



CHINA FOREIGN EXCHANGE TRADE SYSTEM
中國外匯交易中心
全國銀行間同業拆借中心
NATIONAL INTERBANK FUNDING CENTER

用戶手冊

CIBMTS中國銀行間市場本幣交易平臺
v2.9

CFETS

目录

目录	2
1 概述	14
1.1 名词解释	14
2 客户端更新与安装配置	15
2.1 系统主要功能	15
2.2 客户端下载	21
2.3 客户端安装说明	22
2.4 客户端配置说明	22
2.5 防火墙设置	23
2.6 推荐配置	24
2.7 带宽配置	24
3 用户登录与注销	26
3.1 用户登录	26
3.1.1 交易用户登录	26
3.1.2 投资经理用户登录	28
3.2 用户实名认证/身份确认	29
3.3 用户注销	30

4 用户统一认证	31
4.1 用户管理	31
4.1.1 新建用户	31
4.1.2 其他用户管理功能	34
4.2 修改个人密码	38
4.3 用户基础信息维护	39
5 内部管理功能	41
5.1 用户权限配置	41
5.1.1 用户交易权限设置	41
5.1.2 用户身份设置	49
5.2 交易账户组管理	52
5.3 交易账户别名管理	59
5.4 资金账户设置	61
5.4.1 大额账户设置	61
5.4.2 CIPS 账户设置	62
5.5 机构信息设置	64
5.6 互联网登录设置	64
5.7 关联机构维护	65
5.8 同业存款账户设置	66

5.8.1 经办行/产品维护	66
5.8.2 资金账户维护	69
5.9 本币费用管理	73
5.9.1 交易手续费	73
5.9.2 发行服务费	74
5.9.3 缴费通知单	74
5.9.4 当季费用管理	75
6 交易操作	76
6.1 现券市场	77
6.1.1 意向报价	77
6.1.2 对话报价	79
6.1.3 请求报价	86
6.1.4 请求回复	94
6.1.5 做市报价	98
6.1.6 做市点击成交确认	103
6.1.7 指示性报价	109
6.1.8 X-Bond 订单	113
6.1.9 X-Bond 点击成交	119
6.1.10 X-Bargain 询价	123

6.1.11 发行路演	129
6.1.12 委托指令	131
6.1.13 委托指令确认	134
6.1.14 预填指令	136
6.1.15 预填指令确认	139
6.1.16 成交查询	141
6.1.17 成交行情	143
6.2 匿名拍卖	144
6.2.1 预申报	144
6.2.2 查看可申报债券列表	145
6.2.3 报价发起	146
6.2.4 X-Auction 报价管理	149
6.2.5 X-Auction 报价行情	153
6.2.6 成交行情	153
6.2.7 报价信息查询	154
6.2.8 成交查询	155
6.3 回购违约处置	155
6.3.1 申请	155
6.3.2 X-auction 申报	156

6.3.3 报价发起	157
6.3.4 X-auction 管理	159
6.3.5 X-auction 报价行情	162
6.3.6 成交行情	163
6.3.7 报价信息查询	163
6.3.8 成交查询	164
6.3.9 分量	165
6.4 货币市场	166
6.4.1 对话报价	166
6.4.2 请求报价	175
6.4.3 X-Repo 订单	190
6.4.4 X-Repo 点击成交	196
6.4.5 资金意向	198
6.4.6 担保品调整	205
6.4.7 成交查询	210
6.4.8 成交行情	215
6.4.9 存单路演	220
6.4.10 同业存款	228
6.4.11 iDeal 交易意向查询	247

6.5 衍生品市场-利率互换	248
6.5.1X-Swap 订单	248
6.5.2X-Swap 点击成交	253
6.5.3 对话报价	259
6.5.4 请求报价	263
6.5.5 成交查询	268
6.5.6 成交行情	269
6.5.7 当日成交	270
6.6 衍生品市场-标准利率互换	272
6.6.1X-Swap 订单	272
6.6.2X-Swap 点击成交	278
6.6.3 X-Swap 成交查询	279
6.6.4 X-Swap 成交行情	280
6.6.5X-Swap 当日成交	281
6.7 衍生品市场-标准债券远期	282
6.7.1X-Swap 订单	282
6.7.2 实物交割	287
6.7.3 X-Swap 成交查询	291
6.7.4 X-Swap 成交行情	291

6.7.5X-Swap 当日成交	292
6.8 衍生品市场-债券远期	293
6.8.1 对话报价	293
6.8.2 成交查询	297
6.8.3 成交行情	297
6.8.4 当日成交	298
6.9 债券借贷	299
6.9.1 意向报价	299
6.9.2 意向转对话报价	301
6.9.3 对话报价	306
6.9.4 担保品调整报价	311
6.9.5 X-Lending 订单	315
6.9.6 成交查询	322
6.9.7 成交行情	323
6.9.8 付息信息查询	325
6.10 预发行	326
6.10.1 预发行债券信息查询	326
6.10.2 预发行剩余量查询	327
6.10.3 对话报价	328

6.10.4 成交查询	332
6.10.5 成交行情	332
6.11 常备借贷便利	333
6.11.1 常备借贷便利登录	333
6.11.2 SLF 操作	334
6.11.3 超限监测	358
6.11.4 信息查询	359
6.12 衍生品市场-信用违约互换	367
6.12.1 对话报价	367
6.12.2 双向报价	369
6.12.3 成交查询	372
6.12.4 当日成交	373
6.12.5 逐笔成交行情	373
6.12.6 CDS 指数查询	374
6.13 衍生品市场-信用风险缓释凭证	375
6.13.1 对话报价	375
6.13.2 成交查询	379
6.13.3 成交行情	379
6.13.4 当日成交	380

6.13.5 衍生品交易工具查询	380
6.14 衍生品市场-远期利率协议	381
6.14.1 对话报价	381
6.14.2 成交查询	385
6.15 衍生品市场-利率互换期权	385
6.15.1 对话报价	385
6.15.2 指示性报价	389
6.15.3 成交查询	393
6.15.4 成交行情	393
6.15.5 当日成交	394
6.15.6 行权管理	394
6.15.7 报价团报价	396
6.15.8 全市场波动率收盘价	397
6.16 衍生品市场-利率上限/下限期权	398
6.16.1 对话报价	398
6.16.2 指示性报价	402
6.16.3 成交查询	406
6.16.4 成交行情	406
6.16.5 当日成交	407

6.16.6 报价团报价	407
6.16.7 全市场波动率收盘价	408
6.17 衍生品市场-G-Swap	409
6.17.1 对话报价	409
6.17.2 成交查询	413
6.17.3 当日成交	413
7 债券活跃度及 iData	414
7.1 债券活跃度	414
7.2 iData	415
8 交易设置功能	415
8.1 首选交易账户设置	415
8.2 产品篮子维护	418
8.3 信息披露	423
8.3.1 信息披露-关联交易	423
8.3.2 信息披露-重大交易	425
8.3.3 信息披露-信息披露查询	426
8.4 发起报备	427
8.5 交易报备	427
8.6 交易报备确认	429

8.7 机构群组维护	430
8.7.1 现券报价分层设置	430
8.7.2 质押式回购	433
8.7.3 资金意向	436
8.7.4 信用拆借	439
8.8 限额管理	441
8.9 对手方管理	448
8.9.1 对手方限额	448
8.9.2 现券黑名单	472
8.9.3 质押 RFQ 白名单	476
8.9.4 境外业务授信	482
8.10 货币小助手	485
8.10.1 质押式回购小助手	486
8.10.2 信用拆借小助手	491
8.11 衍生品交易参数设置	495
8.11.1 衍生品交易参数	495
8.11.2 衍生品首选资金账户	496
8.12 衍生品专属报价商设置	497
8.13 结算失败报备	500

8.13.1 结算失败报备	500
8.13.1 情况说明	503
9 个人设置	505
9.1 行情显示设置	506
9.2 意向设置	506
9.3 我的关注券设置	507
9.4 报价提示设置	508
9.5 个人信息设置	509
9.6 自动打印设置	510
10 系统设置	512
10.1 锁屏时间	512
10.2 主题色切换	512
11 投资经理展示页面	512

1 概述

1.1 名词解释

【机构】：银行间市场的所有入市法人机构或部分未入市法人机构。只有在机构下可以创建用户。

【交易账户】：包括机构自营账户、资管产品等非法人产品、委托机构等交易账户。所有交易账户都关联在机构下。

【交易账户类型】：包括自营、资管、代理三类交易账户类型。机构自营账户、资管产品、委托机构或产品分别对应三种交易账户类型。

【交易账户组】：机构根据业务需求及交易账户类型进行的交易账户分组，一个交易账户组下仅可设置一类交易账户。

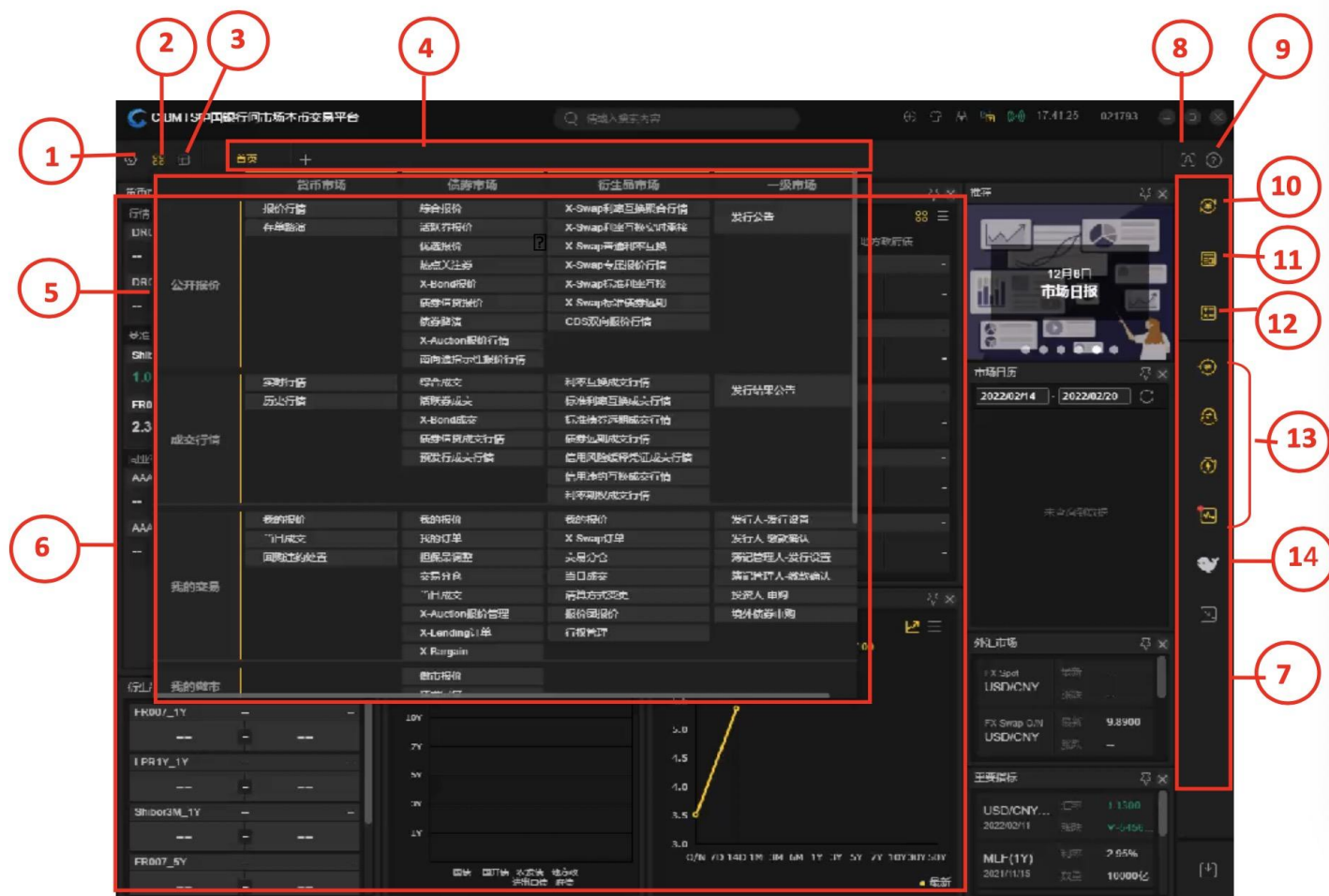
2 客户端更新与安装配置

2.1 系统主要功能

中国银行间市场本币交易平台（China Inter Bank Market Trading System，简称 CIBMTS）为银行间本币市场成员提供现券买卖、质押式回购及衍生品等交易服务，同时提供高效的内部管理和用户管理功能，方便投资管理人和代理人集中管理产品和委托机构等交易账户。

用户定位：银行间本币市场成员的系统管理员和用户。

CIBMTS 主界面如下图所示（根据用户勾选权限不同，展示不同的菜单内容）：



序号	描述
1	管理设置
2	功能列表
3	模板管理
4	TAB 页
5	功能菜单
6	工作区
7	快捷菜单
8	权限检查
9	用户帮助
10	我要报价
11	单券查看记录
12	计算工具
13	消息盒子
14	聊天工具

管理设置由内部管理、交易设置、个人设置、用户统一认证、系统设置和和文件下载组成，详细菜单列表见下图。

一级菜单	二级菜单
内部管理	资金账户设置
	交易账户组管理
	交易账户别名管理
	用户权限设置
	内部标签设置
	用户信息查询
	机构信息设置
	清算所债券持仓量查询
	互联网登录设置
	同业存款账户设置
个人设置	行情显示设置
	衍生品合约顺序
	意向设置
	我的关注券设置
	报价提示设置
	个人信息设置

	成交单设置
交易设置	首选交易账户设置
	产品篮子维护
	搭桥参数设置
	衍生品交易参数设置
	机构群组维护
	限额管理
	对手方管理
	货币小助手
用户统一认证	修改密码
	用户实名认证/身份确认
	人像注册/注销管理
系统设置	显示设置
文件下载	文件下载

功能列表由公开报价、成交行情、我的交易、我的做市、信息查询和和监控组成，详细菜单列表见下图：

一级菜单	货币市场	债券市场	衍生品市场
公开报价	报价行情	综合报价	X-Swap 利率互换聚合行情
	存单路演	活跃券报价	X-Swap 利率互换实时承接
		优选报价	X-Swap 普通利率互换
		热点关注券	X-Swap 标准利率互换
		X-Bond 报价	X-Swap 标准债券远期
		X-Lending 报价	CDS 双向报价行情
		债券路演	
		X-Auction 报价行情	
成交行情	实时行情	综合成交	利率互换成交行情
	历史行情	活跃券成交	标准利率互换成交行情
		X-Bond 成交	标准债券远期成交行情
		债券借贷成交行情	债券远期成交行情

		预发行成交行情	信用风险缓释凭证成交行情
			信用违约互换成交行情
			利率期权成交行情
我的交易	我的报价	我的报价	我的报价
	当日成交	我的订单	X-Swap 订单
	回购违约处置	担保品调整	G-Swap 报价
	货币与债务工具	我的代理	交易分仓
		交易分仓	当日成交
		当日成交	清算方式变更
		X-Auction 报价管理	报价团报价
		X-Bargain	行权管理
我的做市		做市报价	
		请求回复	
信息查询	成交查询	成交查询	
	报价信息查询	报价信息查询	成交查询
	资金汇总查询	付息信息查询	报价信息查询
	标准折算率	债券信息查询	标准债券远期信息查

			询
	风控比例	收益率曲线	标准利率互换信息查询
	基准利率	债券指数	利率互换实时承接额度查询
	公开市场操作	费用查询	衍生品交易工具查询
	资金指数	债券活跃度	利率互换曲线
	当日正回购交易债券查询	做市合规查询	CDS 指数查询
		iData	全市场波动率收盘价
监控	报价监控	报价监控	
			报价监控

2.2 客户端下载

1. 请在专线网交易机的浏览器（推荐谷歌）中输入下载地址 <https://200.31.73.163/cut-release/>。若打开时提示“此网站的安全证书存在问题”，可点击“继续浏览此网站（不推荐）”即可正常打开。

2. 弹出客户端下载主界面, 点击“客户端下载”；

3. 点击“其他下载”，下载“证书驱动”和“微软.NET 4.0”后安装；如已安装老本币可以忽略此操作。

4. 登录客户端时若提示无法找到驱动，可在“其他下载”页面点击“证书驱动”下载后安装。

2.3 客户端安装说明

1. 打开安装包所在文件夹，解压后双击EXE安装包，弹出窗口；
2. 点击【快速安装】按钮，开始安装，点击【完成】完成安装。建议使用推荐安装路径。

*客户端的安装需要基于NET Framework 4.0，否则无法正常安装。

2.4 客户端配置说明

请联系本机构技术人员确认本机构使用的网络是否经过网络地址转换（NAT转换，Network Address Translation）。如未经转换，请忽略此节；如机构内部网络使用NAT转换，则需要将安装路径中配置文件的IP 地址更改为经过转换的IP 地址。

在客户端登录界面中点击【地址转换】

生产环境的IP地址为：<https://200.31.73.163>

2.5 防火墙设置

如果机构交易机上安装了防火墙，或者在访问本币交易系统时需通过机构的防火墙设备，请机构技术人员在防火墙上开通下列端口，以便正常访问CIBMTS系统。

（一） 专线网防火墙策略

环境	类型	服务器地址	端口（TCP）
专线网	客户端	200.31.73.163	443
	交易接口	200.31.73.163	17660-17700
		200.31.71.72	9888 1250, 50100-50109 1260, 51100-51299 1270, 52100-52299

注：交易接口端口 17660-17665、17675 为现券市场端口，17666-17674、17676 为回购和衍生品市场端口，17677 为同业存款市场端口，17678-17700 为预留端口。

（二）互联网防火墙策略

环境	类型	服务器地址	端口（TCP）
互联网	电信	101.230.194.2	443
	联通	58.246.204.226	
	移动	120.253.214.162	

2.6 推荐配置

中国银行间市场交易平台终端配置建议			
分类	细分	最低配置	推荐配置
硬件	CPU	4core 3.4GHZ	I3 以上，3.4GHZ
	内存	8GB	16GB
	硬盘	20GB	
	分辨率	1280x1024 及以上	
	显示器尺寸	17"及以上	
软件	操作系统	Win7，Win8、Win10，以上操作系统建议使用 64 位版本	
	软件依赖	Microsoft Office 2003 或以上、.Net Framework 4.0	
网络情况	内外网	支持内网和互联网（互联网需机构申请开通）	
[说明] 1. 以上配置为独占系统资源，如需运行大量其他应用程序，建议额外提升系统配置。			

中国银行间市场交易接口配置建议		
分类	细分	推荐配置
硬件	CPU	8core 3.4GHZ
	内存	4GB
	磁盘	10GB
网络	专线网	2M 以上
[说明] 1. 以上配置为单个进程独占系统资源, 如需运行大量其他应用程序, 建议额外提升系统配置。		

2.7 带宽配置

单个新平台客户终端最低带宽要求 1M。

单个交易接口最低带宽要求 1M。

如市场成员需使用多个客户终端或使用分屏功能，请根据客户终端（含分屏数）进行带宽升级。

新平台支持 4G VPDN，不再支持拨号和 3G VPDN。仍使用拨号或 3G VPDN 尽快申请专线或 4GVPDN 或申请互联网接入。

若需使用互联网接入的市场成员，请填写《本币交易系统互联网方式接入申请表》（申请表下载地址：
<http://www.chinamoney.com.cn/chinese/scggbbbscggscggtz/20200407/1591738.html#cp=jszc>），加盖公章后向交易中心提交互联网接入申请，并完成互联网防火墙策略设置。

未提交互联网接入申请的市场成员，无法通过互联网接入新平台。

3 用户登录与注销

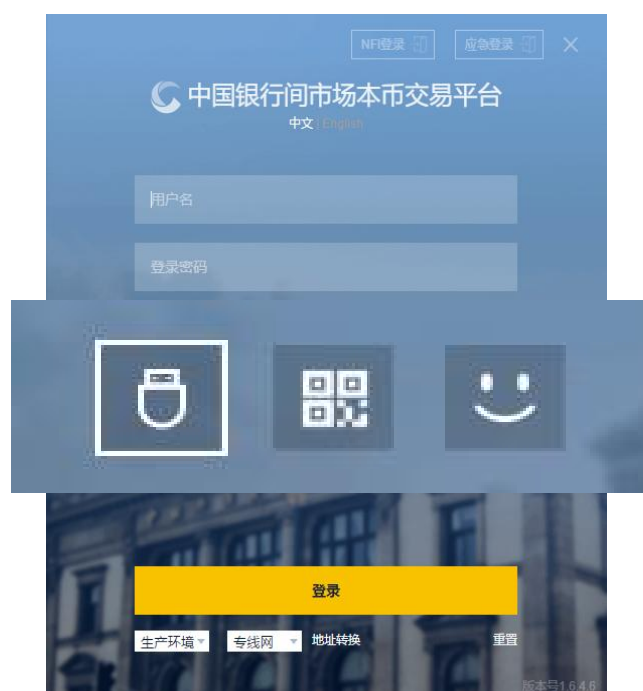
3.1 用户登录

用户安装好客户端，点击快捷登录图标登入系统。

3.1.1 交易用户登录

本币交易系统已有用户可使用原用户 ID、密码及 Key 密码直接登录本平台，或者通过扫描二维码、人脸识别进行验证登录。

中心柜台交易备案系统用户，使用原备案系统用户 ID 和初始密码及 Key 密码直接登录本平台。中心货币经纪备案系统用户，点击登录页面右上方“NFI 登录”，使用原备案系统用户 ID 及初始密码，直接登录本平台。



证书 二维码 人像识别

(1) 证书登录

新用户首次登录后，系统自动弹出密码修改框，输入正确的旧密码以及新密码后完成密码修改，如图：

修改密码

用户名
chenyao

旧密码

新密码

确认密码

注意:

1、密码位数8-10位，必须包括数字、字母、特殊符号
([@#\$%^&*()-+=[]\|_{}~!@#<?>).
2、新密码不得与前4次的密码相同

重置

确认

点击【确认】按钮后，尚未进行身份确认或实名认证的用户，系统将自动进入实名认证/身份确认界面，如已进行过身份确认或实名认证的用户将直接进入主界面。

中心柜台备案系统用户完成修改密码后,可直接进行备案相关操作,无需实名认证或身份确认。

(2) 二维码登录

本期暂不支持

(3) 人脸识别登录

准备工作:

- 1、确保电脑连接一个可以使用的摄像头。
- 2、通过新本币交易系统下载页-其他下载，下载安装人像识别驱动。
- 3、系统管理员通过“用户统一认证-机构用户管理”，给需要使用人脸识别的用户赋予“人像注册/注销”权限。

被赋权用户首次需通过密码+usbkey 登录交易系统, 通过点击系统菜单“管理设置”->“用户统一认证”->“人像注册/注销管理”, 如下图。

人像注册

用户登录名

上传头像

真实姓名 录入人像按键

证件类型
身份证

证件号码

身份证后6位

注册

点击注册页面的摄像头图标，按照提示录入人像信息，人像获取成功后【上传头像】栏位内会显示“人像获取成功”字样，在【身份证后 6 位】栏位输入身份证号码的后六位，点击注册提示注册成功后，人像注册完成。

人像注册成功后，用户下次登录时，输入用户名密码，选择人脸识别，打开摄像头，完成刷脸立即登录系统。

3.1.2 投资经理用户登录

投资经理用户正确输入用户 ID、用户密码(无需插入 UKEY，证书密码为空)，登录 CIBMTS 客户端。



3.2 用户实名认证/身份确认

所有登录 CIBMTS 用户（除系统管理员外）必须进行实名认证或身份确认。其中，前台交易员开展交易必须进行实名认证；无交易员资格证书的用户需进行身份确认。

本币交易系统前台已实名激活用户无需再次实名认证。

未进行实名认证/身份确认的用户登录后自动弹出以下窗口：

用户上传头像

用户登录名
tbs1001

用户类型
界面用户

真实姓名*

国家/地区

省

城市

证件类型
身份证

证件号码*

证件有效起始日*

证件有效截止日*
∞

交易员证书信息

性别

所属部门*

办公电话*

电子邮箱*

传真*

职务

手机号*

验证码

获取验证码

重置

提交

注意：

1.以上信息必须真实有效，如有变更，请及时更新。

2.一名交易员不能同时认证/确认两个及以上用户，如需认证/确认新的用户，需要本机构管理员取消之前用户的身份认证/确认状态。

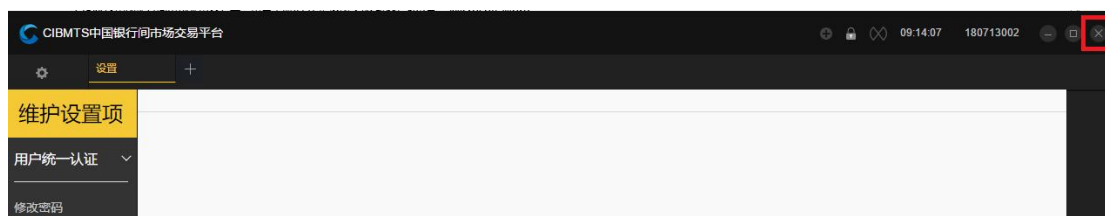
已经获取交易中心发布的“交易员资格证书”的用户，可以输入以上信息（含交易员证书信息），点击【提交】按钮完成实名认证；

尚未获取交易中心发布的“交易员资格证书”的用户，可以输入除“交易员资格证书信息”外的以上信息，点击【提交】按钮完成身份确认。

完成实名认证或身份确认的用户，即可进入主界面。

3.3 用户注销

用户点击主界面右上角的 x，即可退出：



4 用户统一认证

4.1 用户管理

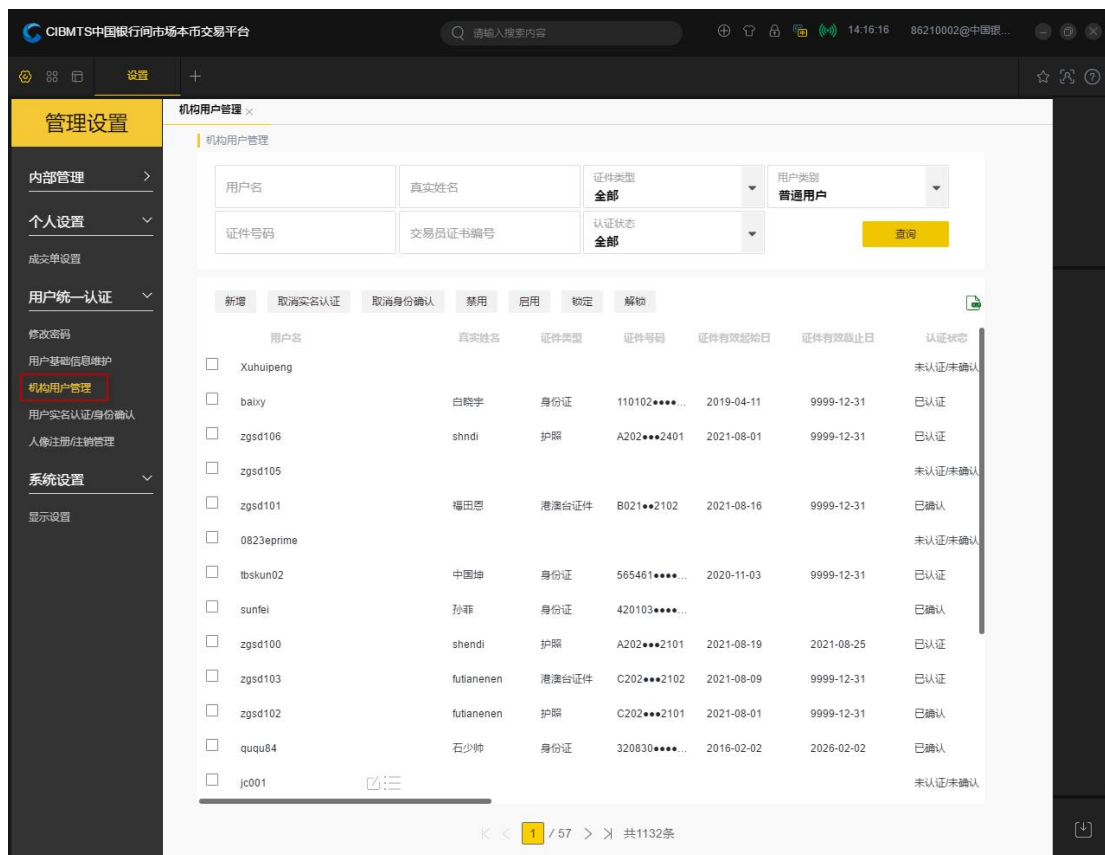
系统管理员或具有相关权限的用户可通过该页面对本机构下所有用户进行新建、锁定、禁用、启用、解锁等操作。

已实名认证或身份确认的用户，管理员可取消实名认证、取消身份确认。

系统管理员同样能在此菜单下，查看用户基本信息、修改用户及对用户“用户统一认证”菜单下权限进行修改。

4.1.1 新建用户

1. 机构系统管理员登录CIBMTS客户端，点击系统菜单“用户统一认证”->“机构用户管理”进入“机构用户管理”界面。如图：



2. 新增用户：界面默认展示该机构下所有的用户，点击“新增”按钮，可新增用户。

如图：

The '用户新增' (Add User) modal form contains the following fields and options:

- 用户名** (Username): Xuhuipeng
- 密码有效期** (Password Validity): Radio buttons for 90天 and 180天 (selected).
- 用户类别** (User Category): Radio button for 普通用户 (selected).
- 可用于** (Available for): Checkboxes for 本币聊天工具 (selected) and 本币新平台 (selected).
- Buttons**: 取消 (Cancel) and 确认 (Confirm).

录入新增用户的ID，选择密码有效期以及该用户可用于登录的系统“聊天工具”或“本

币新平台”，点击【确认】按钮完成用户创建。系统将给出提示信息框，内容为新增的id和初始化密码，如图：



点击【复制密码】按钮，可复制当前新建用户的初始密码；点击【权限设置】按钮，页面跳转到“用户权限设置”页面，如下图：

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☐ 自营身份

☐ 资产管理

☐ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组

机构权限

接口权限

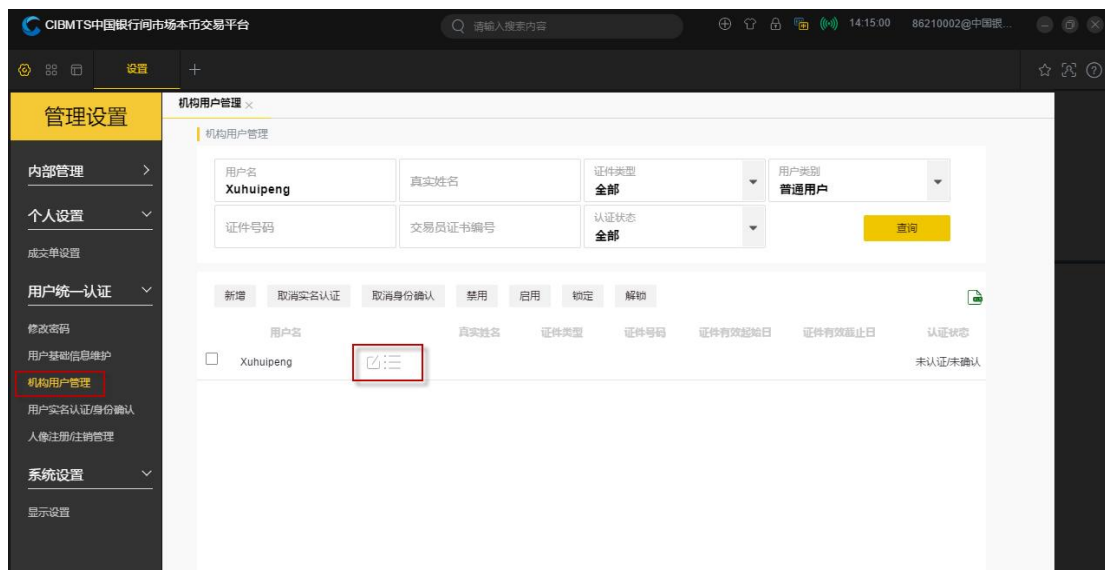
一级目录	二级目录	三级目录	四级目录
内部管理		快速定位权限	
	☒ 用户基本信息	☒ 查询	
		☒ 修改	
	☒ 人像注册/注销管理		
	☒ 机构用户管理	☒ 查询导出	
		☒ 编辑	
	☐ 用户权限设置		
	☐ 资金账户与托管账...		
	☐ 交易账户别名设置		
	☐ 机构联系方式		
	☐ 交易员设置		

确定

您可按需分配以上权限给新建用户（默认分配“用户基本信息”下的查询权限），点击【确认】按钮后保存。

4.1.2 其他用户管理功能

用户管理主页面如图：



1. 查看用户信息。点击上图标红处“详情”图标，可查看用户基础数据。

1) 查看用户实名信息，如图：

用户基础信息

帐户名

XuhuiPeng

用户状态

活动

是否锁定

解锁

锁定原因

创建时间

2021-08-23 10:57:04

用户实名信息

用户类别

可用于

权限

姓名

性别

证件类型

证件号码

证件有效起始日

证件有效截止日

交易员证书编号

通过实名认证时间

取消实名认证时间

取消实名认证操作用户

通过身份确认时间

取消身份确认时间

取消身份确认操作用户

2) 查看用户类型，如图：

用户基础信息

帐户名

Xuhipeng

用户状态

活动

是否锁定

解锁

锁定原因

创建时间

2021-08-23 10:57:04

用户实名信息

用户类别

可用于

权限

☒ 普通用户

3) 查看准入系统，如图：

用户基础信息

帐户名

Xuhipeng

用户状态

活动

是否锁定

解锁

锁定原因

创建时间

2021-08-23 10:57:04

用户实名信息

用户类别

可用于

权限

☒ 本市聊天工具

☒ 本市新平台

4) 查看用户基础信息操作权限，如图：

行实名认证或身份确认的用户，管理员可以对其进行取消实名认证或取消身份确认。如图：

机构用户管理

用户名
Xuhuipeng

证件号码

真实姓名

交易员证书编号

证件类型
全部

认证状态
全部

用户类别
普通用户

查询

新增取消实名认证取消身份确认禁用启用锁定解锁

用户名

真实姓名

证件类型

证件号码

证件有效起始日

证件有效截止日

认证状态

☐

Xuhuipeng

未认证/未确认

4.2 修改个人密码

用户可以修改个人登录密码。

用户登录系统，可以通过点击系统菜单“用户统一认证”->“修改密码”进入。

中心柜台交易备案系统用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“用户统一认证”->“修改密码”进入。

中心货币经纪备案系统用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“内部管理”->“修改密码”进入。

修改密码

用户名

chenyao

旧密码

新密码

确认密码

注意:

1、密码位数8-10位，必须包括数字、字母、特殊符号
(!@#\$%&*()-+[]_.|/;:~`~?~)。`
2、新密码不得与前4次的密码相同

重置

确认

4.3 用户基础信息维护

登录用户可根据该功能查询和修改本人的实名认证或身份认证的信息。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“用户统一认证”->“用户基础信息维护”进入。

用户基础信息维护

认证状态：已认证

用户登录名	真实姓名 陈尧	国家/地区
省	城市	证件类型 身份证
证件号码 320504●●●●●●●●●●	证件有效起始日	证件有效截止日
交易员证书信息 1218	性别	所属部门
办公电话 021-2069	电子邮箱	传真
职务	手机号	验证码

获取验证码

取消实名认证

重置

修改

点击【修改】按钮激活界面信息后，可对用户的基础信息进行维护。

5 内部管理功能

内部管理提供给机构用户设置资金和托管账户、设置交易账户组，并进行用户权限设置和交易账户管理的功能。

5.1 用户权限配置

5.1.1 用户交易权限设置

新建用户时，已分配用户“用户统一认证”菜单下的权限，**如需设置用户的交易权限**，点击系统菜单“内部管理”->“用户权限设置”进入用户管理界面。

如下图：



选择需要赋予权限或修改权限的用户，点击“铅笔”形状的【修改】图标，弹出用户权限修改窗口，如图：（备注：FT账户单指“自贸区账户”）

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

用户ID

18612097909

用户姓名

杨洋

用户类别

普通用户

状态

已认证

状态锁定标识

否

父级用户类别

UUAS场务

父级用户名称

用户身份

用户身份

适用交易账户组

确定

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☒ 自营身份

☐ 资产管理

☒ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组

机构权限

接口权限

自营身份

代理交易

一级目录

二级目录

三级目录

四级目录

交易执行

快速定位权限

信用拆借

询价交易

意向报价

对话报价

质押式回购

回购交易

意向报价

对话报价

请求报价

请求回复

买断式回购

询价交易

意向报价

对话报价

匿名交易

确定

序号	描述
1	交易员身份
2	账户权限 Tab 页

1. 首先按需勾选交易员身份，请在上图红圈 1 处勾选：

如仅交易自营账户的用户可仅勾选自营账户身份；如需交易资产管理产品的用户可选资产管理身份；如有代理交易的用户可勾选代理交易身份：

- 代理交易是指结算代理人根据委托为其他市场参与者进行设置、交易等操作的情形。如您的机构无代理业务，此处勾选“代理交易”提交后系统会给予错误提示；
- 资产管理业务是指各类资产管理人为其旗下基金等非法人产品进行设置、交易等操作的情形。如您的机构无资产管理业务，此处勾选“资产管理”提交后系统会给予错误提示；
- 如您的机构无自营业务，此处勾选“自营”提交后系统会给予错误提示

2. 勾选用户身份后，上图红圈 2 处将根据勾选的身份显示不同的 **Tab** 页，如勾选资产管理身份则显示资产管理权限 **Tab** 页，您可按需在不同 **Tab** 页下为用户赋权。具体操作如下：

(1) 自营账户权限 Tab 页：

如当前用户拥有“自营账户”身份，则可在“自营账户权限”Tab 页下设置其在自营账户下的权限。具体如下图：

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☒ 自营身份

☐ 资产管理

☐ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组 机构权限 接口权限 自营身份

一级目录	二级目录	三级目录	四级目录
交易执行	信用拆借	询价交易	意向报价
			对话报价
	质押式回购	回购交易	意向报价
			对话报价
			请求报价
			请求回复
		匿名交易	
	买断式回购	询价交易	意向报价
			对话报价
	已上市质押券	质押式回购	

确定

(2) 资产管理账户权限 Tab 页：

如当前用户拥有“资产管理”身份，则可在“资产管理权限”Tab 页下设置其在资管产品账户下的权限。具体如下图：

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☐ 自营身份

☒ 资产管理

☐ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组

机构权限

接口权限

资产管理

一级目录	二级目录	三级目录	四级目录
交易执行			快速定位权限
	质押式回购	回购交易	意向报价
			对话报价
			请求报价
			请求回复
		匿名交易	
	买断式回购	询价交易	意向报价
			对话报价
	同业存单路演	意向申购	
现券买卖	现券交易	意向报价	

确定

(3) 代理交易权限 Tab 页：

如当前用户拥有“代理交易”身份，则可在“代理交易权限”Tab 页下设置其在代理账户下的权限。具体如下图：

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☐ 自营身份

☐ 资产管理

☒ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组

机构权限

接口权限

代理交易

一级目录	二级目录	三级目录	四级目录
交易执行			快速定位权限
	☒ 现券买卖	☒ 现券交易	意向报价
			对话报价
			点击做市报价
			请求报价
		☒ 匿名交易	☒ 匿名点击
		☒ 匿名拍卖	
		☒ 代理交易 (预填文...	
		☒ 互联互通	☒ 通银行间申报
			☒ 通交易所申报

确定

(4) 机构权限 Tab 页：

可在“机构权限”Tab 页下，赋予当前用户“内部管理”、“交易账户组设置”等相关权限，
具体如下图：

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☐ 自营身份

☐ 资产管理

☐ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组

机构权限

接口权限

一级目录

二级目录

三级目录

四级目录

内部管理

快速定位权限

☒	用户基本信息	☒ 查询	
		☒ 修改	
☒	人像注册/注销管理		
☒	机构用户管理	☒ 查询导出	
		☒ 编辑	
☒	用户权限设置		
☒	资金账户与托管账...		
☒	交易账户别名设置		
☒	机构联系方式		
☒	...		

确定

(5) 接口权限 Tab 页：

如您的机构已开通交易中心的交易接口，则可在“接口权限”Tab 页下设置当前用户的交易接口权限，如机构尚未开通交易接口，可不设置。

具体如下图：

用户修改

基本信息

权限及交易账户组

交易员身份

☐ 自营身份

☐ 资产管理

☐ 代理交易

☐ 账户管理

☐ FT账户

下载

导入

交易账户组

机构权限

接口权限

一级目录	二级目录	三级目录	四级目录
交易执行			快速定位权限
	质押式回购	回购交易	意向报价
			对话报价
			请求报价
			请求回复
		匿名交易	
	现券买卖	做市交易	请求回复
做市报价			
指示性报价			
现券交易		对话报价	
			意向报价

确定

(6) 交易账户组 Tab 页：

如当前用户已经加入交易账户组，则在“交易账户组”Tab 页可展示其关联的交易账户组（关联交易账户组相关操作具体可参见 5.2 章节“交易账户组管理”）；如用户尚未加入任何交易账户组，则显示为空。

用户修改

用户ID
zg04

用户姓名
资管4

用户类别
普通用户

状态
已确认

交易员身份

☐ 自营账户

☐ 资产管理

☒ 代理交易

☐ FT账户

交易账户组

机构权限

接口权限

代理交易权限

交易账户组名称

公募基金

状态锁定标识
否

父级用户类别
界面用户

父级用户名称
系统管理员

确认

5.1.2 用户身份设置

新平台用户管理体系支持多种身份属性，支持投资和交易分离。如需为投资经理等非交易类的从业人员创建无交易权限、可查看行情的用户身份，可点击系统菜单“内部管理”->“用户权限设置”进入用户管理界面。如下图：



投资经理身份维护的前提为对应用户已经完成身份确认或实名认证，本机构具备用户权限设置的用户可在用户权限设置界面，直接选择需要赋予投资经理身份用户，点击“铅笔”形状的【修改】图标，弹出用户修改窗口，按以下步骤进行操作：

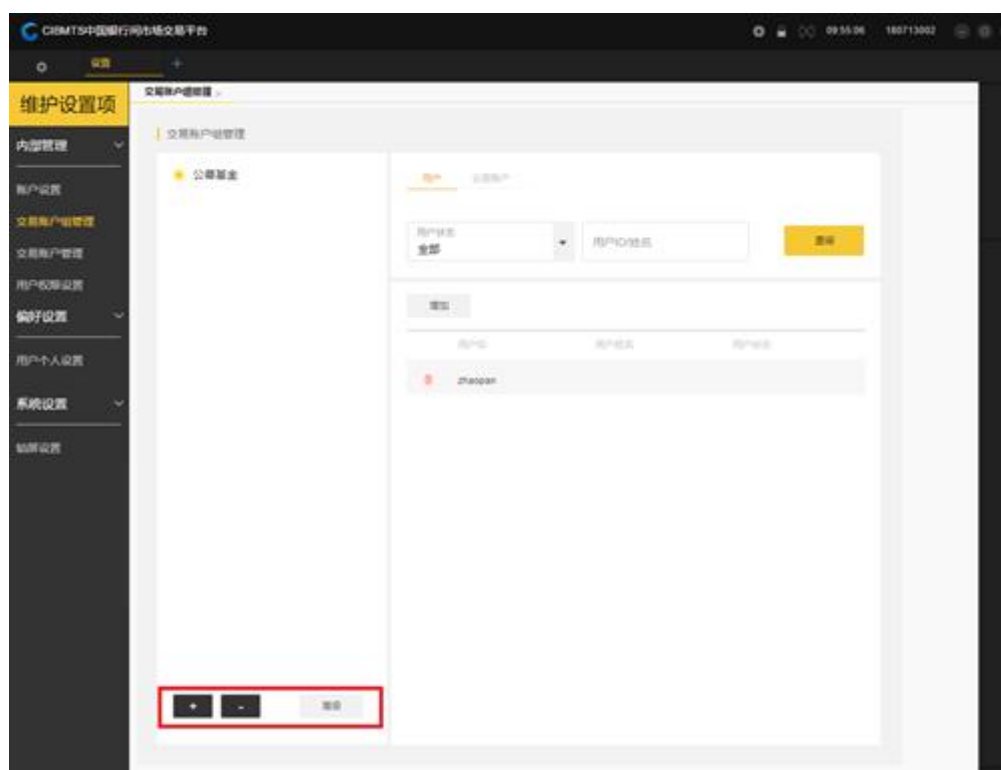
- 1) 针对投资经理用户勾选“用户身份”。
- 2) 在右侧“用户身份”下拉框处选择“投资经理”身份。
- 3) 如本机构设置了多交易账户组，则在右侧“适用交易账户组”下拉框选择当前用户所管理的相应交易账户组；如本机构未设置多交易账户组，可不勾选。

账户有利率互换-实时承接或者利率互换-非实时承接交易账户业务权限，投资经理还可查看X-Swap 报价行情。

5.2 交易账户组管理

交易账户组是指对于本机构管理的自营、代理、资产管理类的交易账户，机构可将多个同类型交易账户设置到同一组中，并将用户关联到对应交易账户组上，以方便新增交易账户及用户，减少设置频次。

用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“内部管理”->“交易账户组管理”进入。



1. 设置交易账户组

(1) 可为机构添加交易账户组，点击上图左下方的【+】按钮，弹出“添加交易账户组”界面。用户输入相关信息以后，点击【提交】按钮完成交易账户组的添加。如下图。

添加交易账户组

×

交易账户组名称
公募基金

编码
GMJJ

类型
资产管理

☒ 自动关联同类型交易账户至本交易账户组

提交

若勾选“自动关联同类型交易账户至本交易账户组”，则新入市联网的交易账户会自动加入到相同类型的交易账户组。

e.g 当一个资产管理类型的交易账户组勾选上述选项，则新入市的资产管理类交易账户将自动加入该分组

（2）可编辑已添加的交易账户组，点击交易账户组管理左下方的【高级】按钮，弹出“交易账户组管理-高级”界面。用户输入相关信息以后，点击【提交】按钮完成交易账户组的编辑。如下图。

交易账户组管理-高级

×

交易账户组名称
公募基金

编码
GMJJ

类型
资产管理

☒ 自动关联同类型交易账户至本交易账户组

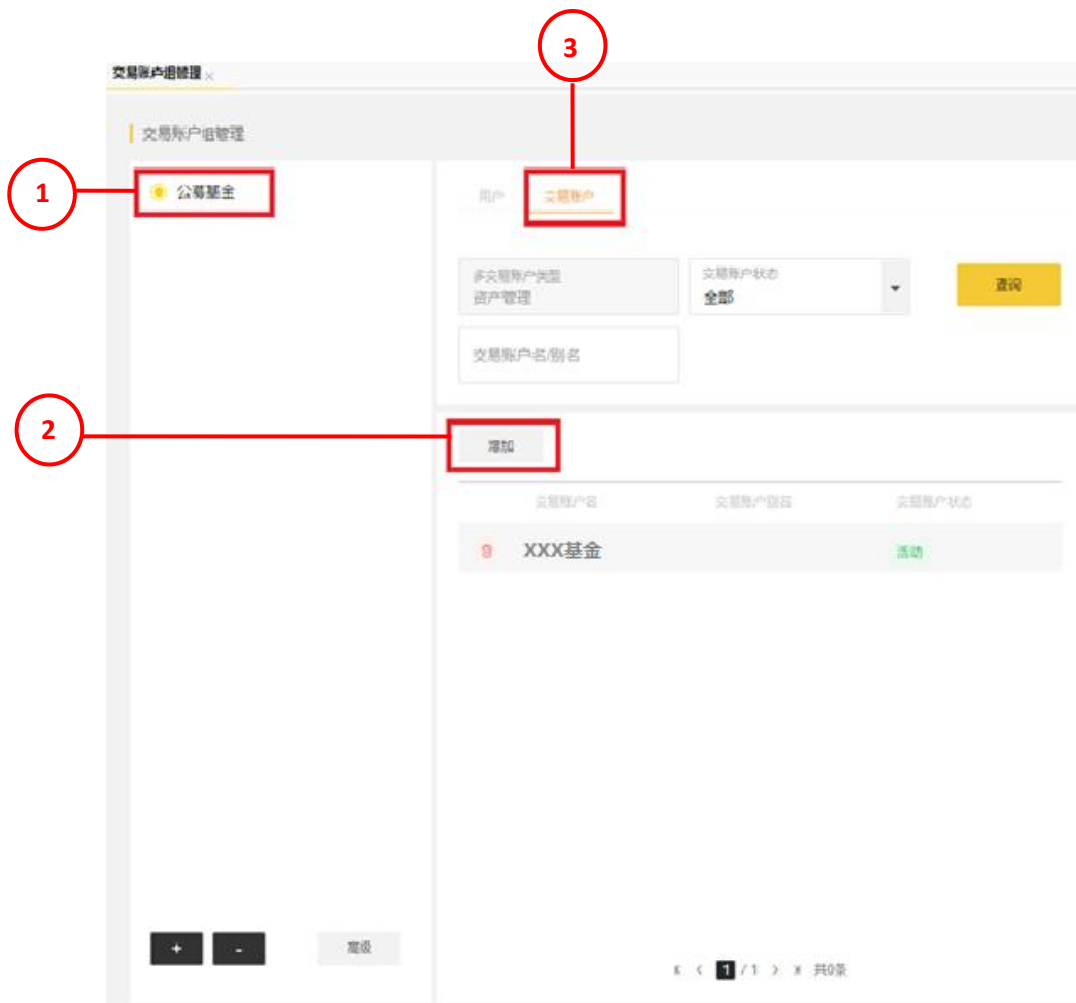
提交

（3）可删除已经添加的交易账户组，在左方选中要删除的交易账户组，点击左下方的【-】按钮，系统提示：“是否确认从该机构删除该交易账户组？”，点击“是”删除该交易账户。该交易账户组与交易账户组内的交易账户和用户都自动解绑。



