

# 深圳证券交易所 质押式报价回购交易 会员业务指南

二〇一四年四月

# 目 录

第一章 报价回购交易概述.....	3
第二章 交易权限申请与开通.....	4
一、交易权限申请.....	4
二、账户申请与指定.....	6
三、技术系统仿真测试.....	6
四、技术系统全网测试.....	7
五、交易权限开通.....	7
六、交易权限暂停和终止.....	7
第三章 额度与质押物管理.....	8
一、报备额度管理.....	8
二、质押物及基金专户投资范围.....	8
三、新增可质押证券.....	9
四、新增基金专户.....	9
第四章 交易.....	10
一、会员交易及相关系统前端控制.....	10
二、交易品种与时间.....	11
三、报价.....	11
四、申报与成交.....	11
第五章 信息披露、数据报送与业务报告.....	12
一、信息披露.....	12
二、数据报送.....	13
三、定期报告.....	13
四、临时报告.....	14
第六章 违约处置.....	15
一、质押券处置委托协议.....	15
二、会员内部管理.....	15
三、违约处置流程.....	15
第七章 其他.....	18

特别说明：本指南仅为方便会员开展质押式报价回购交易（以下简称“报价回购交易”）之用，并非本所业务规则或对规则的解释。如本指南与国家法律、法规及有关业务规则发生冲突，应当以法律、法规及有关业务规则为准。本所将根据报价回购交易的发展情况，对本指南作出修订，并保留对本指南的最终解释权。

为指导报价回购交易顺利开展，根据本所、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）发布的《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》（以下简称“《业务办法》”）和相关规定，制定本指南。

## **第一章 报价回购交易概述**

本指南所称报价回购交易是指会员将符合规定的自有资产作为质押物，以质押物折算后的标准券数量所对应金额作为融资的额度，通过报价方式向会员符合条件的客户融入资金，同时约定会员在回购到期时向客户返还融入资金、支付相应收益的交易。

本所以对报价回购交易实行交易权限管理。会员开展报价回购交易，须向本所申请开通报价回购交易权限，并经本所同意。

会员开展报价回购交易，应当严格遵守相关法律、法规、中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）部门规章和本所、中国结算相关业务规则及规定，切实执行会员报价回购交易内部管理制度，认真履行与客户签署的协议，自觉接受中国证监会、本所和中国结算的监督管理。

会员办理与本所报价回购交易相关的业务，适用本指南。

报价回购交易的登记结算业务，适用中国结算深圳分公司的

相关规定。

## 第二章 交易权限申请与开通

### 一、交易权限申请

具备证券自营和证券经纪业务资格的会员可以申请开通报价回购交易权限。申请开通报价回购交易权限的业务流程及办理时间参见《质押式报价回购交易权限申请与开通流程及办理时间》（附件1）。

会员申请开通报价回购交易权限的，应当提交以下材料：

- （一） 业务申请书；
- （二） 《质押式报价回购交易承诺函》（附件2）；
- （三） 经营证券业务许可证（副本）；
- （四） 业务方案和内部管理制度等相关文件，包括合规管理部门、风险管理部门出具的评估意见书；
- （五） 《客户协议》、《风险揭示书》和《产品资料概览》样本；
- （六） 与第三方机构签订的折算率委托计算协议；
- （七） 《质押券处置委托协议》；
- （八） 业务和技术系统准备情况报告；
- （九） 《质押式报价回购交易证券代码申请表》（附件3）；
- （十） 负责报价回购交易的公司分管人员、高级管理人员与业务人员名单及其联系方式；
- （十一） 以基金专户份额为质押物的，提交与证券投资基金管理公司（以下简称“基金管理公司”）签订的资产管理合同及相关投资顾问协议；
- （十二） 本所规定的其他材料。

业务申请书应当列明报价回购交易报备额度，加盖申请会员公章，会员法定代表人应当在业务申请书上签字，并严格按照如下文字做出承诺：“保证申请材料内容真实、准确、完整，如申请材料存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。”

