

## 附件 2

# 《深圳证券交易所债券交易规则》 暂缓实施条文

序号	暂缓实施事项	条款内容	暂缓实施内容
1	债券预发行交易	<p>1.2 在深圳证券交易所（以下简称本所）开展的债券、资产支持证券及其他具有固定收益特征产品的交易及转让（以下统称债券交易）适用本规则。上市公司发行的可转换公司债券的交易，本所另有规定的，从其规定。</p> <p>在本所开展的债券交易类型包括债券现券交易、债券回购交易、债券预发行交易以及本所认可的其他交易类型。</p> <p>本规则未作规定的，适用本所其他相关业务规则的规定。</p>	第二款中“债券预发行交易”的实施时间另行通知。
2	15:30-20:00 交易时段	<p>3.1.5 除本所另有规定外，本所对不同交易方式下的债券交易时间安排如下：</p> <p>（一）采用匹配成交方式的，每个交易日的 9:15 至 9:25 为开盘集合匹配时间，9:30 至 11:30、13:00 至 15:30 为连续匹配时间；</p> <p>（二）采用点击成交、询价成交和协商成交方式的，交易时间为每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 20:00；</p> <p>（三）采用竞买成交方式的，每个交易日的 9:00 至 10:00 为卖方提交竞买发起申报时间，10:00 至 11:30 为应价方提交应价申报时间。</p>	第（二）项“采用点击成交、询价成交和协商成交方式的，交易时间为每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至 20:00”中 15:30-20:00 交易时段的实施时间另行通知。采用点击成交、询价成交和协商成交方式的，交易时间为每个交易日的 9:00 至 11:30、13:00 至

		<p>交易时间内因故停市，交易时间不作顺延。</p> <p>根据市场发展需要，本所可以调整债券交易时间。</p>	15:30。
3	结算方式与结算周期选择	<p>3.3.9 债券交易的结算方式包括多边净额结算和逐笔全额结算等。债券投资者选择结算方式及结算周期的，应当符合本所和登记结算机构的规定及要求。</p> <p>债券交易申报中结算方式采用逐笔全额结算的，债券投资者可以选择结算周期。债券现券交易结算日和债券回购交易的首次结算日不得晚于交易当日后的第三个交易日（含）。本所另有规定的除外。</p> <p>15:30 至 20:00 申报的债券交易，结算方式应当为逐笔全额结算，且债券现券交易结算日（或者债券回购交易的首次结算日）不得为交易当日。</p>	实施时间另行通知。
4	交易解除	<p>3.4.3 债券交易采用竞买成交方式，或者采用其他交易方式并以多边净额结算方式结算的，经交易系统确认成交后不得解除交易或者改变交易结果，但存在本规则第 8.1 条规定的情形除外。</p> <p>采用点击成交、询价成交、协商成交方式并以逐笔全额结算方式结算的，出现因不可抗力、预期违约、迟延履行等情形导致交易目的无法实现或者交易不能继续履行的，在交收开始前，交易双方协商一致后，可以解除相关交易。</p>	第二款的实施时间另行通知。
5	交易对手范围	3.4.5 采用逐笔全额结算方式的债券交易，债券投资者可以通过交易系统设置交易对手范围，交易一方不在交易对手范围内的交易申报，交易系统不予确认。	实施时间另行通知。
6	点击成交相关事项	<p>4.2.2 采用点击成交方式的，报价的发送范围可以是全市场，也可以是报价方自行选定的部分债券投资者。</p> <p>4.2.4 报价方可以设置申报数量全额成交要求。</p> <p>全额成交是指相关报价仅在全额申报数量经受价方一次性点击接受的情形下方可确认成交，不接受部分成交。</p>	<p>第 4.2.2 条报价的发送范围“也可以是报价方自行选定的部分债券投资者”的实施时间另行通知。采用点击成交方式的，报价的发送范围是全市场。</p> <p>第 4.2.4 条、4.2.5 条、4.2.7 条、4.2.8</p>

		<p>4.2.5 报价方可以在发出报价时设置每次仅显示部分申报数量（以下简称显示数量），单笔成交的数量不超过显示数量。设置的显示数量完全成交后，继续显示设置的显示数量和剩余申报数量的孰低值，直至申报数量完全显示并成交。</p> <p>设置的显示数量应当符合本规则第 3.3.4 条关于点击成交申报数量的相关规定。</p>	条的实施时间另行通知。
	<p>4.2.7 报价方发出报价后，未成交部分，可以修改价格和数量等报价要素。</p>		
	<p>4.2.8 结算方式为多边净额结算，并且符合以下条件的报价，报价方可以选择在本所连续匹配阶段的整时点按照连续匹配的相关规定参与限价申报的匹配成交：</p> <p>（一）报价面向全市场发送；</p> <p>（二）申报价格、申报数量符合匹配成交的相关规定；</p> <p>（三）未设置全额成交要求；</p> <p>（四）本所规定的其他条件。</p>		
7	意向申报	<p>4.3.6 债券投资者可以向全市场或者部分债券投资者发送意向申报，意向申报不可直接确认成交。收到意向申报的债券投资者可以通过询价成交、协商成交等方式与意向申报发出方达成交易。</p> <p>意向申报的申报要素应当包括证券代码、交易方向、发送范围、证券账户号码、是否匿名等内容。</p>	实施时间另行通知。
8	协商成交合并申报	<p>4.5.5 做市商或者本所认可的其他机构与不同对手方针对同一交易品种达成两笔数量相同但交易方向相反的交易意向的，可以将两笔交易合并向交易系统申报，申报要素应当符合本规则第 4.5.3 条的规定。合并申报经前述两笔交易对手方分别确认后，由交易系统确认成交。</p>	实施时间另行通知。
9	跨市场转托管	<p>5.2.5 债券投资者可以通过本所交易系统提交转托管申报，将持有的已上市流通跨市场债券在不同登记结算机构间进行托管转移。</p>	“可以通过本所交易系统提交转托管申报”的实施时间另行通知。