(4) 将交易账户绑定至交易账户组

选中待编辑的交易账户组，选择“交易账户”Tab 页。



序号	描述
1	公募基金
2	增加交易账户组名单
3	交易账户

(5) 为已有交易账户组增加交易账户。通过上图点击【增加】按钮，进入“增加交易账户”界面，勾选需要添加到当前交易账户组中的交易账户，点击【提交】按钮，把同类型的交易账户绑定到选定的交易账户组，如资管产品只可绑定到资产管理类型的交易账户组中。

增加交易账户

交易账户组名称
公募基金

多交易账户类型
资产管理

交易账户状态
全部

交易账户名/别名

查询

☒ 未被关联至本交易账户组

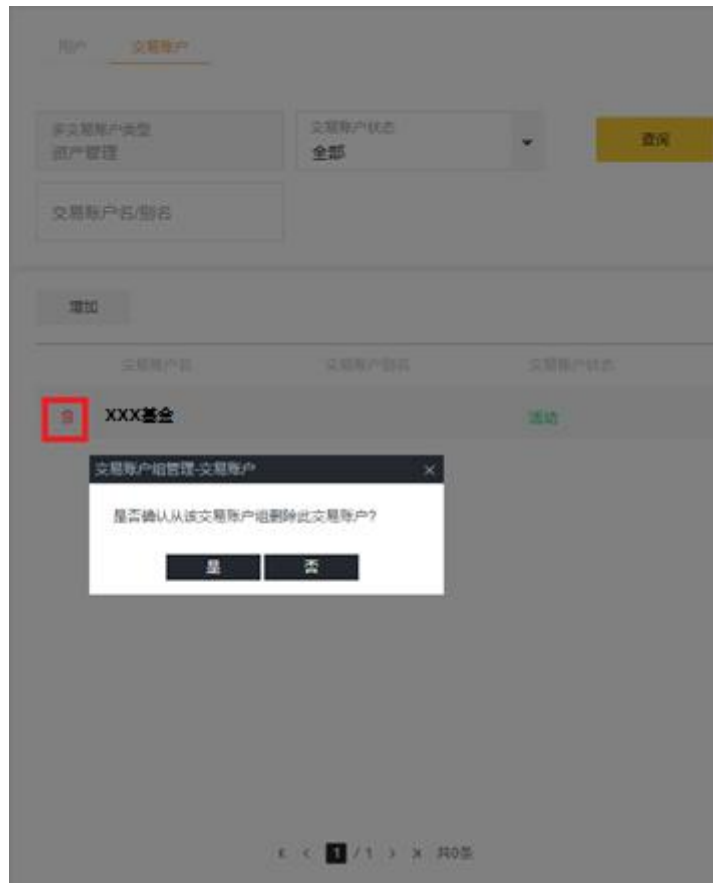
☒ 基金公司-基金

☒ XXXX基金

提交

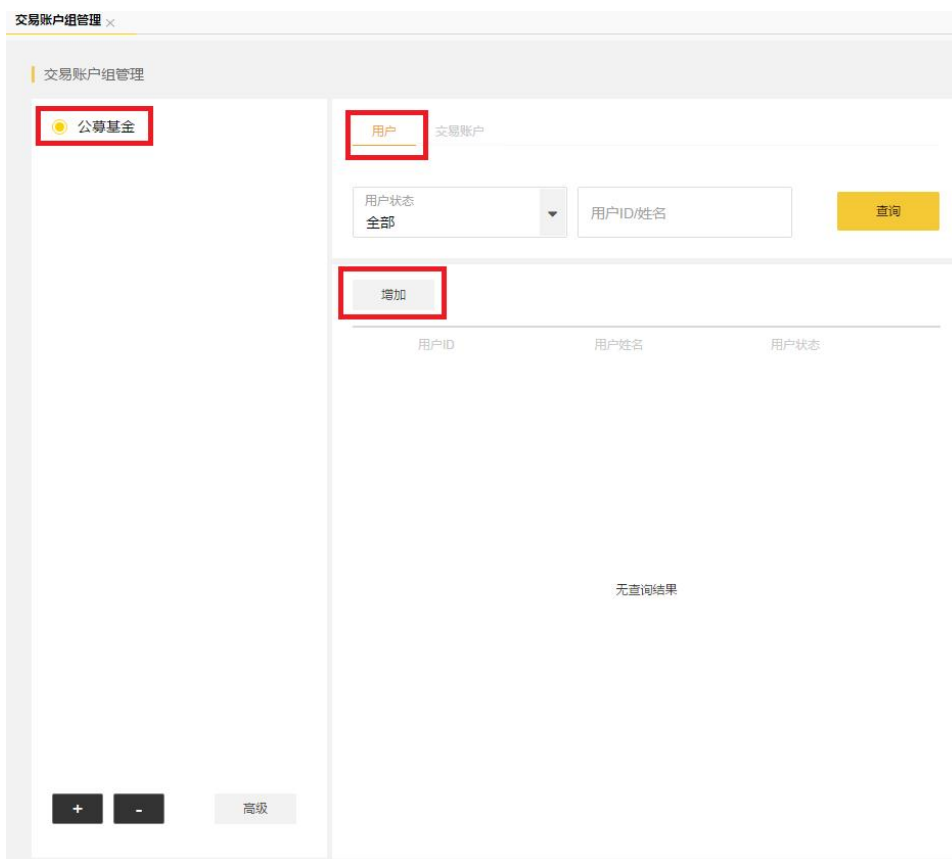
（6）解绑交易账户

在“交易账户”Tab 页，可通过点击交易账户前的“垃圾箱”图标，将该交易账户与当前交易账户组解绑。

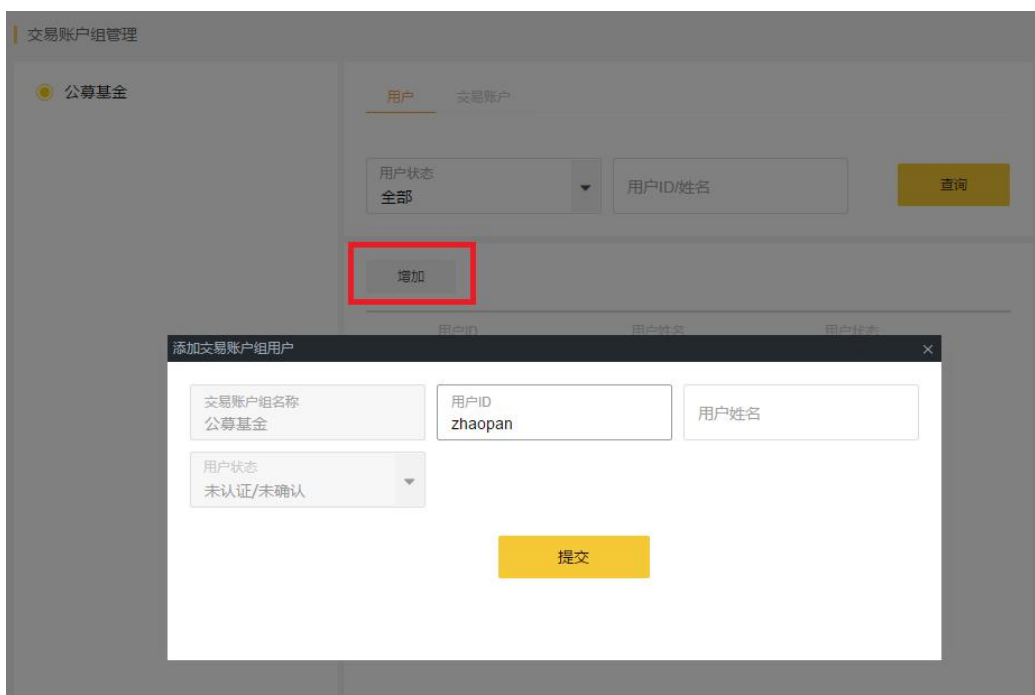


2. 绑定用户和交易账户组

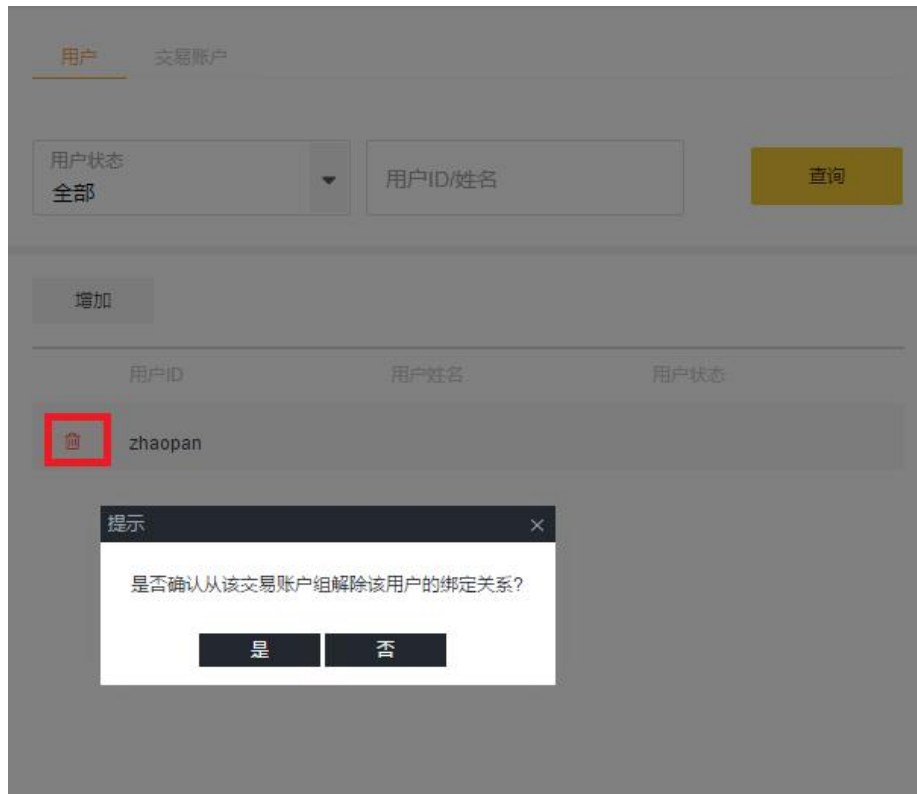
(1) 选中一个交易账户组，选择“用户”Tab 页，可通过“用户状态”和“用户 ID/姓名”对该交易账户组所绑定的用户列表进行查询。



(2) 通过点击【增加】按钮，进入“添加交易账户组用户”界面，搜索用户 ID，把同类型身份的用户绑定到选定的交易账户组。如资产管理类型的交易账户组只可绑定资产管理身份的用户。



(3) 可通过点击每个用户的“垃圾箱”图标对已绑定的用户进行解绑。

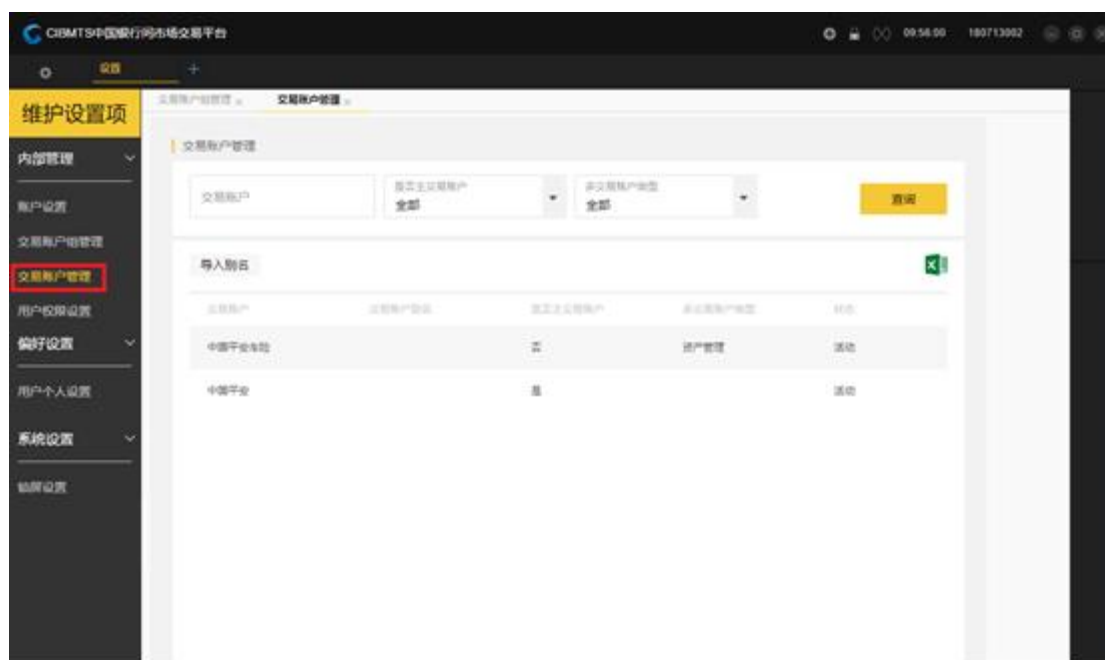


- 一个用户可以绑定在多个交易账户组；
- 一个交易账户只能属于一个交易账户组；
- 交易员身份（自营、资管和代理）和交易账户组的类型必须一致。

5.3 交易账户别名管理

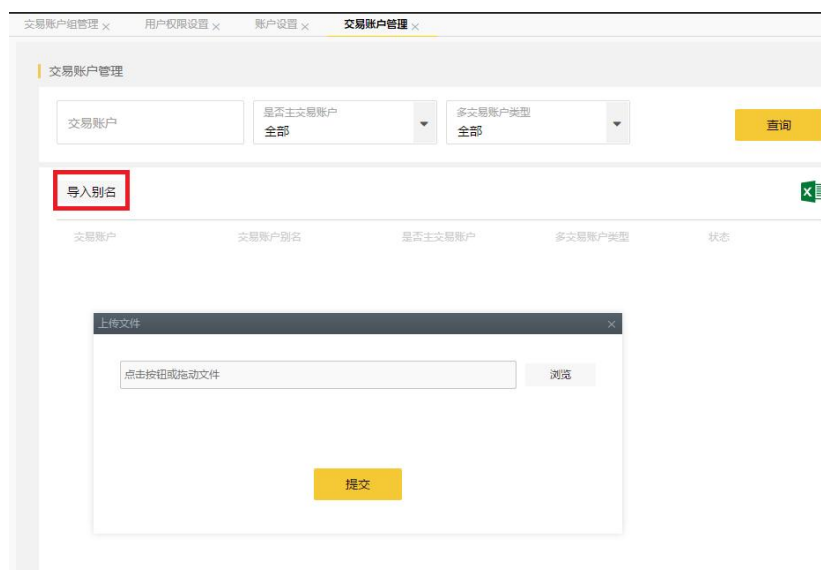
查询和维护交易账户的信息，支持交易账户的别名的导入。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“内部管理”->“交易账户别名管理”进入。



1. 可通过“交易账户”、“是否主交易账户”和“多交易账户类型”对交易账户进行查询。

2. 点击【导入别名】按钮，弹出“上传文件”界面，导入交易账户的别名。



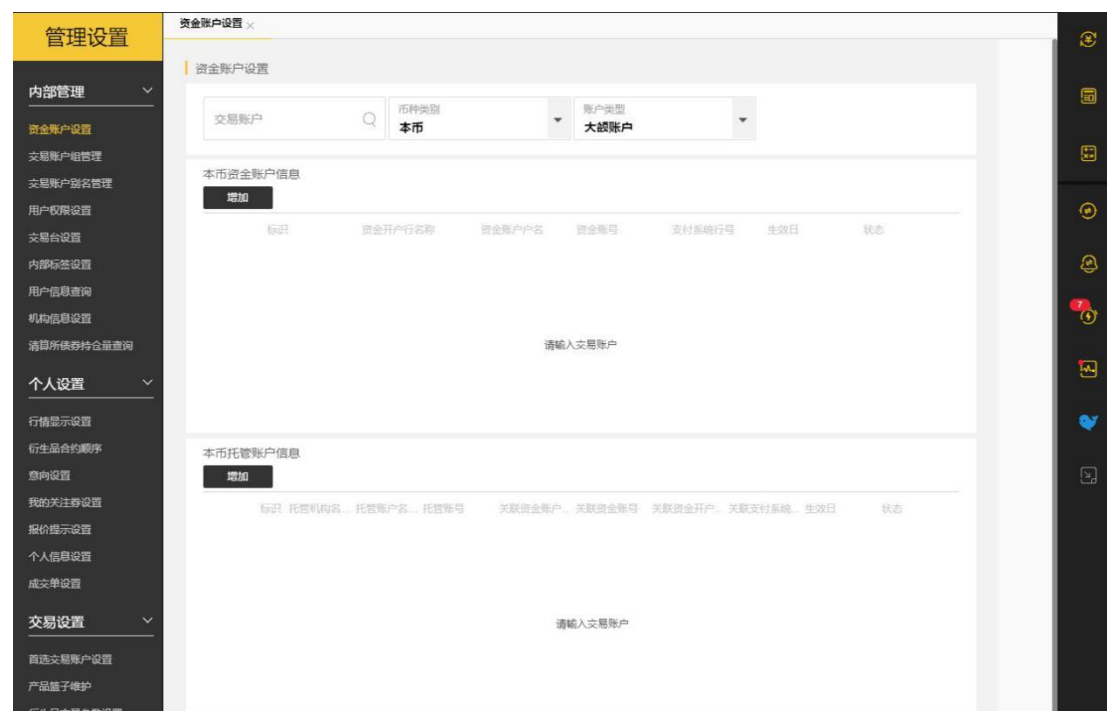
3. 点击上图中绿色 Excel 图标可导出文件。导出文件可作为导入文件使用。

5.4 资金账户设置

5.4.1 大额账户设置

可为本机构下所有交易账户创建大额资金账户，绑定资金账户和托管账户关联关系。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“内部管理”->“账户设置”进入。



1. 用户输入需要设置资金或托管账户的“交易账户”后，在“资金账户信息”区域点击【增加】按钮，弹出“增加资金账户信息”界面。

2. 用户输入需要增加的资金账户相关信息，点击【提交】按钮，完成资金账户的新增。

3. 用户在“托管账户信息”区域点击“铅笔”形状的【修改】按钮，可以为该托管账户关联资金账户，如图：



4. 用户在弹出的修改界面中，在“关联资金账户信息”框中选择需要关联的资金账户，点击【提交】按钮，完成托管账户和资金账户的关联。

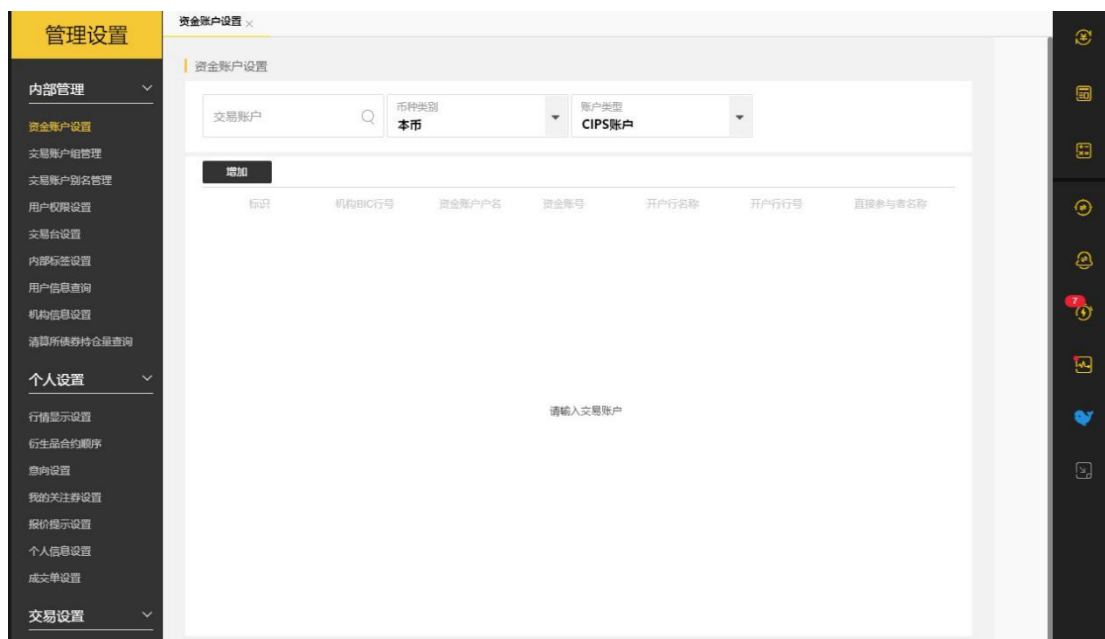
新增、修改托管账户请在银行间市场开户系统（互联网访问地址：<https://ibrs.chinamoney.com.cn/AAMS>）中申请，一旦审核通过可在此系统进行以上操作。在新平台此处主要是完成托管账户和对对应资金账户的关联，可勾选 DVP、非 DVP 和债券通首选的标识作为相关结算类型的首选账户。

5. 资金账户创建完成后，如需修改可点击“铅笔”图标，或点击“垃圾箱”图标删除；托管账户创建完成后，可点击“铅笔”图标修改关联的资金账户，或点击“垃圾箱”图标删除关联资金账户。

5.4.2 CIPS 账户设置

可为本机构下所有交易账户创建CIPS资金账户。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“内部管理”->“账户设置”->“账户类型选择CIPS账户”进入。



1. 用户输入需要设置资金账户的“交易账户”后，在“资金账户设置”区域点击【增加】按钮，弹出“增加 CIPS 资金账户信息”界面。

增加CIPS资金账户信息

* 如拆借交易涉及跨境,建议设置拆借跨境首选属性的资金账号

直接参与者名称*	直接参与者行号*	间接参与者名称
间接参与者行号	开户行名称*	开户行行号*
机构BIC行号	资金账户户名*	资金账号*

☐ 拆借跨境首选

提交

2. 用户输入需要增加的资金账户相关信息，点击【提交】按钮，完成资金账户的新增。

3. 资金账户创建完成后，如需修改可点击“铅笔”图标，或点击“垃圾箱”图标删除资金账户信息。

5.5 机构信息设置

具有“机构权限-机构信息维护”权限的用户可对本机构信基本信息进行修改，本机构所有用户可查看本机构基本信息和交易账户的相关信息。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“内部管理”->“机构信息设置”进入。

1. 基本信息设置

用户点击  按钮，可对本机构的基本信息进行编辑设置，完成后点击  按钮即可。若无编辑按钮，需增加“机构信息维护”权限

2. 交易账户信息

选择“交易账户信息”Tab 页，可以查看本机构息所有交易账户的基本信息，以及相关的业务权限、业务资格等。

5.6 互联网登录设置

系统管理员及其他具有“机构权限-互联网登录设置”权限用户可对本机构互联网登录进行设置。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“内部管理”->“互联网登录

设置”进入。



若本机构不允许互联网登录，则可将“机构互联网接入开关”设置为“关闭”；若本机构有条件允许互联网交易，则可将“机构互联网接入开关”设置为“开启”，同时根据机构内部要求选择所有IP允许交易/指定IP允许交易/所有IP不允许交易。

若需使用互联网接入的市场成员，请填写《本币交易系统互联网方式接入申请表》（申请表下载地址：

<http://www.chinamoney.com.cn/chinese/scggbbscggscggtz/20190523/1310603.html?cp=scggbbscgg>），加盖公章后向交易中心提交互联网接入申请，并完成互联网防火墙策略设置。

未提交互联网接入申请的市场成员，无法通过互联网接入新平台。

5.7 关联机构维护

具有“机构权限-内部管理-关联机构维护”权限的用户可以自行添加关联机构，只展示机构用户添加的所有关联机构信息。

用户登录后系统，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“内部管理”->“关联机构维护”进入。

关联机构维护

关联机构维护-信息披露

本方交易账户

状态
全部

查询

+ 添加

本方	关联机构全称	关联机构简称	状态	申请人	申请机构
  银行(香港)	理香港有限公..	理香港有限公..	待审核		银行股份有限公司.. 2
银行	伙-全球收入...	合伙-全球收入基..	审核通过		银行股份有限公司.. 2

用户点击 **+ 添加** 按钮，弹出添加关联机构界面：

关联机构维护-新增

本方交易账户

关联交易账户

取消

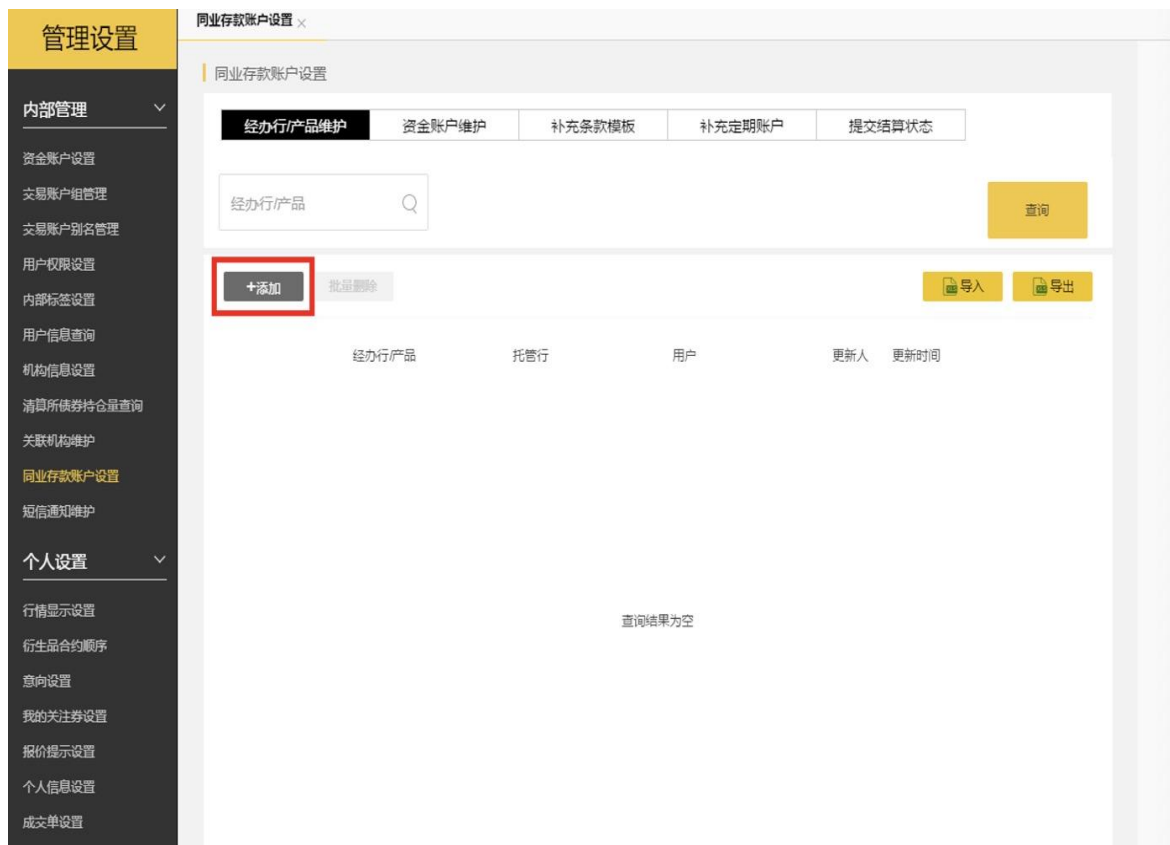
提交

输入本方交易账户与关联交易账户，点击提交即关联机构申请成功，待场务审核。

5.8 同业存款账户设置

5.8.1 经办行/产品维护

用户所在机构具备同业存款交易权限，且用户自营或资管身份下有“清算服务-同业存款账户维护-经办行/产品维护”权限，可以对经办行/产品进行查询和设置操作。



用户可点击  系统菜单“内部管理”->“同业存款账户设置”->“经办行/产品维护”进行经办行/产品查询或设置。点击【导出】按钮可导出查询数据至本地。

1. 用户点击【添加】按钮，进行经办行/产品添加操作，**可通过模糊匹配快速查找并添加**该经办行/产品对应的操作用户列表（即白名单），以进行资金账户设置权限控制，不在白名单里的用户无法在该经办行/产品下设置资金账户。若某一经办行/产品未维护白名单，则视为对该经办行/产品不作资金账户设置权限控制。

新增经办行产品

经办行/产品 类型 **自营** 状态 **生效**

成交单中所展示的经办行/产品名称，将与此处维护的经办行/产品名称一致。

资金账户设置权限控制

用户可选列表

快速搜索用户

- ☐ jha(jha01)
- ☐ JZTEST0025(JZTEST0025)
- ☐ JZTEST0040(JZTEST0040)
- ☐ JZTEST0047(JZTEST0047)
- ☐ yxmzs(yxmzsyh)
- ☐ zsyhyf(zsyhyf)
- ☐ ZYSX0058(tbg)
- ☐ 阿尔卑斯一(test00004)
- ☐ 蔡玲玲(cailingling)
- ☐ 陈萍(chenp)

用户已选列表

若用户已选列表中无用户则视为不作资金账户设置权限控制

确认

2. 用户输入需要增加的经办行/产品信息，点击【确认】按钮完成经办行/产品新增，也可点击【导入】按钮进行批量新增经办行/产品操作。

同业存款账户设置

经办行/产品维护 | 资金账户维护 | 补充条款模板 | 补充定期账户 | 提交结算状态

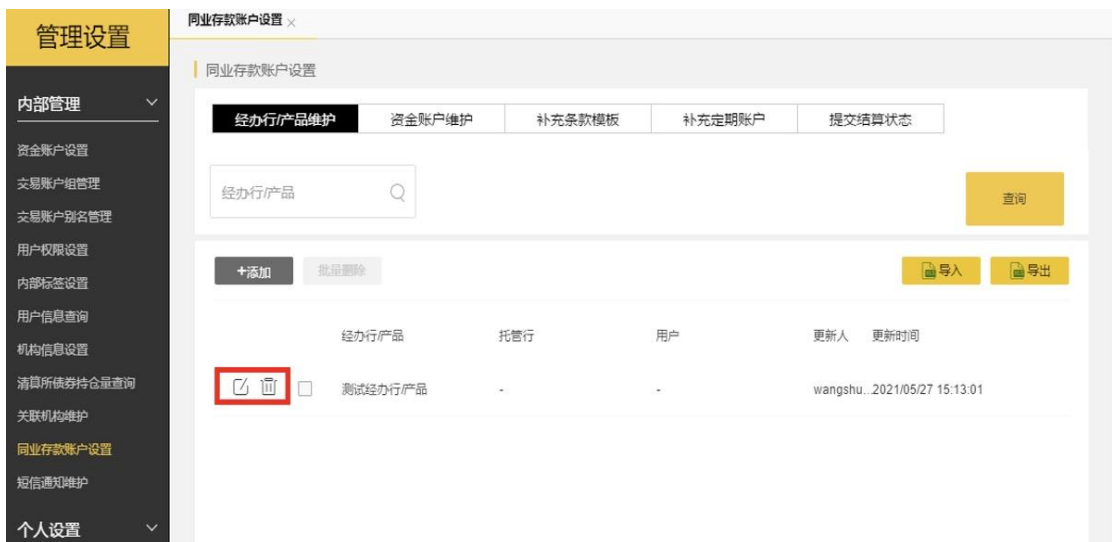
经办行/产品 类型 **全部** 状态 **全部**

查询

+添加 **批量删除** **导入** **导出**

经办行/产品	类型	状态	托管行	用户	更新人	更新时间
--------	----	----	-----	----	-----	------

3. 用户在查询界面点击铅笔”形状的【修改】按钮或【删除】按钮可对经办行/产品进行修改或删除操作。

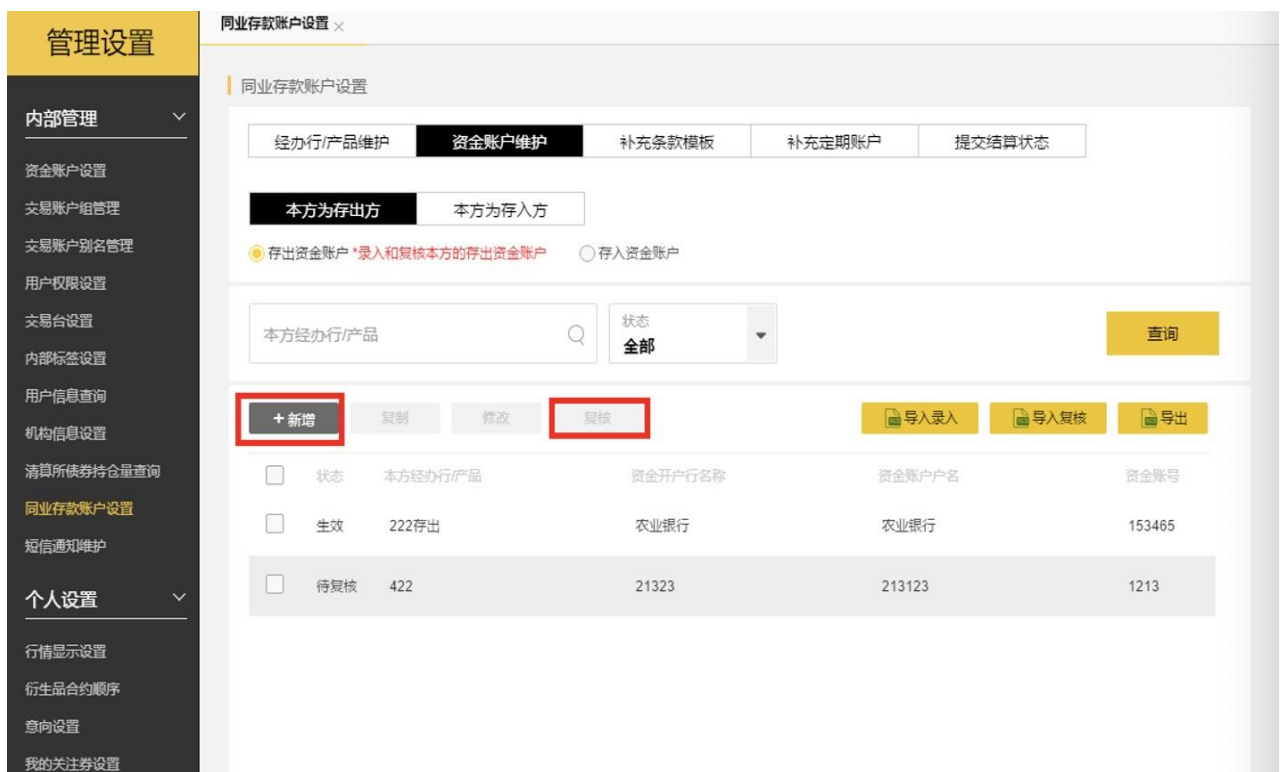


5.8.2 资金账户维护

用户所在机构具备同业存款交易权限，且用户自营或资管身份下有“清算服务-同业存款账户维护-资金账户维护”权限，可以对经办行/产品对应的资金账户进行设置与确认。

若某一经办行/产品已维护操作用户列表（即白名单），则视为对该经办行/产品进行了资金账户设置权限控制，仅白名单内用户可对该经办行/产品对应的资金账户进行设置与确认；若某一经办行/产品未维护白名单，则视为对该经办行/产品不作资金账户设置权限控制，具备相应权限的用户均可对该经办行/产品对应的资金账户进行设置与确认。

用户可点击  系统菜单“内部管理”->“同业存款账户设置”->“资金账户维护”



进行资金账户设置与确认。点击【导出】按钮可导出查询数据至本地。

(1) 本方为存出方

(a) 新增存出资金账户：若机构为存出方，需在本方为存出方 tab 页选择存出资金账户，点击【新增】按钮可维护本方的存出资金账户信息，点击【确认】按钮后，该条账户信息状态为“待复核”，也可点击【导入录入】按钮进行批量新增资金账户操作。

本方为存出方-存出资金账户-新增

本方经办行/产品

资金账号

资金账户户名

支付系统行号

资金开户行名称

确认

(b) 复核存出资金账户：该机构其他具有同业存款资金账户维护权限的用户，可在本方为存出方 tab 页选择存出资金账户，选中该条待复核账户，点击【复核】按钮进行复核操作，复核成功后该条账户信息的状态变为生效, 也可点击【导入复核】按钮进行批量复核资金账户操作。

管理设置

内部管理

资金账户设置

交易账户组管理

交易账户别名管理

用户权限设置

交易台设置

内部标签设置

用户信息查询

机构信息设置

清算所债券持仓量查询

关联机构维护

同业存款账户设置

短信通知维护

个人设置

行情显示设置

同业存款账户设置

经办行/产品维护

资金账户维护

补充条款模板

补充定期账户

提交结算状态

本方为存出方

本方为存入方

☒ 存出资金账户 *录入和复核本方的存出资金账户

☐ 存入资金账户

本方经办行/产品

状态

全部

查询

+ 新增

复制

修改

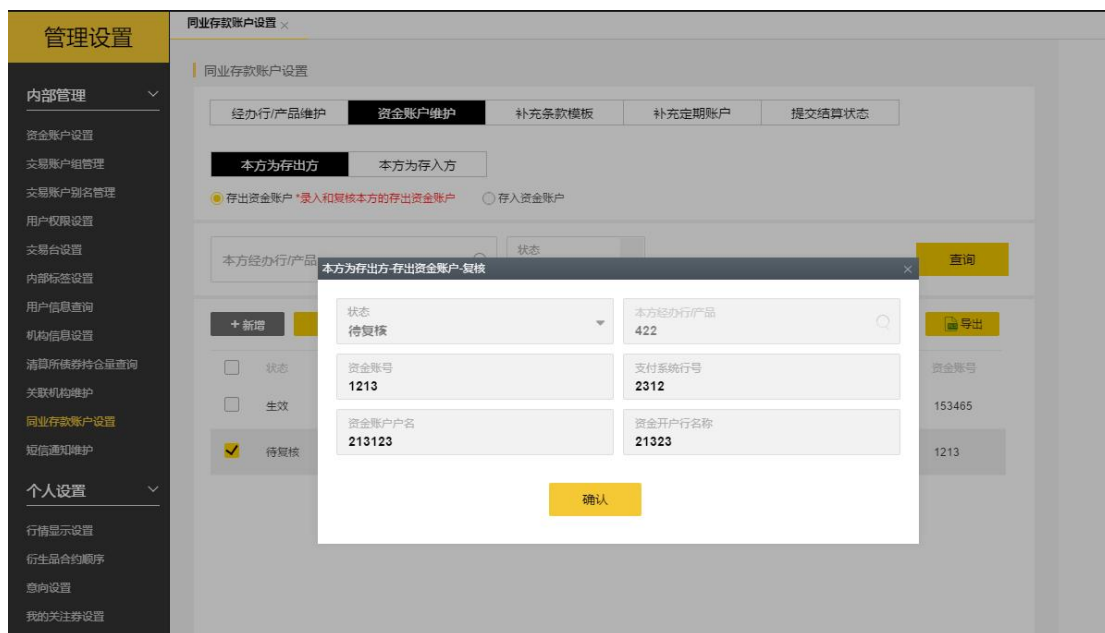
复核

导入录入

导入复核

导出

☐	状态	本方经办行/产品	资金开户行名称	资金账户户名	资金账号
☐	生效	222存出	农业银行	农业银行	153465
☒	待复核	422	21323	213123	1213

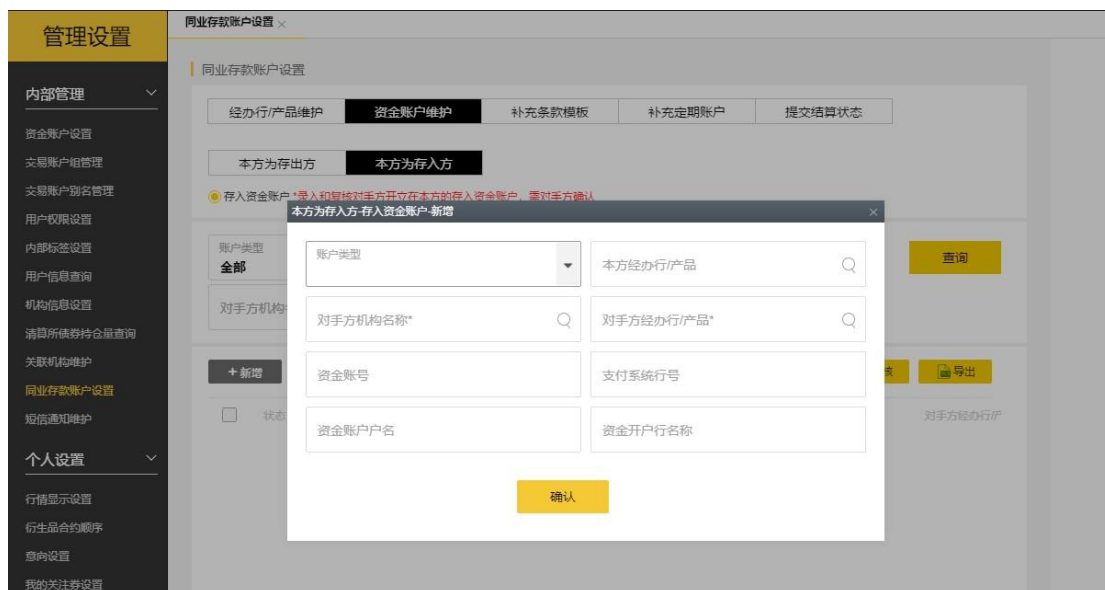


(c) 确认存入资金账户：作为存出方还需确认对手方为本方维护的存入资金账户，在本方为存出方 tab 页选择存入资金账户界面，选中状态为“待确认”的存入资金账户，点击【确认】按钮进行确认操作，确认成功后该条账户信息的状态即变为“生效”，也可点击【导入确认】按钮进行批量确认资金账户操作。

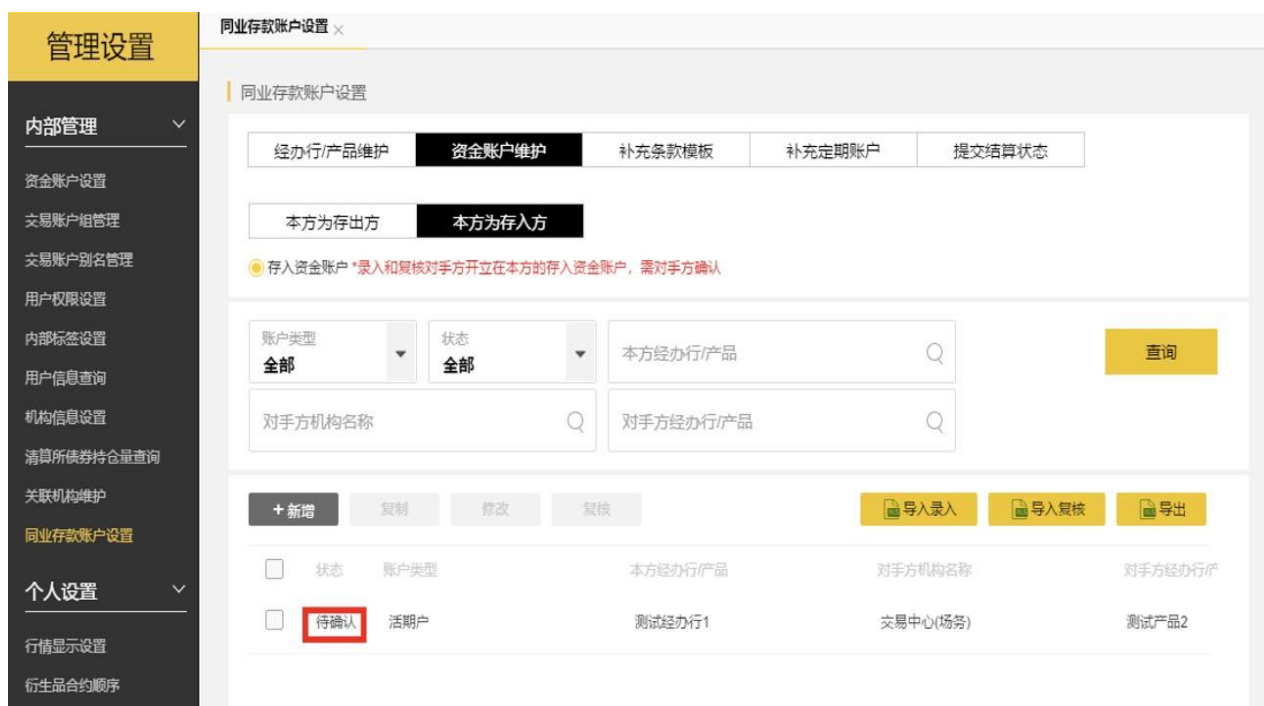


(2) 本方为存入方

(a) 新增存入资金账户：若机构为存入方，需在本方为存入方 tab 页选择存入资金账户，点击【新增】按钮可维护本方的存入资金账户信息，点击【确认】按钮后，该条账户信息状态为“待复核”，也可点击【导入录入】按钮进行批量新增资金账户操作。



(b) 复核存入资金账户：该机构其他具有同业存款资金账户维护权限的用户，可在本方为存入方 tab 页选择存入资金账户，选中该条待复核账户，点击【复核】按钮进行复核操作，复核成功后该条账户信息的状态变为“待确认”，还需对手方（即存出方）确认才能生效，也可点击【导入复核】按钮进行批量复核操作。



5.9 本币费用管理

5.9.1 交易手续费

在“自营/资产管理/代理交易”交易员身份下有“交易查询-交易手续费”权限（至少一个身份下有该权限即可）的用户，可以查询本机构及本机构所有关联交易账户（资产管理及代理交易账户）产生的交易手续费。

用户可点击系统菜单“内部管理”->“本币费用管理”“交易手续费”查询。点击【导出】按钮，可将查询结果导出为 Excel 文件保存至本地。

本币费用管理

本币费用管理

交易手续费

发行服务费

缴费通知单

当季费用管理

成交起始日
2022-02-14

成交终止日
2022-02-14

成交编号

本方

交易员

市场
全部

查询

导出

市场	成交编号	成交日	本方	交易员	成交量	手续费(元)
现券买卖	CBT20220214708736	2022-02-14	工行中国南方电...	韩笑	10,000,000.00	25.00

总记录数: 1笔, 缴费总额合计: 25.00 单位: 元

1

/1

5.9.2 发行服务费

在“自营/资产管理/代理交易”交易员身份下有“交易查询-交易手续费”权限（至少一个身份下有该权限即可）的用户，可以查询本机构产生的发行费数据。

点击【导出】按钮，可将查询结果导出为 Excel 文件保存至本地。

本币费用管理

交易手续费

发行服务费

缴费通知单

当季费用管理

缴款起始日
2022-02-14

缴款终止日
2022-02-14

存单代码

查询

导出

发行日	缴款日期	存单代码	存单简称	实缴纳金额 (元)	发行服务费 (元)
暂无数据					

总记录数0笔，缴费总额合计0元

1

/1

5.9.3 缴费通知单

在“自营/资产管理/代理交易”交易员身份下有“信息查询-缴费单通知”权限（至少一个身份下有该权限即可）的用户，可以查询本机构所有关联交易账户（资产管理及代理交易账户）的历史季度的缴费通知单及回执单。

点击  下载缴费单 按钮，可批量下载或单个下载缴费通知单；点击  下载回执单

按钮，可批量下载或单个下载回执单。点击【导出】按钮，可将查询结果导出为 Excel 文件保存至本地。

本市费用管理

本市费用管理

交易手续费

发行服务费

缴费通知单

当季费用管理

本方

Q

年度

2022

季度

第一季度

缴纳状态

全部

缴费通知单类型

全部

是否已出收费回执

全部

查询

完成缴费三个工作日后缴费状态会更新

下载缴费单

下载回执单

导出

☐	本方	年度/季度	应缴额(元)	缴纳状态	缴费通知单类型	缴费通知单名称	收费回执单名称
暂无数据							

1

/ 1

>

共0条

5.9.4 当季费用管理

在“自营/资产管理/代理交易”交易员身份下有“信息查询-当季费用管理” 权限（至少一个身份下有该权限即可）的用户，可以查询本机构及本机构所有关联交易账户（资产管理及代理交易账户）在当前季度产生的手续费总额，并可申请当季缴费凭证。

勾选一个或多个交易账户后，点击 **申请缴费凭证** 按钮，可向交易中心申请开具对应交易账户的缴费凭证，凭证状态更新为“已申请”；当申请通过审核后，凭证状态更新为“可下载”，可双击预览，或点击 **下载缴费凭证** 按钮将凭证下载保存至本地；当申请被拒绝时，凭证状态更新为“已拒绝”，可通过悬浮框查看拒绝原因。

缴费凭证中列明的费用总额，为当季首日至凭证申请日所产生的费用。若申请凭证后又产生了新费用，请重新申请缴费凭证，更新凭证中的费用总额。

本币费用管理

本币费用管理

交易手续费

发行服务费

缴费通知单

当季费用管理

本方

凭证状态

全部

查询

申请缴费凭证

完成缴费三个工作日后缴费状态会更新

下载缴费凭证

导出

☐	本方	当季应缴费用 (元)	凭证状态
☐	中信北京公共交通控股(集团)有限公司企业年...	15.00	-
☐	中信证券股份有限公司	75,981.31	-
☐	光大湖南省电力公司企业年金计划中信证券组合	50.00	-
☐	全国社保基金二零组合	150.00	-
☐	工行中国南方电网公司企业年金计划中信证券...	75.00	-

1

 / 1 > 共5条

6 交易操作

新平台灵活提供多种交易机制：协商交易机制、点击成交交易机制和匿名点击交易机制。

报价方式包括意向报价、对话报价、请求报价、做市报价和X-Bond订单，另外还提供委托代理和债券路演功能。

开展报价交易前，需确认本方机构或交易账户是否具有相关业务权限或资格，用户权限是否已勾选相关报价、交易的操作权限，以及是否已维护好各交易账户的DVP资金账户和托管账户。

6.1 现券市场

6.1.1 意向报价

6.1.1.1 意向报价发起

用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面（本系统类似窗口以下简称“iQuote”），选择“意向”，填写各类报价要素后，点击按钮，即可发送一笔意向报价：

现券买卖

债券一级

报价方式

指示性

请求

意向

对话

买入

卖出

代码*

1889176

清算速度*

+2

券面总额(万元)

1000

名称*

18飞驰建融4A

到期收益率(%)

3

匿名

备注

到期违约谨慎值购买

投资有风险

收益率高

稳定收益

收益翻倍

保存

提交

6.1.1.2 意向报价管理

报价发送成功后，可在“--我的交易--我的报价--现券买卖”菜单路径下，打开【我的报价】界面，查看已经发出的意向报价，或对意向报价进行修改和撤销操作。

我的报价

现券买卖

债券路演

导入

下载模板

本方方向

全部

买入

卖出

本方状态

全部

待发送

已发送

待成交

新发关键期限

代码/名称

对手方

对手方交易员

机构

☒	本方方向	代码	名称	本方状态	报价类型	本方	对手方	对手方交易员	请求有效	回复有效	回复量(万)	清算速度	到期(%)	净价
☒	买入	100018	10附息国债18	已发送	意向	中信银行	-	- / -	-	-	-	不限	3.34-3....	