以基金专户份额为质押物的，会员应当委托一家或以上基金管理公司担任基金专户管理人。基金专户管理人应当符合以下条件：

- （一） 成立两年以上，具备基金专户管理及债券基金、货币市场基金等公募基金运作管理的经验；
- （二） 具有完善的内部稽核监控制度、合规和风险控制制度；
- （三） 最近两年没有受到刑事处罚、中国证监会行政处罚或者证券交易所纪律处分；
- （四） 与会员不存在关联关系；
- （五） 本所和中国结算规定的其他条件。

以基金专户份额为质押物的，会员应当选择具备基金托管业务资格的第三方金融机构担任基金专户的托管人，基金专户托管人应当符合以下条件：

- （一） 具有债券基金、货币市场基金等公募基金托管运作经验；
- （二） 具有完善的内部稽核监控制度、合规和风险控制制度；
- （三） 最近两年没有受到刑事处罚、中国证监会行政处罚或者证券交易所纪律处分；
- （四） 与会员不存在关联关系；

(五) 本所和中国结算规定的其他条件。

会员合规管理部门应当对业务主要要素的合规性、相关参与主体的法律关系、利益冲突防范措施、客户权益保障措施等方面出具评估意见。

申请材料应当逐项标明序号，压缩为一个电子文件，以“××证券公司报价回购交易申请材料×年×月×日”为文件名，通过“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“公文上传”栏目在线提交，提交时填写的公文标题与文件名相同。上述材料应当采用 PDF 文件格式，其中（一）、（二）、（三）、（九）应当经彩色扫描。

对符合要求的申请，本所向会员分配报价回购交易证券代码，发出《质押式报价回购交易证券代码通知书》（附件 4，以下简称“《证券代码通知书》”）。

## **二、账户申请与指定**

会员取得《证券代码通知书》后，应当根据中国结算深圳分公司的相关规定，向其申请开立报价回购交易专用担保资金账户和报价回购交易专用处置证券账户，并指定自营证券账户。

## **三、技术系统仿真测试**

会员、基金专户管理人及托管人应当按照本所和中国结算深圳分公司的相关要求和安排，参与报价回购交易技术系统仿真测试全部测试项目的测试。

会员提交开展报价回购交易申请材料，并按照《深圳证券交易所报价回购业务之券商技术系统变更指南》完成相关交易、结算系统建设的，按照指定方式提交仿真测试申请表（附件 5）。

以基金专户份额为质押物的，基金专户管理人、托管人完成技术系统准备后，按照指定方式由基金专户管理人提交基金专户申赎仿真测试申请表（附件6），与会员一并参加仿真测试。

#### **四、技术系统全网测试**

仿真测试通过后，会员、基金专户管理人及托管人应当按照本所和中国结算深圳分公司的相关要求和安排，参加报价回购交易技术系统全网测试全部项目的测试。

参加前，会员需通过“会员业务专区”-“业务办理”-“报价回购业务”-“产品新增”，在线申请开通报价回购交易权限，并上传本指南“二、交易权限申请”中要求的材料。

会员参与报价回购交易全网测试使用的证券代码、证券账户、资金账户均参照业务正式开展后的配置。

#### **五、交易权限开通**

技术系统全网测试通过后，本所向会员发出开通指定交易单元报价回购交易权限的通知，会员收到通知后，方可正式开展报价回购交易。

会员提交的“二、交易权限申请”中的材料发生变更的，应当于变更后的次一交易日，通过“会员业务专区”-“业务办理”-“报价回购业务”-“产品变更”，更新相关材料。

#### **六、交易权限暂停和终止**

会员可以通过“会员业务专区”-“业务办理”-“报价回购业务”-“产品注销”，向本所提出终止报价回购交易权限的申请。提交申请时，应当不存在未到期报价回购交易。

本所可以根据《业务办法》的相关规定暂停或终止会员报价回购交易权限。

## **第三章 额度与质押物管理**

### **一、报备额度管理**

会员应当合理确定报价回购交易额度，有效防范业务风险。

业务开展期间，报备的报价回购交易额度需要调整的，会员可以在每一交易日 15:00 前，通过“会员业务专区”-“业务办理”-“报价回购业务”-“产品变更”向本所提出调整申请。调整后的交易规模在申请通过后的次一交易日生效。

