

附件 2:

## 修订对照表

| 原规则条款                                                                                                                                                         | 修改后条款                                                                                                                            |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 第二条 本所上市债券的现券交易、回购交易适用本细则。本细则未作规定的，适用《交易规则》及本所其他有关业务规则。                                                                                                       | 第二条 公开发行且在本所上市债券的现券交易、回购交易适用本细则。本细则未作规定的，适用《交易规则》及本所其他有关业务规则。                                                                    |
| 第三条 本细则所称债券回购交易，是指采用标准券方式的质押式回购交易，债券买断式回购等交易方式由本所另行规定。                                                                                                        | 第三条 本细则所称债券回购交易，是指采用标准券方式的质押式回购交易，债券质押式协议回购等交易方式由本所另行规定。                                                                         |
| 第四条 国债、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券及本所认可的其他债券品种，可以进行现券和回购交易。                                                                                         | 第四条 国债、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、可交换公司债券及本所认可的其他债券品种，可以进行现券和回购交易。                                                    |
| 第五条 债券交易可以采用竞价交易、大宗交易等方式，但不符合《公司债券上市规则》第 2.3 条要求的债券交易应当采用大宗交易方式。                                                                                              | 第五条 债券现券交易可以采用竞价交易、大宗交易等方式，但在申请上市时不能同时符合《公司债券上市规则》第 3.1.2 条所列条件的仅面向合格投资者公开发行的公司债券、企业债券及本所认可的其他品种债券的交易应当采用协议大宗交易等协议交易方式。          |
| 第六条 债券采用竞价交易方式的，每个交易日 9：15 至 9：25 为开盘集合竞价时间，9：30 至 11：30、13：00 至 14：57 为连续竞价时间，14：57 至 15：00 为收盘集合竞价时间。债券采用大宗交易方式的，本所接受申报时间为每个交易日 9：15 至 11：30、13：00 至 15：30。 | 债券回购交易可以采用竞价交易及本所规定的其他方式。<br>债券采用竞价交易方式的，每个交易日 9：15 至 9：25 为开盘集合竞价时间，9：30 至 11：30、13：00 至 14：57 为连续竞价时间，14：57 至 15：00 为收盘集合竞价时间。 |
| 第四十九条 债券现券（除公司债券外）和债券回购大宗交易申报的成交确认时间为每个交易日 15：00 至 15：30。<br>本所对公司债券现券大宗交易申报进行实时成交确认。                                                                         | 债券采用协议大宗交易方式的，本所交易时间为每个交易日 9：15 至 11：30、13：00 至 15：30。<br>债券采用盘后定价大宗交易方式的，本所交易时间为每个交易日 15：05 至 15：30。                            |

|                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                 |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>第二十条 债券现券竞价交易实行当日回转交易，通过竞价交易方式买入的债券，当日可以通过竞价交易或者大宗交易方式卖出。</p> <p>第五十条 通过大宗交易方式买入的债券，当日可以通过大宗交易方式卖出，次一交易日可以通过竞价交易方式卖出。</p>                                            | <p>第六条 债券现券交易实行当日回转交易，当日买入债券当日可以卖出。</p>                                                                                                                         |
| <p>第十条 国债、地方政府债券、企业债券、公司债券、分离交易的可转换公司债券现券交易采用净价交易的方式，可转换公司债券现券交易采用全价交易的方式。</p> <p>净价交易，是指买卖债券时以不含有应计利息的价格申报并成交。</p> <p>全价交易，是指买卖债券时以含有应计利息的价格申报并成交。</p>                 | <p>第十条 国债、地方政府债券、企业债券、公司债券、分离交易的可转换公司债券现券交易采用净价交易的方式，可转换公司债券、可交换公司债券现券交易采用全价交易的方式。</p> <p>净价交易，是指买卖债券时以不含有应计利息的价格申报并成交。</p> <p>全价交易，是指买卖债券时以含有应计利息的价格申报并成交。</p> |
| <p>第四十三条 在本所进行的债券交易符合以下条件的，可以采用大宗交易方式：</p> <p>（一）债券现券交易和债券回购交易单笔买卖交易数量不低于 5 千张，或者交易金额不低于 50 万元人民币；</p> <p>（二）多只债券合计单向买入或卖出的交易金额不低于 100 万元人民币，且其中单只债券的交易数量不低于 2 千张。</p>  | <p>第二十条 债券交易单笔买卖交易数量不低于 5 千张，或者交易金额不低于 50 万元人民币，可以采用大宗交易方式。</p>                                                                                                 |
| <p>第四十四条 本所接受下列类型的债券大宗交易申报：</p> <p>（一）意向申报；</p> <p>（二）定价申报；</p> <p>（三）成交申报。</p>                                                                                         | <p>第二十一条 本所接受下列类型的债券协议大宗交易申报：</p> <p>（一）意向申报；</p> <p>（二）定价申报；</p> <p>（三）成交申报。</p> <p>当天全天停牌、处于临时停牌期间或停牌至收市的债券，本所不接受其协议大宗交易申报。</p>                               |
| <p>第四十七条 成交申报指令包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量、对手方交易单元代码、约定号等内容。</p> <p>成交申报要求明确指定价格和数量。</p> <p>成交申报可以撤销，但在对手方提交申报后不得撤销。</p> <p>本所对约定号、证券代码、买卖方向、价格、数量等各项要素均匹配的成交申报进行成交确认。</p> | <p>第二十四条 成交申报指令包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量、对手方交易单元代码、约定号等内容。</p> <p>成交申报要求明确指定价格和数量。</p> <p>本所对约定号、证券代码、买卖方向、价格、数量等各项要素均匹配的成交申报进行成交确认。未匹配的成交申报可以撤销。</p>            |