1 / 1

撤销

拒绝

提交

成交

6.1.1.3 历史意向报价信息查询

意向报价的历史报价信息，可在“—信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场】-询价查询界面，查看历史的意向报价。



报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询 债券路演

报价方式: 全部 意向报价 对话报价 请求报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码/名称: 日期: 2019/06/03 - 2019/06/05 导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	报价方式	报价类型	方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	本方
190603040402011...	2019/06/03 13:31...	100018	10附息国债18	未成交	意向报价	意向	买入	—	—	—	—
190603040401011...	2019/06/03 13:08...	2019042...	777冒烟	未成交	意向报价	意向	买入	—	—	—	—

总2笔(买入2/卖出0), 0亿MNT(买入0/卖出0) 6亿元(买入6/卖出0) 1 / 1 共2条

6.1.2 对话报价

6.1.2.1 发起对话报价

(1) 任意身份下具有“现券交易-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“对话”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔对话报价：

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

南向通

互联互通

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

X-Auction

买入

卖出

代码*

100018

名称*

10附息国债18

待偿期

17.86Y

估值

-/-

主体/债项

-/-

本方*

中国中信银行

对手方*

中国农业银行

对手方交易员*

房烨

清算速度*

+0

结算日

2022/08/11

净价(元)*

99.5600

到期收益率(%)

4.0646

券面总额(万元)*

10000

结算方式*

券款对付

清算类型*

全额清算

内部标签 (仅本方可见)

保存

提交

报价发送成功后，打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—现券买卖”路径下打开），可查看已经发出的对话报价。

（2）提供批量提交对话报价功能。可点击按钮，在模板中填写对话报价数据，点击按钮导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。

我的报价

现券买卖

南向通

债券借贷

债券路演

预发行

互联互通

材料提交

导入

下载模板

本方方向

全部

买入

卖出

本方状态

全部

待发送

已发送

待成交

新发关键期限

代码名称

对手方

对手方交易员

机构

☒	本方方向	代码	名称	本方状态	报价类型	本方	对手方	对手方交易员	请求有效	回复有效	回复量(万)	清算速度
☒	买入	100018	10附息国债18	已发送	对话	中国中信银行	中国农业银行	房烨	中国建设银行	-	-	+0

撤销

拒绝

提交

成交

6.1.2.2 发起协议转让报价

(1) 任意身份下具有“现券交易-协议转让”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“协议转让”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔协议转让报价：

报价发送成功后，打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—现券买卖”路径下打开），可查看已经发出的协议转让报价。



该截图展示了 CIBMTS 系统中的“现券买卖”协议转让报价界面。界面顶部有“债券市场”、“货币市场”、“衍生品市场”和“一级市场”的标签，当前选中的是“债券市场”。下方有“现券买卖”、“债券借贷”、“债券路演”、“预发行”、“南向通”和“互联互通”的子标签，当前选中的是“现券买卖”。在“报价方式”区域，有“X-Bond”、“做市”、“揭示性”、“请求”、“意向”、“对话”、“协议转让”（当前选中）和“X-Auction”等选项。界面主要分为“买入”和“卖出”两个部分，当前显示的是“买入”报价。在“买入”部分，需要填写以下信息：

- 代码*：1980191
- 名称*：19华汽债02 MD
- 待偿期：1.17Y+2Y
- 估值：-/-
- 主体/债项：-/C
- 本方*：中国银行
- 对手方*：建设银行
- 对手方交易员*：陈曦
- 清算速度*：+0
- 结算日：2022/08/11
- 净价(元)*：95.0000
- 到期收益率(%)：
- 券面总额(万元)*：2000
- 结算方式*：券款对付
- 清算类型*：全额清算

在“内部标签（仅本方可见）”区域，有一个文本输入框。界面底部有一个黄色的“提交”按钮。

6.1.2.3 对话报价管理

(1) 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击

撤销

按钮终止对话报价；也可以双击某笔对话报价，修改部分报价要素后，点击

提交

按钮更新对话报价。

(2) 对话报价确认成交

➤ 对于状态为“待成交”的对话报价，可以双击对话报价记录打开 iQuote，点击

成交

按钮达成一笔对话成交；或点击

拒绝

按钮拒绝对话报价

对话报价确认

本方卖出

10附息国债18

待偿期

估值

主体/债项

100018

17.86Y

-/-

-/-

本方

中国农业银行

对手方

中国中信银行

对手方交易员

党超

清算速度

+0

结算日

2022/08/11

净价(元)

99.5600

到期收益率(%)

4.0646

券面总额(万元)

10000

结算方式

券款对付

清算类型

全额清算

内部标签

拒绝

成交

亦可在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔对话报价，点击

成交

按钮来完

成对话成交；也可点击按钮来拒绝对话报价



6.1.2.4 协议转让报价管理

(1) 对于状态为“已发送”的协议转让报价，可以选中单笔/多笔协议转让报价，点击按钮终止协议转让报价；也可以双击某笔协议转让报价，修改部分报价要素后，点击按钮更新协议转让报价。

协议转让报价确认

本方卖出

19华汽债02 MD

待偿期

估值

主体/债项

1980191

1.17Y+2Y

-/-

-/C

本方

建设银行

对手方

中国银行

对手方交易员

陈蕾彦

清算速度

+0

结算日

2022/08/11

净价(元)

95.0000

到期收益率(%)

券面总额(万元)

2000

结算方式

券款对付

清算类型

全额清算

内部标签

拒绝

成交

(2) 协议转让报价确认成交

- 对于状态为“待成交”的协议转让报价，可以双击协议转让报价记录打开 iQuote，

点击 **成交** 按钮达成一笔协议转让成交；或点击 **拒绝** 按钮拒绝协议转让报价

我的报价

现券买卖

南互通

债券借贷

债券路演

预发行

互联互通

材料提交

导入

下载模板

本方方向

全部

买入

卖出

本方状态

全部

待发送

已发送

待成交

新发关键期限

代码/名称

Q

对手方

Q

对手方交易员

Q

机构

Q

☒	本方方向	代码	名称	本方状态	报价类型	本方	对手方	对手方交易员	请求有效	回复有效	回复量(万)	清算速度	Tom+0
☒	卖出	1980191	19华汽债02 MD	待成交	协议转让	建设银行	中国银行	陈蕾彦	0 / 中...	-	-	+0	-

撤销

拒绝

提交

成交

6.1.2.5 历史对话报价信息查询

对话报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-询价】界面，查看历史的对话报价。

报价信息查询-债券市场											
询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询 债券路演											
报价方式: 全部 意向报价 对话报价 请求报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码名称 Q 日期: 2019/06/03 ~ 2019/06/05 导出											
报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	报价方式	报价类型	方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	本方
190603060402011...	2019/06/03 13:45...	100019	10附息国债19	未成交	对话报价	对话	买入	建设银行	建设银行	陈尧	中信银行(国...
总1笔(买入1/卖出0), 1亿元(买入1/卖出0)											

6.1.2.6 历史协议转让报价信息查询

协议转让报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-询价】界面，查看历史的协议转让报价。

报价信息查询-债券市场

询价查询

订单查询

做市报价查询

债券借贷

债券路演

X-Auction

预发行

南向通

互联互通

报价方式

全部

意向报价

对话报价

请求报价

X-Bargain

成交状态

全部

成交

未成交

代码名称

Q

日期

2022/08/11

-

2022/08/11

导出

报价编号	成交意向编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	报价方式	报价类型	方向	对手方
220811060401000158		2022/08/11 10:43:01	1980191	19华汽债02 MD	成交	对话报价	协议转让	卖出	中国农业银行

总1笔(买入0/卖出1), 0.03亿元(买入0/卖出0.03)

K

<

1

/

>

X

共1条

6.1.2.7 材料提交查询

用户可通过“我的报价”->“现券买卖”点击按钮，打开材料提交查询界面，点击“新增”，填写报价相关要素与材料，点击“提交”即可新增成功。也可查询到提交记录后，点击左侧的修改按钮进行修改，或点击删除按钮删除提交记录。

材料提交

日期

2022/08/11

2022/08/11

状态

全部

已提交

补充说明

提交用印版

系统确认

代码名称

Q

+ 新建

	提交方向	材料编号	报价编号	提交时间	买入方	卖出方	债券名称	状态	文件名称
📄 🔄	卖出	2208110000002469	220811060401000...	2022/08/11 15:59	中国中信银行	中国农业银行	10附息国债18	已提交	下载 材料补充.zip

1

/ 1

>

共1条

材料提交-新增

报价编号

220811060401000181

Q

提交方向*

卖出

买入方*

中国中信银行

Q

卖出方*

中国农业银行

Q

债券名称*

100018|10附息国债18

Q

文件上传

浏览

* 仅支持zip格式

* 文件内容包括风险承诺函、情况说明等

取消

提交

6.1.3 请求报价

6.1.3.1.发送请求报价

(1) 任意身份下具有“现券交易-请求报价”权限用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧



按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“请求”，选择分仓方式（不

分仓/Pre-alloc/Post-alloc），填写各报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔请求报价。其中对于 Post-Allocation 报价，清算速度为+1 时，Tom+0 可选择是或否，当选择是时，则为 Tom+0 交易：

现券买卖

债券路演

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

分仓方式

不分仓

Pre-Allocation

买入

卖出

代码 *

100018

名称 *

10附皇国债18

本方 *

中国XXX

券面总额(万元) *

50000

清算速度 *

+1

结算日

2019/06/04

有效时间 *

15:52

结算方式 *

券款对付

清算类型 *

全额清算

搜索对手方机构

已选6个对手方机构

可选机构列表

建设银行

交通银行

光大银行

浦发银行

招商银行

中信证券

CFETS智能推荐

交通银行

光大银行

浦发银行

招商银行

中信证券

前5

前10

保存

提交

现券买卖

债券路演

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

分仓方式

不分仓

Pre-Allocation

买入

卖出

代码 *

名称 *

券面总额(万元) *

清算速度 *

+1

结算日

2019/06/04

有效时间 *

18:56

结算方式 *

券款对付

清算类型 *

全额清算

搜索对手方机构

可选机构列表

CFETS智能推荐

没有添加任何对手方机构

前5

前10

添加篮子/产品

☐ 平均分配券面总额

保存

提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

南向通

互联互通

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

分仓方式

不分仓

Pre-Allocation

Post-Allocation

买入

卖出

代码 *

名称 *

券面总额 (...)

清算速度 *

+1

Tom+0

是

结算日

2022/03/15

有效时间 *

18:36

结算方式 *

券款对付

清算类型 *

全额清算

搜索交易对手

可选机构列表

CFETS智能推荐

没有添加任何交易对手

前五

前十

保存

提交

87

(2) 用户可点击指示性报价发起请求报价

打开【单券】报价行情界面，可以查看指示性报价行情，点击任意带 图标 的报价可转为请求报价，向该笔指示性报价机构发送请求报价。

单券

100018 1889108 100019 090224 091612001 180413 180205

☆ 10附息国债18 100018

-/-BP

主体/债项 -/-

成交笔数 0

当日行情 债券信息/估值 历史成交行情 相关券推荐

报价行情 全部 做市点击 X-Bond 指示性 意向&经纪报价

报买机...	报买量...	报买价(%)	报卖价(%)	报卖量...	报卖机...	净
建设银行	5000	4.0655	4.0977	-	中信银行	T+
建设银行	5000	4.0655	4.0977	-	中信银行	
中信银行	60000	4.0962	4.0891	60000	中信银行	
中信银行	-	4.1013	4.0583	5000	建设银行	

6.1.3.2 请求报价管理

报价发送成功后，打开【我的报价】界面（“--我的交易—我的报价-现券买卖”路径下打开），可查看已经发出的请求报价。

我的报价

现券买卖 债券路演

导入 下载模板

本方方向 全部 买入 卖出 本方状态 全部 待发送 已发送 待成交 新发关键期限

代码名称 对手方 对手方交易员 机构

本方方向	代码	名称	本方状态	报价类型	本方	对手方	对手方交易员	请求有效	回复有效	回复量(万)	清算速度	到期(%)	净价
☐ 买入	1000004	1000004-中...	待成交	RFQ		工商银行	工商 / 工商银行	14:49	14:49	10000	+1	63.2034	23.0000
☐ 买入	1000001	1000001-中	待发送	RFQ	中信证券	5	- / -	15:29	-		+1		
☒ 买入	100040	10附息国债40	已发送	RFQ	中信证券	5	- / -	13:48	-		+1		

撤销 拒绝 提交 成交

➤ 对于状态为“已发送”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，点击 按钮终止请求报价；或双击请求报价记录打开 iQuote，直接进行撤销。

➤ 对于状态为“待成交”的请求报价，可以双击待成交报价打开 iQuote，点击 成交。

按钮达成一笔请求成交；或点击 **撤销** 按钮终止请求报价。

请求报价确认

买入

请求有效时间 15:52

10附息国债18

券面总额(万元)

100018

50000

本方

中信银行(国际)有限公司

对手方交易员

到期(%)

净价(元)

回复量(万元)

回复有效

☒

陈尧

建设银行

4.1013

99.0000

50000

15:52

▼

加权净价 99.0000 元

加权到期 4.1013 %

券面合计 50000 万元

撤销

成交

(不分仓)

请求报价确认

买入

请求有效时间 18:56

10附息国债18

券面总额(万元)

100018

50000

对手方交易员

到期(%)

净价(元)

回复量(万元)

回复有效

☒

陈尧

建设银行

4.1013

99.0000

50000

18:56

^

产品名称

分配券面(万元)

☒

产品1

30000

☒

产品2

20000

合计(万元)

50000

清算速度

+1

清算日

2019/06/04

清算类型

全额清算

清算方式

券款对付

应计利息

1,826.79 元

全价

100,826.8 元

交易金额

495,000,000.00 元

应计利息总额

9,133,928.57 元

结算金额

504,133,928.57 元

加权净价 99.0000 元

加权到期 4.1013 %

券面合计 50000 万元

撤销

成交

(Pre-alloc 分仓)

请求报价确认

买入

请求有效时间 12:30

17国开债10

券面总额(万元)

170210

5000

对手方交易员

净价(元)

到期(%)

回复量(万元)

回复有效

☒

张世林

招商银行上海...

89.3000

4.9025

3000.00

12:30

▼

☐

王桂香

浦发银行上海...

89.3000

4.9025

3000

12:30

▼

☐

邓文兵

上海银行上海...

89.3000

4.9025

3000

12:30

▼

☐

周伟

北京银行上海...

89.3000

4.9025

3000

12:30

▼

加权净价 89.30 元

加权到期收益率 4.1234 %

券面合计 3000 万元

撤销

成交

(Post-alloc 分仓)

分仓管理

券面总额(万元)

10000

产品

分配券面(万元)

	Q	⊗
	Q	⊗
	Q	⊗
	Q	⊗
	Q	⊗

⊕ 添加

合计(万元)

取消

提交

在分仓界面选择分配的产品以及填写对应分配量，点击提交，若分仓成功则状态变为“已分仓”。

对于 Tom+0 交易，请求方可选择 T 日或 T+1 日分仓：

若 T 日分仓，请求方可在 T 日收盘前提交分仓，状态变为“待本方确认”，当天无法再修改分仓信息。

交易分仓

状态

全部 待本方分仓 待对手方分仓 待确认 已分仓

本方方向

全部 买入 卖出

交易方式

全部 RFQ X-Bond X-Bargain X-Auction

渠道

全部 银行间 债券通

日期

2022/03/15 — 2022/03/16

代码/名称

Q 李亮

对手方

Q

对手方交易员

Q

X-Bond 溢价

全部 显 否

成交意向编号	成交意向时间	状态	有效时间	代码	名称	本方方向	本方	本方交易员	对手方
202203160011000018	2022/03/16 14:43:57	已分仓	16:43:57	157864	19内蒙16	买入	1	李亮	中国银行
202203160011000017	2022/03/16 14:43:57	待本方确认	-	157864	19内蒙16	买入	—	李亮	中国银行
202203160011000016	2022/03/16 14:43:57	待本方分仓	-	1280244	12铁道06	买入	—	李亮	中国银行
202203160011000015	2022/03/16 14:43:57	待本方分仓	-	1280244	12铁道06	买入	—	李亮	中国银行

1 / 1

共4条

分仓管理

券面总额(万) 6000

产品	分配总额(万)
北京公共交通年金中信证券	3,000
第一汽车年金中信组合	3,000

+

 添加

合计 6000

截屏

提交

请求方可在 T+1 日有效时间内对“待本方确认”的成交意向做交易账户和券面总额的修改以及分仓确认操作。提交分仓确认后，若确认成功则状态变为“已分仓”。

分仓管理

券面总额(万) 6000

产品	分配总额(万)
北京公共交通年金中信证券	3,000
北京公共交通年金中信证券	
北京人寿保险委托中信证券权益投资...	
长江金色晚晴年金中信证券	
成都铁路局年金中信证券	
第一汽车年金中信组合	

+

 添加

合计 3000

截屏

取消

提交

请求方若未在 T+1 日有效时间内提交分仓确认，系统在截止时间将自动确认分仓，状态变为“已分仓”。

若 T 日不分仓选择 T+1 日分仓，请求方可在有效时间内提交分仓，分仓成功后状态变为“已分仓”。

6.1.3.4 历史请求报价信息查询

请求报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-询价查询】界面，查看历史的请求报价。



报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询 债券路演

报价方式: 全部 意向报价 对话报价 请求报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码/名称: 日期: 2019/06/03 - 2019/06/05 导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	报价方式	报价类型	方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	本方
190603090411000...	2019/06/03 18:56...	100018	10附息国债18	未成交	请求报价	RFQ	买入	6	6	—	2
190603090412000...	2019/06/03 16:38...	1110001	11兴业次级债	未成交	请求报价	RFQ	买入	6	6	—	中信银行(国...
190603090412000...	2019/06/03 15:52...	100018	10附息国债18	未成交	请求报价	RFQ	买入	6	6	—	中信银行(国...

总3笔(买入3/卖出0), 11亿元(买入11/卖出0) 1 / 1 共3条

点击任意一笔请求报价，可以查看请求报价流水



报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询

报价方式: 全部 意向报价 对话报价 请求报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码/名称: 日期: 2019/06/05 - 2019/06/05 导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	报价方式
190605090412000...	2019/06/05 16:26...	190002	19附息国债02	未成交	请求报价

总1笔(买入1/卖出0), 0.1亿元(买入0.1/卖出0) 1 / 1 共1条

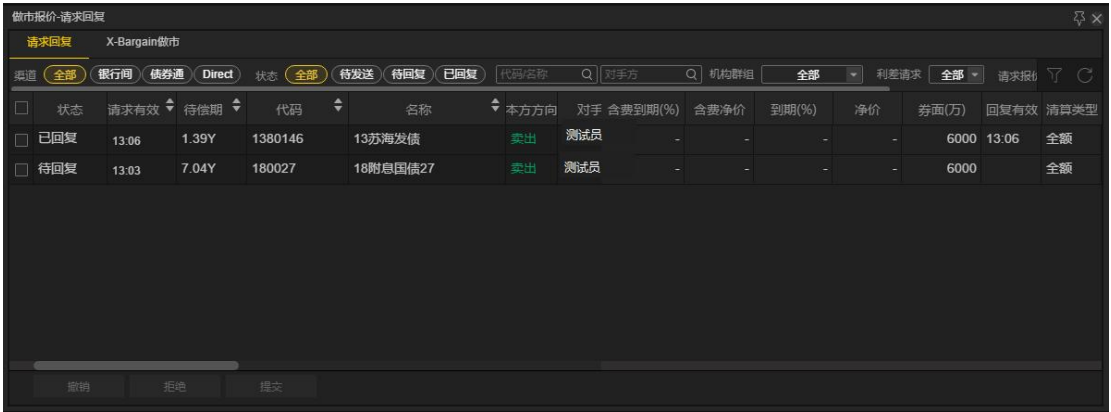
报价详情 成交概览 交易全流程

日期: 2019/06/05 请求报价编号: 190605090412000002

请求方机构	发送时间	有效时间	代码
中国银行	16:24:54	18:24:00	190002
名称	报价类型	方向	待偿期
19附息国债02	RFQ	买入	1.72Y
清算速度	债券币种	债券类型	请求量(万)
T+1	CNY	国债	1,000.00
交易员	请求方	报价来源	
chenly	中国银行	客户端	
状态	撤销	结束时间	16:26:41
报价来源	客户端		

6.1.4 请求回复

自营身份下具有“做市交易-请求回复”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击“我的做市—请求回复”菜单路径，打开【做市报价-请求回复】界面，可以查看本方收到的请求报价：



做市报价-请求回复 X-Bargain做市

渠道: 全部 银行间 债券通 Direct 状态: 全部 待发送 待回复 已回复 代码/名称: 对手方: 机构群组: 全部 利率请求: 全部 请求报价: 提交

☐	状态	请求有效	待偿期	代码	名称	本方方向	对手	含费到期(%)	含费净价	到期(%)	净价	券面(万)	回复有效	清算类型
☐	已回复	13:06	1.39Y	1380146	13苏海发债	卖出	测试员	-	-	-	-	6000	13:06	全额
☐	待回复	13:03	7.04Y	180027	18附息国债27	卖出	测试员	-	-	-	-	6000		全额

撤销 拒绝 提交

➤ 对于状态为“待回复”的请求报价，可以双击请求报价记录打开 iQuote，输入价格后点击  按钮进行回复；或点击  按钮拒绝请求报价；

或在【做市报价-请求回复】界面，直接填写“到期”/“净价”/“券面”字段，点击  按钮进行快捷回复。



做市报价-请求回复

渠道: 全部 银行间 债券通-TW 债券通-BBG 状态: 全部 待发送 待回复 已回复 代码/名称: 对手方: 提交

☐	状态	请求有效	代码	名称	本方方向	对手方交易员	到期(%)	净价	券面(万)	回复有效	清算类型
☒	待回复	16:38	1110001	11兴业次级债	卖出	金春燕 / 中信银行			10000	16:38	全额
☐	已回复	15:52	100018	10附息国债18	卖出	金春燕 / 中信银行	4.1013	99.0000	50000	15:52	全额

取消 提交

➤ 特别地，对于 Closing Order 状态为“待回复”的请求报价，可以双击请求报价记录打开 iQuote，输入利差后点击  按钮进行回复；或点击  按钮拒绝请求报价

请求报价回复

卖出

请求有效时间
13:03

代码
180027

名称
18附息国债27

待偿期
7.04Y

估值
-/-

主体/债项
-/-

本方
交易中心场务

对手方机构
交易中心测试

对手方交易员
测试员

对手方
交易中心测试

渠道
债券通

报价基准*
CVal

利差(BP)*

券面总额(万元)*
6000

清算速度
+1

结算日
2021/11/09

回复有效时间*
13:03

结算方式
券款对付

清算类型
全额清算

拒绝

保存

提交

或在【做市报价-请求回复】界面，直接填写“利差”字段，点击  按钮进行快捷回复。

做市报价-请求回复

X-Bargain做市

请求回复

全部 银行间 债券通 Direct

状态 全部 待发送 待回复 已回复

代码/名称

对手方

机构群组

全部

利差请求

全部

请求报价

报价来源	请求报价类型	报价编号	ListID	报价基准	利差(BP)	含费到期(%)	含费净价	到期(%)	净价	券面(万)	回复有效	清算类型
☐	客户端 RFQ	211108090411000...		CVal	+10.00	-	-	-	-	6000	13:06	全额
☒	RFQ	211108090411000...		CVal		-	-	-	-	6000	13:03	全额

取消

提交

➤ 对于状态为“已回复”的请求报价，可以双击已回复报价记录打开 iQuote，点击

撤销 按钮撤销请求回复；或点击 拒绝 按钮拒绝请求报价；或修改请求回复的价格/数量后点击 提交 按钮，更新请求回复。

请求报价回复

卖出

请求有效时间 15:52

代码 100018

名称 10附息国债18

待偿期 21.05Y

估值 -/-

主体/债项 -/-

本方 建设银行

对手方机构 中信银行

对手方交易员 金春燕

对手方 中信银行(国际)有限公司

净价(元) * 99.0000

到期收益率(%) * 4.1013

券面总额(万元) * 50000

清算速度 +1

清算日 2019/06/04

回复有效时间 * 15:52

清算方式 券款对付

清算类型 全额清算

撤销

拒绝

提交

或在【做市报价-请求回复】界面直接勾选单笔/多笔“已回复”的请求报价，点击

撤销 按钮来撤销请求回复；也可点击 拒绝 按钮拒绝请求报价。

做市报价-请求回复

渠道 全部 银行间 债券通-TW 债券通-BBG

状态 全部 待发送 待回复 已回复

代码/名称 对手方

状态	请求有效	代码	名称	本方方向	对手方交易员	到期(%)	净价	券面(万)	回复有效	清算类型
☐	待回复	16:38	1110001	11兴业次级债	卖出	金春燕 / 中信银行			10000	全额
☒	已回复	15:52	100018	10附息国债18	卖出	金春燕 / 中信银行	4.1013	99.0000	50000	15:52 全额

撤销

拒绝

提交

➤ 特别地，对于 Closing Order 状态为“已回复”的请求报价，可以双击请求报价记录

打开 iQuote，点击  按钮撤销请求回复；或点击  按钮拒绝请求报价；或修改请求回复的利差点击  按钮，更新请求回复。

请求报价回复

卖出

请求有效时间
13:06

代码 1380146	名称 13苏海发债	
待偿期 1.39Y	估值 -/-	主体/债项 AA/AA+
本方 交易中心场务		
对手方机构 交易中心测试	对手方交易员 测试员	
对手方 交易中心测试	渠道 债券通	
报价基准* CVal	利差(BP)* +10.00	
券面总额(万元)* 6000	清算速度 +1	结算日 2021/11/09
回复有效时间* 13:06	结算方式 券款对付	清算类型 全额清算

撤销

拒绝

提交

或在【做市报价-请求回复】界面直接勾选单笔/多笔“已回复”的请求报价，点击  按钮来撤销请求回复；也可点击  按钮拒绝请求报价。

做市报价 请求回复

X-Bargain做市

渠道

全部

银行间

债券通

Direct

状态

全部

待发送

待回复

已回复

代码/名称

对手方

机构群组

全部

利差请求

全部

请求报价

清除

刷新

☒	状态	请求有效	待偿期	代码	名称	本方方向	对手	含费到期(%)	含费净价	到期(%)	净价	券面(万)	回复有效	清算类型
☒	已回复	13.06	1.39Y	1380146	13苏海发债	卖出	测试员	-	-	-	-	6000	13.06	全额
☒	待回复	13.03	7.04Y	180027	18附息国债27	卖出	测试员	-	-	-	-	6000		全额

撤销

拒绝

提交

6.1.5 做市报价

6.1.5.1 发送做市报价

(1) 自营身份下具有“做市交易-做市报价”权限，但不具有分层报价权限或者没有维护报价群组的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“做市”，填写各报价要素后，点击按钮，即可发送一笔做市报价：

现券买卖

债券路演

报价方式

☐ X-Bond
☒ 做市
☐ 指示性
☐ 请求
☐ 意向
☐ 对话

发送对象

☒ 银行间
☐ 北金所

代码*

100018

名称*

10附息国债18

待偿期

21.05Y

估值

-/-

主体/债项

-/-

本方

中信银行

有效时间*

23:20

清算速度*

+1

结算日

2019/06/04

买卖价差(BP)

☐ 冰山券面(万元)

清算类型*

全额清算

结算方式*

券款对付

买入

券面(万元)*

60000

净价(元)*

99.0700

到期(%)*

4.0962

卖出

券面(万元)*

60000

净价(元)*

99.1700

到期(%)*

4.0891

保存

提交

报价发送成功后，点击“我的做市—做市报价”菜单路径，可打开【我的做市-做市报价】界面，查看已经发出的做市报价，或对做市报价进行修改和撤销操作。

(2) 自营身份下具有“做市交易-做市报价”权限，且具有分层报价权限，并且维护了

报价群组的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要

报价】界面，选择“做市”，填写各报价要素后，选择发送对象中的群组，点击按钮，即可发送一笔做市分层报价：

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券路演

报价方式 ☐ X-Bond ☒ 做市 ☐ 指示性 ☐ 请求 ☐ 意向 ☐ 对话

代码 *
zllgz

名称 *
zll国债

本方
农业银行

有效时间 *
20:00

清算速度 *
+1

结算日
2020/05/28

清算类型 *
金额清算

结算方式 *
券款对付

发送对象 ☒ 银行间 ☐ 群组列表

特偿期
3.04Y

估值
178.826675/-16.733689%

主体/债项
AAA/-

冰山券面(万元)	买入券面(万元)	买入净价(元)	买入到期(%)	卖出到期(%)	卖出净价(元)	卖出券面(万元)
银行间 ☐	6000	95.0000	4.7580	3.3440	99.0000	6000
	应计利息		0.065元	应计利息		0.065元
	全价		95.0645元	全价		99.0645元
	交易金额		57,000,000.00元	交易金额		59,400,000.00元
	应计利息总额		38,709.68元	应计利息总额		38,709.68元
	结算金额		57,038,709.68元	结算金额		59,438,709.68元
农业群组1 ☐	6000	96.0000	4.3987	3.3440	99.0000	30000
	应计利息		0.065元	应计利息		0.065元
	全价		96.0645元	全价		99.0645元
	交易金额		57,600,000.00元	交易金额		297,000,000.00元
	应计利息总额		38,709.68元	应计利息总额		193,548.39元
	结算金额		57,638,709.68元	结算金额		297,193,548.39元

批量导入

保存

提交

群组列表

SET1

- ☒ 农业群组1

农业银行 中信银行 安邦保险
- ☐ DW群组
- ☐ shi01
- ☐ 其他

确定

(3) 提供批量提交做市报价功能。可点击按钮，在导出模板中填写做市报价数据，点击按钮导入做市报价后，批量提交。



做市报价

做市报价 指示性报价

+ 新做市报价 导入 导出

状态 全部 已发送 待发送 冻结 发送对象 全部 银行间 北金所 新发关键期限 新上市债券 我的报价 我的关注券 代码/名称 搜索 刷新

	代码	名称	待偿..	状...	发送..	有效..	买入券面..	买入净价	买入到期..	卖出到期..	卖出净价	卖出券面..
☐	☆ 100018	10附息国债18	21.05Y	已发送	银行间	23:20	60000	99.0700	4.0962	4.0891	99.1700	60000

冻结 撤销 提交

6.1.5.2 做市报价管理

➤ 对于状态为“已发送”的做市报价，可以选中单笔/多笔做市报价，点击按钮撤销做市报价；或点击按钮冻结做市报价。



做市报价

做市报价 指示性报价

+ 新做市报价 导入 导出

状态 全部 已发送 待发送 冻结 发送对象 全部 银行间 北金所 新发关键期限 新上市债券 我的报价 我的关注券 代码/名称 搜索 刷新

☒	☆ 100019	10附息国债19	1.06Y	已发送	银行间	23:20	5000	99.0000	4.3886	4.2900	99.1000	5000
☒	☆ 100018	10附息国债18	21.05Y	已发送	银行间	23:20	60000	99.0700	4.0962	4.0891	99.1700	60000

冻结 撤销 提交

➤ 对于状态为“已发送”的做市报价，双击“已发送”报价记录打开 iQuote，点击按钮冻结一笔做市报价；或点击按钮终止做市报价；或修改部分做市报价要素后，点击按钮更新做市报价

现券买卖

债券路演

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

发送对象

☒ 银行间

☐ 北金所

代码*

100019

名称*

10附息国债19

待偿期

1.06Y

估值

-/-

主体/债项

-/-

本方

中信银行

有效时间*

23:20

清算速度*

+1

结算日

2019/06/04

买卖价差(BP)

☐ 冰山券面(万元)

清算类型*

全额清算

结算方式*

券款对付

买入

券面(万元)*

5000

净价(元)*

99.0000

到期(%)*

4.3886

卖出

券面(万元)*

5000

净价(元)*

99.1000

到期(%)*

4.2900

冻结

撤销

提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券路演

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

代码*

21gcz

名称*

21国债

本方

农业银行

每份时间*

20:00

清算速度*

+1

结算日

2020/05/28

清算类型*

净额清算

结算方式*

券款对付

发送对象

☐ 银行间

☒ 北金所

待偿期

3.04Y

估值

178.826675/-16.733689%

主体/债项

AAA/-

冰山券面(万元)

买入券面(万元)

3000

买入净价(元)

99.0000

买入到期(%)

4.7580

卖出净价(元)

99.0000

卖出到期(%)

3.3440

卖出券面(万元)

6000

冻结

撤销

提交

或在【做市报价】界面，直接修改“到期”/“净价”/“券面”字段，点击 提交 按钮进行快捷提交。

做市报价

做市报价 指示性报价

+ 新做市报价

导入

导出

状态

全部

已发送

待发送

冻结

发送对象

全部

银行间

北金所

☐ 新发关键期限

☐ 新上市债券

☐ 我的报价

☐ 我的关注券

代码/名称

搜索

刷新

状态	代码	名称	待偿..	状...	发送..	有效..	买入券面..	买入净价	买入到期..	卖出到期..	卖出净价	卖出券面..
☒	100019	10附息国债19	1.05Y	已发送	银行间	23:20	50000	99.0100	4.3813	4.3615	99.0300	50000
☒	100018	10附息国债18	21.05Y	已发送	银行间	23:20	8000	99.0200	4.0998	4.0998	99.0200	8000

取消

提交

6.1.5.3 历史做市报价查询

请求报价的历史报价信息，可在“ 菜单图标 --信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-做市报价查询】界面，查看历史的做市报价。

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询

报价方式: 全部 指示性报价 请求回复 做市报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码/名称: 日期: 2019/06/05 ~ 2019/06/05 导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	净价	到期(%)	券面(万)	净价	到期(%)	券面(万)	报价方式	报价
190605020401000...	2019/06/05 16:38...	199903	19贴现国债03	未成交	99.0000	0.2383	1,000	100.0000	-0.0123	1,000	做市报价	做市

总1笔, 0.2亿元(买入0.1/卖出0.1)

K < 1 / 1 > 共1条

点击任意一笔做市报价，可以查看做市报价流水

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询

报价方式: 全部 指示性报价 请求回复 做市报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码/名称: 日期: 2019/06/05 ~ 2019/06/05 导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	净价
190605020401000...	2019/06/05 16:38...	199903	19贴现国债03	未成交	99.00
190605010410000...	2019/06/05 16:41...	1805199	18广东债24	未成交	99.00

总2笔, 0.4亿元(买入0.2/卖出0.2)

K < 1 / 1 > 共2条

报价详情 成交概览 做市报价流水

日期: 2019/06/05 报价编号: 190605020401000001

业务时间 交易员 操作类型 买入券面(万)/@买入净价/买入到期(%) / 卖出券面(万)/@卖出净价/卖出到期(%) / 冰山券面(万) 有效时间 清算类型

16:37:50 chenly 新增 1000@99.0000/0.2383 1000@100.0000/-0.0123 —
23:20:00 全撤清算

16:38:07 chenly 撤销 1000@99.0000/0.2383 1000@100.0000/-0.0123 —
23:20:00 全撤清算

6.1.6 做市点击成交确认

用户登录 CIBMTS 客户端，可在【活跃券报价】，或【单券】界面查看做市报价行情，进行点击成交确认。

6.1.6.1 活跃券报价行情

点击“--公开报价--活跃券报价”菜单路径，打开【活跃券报价】界面，可以查看市场当日活跃券的做市报价行情

活跃券报价												
报价方式		X-Bond		清算速度		全部		+0		+1		代码/名称
深度	代码	名称	待偿期	报买机构	报买量(万)	报买价(%)	报卖价(%)	报卖量(万)	报卖机构	评级	最新	
☆	1889108	18中营1C	1.56Y	中信银行	50000	-	-	50000	中信银行	-		
☆	100018	10付息国...	21.05Y	建设银行	5000	4.0655	4.0891	60000	中信银行	-		
				建设银行	5000	4.0655	4.0891	60000	中信银行	-		
				中信银行	60000	4.0962	4.0583	5000	建设银行	-		
☆	100019	10付息国...	1.06Y	中信银行	2000	4.3886	4.2900	5000	中信银行	-		

(1) 双击确认

对于有交易意向的活跃券，可以点击  按钮查看当前债券的所有深度行情，双击浅灰色区域，可打开【点击成交确认】iQuote

点击成交报价确认

卖出

有效时间 23:20

10付息国债18

100018

本方*

建设银行

对手方机构

中信银行

净价(元)

99.0700

到期收益率(%)

4.0962

剩余报价量(万元)

60000

券面总额(万元)*

60000

清算速度

结算日

结算方式

清算类型

+1

2019/06/04

券款对付

全额清算

成交

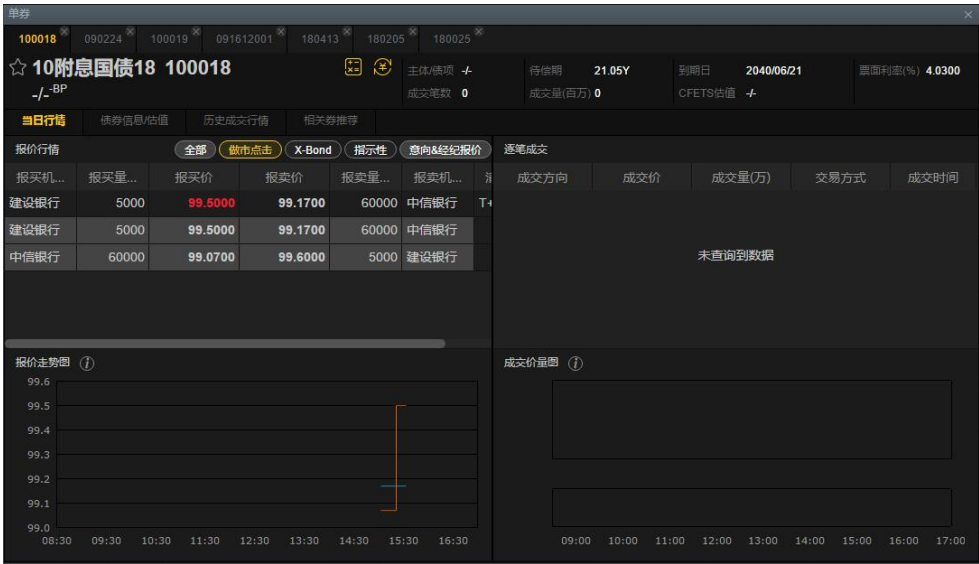
选择确认“本方”和“券面总额”后，点击按钮即可完成一笔点击成交确认。

(2) 单击扫单确认

对于有交易意向的活跃券，可以点击按钮查看当前债券的所有深度行情，单击浅灰色区域中一笔合适的价格，可打开上图扫单界面，选择“本方”、“清算类型”后点击按钮，即可以当前选中的价格对后台进行扫单，最终成交价格将优于或等于该价格，成交量不超过扫单选中的报价量。

6.1.6.2 单券当日行情

客户端界面任意“债券代码”/“债券名称”字段，双击即可打开该债券的单券行情界面。



在“当日行情”—“报价行情”中，查看当前债券的做市报价行情，双击浅灰色区域同样可以打开 iQuote，完成点击成交确认操作。

请求报价回复

卖出

请求有效时间
16:38

代码
1110001

名称
11兴业次级债

待偿期
2.07Y+5Y

估值
-/-

主体/债项
AAA/AAA

本方
建设银行

对手方机构
中信银行

对手方交易员
金春燕

对手方
中信银行(国际)有限公司

净价(元) *

到期收益率(%) *

行权收益率(%) *

券面总额(万元) *
10000

清算速度
+1

结算日
2019/06/04

回复有效时间 *
16:38

结算方式
券款对付

清算类型
全额清算

拒绝

保存

提交

6.1.6.3 做市机构报价

【做市机构报价】界面，可以查看市场当日做市报价行情

做市机构报价

培训机构141

代码/名称

报价方式

全部

做市点击

指示性

清算速度

全部

+0

+1

	笔数	代码	名称	待偿期	报买机构	报买量(万)	报买价	报买价(%)	报卖价	报卖价(%)	报卖量
☆		1805331	18西藏债...	1.39Y	培训机构...	9000	90.0000	11.8195	90.0000	11.8195	9
☆		1805332	18西藏债...	3.39Y	培训机构...	9000	90.0000	7.2294	90.0000	7.2294	9
☆		160026	16附息国...	46.48Y	培训机构...	5000	105.0000	3.2699	105.0000	3.2699	9
☆		1580267	15蒙金隆...	2.49Y	培训机构...	90000	-	-	90.0000	-	9

对于有交易意向的债券，可以点击按钮查看当前债券的所有深度行情，双击浅灰色区域，可打开【点击成交确认】iQuote

点击成交报价确认

×

卖出

有效时间 16:30

18西藏债02

1805331

本方*

中国银行

Q

对手方机构

培训机构141

净价(元)

90.0000

到期收益率(%)

11.8195

剩余报价量(万元)

9000

券面总额(万元)*

9000

清算速度

+1

结算日

2020/05/30

结算方式

券款对付

清算类型

全额清算

成交

6.1.6.4 优选报价

点击“--公开报价--优选报价”菜单路径，打开【优选报价】界面，可以查看部分做市商优质做市报价行情。其中，角标标识该笔报价为全市场最优价。

优选报价																
报价方式 做市点击 X-Bond 清算速度 全部 +0 +1 代码/名称															+RFQ报价	
	深度	代码	名称	待偿期	报价机构	报买量(万)	报买价	报卖价	报卖量(万)	报卖机构	评级	最新价	价差	清算速度	CFETS估值	
☆	≡	147523	18山东13	1.86Y	中信证券	3000	102.0000	102.0000	3000	中信证券	-	-	0.0000 T+1	-	-	
☆	≡	102100076	21宁德国...	2.20Y+2Y	中信证券	3000	50.0000	50.0000	3000	中信证券	AA	100.0000	0.0000 T+1	-	-	
☆	≡	101658002	16宣化化...	79D+7.94Y...	汉口银行	5000	100.0000	99.0000	4000	抚顺银行	A	-	-1.0000 T+1	-	-	
					汉口银行	5000	100.0000	99.0000	4000	抚顺银行	A	-	T+1	-	-	
					抚顺银行	4000	99.0000	100.0000	5000	汉口银行	A	-	T+1	-	-	
☆	≡	120006	12附息国...	10.47Y	兴业银行	3000	119.0852	119.0852	3000	兴业银行	-	100.0000	0.0000 T+1	-	-	
☆	≡	2000002	20抗疫国...	5.62Y	国泰君安证...	10000	100.0600	99.2000	3000	南京银行	-	100.0600	-0.8600 T+1	-	-	
☆	≡	1780153	17常德鼎...	2.71Y	平安银行	798000	60.0000	66.0000	80000	平安银行	AA	38.0000	6.0000 T+1	-	-	
☆	≡	1705423	17湖北债...	347D	东方证券	5000	100.0000	100.0000	5000	东方证券	-	45.0000	0.0000 T+1	-	-	
☆	≡	140217	14国开17	7.67Y	中信证券	79000	80.0001	99.9998	80000	中信证券	-	107.0000	19.9997 T+1	-	-	
☆	≡	147677	18青岛05	1.82Y	-	-	-	80.0000	2000	中信证券	-	104.0000	-T+1	-	-	
☆	≡	157821	19陕西18	7.72Y	招商银行	10000	90.0000	68.0000	90000	平安银行	-	90.0000	-22.0000 T+1	-	-	
☆	≡	200217	20国开17	1.60Y	-	-	-	99.2000	3000	南京银行	-	100.0000	-T+1	-	-	
☆	≡	170404	17农发04	2.18Y	平安银行	80000	80.0000	82.0000	60000	平安银行	-	-	2.0000 T+1	-	-	
☆	≡	1382025	13中能建...	1.21Y	国泰君安证...	10000	100.6600	99.9995	80000	平安银行	AAA	-	-0.6605 T+1	-	-	

(1) 双击确认

对于有交易意向的债券，可以点击按钮查看当前债券的所有深度行情，双击浅灰色区域，可打开【点击成交确认】iQuote。

提交

现券买卖

债券路演

×

报价方式

☐ X-Bond

☐ 做市

☒ 指示性

☐ 请求

☐ 意向

☐ 对话

发送对象

☒ 银行间

☐ 债券通

代码 *

100018

🔍

名称 *

10附息国债18

🔍

待偿期

21.05Y

估值

-/-

主体/债项

-/-

本方

中信银行

有效时间 *

23:20

清算速度

+1

结算日

2019/06/04

买卖价差(BP)

0.36

买入

券面(万元)

99.0000

净价(元) *

99.0000

卖出

券面(万元)

99.0500

净价(元) *

99.0500

到期(%) *

4.1013

到期(%) *

4.0977

⌵

保存

提交

6.1.7.2 管理指示性报价

报价发送成功后，点击“-我的做市-做市报价”菜单路径，可打开【我的做市-指示性报价】界面，查看已经发出的指示性报价，或对指示性报价进行修改和撤销操作。

做市报价

做市报价 指示性报价

+ 新指示性报价 导入 下载模板

状态 全部 已发送 待发送 冻结 发送对象 全部 银行间 债券通 新发关键期限 新上市债券 我的报价 我的关注券 代码/名称

状态	代码	名称	待偿期	状...	发送..	有效	买入券面..	买入净价	买入到期.	卖出到期.	卖出净价	卖出券面..
已发送	100019	10附息国债19	1.06Y	已发送	银行间	23:20	60000	95.0000	8.4602	8.4392	95.0200	60000
已发送	100018	10附息国债18	21.05Y	已发送	银行间	23:20		99.0000	4.1013	4.0977	99.0500	