### **二、质押物及基金专户投资范围**

会员可以提交以下自有资产作为质押物：

- （一）符合深交所债券质押式回购交易相关规定的债券（信用类债券信用级别应当为 AA 级以上）；
- （二）基金份额；
- （三）深交所和中国结算认可的其他证券；
- （四）现金。

以基金专户份额作为质押物的，基金专户的投资范围可以包括：

- （一）现金类品种，包括现金、银行存款、货币市场基金。
- （二）利率类债券，包括交易所债券市场和银行间债券市场上市挂牌的国债、地方政府债、政策性金融债、央票。
- （三）信用类债券，包括交易所债券市场和银行间债券市场上市挂牌的信用级别为 AA 级及以上的企业债、公司债、可分离债、金融债、中期票据、短期融资券、超短融。



### 三、新增可质押证券

在上述已经列明的质押物和基金专户投资范围之外，会员拟增加其他质押证券或投资品种的，应先向本所提出申请和论证报告，经本所和中国结算深圳公司组织相关机构评估确定后，方可进入可质押证券清单或基金专户投资范围。

会员新增可质押证券入库的，应当于 T 日 11:30 前，通过“会员业务专区-公文及报表上传-公文上传”提交《质押式报价回购交易新增可质押证券申请表》（附件 7，以下简称《可质押证券申请表》），该材料应当以 PDF 格式文件格式，并经彩色扫描。本所于 T+1 日将处理意见发送至中国结算深圳分公司。中国结算深圳分公司于 T+1 日录入新增可质押证券，T+2 日生效。

会员应当于 T+1 日晚 21:00 前向中国结算深圳分公司登记结算系统正确发送每只新增可质押证券的当日收盘价（已在二级市场交易的证券）、净值（未在二级市场交易的证券）和折扣系数（折扣系数不能大于 1）。会员委托第三方机构发送每只新可质押证券的收盘价、净值和折扣系数的，参照上述要求执行。

对于新增可质押证券，会员可于 T+2 日日间通过中国结算深圳分公司 D-COM 系统提交新可质押证券。T+1 日折扣系数数据发送失败的，中国结算深圳分公司对 T+2 日质押券入库作失败处理。

### 四、新增基金专户

会员新增一个以上基金专户的，应当提交以下材料：

- （一） 业务申请书；
- （二） 合规管理部门、风险管理部门出具的评估意见书；
- （三） 与基金管理公司签订的资产管理合同及相关投资顾

问协议。

以上材料应当逐项标明序号，压缩为一个电子文件，以“××证券公司报价回购交易新增基金专户申请材料×年×月×日”为文件名，通过“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“公文上传”栏目在线提交，提交时填写的公文标题与文件名相同。上述材料应当采用 PDF 文件格式，其中（一）应当经彩色扫描。

新增基金专户开展业务前，会员、基金专户管理人、托管人应按照中国结算深圳分公司的相关要求和安排，参加并通过中国结算深圳分公司组织的基金专户申赎技术系统仿真测试，并按照“三、新增可质押证券”要求，提交《可质押证券申请表》。

## 第四章 交易

### 一、会员交易及相关系统前端控制

会员应当建立报价回购交易管理系统，对报价回购交易实施统一管理，严格做好以下前端控制：

（一）参与报价回购的客户必须符合资质审查标准，并已签署《客户协议》、《风险揭示书》；

（二）会员实际开展的报价回购交易总金额不得超过其报价回购额度，报价回购额度为“报备的报价回购交易的额度”与“质押库和担保资金账户中未被司法冻结或其他原因冻结的所有质押物经折算后的标准券总量所对应金额”中的较小值；

会员可以在报价回购额度内，根据质押物明细数据及未到期余额数据对委托申报进行有效控制。同时，建立占用率预警机制，报价回购总额不超过标准券总额，按照 90% 占用率进行预警，最终占用比例不超过 95%。