|                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>第四十八条 债券现券和债券回购大宗交易申报价格范围为前收盘价的上下 30%。</p>                                                                                                                                               | <p>第二十五条 债券协议大宗交易申报价格范围为前收盘价的上下 30%。</p>                                                                                                                                                                            |
|                                                                                                                                                                                             | <p>第二十六条 盘后定价大宗交易的申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、交易单元代码、证券营业部识别码、买卖方向、数量、价格类型等内容。</p> <p>盘后定价大宗交易的价格类型包括：</p> <p>（一）证券当日收盘价；</p> <p>（二）证券当日成交量加权平均价格。</p> <p>在接受申报的时间内，未成交申报可以撤销。</p> <p>当天全天停牌或停牌至收市的债券，本所不接受其盘后定价大宗交易申报。</p> |
| <p>第二十六条 当日通过竞价交易方式买入的债券，当日可申报作为质押券；当日通过大宗交易方式买入的债券，次一交易日可申报作为质押券；当日提交的质押券，在确认质押成功后，当日可用于相应的债券回购交易。</p>                                                                                     | <p>第三十二条 当日买入的债券，当日可申报作为质押券；当日提交的质押券，在确认质押成功后，当日可用于相应的债券回购交易。</p>                                                                                                                                                   |
| <p>第三十三条 债券回购交易实行“一次成交、两次结算”。</p> <p>债券回购交易初次结算的结算价格为 100 元。回购到期二次结算的结算价格为购回价，购回价等于每百元资金的本金和利息之和，其计算公式为：</p> <p>购回价=100 元+每百元资金到期年收益×回购天数/365（天）</p> <p>回购天数，是指本细则第二十八条所述债券回购品种对应的回购期限。</p> | <p>第三十九条 债券回购交易实行“一次成交、两次结算”。</p> <p>债券回购交易初次结算的结算价格为 100 元。回购到期二次结算的结算价格为购回价，购回价等于每百元资金的本金和利息之和，其计算公式为：</p> <p>购回价=100 元+每百元资金到期年收益×回购天数/365（天）</p> <p>回购天数，是指本细则第三十四条所述债券回购品种对应的回购期限。</p>                         |
| <p>第五十四条 本所在交易时间内通过交易系统、交易所网站等即时公布公司债券大宗交易的报价信息。</p> <p>发布的报价信息包括：证券代码、证券简称、申报类型、买卖方向、数量、价格等。</p>                                                                                           | <p>第五十二条 本所在交易时间内通过交易系统或交易所网站等即时公布以下交易信息：</p> <p>（一）债券协议大宗交易的报价信息。发布的报价信息包括：证券代码、证券简称、申报类型、买卖方向、数量、价格等。</p>                                                                                                         |

|                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>第五十五条 本所在交易时间内通过交易所网站即时公布公司债券大宗交易的成交信息。</p> <p>发布的成交信息包括：证券代码、证券简称、开盘价、当日最高价、当日最低价、总成交数量、总成交金额、总成交笔数等。</p> | <p>（二）债券协议大宗交易的成交信息。发布的成交信息包括：证券代码、证券简称、当日最新价、当日最高价、当日最低价、总成交数量、总成交金额、总成交笔数等。</p> <p>（三）债券盘后定价大宗交易的交易信息，内容包括：证券代码、证券简称、价格、当日累计成交数量、当日累计成交金额以及实时买入或卖出的申报数量等。</p>                                                                                                                       |
| <p>第五十六条 本所在每个交易日结束后，通过交易所网站公布债券大宗交易每笔成交信息。</p> <p>发布的成交信息包括：证券代码、证券简称、成交量、成交价格以及买卖双方所在会员营业部或交易单元的名称。</p>     | <p>第五十三条 本所在每个交易日结束后，通过交易所网站公布以下交易信息：</p> <p>（一）债券协议大宗交易每笔成交信息。发布的成交信息包括：证券代码、证券简称、成交量、成交价格以及买卖双方所在会员证券营业部或交易单元的名称。</p> <p>（二）单只债券盘后定价大宗交易的累计成交量、累计成交金额，及该证券当日买入、卖出金额最大五家会员证券营业部或交易单元的名称和各自的买入、卖出金额；</p> <p>（三）单只债券大宗交易的累计成交量、累计成交金额，及该证券当日买入、卖出金额最大五家会员证券营业部或交易单元的名称和各自的买入、卖出金额。</p> |
| <p>第六十六条 本细则自 2012 年 12 月 10 日起施行。本所此前发布的规定与本细则不一致的，以本细则为准。</p>                                               | <p>第六十三条 本细则自 2016 年 5 月 9 日起施行。本所发布的《深圳证券交易所债券交易实施细则》（深证会〔2012〕144 号）同时废止。</p>                                                                                                                                                                                                       |

特别说明：本修订对照表仅为市场参与者进一步了解规则修订内容之用，具体修订内容应以相关业务规则为准。