冻结 撤销 提交

序号	描述
序号	描述
1	下载模板按钮
2	导入按钮
3	冻结按钮
4	拒绝按钮
5	提交按钮

1. 提供批量提交指示性报价功能。可点击【下载模板】按钮，在导出模板中填写指示性报价数据，点击【导入】按钮导入指示性报价后，批量提交。

2. 对于状态为“已发送”的指示性报价，可以选中单笔/多笔报价，点击【撤销】按钮撤销指示性报价；或点击【冻结】按钮冻结指示性报价。

3. 对于状态为“已发送”的指示性报价，可以双击“已发送”报价记录打开 iQuote，点击【冻结】按钮冻结一笔指示性报价；或点击【撤销】按钮终止指示性报价；或修改部分指示性报

价要素后，点击【提交】按钮更新报价

4.或在“指示性报价”Tab，直接修改“到期”/“净价”/“券面”字段，点击【提交】按钮进行快捷提交。

做市报价

做市报价

指示性报价

+ 新指示性报价

导入

下载模板

状态

全部

已发送

待发送

冻结

发送对象

全部

银行间

债券通

☐ 新发关键期限

☐ 新上市债券

☐ 我的报价

☐ 我的关注券

代码/名称

Q

Y

C

☒	代码	名称	待偿期	状...	发送..	有效	买入券面..	买入净价	买入到期	卖出到期	卖出净价	卖出券面..
☒	100019	10附息国债19	1.05Y	已发送	银行间	23:20	5000	99.0500	4.3417	4.3219	99.0700	5000
☒	100018	10附息国债18	21.05Y	已发送	银行间	23:20	30000	99.0000	4.1013	4.1006	99.0100	30000

取消

提交

6.1.7.3 历史指示性报价查询

请求报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-做市报价查询】界面，查看历史的指示性报价。

报价信息查询-债券市场

询价查询

订单查询

做市报价查询

代理查询

报价方式

全部

指示性报价

请求回复

做市报价

成交状态

全部

成交

未成交

代码/名称

Q

日期

2019/06/05

~

2019/06/05

Y

C

导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	净价	到期(%)	券面(万)	净价	到期(%)	券面(万)	报价方式	报价
190605010410000...	2019/06/05 16:41...	1805199	18广东债24	未成交	99.0000	3.9703	1,000	100.0000	3.7072	1,000	指示性报价	指示

总1笔, 0.2亿元(买入0.1/卖出0.1)

K < 1 / 1 > X 共1条

点击任意一笔指示性报价，可以查看报价详情。

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询

报价方式 全部 指示性报价 请求回复 做市报价 成交状态 全部 成交 未成交

代码名称 日期 2019/06/05 - 2019/06/05 导出

报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	净价
190605010410000...	2019/06/05 16:41...	1805199	18广东债24	未成交	99.00

最后更新时间 2019/06/05 16:41:56 报价编号 190605010410000001

报价时间	2019/06/05 16:40:46	报价截止时间	2019/06/05 23:20:00
代码	1805199	名称	18广东债24
报价状态	撤销	报价方式	指示性报价
报价类型	指示性	清算速度	T+1
本方	中国银行	本方交易员	chenly
债券类型	地方政府债	评级	-/AAA
待偿期	4.20Y	报价来源	客户端
发送对象	银行间	债券币种	CNY

方向	买入	净价	99.0000
到期(%)	3.9703	券面(万)	1,000
结算日	2019/06/06		

方向	卖出	净价	100.0000
到期(%)	3.7072	券面(万)	1,000

总1笔, 0.2亿元(买入0.1/卖出0.1) K < 1 / 1 > 共1条

6.1.8 X-Bond 订单

6.1.8.1 X-Bond 提交

任意身份下具有“现券买卖-匿名交易”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧



按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“X-Bond”，选择订单类型，

填写各报价要素后，点击

提交

按钮，即可发送一笔订单：

现券买卖
债券路演

报价方式
☒ X-Bond
☐ 做市
☐ 指示性
☐ 请求
☐ 意向
☐ 对话

订单类型
☒ 限价
☐ 弹性
☐ 市转撤
☐ 市转限

买入
卖出
双边

本方 *
中信银行

代码 *
100018

名称 *
10附息国债18

待偿期
21.05Y

估值
-/-

主体/债项
-/-

报价类型
连续报价

清算速度
+1

结算日
2019/06/04

净价(元) *
99.0000

到期收益率(%) *
4.1013

参考券面总额(手)
x1000万

券面总额(手) *
5
x1000万

重置
保存
提交

注：市转撤和市转限订单，只有在市场上有反方向可成交量时才可提交；限价和弹性订单无此限制

对于具有资管或代理身份的交易员，可提交 Post-Allocation 的订单，提交该类订单时，本方字段不展示。Post-Allocation 订单成交后需要在规定时间内在“交易分仓”面板对拟交易产品账户进行分仓。（弹性订单、市转撤、市转限均可提交分仓订单）。

限价-单边-填入-分仓

现券买卖

发行路演

报价方式

☒ X-Bond
 ☐ 做市
 ☐ 指示性
 ☐ 请求
 ☐ 意向
 ☐ 对话

订单类型

☒ 限价
 ☐ 弹性
 ☐ 市转撤
 ☐ 市转限

是否分仓

☒ 是
 ☐ 否

买入

卖出

双边

* 注：Post-allocation即以资管或代理人身份达成交易，成交后请于规定时间内在“分仓管理”对拟交易产品账户进行分仓

代码

171717

名称

17国开10

待偿期

100Y+1234D

估值

196.1234 / 4.1234%

主体 / 债项

AAA / AAA+

报价类型

连续报价

清算速度

+1

结算日

2018/10/11

净价(元)

97.1717

到期收益率(%)

4.1712

参考券面总额(手)

×1000万

券面总额(手)

4

×1000万

应计利息

890,000.00 元

全价

942,229.51 元

交易金额

52,229.51 元

应计利息总额

890,000.00 元

结算金额

34,890,000.00 元

批量导入

重置

保存

提交

6.1.8.2 订单管理

订单发送成功后，点击“--我的交易--我的订单”菜单路径，可打开【我的订单】界面，查看已经发出的订单，或对订单进行修改和撤销操作。

我的订单

+新订单

导入

下载模板

全部

限价

弹性

市转限

OCO

If Done

全部

买入

卖出

代码/名称

Q

Y

☒	状态	类型	代码	名称	债券类型	待偿期	方向	报价类型	清算速度	剩余券面(万元)
☒	有效	限价	100018	10附息国债18	国债	21.05Y	买入	连续报价	+1	5000
☒	有效	限价	100018	10附息国债18	国债	21.05Y	买入	连续报价	+1	3000

总2 笔记录

一键冻结

冻结

撤销

激活

设置OCO

设置If Done

序号	描述
1	一键冻结
2	冻结
3	撤销
4	设置 OCO
5	设置 IF Done

1. 对于状态为“有效”的订单，可以双击订单记录打开 iQuote，修改部分订单要素后，点击【提交】按钮更新订单；或点击【保存】按钮，保存当前订单数据，暂不提交。

现券买卖

债券路演

报价方式

X-Bond

做市

指示性

请求

意向

对话

订单类型

限价

弹性

市转撤

市转限

买入

卖出

本方 *

中信银行

代码 *

100018

名称 *

10附息国债18

待偿期

21.05Y

估值

-/-

主体/债项

-/-

报价类型

连续报价

清算速度

+1

结算日

2019/06/04

净价(元) *

99.0000

到期收益率(%) *

4.1013

券面总额(手) *

5

x1000万

保存

提交

2、设置 OCO 交易策略

在【我的订单】界面，勾选需要进行 OCO 交易策略设置的多笔订单（仅报价类型为连续报价的限价订单支持），点击【设置 OCO】按钮进行设置；

3、设置 If Done 交易策略

在【我的订单】界面，勾选需要进行 If Done 交易策略设置的 2 笔订单（仅报价类型为连续报价的限价订单支持），点击【设置 IF Done】按钮进行设置；

可通过  按钮调整交易策略中优先交易订单的顺序。

设置If Done

本方 中信银行

If Done编号

	订单编号	代码	名称	方向	清算速度	净价(元)	到期(%)	券面(万元)
1	1906030501000000005	100018	10附息国债 18	买入	+1	99.0000	4.1013	5000
1								
2	1906030501000000006	100018	10附息国债 18	买入	+1	98.0000	4.1736	3000

重置

保存

提交

6.1.8.3 post-alloc 分仓

X-bond 需要分仓的订单成交意向后，可在“--我的交易--交易分仓”菜单路径下，查看成交意向信息，分仓方可在分仓有效时间内进行分仓操作。

若交易双方都是需分仓的订单撮合达成成交意向，则交易双方都进行分仓操作后，系统自动根据双方的分配量达成成交

交易分仓

状态

全部待本方分仓待对手方分仓已分仓

本方方向全部买入卖出

交易方式全部RFQX-Bond

渠道全部银行间债券通

日期

2019/08/302019/08/30

代码/名称

Q

本方交易员

Q

对手方

Q

对手方交易员

Q

成交意向编号	成交意向时间	状态	有效时间	代码	名称	本方方向	本方	本方交易员	对手方	
CBT201908309000031	2019/08/30 14:46:07	待本方分仓	17:00:00	110252	11国开52	买入	—	郝莫淘	4	
CBT201908309000022	2019/08/30 14:29:15	待对手方分仓	16:49:15	140009	14附息国债09	卖出	中信证券	文啦啦	—	
CBT201908309000023	2019/08/30 14:29:15	待对手方分仓	16:49:15	140009	14附息国债09	卖出	中信证券	文啦啦	—	
CBT201908309000004	2019/08/30 10:19:35	待本方分仓	14:19:35	1620022	16长沙银行二级	卖出	—	郝莫淘	农业银行	
CBT201908309000003	2019/08/30 10:12:16	已分仓	14:12:16	110252	11国开52	卖出	5	郝莫淘	3	
CBT201908309000002	2019/08/30 09:56:56	待本方分仓	13:56:56	160312	16进出12	买入	—	文啦啦	阳光资管	
CBT201908309000001	2019/08/30 09:47:41	待本方分仓	13:47:41	180001	18附息国债01	买入	—	文啦啦	阳光资管	

1

</

点击“待本方分仓”的成交意向记录，打开分仓界面：

分仓管理

券面总额(万元)

10000

产品	分配券面(万元)

+

添加

合计(万元)

取消

提交

在分仓界面选择分配的产品以及填写对应分配量，点击提交，若分仓成功则状态变为“已分仓”。

6.1.8.4 历史订单查询

请求报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-订单查询】界面，查看历史的 X-bond 订单。



报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询

报价类型: 全部 集中报价 连续报价 成交状态: 全部 成交 未成交 代码名称: 订单日期: 2019/06/05 ~ 2019/06/05 导出

订单编号	最后更新时间	代码	名称	订单类型	报价类型	方向	本方	本方交易员	净价(元)	券面(万)	成交量(万)
190605050100000...	2019/06/05 16:30...	190001	19附息国债01	限价	连续报价	买入	中国银行	chenly	100.0000	10,000	

1 / 1 共1条

6.1.9 X-Bond 点击成交

任意身份下具有“现券买卖-匿名交易”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，可在【X-bond 报价】、【活跃券报价】，或【单券】界面查看 X-Bond 连续报价行情，进行点击成交。

6.1.9.1 X-bond 报价行情

具有“现券买卖-匿名交易”权限的用户可点击“--公开报价--X-bond 报价”菜单路径，打开【X-bond 报价】行情界面，选择“连续报价”Tab 页，可以查看市场当日的连续报价订单行情



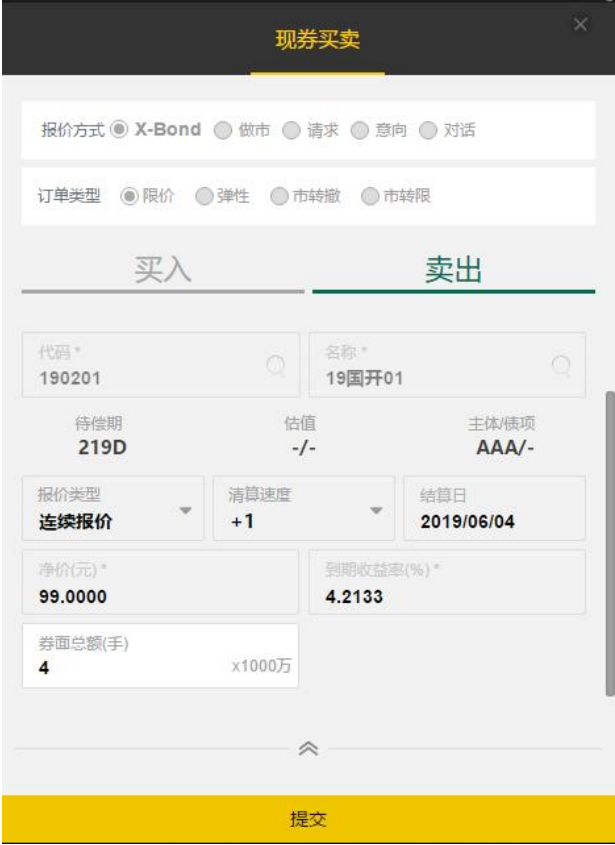
X-Bond报价

连续报价 集中报价

代码名称: 报买到期(%) 报卖到期(%) 清算速度: 全部 +0 +1 其他: 全部 我的关注券 活跃券 新订单 一键冻结

深度	待偿期	代码	名称	清算速度	报买量(万)	报买净价(元)	报买到期(%)	报卖到期(%)	报卖净价(元)	报卖量(万)	最
☆ 三	159D	180216	18国开16	+1	15000	99.9997	2.5823	4.6570	99.1063	5000	1
☆ 三	162D	180410	18农发10	+1	5000	99.9827	2.6019	4.6010	99.1060	8000	1
☆ 三	6.44Y	180411	18农发11	+1	-	-	-	4.1574	99.1061	5000	1
☆ 三	9.60Y	190205	19国开05	+1	92000	98.9000	3.6158	3.6032	99.0000	284000	1
☆ 三	219D	190201	19国开01	+1	3000	99.8000	2.8514	2.1785	100.2000	7000	1
					3000	99.8000	2.8514	2.1785	100.2000	7000	
					1000	99.0000	4.2133	-	-	-	
☆ 三	225D	190301	19进出01	+1	1000	99.0000	4.0324	3.8576	99.1047	10000	1

对于有交易意向的债券，可以点击按钮查看当前债券的所有深度行情，双击净价/到期/报价量字段，可打开 iQuote，确认“券面总额”后点击按钮进行成交。



现券买卖

报价方式: ☒ X-Bond ☐ 做市 ☐ 请求 ☐ 意向 ☐ 对话

订单类型: ☒ 限价 ☐ 弹性 ☐ 市转撤 ☐ 市转限

买入 卖出

代码: 190201 名称: 19国开01

待偿期: 219D 估值: -/- 主体/债项: AAA/-

报价类型: 连续报价 清算速度: +1 结算日: 2019/06/04

净价(元): 99.0000 到期收益率(%): 4.2133

券面总额(手): 4 x1000万

提交

6.1.9.2 活跃券报价行情

点击“--公开报价--活跃券报价”菜单路径，打开【活跃券报价】界面，具有“现券买卖-匿名交易”权限的用户可以查看市场当日活跃券的 X-Bond 订单行情

活跃券报价											
报价方式: ☒ 做市点击 ☒ X-Bond 清算速度: ☒ 全部 ☐ +0 ☐ +1 代码/名称:											
深度	代码	名称	待偿期	报买机构	报买量(万)	报买价(%)	报卖价(%)	报卖量(万)	报卖机构	评级	最新
☆ 	199916	19贴现国	49D	X-Bond	254000	3.3628	3.2859	296000	X-Bond	BBB+	
				X-Bond	254000	3.3628	3.2859	296000	X-Bond	BBB+	
				X-Bond	3000	5.7549	-	-	-	BBB+	

(1) 双击确认

对于有交易意向的活跃券，可以点击按钮查看当前债券的所有深度行情，双击浅

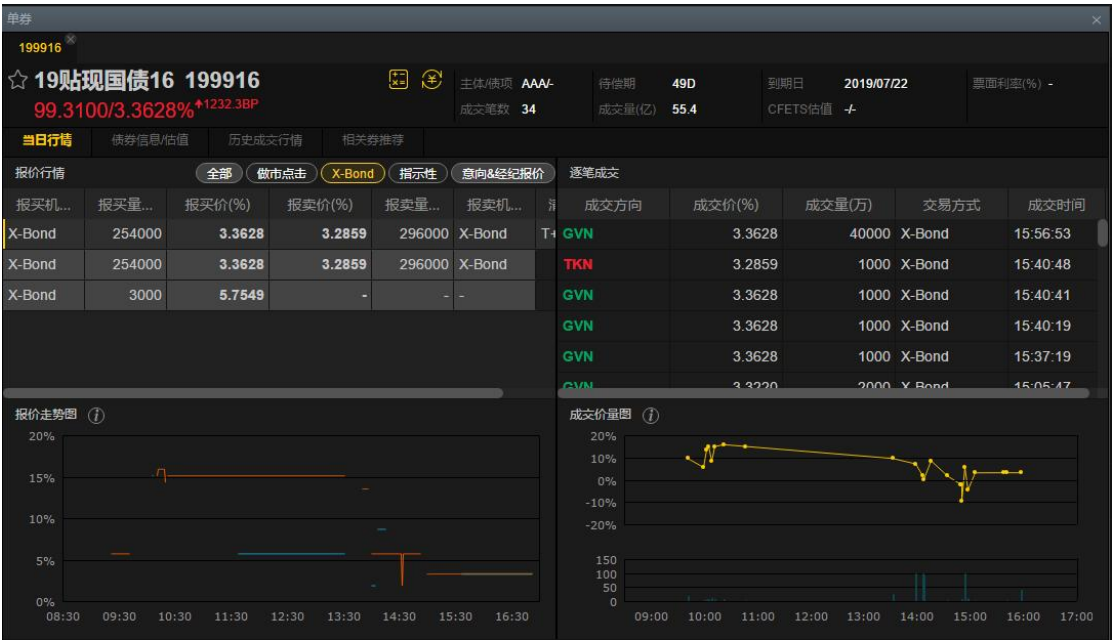
灰色区域，同样可打开【X-bond】iQuote 进行成交确认

(2) 单击扫单确认

对于有交易意向的活跃券，可以点击  按钮查看当前债券的所有深度行情，单击浅灰色区域中一笔合适的价格，可打开上图扫单界面，选择“本方”、“清算类型”后点击  按钮，即可以当前选中的价格对后台进行扫单，最终成交价格将优于或等于该价格。

6.1.9.3 单券当日行情

客户端界面任意“债券代码”/“债券名称”字段，双击即可打开该债券的单券行情界面。



在“当日行情”—“报价行情”中，具有“现券买卖-匿名交易”权限的用户可查看当前债券的 X-Bond 行情，双击浅灰色区域同样可以打开 iQuote，完成点击成交操作。

6.4.9.4 优选报价

点击“--公开报价--优选报价”菜单路径，打开【优选报价】界面，具有“现券买卖-匿名交易”权限的用户可以查看市场当日部分优质做市商使用债券的 X-Bond 订单行情。其中，角标标识该笔报价为全市场最优价。

优选报价															
报价方式 （做市点选） X-Bond 清算速度 全部 +0 +1 代码名称 Q Y +RFQ报价															
深度	代码	名称	待偿期	报买机构	报买量(万)	报买价	报卖价	报卖量(万)	报卖机构	评级	最新价	价差	清算速度	CFETS估值	
☆	147523	18山东13	1.86Y	X-Bond	4000	102.0000	102.0000	3000	中信证券	-	-	0.0000 T+1	-	-	
				X-Bond	4000	102.0000	102.0000	3000	中信证券	-	-	T+1	-	-	
				中信证券	3000	102.0000	-	-	-	-	-	T+1	-	-	
				X-Bond	4000	101.0000	-	-	-	-	-	T+1	-	-	
				X-Bond	8000	100.0000	-	-	-	-	-	T+1	-	-	
☆	102100076	21宁德国...	2.20Y+2Y	中信证券	3000	50.0000	50.0000	3000	中信证券	AA	100.0000	0.0000 T+1	-	-	
☆	101658002	16宣化化...	79D+7.94Y...	汉口银行	5000	100.0000	99.0000	4000	抚顺银行	A	-	-1.0000 T+1	-	-	
☆	140217	14国开17	7.67Y	X-Bond	9000	107.0000	99.9998	80000	中信证券	-	107.0000	-7.0002 T+1	-	-	
☆	100040	10附息国...	19.10Y	X-Bond	8000	100.0000	99.9995	80000	平安银行	-	100.0000	-0.0005 T+1	-	-	
☆	120006	12附息国...	10.47Y	兴业银行	3000	119.0852	119.0852	3000	兴业银行	-	100.0000	0.0000 T+1	-	-	
☆	160417	16农发17	1.47Y	X-Bond	8000	100.0000	99.2000	3000	南京银行	-	-	-0.8000 T+1	-	-	
☆	160210	16国开10	4.42Y	X-Bond	8000	100.0000	99.9995	80000	平安银行	-	-	-0.0005 T+1	-	-	
☆	150023	15附息国...	3.95Y	X-Bond	8000	100.0000	99.9995	80000	平安银行	-	-	-0.0005 T+1	-	-	
☆	150021	15附息国...	13.88Y	X-Bond	8000	100.0000	99.9995	80000	平安银行	-	-	-0.0005 T+1	-	-	
☆	150010	15附息国...	43.56Y	X-Bond	8000	100.0000	99.9995	80000	平安银行	-	100.0000	-0.0005 T+1	-	-	

（1）双击确认

对于有交易意向的活跃券，可以点击按钮查看当前债券的所有深度行情，双击浅灰色区域，同样可打开【X-bond】iQuote 进行成交确认

债券市场 货币市场 衍生品市场 一级市场

现券买卖 债券借贷 债券路演 预发行 南向通

报价方式 ☒ X-Bond ☐ 做市 ☐ 指示性 ☐ 请求 ☐ 意向 ☐ 对话 ☐ X-Auction

订单类型 ☒ 限价 ☐ 弹性 ☐ 市转撤 ☐ 市转限

是否分仓 ☐ 是 ☒ 否

买入 卖出

本方* 国泰君安证券

代码* 147523 名称* 18山东13

待偿期 1.86Y 估值 -/- 主体/债项 -/AAA

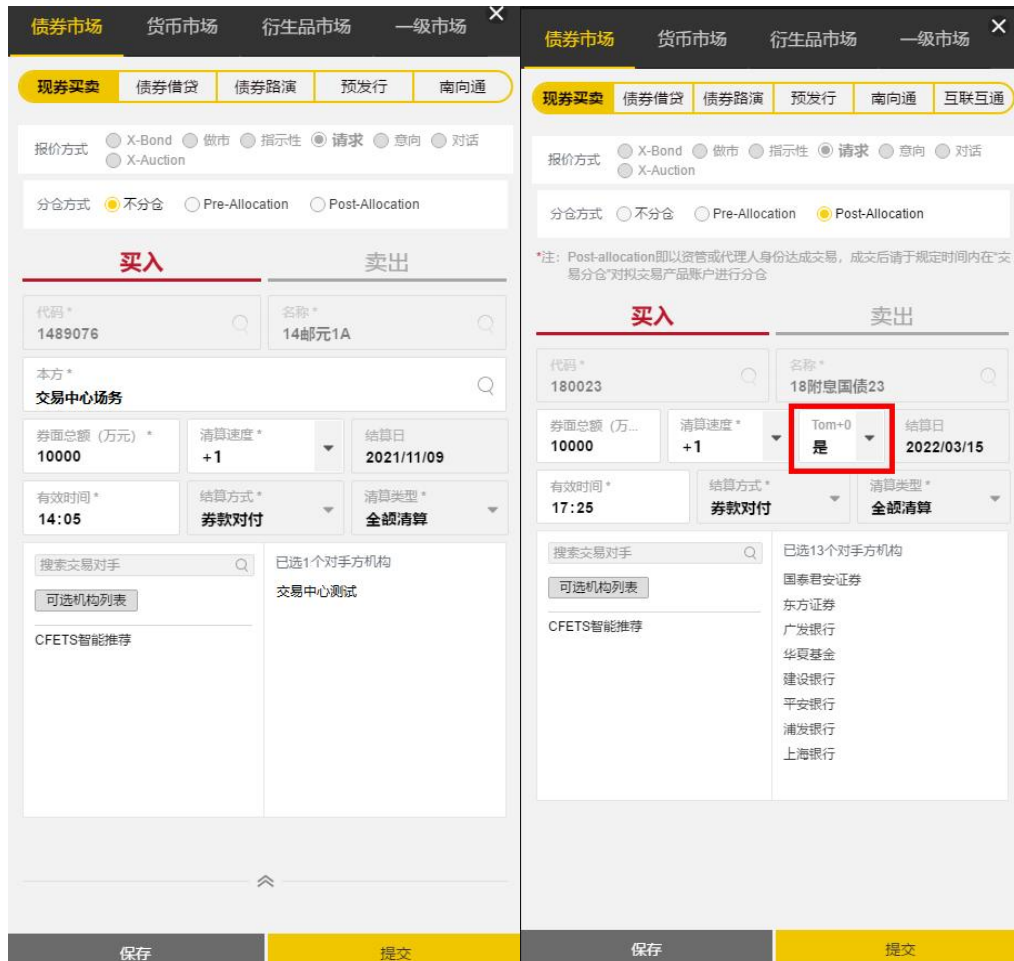
报价类型 连续报价 清算速度 +1 结算日 2021/11/04

净价(元)* 102.0000 到期收益率(%)* 2.7064

券面总额(手)* 4 x1000万

提交

(2) 点击按钮  或者对于有交易意向的活跃券点击  按钮，可以打开【我要报价】页面，发起请求报价。当分仓方式选择 Post-Allocation 时，Tom+0 可选择是或否，当选择是时，支持 Tom+0 交易。



6.1.10X-Bargain 询价

6.1.10.1 提交 X-Bargain 询价

机构用户登录 CIBMTS 客户端，可在“--公开报价--综合报价”菜单路径下，打开【意向报价】界面：

现券买卖-综合报价

最优报价意向报价经纪报价

☐ 具名☐ 推荐

报价意向导入

	方向	交易员/报价机构	代码	名称	到期%	报价量(万)	热度	待偿期	债券类型	主体/债
☆	买入	(B)	090030	09附息国债30	14.63	1000000		39.30Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	090020	09附息国债20	35.18	1000000		9.04Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	090005	09附息国债05	32.44	6000000		18.66Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	080209	08国开09	26.96	1000000		7.83Y	政策性金	AAA+
☆	买入	(B)	080020	08国债20	24.22	2000000		18.20Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	080006	08国债06	21.48	5000000		17.74Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	070006	07国债06	18.74	12000000		16.76Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	0700007	07特别国债07	17.37	6000000		2.33Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	0700004	07特别国债04	14.63	4000000		18.14Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	060211	06国开11	10.52	3000000		321D	政策性金	AAA+
☆	买入	(B)	100026	10附息国债26	31.07	2000000		20.01Y	国债	-/-
☆	买入	(B)	060019	06国债19	7.78	1000000		1.26Y	国债	-/-

点击按钮，打开 X-Bargain 询价界面，填写本方信息中各报价要素后，点击

提交

按钮，即可发送一笔 X-Bargain 询价。

X-Bargain询价

X-Bargain10附息国债26交易分金

第1轮等待中

1轮次

卖出本方方向

优最优报价

14:28倒计时

热度2

对手方信息

报到期(%)

券面(万元)

状态

操作中

待出价

对手方

等待中

本方

本方信息匿名询价提交成功

报到期(%)

底到期(%)

费用(厘)

券面(万元)

一口价

寻找做市商

AON

撤销

提交

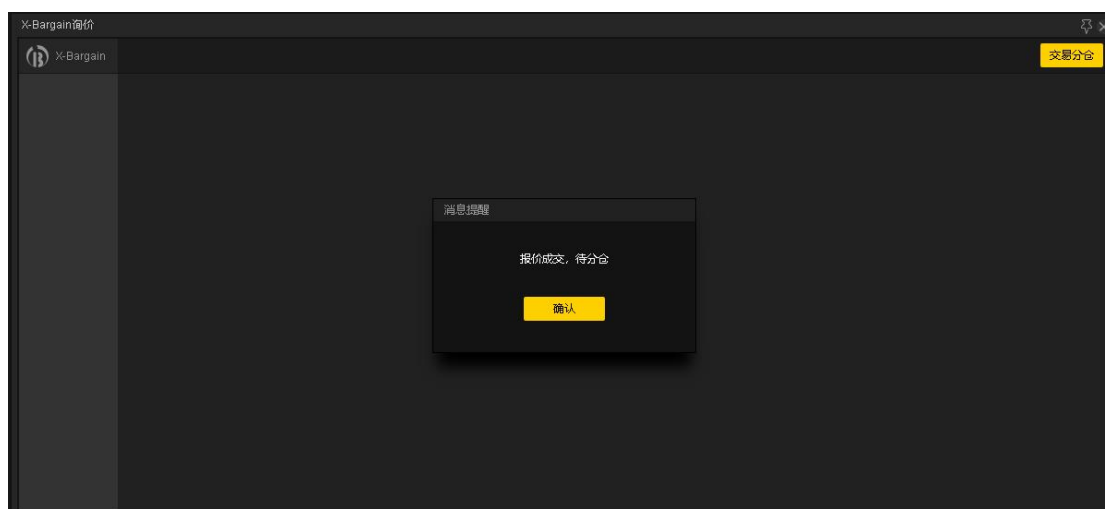
轮次	本方到期/行权(%)	本方到期/行权(%)	对手方到期/行权(%)	本方净价(元)	本方净价(元)	对手方净价(元)	本方券面(万元)	对手方券面(万元)
查询内容不存在								

双方都提交询价后，价格与券面未匹配成功则进入下一轮询价；三轮询价结束仍未匹配成交则协商失败，报价结束。



直接成交：

双方询价匹配成功，则达成成交意向。可在“我的交易”菜单下点击交易分仓或直接点击 X-Bargain 询价界面 **交易分仓** 进入分仓界面，进行交易分仓操作，交易双方分仓完成后生成成交单。



交易分仓

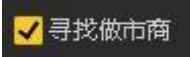
状态: 全部 待本方分仓 待对手方分仓 已分仓 本方方向: 全部 买入 卖出 交易方式: 全部 RFQ X-Bond X-Bargain X-Auction 渠道: 全部 银行间 债券通

日期: 2020/09/07 — 2020/09/07 代码/名称: Q 本方交易员: Q 对手方: Q 对手方交易员: Q

成交意向编号	成交意向时间	状态	有效时间	代码	名称	本方方向	本方	本方交易员	对手方
CBT20200907201033	2020/09/07 15:36:36	待本方分仓	16:36:36	100026	10附息国债26	买入	—	赵雯	中国银行

K < 1 / 1 > X 共1条

间接成交：

询价双方任一方在询价过程中勾选 ，询价匹配成功后状态变为“待搭桥”。

X-Bargain询价 13国开05 交易分仓

轮次: DONE 本方方向: 卖出 最优报价: 倒计时: 热度: 2

对手方信息

报 到期(%) 57.0000 ☆

券面(万元) 200 ☐ AON

状态 操作完成

本方信息

报 *到期(%) 58.9999 ☆ 一口价

底 *到期(%) 59.9999

费用(厘) 0 ☒ 寻找做市商

*券面(万元) 100 ☐ AON

100W@57.9897%

轮次	本方到期/行权(...)	本方到期/行权(...)	对手方到期/行权(%)	本方净价(元)	本方净价(...)	对手方净价(...)	本方券面(万元)	对手方券面(万元)
1	58.9999%	58.9999%	57.0000%	38.5398	37.9980	39.6575	100	200

做市商在 “--我的做市--请求回复” 菜单路径下点击进入【X-Bargain 做市】界面，对需要搭桥的报价进行确认或拒绝。确认后报价方与搭桥方达成 X-Bargain 成交意向。交易双方分仓完成后生成成交单。

做市报价-请求回复

请求回复 X-Bargain做市

代码/名称 买方机构类型 全部 卖方机构类型 全部 清算速度 全部 T+0 T+1

代码	名称	买方机构类型	卖方机构类型	费用合计(厘)	费用金额合计(元)	清算速度	结算日	买方净值
031800154	18西永PPN001	农村商业银行和...	证券公司	0	0.00	T+0	2020/09/07	102.800
130205	13国开05	城市商业银行	股份制商业银行	2	20.00	T+1	2020/09/08	39.100
147711	18甘肃05	证券公司	区内其他(国际)	8	160.00	T+1	2020/09/08	86.245
1605466	16山西债15	证券公司	财务公司	20	40000.00	T+0	2020/09/07	91.991

拒绝 确认

6.1.10.2 X-Bargain 报价管理

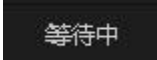
点击进入 X-Bargain 询价后，交易双方都可以在【X-Bargain 管理】界面查看询价信息

X-Bargain报价管理

方向 全部 买入 卖出 状态 全部 待出价 等待中 待搭桥 轮次 全部 1 2 3 DONE 代码/名称 清算速度 全部 T+0 T+1

状态	轮次	代码	名称	热度	方向	本方到期/行权(%)	本方到期/行权(%)	对手方到期/行权(%)	本方
待出价	1	1209002	12浦发次级债		卖出	-	-	-	-
待出价	1	1180022	11晋文转债		卖出	-	-	-	-
等待中	1	147664	18四川09		卖出	19.0000%	20.0000%	-	8
待搭桥	DONE	1180017	11横店债		卖出	11.0001%	11.0001%	11.0001%	9

对于状态：表示对方已出价，本方未出价；表示双方都未出价；

表示本方已出价，对方未出价；表示待做市商搭桥。

双击任意报价，跳转至 X-Bargain 询价界面

6.1.10.3 X-Bargain 活跃券成交行情

6.1.10.3.1 活跃券逐笔行情

用户点击“--成交行情—活跃券成交”菜单路径，打开【活跃券成交】界面，选择“逐

笔成交” TAB，查看逐笔成交行情数据，通过筛选交易方式查询不同债券的逐笔行情。

活跃券成交

成交汇总

逐笔成交

交易方式

全部

X-Bond

做市点击

RFQ

对话报价

X-Bargain

代码	名称	成交价	成交量(万)	成交方向	交易...	待偿期	评级	成交时间
180014	18附息国债114	69.2986	20000	TRD	X-Bargain	313D	AAA	10:55:52

6.1.10.3.2 活跃券汇总行情

用户点击“--成交行情--活跃券成交”菜单路径，打开【活跃券成交】界面，选择“成交汇总” TAB，查看成交汇总行情数据，通过筛选交易方式查询不同债券的汇总行情。

活跃券成交

成交汇总

逐笔成交

交易方式

汇总

X-Bond

做市点击

RFQ

对话报价

X-Bargain

	代码	名称	最新价	涨跌	笔数	成交量(亿)	开盘价	最高价	最低价	加权价	前收结
☆	180014	18附息国债114	69.2986	-	1	2	69.2986	69.2986	69.2986	69.2986	

6.1.11 发行路演

6.1.11.1 发布发行路演

(1) 具有债券路演权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“债券市场”，选择债券路演，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送：

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

现券买卖

债券路演

债券名称 **

发行人 **

Q

** 债券名称和发行人 至少有一项必填

债券币种 *

企业性质

主体评级

CNY

债券类型*

利率区间(%)

计划发行量(亿元)

期限 *

单位 *

M

发行日(开始) *

发行日(结束)

缴款日

上市日

报价截止日 *

备注 (全市场可见)

保存

提交

(2) 提供批量提交债券路演功能。可点击  按钮，在模板中填写报价数据
点击  按钮导入报价后，选中校验通过的报价，批量提交。

我的报价

现券买卖 债券路演

导入 下载模板

本方状态 全部 债券名称 发行人 发行日 报价截止日 期限 M M

债券名称	债券类型	发行人	主体评级	企业性质	发行日	本方状态	债券币种	期限	计划发行量(亿)	利率区间(%)	报价截止
123	企业债	北京首钢股份有...	AAA	地方国企	2019/07/09-2019/07/12	已发送	CNY	5Y	10	5	2019/07/1
123	短期融...	北京居然之家投...	AA+	民营	2019/07/09-2019/07/12	已发送	CNY	2Y	3	5	2019/07/1
123	资产支...	福建省宁德市20...	-	-	2019/05/29-2019/06/28	待发送	CNY	3Y	2	4	2019/05/2

撤销 提交

债券路演导入

共2笔报价校验成功，1笔报价校验失败；具体提示信息可在对应红色框处或红色感叹号处查看

导入

债券名称*	发行人*	债券类型*	债券币种*	主体评级	企业性质	期限*	发行日（开...）	发行日（结...）	计划发行量...
农业	ldd0302建的机...	企业债	USD	AAA-	外资企业	12D	2019/07/26		
农业	ldd0302建的机...	企业债	USD	AAA-	外资企业	13D	2019/07/26		
农业	ldd0302建的机...	企业债	USD	AAA-	外资企业	23M	2019/07/26		

删除 提交

6.1.11.2 发行路演管理

报价发送成功后，可在“--债券市场-我的交易--我的报价”菜单路径下，

- 1) 打开【我的报价】的“信用债”Tab 页，查看已经发出的路演信息，或对路演信息进行修改和撤销操作；

我的报价

现券买卖 债券路演

本方状态 全部 债券名称 发行人 发行日 报价截止日 期限

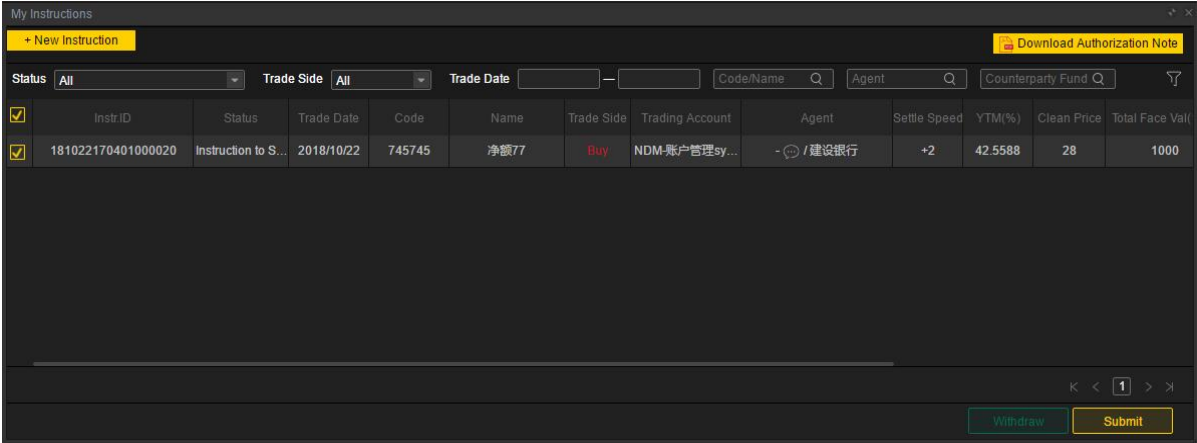
债券名称	债券类型	发行人	主体评级	企业性质	发行日	本方状态	债券币种	期限	计划发行量(亿)
	企业债	北京首钢股份有...	AAA	地方国企	2019/06/05	已发送	CNY	3Y	8

撤销 提交

6.1.12 委托指令

6.1.12.1 提交委托指令

境外机构用户登录 CIBMTS 客户端，可在“--我的交易—我的委托”菜单路径下，打开【My Instructions】界面：



点击  按钮，打开委托指令界面，填写各报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔委托指令。

CASH BOND

Buy
Sell

Code*
199903

Name*
19贴现国债03

Issuer Coupon Maturity Date*
中华人民共和国财政部 99.444 2023/06/11

ISIN
CND10001WSQ9

TTM
4.02Y

Valuation
-

Issuer Rating/Bond Rating
-/-

Trading Account*
China Construction Bank Corporation HongKong Branch

Counterparty
BOC

Counterparty Trader
chenly

Agent
CCB

Trade Date*
2019/06/05

Settle Speed*
+0

Settle Date
2019/06/05

Clean Price(Yuan)*
100.0000

YTM(%)*
-0.0122

Total Face Value(10K Yuan)*
10000

Settle Type*
DVP

SAVE
SUBMIT

6.1.12.2 管理委托指令

委托指令发出后，委托方可在【My Instructions】界面查看委托指令。

+ New Instruction
Download Authorization Note

Status: **All**
Trade Side: **All**
Trade Date: **2019/06/05**
Code/Name:
Agent:
Counterparty Fund:

	Instr.ID	Status	Initiator/Issuer	Quote Method	Trade Date	Instruction Create Date	Code	Name
☒	190605170402011646	Instruction to Confirm	中华人民共和国财政部	Instruction	2019/06/05	2019/06/05	199903	19贴现国债03
☐	190605160402011645	Pre-filled Instruction to Confirm	Dongguan Rural Credit Union	Pre-filled Instruction	2019/06/05	2019/06/05	1921001	19东莞农商

Withdraw / Reject
Submit / Confirm

➤ 对于状态为“Instructiontoconfirm”的委托指令，可以选中单笔/多笔委托指令，点击 Withdraw / Reject 按钮撤销委托指令；或双击委托指令记录可以打开 iQuote，可以点击

WITHDRAW

按钮进行撤销；

➤ 对于状态为“Instructiontoconfirm”的委托指令，双击打开 iQuote 后，也可以修改交易日，净价，券面金额等要素，修改后点击 **SUBMIT**，可提交修改。

CASH BOND

Buy

Sell

Code*
199903

Name*
19贴现国债03

Issuer Coupon Maturity Date*
中华人民共和国财政部 99.444 2023/06/11

ISIN
CND10001WSQ9

TTM
4.02Y

Valuation
-

Issuer Rating/Bond Rating
-/-

Trading Account*
China Construction Bank Corporation HongKong Branch

Counterparty
BOC

Counterparty Trader
chenly

Agent
CCB

Trade Date *
2019/06/05

Settle Speed *
+0

Settle Date
2019/06/05

Clean Price(Yuan) *
100.0000

YTM(%) *
-0.0122

Total Face Value(10K Yuan) *
10000

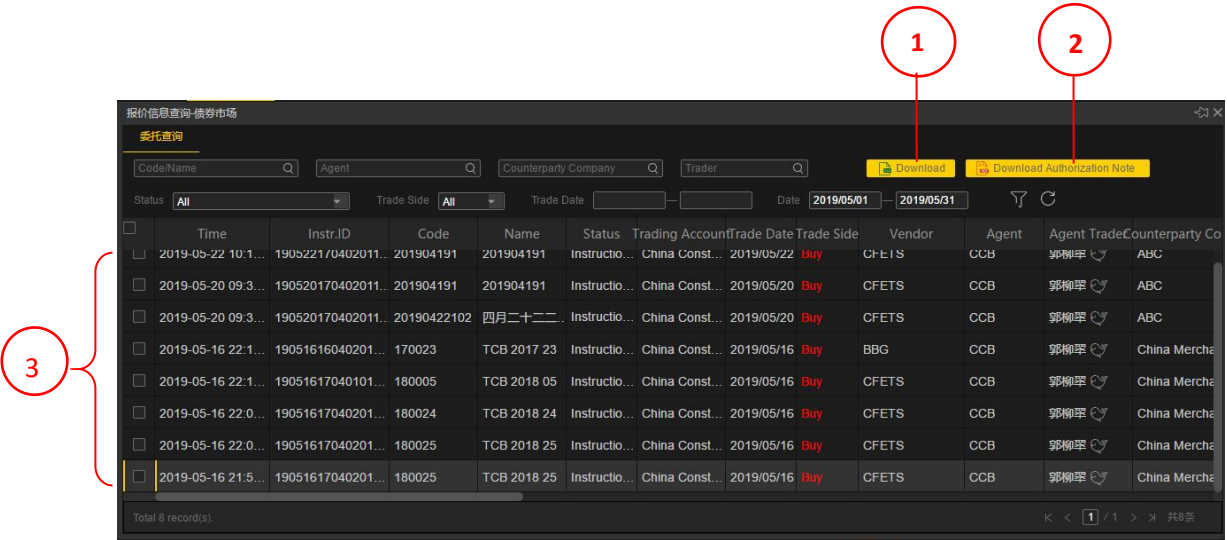
Settle Type *
DVP

WITHDRAW

SUBMIT

6.1.12.3 历史委托查询

委托方可查看历史委托信息，可在“--信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-委托查询】界面，查看历史委托信息，如下图所示：



序号	描述
1	Download 按钮，选中 download 按钮，导出所有查询记录
2	Download Authorization Note，点击” Download Authorization Npte”，下载选中记录的委托单
3	勾选框，勾选需要下载的委托单

6.1.13 委托指令确认

代理行用户登录 CIBMTS 客户端，可在“—我的交易—我的代理”菜单路径下，打开【我的代理】界面：



- 对于状态为“委托待确认”的委托指令，可以选中单笔/多笔指令，点击按钮拒绝指令；
- 在【我的代理】界面双击该笔指令，可以打开 iQuote，点击按钮确认委托；点击按钮拒绝委托。

指令委托确认

买入

美元外币债

369369

代偿期

2.6Y

估值

97.1234

评级

AAA/AA-

发行人 票面 到期日

Bank of China|10|2022/02/10

ISIN

123456

对手方

爱建信托

对手方交易员

刘伟

委托方

NDM-账户管理syj产品

委托方交易员

交易日

2018/10/22

清算速度

+2

结算日

2018/10/24

净价(元)

36

到期收益率(%)

50.08

结算币种

汇率*

6.258565

应计利息(*)

0.56452

券面总额(万元)

1000

清算类型

全额清算

结算方式

见券付款

备注

拒绝

确认

代理行确认委托后，委托指令状态变为“委托转对话”，由代理方新增一笔对应的对话报价，发送给交易对手方。委托转对话生成的对话报价，可以代理方的我的报价界面中查看。

我的报价

债券路演

导入

下载模板

本方向

全部

买入

卖出

本方状态

全部

待发送

已发送

待成交

新发关键期限

代码/名称

对手方

对手方交易员

请求有效

回复有效

回复量(万)

清算速度

到期(%)

净价

本方向

代码

名称

本方状态

报价类型

本方

对手方

对手方交易员

请求有效

回复有效

回复量(万)

清算速度

到期(%)

净价

买入

199903

19贴现国债03

已发送

对话

建行香港

中国银行

chenly

中国...

