

深圳证券交易所、中国结算深圳分公司关于贴现国债实行净价交易及发布V4.53版数据接口规范的通知 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/306/2021_2022__E6_B7_B1_E5_9C_B3_E8_AF_81_E5_c80_306611.htm 深圳证券交易所、中国结算深圳分公司关于贴现国债实行净价交易及发布V4.53版数据接口规范的通知各会员及相关单位：根据财政部、中国人民银行、证监会关于贴现国债实行净价交易的通知（财库[2007]21号文）要求，对贴现发行的零息国债将实行净价交易；此外，为支持分离交易型可转债的回售、资产证券化产品协议转让的成交即时确认、中小企业板临时公告的提示、基金账户区间扩大等业务，深圳证券交易所（以下简称“本所”）和中国结算深圳分公司对数据接口规范进行了相应修订。本次修订，以《深圳证券交易所数据接口规范（V4.53）》（标准代号为TS-0407-001）正式发布。现将有关事项公告如下：一、有关业务说明 1、贴现国债净价交易 贴现国债应计利息额计算公式为：贴现国债的应计利息额，同付息国债一样，通过证券信息库的“本年每股利润”（XXBNLR）和行情库的“市盈率1”（HQSYL1）发布。除此之外，贴现国债的净价交易模式与现有付息国债的净价交易完全相同，技术方案不变，具体参见本所2001年11月16日发布的《深圳证券交易所国债净价交易技术方案》（本所网站-技术专栏-历史资料 [http](http://www.szse.cn/upfiles/attach/1045/2003/11/07/gzjj2.doc)

[://www.szse.cn/upfiles/attach/1045/2003/11/07/gzjj2.doc](http://www.szse.cn/upfiles/attach/1045/2003/11/07/gzjj2.doc)）。对券商系统有以下技术需求：行情揭示系统需按每百元国债价格的净价、每百元国债所含的应计利息、全价至少两部分

揭示；另还需揭示成交金额和结算金额中的至少一个；委托系统包含柜台系统、电话委托、自助终端、网上委托现行各种方式，均按每百元国债价格的净价进行报盘；交割单打印系统需揭示每百元国债价格的净价、每百元国债价格所含的应计利息、结算价、成交数量、成交金额、结算金额。

2、分离交易型可转债回售 因分离交易型可转债使用了与原有可转债（证券代码以‘12’开头）不同的代码区间（证券代码以‘115’开头），请各会员单位检查相关系统能否处理115xxx证券的回售业务委托、回报、结算等处理。

3、资产证券化产品协议转让成交即时确认 现有资产证券化产品在15：00前可进行成交申报，但只能在15：00集中竞价市场闭市后才能进行成交确认，为改进以支持资产证券化产品的即时成交确认，证券信息库（SJSXX.DBF）中的证券级别字段（XXZQJB）增加一个取值定义：‘B’-协议转让即时成交确认证券；新证券信息库中的证券级别字段也同样修订。资产证券化产品的证券级别将由原来的‘N’变更为‘B’。

100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com