（三）报价回购交易的申报数量单位为张，1 张为人民币

100 元；初始交易最低申报数量为 10 张，超出部分应当为 10 张的整数倍；提前购回交易最低申报数量为 1 张，超出部分应当为 1 张的整数倍；

（四） 在确保质押物及可用标准券数量足额的情况下，方可提交质押物转出申报。

## **二、交易品种与时间**

业务开展期间，交易品种期限发生减少或增加的，会员应当在变更后次一个交易日内通过“会员业务专区”-“业务办理”-“报价回购业务”-“产品变更”向本所报备。

会员可以在《业务办法》规定的交易时间内，与客户约定具体业务办理时间。

## **三、报价**

会员可以根据客户初始委托参与资金、品种期限等不同情况，制定报价标准，对符合同一报价标准的客户，应当给予相同报价。

会员可以在初始委托时与客户约定提前购回报价，或约定提前购回价格确定方式。发生提前购回的，会员应当保证申报中的提前购回价格符合与客户的约定。

## **四、申报与成交**

### **（一）购回交易**

报价回购交易实行“一次成交，两次结算”，对于到期购回，会员不须申报，由中国结算深圳分公司自动进行清算交收。会员应当做好到期购回与客户之间的资金清算交收。

对于提前购回交易，会员须向交易系统申报提前购回交易指令。会员应当逐笔检查提前购回交易委托与对应初始交易的关系，包括但不限于：对应初始交易申报合同序号一致性、客户证券账户号码一致性、数量不能超出初始交易数量、对应初始交易为未到期交易等。

根据提前购回数量是否为对应的初始交易全部数量，提前购回交易分为全部提前购回与部分提前购回。对于部分提前购回，会员应当将初始交易与对应的提前购回交易进行合并管理，维护初始交易剩余成交数量。

## （二）自动续做

《客户协议》允许客户自动续做的，会员应当与客户明确约定以下事项：

- 1、自动续做的初始交易金额是否包含上一期回购收益；
- 2、是否允许部分不再续做。

上述约定应当符合《业务办法》初始交易申报数量的规定。

会员应当采取合理方式提请客户注意自动续做相应的协议条款，并予以说明。

会员对巨额提前购回或巨额不再续做进行限制的，应向客户明确约定限制及解除限制的条件。

# 第五章 信息披露、数据报送与业务报告

## 一、信息披露

会员应当通过网站建立报价回购交易业务专栏，向客户披露《业务办法》、《风险揭示书》、《产品资料概览》、业务介绍及办理流程、折算率发布与调整等信息披露文件。

会员应当通过交易系统，向客户提供交易流水、客户未到期

报价回购总量、证券公司未到期报价回购总量及证券公司质押物所折算的标准券总量等信息。

会员应当在每一交易日开市前，通过其网站或系统公布当日报价回购可用额度、报价标准、各品种的到期购回报价、提前购回报价或价格确定方式等。

以基金专户份额作为质押物的，会员还应当向客户披露基金专户份额净值、基金专户定期报告、基金专户临时报告、基金专户持有人会议决议等文件。

## **二、数据报送**

会员应当最迟于每一交易日 9:00 前通过“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“创新业务报表报送”栏目，以 DBF 方式向本所报备前一交易日的“报价回购合格投资者报告”、“报价回购业务规模报告”等数据。

具体报送要求见《报价回购业务之券商技术系统变更指南》“报价回购业务数据报送指南”。

## **三、定期报告**

会员应当在业务开展后，向本所定期提交质押式报价回购交易风险管理报告。新开业务半年内每三个月结束后的十个交易日内提交，半年以上每六个月结束后的十个交易日内提交，报告可以通过本所“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“公文上传”提交。

风险管理报告应包括以下内容：

- (一) 业务运行情况；
- (二) 质押物管理：质押物投资管理、标准券使用比例实

时监控及预警、质押物出入库、质押物折算率评估意见等；

（三） 业务额度管理：报备额度、业务开展额度、净资本控制情况等；

（四） 流动性风险管理及压力测试：流动性风险管理情况，并通过模拟极端情景，考察内部管理制度对流动性风险的应对能力；

（五） 市场风险、信用风险、操作风险等管理；

（六） 业务异常、应急处理及其他需要报告的事项。

以基金专户份额作为质押物的，基金专户管理人应在每半年结束后十个交易日内向本所报送基金专户运作报告。基金专户运作报告应包括基金专户规模、投资管理、净值表现、折算率变化、风险管理、业务异常及应急处理等情况。

#### **四、临时报告**

因质押物价值大幅波动、折算率调整、司法冻结或扣划等原因可能导致质押物不足的，会员应当立即向本所报告，并及时采取有效措施确保其报价回购可用额度占有率不超过前述规定水平。