-

-

-

+0

-0.0122

100.0000

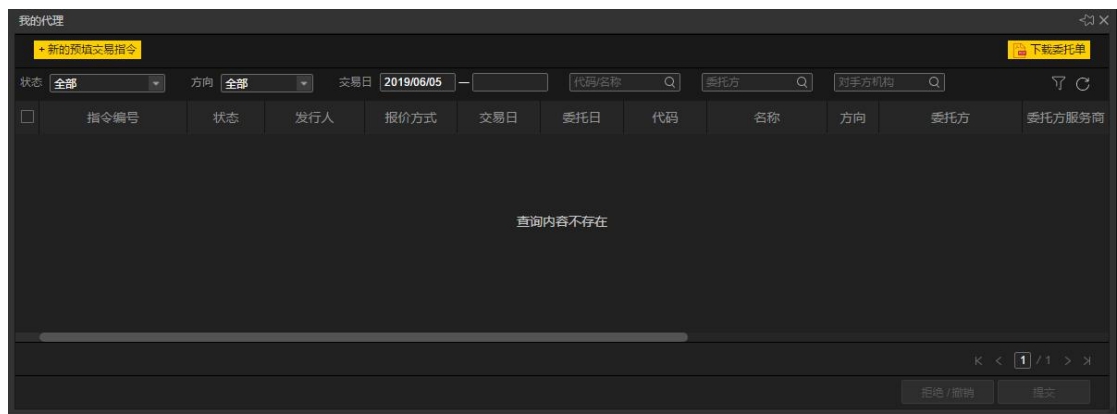
撤销

拒绝

提交

成交

代理行在【我的报价】界面双击对话报价记录，可打开 iQuote 查看对话报价。



点击 **+ 新的预填交易指令**，打开新增预填指令界面，填写完整交易要素后，点击 **提交** 按钮，即可新增预填指令。

预填指令

买入
卖出

代码 *
1921001

ISIN
CND10001X7D7

待偿期
2.64Y

代理方 *
建设银行

对手方 *
中国银行

委托方 *
建行香港

交易日 *
2019/06/05

净价(元) *
99.5000

券面总额(万元) *
1000

清算类型 *
全额清算

名称 *
19东莞农商绿色金融01

估值
-

主体 / 债项
AAA/AAA

对手方交易员 *
chenly

委托方交易员 *
王筠豪委托方

清算速度 *
+0

到期收益率(%) *
3.6966

结算方式 *
券款对付

结算日
2019/06/05

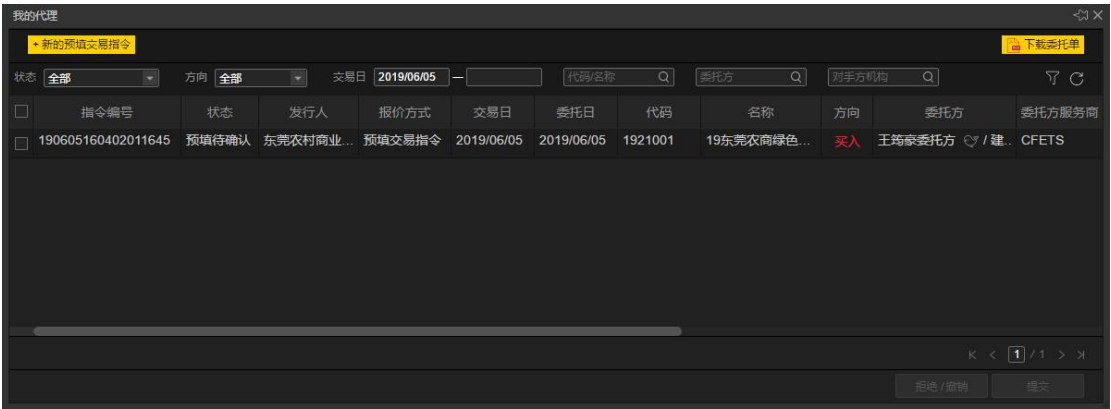
委托方服务商 *
CFETS

保存

提交

6.1.14.2 管理预填指令

预填指令发出后，代理方可在【我的代理】界面查看预填指令。



- 对于状态为“预填待确认”的预填指令，可以选中单笔/多笔指令，点击 **拒绝/撤销** 按钮撤销预填指令；双击预填指令记录可以打开 iQuote，点击 **撤销** 按钮进行撤销；
- 对于状态为“预填待确认”的预填指令，双击记录打开 iQuote 后，可以修改交易日、对手方、净价、券面金额等要素，修改要素后点击 **提交** 按钮，可提交修改。

预填指令

买入

卖出

代码*

1921001

名称*

19东莞农商绿色金融01

ISIN

CND10001X7D7

待偿期

2.64Y

估值

-

主体/债项

AAA/AAA

代理方*

建设银行

对手方*

中国银行

对手方交易员*

chenly

委托方*

建行香港

委托方交易员*

王筠豪委托方

交易日*

2019/06/05

清算速度*

+0

结算日

2019/06/05

净价(元)*

99.5000

到期收益率(%)*

3.6966

券面总额(万元)*

1000

结算方式*

券款对付

清算类型*

全额清算

委托方服务商*

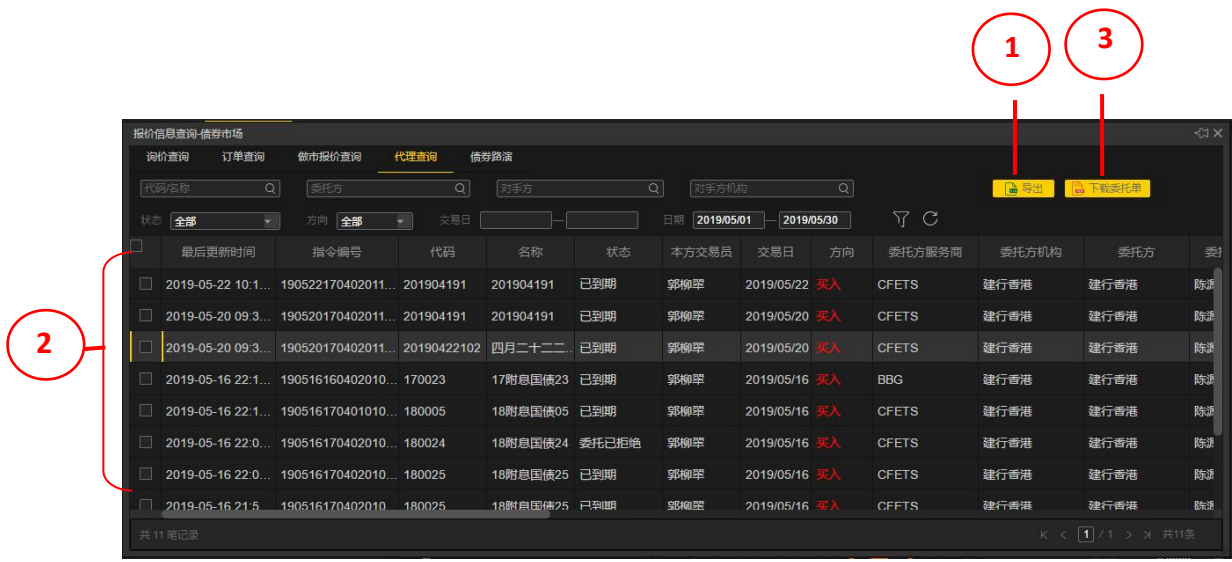
CFETS

撤销

提交

6.1.14.3 历史代理查询

代理方可查看历史代理信息，可在“--信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-代理查询】界面，查看历史代理信息。



序号	描述
1	导出按钮，导出所有的查询结果
2	勾选框，勾选记录的委托单
3	下载委托单按钮，下载选中记录的委托单

6.1.15 预填指令确认

境外机构用户登录 CIBMTS 客户端，可在“--我的交易—我的委托”菜单路径下，打开【My Instructions】界面：

My Instructions

+ New Instruction Download Authorization Note

Status: All Trade Side: All Trade Date: 2019/06/05 Code/Name: Agent: Counterparty Fund: Q T C

Instr.ID	Status	Initiator/Issuer	Quote Method	Trade Date	Instruction Create Date	Code	Name	Trade Side	Trading Account
190605160402011645	Pre-filled In...	Dongguan Rural...	Pre-filled Instr...	2019/06/05	2019/06/05	1921001	19东莞农商绿...	Buy	China Constructi...

Withdraw / Reject Submit / Confirm

➤ 对于状态为“Pre-filled instruction toconfirm”的预填指令，可以选中单笔/多笔指令，点击 **Withdraw / Reject** 按钮拒绝指令，或点击 **Submit / Confirm** 确认指令；

➤ 或在【MyInstruction】界面双击该笔指令，点击 **Confirm** 按钮确认预填指令；也可点击 **Reject** 按钮来拒绝预填指令。

Pre-filled Instruction

Buy

Code: 1921001 Name: 19东莞农商绿色金融01

ISIN: CND10001X7D7

TTM: 2.64Y Valuation: - Issuer Rating / Bond Rating: AAA/AAA

Trading Account: China Construction Bank Corporation HongKong Brar

Counterparty: BOC Counterparty Trader: chenly

Agent: CCB Agent Trader: chenxi

Trade Date: 2019/06/05 Settle Speed: +0 Settle Date: 2019/06/05

Clean Price(Yuan): 99.5000 YTM(%): 3.6966

Total Face Value(10K Yuan): 1000 Settle Type: DVP

Clearing Type: CCB Vendor: CCB

Reject Confirm

预填指令确认后，将成为一笔状态为“委托待确认”的指令。待代理方确认或系统自动确认后，预填指令状态变为“委托转对话”。并由代理方发送一笔相应的对话报价至对手方。

6.1.16 成交查询

6.1.16.1 当日成交

可在“--我的交易--当日成交”菜单路径下，打开【当日成交-现券买卖】界面，查看当日成交信息。通过对方向、做市类型、交易方式、是否利差交易、X-Bond 搭桥、渠道等输入项的选择，查看对应的当日成交信息。双击选中的成交记录，可查看对应成交单。



6.1.16.2 成交查询

可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-现券买卖-成交明细】界面，查看历史的成交信息。点击可导出当前查询界面的成交信息，点击可下载。双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。

成交查询										
现券买卖-成交明细										
南向通-成交明细 上市前交易意向 债券借贷-成交明细 预发行-成交明细										
交易方式 全部 对话报价 RFQ 点击成交 X-Bond X-Bargain X-Auction 本方方向 全部 买入 卖出 代码/名称 日期 2021/11/02 导出 下载成交单										
☐	成交编号	代码	名称	本方方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	对手方代理机构	本方	本方交易
☐	CBT20211102200001	170025	17附息国债25	卖出	中银香港资管-bc	中银香港资管..	Terry Ngai	—	工商银行	乔浦发
截图										
总1笔(买入0/卖出1), 0.6亿元(买入0/卖出0.6)										

预览

现券买卖成交单

成交日期 2021/11/02

成交编号 CBT20211102200001

买方 中银香港资产管理有限公司-bc 债券代码 170025 债券名称 17附息国债25 结算日 2021/11/03 结算方式 券款对付		卖方 中国工商银行股份有限公司 净价(元/百) 104.1353 到期收益率(%) 3.0600 券面总额(万) 6,000 结算金额(元) 62,487,511.49	
全价(元/百)	104.1459	应计利息(元/百)	0.01055
交易金额(元)	62,481,180.00	应计利息总额(元)	6,331.49

买方信息

机构	中银香港资产管理有限公司-bc
法定代表人/地址	-/-
交易员/电话	Terry Ngai/58563524
资金账户户名	HONG KONG MONETARY AUTHORITY CMU
资金开户行	Bank of China (Hong Kong) Ltd (Renminbi Clearing Centre)
资金账号/支付系统行号	01287560124067/BKCHHKHH838
托管账户户名	香港金融管理局CMU
托管账号/托管机构	00000025334/国债登记结算公司

卖方信息

机构	中国工商银行股份有限公司
法定代表人/地址	周现金. 法法全部/上海黄浦区外滩1988号
交易员/电话	dwjdjejfjjifeief
资金账户户名	乔浦发/1234123
资金开户行	中国工商银行股份有限公司
资金账号/支付系统行号	0101000111400010077/ICBKCNCJXXX
托管账户户名	中国工商银行股份有限公司
托管账号/托管机构	A0001000001/国债登记结算公司

6.1.17 成交行情

6.1.17.1 汇总成交行情

可在“--成交行情—综合成交”菜单路径下，打开【现券买卖成交汇总】界面，查看汇总成交行情数据。根据选择“交易方式”可切换查看对应行情信息。

现券买卖-综合成交

成交汇总

逐笔成交

交易方式

汇总

X-Bond做市点击RFQ对话报价X-Bargain

代码/名称

	代码	名称	最新价(%)	涨跌(BP)	笔数	成交量(亿)	开盘
☆	180210	18国开10	4.8859	9.1094▲	4	0.4	
☆	170010	17附息国债10	2.0000	-	2	0.4	
☆	190210	19国开10	1.4856	13.4318▼	3	0.5	
☆	020005	02国债05	2.9000	5.6226▲	29	3	:
☆	180024	18附息国债24	3.0696	-	3	2.7	
☆	190011	19附息国债11	1.4211	0.515▼	2	2	
☆	2021	债券中文简称00	7.0454	-	2	2.8	
☆	0721201917	自动终止072117	0.6221	6.4028▼	22	18.9	
☆	102001870	20连云港MTN001	5.0827	0.8256▼	26	27.4	
☆	160216	16国开16	4.9043	19.5952▲	2	15.1	
☆	200017	20附息国债17	7.4884	-	1	15	
☆	088041	08铁道02	4.5926	-	1	10	

6.1.17.2 逐笔成交行情

可在“--成交行情—综合成交”菜单路径下，打开【现券买卖逐笔成交】界面，查看逐笔成交行情数据。根据选择“交易方式”可切换查看对应行情信息。

现券买卖-综合成交								
成交汇总		逐笔成交						
交易方式		全部	X-Bond	做市点击	RFQ	对话报价	X-Bargain	X-Auction
代码	名称	成交价(%)	成交量(万)	成交方	交易方式	待偿期	评级	债
180210	18国开10	4.8859	1000	GVN	做市点击	6.67Y	-	C
170010	17付息国债10	2.0000	3000	GVN	RFQ	5.50Y	-	C
180210	18国开10	2.0000	1000	TRD	对话报价	6.67Y	-	C
190210	19国开10	1.4856	1000	TRD	对话报价	7.55Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C
020005	02国债05	2.9000	1000	GVN	X-Bond	10.56Y	-	C

6.2 匿名拍卖

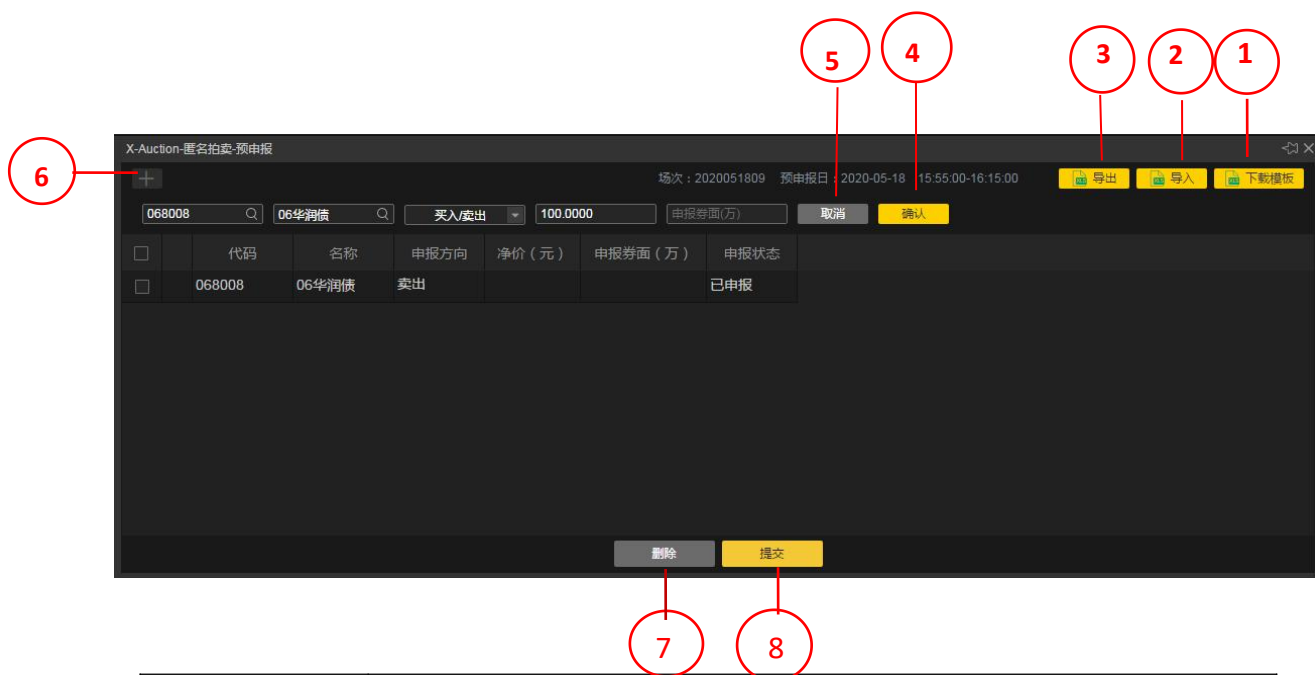
6.2.1 预申报

任意身份下具有“现券买卖-匿名拍卖”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，通过点击 X-Auction 默认模板，打开 X-Auction 操作页面。

点击申报页面的“预申报”按钮，打开 X-Auction-匿名拍卖-预申报页面。右上方展示当前场次、预申报日及时间段。

该页面支持批量申报导入和单笔申报导入。

- 1、批量申报导入：点击【下载模板】，填写申报必填要素后，点击【导入】把申报数据导入到该页面；
- 2、单笔申报导入：点击【+】，填写申报必填要素后，点击【确认】后添加一笔申报；若点击【取消】，则申报不提交；
- 3、通过批量/单笔申报导入后，申报状态都为“未申报”，勾选预申报记录，点击【提交】，申报状态变为“已申报”。若勾选预申报记录后点击【删除】，预申报撤销，申报记录从该页面消失。



序号	描述
1	下载模板
2	导入
3	导出
4	确认
5	取消
6	添加
7	删除
8	提交

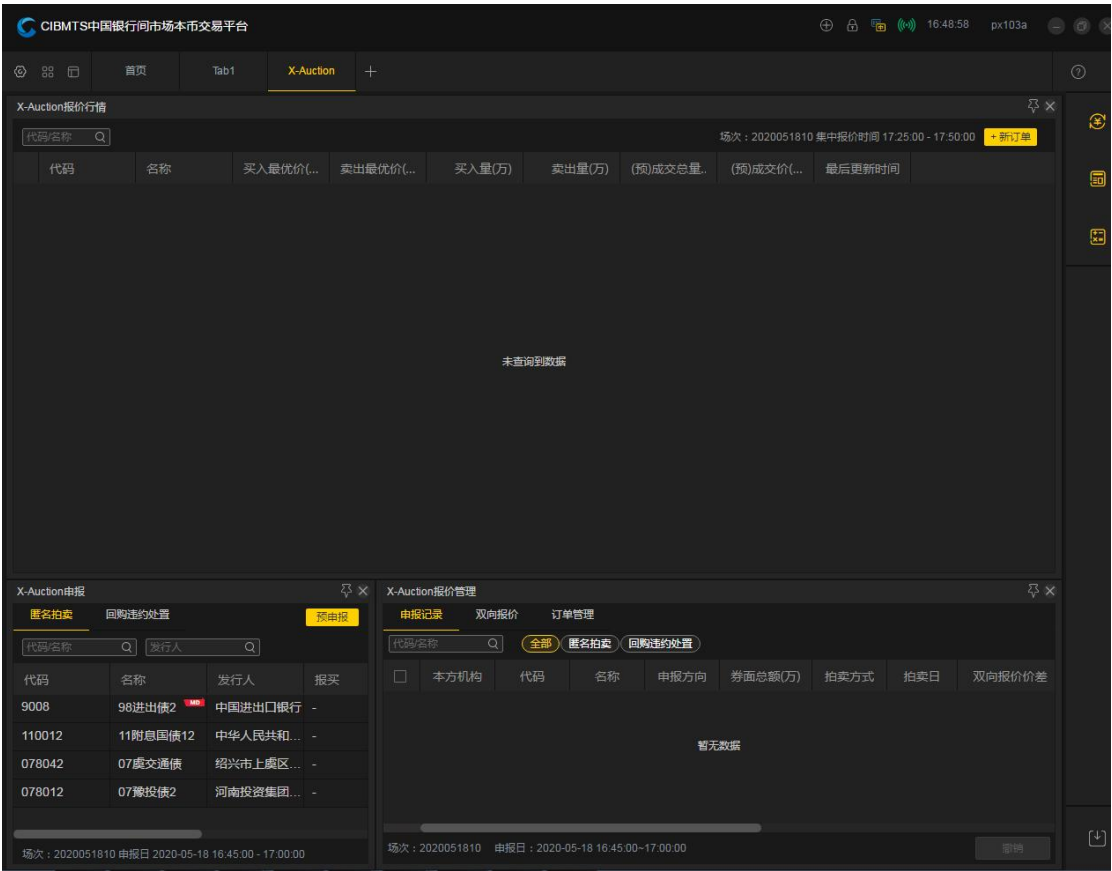
6.2.2 查看可申报债券列表

申报日，可在 X-Auction 申报界面查看可申报债券，并进行申报。

1、双击可申报债券代码、债券名称打开单券/合约界面。

2、双击可申报债券其他字段打开申报录入界面（通过 F8 或  图标也可打开申报录入界

面）。



6.2.3 报价发起

6.2.3.1 申报录入

申报日，可以对可申报债券列表内的债券进行申报。点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面选择“X-Auction”，报价类型选择“申报”，填写各类报价要素后，点击  按钮提交申报：

6.2.3.2 双向报价

拍卖日-双向报价阶段，点击右侧按钮，或通过快捷键 **F8** 打开【我要报价】界面选择“X-Auction”，报价类型选择“双向报价”，填写各类报价要素后，点击按钮，提交一笔双向报价：

债券市场 货币市场 衍生品市场

现货买卖 债券路演

报价方式 ☐ X-Bond ☐ 做市 ☐ 指示性 ☐ 请求 ☐ 意向 ☐ 对话
☒ X-Auction

报价类型 ☐ 申报 ☒ 双向报价 ☐ 订单

本方

代码* 1980030 名称* 19昆空港债

买入 卖出

净价(元)* 78 净价(元)* 89.00

最大报价价差(元)* 30.00

重置 提交

6.2.3.3 订单

拍卖日-集中报价阶段，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面选择“X-Auction”，报价类型选择“订单”

可通过以下方式打开订单录入界面：

- (1) 右侧导航栏的图标；
- (2) F8 快捷键；
- (3) 报价行情-新订单；

(4) X-Auction 报价管理-新订单;

输入完订单要素后, 点击【提交】按钮, 提交订单; 点击【保存】按钮, 保存订单至 X-Auction-报价管理-订单页面。

现券买卖 债券路演

报价方式: ☐ X-Bond ☐ 做市 ☐ 指示性 ☐ 请求 ☐ 意向 ☐ 对话 ☒ X-Auction

报价类型: ☐ 申报 ☐ 双向报价 ☒ 订单

买入 卖出

本方* 培训机构103

代码* 078042 名称* 07 债交通债

价格区间 50.00-97.00 净价(元)* 56.00

券面总额(万元)* 2000

到期(%) 38.5053 清算速度 T+1

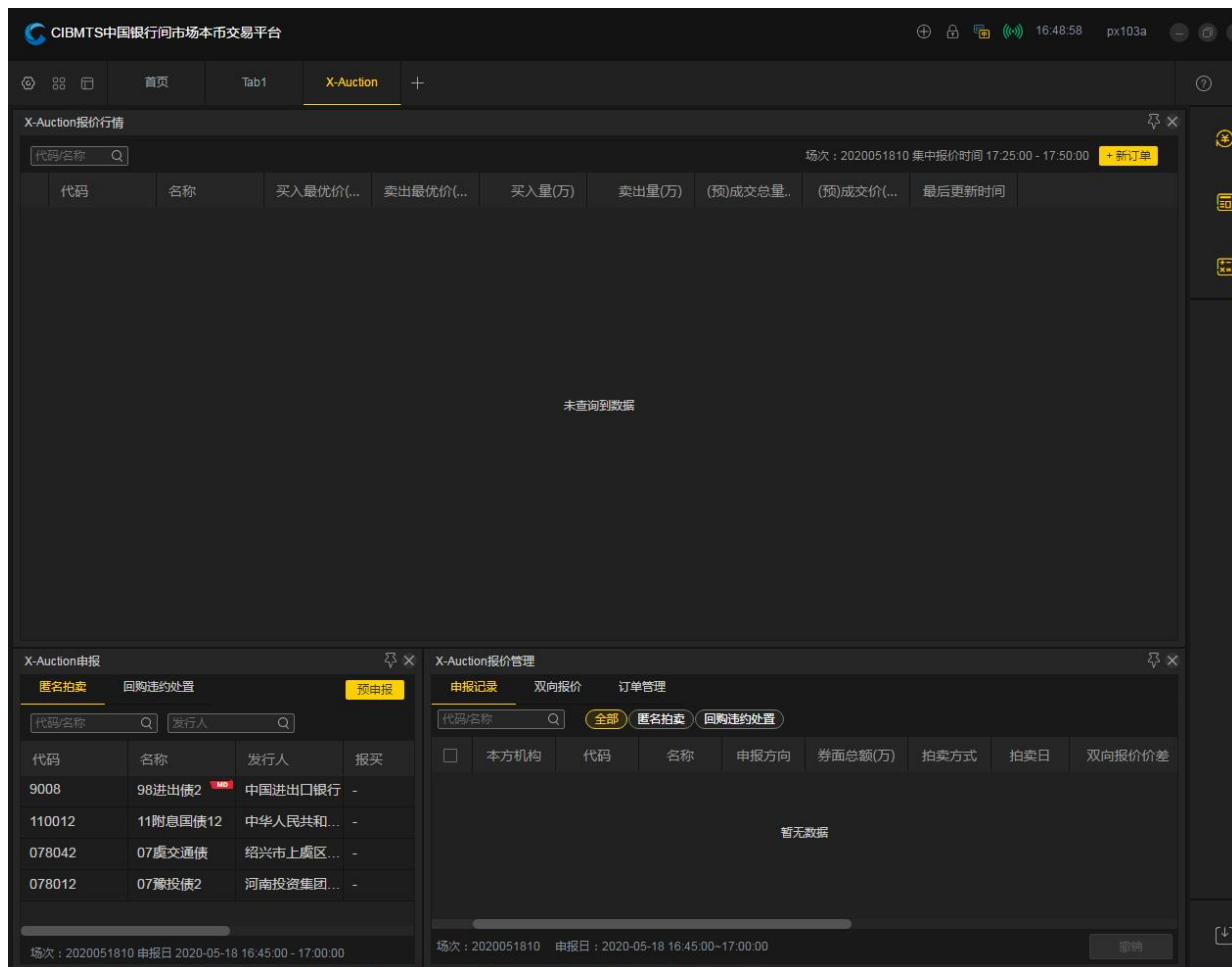
全价(元) 60.4619 应计利息 4.46189 结算日 2020/05/20

保存 提交

6.2.4 X-Auction 报价管理

6.2.4.1 申报管理

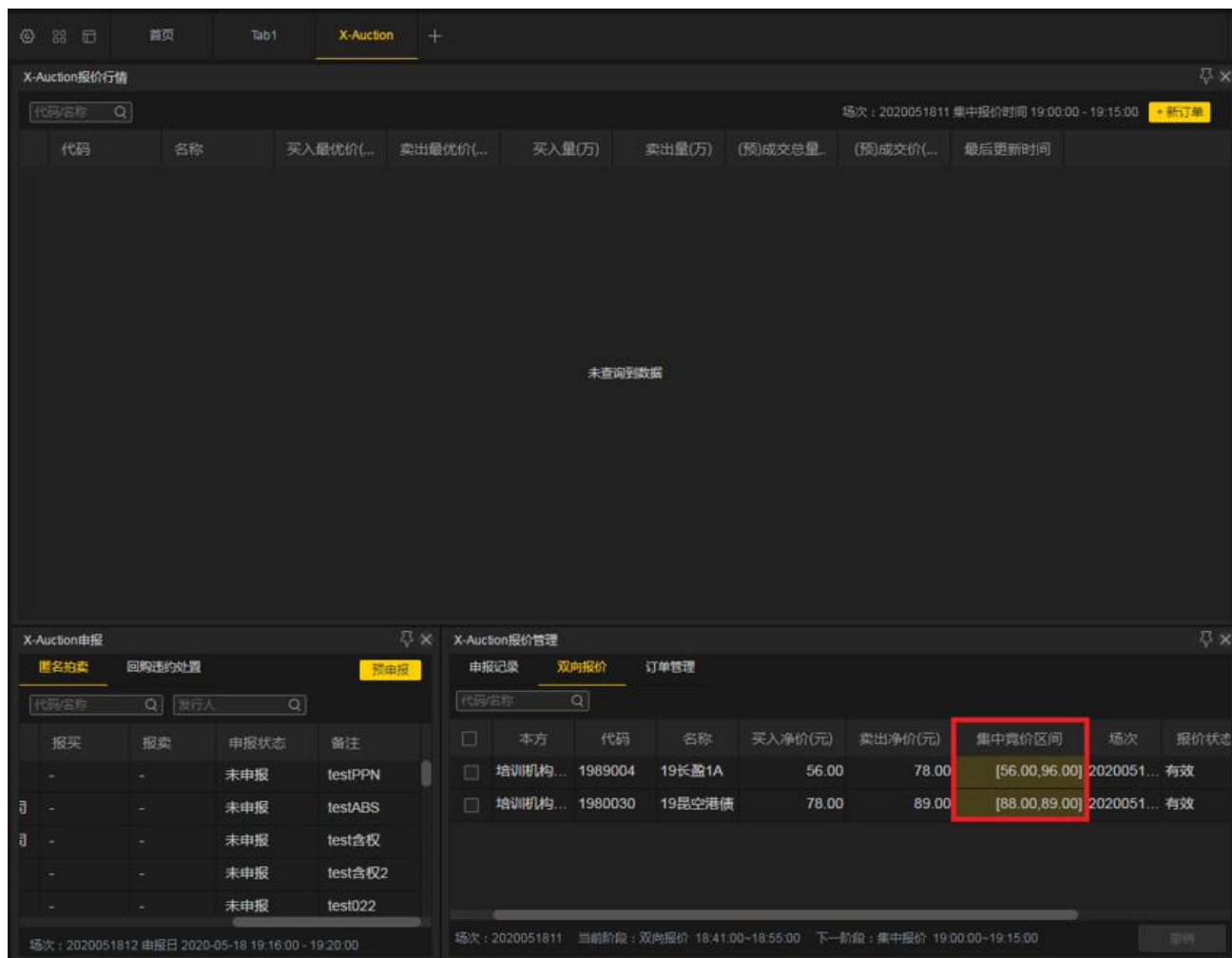
- (1) 录入申报并提交申报后, 申报记录在 X-Auction 管理-申报记录中查询。
- (2) 勾选申报后, 点击【撤销】按钮撤销申报记录。



6.2.4.2 双向报价管理

可对拍卖日-双向报价阶段的双向报价进行管理。

- (1) 提交的双向报价，在 X-Auction 管理-双向报价中查询。
- (2) 勾选双向报价记录，点击【撤销】按钮，撤销勾选的双向报价记录。



6.2.4.3 订单管理

可对拍卖日-集中报价阶段提交或保存的订单进行管理。

(1) 激活/撤销订单

- 勾选【订单状态】为冻结的订单后，点击【激活】按钮激活订单，激活后订单状态为有效。
- 勾选任意订单后，点击【撤销】按钮撤销订单，撤销后的订单不展示在该页面。

(2) 双击【代码】或【名称】，弹出单券页面；

(3) 批量订单编辑

单击可编辑字段【净价（元）】、【到期%】、【行权%】、【券面总额（万）】中任

一字段，进入页面编辑状态，右下角按钮变为【取消】和【提交】按钮，修改完可编辑字段后点击【提交】按钮，提交修改后的订单点击【取消】按钮，订单维持修改前数据。



(4) 单笔订单编辑

双击除【代码】、【名称】、【净价（元）】、【到期%】、【行权%】、【券面总额（万）】之外的任一字段，打开订单修改，修改后可点击【保存】或【提交】订单。



6.2.5 X-Auction 报价行情

- (1) 该页面展示订单的最优预匹配行情。
- (2) 点击可关注债券，债券将出现在我的关注券页面。
- (3) 双击【代码】或【名称】可打开单券页面。

X-Auction报价行情									
代码/名称		场次：2020051909 集中报价时间 13:02:00 - 13:15:00							
		+新订单							
代码	名称	买入最优价(...)	卖出最优价(...)	买入量(万)	卖出量(万)	(预)成交总量..	(预)成交价(...)	最后更新时间	
☆ 078042	07厦交通债	56.00	-	2000	-	-	-	2020/05/19 13:02:44	

6.2.6 成交行情

集中报价阶段结束后，达成的成交展示在现券买卖-综合成交-逐笔成交行情界面。【交易方式】选择 X-Auction，则页面只展示 X-Auction 的逐笔成交行情。

现券买卖-综合成交									
成交汇总		逐笔成交							
交易方式		全部	X-Bond	做市点击	RFQ	对话报价	X-Auction	代码/名称	
代码	名称	成交价(%)	成交量(万)	成交方...	交易方. ▼	待偿期	评级	债券币种	成交时间
180016	18附息国债16	5.4243	1000	DONE	X-Auction	3.17Y	AA	CNY	15:35:01
180016	18附息国债16	5.4243	1000	DONE	X-Auction	3.17Y	AA	CNY	15:35:01
180015	18附息国债15 MD	-	2000	DONE	X-Auction	102D	AA	CNY	15:35:01

选择成交汇总 tab 页，展示债券成交汇总信息。

现券买卖-综合成交

成交汇总逐笔成交

交易方式

汇总

X-Bond

做市点击

RFQ

对话报价

代码/名称

了

	代码	名称	最新价(%)	涨跌(BP)	笔数	成交量(亿)	开盘价(%)	最高价(%)	最低价(%)	加权价(%)	前
☆	078042	07虞交通债	39.6770	-	1	0.2	39.6770	39.6770	39.6770	39.6770	
☆	1080083	10攀国投债	-223.9322	-	1	0.4	-223.9322	-223.9322	-223.9322	-223.9322	
☆	1920004	19长安银行二级01	6.5391	124.07▲	1	0.1	6.5391	6.5391	6.5391	6.5391	
☆	180027	18附息国债27	3.6287	-	1	0.2	3.6287	3.6287	3.6287	3.6287	
☆	100003	10附息国债03	4.4233	23.25▲	1	0.2	4.4233	4.4233	4.4233	4.4233	
☆	100001	10附息国债01	2.3961	260.23▲	1	0.1	2.3961	2.3961	2.3961	2.3961	

6.2.7 报价信息查询

打开债券市场的报价信息查询页面，选择 X-Auction 所在的 tab 页，查看 X-Auction 的历史申报记录、历史双向报价记录、历史订单记录。

点击【成交状态】为成交的订单，查看该订单的成交概览。

报价信息查询-债券市场												
询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询 信用债 ABS路演查询 存单路演查询-发行人 存单路演查询-投资方 X-Auction												
报价类型 ☐ 申报 ☐ 双向报价 ☒ 订单 代码/名称 日期 订单编号 本方交易员 导出												
订单编号	本方	本方交易员	交易方向	代码	名称	净价(元)	全价(元)	券面总额(万元)	到期(%)	行权(%)	每百元本金(元)	剩余券面总额(万元)
180725090413000123	建设银行闵行支行...	王林	买入	170002	17农发02	—	—	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000117	建设银行闵行支行...	邵胜	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	—	—	5.68	5,000
180725090413000116	建设银行张江支行...	王德	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000113	建设银行张江支行...	李书斌	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000110	建设银行张江支行...	杨勇	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000108	建设银行张江支行...	冯念	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000106	南京银行张江支行...	何光	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000105	北京银行张江支行...	冷德	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000104	广发银行张江支行...	孙安怡	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000103	招商银行张江支行...	费德	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000102	招商银行张江支行...	蔡群	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000

6.2.8 成交查询

打开现券市场-成交查询页面，选择【交易方式】为 X-Auction 的标签，查看 X-Auction 的历史成交信息。

成交查询

现券买卖-成交明细 上市前交易意向

交易方式 全部 对话报价 RFQ 点击成交 X-Bond X-Auction 本方方向 全部 买入 卖出 代码/名称 日期 2020/05/19 ~ 2020/05/19 导出 下载成交单

☐	成交编号	代码	名称	本方方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	对手方代理机构	本方	本方交易员
☐	CBT20200519500007	078042	07虞交通债	买入	培训机构105	培训机构105	交易员105A	—	培训机构105	交易员103A
☐	CBT20200519500006	1080083	10攀国投债	卖出	培训机构105	培训机构105	交易员105A	—	培训机构105	交易员103A

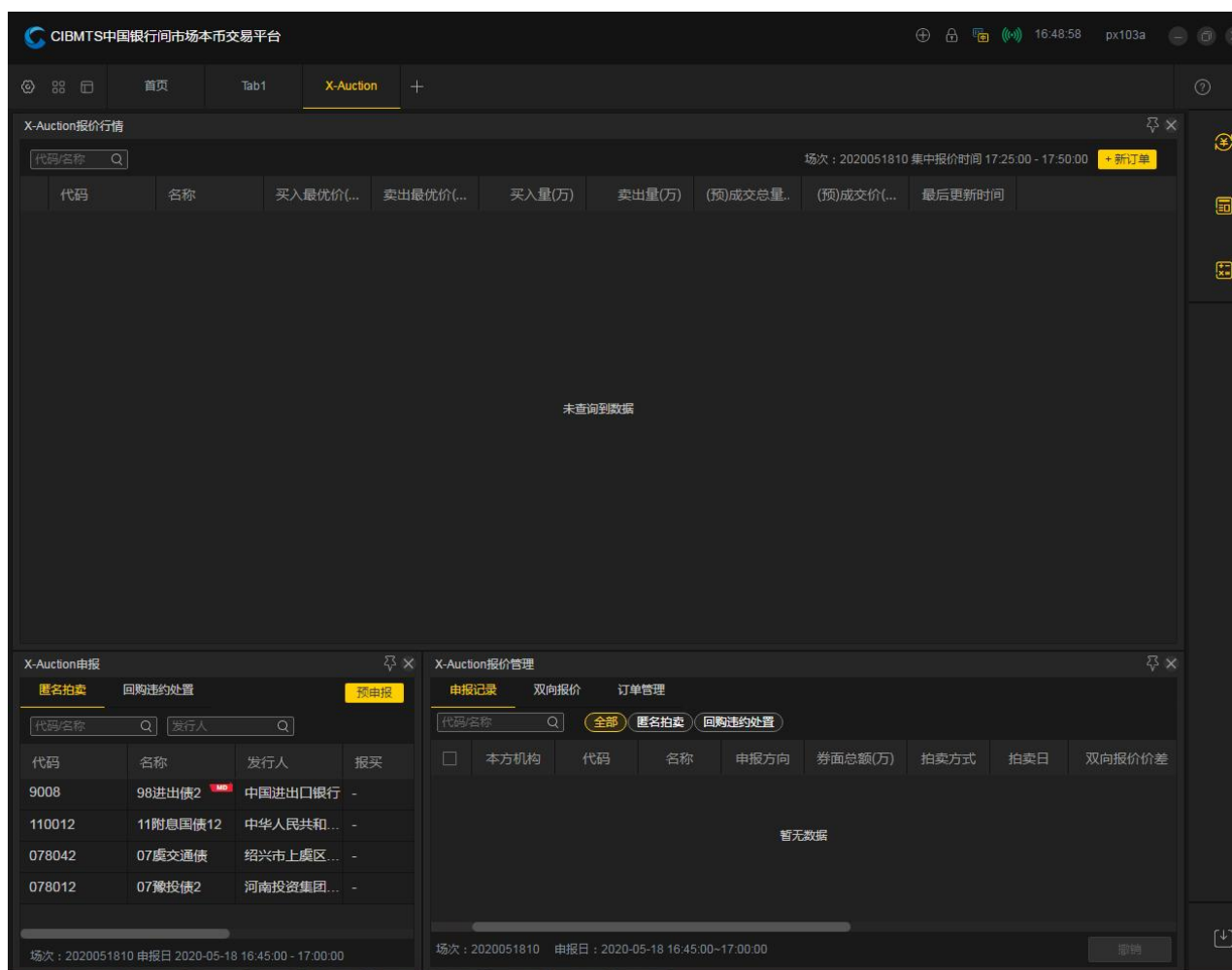
总0笔(买入0/卖出0), 0亿元(买入0/卖出0) 1 / 1 共2条

6.3 回购违约处置

6.3.1 申请

通过点击货币市场-回购违约处置打开申请 tab 页面。

由回购市场中已发生成交的逆回购方（守约方）提交回购违约处置申请。双击页面的【回购成交编号】（目前仅限质押式回购），查看对应的成交单。



6.3.3 报价发起

6.3.3.1 申报

具有匿名拍卖权限的交易员登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面（本系统类似窗口以下简称“iQuote”），选择“X-Auction”，报价类型选择“申报”，填写各类报价要素后，点击  按钮，提交一笔申报：

现券买卖

债券路演

报价方式

☐ X-Bond

☐ 做市

☐ 指示性

☐ 请求

☐ 意向

☐ 对话

☒ X-Auction

报价类型

☒ 申报

☐ 双向报价

☐ 订单

买入

卖出

代码*

9008

Q

券面总额(万元)

名称*

98进出债2

Q

重置

提交

6.3.3.2 订单

具有匿名拍卖权限的交易员登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面（本系统类似窗口以下简称“iQuote”），选择“X-Auction”，报价类型选择“订单”

通过以下方式打开订单录入界面：

- (1) 右侧导航栏的图标;
- (2) F8 快捷键;

(3) 报价行情-新订单;

(4) X-Auction 报价管理-新订单;

输入完订单要素后, 点击【提交】按钮, 提交订单; 点击【保存】按钮, 保存订单至 X-Auction-报价管理-订单页面。

现券买卖 债券路演

报价方式: ☐ X-Bond ☐ 做市 ☐ 指示性 ☐ 请求 ☐ 意向 ☐ 对话
☒ X-Auction

报价类型: ☐ 申报 ☐ 双向报价 ☒ 订单

买入 卖出

本方* 培训机构103

代码* 078042 名称* 07虞交通债

价格区间 50.00-97.00 净价(元)* 56.00

券面总额(万元)* 2000

到期(%) 38.5053 清算速度 T+1

全价(元) 60.4619 应计利息 4.46189 结算日 2020/05/20

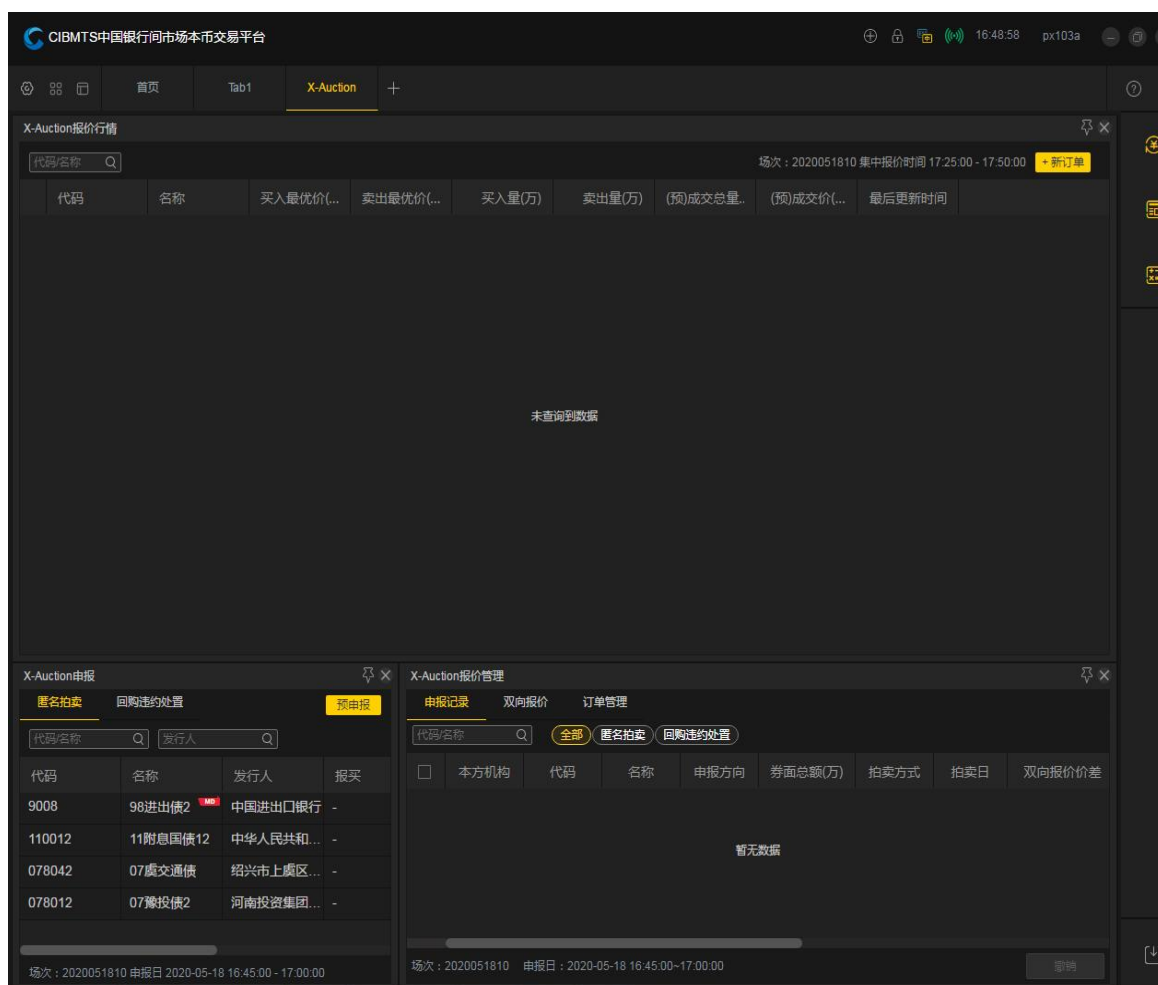
保存 提交

6.3.4 X-auction 管理

6.3.4.1 申报

(1) 录入申报并提交申报后, 申报记录在 X-Auction 管理-申报记录中查询。

(2) 勾选申报后，点击【撤销】按钮撤销申报记录。



6.3.4.2 订单

保存或提交的订单均展示在该页面。

(1) 激活/撤销订单

勾选【订单状态】为冻结的订单后，点击【激活】按钮激活订单，激活后订单状态为有效。

勾选任意订单后，点击【撤销】按钮撤销订单，撤销后的订单不展示在该页面。

(2) 双击【代码】或【名称】，弹出单券页面；

(3) 批量订单编辑

单击可编辑字段【净价（元）】、【到期%】、【行权%】、【券面总额（万）】中任一字段，进入页面编辑状态，右下角按钮变为【取消】和【提交】按钮，修改完可编辑字段后点击【提交】按钮，提交修改后的订单；点击【取消】按钮，订单展示为维持修改前数据。



(4) 单笔订单编辑

双击除【代码】、【名称】、【净价（元）】、【到期%】、【行权%】、【券面总额（万）】之外的任一字段，打开订单修改，修改后点击【保存】或【提交】订单。

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券路演

报价方式

☐ X-Bond
☐ 做市
☐ 指示性
☐ 请求
☐ 意向
☐ 对话
☒ X-Auction

报价类型

☐ 申报
☐ 双向报价
☒ 订单

买入

卖出

本方*

代码*

038018

名称*

03中债债(2)

集中报价范围

111.0000-999.0000

净价(元)*

120.0000

申报总额(万元)*

1000

到期(%)

-0.5355

清算速度

T + 1

全价(元)

122.4943

应计利息

2.49426

结算日

2020/06/08

保存

提交

6.3.5 X-auction 报价行情

- (1) 展示当前场次全市场订单的最优预匹配行情。
- (2) 点击  关注债券，债券将出现在我的关注券页面。
- (3) 双击【代码】或【名称】打开单券页面。

X-Auction报价行情								
代码/名称		场次: 2020051909 集中报价时间 13:02:00 - 13:15:00						
代码	名称	买入最优价(...)	卖出最优价(...)	买入量(万)	卖出量(万)	(预)成交总量...	(预)成交价(...)	最后更新时间
☆ 078042	07厦交通债	56.00	-	2000	-	-	-	2020/05/19 13:02:44

6.3.6 成交行情

集中竞价结束后，达成的成交展示在现券买卖-综合成交-逐笔成交行情界面。【交易方式】选择 X-Auction，展示 X-Auction 的逐笔成交行情。

现券买卖-综合成交									
成交汇总		逐笔成交							
交易方式		全部	X-Bond	做市点击	RFQ	对话报价	X-Auction	代码/名称	
代码	名称	成交价(%)	成交量(万)	成交方...	交易方. ▼	待偿期	评级	债券币种	成交时间
180016	18附息国债16	5.4243	1000	DONE	X-Auction	3.17Y	AA	CNY	15:35:01
180016	18附息国债16	5.4243	1000	DONE	X-Auction	3.17Y	AA	CNY	15:35:01
180015	18附息国债15 MD	-	2000	DONE	X-Auction	102D	AA	CNY	15:35:01

选择成交汇总 tab 页，查看债券成交汇总信息。

现券买卖-综合成交											
成交汇总		逐笔成交									
交易方式		汇总	X-Bond	做市点击	RFQ	对话报价	代码/名称				
	代码	名称	最新价(%)	涨跌(BP)	笔数	成交量(亿)	开盘价(%)	最高价(%)	最低价(%)	加权价(%)	首
☆	078042	07厦交通债	39.6770	-	1	0.2	39.6770	39.6770	39.6770	39.6770	
☆	1080083	10攀国投债	-223.9322	-	1	0.4	-223.9322	-223.9322	-223.9322	-223.9322	
☆	1920004	19长安银行二级01	6.5391	124.07▲	1	0.1	6.5391	6.5391	6.5391	6.5391	
☆	180027	18附息国债27	3.6287	-	1	0.2	3.6287	3.6287	3.6287	3.6287	
☆	100003	10附息国债03	4.4233	23.25▲	1	0.2	4.4233	4.4233	4.4233	4.4233	
☆	100001	10附息国债01	2.3961	260.23▲	1	0.1	2.3961	2.3961	2.3961	2.3961	

