

附件：

## 银行间债券市场交易行为信息档案实施指南（试行）

**第一条** 为维护银行间债券市场交易秩序，提升市场交易效率，根据《中国银行间市场交易商协会章程》《银行间债券市场债券交易自律规则》等中国银行间市场交易商协会（以下简称“交易商协会”）自律规范文件，制定本指南。

**第二条** 本指南所称交易，是指交易双方在银行间债券市场开展的债券及相关衍生品交易，包括现券买卖、债券质押式回购、债券买断式回购、债券远期、债券借贷等。

**第三条** 交易行为信息档案主要记录银行间债券市场参与者在债券报价、交易、结算等环节的未履约信息、履约统计信息、违法违规信息及根据监管要求需要记入的相关信息（以下统称为“交易行为信息”）。

**第四条** 交易行为信息收集遵循“最少、必要”原则。

**第五条** 交易行为信息收集内容包括：

（一）市场参与者在经纪撮合达成后未在交易平台履行交易约定的信息，及履约情况统计信息；

（二）市场参与者债券交易结算失败信息，以及如期进行债券结算的统计信息；

（三）市场参与者被举报投诉的债券交易未履约信息；

（四）市场参与者因虚假报价、虚假交易、内幕交易、操纵市场、利益输送等相关交易行为受到行政处罚、行政监管措施或

自律处分等信息；

（五）根据监管要求需要记入交易行为信息档案的其他信息。

**第六条** 符合以下情形之一的，可以不记入交易行为信息档案：

（一）合约达成日日终前且未在交易平台执行交易，交易双方协商一致撤销交易的；

（二）交易执行日日终前，交易双方协商一致更改交易执行日期或清算速度的（不变更交易标的、交易价格、交易量）；

（三）结算日日终前，交易一方或双方发现交易要素录入错误将导致结算失败，经交易双方协商一致重新交易，不影响如期结算的；

（四）结算日日终前，交易双方协商一致继续交易（不变更交易标的、交易价格、交易量），且于原定结算日次 1 交易日内完成结算，并及时向交易商协会提交加盖机构公章或业务专用章书面说明的；

（五）结算失败，但结算双方协商一致完成循环结算的；

（六）人民银行或交易商协会认可的其他情形。

**第七条** 信息主体、货币经纪公司需要对相关交易行为信息作出补充说明的，应向交易商协会提交相关证明材料，由交易商协会将补充说明记入交易行为信息档案，并在查询时予以展示。

信息主体是指与交易行为信息相关的当事主体。

**第八条** 信息主体认为交易行为信息存在错误、遗漏的，可提出异议并出具证明材料，申请更正。经核查属实的，将在交易

行为信息档案中予以更正，并明确告知信息主体。

涉及经纪业务的，信息主体应先联系货币经纪公司申请更正。对货币经纪公司更正结果存在异议的，可向交易商协会申请复核。

**第九条** 交易行为信息遵循“授权查询”原则。市场参与者在征得信息主体书面同意后，向交易商协会申请查询，不得擅自对外公开、披露信息主体交易行为信息。

涉及经纪业务的，市场参与者与货币经纪公司可通过经纪服务协议或其他适当方式，明确相关查询授权并约定用途。

**第十条** 交易行为信息中的未履约信息、违法违规信息，查询期限为相关行为发生之日起5年。

**第十一条** 市场参与者应按照与信息主体约定的用途使用该信息主体的交易行为信息，不得用作约定以外的用途。

**第十二条** 交易商协会根据市场发展需要收集、整理、保存市场参与者的交易行为信息，并提供信息查询、展示等相关服务。

**第十三条** 本指南自发布之日起实施。

**第十四条** 本指南由交易商协会秘书处负责解释。