

关于调整深市受信用保护债券质押式回购业务相关事宜的通知

中国结算深业字〔2022〕51号

各市场主体：

根据《中国证券登记结算有限责任公司受信用保护债券质押式回购管理暂行办法（2022年修订版）》（以下简称“《暂行办法》”），现就受信用保护债券质押式回购业务有关事项调整并通知如下：

一、对于经审核符合《暂行办法》相关规定的合格受信用保护债券，允许投资者将相关债券及对应的为其提供信用风险保护的合格信用保护凭证一并提交入质押品保管库开展融资回购交易。其中，本业务中的合格信用保护凭证仅限于为单一债券提供信用保护的凭证；债券及凭证的数量对应关系始终为1张凭证保护1张债券，不受债券分期偿还等因素影响。

二、投资者申报相关债券及凭证入质押品保管库（以下简称“入库”）或从质押品保管库转出（以下简称“出库”）的，需委托结算参与人向本公司申报。结算参与人可向本公司指定邮箱（szhg@chinaclear.com.cn）提交《受信用保护债券回购入库/出库申请表》（见附件）进行申报。对于每个交易日13:30前收到的申请，本公司当日办理；对于13:30后收到的申请，业务办理顺延一个交易日。

三、对于入库申请，本公司首先办理信用保护凭证入库（T日），次一交易日（T+1日）根据已成功入库的凭证数量，办理相应数量的受信用保护债券的入库。T+1日入库成功的受信用保护债券 T+1日起可用于弥补标准券不足，T+2日起可用于回购交易。

四、对于出库申请，本公司首先办理受信用保护债券出库（T日），当日日终在可出库质押券折算标准券数量足额的条件下予以出库成功，T+1日在受信用保护债券出库成功的情况下办理相应数量的信用保护凭证的出库。当日出库成功的受信用保护债券、信用保护凭证，下一交易日起可以卖出。

五、对于合格信用保护凭证剩余保护期限不再符合《暂行办法》相关规定，或凭证创设机构丧失合格创设机构资格的，本公司将对相关受信用保护债券和信用保护凭证实施出库处理，无需投资者或结算参与者申请。投资者或结算参与者应及时补足质押券或现金担保品。

六、本公司每个交易日计算并公布合格受信用保护债券的折算率。本公司将已入库且库内具有足额信用保护凭证的受信用保护债券纳入标准券核算，核算方式按照《中国结算深圳分公司债券登记结算业务指南》相关规定办理。

七、已成功的受信用保护债券及信用保护凭证入库、出库数据，本公司通过业务类别为 ZYRK、ZYCK 的明细结果库数据（SJSJG）向结算参与者发送，其中客户订单编号为空。质押品

保管库内的受信用保护债券及信用保护凭证明细，本公司通过业务类别为 ZYMX 的明细结果库数据向结算参与人发送。

八、本通知自 2022 年 8 月 1 日起实施。《关于开展深市受信用保护债券质押式回购业务相关事宜的通知》（中国结算深业字〔2021〕10 号）同步废止。

业务联系电话：0755-21899255

特此通知。

附件：受信用保护债券回购入库/出库申请表（模板）

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

2022 年 7 月 29 日

附件

受信用保护债券回购入库/出库申请表

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司：

本公司申请办理受信用保护债券业务如下：

业务类型	<input type="checkbox"/> 入库 <input type="checkbox"/> 出库		
一、回购融资主体信息			
回购融资主体证券账户号			
回购融资主体证券账户全称			
托管单元号码			
二、入库/出库信用保护凭证信息			
序号	凭证代码	凭证简称	凭证数量（张）
1			
2			
三、入库/出库受信用保护债券信息			
序号	债券代码	债券简称	债券数量（张）
1			
2			
四、联系人信息			
联系人		手机	
固定电话		邮箱	

本公司承诺：遵守有关法律法规、行政规章和贵公司相关业务规则等规定；保证上述申请是回购融资主体的真实意思表示，本公司同意回购融资主体的相关申请；知晓并同意贵公司在合格信用保护凭证剩余保护期限不再符合《中国证券登记结算有限责任公司受信用保护债券质押式回购管理暂行办法》相关规定或凭证创设机构丧失合格创设机构资格时，将相关受信用保护债券和信用保护凭证实施出库处理，本公司及回购融资主体将及时补足质押券或现金担保品。本公司承担由此产生的一切后果与责任。

特此申请。

申请单位（结算参与人）全称

（加盖公章或预留印鉴）

年 月 日