6.3.7 报价信息查询

打开债券市场的报价信息查询页面，选择 X-Auction 所在的 tab 页，查看 X-Auction 的历史申报记录、历史双向报价记录、历史订单记录。

点击【成交状态】为成交的订单，查看该订单的成交概览。

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询 信用债 ABS路演查询 存单路演查询-投资方 存单路演查询-投资方 X-Auction

报价类型 ☐ 申报 ☐ 双向报价 ☒ 订单 代码/名称 日期 订单编号 本方交易员 导出

订单编号	本方	本方交易员	交易方向	代码	名称	净价(元)	全价(元)	券面总额(万元)	到期(%)	行权(%)	每百元本金(元)	剩余券面总额(万元)
180725090413000123	建设银行闵行支行...	王林	买入	170002	17农发02	—	—	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000117	建设银行闵行支行...	邵进	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	—	—	5.68	5,000
180725090413000116	建设银行张江支行...	王德	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000113	建设银行张江支行...	李书斌	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000110	建设银行张江支行...	杨勇	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000108	建设银行张江支行...	汤念	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000106	南京银行张江支行...	何光	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000105	北京银行张江支行...	冷德	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000104	广发银行张江支行...	孙安怡	买入	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000103	招商银行张江支行...	贾德	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000
180725090413000102	招商银行张江支行...	蔡霖	卖出	170002	17农发02	72.1629	72.1629	5,000	5.1452	5.1452	5.68	5,000

1 / 15 共25条

6.3.8 成交查询

打开现券市场-成交查询页面，选择【交易方式】为 X-Auction 的标签，查看 X-Auction 的历史成交信息。

成交查询

现券买卖-成交明细 上市前交易意向

交易方式 ☒ 全部 ☐ 对话报价 ☐ RFQ ☐ 点击成交 ☐ X-Bond ☒ X-Auction 本方方向 ☒ 全部 ☐ 买入 ☐ 卖出 代码/名称 日期 2020/05/19 - 2020/05/19 导出 下载成交单

☐	成交编号	代码	名称	本方方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	对手方代理机构	本方	本方交易员
☐	CBT20200519500007	078042	07虞交通债	买入	培训机构105	培训机构105	交易员105A	—	培训机构1...	交易员103A
☐	CBT20200519500006	1080083	10攀国投债	卖出	培训机构105	培训机构105	交易员105A	—	培训机构1...	交易员103A

总0笔(买入0/卖出0), 0亿元(买入0/卖出0) 1 / 1 共2条

6.3.9 分量

该页面默认展示本机构申请债券达成的所有成交和分量信息。由提交申请债券的逆回购方对成交进行分量操作。

- (1) 用户勾选一笔【状态】为“未分量”的成交，点击【分量】按钮，弹出新增分量页面。
 - (2) 用户勾选一笔【状态】为“已分量”的成交后点击【分量】按钮，或者直接双击一笔【状态】为“已分量”的成交，弹出修改分量页面。
- 双击页面的任一行的【回购成交编号】字段（目前仅限质押式回购），查看该回购成交编号对应的成交单。

回购违约处置

申请分量

分量修改

☐	成交编号	本方	代码	名称	净价(元)	券面总额(万)	结算金额(元)	违约方	回购成交
☒	CBT20200521500018	交通银行	zllgkz	zll国开债	88.0000	100	880,161.3	-	-
☐	CBT20200521500017	交通银行	189910	18贴现国...	90.0000	2,400	21,656,678.4	建设银行	CR2019
☐	CBT20200520500016	交通银行	147859	18福建06	88.0000	1,000	8,832,274	中国建设银行股份...	CR2019
☐	CBT20200520500015	交通银行	zww191127	zww19付息...	99.0000	700	6,941,475.8	-	-
☐	CBT20200520500014	交通银行	zllqyz	zll企业债	100.0000	300	302,258.07	-	-
☐	CBT20200520500013	交通银行	zww191127	zww19付息...	99.0000	1,000	9,916,394	-	-
☐	CBT20200520500012	交通银行	zllgz	zll国债	92.0000	4,000	36,803,224	-	-
☐	CBT20200519500003	交通银行	100001	10付息国...	99.0000	1,000	9,962,057	-	-

1 / 2

共86条

单笔成交分量编辑页面：

- (1) 点击  按钮可添加一行分量行；
 - (2) 点击  按钮可删除对应分量行；
- 填写完所有字段信息后，点击  按钮，提交分量信息。

成交编号
CBT20200521500018

本方机构
交通银行

代码
zllgkz

净价(元)
88.0000

名称
zll国开债

券面总额(万)
100

结算金额(元)
880,161.3

回购成交编号	违约方	原质押券面(万)	原回购到期结算金额(元)	分量(万)*	⊕添加
CR20191130300016	Q 汇丰银行	100	1,001,753.42	100	⊗
	Q				⊗
	Q				⊗
	Q				⊗
	Q				⊗

取消

提交

6.4 货币市场

6.4.1 对话报价

6.4.1.1 发起报价

（1）任意身份下具有“质押式回购交易-对话报价”或“买断式回购交易-对话报价”或“信用拆借-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，在货币市场下选择“质押式回购”（报价方式选择对话）或者“买断式回购”（含单券和多券）或者“信用拆借”市场，填写各类报价要素后，点击按钮，即可发送一笔对话报价：

其中，质押式回购单笔交易支持使用不同托管机构的债券，即跨托管交易；信用拆借支持具有夜盘交易权限的机构在夜盘时段开展拆借交易。

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

质押式回购存单路演

报价方式 请求 对话

正回购逆回购

CNY券款对付券款对付全部清算

代码*	名称* 展型	券面总额(万元)*	折算比例(%)	估值净价(元)	+
1 100009	10附息国债09	5,000	90.00	—	🗑
2 101801111	18涪陵交通MT	5,000	90.00	—	🗑
3 101900224	19冀旅投MTNC	5,000	90.00	—	🗑

* 注: 当前所选质押券涉及多家托管机构

☐ 取CFETS标准折算率

中债登券面总额合计(万元)	中债登质押券折算总额(元)	中债登交易金额(元)*
5,000	45,000,000.00	45,000,000.00
上海所券面总额合计(万元)	上海所质押券折算总额(元)	上海所交易金额(元)*
10,000	90,000,000.00	90,000,000.00
券面总额合计(万元)	质押券折息总额(元)	交易金额合计(元)*
15,000	135,000,000.00	135,000,000.00

首次结算日

2020-04-27

到期结算日

2020-05-11

回购利息(元)

113,917.81

到期结算金额(元)

135,113,917.81

实际占款天数

14

交易品种

R014

批量导入保存提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

质押式回购存单路演

报价方式 请求 对话

正回购逆回购

本方* 农业银行 回购方式* 双边回购

对手方* 中国银行 对手方交易员* 白婧

回购期限(天)*	回购利率(%)	清算速度*	结算币种*
23	5.000	+0	CNY
债券币种*	首次结算方式*	到期结算方式*	清算类型*
CNY	券款对付	券款对付	金额清算

代码*

名称* 展型

券面总额(万元)*

折算比例(%)

估值净价(元)

+

1 1989019	19中盈万家1A	100	70.000	—	🗑
-----------	----------	-----	--------	---	---

首次结算日

2019-12-09

到期结算日

2020-01-02

回购利息(元)

2,301.11

到期结算金额(元)

702,301.11

实际占款天数

24

交易品种

R1M

批量导入保存提交

券面总额合计(万元)

质押券折算总额(元)

交易金额(元)*

100	700,000.00	700,000.00
-----	------------	------------

首次结算日

2019-12-09

到期结算日

2020-01-02

回购利息(元)

2,301.11

到期结算金额(元)

702,301.11

实际占款天数

24

交易品种

R1M

批量导入保存提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购买断式回购信用拆借同业存款资金意向

买断类型 单券 多券

正回购逆回购

本方* 国泰君安证券

对手方* 广发银行 对手方交易员* 蔡的六

回购期限(天)*	回购利率(%)	清算速度*	结算币种*
2	1.3689	+0	CNY
首次结算方式*	到期结算方式*	清算类型*	债券币种*
券款对付	券款对付	金额清算	CNY

代码*

名称*

券面总额(万元)*

w2021-1551	w2021-1551	10,000
------------	------------	--------

首次净价(元)*

首次收益率(%)

到期净价(元)*

到期收益率(%)

99.0000	3.5876	98.9891	3.5911
---------	--------	---------	--------

内部标签 (仅本方可见)

取CFETS估值

重置批量导入保存提交

首次结算金额(元)

99,100,833.33

到期结算金额(元)

99,108,266.67

首次结算日

2021-06-21

到期结算日

2021-06-23

首次应计利息(元)

0.10083

到期应计利息(元)

0.11917

首次全价(元)

99.1008

到期全价(元)

99.1083

实际占款天数

2

交易品种

OR007

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购买断式回购信用拆借同业存款资金意向

买断类型 单券 多券

正回购逆回购

本方* 国泰君安证券

对手方* 广发银行 对手方交易员* 蔡的六

回购期限(天)*	回购利率(%)	清算速度*	结算币种*
1	1.2300	+0	CNY
首次结算方式*	到期结算方式*	清算类型*	债券币种*
券款对付	券款对付	金额清算	CNY

代码

名称展型

券面总额(万元)

折算比例(%)

估值净价(元)

+

1 112115004	21民生银行CD004	10,000	100.00	—	🗑
-------------	-------------	--------	--------	---	---

首次结算日

2021/06/21

到期结算日

2021/06/22

实际占款天数

1

交易品种

OR001

回购利息(元)

3,369.86

重置批量导入保存提交

券面总额合计(万元)

首次结算金额合计(元)

到期结算金额合计(元)

10,000	100,000,000.00	100,003,369.86
--------	----------------	----------------

首次结算日

2021/06/21

到期结算日

2021/06/22

实际占款天数

1

交易品种

OR001

回购利息(元)

3,369.86

重置批量导入保存提交

债券市场 货币市场 衍生品市场 一级市场

质押式回购 买断式回购 信用拆借 同业存款 资金意向

拆入 拆出

本方* 华泰证券(上海)资管

对手方* ① 中国银行

对手方交易员* 白娟

拆借期限(天)* 1 基准利率* 固定利率 拆借利率(%)* 3.0000

拆借金额(万元)* 6,000.00 清算速度* +0

资金账户信息* *大崎|华泰证券(上海)资产管理有限公司-中央结算公司-0000

补充条款

首次结算日 2022-03-11 到期还款日 2022-03-12

拆借利息(元) 5,000.00 到期还款金额(元) 60,005,000.00

实际占款天数 1 交易品种 IBO001

重置 批量导入 保存 提交

(2) 也可批量提交对话报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—货币市场”路径下打开），选择对应的质押式回购（交易方式选择“对话”）或者买断式回购市场（选择买断式回购-单券或买断式回购-多券）或者信用拆借市场后，点击  按钮，在导出的模板中填写对话报价数据，点击  按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。

我的报价-货币市场

质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演-投资人

交易方式 ☒ 对话 ☐ RFQ ☐ X-Repo

状态 ☒ 全部 ☐ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交 本方向 ☒ 全部 ☐ 正回购 ☐ 逆回购 回购期限(天) - 本方 对手方 对手方机构

☐	本方方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	代码	名称
☐	正回购	已发送	国泰君安证券	1112机构lm02 陈三	1112机构lm01	10,000,000.00	1	1.2300	w1927	w1927代码

撤销 拒绝 提交 成交

人民币质押式回购：共1笔(正回购1/逆回购0)，0.1亿(正回购0.1/逆回购0)，净融资0.1亿

我的报价-货币市场

质押式回购

买断式回购-单券

买断式回购-多券

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演-投资人

导入

导出

状态

全部

待发送

已发送

待成交

交易方向

全部

正回购

逆回购

回购期限(天)

-

本方

Q

对手方

Q

对手方机构

Q

本方方向

本方状态

本方

对手方

对手方交易员

回购期限(天)

回购利率(%)

首次结算金额

代码

名称

券面总额(万)

首次净价

正回购

已发送

国泰君安证券

1662126

陈峰 / 建设

1

1.3505

99,100,833.33

w2021-1551

w2021-1551

10,000

99.0000

撤销

拒绝

提交

成交

人民币买断式回购(单券)：共1笔(正回购1/逆回购0)，0.9910083333亿(正回购0.9910083333亿逆回购0)

1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击 

按钮终止对话报价；也可以双击某笔对话报价，修改部分报价要素后，点击  按钮更新对话报价。

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以：

(a) 拒绝或达成成交。一是在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔对话报价，点击  按钮直接达成成交，或点击  按钮拒绝对话报价；二是可直接双击某条对话报价记录打开 iQuote，点击  按钮达成一笔对话成交，或点击  来拒绝成交。

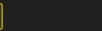
我的报价-货币市场

质押式回购

交易方式 ☒ 对话 ☐ RFQ

状态 ☒ 全部 ☐ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交 本方方向 ☒ 全部 ☐ 正回购 ☐ 逆回购 回购期限(天) - 本方 Q 对手方 Q 对手方机构 Q

☒	本方方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	代码	名称	折算比例(%)
☒	逆回购	待成交	中国银行	农业银行	李西西 / 农业银行	700,000.00	23	5.000	1989019	19中盈万家1A3	70.000

人民币质押式回购：共1笔(正回购0/逆回购1),0.007亿(正回购0/逆回购0.007)

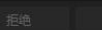
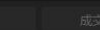
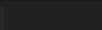
我的报价-货币市场

质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演-投资人

交易方式 ☒ 对话 ☐ RFQ

状态 ☒ 全部 ☐ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交 交易方向 ☒ 全部 ☐ 正回购 ☐ 逆回购 回购期限(天) - 本方 Q 对手方 Q 对手方机构 Q

☒	本方方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	回购期限(天)	回购利率(%)	首次结算金额	代码	名称	券面总额(万)	首次净价
☒	正回购	已发送	国泰君安证券	1662126	陈峰 / 建设银行	1	1.3505	99,100,833.33	w2021-1551	w2021-1551	10,000	99.0000

人民币买断式回购(单券)：共1笔(正回购1/逆回购0), 0.9910083333亿(正回购0.9910083333/逆回购0)

债券市场

货币市场

衍生品市场

质押式回购

存单路演

报价方式

请求

对话

逆回购

本方*

中国银行

回购方式*

双边回购

对手方*

农业银行

对手方交易员*

李西西

回购期限(天)*

23

回购利率(%)*

5.000

清算速度*

+0

结算币种*

CNY

债券币种*

CNY

首次结算方式*

券款对付

到期结算方式*

券款对付

清算类型*

全额清算

代码*

名称* 类型

券面总额(万元)*

折算比例(%)*

估值净价(元)

1

1989019

19中盈万家1A

100

70.000

—

—

券面总额合计(万元)

100

质押券折算总额(元)

700,000.00

交易金额(元)*

700,000.00

首次结算日

2019-12-09

到期结算日

2020-01-02

回购利息(元)

2,301.11

到期结算金额(元)

702,301.11

实际占款天数

24

交易品种

R1M

拒绝

提交

成交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

质押式回购

买断式回购

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演

拆入

本方*

中国银行

对手方*

富国基金公司

对手方交易员*

姜渝

拆借期限(天)*

1

基准利率*

固定利率

拆借利率(%)*

3.0000

拆借金额(万元)*

5,000.00

清算速度*

+0

资金账户信息*

*CIPS|中国银行股份有限公司-中国银行股份有限公司-MUZH1

补充条款

首次结算日

2022/03/17

到期还款日

2022/03/18

拆借利息(元)

4,166.67

到期还款金额(元)

50,004,166.67

实际占款天数

1

交易品种

IBO001

撤销

提交

(b) 进行报价交谈。在【我的报价】界面双击某条对话报价记录打开 iQuote，进入交谈界面，修改部分报价要素，点击提交按钮更新对话报价，交谈记录可在交谈界面上方查看。

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

质押式回购

存单路演

报价方式 请求 对话

正回购

14:14 何健康 将 清算速度 从 +0修改为+1 ;

14:12 何健康 将 交易金额 从 700000.00元修改为7000000.00元 ;修改质押券明细 债券 1989012-19和衷1C 的 券面总额(万元) 从 100.000 修改为 1000.000 ;

本方* 中国银行

回购方式* 双边回购

对手方* 德意志银行

对手方交易员* 何健康

回购期限(天)* 20

回购利率(%)* 4.000

清算速度* +1

结算币种* CNY

债券币种* CNY

首次结算方式* 券款对付

到期结算方式* 券款对付

清算类型* 全额清算

代码* 名称* 券型 券面总额(万元)* 折算比例(%)* 估值净价(元) +

1 1989012 19和衷1C 1000 70.000 -

取CFETS标准折算率

券面总额合计(万元) 1,000

质押券折算总额(元) 7,000,000.00

交易金额(元)* 7,000,000.00

首次结算日 2019-12-10 到期结算日 2019-12-30

回购利息(元) 15,342.47 到期结算金额(元) 7,015,342.47

实际占款天数 20 交易品种 R021

拒绝 提交 成交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购

买断式回购

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演

拆入

10:12 白娟 将 拆借金额(万元) 从 5,000修改为6,000 ;

本方* 中国银行

对手方* 富国基金公司

对手方交易员* 姜渝

拆借期限(天)* 1

基准利率* 固定利率

拆借利率(%)* 3.0000

拆借金额(万元)* 6,000.00

清算速度* +0

资金账户信息* *CIPS[中国银行股份有限公司-中国银行股份有限公司-MUZH1

补充条款

首次结算日 2022/03/17 到期还款日 2022/03/18

拆借利息(元) 5,000.00 到期还款金额(元) 60,005,000.00

实际占款天数 1 交易品种 IBO001

撤销 提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购

买断式回购

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演

买断类型 单券 多券

正回购

14:02 张伟 将 到期净价 从 118.0114修改为118.0117 ;将 到期收益率(%) 从 113.4694修改为113.4576 ;将 回购利率(%) 从 1.2071修改为1.2989 ;

本方* 广发银行

对手方* 国泰君安证券

对手方交易员* 张伟

回购期限(天)* 1

回购利率(%)* 1.2989

清算速度* +0

结算币种* CNY

首次结算方式* 券款对付

到期结算方式* 券款对付

清算类型* 全额清算

债券币种* CNY

代码* xxg056

名称* 小香瓜零五六

券面总额(万元)* 10,000

首次净价(元)* 118.0922

首次收益率(%)* 100.9991

到期净价(元)* 118.0117

到期收益率(%)* 113.4576

取CFETS标准估值

首次结算金额(元) 99,150,977.00 到期结算金额(元) 99,154,505.40

首次结算日 2021-06-21 到期结算日 2021-06-22

首次应计利息(元) 1.18643 到期应计利息(元) 1.27117

首次全价(元) 119.2786 到期全价(元) 119.2829

实际占款天数 1 交易品种 OR001

拒绝 提交 成交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购

买断式回购

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演

买断类型 单券 多券

逆回购

14:02 张伟 修改债券明细 增加债券 test031201-3123 券面总额(万元) 20,000 ;折算比例 (%) 100.00 ;首次结算金额(元) 200,000,000.00 ;净价(元) 100.0000 ;全价(元) 100.0000 ;应计利息(元) 0.00000 ;将 券面总额合计 从 10,000修改为30,000 ;将 首次结算金额合计 从 100,000,000.00修改为300,000,000.00 ;将 到期结算金额合计 从 100,003,369.86修改为300,010,109.59 ;

本方* 广发银行

对手方* 国泰君安证券

对手方交易员* 张伟

回购期限(天)* 1

回购利率(%)* 1.2300

清算速度* +0

结算币种* CNY

首次结算方式* 券款对付

到期结算方式* 券款对付

清算类型* 全额清算

债券币种* CNY

代码 名称 券型 券面总额(万元) 折算比例(%)* 估值净价(元)

1 112115004 21民生银行CD004 10,000 100.00 -

2 test031201 3123 20,000 100.00 -

取CFETS标准折算率

券面总额合计(万元) 30,000

首次结算金额合计(元) 300,000,000.00

到期结算金额合计(元) 300,010,109.59

首次结算日 2021/06/21 到期结算日 2021/06/22

实际占款天数 1 交易品种 OR001

回购利息(元) 10,109.59

拒绝 提交 成交

6.4.1.3 历史对话报价信息查询

对话报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-货币市场】界面，选择质押式回购（交易方式选择对话）或者买断式回购-单券或者买断式回购-多券或者信用拆借市场，查看历史的对话报价。

报价信息查询-货币市场

质押式回购

交易方式：☒ 对话 ☐ RFQ

报价类型 **全部** 对话 聊天 成交状态 **全部** 成交 未成交 本方方向 **全部** 正回购 逆回购 对手方 日期 2019/12/09 ~ 2019/12/09

报价编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	成交状态	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	代码	名称
191209060901010821	正回购	农业银行	招商银行	招商银行	林百宏	成交	1,000,000.00	1	2.000	010221	01国
191209060902010834	正回购	农业银行	招商银行	招商银行	林百宏	成交	2,000,000.00	1	2.000	010221	01国
191209060902010821	正回购	农业银行	招商银行	招商银行	林百宏	成交	1,000,000.00	1	3.000	010221	01国

人民币质押式回购：共3笔(正回购3/逆回购0),0.04亿元(正回购0.04/逆回购0)

K < 1 / 1 > X 共3条

报价信息查询-货币市场

质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演查询-发行人 存单路演查询-投资人

报价类型 全部 对话 聊天 成交状态 全部 已成交 未成交 本方 搜索 刷新 导出

报价编号	本方方向	本方	对手方	对手方交易员	成交状态
210621061001000002	正回购	广发银行	国泰君安证券	张伟	成交

报价详情 成交概览

最后更新时间 2021/06/21 14:08:37 报价编号 210621061001000002

本方方向	正回购	报价状态	成交
本方	广发银行		
本方机构	广发银行	本方交易员	蔡韵六
对手方	国泰君安证券		
对手方机构	国泰君安证券	对手方交易员	张伟
回购期限(天)	1	回购利率(%)	1.2989
首次结算金额	99,150,977.00	到期结算金额	99,154,505.40
清算速度	T+0	清算类型	全额清算
首次结算日	2021/06/21	到期结算日	2021/06/22
交易品种	OR001	实际占款天数	1
债券币种	CNY	结算币种	CNY
内部标签	—	汇率	—
交谈轮次	1	报价来源	客户端
应急标识	否	报价类型	对话报价

代码	名称	券面总额(万)	
xxq056	小香瓜零五六	10000	
首次净价	首次收益率(%)	首次应计利息	首次全价
118.0922	100.9991	1.18643	119.2786
到期净价	到期收益率(%)	到期应计利息	到期全价
118.0117	113.4576	1.27117	119.2829

人民币买断式回购(单券)：共1笔(正回购1/逆回购0)，0.99150977亿(正回购0.99150977/逆回购0)

K < 1 / 1 > X 共1条

报价信息查询-货币市场

质押式回购

买断式回购-单券

买断式回购-多券

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演查询-发行人

存单路演查询-投资人

报价类型

全部

对话

聊天

成交状态

全部

成交

未成交

导出

报价详情

成交概览

下载成交单

报价编号

本方向

本方

对手方

对手方机构

对手

成交时间 2021/06/21 14:08:19

成交编号 OR20210621900005

210621061091000004

逆回购

广发银行

国泰君安证券

国泰君安证券

张伟

本方向

逆回购

成交状态

正常

本方

广发银行

本方机构

广发银行

本方交易员

蔡皓六

对手方

国泰君安证券

对手方机构

国泰君安证券

对手方交易员

张伟

回购期限(天)

1

回购利率(%)

1.2300

券面总计(万)

30,000

首次结算金额合计

300,000,000.00

回购利息

10,109.59

到期结算金额合计

300,010,109.59

清算速度

T+0

清算类型

全额清算

首次结算日

2021/06/21

到期结算日

2021/06/22

首次结算方式

券款对付

到期结算方式

券款对付

交易品种

OR001

实际占款天数

1

派息标识

无

债券币种

CNY

结算币种

CNY

代码

名称

券面总额(万)

折算比例(%)

首次结算日

112115004

21民生银行CD004

10,000

100.00

100,000.00

test031201

3123

20,000

100.00

200,000.00

截屏

人民币买断式回购(多券): 共1笔(正回购0/逆回购1),3亿(正回购0/逆回购3) < 1 / 1 >

报价信息查询-货币市场

质押式回购

买断式回购-单券

买断式回购-多券

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演查询-投资人

成交状态

全部

成交

未成交

本方方向

全部

折入

折出

日期

导出

报价编号	本方方向	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员
210622060102000368	折出	国泰君安证...	张伟	1112机构...	陈三 / 1112机构...

报价详情

最后更新时间

2021-06-22 15:46:14

报价编号

210622060102000368

本方方向

折出

报价状态

询价

本方

国泰君安证券

本方交易员

张伟

对手方

1112机构m04

对手方交易员

陈三

折借金额(万)

2,000

折借期限(天)

1

折借利率

IBO001+2BP

清算速度

T+0

报价类型

对话

场次类型

日盘

实收轮次

1

应急标识

否

补充条款

—

到期还款金额

—

折借利息

—

首次结算日

2021-06-22

到期还款日

2021-06-23

交易品种

IBO001

实际占款天数

1

人民币信用拆借：共1笔(折入0折出1)，0.24亿(折入0折出0.2)

1 / 1

6.4.2 请求报价

6.4.2.1 发送请求报价

任意身份下具有“回购交易-请求报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧



按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，报价方式选择“请求”，填写各类报价要素后，点击 **提交** 按钮，即可发送一笔请求报价：

债券市场

货币市场

衍生品市场

质押式回购

买断式回购

信用拆借

资金意向

存单路演

报价方式 ☐ 对话 ☒ 请求 ☐ X-Repo

分仓方式 ☒ 不分仓 ☐ Pre-Allocation

正回购

逆回购

本方 *
建设银行

请求量(万元) *

回购期限(天) *

有效时间 *
14:16

清算速度 *
+0

结算币种 *
CNY

首次结算日

到期结算日

搜索交易对手

交易对手列表

☐ 中信证券
☐ 华夏银行
☒ 中国银行
☒ 国开行
☒ 招商银行
☐ 农业银行
☒ 东北证券

已选4个对手方

东北证券

对手方交易员

招商银行

对手方交易员

国开行

对手方交易员

中国银行

王贝贝

前3

前10

备注(交易对手可见)

隔离特战队，我做好的骄傲。

押利率值

押存单

6

保存

提交

如为资管或代理用户，可选择分仓方式“Pre-Allocation”，填写各类报价要素后，点击 **提交** 按钮，发送一笔 Pre-Allocation 请求报价：

债券市场

货币市场

衍生品市场

质押式回购

买断式回购

信用拆借

资金意向

存单路演

报价方式

对话

请求

X-Repo

分仓方式

不分仓

Pre-Allocation

*注：Pre-allocation即以资管人/代理人身份发送请求报价，发送前需选择拟分仓的资管/代理类产品账户。

正回购

逆回购

请求量(万元)*

回购期限(天)*

有效时间*

14:16

清算速度*

+0

结算币种*

CNY

首次结算日

到期结算日

搜索交易对手

交易对手列表

中国银行

中信证券

东北证券

光大银行

建设银行

农业银行

前3

前10

已选3个对手方

中国银行

王免贝

对手方交易员

东北证券

对手方交易员

添加篮子/产品

平均分配请求量

按篮子

按产品

产品列表

篮子列表

产品名称

分配请求量(万元)

产品

创兴银行

请输入分配量

建设银行台北

请输入分配量

建设银行(亚洲)

请输入分配量

保存

提交

在【我要报价】界面点击 [交易对手列表](#) 按钮，打开“交易对手列表”页面，点击“可交易对手”tab 页，可选择需要发送的对手方；点击“可申请对手方”Tab 页，选择一个或多个对手方，可向其发送加入质押 RFQ 白名单的申请。特别地，对于 Pre-Allocation 请求报价，请先选择一个或多个本方产品后，再选择交易对手。当选择多个本方产品时，可仅填写请求总量暂不做具体分配，也可准确填写每个产品的分配量。

177

交易对手列表

可交易对手方

可申请对手方

☐ 全选

☒ 德邦证券

☒ 光大银行

☐ 华夏银行

☐ 农业银行

☐ 培训机构004

☐ 培训机构008

☐ 培训机构013

☐ 培训机构016

☒ 德意志银行

☐ 光大证券

☐ 建设银行

☐ 培训机构001

☐ 培训机构005

☐ 培训机构010

☐ 培训机构014

☐ 培训机构016

☒ 东方证券

☐ 河南固始农商行

☐ 交通银行

☐ 培训机构002

☐ 培训机构006

☐ 培训机构011

☐ 培训机构015

☐ 培训机构016

☒ 工商银行

☐ 河南西峡农商行

☐ 交易中心(场务)

☐ 培训机构003

☐ 培训机构007

☐ 培训机构012

☐ 培训机构016

☐ 培训机构016

本方

已选对手方

培训机构101

德意志银行

光大银行

东方证券

德邦证券

工商银行

截图(Alt + A)

申请说明

烦请添加本方为质押RFQ交易对手，谢谢！

重置

确认

6.4.2.2 请求报价管理-我的请求

请求报价发送成功后，打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—货币市场”路径下打开），交易方式选择“RFQ || 我的请求”，可查看已经发出的请求报价并进行报价管理。

我的报价-货币市场

质押式回购

交易方式 对话 RFQ || 我的请求 持仓管理

状态 全部 待发送 已发送 待确认 待分配 待确认分配 已确认 回购期限(天) - 本方 对手方 对手方机构

☐	本方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	回购期限(天)	请求量(万)	请求有效	回复量(万)	回复有效	回购利率	分配有效	清算速度	备注
☐	正回购	待分配 ¹	2	培训机构120	交易员120A	50	5,000	11:11	5,000	13:13	10.00000%	10:22	+0	
☐	正回购	已发送	培训机构002	3	-	30	3,000	11:11	-	-	-	-	+0	押利率债
☐	正回购	已确认	2	3	-	40	4,000	11:05	-	-	-	-	+0	
☐	正回购	待确认/分配 ²	2	培训机构120	交易员120A	20	2,000	11:04	2,000	13:09	DR021+10BP	-	+0	
☐	正回购	待确认 ¹	培训机构002	培训机构110	交易员110A	10	1,000	10:49	1,000	13:07	10.00000%	-	+0	押利率债

撤销

提交

确认

1. 对于状态为“已发送”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，点击  按钮终止请求报价；或双击请求报价记录打开 iQuote，直接进行撤销。



该界面为质押式回购交易的操作窗口。顶部有“债券市场”、“货币市场”和“衍生品市场”三个标签，其中“货币市场”被选中。下方有一个黄色的“质押式回购”按钮。再下方是“报价方式”选择，包括“请求”（当前选中）和“对话”。

界面主要分为“正回购”和“逆回购”两个部分。当前显示的是“正回购”信息：

- 本方***：培训机构110
- 请求量(万元)***：1,000
- 回购期限(天)***：7
- 有效时间***：11:42
- 清算速度***：+0
- 结算币种***：CNY
- 首次结算日**：2019/12/31
- 到期结算日**：2020/01/07

下方是“搜索对手方机构”区域，包含一个搜索框和“交易对手列表”按钮。列表显示了已选2个对手方机构：培训机构111和培训机构112。下方还有一个复选框列表，包括培训机构111、培训机构112、培训机构140和培训机构112-基金产品2。底部有“前3”和“前10”的筛选按钮。

最下方是“备注(对手方可见)”区域，包含一个“押存单”输入框。底部右侧有“押利率信”和“押存单”两个按钮。最底部有一个灰色的“撤销”按钮。

2. 对于状态为“待确认”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，点击  按钮确认回复；或点击  按钮撤销请求报价。或双击请求报价记录打开 iQuote，直接进行确认或者撤销。特别地，对于状态为“待确认”且各产品未填写具体分配量的 Pre-Allocation 请求报价，可勾选“延迟分配”后，点击  按钮对回复进行延迟分配。如选择延迟分配，状态更新为“待分配”。

请求报价确认

请求报价确认-pre

正回购

请求有效时间 11:42

正回购

请求有效时间 19:00

本方

培训机构110

请求量(万元)

1,000

回购期限(天)

7

结算币种

CNY

清算速度

+0

首次结算日

2019/12/31

到期结算日

2020/01/07

对手方

对手方交易员

回复量(万元)

回购利率

回复有效

培训机构112

交易员112A

1,000

14.00

请求量(万元)

1,000

回购期限(天)

20

分仓方式

Pre-Allocation

结算币种

CNY

清算速度

+0

首次结算日

2020/07/27

到期结算日

2020/08/17

对手方

对手方交易员

回复量(万元)

回购利率

回复有效/分配有效

培训机构120

1,000

—

19:00

产品名称

已分配量(万元)

已勾选量(万元)

合计(万元)

1 培训机构002-基金..

0

0

0

2 培训机构002-基金..

0

0

0

勾选的回复量总计(万元):1,000

合计: 产品2个, 已分配量0万, 已勾选量0万, 共0万

撤销

确认

撤销

确认

3. 对于状态为“待分配”的请求报价，不可撤销，可以双击请求报价记录打开 iQuote，填写分配回复量后，直接进行确认。

请求报价确认-pre

正回购

请求有效时间 11:22

请求量(万元)

5,000

回购期限(天)

50

分仓方式

Pre-Allocation

结算币种

CNY

清算速度

+0

首次结算日

2020/07/09

到期结算日

2020/08/28

对手方

对手方交易员

回复量(万元)

回购利率

回复有效/分配有效

培训机构110

交易员110A

5,000

10.000000%

10.32

产品名称

分配回复量(万元)

培训机构002-基金产品1

2,500

培训机构002-基金产品2

2,500

平均分配回复量

合计(万)

5,000

产品名称

已确认量(万元)

已勾选量(万元)

合计(万元)

1 培训机构002-基金.. 0

2,500

2,500

2 培训机构002-基金.. 0

2,500

2,500

合计: 产品2个, 已确认量0万, 已勾选量5,000万, 共5,000万

撤销

确认

4. 对于状态为“待确认/分配”的请求报价，不可撤销，可以选中单笔/多笔对手方回复的报价请求报价，点击 **确认** 按钮确认回复；可以双击请求报价记录打开 iQuote，直接进行确认。特别地，对于状态为“待确认”且各产品未填写具体分配量的回复，可勾选“延迟分配”后，点击 **确认** 按钮对回复进行延迟分配。

5. 对于状态为“已确认”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，点击 **撤销** 按钮撤销未回复的剩余请求报价。或双击请求报价记录打开 iQuote，直接进行撤销。

6.4.2.3 请求报价管理-我的回复

任意身份下具有“回购交易-请求回复”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，打开【我的报价】界面（“--我的交易--我的报价-货币市场”路径下打开），交易方式选择“RFQ || 我的回复”，可查看本方收到的请求报价、请求报价进行回复或进行管理。

我的报价-货币市场

质押式回购

交易方式: 对话 RFQ || 我的请求 我的回复 质押管理

状态: 全部 待回复 待发送 已回复 待分配 回购期限(天) 本方 对手方 对手方机构

☐ 本方方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	回购期限(天)	请求量(万)	请求有效	回复量(万)*	回复有效*	回购利率	分配有效	清算速度	备注	首
☐ 逆回购	待分配	培训机构110	2	交易员002B	50	5,000	11.22	5,000	13.23	10.00000%	10.32	+0		20
☐ 逆回购	待回复	培训机构110	培训机构002	交易员002B	30	3,000	11.11				-	+0	押利率债	20
☐ 逆回购	已回复	培训机构110	培训机构002	交易员002B	10	1,000	10.49	1,000	13.07	10.00000%	-	+0	押利率债	20
☐ 逆回购	待回复	培训机构110	2	交易员002B	20	2,000	11.04				-	+0		20

撤销 拒绝 提交 批量回复 按比例 按定单 按平均 回复有效 || 回购利率 固定利率 %

共4笔, 请求量11,000万, 回复量6,000万

- 1、对于状态为“待回复”的请求报价，可以：
- 1) 通过 iQuote 进行报价回复。双击某条请求报价记录打开 iQuote，输入待回复要素后可点击  按钮进行回复。对于 Pre-Allocation 的请求报价，置灰显示的对手方为不在本方 RFQ 白名单内的客户，可以通过点击  图标快速添加白名单；白底显示的对手方为本方 RFQ 白名单内的客户，可以通过点击开关按钮调整是否可对其进行分配。当收到的 Pre-Allocation 请求报价未具体分配时，回复方可仅回复总量，也可具体分配至每一产品。

逆回购 请求有效时间 11:11

本方: 培训机构111
对手方机构: 培训机构002
对手方交易员: 交易员002B

回购期限(天): 30
清算速度: +0
首次结算日: 2020/07/09
到期结算日: 2020/08/10
货币币种: CNY
请求量(万元): 3,000
回复量(万元)*: 3,000
回复有效时间*: 13:44
基准利率: 固定利率
回购利率(%):

分合方式: Pre-Allocation

回购期限(天): 20
清算速度: +0
首次结算日: 2020/07/09
到期结算日: 2020/07/29
货币币种: CNY
请求量(万元): 2,000
回复量(万元)*: 1,000
回复有效时间*: 13:40
基准利率: 固定利率
回购利率(%):

按请求分配 按平均分配

最高分配	对手方	分配请求量(万)	分配回复量(万)
1	培训机构002-基金产品1	1,000	
2	培训机构002-基金产品2	1,000	
		合计(万)	

备注: 押利率债

拒绝 保存 提交

2) 【我的报价】界面进行快捷回复。选中单笔/多笔请求报价，可在界面上直接填写“回复量”/“回复有效时间”/“回购利率(可选)”，点击 **提交** 按钮进行快捷回复；特别地，对于 Pre-Allocation 请求报价，批量回复时默认仅回复总量，不做具体分配。

我的报价-货币市场

交易方式: 对话 RFQ 我的请求 我的回复 提醒管理

状态: 全部 待回复 待发送 已回复 待分配

已	本方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	回购期限(天)	请求量(万)	请求有效	回复量(万)*	回复有效*	回购利率	分配有效	清算速度	备注	商
☒	逆回购	待回复	培训机构110	培训机构002	交易员002B	30	3,000	11:11	3,000	13:48	固定利率	-	+0	押利率债	20
☐	逆回购	已回复	培训机构110	培训机构002	交易员002B	10	1,000	10:49	1,000	13:07	10.00000%	-	+0	押利率债	20
☒	逆回购	待回复	培训机构110	2	交易员002B	20	2,000	11:04	2,000	13:48	固定利率	-	+0		20

拒绝 保存 提交 批量回复 按比例 按定量 按平均

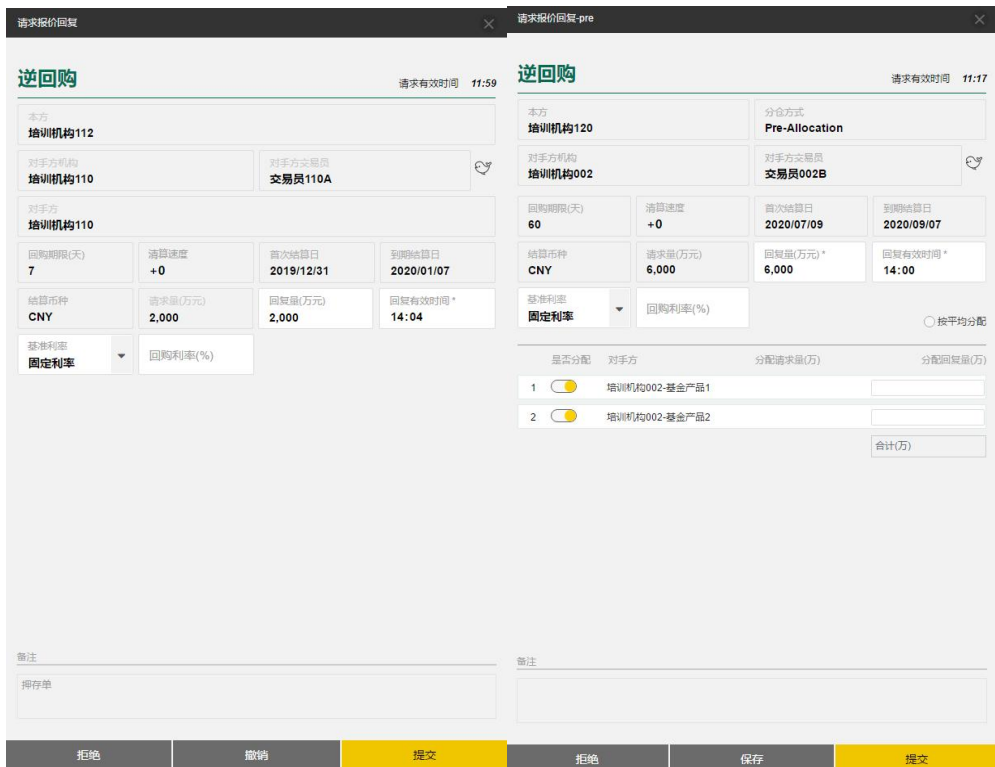
已勾选2笔, 请求量5,000万, 回复量5,000万

3) 在【我的报价】界面进行批量回复。勾选单笔/多笔请求报价后，选择在界面下方区域选择批量回复方式 **批量回复** ☒ **按比例** ☐ **按定量** ☐ **按平均**，以及回复有效、回购利率方式，进行批量回复。回购利率回复时为非必填项，如填写可选择按“固定利率”、按基准（DR/R）加减点的形式。



4) 拒绝报价。可在【我的报价】界面勾选单笔/多笔直接点击 **拒绝** 按钮拒绝回复，或双击某笔收到的请求报价记录打开 iQuote，点击 **拒绝** 按钮拒绝回复。

2. 对于状态为“已回复”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，快捷修改回复要素或批量修改回复要素后，点击 **提交** 按钮再次回复；或点击 **拒绝** 按钮终止请求报价，亦或点击 **撤销** 按钮撤销回复。也可双击请求报价记录打开 iQuote，修改回复要素进行提交、直接拒绝或者撤销。



3. 对于状态为“待分配”的报价，不可撤销、拒绝、再次修改回复，仅可双击请求报价记录打开 iQuote 进行查看。

请求报价管理-pre

逆回购

请求有效时间 11:22

本方
培训机构110

对手方机构
培训机构002

回购期限(天)
50

结算币种
CNY

基准利率
固定利率

分金方式
Pre-Allocation

对手方交易员
交易员002B

清算速度
+0

首次结算日
2020/07/09

到期结算日
2020/08/28

请求量(万元)
5,000

回购量(万元)*
5,000

回购利率(%)
10.00000

回购有效时间*
13:23

是否分配

对手方

分配请求量(万)

分配回购量(万)

1

☐

培训机构002-基金产品1

2

☐

培训机构002-基金产品2

合计(万)

备注

6.4.2.4 请求报价管理-提券管理

任意身份下具有“回购交易-请求报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，打开【我的报价】界面（“--我的交易--我的报价-货币市场”路径下打开），交易方式选择“RFQ || 提券管理”，可查看本方已确认的请求报价并进行提券管理。可进行批量提券。

质押式回购

交易方式 ☐ 对话 ☒ RFQ || 我的请求 提券管理

状态 ☒ 全部 ☐ 待提券 ☐ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交 本方向 ☒ 全部 ☐ 正回购 ☐ 逆回购 回购期限(天) - 本方 对手方 对手方机构

本方方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	交易金额(万)	回购期限(天)	回购利率	代码	名称	折算比例(%)	券面总计(万)	清算速
☐	正回购	已发送	培训机构002	培训机构110	交易员110A	1,000	10	10.00000%	2	2	2	1,000.000 +0
1								ztlpy	ztl央票	100.00000	500.000	
2								ztlqyz	ztl企业债	100.00000	500.000	
☒	正回购	待提券	培训机构00...	培训机构111	交易员111A	2,500	50	-	-	-	-	+0
☒	正回购	待提券	培训机构00...	培训机构111	交易员111A	2,500	50	-	-	-	-	+0
☐	正回购	待提券	培训机构00...	培训机构110	交易员110A	2,500	50	10.00000%	-	-	-	+0
☐	正回购	待提券	培训机构00...	培训机构110	交易员110A	2,500	50	10.00000%	-	-	-	+0

撤销

拒绝

提交

成交

批量提券

人民币质押式回购：共8笔(正回购8/逆回购0),1.8亿(正回购1.8/逆回购0)

- 1) 对于状态为“待提券”的提券报价，双击请求报价记录打开 iQuote，填写质押券要素（质押券支持使用不同托管机构的债券，即跨托管交易）将报价信息补录完整后，可点击  按钮发送报价；也可点击  按钮保存该笔报价。

请求报价提券

请求报价提券

正回购

正回购

本方 * ①

培训机构002-基金产品1

回购方式 *

双边回购

对手方 * ①

培训机构111

对手方交易员 *

培训机构111A

回购期限(天) *

1

回购利率(%) *

3.12

清算速度 *

+1

结算币种 *

CNY

债券币种 *

CNY

首次结算方式 *

券款对付

到期结算方式 *

券款对付

清算类型 *

金额清算

代码 *

名称 */ 类型

券面总额(万元) *

折算比例(%) *

估值净价(元) +

1

w1927

w1927代码

1,000.00

100.00

—

代码 *

名称 */ 类型

券面总额(万元) *

折算比例(%) *

估值净价(元) +

1

zihyp

zihyp

1,000.000

100.00000

—

2

zihyz

zihyz

1,000.000

100.00000

—

券面总额合计(万元)

1,000.00

质押券折算总额(元)

10,000,000.00

交易金额(元)

10,000,000.00

首次结算日

2022/01/11

到期结算日

2022/01/12

回购利息(元)

854.79

到期结算金额(元)

10,000,854.79

实际占款天数

1

交易品种

R001

券面总额合计(万元)

1,000.000

质押券折算总额(元)

10,000,000.00

交易金额(元)

10,000,000.00

首次结算日

2020/07/09

到期结算日

2020/08/28

回购利息(元)

—

到期结算金额(元)

—

实际占款天数

50

交易品种

R2M

保存

提交

保存

提交

2) 对于状态为“已发送”的提券报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击 撤销 按钮终止提券报价。也可双击请求报价记录打开 iQuote，撤销报价或对报价要素进行修改后提交报价。

请求报价提券

正回购

本方 * ①

培训机构002-基金产品2

回购方式 *

双边回购

对手方 * ①

培训机构111

对手方交易员 *

培训机构111A

回购期限(天) *

1

回购利率(%) *

3.1200

清算速度 *

+0

结算币种 *

CNY

债券币种 *

CNY

首次结算方式 *

券款对付

到期结算方式 *

券款对付

清算类型 *

金额清算

代码 *

名称 */ 类型

券面总额(万元) *

折算比例(%) *

估值净价(元) +

1

test1234

test1234

1,000

100.00

99.9991

券面总额合计(万元)

1,000

质押券折算总额(元)

10,000,000.00

交易金额(元)

10,000,000.00

首次结算日

2022/01/10

到期结算日

2022/01/11

回购利息(元)

854.79

到期结算金额(元)

10,000,854.79

实际占款天数

1

交易品种

R001

撤销

提交

- 3) 对于状态为“待成交”的提券报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击 **成交** 按钮进行成交，或点击 **拒绝** 按钮拒绝成交。也可双击请求报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝或者修改交谈要素后进行提交。

请求报价提券

逆回购

11:20 陈诚 将 回购利率(%) 从 3.12 修改为 3.17 ;

本方 * ①

培训机构111

回购方式 *

双边回购

对手方 * ①

培训机构002-基金产品2

对手方交易员 *

交易员002B

回购期限(天) *

1

回购利率(%) *

3.17

清算速度 *

+1

结算币种 *

CNY

债券币种 *

CNY

首次结算方式 *

券款对付

到期结算方式 *

券款对付

清算类型 *

全额清算

代码 *

名称 * / 类型

券面总额(万元) *

折现比例(%) *

估值净价(元)

1

w1927

w1927代码

1,000.00

100.00

—

债券估值合计(万元)

1,000.00

新债券折现总额(元)

10,000,000.00

交易金额(元)

10,000,000.00

首次结算日

2022/01/11

到期结算日

2022/01/12

回购利息(元)

868.49

到期结算金额(元)

10,000,868.49

实际占款天数

1

交易品种

R001

拒绝

提交

成交

- 4) 批量提券：对于“待提券”状态的正回购方向的请求报价，可以同时勾选一笔/多笔报价编号和回复编号相同的请求报价，点击 **批量提券** 按钮打开 iQuote，填写质押券要素(质押券不支持跨托管)将报价信息补录完整后，可 **提交** 点击按钮批量发送报价；也可点击 **保存** 按钮批量保存这笔报价。

请求报价批量提券

正回购

批量提券共2笔

本方 * ①

培训机构002

回购方式 *

双边回购

对手方 * ①

培训机构120

对手方交易员 *

交易员120A

回购期限(天) *

20

回购利率(%) *

10.00000

清算速度 *

+0

结算币种 *

CNY

债券币种 *

CNY

首次结算方式 *

券款对付

到期结算方式 *

券款对付

清算类型 *

全额清算

代码 *

名称 * / 类型

券面总额(万元) *

折算比例(%) *

估值净价(元) +

1

zlhyp

zlh央票

20,000.000

100.00000

—

☐ 取CFETS标准折算率

券面总额合计 (万元)

