

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报表》的通知

中国结算发字〔2017〕152号

各市场参与者：

为落实《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》的要求，明确回购融资主体数据报送的具体内容、指标和格式等要求，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报表》（以下简称《报表》，见附件），现予发布。请各相关结算参与者、托管人等市场参与机构，按照《报表》的具体内容和要求开展数据报送工作。

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，不时修订回购融资主体数据报送内容和要求，并通过更新发布《报表》的方式通知各市场参与者。

业务联系电话：

中国结算 010-50938649；

上海证券交易所 021-50182661；

深圳证券交易所 0755-88668150。

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报表

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报表

一、自营业务模式数据报送表

表 1/3:

<h3>债券质押式回购融资主体数据报送</h3> <h4>——自营业务模式数据报送表 (注 1)</h4>				
结算参与人名称:				
结算参与人编码:				
自营结算备付金账号 (担保交收)	沪			
	深			
填报日期:				
自营业务分管领导:	姓名		职务	
	电话		手机	
	Email			
自营业务部门负责人:	姓名		所在部门	
	职务		电话	
	手机		Email	
填报联系人:	姓名		所在部门	
	职务		电话	
	手机		Email	

注:

1、拥有交易所交易单元且直接结算的保险公司、财务公司等参照证券公司自营业务模式报送相关数据。

表 2/3:

自营业务模式数据报送表——主体信息			
填制单位:		填制日期:	
行次	回购融资主体信息		
1	机构名称 (注 1)		
2	证明文件号码 (注 2)		
3	固定收益自营部门投资额度上限 (注 3, 单位: 亿元)		
回购融资主体证券账户信息			
4	自营一码通账号 (注 4)		
5	持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号 (注 5)	沪	
		深	
6	持有交易所债券余额的其他自营证券账户号 (注 6)	沪	
		深	

注:

- 1、机构名称请填写开户证明文件 (营业执照或社会信用证) 上的全称。
- 2、证明文件号码应填写社会信用证 (三证合一) 号码; 没有该号的可填写营业执照号。
- 3、没有单独成立固定收益部门的机构, 应填写公司批准的对于固定收益投资业务的投资额度上限。
- 4、自营一码通账号为中国结算账户系统分配的一码通账号。
- 5、填写报送机构在月末持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号, 可填多个, 多个证券账户中间用分号或者逗号分隔。
- 6、填写报送机构在月末持有交易所债券余额的其他证券账户号, 多个账户之间用分号或者逗号隔开。

表 3/3:

自营业模式数据报送表——数据报送主表				
填制单位:		填制日期:		
一、自有债券量(会计口径,注1)				
种类	行次	月末持有量(面值;亿元)		
		上交所	深交所	
利率债(注2)	1			
信用债(注3)	2			
种类	行次	银行间		
利率债	3			
信用债	4			
其中:(一)交易所市场债券入库、质押及冻结情况(月末;折算前面值;亿元)				
1、债券质押式回购已入库数量(面值)		上交所	深交所	
利率债	5			
信用债	6			
2、债券质押式协议回购质押冻结数量(面值)		上交所	深交所	
利率债	7			
信用债	8			
3、其他质押或冻结债券数量(面值)		上交所	深交所	
利率债	9			
信用债	10			
(二)银行间市场债券质押、冻结或买断式正回购的情况(月末;折算前面值;亿元)				
1、因银行间市场债券质押式回购被质押冻结数量(面值)		银行间		
利率债	11			
信用债	12			
2、其他质押或冻结数量(面值)		银行间		
利率债	13			
信用债	14			
3、买断式正回购的卖出回购数量(面值)		银行间		
利率债	15			
信用债	16			
二、回购未到期余额(月末)				
种类	方向		行次	未到期余额(月末,亿元)
上交所	债券质押式回购	正回购	17	
		逆回购	18	
	债券质押式协议回购	正回购	19	
		逆回购	20	

深交所	债券质押式回购	正回购	21	
		逆回购	22	
	债券质押式协议回购	正回购	23	
		逆回购	24	
银行间	债券质押式回购	正回购	25	
		逆回购	26	
	债券买断式回购	正回购	27	
		逆回购	28	
三、资产负债情况(月末,注4)				
项目			行次	月末(亿元)
总资产			29	
净资产			30	
总负债			31	
四、杠杆倍数				
杠杆倍数	回购杠杆(注5)	上交所	32	
		深交所	33	
		银行间	34	
		债券全市场(注6)	35	
	总体杠杆(注7)		36	

注:

1、自有债券量按照会计口径统计是指,对于银行间买断式回购的标的债券过户的情况,买断式正回购的卖出回购债券纳入产品持有债券统计范围,买断式逆回购的买入返售债券不纳入产品持有债券统计范围。债券借贷等标的债券过户的情况,参照该标准。

2、利率债包含国债、地方债、央票、政策性金融债。

3、信用债的范围包括:交易所市场的企业债、公司债、可转债、分离债、可交换债、资产支持证券等;银行间市场的金融债、企业债券、政府支持债券、中期票据、短期融资券、定向工具、国际机构债、资产支持证券、同业存单等。

4、资产负债情况填写证券公司法人层面的总资产、净资产和总负债。

5、回购杠杆=自有债券量/(自有债券量-正回购未到期额),分市场按照各分市场自有债券量及回购未到期额计算,债券全市场按照交易所和银行间的自有债券总量和回购未到期总额计算。

6、债券全市场指交易所债券市场和银行间债券市场合并计算回购杠杆。

7、总体杠杆=总资产/(总资产-总负债)。

二、经纪业务模式数据报送表

表 1/5

<h3 style="margin: 0;">债券质押式回购融资主体数据报送</h3> <h4 style="margin: 0;">——经纪业务模式数据报送表</h4>				
结算参与人名称:				
结算参与人编码:				
经纪结算备付金账号 (担保交收)	沪			
	深			
填报日期:				
经纪业务分管领导:				
	姓名		职务	
	电话		手机	
	Email			
经纪业务部门负责人:				
	姓名		所在部门	
	职务		电话	
	手机		Email	
填报联系人:				
	姓名		所在部门	
	职务		电话	
	手机		Email	

表 2/5:

<h3 style="margin: 0;">证券公司经纪业务模式数据报送表——主体基本 信息（有托管人的产品客户）（注 1）</h3>		
填制单 位:		
	填制日期:	
行 次	回购融资主体信息	
1	产品名称（注 2）	
2	基金编码（注 3）	
3	管理人名称	
4	管理人类别	选择类别（注 4）

5	托管人名称	
6	产品类别	选择类别(注5)
行次	回购融资主体证券账户信息	
1	该产品一码通账号(注6)	
2	产品持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号(注7)	沪
		深
3	产品持有交易所债券余额的其他证券账户号(注8)	沪
		深

注:

1、此报表适用于经纪业务模式下参与融资回购交易的各类有托管人的产品,报送机构为经纪券商。

2、产品名称应与产品设立文件或者向监管机构的备案文件等有关证明材料保持一致。

3、基金编码,公募基金填写在证监会备案的基金编码;私募投资基金等产品填写在基金业协会备案的编码。无上述两类编码的可不填。

4、管理人类别在以下选项中选择:01 证券公司;02 证券公司资管子公司;03 基金公司;04 基金公司资管子公司;05 期货公司;06 期货公司资管子公司;07 商业银行;08 保险公司或保险资产管理公司;09 信托公司;10 私募基金管理人;11 其他金融机构。

5、产品类别在以下选项中选择:01 基金公司特定资管产品(单一客户);02 基金公司特定客户资管产品(多客户);03 证券投资基金;04 证券公司资管产品(定向资管);05 证券公司资管产品(集合资管);06 证券公司资管产品(专项资管);07 期货公司资管(单一客户);08 期货公司资管(多客户);09 保险资管产品(特定客户资管);10 保险资管产品(集合资管);11 保险产品;12 保险公司自有资金;13 信托产品;14 私募基金;15 银行理财产品;16 企业年金;17 社保基金;18 地方社保基金;19 养老金产品;20 其他。

6、该产品一码通账号为中国结算账户系统分配的一码通账号。

7、填写该产品月末在报送券商处持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号,如果同一产品在报送券商处存在多个月末交易所债券质押式正回购余额的证券账号,填写多个,用分号或者逗号隔开。

8、该产品在报送券商处月末持有交易所债券余额的其他证券账户号,可填写多个,多个账户之间用分号或者逗号隔开。

表 3/5:

证券公司经纪业务模式数据报送表——主体基本信息 (无托管人的产品客户)(注1)		
填制单位:		填制日期:
行次	回购融资主体信息	
1	产品名称(注2)	
2	基金编码(注3)	
3	管理人名称	
4	管理人类别	选择类别(注4)
5	产品类别	选择类别(注5)
6	产品成立日	

7	初始募集金额（亿元）	
8	投资比例限制（产品类型）	选择类别（注6）
9	结构化产品初始杠杆倍数（注7）	
行次	回购融资主体证券账户信息	
1	该产品一码通账号（注8）	
2	产品持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号（注9）	沪
		深
3	产品持有交易所债券余额的其他证券账户号（注10）	沪
		深

