券交易所报送数据。对于有托管人的产品类回购融资主体，且其托管人不为结算参与人的，回购融资主体除应授权和委托其结算参与人向中国结算、证券交易所报送数据外，还应同时授权和委托其托管人向中国结算、证券交易所报送数据。

第五条 结算参与人、托管人应当按照本指引及中国结算和证券交易所的相关要求，建立融资回购交易的数据采集和填报机制，建立必要的技术系统，按要求报送自身或代客户报送回购融资主体相关数据，并对其报送数据的真实性、准确性、完整性负责。

第六条 委托结算参与人、托管人代为向中国结算、证券交易所报送数据的回购融资主体、产品类回购融资主体的管理人，应当及时向结算参与人、托管人提供相关数据，并对其提供数据的真实性、准确性、完整性负责。

第七条 结算参与人、托管人根据自身或客户参与融资回购交易的不同交易结算模式，分别开展相关数据的报送。

对于自营业务模式的融资回购交易，作为结算参与人的证券公司等机构应当按照本指引第八条规定报送相关数据。

对于经纪业务模式的融资回购交易，作为结算参与人的证券公司应当按照本指引第九条规定报送机构类回购融资

主体以及无托管人的产品类回购融资主体的相关数据；对于有托管人的产品类回购融资主体，作为结算参与人的证券公司及该产品的托管人应当按照本指引第十条规定分工报送相关数据。

对于托管人结算业务模式的融资回购交易，作为结算参与人的托管人应当按照本指引第十一条规定报送其托管的产品类回购融资主体的相关数据。

第八条 自营业务模式下，开展融资回购交易的证券公司等机构应当报送以下数据：

（一）主体基本信息及证券账户信息；

（二）在证券交易所市场和银行间市场的债券现券持仓余额及持仓结构数据；

（三）在证券交易所市场和银行间市场的债券回购余额及未到期结构数据；

（四）资产负债情况；

（五）中国结算和证券交易所规定的其他数据。

第九条 经纪业务模式下，对于开展融资回购交易的机构客户，以及无托管人的产品客户，证券公司应当报送客户的以下数据：

（一）主体基本信息及证券账户信息；

（二）在该证券公司的债券现券持仓余额及持仓结构数据；

- (三) 在该证券公司的债券回购余额及未到期结构数据;
- (四) 在该证券公司的金融资产、负债情况;
- (五) 中国结算和证券交易所规定的其他数据。

第十条 经纪业务模式下, 对于有托管人的产品客户, 证券公司和托管人应当分别报送相关数据。证券公司报送产品在经纪业务中涉及的相关主体信息和账户信息; 托管人报送产品的以下数据:

- (一) 主体基本信息及证券账户信息;
- (二) 在证券交易所市场和银行间市场的债券现券持仓余额及持仓结构数据;
- (三) 在证券交易所市场和银行间市场的债券回购余额及未到期结构数据;
- (四) 产品的资产负债情况;
- (五) 中国结算和证券交易所规定的其他数据。

第十一条 托管人结算业务模式下, 对于开展融资回购交易的托管产品, 托管人应当报送产品的以下数据:

- (一) 主体基本信息及证券账户信息;
- (二) 在证券交易所市场和银行间市场的债券现券持仓余额及持仓结构数据;
- (三) 在证券交易所市场和银行间市场的债券回购余额及未到期结构数据;
- (四) 产品的资产负债情况;

(五) 中国结算和证券交易所规定的其他数据。

第十二条 中国结算和证券交易所可以根据融资回购交易的发展情况，确定并发布不同业务模式下应当进行数据报送的最低标准。最低标准按照回购融资主体的回购未到期规模确定。

第十三条 数据报送的频率为每月一次，结算参与人和托管人应当在每月初的七个工作日内报送上一月的数据。

中国结算和证券交易所可以根据融资回购交易的整体风险情况，对全部或部分结算参与人和托管人数据报送的内容、频率、日期和数据统计周期进行调整。对于自身或客户融资回购业务风险较高的结算参与人或托管人，中国结算和证券交易所可以不定期要求其报送数据。

第十四条 中国结算和证券交易所在本指引第八、九、十、十一条规定的范围内，制定并发布报送数据的具体指标、格式等要求。

中国结算和证券交易所可以根据债券市场发展情况和融资回购交易风险监测的需要，不定期调整并发布报送数据的内容、具体指标、格式等要求。

第十五条 证券交易所和中国结算建立和维护数据报送系统，结算参与人和托管人通过数据报送系统进行数据报送。

第十六条 中国结算和证券交易所可以对结算参与人和托管人所报送数据进行现场或非现场核查。

第十七条 结算参与人、托管人未按照本指引以及证券交易所和中国结算的要求报送数据，连续多次数据报送不及时或者所报送数据出现重大遗漏、错报以及虚假报送情况的，证券交易所和中国结算可以根据规则对相关结算参与人、托管人采取口头或书面警示、约见谈话、通报批评、公开谴责等自律管理措施或纪律处分。情节严重的，证券交易所和中国结算可以提请中国证监会处理。

对于回购融资主体未按本指引规定向中国结算、证券交易所报送相关数据，或者委托结算参与人、托管人报送数据的回购融资主体、产品类回购融资主体管理人未按本指引规定向结算参与人、托管人提供数据，证券交易所和中国结算有权对其采取前款规定的自律管理措施或纪律处分，证券交易所所有权对其采取限制融资回购交易措施。

第十八条 证券交易所和中国结算根据结算参与人和托管人报送的数据对回购融资主体参与融资回购交易的风险情况进行评估，对高风险的回购融资主体采取提醒、关注等风险控制措施；通过指标预警、压力测试和情景分析等方式对融资回购交易的总体风险进行分析，并提请中国证监会处理。

第十九条 证券交易所和中国结算制定结算参与人和托管人报送数据的查询、使用、保密等管理制度，确保报送数据信息的安全。

第二十条 本指引相关用语含义：

（一）融资回购交易是指融资方在证券交易所市场开展的债券质押式回购交易。按照其交易结算模式分为自营业务模式、经纪业务模式和托管人结算业务模式。

自营业务模式是指证券公司、保险机构、财务公司等结算参与者通过直接拥有或租用的交易单元进行回购交易，并且作为中国结算的结算参与者，直接办理自身回购交易的证券资金结算业务的模式。

经纪业务模式是指证券公司接受投资者委托，通过直接拥有的经纪业务交易单元进行回购交易，并且作为中国结算的结算参与者，以自身名义办理回购交易的证券资金结算业务的模式。

托管人结算业务模式是指投资者通过租用交易单元的方式进行回购交易，并且委托托管人（中国结算的结算参与者），办理回购交易的证券资金结算业务的模式。

（二）回购融资主体，是指通过开立证券账户参与融资回购交易的合格投资者。

（三）结算参与者是指经中国结算核准，在中国结算设立和管理的电子化证券资金结算系统内，直接参与中国结算组织的证券、资金清算交收业务的证券公司、商业银行和其他合格机构。

（四）证券公司的经纪客户根据客户类型分为机构客户

和产品客户。其中，机构客户包括符合融资回购交易投资者适当性管理条件的企事业单位法人机构、合伙企业等非法人机构、各类金融机构等；产品客户主要指金融机构发行的理财产品，包括但不限于证券公司资产管理产品、基金及基金子公司产品、期货公司资产管理计划、银行理财产品、保险产品、保险资产管理产品、信托产品以及社会保障基金、企业年金等养老基金、慈善基金等社会公益基金。

第二十一条 本指引由中国结算、证券交易所负责解释。

第二十二条 本指引自 2017 年 11 月 17 日起实施。