20,000.000

质押券折算总额(元)

200,000,000.00

交易金额 (元)

20,000,000.00

首次结算日

2020/07/09

到期结算日

2020/07/29

回购利息 (元)

109,289.62

到期结算金额 (元)

20,109,289.62

实际占款天数

20

交易品种

R021

保存

提交

任意身份下具有“回购交易-请求回复”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，打开【我的报价】界面（“-我的交易—我的报价-货币市场”路径下打开），交易方式选择“RFQ || 提券管理”，可查看被请求方确认的请求回复并进行提券报价管理。

我的报价-货币市场

质押式回购

交易方式 ☐ 对话 ☒ RFQ || 我的请求 我的回复 我的成交

状态 ☒ 全部 ☐ 待提券 ☐ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交

☐

本方向

☐

本方状态

☐

本方

☐

对手方

① 逆回购

待提券

培训机构112

培训机构

☐

逆回购

待成交

培训机构112

培训机构

☐

逆回购

待成交

培训机构112

培训机构

☐

逆回购

待成交

培训机构112

培训机构

撤销

拒绝

成交

1) 对于状态为“待提券”操作，需先由请求方补录作。

2) 对于状态为“待成交”多笔请求报价，点击

请求报价

逆回购

本方 * ①

培训机构111

回购方式 *

双边回购

对手方 * ②

培训机构002-基金产品2

对手方交易员 *

交易员002B

回购期限(天) *

1

回购利率(%) *

3.1200

清算速度 *

+0

结算币种 *

CNY

债券币种 *

CNY

首次结算方式 *

券款对付

到期结算方式 *

券款对付

清算类型 *

净额清算

代码 *

名称 * / 类型

券面总额(万元) *

折算比例(%) *

估值净价(元)

1

test1234

test1234

1,000

100.00

99.9991

☐ 取CFETS标准折算率

券面总额合计 (万元)

1,000

质押券折算总额(元)

10,000,000.00

交易金额 (元)

10,000,000.00

首次结算日

2022/01/10

到期结算日

2022/01/11

回购利息 (元)

854.79

到期结算金额 (元)

10,000,854.79

实际占款天数

1

交易品种

R001

拒绝

提交

成交

的提券报价，不可进行相关报价并提交后进行后续操

的提券报价，可以选中单笔/按钮进行成交，或

点击  按钮拒绝成交。也可双击请求报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝或者修改交谈要素后进行提交。

3) 对于状态为“已发送”的提券报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击  按钮终止提券报价。也可双击请求报价记录打开 iQuote，撤销报价或对报价要素进行修改后提交报价。

请求报价提券

逆回购

14:33 白晴 将 回购利率(%)从 3.1200修改为3.2100 ;

本方 * ①
培训机构111

回购方式 *
双边回购

对手方 * ①
培训机构002-基金产品2

对手方交易员 *
交易员002B

回购期限(天) *
1

回购利率(%) *
3.2100

清算速度 *
+0

清算币种 *
CNY

债券币种 *
CNY

首次结算方式 *
券款对付

到期结算方式 *
券款对付

清算类型 *
全额清算

代码 *	名称 * / 类型	券面总额(万元) *	折溢价比例(%) * 估值净价(元)
1 test1234	test1234	1,000	100.00 99.9991

☐ 取CFETS标准折算率

券面总额合计(万元)
1,000

质押券折算总额(元)
10,000,000.00

交易金额(元)
10,000,000.00

首次结算日
2022/01/10

到期结算日
2022/01/11

回购利息(元)
879.45

到期结算金额(元)
10,000,879.45

实际占款天数
1

交易品种
R001

撤销

提交

6.4.2.5 历史请求报价信息查询

请求报价的历史报价信息，可在“--信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开

【报价信息查询-货币市场】界面，交易方式选择“RFQ”，查看历史的请求报价、请求回复及提券管理信息。

报价信息查询-货币市场											
质押式回购											
交易方式: ☐ 对话 ☒ RFQ ☐ 请求/回复 ☐ 提券信息											
查询类型: ☒ 全部 ☐ 我的请求 ☐ 我的回复 本方方向: ☒ 全部 ☐ 正回购 ☐ 逆回购 日期: 2019/12/30 - 2019/12/30 对手方: Q Y C 导出											
报价编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	报价方式	请求量(万)	回复量(万)	确认量(万)	回购期限(天)	清算速度
191230090911000059	逆回购	培训机构112	培训机构110	培训机构110	交易员110A	我的回复	5,000	5,000	5,000	35	T+0
191230090911000038	逆回购	培训机构112	培训机构110	培训机构110	交易员110A	我的回复	2,000	2,000	2,000	14	T+0
191230090912000041	逆回购	培训机构112	培训机构110	培训机构110	交易员110A	我的回复	3,000	3,000	3,000	21	T+0
人民币质押式回购: 共3笔(正回购0笔逆回购3), 1亿(正回购0笔逆回购1)											
K < 1 / 1 > X 共3条											

6.4.3 X-Repo 订单

6.4.3.1 X-Repo 订单提交

(1) 任意身份下具有“质押式回购-匿名点击”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择【货币市场】，报价方式选择“X-Repo”，填写各报价要素后，点击  按钮，即可提交订单。

回购方式可以选择【双边回购】，其中，双边回购的正回购方还支持预提交质押券，逆回购方支持提交分层订单的功能。

债券市场 货币市场 衍生品市场 X 债券市场 货币市场 衍生品市场

质押式回购 买断式回购 存单路演

报价方式 ☐ 对话 ☐ 请求 ☒ X-Repo

正回购 逆回购

本方* ① 培训机构001 回购方式* 双边回购

合约名称* R001 回购利率(%)* 4.00 交易金额(手)* 1 x1亿

清算速度* +0 首次结算日 2020/12/15 到期结算日 2020/12/16

实际占款天数 1 回购利息(元) 10,958.90 到期结算金额(元) 100,010,958.90

预提质押券 ☐

代码*	名称* 类型	券面总额(万元)*	折算率(%)*	可融资金额(万元)*
1	209952 20贴现国债52	50,000	83.61	41,805

特提质押券(万元) 0 (-31,803) 可融资金额(万元) 41,805

批量导入 保存 提交 批量导入 保存 提交

报价发送成功后，点击“--我的报价-X-Repo-我的订单”菜单路径，可打开【我的订单】界面，在该页面可查看已经发出的 X-Repo 订单，或对订单进行冻结、激活或撤销操作。

我的报价-货币市场

质押式回购 买断式回购 存单路演-投资人

交易方式 ☐ RFQ ☒ X-Repo ☐ 我的订单 提单管理

状态 ☒ 全部 ☐ 有效 ☐ 冻结 ☐ 预提交 本方方向 ☒ 全部 ☐ 正回购 ☐ 逆回购 回购方式 ☒ 全部 ☐ 双边 ☐ 通用 本方 合约名称 交易品种

☐	本方方向	状态	本方	合约名称	交易品种	回购利率(%)	交易金额(万)	代码	名称	折算率(%)	券面总计(万)	可融资金额(万)	清算速度	回购方式	激活时间
☐	正回购	有效	培训机构001	R001	R001	5.96	10,000	-	-	-	-	-	+0	双边	16:06:25
☐	逆回购	有效	培训机构001	R001	R001	3.60	10,000	-	-	-	-	-	+0	双边	16:05:46
☐	正回购	有效	培训机构001	R001_mini	R001	5.96	1,000	209953	20贴现国债...	85.03	3,000	2,550	+0	双边	16:05:46

人民币质押式回购 共3笔(正回购2笔/逆回购1) 2.1亿正回购1.1亿逆回购1

(3) 提供批量提交 X-Repo 订单功能。可点击  按钮，在导出模板中填写订单数据，点击  按钮导入 X-Repo 订单后，展示在导入页面上，可勾选多笔订单批量提交。

➤ 对于状态为“有效”的订单，可以双击订单记录打开 iQuote，修改部分订单要素后，
点击  按钮更新订单；或点击  按钮，保存当前订单数据，暂不提交。

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

质押式回购

买断式回购

报价方式

☐ 对话

☐ 请求

☒ X-Repo

正回购

逆回购

本方* ①

培训机构001

Q

回购方式*

双边回购

▼

合约名称*

R014

▼

回购利率(%)*

3.24

▲▼

交易金额(手)*

1

▲▼

x1亿

清算速度*

+0

▼

首次结算日

2020/12/15

到期结算日

2020/12/29

实际占款天数

14

回购利息(元)

124,273.97

到期结算金额(元)

100,124,273.97

预提质押券

🔍

	代码*	名称* / 类型	券面总额(万元)*	折算率(%)	可融资金额(万元)	+
1	209951	20贴现国债51	20,000	84.75	16,950	🗑
2	209950	20贴现国债50	200	94.65	189	🗑

待质押金额(万元)

0 (-7,126)

可融资总金额(万元)

17,139

批量导入

保存

提交

6.4.3.3 提券管理

双边回购达成成交后，正回购方尚未提交质押券的，交易双方可以点击“我的
报价-X-Repo-提券管理”单选按钮来查看待本方或对手方提券的成交。

我的报价-货币市场

×

质押式回购

买断式回购

存单融资-投资人

交易方式

☐ 对话

☐ RFQ

☒ X-Repo

||

我的订单

• 提券管理

状态

全部

待提券

匹配成功

全部

正回购

逆回购

Q

本方

Q

对手方

Q

对手方机构

Q

🔄

	本方方向	状态	匹配成交	提券截止	本方	合约名称	对手方	对手方交易员	回购利率(%)	交易金额(万)	交易品种	实际占款天数	成交序列号
📄	正回购	待提券 ①	16.06.35	16.36.35	培训机构001	R014	交易中心(杨芳)	联测零二五	3.20	10,000	R014	14	REPO2020121505000063
📄	正回购	待提券 ①	16.06.12	16.36.12	培训机构001	R014	交易中心(杨芳)	联测零二五	3.20	10,000	R014	14	REPO2020121505000061

提交质押券

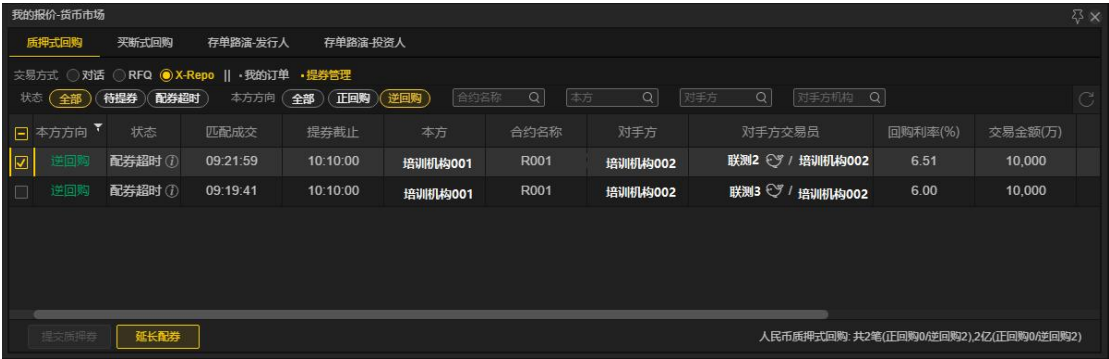
人民币质押式回购 共2笔(正回购2/逆回购0) 2亿(正回购2/逆回购0)

其中，临近提券截止时间时，待提券的成交记录会用倒计时的形式展示提券截止时间，

同时系统会通过消息盒子提醒正回购方有即将配券超时的订单：



其中，对于配券超时的订单，正回购可以联系逆回购方，逆回购方同意后可以勾选配券超时的订单，点击 **延长配券** 进行延长配券；延长配券后的订单会恢复待提券状态等待正回购方提券。



正回购方勾选一笔或多笔待提券的订单，点击 **提交质押券** 进入【提交质押券】页面进行提券。

6.4.3.4 提交质押券

(1) 在 “**我的报价-X-Repo-提券管理**” 页面，勾选一笔待提券的正回购订单，点击 **提交质押券**，会进入单笔的【提交质押券】页面。

提交质押券

提券截止
对手方

16:36:35
培训机构002

合约名称
对手方机构

R014
培训机构002

回购利率(%)
对手方交易员

3.20
联测

交易金额(万)
到期结算金额(万)

10,000
10,012.273973

	代码 *	名称 *	券面总计(万元) *	折算率(%)	可融资金额(万元)	
1				-	0	

本方: 培训机构001

可融资总金额: 0万元, 待质押金额: 10,013万元

取消

提交

在页面下方添加债券代码、名称等要素，填写完整后点击提交，提交成功的，系统会自动生成成交单。

提交质押券

提券截止
对手方

16:36:35
培训机构002

合约名称
对手方机构

R014
培训机构002

回购利率(%)
对手方交易员

3.20
联测

交易金额(万)
到期结算金额(万)

10,000
10,012.273973

	代码 *	名称 *	券面总计(万元) *	折算率(%)	可融资金额(万元)	
1	209953	20贴现国债53	20,000	85.03	17,006	

本方: 培训机构001

可融资总金额: 17,006万元, 待质押金额: 0 (-6,993) 万元

取消

提交

(2) 在“我的报价-X-Repo-提券管理”页面，勾选多笔待提券的正回购订单，点击提交质押券，会进入批量【提交质押券】页面。

提交质押券

	提券截止	合约名称	对手方	回购利率(%)	交易金额(万)	代码	名称	折算率(%)	券面总计(万)	可融资金额(万)
1	07:34	R014	培训机构002	3.20	10,000	209953	20贴现国债53	85.03	11,780	10,016
2	07:57	R014	培训机构002	3.20	10,000	2	2	-	11,790	10,015
						209953	20贴现国债53	85.03	8,220	6,989
						209951	20贴现国债51	84.75	3,570	3,025

本方: 培训机构001

可融资总金额: 20,031万元, 待质押金额: 0 (-7) 万元

	代码 *	名称 *	券面总计(万) *	剩余券面(万)
1	209953	20贴现国债53	20,000	0
2	209951	20贴现国债51	10,000	6,430

取消

自动配售

提交

6.4.3.5 历史订单查询

X-Repo 的历史报价信息，可在“--我的交易—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-质押式回购市场-X-Repo】界面，查看历史的 X-Repo 订单。

其中，点击按钮可以展开预提券订单或分层订单来查看详细的债券信息或群组信息。



订单编号	本方方向	本方	订单状态	成交状态	合约名称	交易品种	回购利率(%)	交易金额(万)	剩余金额(万)	代码	名称	折算比例(%)	券息总计(万)	剩余券息(万)	清算时
201215230901000097	正回购	培训机构001	成交	成交	GR003	R007	4.10	1,000	0	—	—	—	—	—	T+0
201215050901000038	正回购	培训机构001	成交	成交	R007	R007	3.40	10,000	0	2	2	2	11,000	440	T+0
1										209953	20贴现国债53	87.72	3,000	0	
2										209950	20贴现国债50	97.64	8,000	440	
201215050901000033	逆回购	培训机构001	成交	成交	R001_mini	R001	5.95	1,000	0	—	—	—	—	—	T+0
201215230901000023	逆回购	培训机构001	成交	成交	GR021	R021	4.10	1,000	0	—	—	—	—	—	T+0
201215230901000019	正回购	培训机构001	成交	成交	GR028	R1M	3.00	1,000	0	—	—	—	—	—	T+0
201215050901000024	正回购	培训机构001	成交	成交	R014	R014	3.20	10,000	0	—	—	—	—	—	T+0
201215050901000016	正回购	培训机构001	成交	成交	R007	R007	3.40	10,000	0	—	—	—	—	—	T+0
201215050901000001	逆回购	培训机构001	成交	成交	R007	R007	4.00	10,000	0	—	—	—	—	—	T+0

6.4.4 X-Repo 点击成交

6.4.4.1 X-Repo 双边回购报价行情

任意身份下具有“质押式回购-匿名点击”权限的用户可点击“--公开报价—X-Repo 报价行情”菜单路径，打开【X-Repo 报价行情】双边回购 tab 界面，选择“本方”交易账户，可以查看该交易账户市场当日的质押式回购双边回购报价行情。

X-Repo报价行情

当前场: 08:45:00-08:55:00(盘前) 下一场: 09:00:00-12:00:00

培训机构007 合约名称 Q 一键冻结 +新订单

合约名称	正回购量(亿)	正回购利率(%)	逆回购利率(%)	逆回购量(亿)
R001	5 (5)	2.00	2.35	1 (0)
	6 (6)	1.50	2.36	6 (6)
	6 (6)	1.35	-	-
R001_mini	-	-	-	-
R007	15 (15)	2.95	3.00	6 (6)
R007_mini	-	-	-	-
R014	1 (0)	3.00	3.10	8 (7)
R014_mini	-	-	-	-

对于有交易意向的合约，可以点击  按钮查看当前合约的所有深度行情，双击价格/报价量字段，可打开 iQuote，确认“报价量”后点击  按钮进行成交，点击成交时支持正回购方同步预提交质押券。

CIBMTS 中国银行间市场本币交易平台

当前场: 13:30:00-15:50:00 下一场: 15:52:00-17:50:00

中国央行 合约类型 Q 合约名称 Q 一键冻结 +新订单

合约名称	正回购量(亿)	正回购利率(%)	逆回购利率(%)	逆回购量(亿)
R003	-	-	5.20	1 (1)
R002	-	-	-	-
R004	1 (0)	5.21	-	-
R014	-	-	-	-
R014_mini	-	-	-	-
CDR001	-	-	-	-
CD_R001	-	-	-	-
CD_R002	-	-	-	-
LG_R002	-	-	-	-
CDR002	-	-	-	-

正回购

本方* ① 中国银行

回购方式* 双边回购

合约名称* R003 回购利率(%)* 5.20 交易金额(手) 1 x1亿

清算速度 +0 首次结息日 2022/09/05 到期结息日 2022/09/08

实际占款天数 3 回购利息(元) 42,739.73 到期结息金额(元) 100,042,739.73

* R类合约仅支持使用国债、央行票据、政策性金融债。

预提交质押券

代码* 名称* 券面总额(万元)* 折算率(%) 可融资金额(万元)+

1 10.005 可融资金额(万元) 0

成交

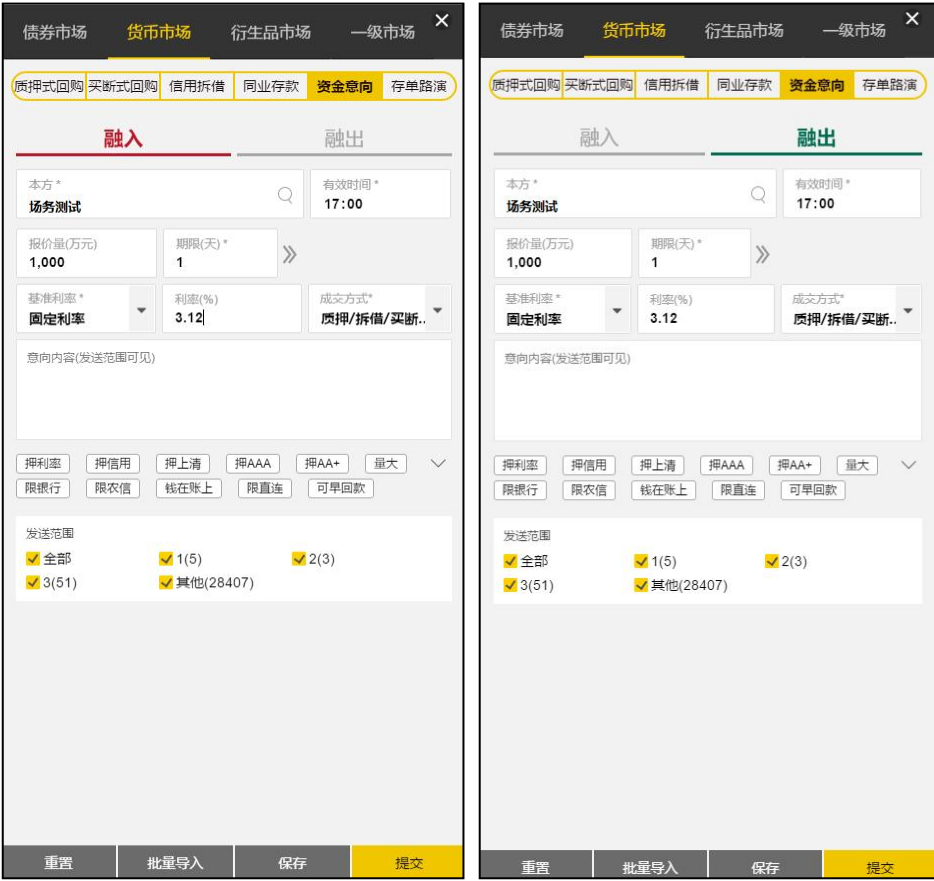
6.4.5 资金意向

6.4.5.1 发起报价

(1) 单笔提交：具有“质押式回购”、“信用拆借”或“买断式回购”交易权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，

在货币市场下选择“资金意向”，填写各类意向报价要素后，点击  按钮，即可发送。

其中，发送范围为机构群组维护（详见 7.3.3 机构群组维护）中设置的用于资金意向报价的机构群组。



该图展示了 CIBMTS 客户端发起报价的界面，分为“融入”和“融出”两个选项卡。当前显示的是“融入”选项卡下的“资金意向”子选项卡。界面包含以下主要区域：

- 顶部导航栏：**包含“债券市场”、“货币市场”、“衍生品市场”和“一级市场”四个选项卡，其中“货币市场”被选中。
- 子选项卡：**在“货币市场”下，有“质押式回购”、“买断式回购”、“信用拆借”、“同业存款”、“资金意向”和“存单路演”六个子选项卡，其中“资金意向”被选中。
- 操作区域：**
 - 融入/融出切换：**上方有“融入”和“融出”两个切换按钮，当前“融入”被选中。
 - 基本信息：**包括“本方*”（场务测试）、“有效时间*”（17:00）、“报价量(万元)”（1,000）、“期限(天)”（1）。
 - 利率设置：**包括“基准利率*”（固定利率）、“利率(%)”（3.12）、“成文方式*”（质押/拆借/买断..）。
 - 意向内容：**下方有一个文本输入框，标注为“意向内容(发送范围可见)”。
 - 筛选条件：**下方有一组按钮，包括“押利率”、“押信用”、“押上清”、“押AAA”、“押AA+”、“量大”、“限银行”、“限农信”、“钱在账上”、“限直连”、“可早回款”。
 - 发送范围：**下方有一个复选框列表，包括“全部”、“1(5)”、“2(3)”、“3(51)”、“其他(28407)”，其中“全部”、“1(5)”、“2(3)”、“3(51)”和“其他(28407)”均被选中。
- 底部操作栏：**包含“重置”、“批量导入”、“保存”和“提交”四个按钮，其中“提交”按钮为黄色高亮。

(2) 批量提交：可通过以下方式打开批量导入弹窗，阅读“填写说明”后在“填写报价”区域填写资金意向数据，点击  按钮，选中校验通过的意向报价进行批量保存或批量提交。

- 通过【我要报价】界面点击“批量导入”；
- 在【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价-货币市场”路径下打开）选择“资金意向”市场后点击按钮；
- 在【资金意向板】界面（“—公开报价—报价行情”路径下选择“资金意向板”）点击按钮。

我的报价-货币市场

本方方向	本方状态	本方	期限(天)	报价量(万元)	成交方式	意向内容	发送范围	价格	有效时间	剩余报价量(万元)	意向报
☐ 融入	已发送	场务测试	1	5,000	质押/拆借/买断单券/买断多券	—	全市场	2.31%	16:55	5,000	220110
☐ 融出	已发送	场务测试	1	3,000	质押/拆借/买断单券/买断多券	—	全市场	1.25%	16:55	3,000	220110

资金意向：共2笔(融入1/融出1)，0.8亿(融入0.5/融出0.3)

报价行情

X-Repo双边 X-Repo通用 资金意向板

头寸 ☐ 已平 ☒ 未平 待入(亿) 待出(亿)

方向 ☒ 全部 ☐ 融入 ☐ 融出 期限(天) 报价量 全部 成交方式 全部 机构类型 全部 仅看 分钟 仅看关注 仅看自营

报价方	交易员	意向内容	剩余量(亿)	成交方式	方向	期限(天)	报价量(亿)	报价机构	价格	有效时间	最后更新时间
☆ 浦发银行	陈敏	出 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押 拆借 买断 融出	融出	1	0.3	浦发银行	1.25%	16:55	13:55:42
☆ 中国银行	白娟	借 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押 拆借 买断 融入	融入	1	0.3	中国银行	1.25%	16:59	14:00:16
☆ 中国银行	白娟	出 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押 拆借 买断 融出	融出	1	0.3	中国银行	1.25%	16:59	14:00:16
☆ 浦发银行	陈敏	借 1天 0.5亿 @2.31%	0.5	质押 拆借 买断 融入	融入	1	0.5	浦发银行	2.31%	16:55	13:55:52
☆ 农业银行	陈诚	借 1天 0.1亿 @1.23%	0.1	质押 拆借 买断 融入	融入	1	0.1	农业银行	1.23%	16:52	13:52:24
☆ 建设银行	A陈志鹏	借 10天 1亿 @10.00%	1	质押 拆借 买断 融入	融入	10	1	建设银行	10.00%	16:48	13:48:16

资金意向：共6笔(融入4笔/融出2笔)，2.5亿(融入1.9亿/融出0.6亿)

6.4.5.2 资金意向报价管理

资金意向提交成功后，在【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价-货币市场”路径下打开），选择“资金意向”市场后，可查看已经提交或保存的资金意向，并进行管理。

可以选中单笔/多笔报价，点击按钮终止报价；也可以双击某笔报价，修改部分报价要素后，点击按钮更新报价。对状态为“待发送”的报价，可以在勾选框选中之后直接点击“提交”。

我的报价-货币市场

质押式回购

买断式回购-单券

买断式回购-多券

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演-发行人

存单路演-投资人

导入

导出

本方方向

全部

融入

融出

本方状态

全部

待发送

已发送

期限(天)

本方

Q

成交方式

全部

质押

拆借

买断单券

买断多券

融出

融入

融入

本方方向

本方状态

本方

期限(天)

报价量(万元)

成交方式

意向内容

发送范围

价格

有效时间

剩余报价量(万元)

意向报

融出

已发送

场务测试

1

2,000

质押/拆借/买断单券/买断多券

—

全市场

3.12%

17:00

2,000

211221

融入

待发送

场务测试

1

2,000

质押/拆借/买断单券/买断多券

—

全市场

3.12%

17:00

2,000

211221

融入

已发送

场务测试

1

1,000

质押/拆借/买断单券/买断多券

—

全市场

1.00%

17:00

1,000

211221

取消

提交

资金意向: 共3笔(融入2/融出1), 0.5亿(融入0.3/融出0.2)

6.4.5.3 资金意向板和报价行情

(1) 逐条查看意向报价。用户通过可点击“—公开报价—报价行情”菜单路径，选择【资金意向板】界面，可以查看当日市场的逐条资金意向报价信息。用户可设置方向、期限、报价量、机构类型、成交方式等查看符合筛选条件的意向报价。

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

☰

(2) 查看意向报价统计信息。用户通过点击【资金意向板】右上方的“资金意向走势统计”打开行情统计界面，可以查看当前全市场“融入”“融出”的笔数和报价量，以及“今日”和“昨日”意向报价笔数及报价量的走势图。点击上方返回资金意向板。

报价行情

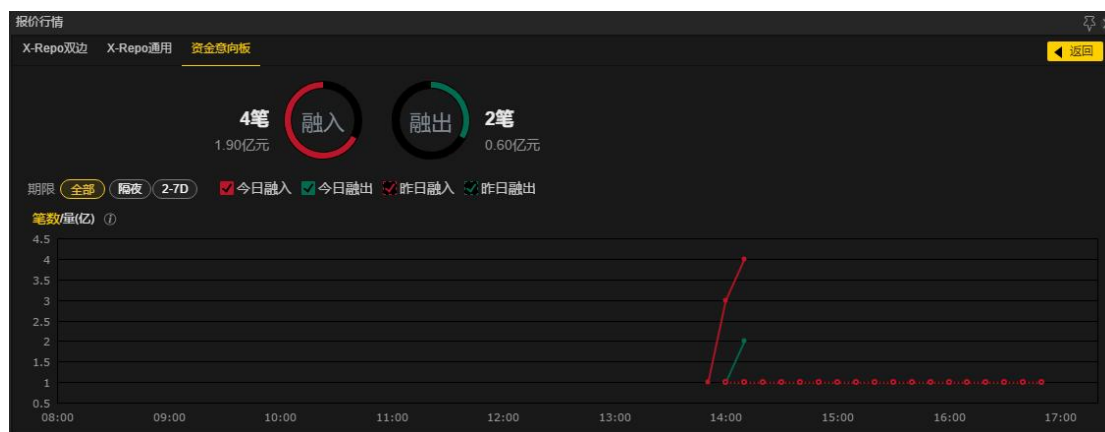
X-Repo双边 X-Repo通用 资金意向板

头寸 ☐ 已平 ☒ 未平 待入(亿) 待出(亿)

方向 ☒ 全部 ☐ 融入 ☐ 融出 期限(天) - 报价量 成交方式 机构类型 仅看 分钟 ☐ 仅看关注 ☐ 仅看自营

报价方	交易员	意向内容	剩余量(亿)	成交方式	方向	期限(天)	报价量(亿)	报价机构	价格	有效时间	最后更新时间
☆ 浦发银行	陈敏	出 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押 拆借 买断	融出	1	0.3	浦发银行	1.25%	16:55	13:55:42
☆ 中国银行	白娟	借 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押 拆借 买断	融入	1	0.3	中国银行	1.25%	16:59	14:00:16
☆ 中国银行	白娟	出 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押 拆借 买断	融出	1	0.3	中国银行	1.25%	16:59	14:00:16
☆ 浦发银行	陈敏	借 1天 0.5亿 @2.31%	0.5	质押 拆借 买断	融入	1	0.5	浦发银行	2.31%	16:55	13:55:52
☆ 农业银行	陈诚	借 1天 0.1亿 @1.23%	0.1	质押 拆借 买断	融入	1	0.1	农业银行	1.23%	16:52	13:52:24
☆ 建设银行	A陈志鹏	借 10天 1亿 @10.00%	1	质押 拆借 买断	融入	10	1	建设银行	10.00%	16:48	13:48:16

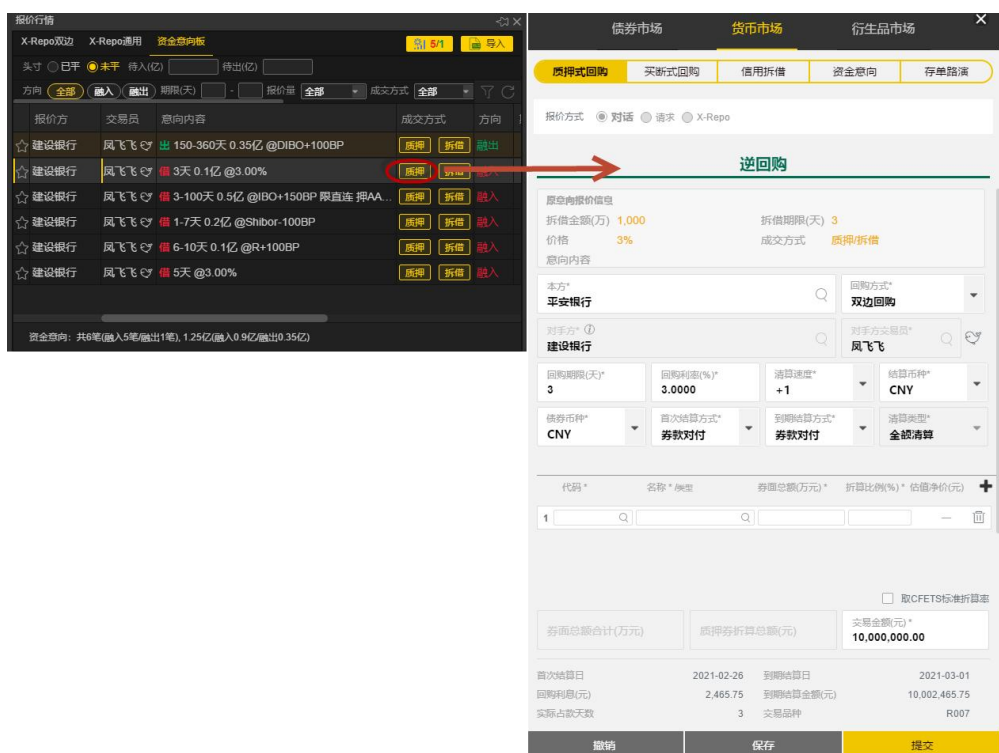
资金意向: 共6笔(融入4笔/融出2笔), 2.5亿/融入1.9亿/融出0.6亿



6.4.5.4 资金意向转对话报价

用户可将资金意向板上报价转为质押式回购、信用拆借对话报价或买断式回购单券/多券对话报价进行发送。

(1) 资金意向转质押式回购对话报价：用户在【资金意向板】，当任意身份下具有“质押式回购”权限时，可以通过点击任意一笔报价里“成交方式”中的 **质押** 按钮，打开【我要报价-质押式回购-对话报价】界面，要素填写完整后进行提交或保存，则完成一笔质押式回购对话报价的保存或发送。（对话报价后续操作详见“6.4.1 对话报价”章节）。



(2) 资金意向转信用拆借对话报价：用户在【资金意向板】，当自营身份或代理身份下具有“信用拆借”权限时，可以通过点击任意一笔报价里“成交方式”中的 **拆借** 按钮，打开【我要报价-信用拆借】对话报价界面，要素填写完整后进行提交或保存，则完成一笔信用拆借对话报价的保存或发送（对话报价后续操作详见“6.4.1 对话报价”章节）。

报价行情

X-Repo双边 X-Repo通用 **资金意向板** 5/1 导入

头寸: 已平 未平 待入(亿) 待出(亿)

方向: 全部 融入 融出 期限(天) 报价量 全部 成交方式 全部

报价方	交易员	意向内容	成交方式	方向
☆ 建设银行	凤飞飞	出 150-360天 0.35亿 @DIBO+100BP	质押 拆借 融出	
☆ 建设银行	凤飞飞	借 3天 0.1亿 @3.00%	质押 拆借 融入	
☆ 建设银行	凤飞飞	借 3-100天 0.5亿 @IBO+150BP 限直连 押AA...	质押 拆借 融入	
☆ 建设银行	凤飞飞	借 1-7天 0.2亿 @Shibor-100BP	质押 拆借 融入	
☆ 建设银行	凤飞飞	借 6-10天 0.1亿 @R+100BP	质押 拆借 融入	
☆ 建设银行	凤飞飞	借 5天 @3.00%	质押 拆借 融入	

资金意向: 共6笔(融入5笔融出1笔), 1.25亿(融入0.9亿融出0.35亿)

拆出

原意向报价信息

拆借金额(万) 1,000 拆借期限(天) 3

价格 3% 成交方式 质押/拆借

意向内容

本方* ① 平安银行

对手方* ① 建设银行

对手方交易员* 凤飞飞

拆借期限(天)* 3 基准利率* 固定利率 拆借利率(%)* 3.0000

拆借金额(万元)* 1000.00 清算速度* +1

补充条款

首次结算日 2021-02-26 到期还款日 2021-03-01

拆借利息(元) 2,500.00 到期还款金额(元) 10,002,500.00

实际占款天数 3 交易品种 IBO007

撤销 保存 提交

(3) 资金意向转买断式回购单券/多券对话报价：用户在【资金意向板】，当任意身份下具有“买断式回购”权限时，可以通过点击任意一笔报价里“成交方式”中的**买断**按钮，打开【我要报价-买断式回购-对话报价】界面，选择“单券”或“多券”，要素填写完整后进行提交或保存，则完成一笔买断式回购对话报价的保存或发送。（对话报价后续操作详见“6.4.1 对话报价”章节）。

报价行情

X-Repo双边
X-Repo通用
资金意向板

5142
导入

头寸
已平
未平
待入(亿)
待出(亿)

方向
全部
融入
融出
期限(天)
-
-
报价量
全部
成交方式
全

报价方	交易员	意向内容	剩余量(亿)	成交方式
☆ 中国银行	白娟	出 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押/拆借/买断
☆ 浦发银行	陈敏	出 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押/拆借/买断
☆ 中国银行	白娟	借 1天 0.3亿 @1.25%	0.3	质押/拆借/买断
☆ 浦发银行	陈敏	借 1天 0.5亿 @2.31%	0.5	质押/拆借/买断
☆ 农业银行	陈诚	借 1天 0.1亿 @1.23%	0.1	质押/拆借/买断
☆ 建设银行	A陈志鹏	借 10天 1亿 @10.00%	1	质押/拆借/买断

资金意向: 共6笔(融入4笔/融出2笔), 2.5亿(融入1.9亿/融出0.6亿)

债券市场
货币市场
衍生品市场
一级市场

质押式回购
买断式回购
信用拆借
同业存款
资金意向
存单路演

天断类型
单券

逆回购

原意向报价信息

期限(天) 1
成交方式 质押/拆借/买断单券/买断多券

报价量(万) 3,000
剩余量(万) 3,000
价格 1.25%

意向内容 -

本方* 农业银行

对手方* ① 中国银行
对手方交易员* 白娟

回购期限(天)* 1
回购利率(%)* 1.2500
清算速度* +0
清算币种* CNY

首次结算方式* 券款对付
到期结算方式* 券款对付
清算类型* 全额清算
债券币种* CNY

代码*
名称*
券面总额(万元)*

首次净价(元)*
首次收益率(%)*
到期净价(元)*
到期收益率(%)*

首次结算金额(元)
首次结算日 2022-01-10
到期结算金额(元)
到期结算日 2022-01-11

首次应计利息(元)
到期应计利息(元)
首次全价(元)
到期全价(元)

实际占款天数 1
交易品种 OR001

撤销
保存
提交

6.4.5.5 报价信息查询

资金意向报价的历史报价信息，可在“—信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-货币市场】界面，选择资金意向，查看历史的报价。用户可设置方向、日期、期限、转对话状态、意向报价编号等查看符合筛选条件的意向报价。点击一笔意向报价，可查看报价详情及已转（如有）对话报价信息。

报价信息查询-货币市场										
质押式回购 买断式回购 信用拆借 资金意向 存单路演询价-发行人 存单路演询价-投资人										
本方向		全部	融入	融出	日期	2021/03/10	2021/03/10	期限(天)		
				转对话	全部	未转	已转	意向报价编号		
意向报价编号	本方向	本方	本方交易员	转对话	报价量(万元)	期限(天)	价格	成交方式	有效时间	最后更新时间
210310042201007047	融出	中国银行	索丽娜	未转	900	6-300	—	质押/拆借	2021/03/10 17:00	2021/03/10 16:18:46
210310042202003464	融入	中国银行	索丽娜	未转	900	9	—	质押/拆借	2021/03/10 15:54	2021/03/10 15:54:00
210310042201003463	融入	中国银行	索丽娜	未转	—	2	—	质押/拆借	2021/03/10 13:27	2021/03/10 13:27:00
210310042201003179	融入	中国银行	王贝贝	未转	1,000	5	5.00%	质押/拆借	2021/03/10 11:59	2021/03/10 11:59:00
210310042201000001	融出	中国银行	中国银行姜一	未转	100	1-10	1.00%	质押/拆借	2021/03/10 10:09	2021/03/10 10:09:00
210310042201000002	融出	中国银行	中国银行姜一	未转	100	1-100	1.00%	质押/拆借	2021/03/10 10:09	2021/03/10 10:09:00
210310042202000001	融入	中国银行	中国银行姜一	已转	100	1-10	1.00%	质押/拆借	2021/03/10 10:09	2021/03/10 08:32:19
210310042202000002	融入	中国银行	中国银行姜一	已转	100	1-100	1.00%	质押/拆借	2021/03/10 10:09	2021/03/10 08:10:07

资金意向: 共8笔(融入5笔/融出3), 0.32亿(融入0.21亿/融出0.11)

报价详情			
最后更新时间 2021/03/10 08:10:07		意向报价编号 210310042202000002	
本方向	融入	本方	中国银行
本方交易员	中国银行姜一	转对话	已转
报价量(万元)	100	期限(天)	1-100
价格	1.00%	成交方式	质押/拆借
有效时间	2021/03/10 10:09	报价状态	撤销
发送范围	全市场		
意向内容	—		
对话报价编号	210310060901000001	市场	质押式回购
本方向	正回购	对手方	建设银行
对手方交易员	建设银行姜一	对手方机构	建设银行
交易金额	10,000,000.00	回购期限	1
回购利率	1.0000	清算速度	T+1
报价状态	有效	最后更新时间	2021/03/10 08:10:07

6.4.6 担保品调整

6.4.6.1 发起担保品调整

可通过发起担保品调整报价，对存续期质押式回购交易进行质押券替换。对已经达成的质押式回购成交，任意身份下具有“质押式回购-回购交易”或“质押式回购-匿名交易”权限的用户，在“-我的交易-担保品调整”路径下的【质押式回购-待处理】界面，点击“”，打开【质押式回购-未到期成交】界面，选择需要替换质押券的成交，双击进入【质押式回购-质押券替换】白屏界面，维护新的质押券信息后提交，即可发起一笔担保品调整报价。

担保品调整: 货币市场

质押式回购-待处理

质押式回购-已调整

发起质押券替换

状态

全部

已发送

待发送

待成交

本方向

全部

正回购

逆回购

回购期限(天)

本方

Q

对手方

Q

对手方机构

Q

成交编号

状态

本方

对手方

对手方交易员

本方向

交易金额

回购期限(天)

回购利率(%)

清算速度

回购利

未查询到数据

人民币质押式回购: 共0笔 (正回购0/逆回购0), 0亿 (正回购0/逆回购0), 净融资0亿

担保品调整

质押式回购-未到期成交

本方方向全部正回购逆回购成交编号本方对手方对手方机构代码/名称回购期限(天)成交日期

仅展示位于首次结算日(不含)与到期结算日(不含)之间的未到期成交记录。请双击发起质押券替换

成交编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	本方交易员	代理方交易员	本方代理机构
CR20220815211475	逆回购	中国农业银行	建设银行	建设银行	30,000,000.00	100	3.0000	陈诚	—	—
CR20220815211472	逆回购	中国农业银行	建设银行	建设银行	30,000,000.00	30	4.0000	陈诚	—	—

人民币质押式回购：共2笔（正回购0/逆回购2），0.6亿（正回购0/逆回购0.6），净融资-0.6亿

K<1/>X共2条

质押式回购-质押券替换

正回购逆回购

本方* ① 中国农业银行

回购方式* 双边回购

对手方* ① 建设银行

对手方交易员* 白明浩

回购期限(天)* 30

回购利率(%)* 4.0000

清算速度* +0

结算币种 CNY

债券币种 CNY

首次结算方式* 券款对付

到期结算方式* 券款对付

清算类型* 全额清算

原质押券明细

	代码*	名称/ 类型*	券面总额(万元)*	折算比例(%)*	估值净价(万元)*
1	018006	国开1702	4,290	70.00	100.9130

新质押券明细

	代码*	名称/ 类型*	券面总额(万元)*	折算比例(%)*	估值净价(万元)*	
1					-	

一键带入原质押券 取CFETS标准折算率

原券面总额合计(万元) 4,290 原质押券折算总额(元) 30,030,000.00

新券面总额合计(万元) 新质押券折算总额(元)

首次结算日 2022/08/15 到期结算日 2022/09/14

回购利息(元) 98,630.14 到期结算金额(元) 30,098,630.14

实际占款天数 30 交易金额(元) 30,000,000.00

交易品种 R1M

保存提交

6.4.6.2 担保品调整报价管理

1. 担保品调整报价发送成功后，可在“-我的交易-担保品调整”路径下的【质押式回购-待处理】界面查看已经发出的担保品调整报价，并进行担保品调整报价管理，选中需要管理的担保品调整报价双击后进入【质押式回购-质押券替换】白屏界面，修改需要变更

要素后点击“”或直接点击“”，对已选担保品调整报价进行修改或撤销。

质押式回购-质押券替换

正回购

逆回购

本方* ①
中国农业银行

回购方式*
双边回购

对手方* ①
建设银行

对手方交易员*
白明浩

回购期限(天)*
100

回购利率(%)*
3.0000

清算速度*
+0

结算币种
CNY

债券币种
CNY

首次结算方式*
券款对付

到期结算方式*
券款对付

清算类型*
全额清算

原质押券明细

代码*	名称/ 类型*	券面总额(万元)*	折算比例(%)*	估值净价(万元)*
1 098079	09华润债02	3,530	85.01	103.7671

新质押券明细

代码*	名称/ 类型*	券面总额(万元)*	折算比例(%)*	估值净价(万元)
1 东方-2022(	东方-202209	3,500	80.00	-

一键带入原质押券

取CFETS标准折算率

原券面总额合计(万元)	3,530	原质押券折算总额(元)	30,008,530.00
新券面总额合计(万元)	3,500	新质押券折算总额(元)	28,000,000.00
首次结算日	2022/08/15	到期结算日	2022/11/23
回购利息(元)	246,575.34	到期结算金额(元)	30,246,575.34
实际占款天数	100	交易金额(元)	30,000,000.00
交易品种	R4M		

撤销

提交

2. 对于收到的担保品调整报价，可在“-我的交易-担保品调整”路径下的【质押式回购-待处理】界面查看，并进行担保品调整报价管理，选中需要管理的担保品调整报价双击进入【质押式回购-质押券替换】白屏界面，点击“”或“”，对已选担保品调整报价进行成交或拒绝。

质押式回购-质押券替换

正回购

逆回购

本方*
建设银行

回购方式*
双边回购

对手方*
中国农业银行

对手方交易员*
陈诚

回购期限(天)*
100

回购利率(%)*
3.0000

清算速度*
+0

结算币种
CNY

债券币种
CNY

首次结算方式*
券款对付

到期结算方式*
券款对付

清算类型*
金额清算

原质押券明细

	代码*	名称/ 类型*	券面总额(万元)*	折算比例(%)*	估值净价(万元)*
1	098079	09华润债02	3,530	85.01	103.7671

新质押券明细

	代码*	名称/ 类型*	券面总额(万元)*	折算比例(%)*	估值净价(万元)
1	东方-20220	东方-202209	3,500	90.00	-

原券面总额合计(万元)
3,530

原质押券折算总额(元)
30,008,530.00

新券面总额合计(万元)
3,500

新质押券折算总额(元)
31,500,000.00

首次结算日
2022/08/15

到期结算日
2022/11/23

回购利息(元)
246,575.34

到期结算金额(元)
30,246,575.34

实际占款天数
100

交易金额(元)
30,000,000.00

交易品种
R4M

拒绝

成交

3. 对于已调整担保品的成交，可在“-我的交易-担保品调整”路径下的【质押式回购-已调整】界面查看，双击可查看成交单，在成交单附件协议中有担保品调整信息。

担保品调整-货币市场

质押式回购-待处理

质押式回购-已调整

本方方向

全部

正回购

逆回购

本方

对手方

对手方机构

对手方交易员

回购期限(天)

成交编号

	成交编号	更新时间	本方	本方方向	对手方	对手方交易员	对手方机构	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	本方交易
☐	CR20220902200007	2022/09/02 15:59:44	中国银行	逆回购	中信证券	沈阳	中信证券	100,000.00	12	1.0000	杨乐
☐	CR20220902200006	2022/09/02 15:54:19	中国银行	逆回购	中信证券	沈阳	中信证券	100,000.00	12	1.0000	杨乐
☐	CR20220827200004	2022/09/02 13:54:45	中国银行	正回购	中信证券	沈阳	中信证券	100,000.00	23	2.0000	杨乐
☐	CR20220829300042	2022/08/30 17:00:05	中国银行	逆回购	海通证券金中	杜玲	海通证券	100,000,000...	32	5.0000	白娟
☐	CR20220823300010	2022/08/30 16:53:51	中国银行	正回购	中信证券	沈阳	中信证券	68,021,000.00	30	1.0326	杨乐
☐	CR20220823300045	2022/08/27 15:04:08	中国银行	正回购	中信证券	沈阳	中信证券	52,245,000.00	30	1.2340	杨乐
☐	CR20220823300046	2022/08/27 15:03:23	中国银行	正回购	中信证券	沈阳	中信证券	52,245,000.00	30	1.2340	杨乐
☐	CR20220823300037	2022/08/26 17:18:28	中国银行	正回购	中信证券	沈阳	中信证券	31,332,000.00	30	1.2340	杨乐

