

## 银行间债券市场交易行为信息档案业务问答

### 1、为什么要建立银行间债券市场交易行为信息档案？

答：近年来，债券市场持续快速发展，债券交易规模持续增加，市场参与主体日益多元化，但同时债券交易纠纷和交易违约也有所增多，甚至出现部分机构随意违约、恶意违约的情形。因此，加强债券市场诚信体系建设、维护债券市场交易秩序的市场需求日益强烈。

为回应市场关切，维护市场交易秩序，提高市场交易效率，2022年7月交易商协会建立银行间债券市场交易行为信息档案，并以“授权查询”为基本原则，为全市场成员提供相关信息查询服务。

### 2、交易行为信息的报送主体及具体方式如何？

答：交易行为信息报送主体及方式主要包括：一是经纪业务相关信息，由货币经纪公司按照规定报送。二是交易结算相关信息，由交易商协会收集交易结算失败报备说明，并与金融基础设施机构进行信息共享。三是举报投诉相关信息，主要来自交易商协会受理的交易纠纷投诉。四是行政处罚、行政监管措施或自律处分等信息，由交易商协会根据市场公开信息收集整理。此外，交易商协会在开展业务检查、调查等自律管理活动中获取的相关机构交易未履约信息，也可记入交易行为信息档案。

### 3、市场参与者是否需要报送相关交易行为信息？

答：根据中国人民银行公告〔2013〕第12号等有关规定，

发生债券交易结算失败后，**该笔债券交易的参与双方**都应向金融基础设施机构和交易商协会提交书面说明。市场参与者可以选择任一**金融基础设施机构的结算失败报备说明表**填写，发送至交易商协会指定邮箱 [jssb@nafmii.org.cn](mailto:jssb@nafmii.org.cn)，或传真至 010-66539028。待交易行为信息档案系统上线后，市场参与者不仅可在线查询交易行为信息，还可在**线填写债券交易结算失败报备说明、提交豁免申请**，自主报送债券交易结算的统计信息等。

4、债券交易结算失败后，如何申请豁免记入？

答：市场参与者认为符合豁免记入交易行为信息档案相关情形的，可向交易商协会提交豁免申请。申请豁免时，市场参与者应提交相关书面材料，包括但不限于债券交易**结算失败报备说明表及相应的成交单**（外汇交易中心本币交易系统下载）等。协商一致继续交易的，还应同时提交**新的成交单**。

5、现券交易结算失败后，交易双方协商一致继续交易的，哪些情形可以申请豁免？

答：原则上，交易双方应不变更标的债券、交易价格、券面金额，且于原定结算日次日日终前完成结算。其中，交易价格可以是债券净价、债券全价或到期收益率，任选其一。

6、债券质押式回购首期结算失败后，交易双方协商一致继续交易的，哪些情形可以申请豁免？

答：交易双方应于原定结算日次日日终前完成首期结算，其中质押券可调整，但原则上应不变更回购融资期限、融资规模。为不变更到期结算日，交易双方协商一致**减少回购融资期限的**，也可申请豁免。结合银行间债券市场实际，隔夜质押式回购首期

结算失败后，可直接申请豁免。

7、债券质押式回购到期结算失败后，哪些情形可以申请豁免？

答：结算双方应于原定结算日次日日终前办理逾期返售，并完成结算。通过中央结算公司或上海清算所业务系统线上办理逾期返售的，应在**结算失败报备说明表中注明**。通过线下操作完成逾期返售的，还应同时提交加盖机构公章或业务专用章的书面证明材料。

8、未履约行为是记录交易一方，还是交易双方？

答：原则上仅记录交易一方，即未履约的责任主体机构。但在一些特殊情形下，交易双方可能同时被记未履约行为，如交易双方自行撤销或变更交易，但不满足相关豁免情形的。

9、为什么未履约行为涉及经纪业务的，应先联系货币经纪公司更正？

答：先行联系货币经纪公司进行更正，将有助于提高相关各方的工作效率。对货币经纪公司更正结果存有异议的，市场参与者可向交易商协会申请复核。

10、交易行为信息查询结果如何查询、展示？

答：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并授权后，可向交易商协会申请查询。过渡期内，市场参与者仅可申请查询自身交易行为信息。

关于交易行为信息档案其他事宜，请联系：

郑老师 010-66539246 [zhenglidong@nafmii.org.cn](mailto:zhenglidong@nafmii.org.cn)

郭老师 010-66539225 [guohuiming@nafmii.org.cn](mailto:guohuiming@nafmii.org.cn)