对 T 日（T 日为初始交易、提前购回交易的申报日，或到期购回日）的清算结果，在 T+1 日资金划付失败的，会员应当立即向本所报告，说明资金划付失败的原因及处理措施。资金划付失败是由于会员资金不足导致，且未能及时采取处理措施的，本所可自 T+2 日起暂停接受会员初始交易申报，只接受提前购回申报。

由于业务和技术等原因造成业务出现异常情况的，会员应当在异常情况发生时及时向本所汇报，并于发生之日起的 2 个交易

日内提交书面报告，持续报告进展情况。

## **第六章 违约处置**

会员应当制定完善的违约处置方案，明确违约处置流程及会员内部各相关部门的职责，严格按照相关要求执行，切实保护客户权益。

### **一、质押券处置委托协议**

会员与第三方证券公司签订的《质押券处置委托协议》，应当载明处置的条件、流程、时限，双方的权利与义务，合同的生效与终止等内容。

以基金专户份额作为质押物的，会员应当与基金专户管理人签订《质押券处置委托协议》。

《质押券处置委托协议》应当明确质押券处置的具体流程及各方职责，确保质押券处置时第三方证券公司或基金专户管理人的独立性及处置过程透明、公允。业务开展期间，《质押券处置委托协议》发生变更、终止的，会员应当及时向本所报告。

### **二、会员内部管理**

会员应当在业务方案中，应明确规定其合规、风险管理、自营等部门在会员违约处置、第三方违约处置、基金专户管理人违约处置流程中的职责。

### **三、违约处置流程**

会员报价回购交易权限终止（T日）后，按以下“会员违约处置”进行处理。

会员违反“会员违约处置”的规定，在 T 日 15:00 前未能提交质押券处置申请；或在合理时间内未能完成质押券处置；或出现其他怠于、不当或无法履行处置义务情形的，本所可以根据《质押券处置委托协议》通知第三方证券公司进行处置，按以下“第三方违约处置”进行处理。

以基金专户份额作为质押物的，会员报价回购交易权限终止（T 日）后，按以下“基金专户管理人违约处置”进行处理。

#### （一）会员违约处置

1、T 日 15:00 前，会员分别通过“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“公文上传”栏目、指定传真电话向本所、中国结算深圳分公司提交质押券处置申请（附件 8）；

2、本所对质押券处置申请进行形式核对，填写内容齐备的，在 T+1 日 12:00 前书面通知中国结算深圳分公司、会员；

3、中国结算深圳分公司根据本所的通知，将全部质押券转入会员专用处置证券账户，同时将担保资金划入会员客户结算备付金账户；

4、会员可以自 T+2 日起的合理时间内，对质押券按照价格公允、快速处置的原则进行处置，处置所得资金进入会员客户结算备付金账户；

5、处置所得与担保资金之和，由会员按债权比例优先向客户公平清偿。

6、全部债务清偿后，会员向本所和中国结算深圳分公司提交业务终止报告，并可向中国结算深圳分公司申请解除剩余质押物的质押登记；处置所得与担保资金之和仍不足以偿付的，由会员对客户承担全部法律责任，客户可按《客户协议》约定的方式进行仲裁或诉讼。



## （二）第三方违约处置

1、中国结算深圳分公司根据本所的通知，将全部质押券转入会员专用处置证券账户，并托管至第三方证券公司的自营交易单元；将担保资金划入会员客户结算备付金账户；

2、第三方证券公司根据《质押券处置委托协议》的约定，对质押券按照价格公允、快速处置的原则进行处置，所得资金进入其自营结算备付金账户；

3、第三方证券公司完成处置的，根据相关规定划付处置所得资金，处置所得与担保资金之和按债权比例优先向客户公平清偿；

4、全部债务清偿后，会员应向本所和中国结算深圳分公司提交业务终止报告，并可向中国结算深圳分公司申请解除剩余质押物的质押登记；处置所得与担保资金之和仍不足以偿付的，由会员对客户承担全部法律责任，客户可按《客户协议》约定的方式进行仲裁或诉讼。

