

银发〔2005〕141号

全国银行间同业拆借中心、中央国债登记结算有限责任公司：

为完善全国银行间债券市场债券交易信息披露制度，提高市场透明度，建立、健全风险监测和预警指标体系，防范市场风险，现就债券远期交易信息披露和风险监测有关事项通知如下：

一、日常披露信息

全国银行间同业拆借中心（以下简称同业中心）和中央国债登记结算有限责任公司（以下简称中央结算公司）应根据《全国银行间债券市场债券远期交易管理规定》（中国人民银行公告〔2005〕第9号）及市场风险防范的实际需要，加强对债券远期交易信息的收集、处理等工作，及时向市场投资者披露有关信息。

其中，由同业中心负责披露的信息有：

（一）市场报价信息；

（二）市场成交和行情信息；

（三）市场统计信息：

1. 单只债券不同期限品种远期交易买入（或卖出）余额及其分别占市场远期交易买入（或卖出）总余额和该只债券市场流通量的比例；

2. 单个期限品种远期交易买入（或卖出）余额及其占市场远期交易买入（或卖出）总余额的比例。

由同业中心和中央结算公司共同负责披露的信息有：

（一）单只债券单日远期交易待交割量及其占该只债券市场流通量的比例，该比例超过5%的，向市场投资者公告该只债券名称和债券远期交易到期交割日期；

（二）市场投资者债券远期交易量排名；

（三）市场投资者违约情况和中国人民银行授权披露的市场投资者违规情况。

二、风险监测和预警指标

同业中心和中央结算公司要加强债券远期交易市场的一线监控工作，建立、健全债券远期交易市场风险监测和预警指标体系，及时揭示并有效防范市场风险。风险监测和预警指标至少应包括以下内容：

（一）单家机构单只债券远期交易买入/卖出余额及其分别占该只债券流通量和该只债券市场远期交易买入/卖出总余额的比例；

（二）单家机构单个期限品种远期交易买入/卖出余额及其占该期限品种市场远期交易买入/卖出总余额的比例；

（三）单家机构远期交易卖出余额及其占该机构可用自有债券总余额的比例；

(四) 单家机构远期交易净买入余额及其占该机构实收资本(或净资产、基金资产净值、人民币营运资金)的比例;

(五) 单只债券持有量前5名机构各自债券持有量及其占该只债券总发行量的比例;

(六) 市场异常报价和交易信息。

同业中心和中央结算公司要加强债券远期交易的监测、分析工作，在每季度结束后的10个工作日内向中国人民银行提交该季度债券远期交易市场监测分析报告。

二〇〇五年六月三日

来源：《新法规速递》网站

中国内部审计协会. 版权所有 LT科技制作
协会地址：北京市海淀区中关村南大街4号
联系电话：010-82199846/47 电子邮件：xinxibu@263.net
Copyright (C) 2003 . All rights reserved