注：

- 1、此报表适用于经纪业务模式下参与融资回购交易的各类无托管人的产品客户，报送机构为经纪券商。
- 2、产品名称应与产品设立文件或者向监管机构的备案文件等有关证明材料保持一致。
- 3、基金编码，公募基金填写在证监会备案的基金编码；私募投资基金等产品填写在基金业协会备案的编码。无上述两类编码的可不填。
- 4、管理人类别在以下选项中选择：01 证券公司；02 证券公司资管子公司；03 基金公司；04 基金公司资管子公司；05 期货公司；06 期货公司资管子公司；07 商业银行；08 保险公司或保险资产管理公司；09 信托公司；10 私募基金管理人；11 其他金融机构。
- 5、产品类别在以下选项中选择：01 基金公司特定资管产品（单一客户）；02 基金公司特定客户资管产品（多客户）；03 证券投资基金；04 证券公司资管产品（定向资管）；05 证券公司资管产品（集合资管）；06 证券公司资管产品（专项资管）；07 期货公司资管（单一客户）；08 期货公司资管（多客户）；09 保险资管产品（特定客户资管）；10 保险资管产品（集合资管）；11 保险产品；12 保险公司自有资金；13 信托产品；14 私募基金；15 银行理财产品；16 企业年金；17 社保基金；18 地方社保基金；19 养老金产品；20 其他。
- 6、投资比例限制（产品类型）在以下选项中选择：01：80%以上的资产投资于股票的（即股票基金或产品）；02：80%以上的资产投资于债券的（即债券基金或产品）；03：仅投资于货币市场工具（即货币市场基金或产品）；04：投资于股票、债券、货币市场工具，但不属于股票基金和债券基金的（即混合基金或产品）；05：不限制比例（其他类产品）。
- 7、填写结构化产品成立时设定的杠杆倍数：杠杆倍数=优先级份额/劣后级份额。若存在中间级份额，应当在计算杠杆倍数时计入优先级份额。如果产品不是结构化产品，则不填。
- 8、该产品一码通账号为中国结算账户系统分配的一码通账号。
- 9、填写该产品月末在报送券商处持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号，如果同一产品在报送券商处存在多个月末交易所债券质押式正回购余额的证券账号，填写多个，用分号或者逗号隔开。
- 10、填写该产品月末在报送券商处持有交易所债券余额的其他证券账户号，可填写多个。多个账户之间用分号或者逗号隔开。

表 4/5:

证券公司经纪业务模式数据报送表——主体基本信息（机构客户）（注1）		
填制单位：		填制日期：
行	回购融资主体信息	

次		
1	机构客户名称(注2)	
2	机构客户证明文件号码(注3)	
3	经纪业务客户机构类别	选择类别(注4)
4	机构客户的主营业务	
行次	回购融资主体证券账户信息	
1	该客户一码通账号(注5)	
2	客户持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号(注6)	沪
		深
3	客户持有交易所债券余额的其他证券账户号(注7)	沪
		深

注:

1、此报表适用于经纪业务模式下的法人机构类客户，报送机构为经纪券商。在数据报送统计期内，法人回购融资主体单日最大回购未到期余额超过一定金额门槛的需要进行数据报送，不满足报送门槛的无需报送。

2、经纪业务客户名称应填写证明文件上的全称。

3、机构客户证明文件号码为社会信用证（三证合一）号码；没有该号的可填写营业执照号。

4、经纪业务客户机构类别在以下选项中选择：01 一般法人机构；02 金融机构；03 非法人机构。

5、该客户一码通账号为中国结算账户系统分配的一码通账号。

6、填写该客户月末在报送券商处持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号，如果同一客户在报送券商处存在多个月末交易所债券质押式正回购余额的证券账户号，填写多个，用分号或者逗号隔开。

7、填写该客户月末在报送券商处持有交易所债券余额的其他证券账户号，可填写多个。多个账户之间用分号或者逗号隔开。

表 5/5:

证券公司经纪业务模式数据报送表——数据报送主 表(无托管人的产品客户、机构客户) (注1)			
填制单位:		填制日期:	
一、现券托管量(注2)			
种类	行次	托管量(月末;面值;亿元)	
		上交所	深交所
利率债(注3)	1		
信用债(注4)	2		
其中:交易所市场债券入库、质押及冻结情况(月末;折算前面值;亿元)			
1、债券质押式回购已入库数量(面值)		上交所	深交所
利率债	3		