## （三）基金专户管理人违约处置

1、T日15:00前，会员分别通过“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“公文上传”栏目、指定传真电话向本所、中国结算深圳分公司提交质押券处置申请，并通知基金专户管理人；

2、本所以对质押券处置申请进行形式核对，填写内容齐备的，在T+1日12:00前书面通知中国结算深圳分公司、会员、基金专户管理人；

3、中国结算深圳分公司根据本所的通知，将全部质押券转入会员专用处置证券账户，担保资金划入会员客户结算备付金账户；

4、基金专户管理人根据《质押券处置委托协议》的约定，对专户资产进行处置；

5、基金专户管理人完成处置的，会员提交赎回委托，赎回资金交收进入会员的客户结算备付金账户，处置所得与担保资金之和按债权比例优先向客户公平清偿；

6、全部债务清偿后，会员应当向本所和中国结算深圳分公司提交业务终止报告；处置所得与担保资金之和仍不足以偿付的，由会员对客户承担全部法律责任，客户可按《客户协议》约定的方式进行仲裁或诉讼。

## 第七章 其他

业务开展期间，会员报价回购业务联系人信息发生变更的，应当通过“会员业务专区”-“业务办理”-“报价回购业务”-“产品变更”向本所报备。

本所报价回购交易业务联系人：刘超，何文俊

联系电话：0755-8866 8047，0755-8866 8883

传真：0755-8208 3864

电子邮件：cliu@szse.cn，wjhe@szse.cn

附件：1. 质押式报价回购交易权限申请与开通流程及办理时间  
2. 质押式报价回购交易承诺函  
3. 质押式报价回购交易证券代码申请表  
4. 质押式报价回购交易证券代码通知书  
5. 质押式报价回购交易技术系统仿真测试申请表  
6. 质押式报价回购基金专户申赎技术系统仿真测试申请表

7. 质押式报价回购交易新增可质押证券申请表
8. 质押式报价回购交易质押券处置申请表

附件 1:

## 质押式报价回购交易权限申请与开通流程及 办理时间

编号	事项	具体流程	办理时间 (工作日)
1	申请材料 预沟通	<p>本所根据会员提交的业务方案反馈完善建议。方案中主要业务安排和要点须根据公司合规及风控部门的确定性意见形成。相关基金公司、托管银行以及折算率计算机构的相关服务方案已经确定。</p> <p>会员技术系统开发可以在方案准备期间同时进行，技术接口规范内容详见《报价回购交易券商技术系统变更指南》。</p>	5 日
2	申请材料提交、审核与分配证券代码	<ol style="list-style-type: none"> <li>1) 会员在完成最终业务方案后，形成报价回购业务权限申报材料；</li> <li>2) 会员通过本所“会员业务专区-公文及报表上传-公文上传”栏目正式提交申报材料，材料上传后通知本所业务联系人。申请材料要求详见《深圳证券交易所质押式报价回购交易会员业务指南》（以下简称《业务指南》）；</li> <li>3) 本所在收到申请材料后组织方案实施讨论会，召集相关方对方案实施要点、技术系统准备以及上线安排等内容进行沟通，确定业务上线方案和具体时间表；</li> <li>4) 本所根据会员申请分配产品证券代码和简称，并发出代码通知书；</li> <li>5) 申报材料未通过的修改后重新提交。</li> </ol>	7 日
3	账户申请与指定	<p>会员取得代码通知书后，1) 向中国结算深圳分公司资金交收部申请开立报价回购交易专用担保金账户；2) 向客户服务部申请开立报价回购交易专用处置证券账户、指定自营证券账户。申请材料要求详见《质押式报价回购登记结算业务指南》。</p>	7 日
4	技术系统测试	<ol style="list-style-type: none"> <li>1) 会员通过指定方式提交技术系统测试申请，基金专户管理人提交基金专户申赎仿真测试申请。申请材料要求详见本所《业务指南》；</li> <li>2) 按照仿真测试相关要求和安排，会员、基金管理人、托管人需完成交易、结算、申赎等</li> </ol>	14-30 日