	信用债		4		
2、	债券质押式协议回购质押冻结数量（面值）			上交所	深交所
	利率债		5		
	信用债		6		
3、	其他质押或冻结债券数量（面值）			上交所	深交所
	利率债		7		
	信用债		8		
二、回购未到期余额（月末）（注5）					
	种类	方向	行次	未到期余额（月末；亿元）	
上交所	债券质押式回购	正回购	9		
		逆回购	10		
	债券质押式协议回购	正回购	11		
		逆回购	12		
深交所	债券质押式回购	正回购	13		
		逆回购	14		
	债券质押式协议回购	正回购	15		
		逆回购	16		
三、客户资产负债情况（月末）（注6）					
	项目		行次	月末（亿元）	
	客户总金融资产		17		
	客户总负债		18		
	客户净金融资产		19		
四、杠杆倍数					
杠杆倍数	回购杠杆（注7）	上交所	20		
		深交所	21		
		交易所债券市场（注8）	22		
	总体杠杆（注9）	23			

注：

- 1、本表适用于券商经纪业务模式下的无托管人的产品客户及机构客户，报送机构为经纪券商。
- 2、现券托管量的范围，仅限于产品客户或机构客户在报送券商处托管的现券量。
- 3、利率债包含国债、地方债、央票、政策性金融债。
- 4、交易所市场信用债的范围：企业债、公司债、可转债、分离债、可交换债、资产支持证券等。
- 5、回购未到期余额的范围：仅限于产品客户或机构客户在报送券商处托管的回购未到期余额。
- 6、客户资产负债情况的范围，仅填写产品客户或机构客户在报送券商处的托管总金融资产、托管总负债。客户总金融资产包括客户存管在券商处的交易保证金、托管在券商处的证券及衍生品总市值；客户总负债包括客户参与各项回购业务产生的负债以及融资融券业务产生的负债总和。客户净金融资产，客户总金融资产减去客户总负债。
- 7、回购杠杆=债券托管量/(债券托管量-正回购未到期额)，分市场按照各分市场托管量及回购未到期额计算，债券市场按照托管总量和回购未到期总额计算。
- 8、交易所债券市场指上交所和深交所债券市场合并计算回购杠杆。

9、总体杠杆=客户总金融资产/(客户总金融资产-总负债)。

三、托管人数据报送表（含托管人结算业务模式的产品、经纪业务模式下有托管人的产品）

表 1/3:

<h2 style="margin: 0;">债券质押式回购融资主体数据报送</h2> <h3 style="margin: 0;">——托管人数据报送表（注 1）</h3>																								
<table border="1" style="margin: auto; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">托管人名称:</td> <td colspan="3"></td> </tr> <tr> <td colspan="2">结算参与人编码:</td> <td colspan="3"></td> </tr> <tr> <td>自营结算备付金账号 (担保交收)</td> <td style="text-align: center;">沪 深</td> <td colspan="3"></td> </tr> <tr> <td colspan="2">填报日期:</td> <td colspan="3"></td> </tr> </table>					托管人名称:					结算参与人编码:					自营结算备付金账号 (担保交收)	沪 深				填报日期:				
托管人名称:																								
结算参与人编码:																								
自营结算备付金账号 (担保交收)	沪 深																							
填报日期:																								
托管业务分管领导:	姓名		职务																					
	电话		手机																					
	Email																							
托管业务部门负责人:	姓名		所在部门																					
	职务		电话																					
	手机		Email																					
填报联系人:	姓名		所在部门																					
	职务		电话																					
	手机		Email																					

注:

1、此报表适用于托管人名下托管的参与融资回购业务的各类产品，包括两类业务模式的托管客户：托管人结算业务模式的产品、经纪业务模式下有托管人的产品。报送机构为产品托管人。

表 2/3:

<h2 style="margin: 0;">托管人数据报送表——主体信息（托管人填报）</h2>		
填制单位:		填制日期:
行次	回购融资主体信息	

1	产品名称（注1）	
2	基金编码（注2）	
3	管理人名称	
4	管理人类别	选择类别（注3）
5	托管人名称	
6	产品类别	选择类别（注4）
7	产品成立日	
8	初始募集金额（亿元）	
9	投资比例限制（产品类型）	选择类别（注5）
10	结构化产品初始杠杆倍数（注6）	
11	产品托管人是否是该产品的结算 参与人	是/否
行 次	回购融资主体证券账户信息	
1	该产品一码通账号（注7）	
2	产品持有交易所债券质押式正回 购余额的证券账户号（注8）	沪
		深
3	产品持有交易所债券余额的其他 证券账户号（注9）	沪
		深
4	产品其他证券账户号（注10）	沪
		深