		全部测试项目； 3) 本所视仿真测试情况和需要，组织会员参加全网测试。会员使用真实交易单元及账户参加本所组织的全网测试的，须在测试前，向本所申请交易权限开通。	
5	开通交易权限	1) 仿真测试通过后，全网测试前，会员通过本所“会员业务专区-业务办理-报价回购业务-产品新增”在线申请开通报价回购交易权限，指定报价回购业务专用交易单元； 2) 申请材料符合规定的，本所为其所指定的交易单元开通报价回购交易权限。	3 日
6	业务开展	1) 全网测试通过后，本所向符合业务开展条件的会员发出同意开展报价回购交易的通知； 2) 在确定交易日正式开展业务。	3 日

注：1、办理时间不包括会员对所反馈的相关问题提交论证说明材料或重新提交材料的时间。

2、技术系统测试时间不包括会员技术系统需要进一步调整改造的时间。

附件 2:

## 质押式报价回购交易承诺函

深圳证券交易所:

我司申请参与质押式报价回购交易业务，并郑重承诺如下:

第一条 我司充分知晓、认可并同意遵守《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》(以下简称“《业务办法》”)、《深圳证券交易所质押式报价回购交易会员业务指南》及其他相关规定。

第二条 我司同意接受贵所依据《业务办法》及其他相关规定对本业务实施的监管。

第三条 我司同意遵照《业务办法》及其他相关规定和贵所要求及时提供相关材料，并保证材料的真实性、准确性和完整性。

第四条 我司承诺对符合同一报价标准的客户，给予相同报价。

第五条 我司同意遵照贵所的技术规范要求建立或改造交易及相关系统，严格按照接口要求发送业务数据和指令，并对发送的数据及指令的准确性、完整性和有效性负责。

第六条 我司因自身原因导致质押式报价回购交易业务出现差错的，将立即通知贵所并及时采取措施，自行负责与客户协商解决。由此给客户造成的损失，贵所不承担任何责任。

第七条 我司同意遵照贵所指定的登记结算机构的规定和要求办理质押式报价回购交易的清算、交收。

第八条 我司接受贵所依据《业务办法》及其他相关规定或国家有关主管机关的要求，暂停或终止我司质押式报价回购交易权限。

承诺人(公司盖章)

法定代表人(签字)

年 月 日

附件 3:

## 质押式报价回购交易证券代码申请表

证券公司全称		会员代码	
产品名称			
<b>质押物种类</b> (请在相应选项打√或填写)	<input type="checkbox"/> 符合深交所债券质押式回购交易相关规定的债券 <input type="checkbox"/> 基金份额 <input type="checkbox"/> 现金 <input type="checkbox"/> 深交所和中国结算认可的其他证券: _____		
报备规模(元)			
品种期限			
业务联络人姓名		联系电话	
手机		传真	
邮箱			
联系地址及邮政编码			
以下由会员管理部填写			
证券代码		证券简称	
经办人: _____  复核人: _____  部门负责人: _____		深圳证券交易所  会员管理部  年 月 日	

附件 4:

## 质押式报价回购交易证券代码通知书

证券公司全称		会员代码	
产品名称			
证券代码		证券简称	
<p>根据《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》等相关规定，XX 公司提交的业务申请符合要求，现向其分配报价回购交易证券代码，核定证券简称。请协助办理质押式报价回购交易相关事宜。</p> <p style="text-align: right;">深圳证券交易所 会员管理部 年 月 日</p>			



附件 5:

## 质押式报价回购交易技术系统仿真测试申请表

(证券公司填写)

产品名称					
管理人全称		会员代码			
是否完成业务、技术系统准备					
系统开发商名称					
质押物种类					
报备的业务规模 (元)					
交易品种					
初始交易门槛 (元)		初始交易基数 (元)			
提前购回门槛 (元)		提前购回基数 (元)			
公司该业务的负责部门及人员编制					
报价回购交易相关人员信息					
人员类别	姓名	电话	手机	电子邮箱	传真
公司分管领导					
部门负责人					
业务联络人					
技术联络人					
申请测试信息					
测试证券代码					
测试经纪托管单元 (用于客户资金清算)					
测试资金结算主席位 (用于自营资金清算)					