注：

1、产品名称应与产品设立文件或者向监管机构的备案文件等有关证明材料保持一致。如果产品类型为企业年金计划，则应以托管人单独核算的不同管理人管理的投资组合为单位进行报送。

2、基金编码，公募基金填写在证监会备案的基金编码；私募投资基金等产品填写在基金业协会备案的编码。无上述两类编码的可不填。

3、管理人类别在以下选项中选择：01 证券公司；02 证券公司资管子公司；03 基金公司；04 基金公司资管子公司；05 期货公司；06 期货公司资管子公司；07 商业银行；08 保险公司或保险资产管理公司；09 信托公司；10 私募基金管理人；11 其他金融机构。

4、产品类别在以下选项中选择：01 基金公司特定资管产品（单一客户）；02 基金公司特定客户资管产品（多客户）；03 证券投资基金；04 证券公司资管产品（定向资管）；05 证券公司资管产品（集合资管）；06 证券公司资管产品（专项资管）；07 期货公司资管（单一客户）；08 期货公司资管（多客户）；09 保险资管产品（特定客户资管）；10 保险资管产品（集合资管）；11 保险产品；12 保险公司自有资金；13 信托产品；14 私募基金；15 银行理财产品；16 企业年金；17 社保基金；18 地方社保基金；19 养老金产品；20 其他。

5、投资比例限制（产品类型）在以下选项中选择：01：80%以上的资产投资于股票的（即股票基金或产品）；02：80%以上的资产投资于债券的（即债券基金或产品）；03：仅投资于货币市场工具（即货币市场基金或产品）；04：投资于股票、债券、货币市场工具，但不属于股票基金和债券基金的（即混合基金或产品）；05：不限制比例（其他类产品）。

6、填写结构化产品成立时设定的杠杆倍数：杠杆倍数=优先级份额/劣后级份额。若存在中间级份额，应当在计算杠杆倍数时计入优先级份额。如果产品不是结构化产品，则不填。

- 7、该产品一码通账号为中国结算账户系统分配的一码通账号。
- 8、填写该产品在月末持有交易所债券质押式正回购余额的证券账户号，如果同一产品在该托管人处存在多个月末交易所债券质押式正回购余额的证券账户号，填写多个，用分号或者逗号隔开。
- 9、填写该产品月末持有交易所债券余额的其他证券账户号，多个账户之间用分号或者逗号隔开。
- 10、填写该产品在月末不持有交易所债券余额也不持有债券质押式正回购余额的其他证券账户号。

表 3/3:

托管人数据报送表——数据报送主表（托管人填报）				
填制单位：		填制日期：		
一、产品持有债券量(会计口径，注1)				
种类	行次	月末持有量（面值；亿元）		
		上交所	深交所	
利率债（注2）	1			
信用债（注3）	2			
种类	行次	银行间		
利率债	3			
信用债	4			
二、回购未到期余额（月末）				
	种类	方向	行次	未到期余额（月末，亿元）
上交所	债券质押式回购	正回购	5	
		逆回购	6	
	债券质押式协议回购	正回购	7	
		逆回购	8	
深交所	债券质押式回购	正回购	9	
		逆回购	10	
	债券质押式协议回购	正回购	11	
		逆回购	12	
银行间	债券质押式回购	正回购	13	
		逆回购	14	
	债券买断式回购	正回购	15	
		逆回购	16	
三、资产负债情况（月末）				

项目		行次	月末（亿元）	
产品总资产		17		
产品净资产		18		
产品总负债		19		
四、杠杆倍数				
杠杆倍数	回购杠杆（4）	上交所	20	
		深交所	21	
		银行间	22	
		债券全市场（注5）	23	
	总体杠杆（注6）		24	

注：

1、产品持有债券量按照会计口径统计是指，对于银行间买断式回购的标的债券过户的情况，买断式正回购的卖出回购债券纳入产品持有债券统计范围，买断式逆回购的买入返售债券不纳入产品持有债券统计范围。债券借贷等标的债券过户的情况，参照该标准。

2、利率债包含国债、地方债、央票、政策性金融债。

3、信用债的范围包括：交易所市场的企业债、公司债、可转债、分离债、可交换债、资产支持证券等；银行间市场的金融债、企业债券、政府支持债券、中期票据、短期融资券、定向工具、国际机构债、资产支持证券、同业存单等。

4、回购杠杆=产品持有债券量/(产品持有债券量-正回购未到期额)，分市场按照各分市场产品持有债券量及回购未到期额计算，债券市场按照持有债券总量和回购未到期总额计算。

5、债券全市场指交易所债券市场和银行间债券市场合并计算回购杠杆。

6、总体杠杆=总资产/(总资产-总负债)。