测试自营证券账户（用于提交质押券）	
测试指定自营证券账户（用于记录可用额度）	
指定报盘自营交易单元（自营席位对应的交易单元）	
测试基金专户/基金代码	
申请单位意见	
<p>我公司报价回购交易技术系统已基本准备就绪，各项功能验证正常，现申请参加深圳证券交易所联合中国结算深圳分公司组织的技术系统仿真测试。</p> <p style="text-align: right;">单位公章 年 月 日</p>	

附件 6:

## 质押式报价回购基金专户申赎技术系统仿真测试申请表

(基金公司填写)

基金专户全称					
基金专户简称		基金专户代码 (可填真实号码)			
管理人全称					
结算参与者代码		基金专户结算账号 (可填真实号码)			
托管行全称		通信小站号 (用于接受清算数据)			
结算参与者代码		基金专户资金交收账户 (可填真实号码)			
代销机构全称					
结算参与者代码					
测试自营托管单元 (自营资金清算)		测试经纪托管单元 (客户资金清算)			
投资者全称		证券账户号码 (可填真实号码)			
公司该业务的负责部门 及人员编制					
<b>基金专户申赎相关人员信息 (业务和技术)</b>					
人员类别	姓名	电话	手机	电子邮箱	传真
<b>申请单位意见</b>					
<p>我公司基金专户申赎技术系统已基本准备就绪, 各项功能验证正常, 现申请参加深圳证券交易所联合中国结算深圳分公司组织的技术系统仿真测试。</p> <p style="text-align: right;">单位公章 年 月 日</p>					

附件 7:

## 质押式报价回购交易新增可质押证券申请表

产品信息	产品名称						
	证券简称		证券代码				
	证券公司全称		可质押证券申报次数		<input type="checkbox"/> 首次申报 <input type="checkbox"/> 第__次申报(打钩或填写)		
可质押证券信息	序号	证券简称	证券代码	发行时间	发行规模 (亿元)	折扣系数	备注
		可添行填写					
备注: 另文附可质押证券相关评估说明。如有评级, 请在备注栏填写评级机构、评级时间及评级结果。							
证券公司联系人	业务联络人姓名			联系电话			
	手机			传真			
	邮箱						
	联系地址及邮政编码						
申请单位意见							
<p>根据《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》相关规定, 现申报上述质押式报价回购交易可质押券, 请予以办理。</p> <p style="text-align: right;">单位公章</p> <p style="text-align: right;">年 月 日</p>							
<p><b>备注:</b> 1、T 日中午 11:30 前, 证券公司通过会员业务专区“公文及报表上传-公文上传”提交本申报表。T 日为该申请表提交日;</p> <p>2、T+1 日会员管理部审核并发送至中国结算深圳分公司;</p> <p>3、中国结算深圳分公司于 T+1 日录入新增可质押证券, T+2 日生效。证券公司应当于 T+1 日晚 21:00 前向中国结算深圳分公司登记结算系统正确发送每只新增可质押证券的当日收盘价(已在二级市场交易的证券)、净值(未在二级市场交易的证券)和折扣系数(折扣系数不能大于 1);</p> <p>4、T+2 日日间, 证券公司向中国结算深圳分公司 D-COM 系统申请质押券入库。</p>							

附件 8:

## 质押式报价回购交易质押券处置申请表

证券公司全称			会员代码		
产品信息	产品名称				
	证券代码				
	质押券种类				
	指定的自营证券账户号码				
	专用担保资金账户号码				
	专用处置证券账户号码				
处置信息	处置方式				
	<input type="checkbox"/> 自行处置 <input type="checkbox"/> 第三方处置 <input type="checkbox"/> 基金专户管理人处置				
	“自行处置”的填写以下内容				
	指定客户交易单元代码				
	“第三方处置”的填写以下内容				
	第三方名称				
	第三方指定自营交易单元代码				
	“基金专户管理人处置”的填写以下内容				
基金专户管理人名称					
目前标准券总额(元)					
已开展业务规模(元)					
报价回购交易相关人员信息					
人员类别	姓名	固定电话	手机	电子邮箱	传真
公司业务联络人					
第三方处置联络人					
专户管理人处置联络人					
<p>根据《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》规定，我公司报价回购交易权限已终止。现向贵所及中国结算深圳分公司申请质押券处置，请予以办理。</p> <p style="text-align: right;">单位公章 年    月    日</p>					