人民币质押式回购：共62笔（正回购33/逆回购29），85.546313亿（正回购72.825163/逆回购12.72115），净融资60.104013亿

质押式回购成交单



成交日期 2022/09/01

成交编号 CR20220902200007

正回购方 中信证券股份有限公司		逆回购方 中国银行股份有限公司	
回购期限(天)	回购利率(%)	交易金额(元)	到期结算金额(元)
12	1.0000	100,000.00	100,032.88
券面总额合计(万元)	回购利息(元)	首次结算方式	到期结算方式
20	32.88	券款对付	券款对付
首次结算日	到期结算日	实际占款天数	交易品种
2022/09/01	2022/09/14	12	R014
债券代码	债券名称	券面总额(万元)	折算比例(%)
211402	211402国债2	20	79.00

正回购方信息

机构	中信证券股份有限公司
法定代表人	-
地址	-
交易员/电话	沈阳/010-59511111
资金账户户名	中信证券股份有限公司
资金开户行	中信银行北京瑞城中心支行
资金账号	11111111111111111111
支付系统行号	310301000000000000
托管账户户名	中信证券
托管账号	11111111111111111111
托管机构	国债登记结算公司

逆回购方信息

机构	中国银行股份有限公司
法定代表人	你号
地址	复兴门内大街1号 111
交易员/电话	杨乐/
资金账户户名	中国银行总行
资金开户行	中国银行总行
资金账号	11111111111111111111
支付系统行号	11111111111111111111
托管账户户名	中国银行
托管账号	11111111111111111111
托管机构	国债登记结算公司

附加协议:
2022/09/02 中国银行股份有限公司—杨乐 和 中信证券股份有限公司—沈阳, 就 CR20220902200007 达成附加协议。15:59:44 增加了质押券债券代码 1989574 券面总额(万元)为 10, 折算比例(%)为 32.00。

成交序列号: 000008

6.4.6.3 历史担保品调整报价信息查询

担保品调整报价的历史报价信息,可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下,打开【报价信息查询-货币市场-担保品调整】界面,查看历史的担保品调整报价。



6.4.7 成交查询

6.4.7.1 当日成交

可在“--我的交易--当日成交”菜单路径下，打开【当日成交-货币市场】界面。

点击“质押式回购”tab，查看质押式回购当日成交信息，可单击某条成交记录或点击左侧图标，展开查看质押券明细；也可在筛选条件搜索框输入债券代码/名称，查询质押券中包含该只债券的成交信息。双击选中的成交记录，可查看对应成交单。其中，质押式回购跨托管交易成交单载有每只券对应的托管机构，各托管机构对应的交易金额和到期结算金额，以及交易双方对应到各托管机构的资金托管账户信息。

点击“买断式回购-单券或买断式回购-多券”tab，查看买断式回购当日成交信息，双击选中的某条成交记录，可查看对应成交单。

点击“信用拆借”tab,查看信用拆借当日成交信息。通过界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据。双击选中的成交记录，可查看对应成交单。

当日成交-货币市场										
质押式回购										
交易方式 全部 对话 RFQ X-Repo 本方方向 全部 正回购 逆回购 回购期限(天) 本方 对手方 对手方机构 代码/名称 折算比例(%) 券面转										
成交编号	本方方向	本方	对手方	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	代码	名称	折算比例(%)	券面转
CR20200302300008	逆回购	交通银行	建设银行	23,100.00	3	2.5687	zllgz	zll国债	0.0770	
CR20200302300007	逆回购	交通银行	建设银行	4,000,000.00	1	2.4560	zllgz	zll国开债	20.0000	
CR20200302300006	逆回购	交通银行	建设银行	10,000,000.00	1	1.0000	zllgz	zll国开债	100.0000	
CR20200302300005	逆回购	交通银行	建设银行	67,777,770.00	1	1.0000	zllgz	zll国债	100.0000	
CR20200302300004	逆回购	交通银行	建设银行	35,000,000.00	7	3.6600	2019121005	企业债A+_USD	50.0000	
CR20200302300003	逆回购	交通银行	建设银行	70,000,000.00	7	12.0000	2019121111	中票_浮动AA11...	100.0000	
CR20200302200003	逆回购	交通银行	建设银行	1,000,000.00	1	2.4500	zllqyz	zll企业债	100.0000	
CR20200302200001	逆回购	交通银行	建设银行	10,000,000.00	1	6.6600	zllqyz	zll企业债	100.0000	
CR20200302300001	逆回购	交通银行	建设银行	101,000,000.00	100	10.0000	2	2	2	1
人民币质押式回购：共9笔(正回购0/逆回购9)，2.988亿(正回购0/逆回购2.988)										

当日成交-货币市场										
质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 同业存款 信用拆借										
本方方向 全部 正回购 逆回购 回购期限(天) 本方 对手方 对手方机构 代码/名称 交易品种 成交编号										
成交编号	本方方向	本方	对手方	回购期限(天)	回购利率(%)	首次结算金额	代码	名称	券面总额(万)	首次净价
OR20210622300411	逆回购	国泰君安证券	广发银行	1	1.2316	99,203,296.70	qiao0409006	qiao0409006	10,000	99.0000
人民币买断式回购(单券)：共1笔(正回购0/逆回购1)，0.992032967亿(正回购0/逆回购0.992032967)，净融资-0.992032967亿										

当日成交-货币市场										
质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 同业存款 信用拆借										
本方方向 全部 正回购 逆回购 回购期限(天) 本方 对手方 对手方机构 代码/名称 交易品种 成交编号										
成交编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	回购期限(天)	回购利率(%)	首次结算金额	代码	名称	折算比例(%)
OR20210622900041	逆回购	国泰君安证券	广发银行	广发银行	3	2.3000	100,000,000.00	w1927	w1927代码	100.00
人民币买断式回购(多券)：共1笔(正回购0/逆回购1)，1亿(正回购0/逆回购1)，净融资-1亿										

当日成交-货币市场										
质押式回购 买断式回购 信用拆借										
本方方向 全部 拆入 拆出 拆借期限(天) 交易品种 对手方 成交编号 清算速度 全部 +0 +1 场次类型 全										
成交编号	本方方向	本方	对手方	拆借金额(万)	拆借期限(天)	拆借利率(%)	清算速度	补充条款	拆借利息	到期还款金
IBO20210224300012	拆入	农业银行	中国银行	10.0000000...	10	0.230000000	T+1	—	7.03	100,007.1
IBO20210224300011	拆入	农业银行	中国银行	10.0000000...	10	0.230000000	T+1	—	7.03	100,007.1
IBO20210224300010	拆入	农业银行	中国银行	10.0000000...	10	0.230000000	T+1	—	7.03	100,007.1

6.4.7.2 成交查询

可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-货币市场】界面，查看质押式回购或买断式回购历史的成交信息。

点击“质押式回购”tab，可导出当前查询界面的成交信息，也可在筛选条件中“是否展开质押券明细”选择“是”，导出带质押券明细信息的成交记录。双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。其中，质押式回购跨托管交易成交单载有每只券对应的托管机构，各托管机构对应的交易金额和到期结算金额，以及交易双方对应到各托管机构的资金托管账户信息。



交易方式	全部	对话	RFQ	X-Repo	本方方向	全部	正回购	逆回购	对手方	Q	日期	2021/05/10	2021/06/22	交易品种	导出	下载成交单
成交编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	交易金额	回购期限(天)	回购利率(%)	代码	名称							
CR20210609200003	逆回购	广发银行	南方电网年金中信...	中信证券	10,000,000.00	90	2.3300	1480501	14安...							
CR20210609200002	逆回购	广发银行	南方电网年金中信...	中信证券	20,000,000.00	3	2.3300	1080106	10铁...							

人民币质押式回购：共2笔(正回购0逆回购2)，0.3亿(正回购0逆回购0.3)，净融资-0.3亿

点击 X-Repo 匹配成交明细页面查看 X-Repo 匹配成交信息。点击可导出当前查询界面的成交信息，也可在筛选条件中“是否展开质押券明细”选择“是”

，导出 X-Repo 匹配明细信息的成交记录。双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。其中，质押式回购跨托管交易成交单载有每只券对应的托管机构，各托管机构对应的交易金额和到期结算金额，以及交易双方对应到各托管机构的资金托管账户信息。



点击“买断式回购-单券或买断式回购-多券”tab，可导出当前查询界面的成交信息，双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。



成交查询-货币市场

质押式回购成交明细 X-Repo匹配成交明细 买断式回购成交明细-单券 **买断式回购成交明细-多券** 信用拆借成交明细 同业存放成交明细 派息明细查询

本方方向 **全部** 正回购 逆回购 对手方 Q 代码/名称 Q 日期 2021/06/22 - 2021/06/22 交易品种 Q 导出 下载成交单

成交编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	回购期限(天)	回购利率(%)	首次结算金额	代码	名称
OR20210622900041	逆回购	国泰君安证券	广发银行	广发银行	3	2.3000	100,000,000.00	w1927	w1927

人民币买断式回购(多券): 共1笔(正回购0/逆回购1), 1亿(正回购0/逆回购1), 净融资-1亿

1 / 1

成交查询-货币市场

质押式回购成交明细 X-Repo匹配成交明细 买断式回购成交明细-单券 **买断式回购成交明细-多券** 信用拆借成交明细 同业存放成交明细 派息明细查询

本方方向 **全部** 正回购 逆回购 对手方 Q 代码/名称 Q 日期 2021/06/22 - 2021/06/22 交易品种 Q 导出 下载成交单

成交编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	回购期限(天)	回购利率(%)	首次结算金额	代码	名称
OR20210622900041	逆回购	国泰君安证券	广发银行	广发银行	3	2.3000	100,000,000.00	w1927	w1927

人民币买断式回购(多券): 共1笔(正回购0/逆回购1), 1亿(正回购0/逆回购1), 净融资-1亿

1 / 1

点击“买断式回购-多券”tab，可导出当前查询界面的成交信息，也可在筛选条件中“是否展开债券明细”选择“是”，导出带债券明细信息的成交记录双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。

点击“派息明细查询”按钮，可以查看和导出某笔成交债券派息明细。



点击“信用拆借成交明细”tab，查看信用拆借历史的成交信息。可导出当前查询界面的成交信息，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据。双击选中的成交记录，可查看对应成交单。

成交编号	本方方向	本方	对手方	拆借金额(万)	拆借期限(天)	拆借利率(%)	清算速度	补充条款	本方交易员	对手方交易员
IBO20210621300005	拆出	广发银行	北京银行	100.00	250	2.3000	T+0	—	连昕昕	崔健
IBO20210621300004	拆入	广发银行	北京银行	100.00	180	2.0000	T+0	—	连昕昕	崔健
IBO20210621300003	拆入	广发银行	北京银行	100.00	60	10.0000	T+0	das	连昕昕	崔健
IBO20210621300002	拆入	广发银行	北京银行	100.00	10	2.5000	T+0	—	连昕昕	崔健
IBO20210621300001	拆入	广发银行	北京银行	50,000.00	30	2.3000	T+0	—	连昕昕	崔健

人民币信用拆借: 共5笔(拆入4拆出1), 5.04亿(拆入5.03拆出0.01), 净融资5.02亿

6.4.8 成交行情

6.4.8.1 实时成交行情

可在“--成交行情--实时行情”菜单路径下，打开【实时行情-货币市场】界面，可通过切换 tab 页，查看质押式回购、X-repo、买断式回购、信用拆借的实时行情数据。在质押式回购、买断式回购、信用拆借 tab 页下，可查看价格走势（7D）图。质押式回购 Tab 页点击右上角“”按钮，进行“行情类别”筛选，可切换 DR 或 R 查看对应行情信息。

信用拆借 Tab 页点击右上角“”按钮，进行“行情类别”筛选，可切换 DIBO 或 IBO 查看对应行情信息。点击右上角“”的彩虹条，可以查看资金指数的详细界面信息。

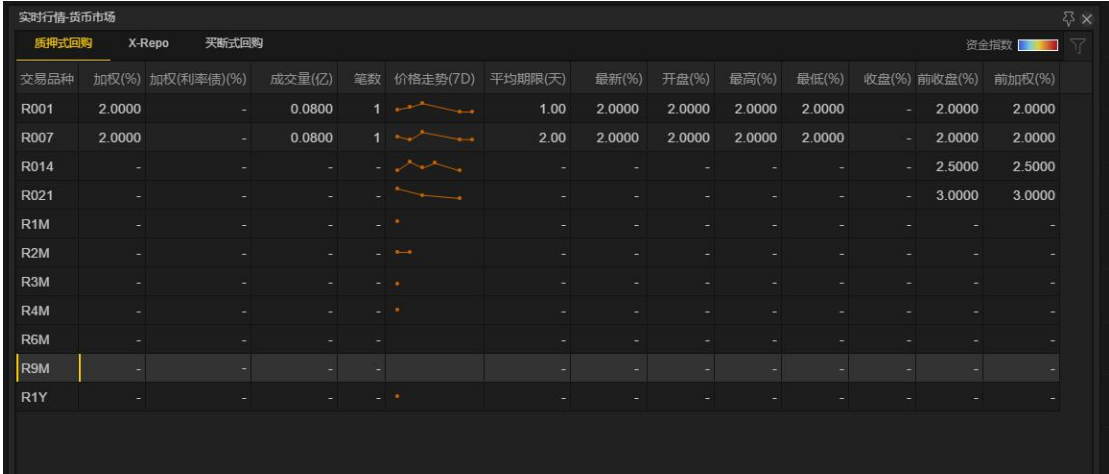


图 1：质押式回购实时行情界面



图 2：信用拆借实时行情界面

双击某交易品种“价格走势（7D）”图，打开“价量走势-xx”界面，可查看更多统计维度的价量走势情况，包括当日分钟走势图（选择“1 分”），以及最近 31 日的“30 分/60 分/日”走势图。

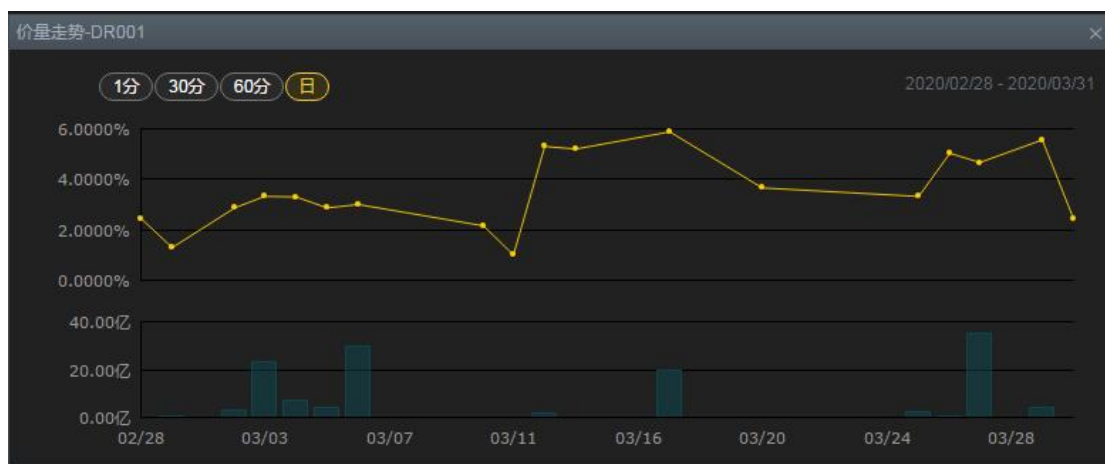


图 3：质押式回购价量走势图界面



图 4：信用拆借价量走势图界面

实时行情-货币市场

交易品种	加权(%)	成交量(亿)	笔数	最新(%)	开盘(%)	最高(%)	最低(%)	前加权(%)
R001	2.0000	1.0000	1	2.0000	2.0000	2.0000	2.0000	-
R007	2.1000	1.0000	1	2.1000	2.1000	2.1000	2.1000	-
R014	3.0000	1.0000	1	3.0000	3.0000	3.0000	3.0000	-
R021	-	-	-	-	-	-	-	-
R1M	-	-	-	-	-	-	-	-
R3M	-	-	-	-	-	-	-	-

图 5：X-repo 实时行情界面

实时行情-货币市场											
质押式回购		X-Repo		买断式回购							
交易品种	加权(%)	成交量(亿)	笔数	价格走势(7D)	平均期限(天)	最新(%)	开盘(%)	最高(%)	最低(%)	收盘(%)	前收盘(%)
OR001	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR007	3.0082	0.0982	1		2.00	3.0082	3.0082	3.0082	3.0082	-	-
OR014	2.9992	0.0982	1		14.00	2.9992	2.9992	2.9992	2.9992	-	-
OR021	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR1M	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR2M	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR3M	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR4M	10.5659	0.0010	1		100.00	10.5659	10.5659	10.5659	10.5659	-	-
OR6M	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR9M	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-
OR1Y	-	-	-		-	-	-	-	-	-	-

图 6：买断式回购实时行情界面



图 7：资金指数界面

6.4.8.2 历史行情查询

可在“--成交行情--历史行情”菜单路径下，打开【历史行情-货币市场】界面。

点击“质押式回购”tab，可查询近一年的成交行情信息，并支持对查询结果的导出。“行情类别”可选择 DR 或 R，查看对应的行情信息。

历史行情-货币市场

质押式回购 买断式回购 信用拆借

交易方式 **汇总** 对话 行情类别 **DR** **R** 日期 2020/12/30 ~ 2020/12/30 交易品种 Q 结算币种 **CNY** 导出

日期	交易品种	加权平均利率(%)	成交量(亿)	成交笔数	平均回购期限(天)	最新利率(...)	开盘利率(...)	最
20201229	DR007	2.2222	0.5000	1	6.00	2.2222	2.2222	
20201229	DR014	3.8959	0.3073	4	10.05	3.3333	5.0000	
20201229	DR021	14.8683	3.0000	3	21.00	15.1111	14.5726	
20201229	DR1M	5.5000	0.1000	1	22.00	5.5000	5.5000	
20201229	DR2M	10.6000	0.1000	1	35.00	10.6000	10.6000	
20201229	DR3M	5.3000	0.0360	1	80.00	5.3000	5.3000	
20201229	DR4M	6.0755	92.7770	90	106.64	4.2619	4.1632	
20201229	DR9M	6.6234	1.1940	15	224.28	8.4343	8.7374	
20201229	DR1Y	7.0282	1.3790	17	318.22	5.7495	6.7525	

历史行情-质押

质押式回购

交易方式 **汇总** 对话 行情类别 **DR** **R** 日期 2020/03/03 ~ 2020/03/03 交易品种 Q 结算币种 **CNY** **USD** 导出

日期	交易品种	加权平均利率(%)	加权平均利率(利率债)(%)	成交量(亿)	成交笔数	平均回购期限(天)	
20200303	R001	3.3230	3.3230	23.0000	221	1.00	
20200303	R007	2.8823	2.8840	35.3630	369	4.97	
20200303	R014	2.8881	2.8357	53.0380	516	13.98	
20200303	R021	4.4428	4.4141	21.7000	213	20.86	
20200303	R1M	2.5429	2.5429	21.5000	215	29.12	
20200303	R2M	2.9957	2.9957	17.3000	173	60.00	

点击“买断式回购”tab，可查询近一年的成交行情信息，并支持对查询结果的导出。

历史行情-货币市场

质押式回购 买断式回购

日期 2020/12/02 ~ 2020/12/02 交易品种 Q 结算币种 **CNY** 导出

日期	交易品种	加权平均利率(%)	成交量(亿)	成交笔数	平均回购期限(天)	最新利率(%)	开盘利率(%)	最高利率(%)	最低利率(%)	收盘利率(%)	前收盘利率(%)	前加权利率(%)
20201202	OR001	3.6285	0.9719	4	1.00	3.0011	12.0000	12.0000	3.0011	-	2.5433	25.330
20201202	OR007	6.7503	0.3961	9	3.12	1.9994	2.2952	12.0068	1.9947	-	5.0031	2.786
20201202	OR014	15.8335	1.8904	3	12.04	20.9992	19.9993	20.9992	2.2733	-	21.0007	9.963
20201202	OR021	16.5508	4.9682	9	19.47	21.9979	17.9994	46.0002	-7.8604	-	6.0000	15.367
20201202	OR1M	4.2073	5.2558	10	24.96	4.5996	2.0002	15.0005	-3.1533	-	12.0001	19.811
20201202	OR2M	6.6920	2.8230	9	45.16	0.1177	14.9993	14.9993	0.1177	-	14.9991	15.285
20201202	OR3M	5.4960	1.6104	4	90.00	5.7979	11.9999	11.9999	3.5935	-	14.0000	41.892
20201202	OR4M	5.8883	1.5320	5	91.21	5.8026	0.2200	20.0001	0.2200	-	47.4698	47.469
20201202	OR6M	20.0001	0.1205	1	160.00	20.0001	20.0001	20.0001	20.0001	-	25.1698	13.500

点击“信用拆借”tab，可查询近一年的成交行情信息，并支持对查询结果的导出。“行情类别”可选择 DIBO 或 IBO，查看对应的行情信息。

历史行情-货币市场

质押式回购买断式回购信用拆借

行情类别DIBOIBO日期2021/02/24-2021/02/24交易品种导出

日期	交易品种	加权平均利率(%)	成交量(亿)	成交笔数	平均拆借期限(天)	最新利率(%)	开盘利率(%)	
20210224	DIBO007	4.444400000	0.4000	2	3.00	5.555500000	3.333300000	5

历史行情-货币市场

质押式回购买断式回购信用拆借

行情类别DIBOIBO日期2021/02/24-2021/02/24交易品种导出

日期	交易品种	加权平均利率(%)	成交量(亿)	成交笔数	平均拆借期限(天)	最新利率(%)	开盘利率(%)	
20210224	IBO007	4.444400000	0.4000	2	3.00	5.555500000	3.333300000	5
20210224	IBO001	5.115500000	0.0300	3	1.00	10.000000000	2.346500000	10

6.4.9 存单路演

6.4.9.1 发布存单路演

(1) 具有存单路演权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“货币市场-存单路演”，选择限额募集或者限额募集，

填写各类报价要素后，点击 ，设置投资人范围名单，勾选全市场或

者在待选区搜索投资人名单，勾选左侧的方框，被勾选的投资人名单会展示在右侧选中区，在选中区可以勾选已选中的投资人名单，点击 **删除所选** 可以删除已选的投资人名单，点击 **清空白名单** 清空已选的投资人名单，点击 **导出** 可以导出已选的投资人名单，最后点击 **提交** 按钮确认投资人范围，回到【我要报价-存单路演】页面，点击 **提交** 按钮，即可发送存单：

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购 买断式回购 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演

募集方式 ☒ 超额募集 ☐ 限额募集

主体评级 * AA 期限 * 1M 币种 * CNY

息票类型 * 零息 参考收益率(%) *

计划发行量(亿) * 路演截止日 * 2021/12/03

发行开始日 * 2021/12/04 发行结束日 缴款日 * 2021/12/05

投资人范围 **点击设置**

备注

提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

质押式回购 买断式回购 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演

募集方式 ☐ 超额募集 ☒ 限额募集

主体评级 * AA 期限 * 1M 币种 * CNY

息票类型 * 零息 参考收益率(%) *

计划发行量(亿) * 路演截止日 * 2021/12/03

发行开始日 * 2021/12/04 发行结束日 缴款日 * 2021/12/05

投资人范围 **点击设置**

备注

提交

我要报价-投资人范围

待选区

☒ 东莞银行股份有限公司资管
☒ 兴业银行股份有限公司资管
☒ 齐商银行股份有限公司资管
☒ 广发银行股份有限公司资管
☒ 乌鲁木齐市商业银行资管
☒ 中国银行股份有限公司资管
☒ 中信银行股份有限公司资管
☒ 华夏银行股份有限公司资管
☐ 浙商银行股份有限公司资管
☐ 中国工商银行股份有限公司资管
☐ 招商银行股份有限公司资管
☐ 上海农村商业银行股份有限公司资管
☐ 宁波银行股份有限公司资管
☐ 南京银行股份有限公司资管
☐ 北京银行股份有限公司资管
☐ 恒丰银行股份有限公司资管
☐ 中国光大银行资管
非金融机构
境外证券公司

选中区

		机构名称	机构类型
1	☐	中国建设银行股份有限公司	大型商业银行
2	☐	中国建设银行(亚洲)股份有限公司	境外银行
3	☐	汉口银行股份有限公司资管	商业银行资管
4	☐	上海浦东发展银行资管	商业银行资管
5	☐	交通银行股份有限公司资管	商业银行资管
6	☐	中国农业银行股份有限公司资管1	商业银行资管
7	☐	兴业银行股份有限公司资管	商业银行资管
8	☐	东莞银行股份有限公司资管	商业银行资管
9	☐	齐商银行股份有限公司资管	商业银行资管
10	☐	广发银行股份有限公司资管	商业银行资管
11	☐	乌鲁木齐市商业银行资管	商业银行资管
12	☐	中国银行股份有限公司资管	商业银行资管
13	☐	中信银行股份有限公司资管	商业银行资管
14	☐	华夏银行股份有限公司资管	商业银行资管

☐ 全市场 **提交** **删除所选** **清空白名单** **导出**

6.4.9.2 存单路演报价查看

(1) 市场存在存单路演报价时，可在“—公开报价—存单路演”菜单下查看全市场存单路演信息，在发行人设置的投资人范围中且有申购权限的用户可点击存单信息，跳转到【我要报价-投资人申购】界面，输入预申购量，调整分配申购账户后，点击提交，申购非本机构发行的存单路演。

存单路演

主体评级 全部 AAA AAA- AA+ AA AA- A+ A A- 其他 发行日 发行人

		1M		3M	6M
AAA	农业银行/谢严	1.20	的点点滴滴		
		3.00 ¹⁰⁰			
AA	招商银行/王斐	S1W+6BP ³			

投资人申购

* 注：该存单路演支持超额募集，请于下午8点前对发行人分配的申购量进行确认拒绝，过期不操作视为确认。

发行人
中国光大银行

主体评级 *
AAA

期限 *
1M

币种 *
CNY

息票类型 *
零息

参考收益率(%) *
3.00

发行日
2021/12/07

路演截止日
2021/12/06

预申购量(亿) *

分配申购账户

搜索本方

本方

招商银行

提交

222

6.4.9.3 存单路演管理

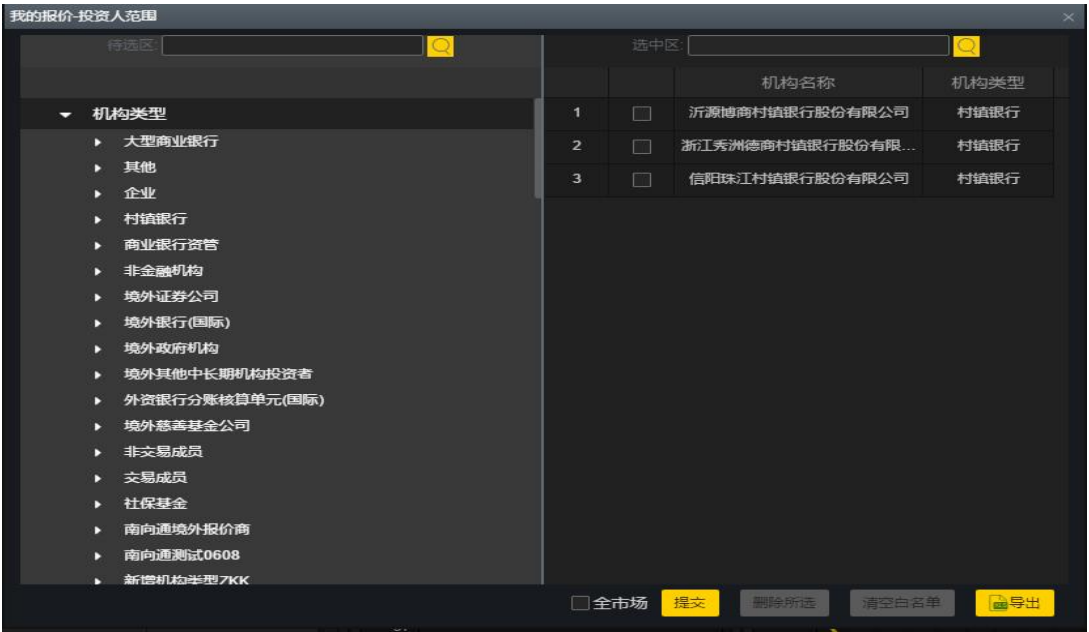
报价发送成功后，可在“--我的交易--我的报价”菜单路径下：

发行人：

(1) 可打开【我的报价】的“存单路演-发行人”Tab 页，查看已经发出的路演信息，或对路演信息进行修改、撤销、超额募集分配或终止报价操作；



(2) 点击投资人范围的可以查看投资人名单，或者修改投资人名单。



(3) 当该存单有投资人申购时，会展示，发行人可以分配申购量，点击展开预申

购总量页面，输入分配申购量，点击提交，分配完申购量。

(4) 当有一笔存单路演有多个投资人申购时，点击该路演报价最前端折叠符号可展开投资人信息。

期限	全部	1M	3M	6M	9M	1Y	募集方式	全部	超额募集	限额募集	发行日	2022/11/02	终止报价	导出
操作人	投资人范围	主体评级	息票类型	参考收益率	计划发行量(亿)	预申购总量(亿)	预申购账户数	状态	币种					
设置	AA+	零息	1.88%	20.0	2.0	1	募集中	CNY						
设置	AA+	浮息	Shibor_1M+22223...	44444.0	0.0	1	待分配	USD						

(5) 若有投资人申购状态为“预申购成功”，点击“预申购成功”可弹出路演意向单。

存单路演意向单

日期 2022/07/27 10:15:58 存单路演编号 220727202000006762

发行人	发行人交易员
期限 3M	息票类型 零息
参考收益率 2.30%	缴款日 2022/07/29
币种 CNY	发行日 2022/07/28

申购方	预申购交易员
预申购量(亿) 200.0	分配交易量(亿) 200.0
预申购编号 22072721200000...	

申购分配账户

投资人：

(1) 打开【我的报价】的“存单路演-投资人”Tab 页，查看已申购的存单路演信息，或对已申购的存单路演信息进行修改、撤销、确认操作；



期限	全部	1M	3M	6M	9M	1Y	发行日	2021/12/07	—	发行人	Q	批量撤销	批量拒绝	批量确认
	存单路演编号	交易员/发行机构	期限	主体评级	息票类型	参考收益率	本方交易员	申购状态	预申购量(亿)	更新时间				
☐	211206202000006601	陈新光/光大银行	1M	AAA	零息	3.00%	王斐	待分配	20.0	2021/12/06 15:45:1				

(2) 当【我的报价】的“存单路演-投资人”Tab 页，当发行人分配申购量后，投资人申购状态变为待确认，点击存单信息，展示【我要报价-投资人申购】，点击确认或者拒绝分配申购量。



期限	全部	1M	3M	6M	9M	1Y	发行日	2021/12/07	—	发行人	Q	批量撤销	批量拒绝	批量确认
	存单路演编号	交易员/发行机构	期限	主体评级	息票类型	参考收益率	本方交易员	申购状态	预申购量(亿)	更新时间				
☐	211206202000006601	陈新光/光大银行	1M	AAA	零息	3.00%	王斐	待确认	30.0	2021/12/06 15:45:1				

(3) 若有申购状态显示为“预申购成功”，点击可弹出路演意向单。

6.4.9.4 存单路演查询

报价结束后，可在“—信息查询—报价信息查询”菜单路径下

发行人：

(1) 打开【报价信息查询】的“存单路演查询-发行人”Tab 页，查看“已终止”状态下的

存单路演报价信息，点击投资人范围可以查看该存单的投资人名单。

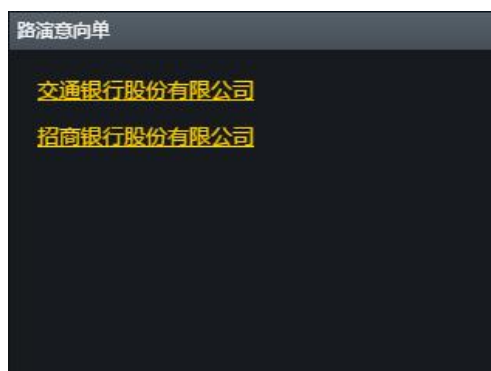
报价信息查询-货币市场					
质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演查询-发行人 存单路演查询-投资人					
期限	1M 3M 6M 9M 1Y	发行日			导出
最后更新时间	存单路演编号	状态	期限	本方交易员	申购信息
2021/11/30 15:47:43	211130202000006537	已终止	1Y	陈昕	最后更新时间 2021/11/30 15:47:43 存单路演编号 211130202000006537
2021/11/30 15:00:17	211130202000006536	已终止	1M	陈昕	机构 中国建设银行股份有限公司 预申购量(亿) 11.0
2021/11/30 14:58:53	211130202000006535	已终止	1M	陈昕	分配申购量(亿) 20 状态 确认
2021/11/30 14:58:41	211130202000006534	已终止	1M	陈昕	交易账户 建设银行
2021/11/30 14:58:09	211130202000006533	已终止	1M	陈昕	
2021/11/30 14:57:57	211130202000006532	已终止	3M	陈昕	
2021/11/30 14:57:35	211130202000006531	已终止	1M	陈昕	
2021/11/24 15:13:37	211124202000006471	已终止	3M	李松	
2021/11/24 15:11:40	211124202000006470	已终止	3M	李松	
2021/11/24 14:43:01	211124202000006469	已终止	3M	李松	
2021/11/24 14:42:35	211124202000006468	已终止	1M	李松	
2021/11/24 14:38:50	211124202000006467	已终止	1M	李松	
K < 1 / 2 > X 共63条					

(2) 双击报价信息可展开该存单的申购信息。

报价信息查询-货币市场					
质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演查询-发行人 存单路演查询-投资人 担保品调整 iDeal交易意向					
期限	1M 3M 6M 9M 1Y	募集方式	超额募集 限额募集		导出
最后更新时间	存单路演编号	募集方式	状态	意向单	申购信息
2022/10/25 10:33:20	221025202000007725	限额募集	已终止	民	最后更新时间 2022/08/02 14:24:28 存单路演编号 220802202000006931
2022/10/25 10:25:21	221025202000007728	超额募集	已终止	1M	机构 中国农业银行股份有限公司 预申购量(亿) 1.0
2022/10/25 10:11:04	221025202000007724	限额募集	已终止	1Y	分配申购量(亿) 1 状态 确认
2022/10/25 10:10:20	221025202000007722	超额募集	已终止	1M	交易账户 中国农业银行股份有限公司
2022/10/25 10:09:57	221025202000007721	超额募集	已终止	1M	
2022/10/20 14:09:46	221020202000007616	限额募集	已终止	1M	
2022/10/18 14:00:23	221018202000007561	超额募集	已终止	1Y	
2022/09/28 18:52:28	220928202000007442	限额募集	已终止	1M	
2022/09/28 18:50:42	220928202000007441	超额募集	已终止	1M	
2022/08/02 14:24:28	220802202000006931	超额募集	已终止	民	
2022/07/28 18:19:12	220728202000006807	超额募集	已终止	1M	
2022/07/28 18:18:53	220728202000006806	超额募集	已终止	1M	
K < 1 / 4 > X 共125条					

(3) 若有投资人预申购成功成功，点击“意向单”列的图标，可弹窗展示预申购成功的投资人列表。

报价信息查询-货币市场										
质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演查询-发行人 存单路演查询-投资人 担保品调整 iDeal交易意向										
期限 1M 3M 6M 9M 1Y 募集方式 超额募集 限额募集 发行日 导出										
最后更新时间	存单路演编号	募集方式	状态	意向单	期限	本方交易员	投资人范围	主体评级	息票类型	参考收益率
2022/07/27 16:48:00	220727202000006769	超额募集	已终止	限	1M	郭茜	查看	AA-	零息	2.8
2022/07/27 10:15:58	220727202000006762	超额募集	已终止	限	3M	丁昂	查看	AA-	零息	2.3
2022/06/22 10:04:27	220622202000006642	限额募集	已终止	限	1M	景新	查看	AA-	零息	2.3
2022/06/22 09:49:44	220622202000006641	超额募集	已终止	限	1M	景新	查看	AA-	零息	1.4
2022/05/27 09:49:52	220527202000006521	超额募集	已终止	限	1M	宋思慧	查看	AA-	零息	4.8
2022/05/26 11:08:05	220526202000006481	超额募集	已终止	限	1M	宋思慧	查看	AA-	零息	8.5
2022/02/10 19:45:19	220210202000006281	超额募集	已终止	限	1M	卡姆零零三	查看	AA-	零息	1.0
2022/02/07 10:39:55	220207202000006163	超额募集	已终止	限	3M	车征	查看	AA-	固息	1.8
2022/02/07 10:39:29	220207202000006162	限额募集	已终止	限	3M	车征	查看	AA-	浮息	Shibor_1W
2022/02/07 10:39:00	220207202000006161	超额募集	已终止	限	1M	车征	查看	AA	零息	1.5



(4) 点击投资人机构名称，可打开存单路演意向单。

存单路演意向单

日期 2022/07/27 10:15:58

存单路演编号 220727202000006762

发行人

发行人交易员

期限

3M

息票类型

零息

参考收益率

2.30%

缴款日

2022/07/29

币种

CNY

发行日

2022/07/28

申购方

预申购交易员

预申购量(亿)

200.0

分配交易量(亿)

200.0

预申购编号

22072721200000...

申购分配账户

投资人：

(1) 打开【报价信息查询】的“存单路演-投资人”Tab 页，查看投资人的“预申购成功”和“已撤销”状态下的申购信息。

报价信息查询-货币市场															
质押式回购		买断式回购-单券		买断式回购-多券		信用拆借		同业存款		资金意向					
存单路演查询-发行人		存单路演查询-投资人		担保品调整		iDeal交易意向									
期限	1M	3M	6M	9M	1Y	募集方式	超额募集	限额募集	发行日	—	发行人	Q	Y	C	导出
最后更新时间	预申购编号					募集方式	存单路演编号			本方交易员	预申购量(亿)	分配申购量(亿)	预申购交易账户	状态	期限
2022/10/31 13:53:28	221031212000005724					限额募集	221031202000007882			鬼思谧	5.0	—	1 限	预申购成功	1M
2022/10/26 17:10:45	221026212000005629					限额募集	221026202000007767			鬼思谧	5.0	—	1 限	预申购成功	1M
2022/10/26 16:15:45	221026212000005627					超额募集	221026202000007766			鬼思谧	—	—	1 限	已撤销	1M
2022/10/26 15:35:52	221026212000005624					限额募集	221026202000007764			鬼思谧	9.0	—	1 限	预申购成功	1M
2022/10/26 15:27:38	221026212000005621					限额募集	221026202000007758			鬼思谧	5.0	—	1 限	已撤销	1M
2022/10/26 15:12:25	221026212000005617					超额募集	221026202000007756			鬼思谧	60.0	—	1 限	已撤销	1M
2022/10/26 15:02:57	221026212000005615					限额募集	221026202000007760			鬼思谧	0.4	—	1 限	已撤销	1M
2022/10/26 14:59:02	221026212000005613					超额募集	221026202000007757			鬼思谧	30.0	30.0	1 限	预申购成功	1M
2022/10/25 16:29:15	221025212000005610					超额募集	221025202000007755			鬼思谧	66.0	—	1 限	已撤销	1M
2022/10/25 16:20:46	221025212000005609					超额募集	221025202000007735			鬼思谧	33.0	—	1 限	已撤销	1M
2022/10/25 16:20:46	221025212000005571					超额募集	221025202000007735			鬼思谧	—	—	1 限	已撤销	1M

债券市场

货币市场

一级市场

同业存款

报价方式

对话

提前支取

本方存入

本方存出

本方经办行/产品*

对手方*

对手方经办行/产品*

对手方交易员*

存款期限(天)*

存款利率(%)*

存款金额(万元)*

清算速度*

付息频率*

提前支取约定

资金账户信息

添加附件

补充条款

505

明日复明日

111

重置

批量导入

保存

提交

债券市场

货币市场

一级市场

同业存款

报价方式

对话

提前支取

本方存入

本方存出

本方经办行/产品*

对手方*

对手方经办行/产品*

对手方交易员*

存款期限(天)*

存款利率(%)*

存款金额(万元)*

清算速度*

付息频率*

提前支取约定

资金账户信息

添加附件

补充条款

505

明日复明日

111

重置

批量导入

保存

提交

(2) 也可批量提交对话报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—货币市场”路径下打开），选择对应的同业存款（交易方式选择“同业存款报价”，）点击按钮，在导出的模板中填写对话报价数据，点击按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。

我的报价-货币市场

质押式回购

买断式回购-单券

买断式回购-多券

同业存款

资金意向

存单路演-投资人

导入

导出

类型:

同业存款报价

提前支取报价

状态

全部

已发送

待发送

待成交

本方方向

全部

存入

存出

存款期限

本方经办行/产品

对手方

	本方方向	本方状态	本方经办行/产品	对方经办行/产品托管	对手方	对手方经办行/产品	对手方交易员	存款金额(万)	存款期限(天)	存款利率	清算速
☐	存出	待成交	平安资管cty	工商银行	农业银行	农行cty	宋爱丽c / 农业银行	1,000.00	1	1.0000	+0
☐	存出	待成交	平安资管cty	工商银行	农业银行	农行cty	宋爱丽c / 农业银行	1,000.00	1	1.0000	+0
☐	存出	待成交	平安资管cty	工商银行	农业银行	农行cty	宋爱丽c / 农业银行	1,000.00	1	1.0000	+0
☐	存入	待成交	平安资管cty	工商银行	农业银行	农行cty	宋爱丽c / 农业银行	1,000.00	1	1.0000	+0
☐	存入	待成交	平安资管cty	工商银行	农业银行	农行cty	宋爱丽c / 农业银行	1,000.00	1	1.0000	+0

撤销

拒绝

提交

成交

人民币同业存款: 共7笔(存入4/存出3), 0.7亿(存入0.4/存出0.3), 净融入0.1亿

同业存款导入

导入

☐	本方方向*	本方经办行/产品*	对手方*	对手方经办行/产...	对手方交易员*	存款期限(天)*	存款利率*	存款金额(万)*	清算速度
未查询到数据									

删除 保存 提交

6.4.10.2 报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】界面，选择“同业存款”（交易方式选择“同业存款报价”）可查看待发送、已发送、待成交的对话报价，并进行对话报价管理。

1. 对于状态为“待发送”的对话报价：

（a）可以选中单笔/多笔对话报价，点击  按钮提交对话报价

我的报价-货币市场

质押式回购 买断式回购-单券 买断式回购-多券 信用拆借 同业存款 资金意向 存单路演-发行人 存单路演-投资人

类型：☒ 同业存款报价 ☐ 提前支取报价

状态：☒ 全部 ☐ 已发送 ☐ 待发送 ☐ 待成交

本方方向：☒ 全部 ☐ 存入 ☐ 存出

存款期限： -

本方经办行/产品：

对手方：

☐	本方方向	本方状态	本方经办行/产品	对方经办行/产品	对手方	对手方经办行/产品	对手方交易员	存款金额(万)	存款期限(天)	存款利率	清算速度
☒	存出	待发送	上海银行		天津银行	天津银行	陈倩倩 / 天津银行	200.00	21	2.0000	+0
☐	存出	已发送	上海银行		天津银行	天津银行	陈倩倩 / 天津银行	200.00	21	2.0000	+0

撤销 拒绝 提交 成交

人民币同业存款：共2笔(存入0/存出2)，0.04亿(存入0/存出0.04)，净融出0.04亿

（b）也可以双击某笔对话报价，修改部分报价要素后，点击  按钮发送对话报价：

2. 对于状态为“已发送”的对话报价：

（a）可以选中单笔/多笔对话报价，点击  按钮终止对话报价：



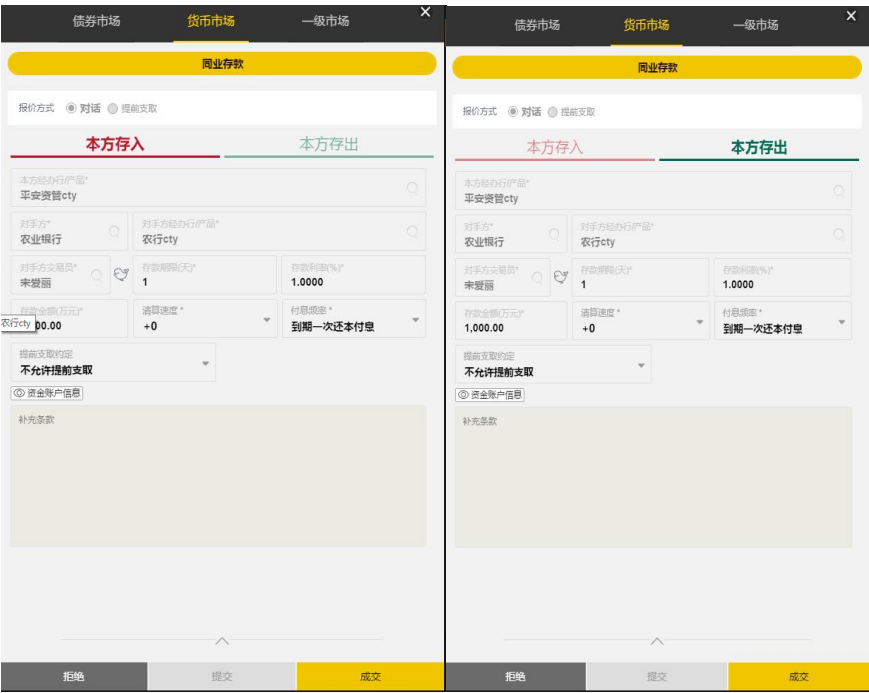
(b) 也可以双击某笔对话报价，修改部分报价要素后，点击 **提交** 按钮更新对话报价。

3. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以拒绝或达成成交，同业存款市场对话报价不支持交谈：

(a) 在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔对话报价，点击 **成交** 按钮直接达成成交，或点击 **拒绝** 按钮拒绝对话报价；



(b) 双击某条对话报价记录可打开【我要报价】界面，点击 **成交** 按钮达成一笔对话成交，或点击 **拒绝** 来拒绝成交：



6.4.10.3 报价信息查询

对话报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-货币市场】界面，选择同业存款（交易方式选择同业存款报价）查看历史的对话报价，即已撤销的、已成交的或已被拒绝的对话报价。

（1）自营或资管身份具下有“监控权限-同业存款”权限的客户端用户，可查询本机构下所有交易员发出与收到的当日及历史同业存款报价或提前支取报价。

（2）仅在自营、资管任一或多个身份下有“交易执行-同业存款-同业存放/存放同业”权限的用户，仅可查询本交易员发出与收到的当日及历史同业存款对话报价或同业存款提前支取报价。



6.4.10.4 报价监控

对话报价的历史报价信息，可在“--监控--货币市场--报价监控”菜单路径下，打开【报价监控-货币市场】界面，选择同业存款查看历史的对话报价。

报价监控界面仅支持自营或资管身份具有“监控权限-同业存款”权限的客户端用户，可查询本机构下所有交易员发出与收到的当日同业存款报价或提前支取报价。



6.4.10.5 提前支取

交易员（自营或资管身份下）及交易员所在机构的主交易账户同时具有【交易执行】-【同业存款】-【存放同业】权限可对已成交未到期的、允许提前支取的成交发起提前支取报价：

- （1）交易员登录 CIBMTS 客户端，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，在货币市场下选择“同业存款”（报价方式选择提前支取）填写提前支取的成交编号、提前支取报价要素后，点击按钮，可发送提前支取报价；

债券市场

货币市场

衍生品市场

质押式回购

买断式回购

信用拆借

同业存款

资金意向

存单路演

报价方式

对话

提前支取

本方存入

本方存出

成交编号*

成交日*

本方经办行/产品*

对手方*

对手方经办行/产品*

对手方交易员*

存款期限(天)*

存款利率(%)*

存款金额(万...)

剩余存款本金(万...)

清算速度*
+0

付息频率*
到期一次还本付!

提前支取约定
不允许提前支取

补充条款

对手方交易员*

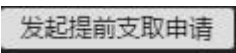
提前支取日*

提前支取本金(万元)*

重置

保存

提交

(2) 交易员可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-货币市场】界面，选择同业存款（交易方式选择同业存款成交）查看已达成的对话报价成交。勾选一笔符合提前支取条件的成交，点击按钮发起提前支取申请。

成交查询-货币市场

质押式回购成交明细

X-Repo匹配成交明细

买断式回购成交明细-单券

买断式回购成交明细-多券

信用拆借成交明细

同业存款成交明细

类型

● 同业存款成交

○ 提前支取成交

发起提前支取申请

本方方向

全部

存入

存出

本方经办行/产品

对手方

对手方经办行/产品

日期

2021/04/01 - 2021/05/26

导出

下载成交单

成交编号	本方方向	本方经办行/产品	本方经办行/产品...	对手方	对手方经办行/产...	对手方交易员	存款期限(天)	存款利率(%)	存款金额(万)
☐ IBD20210518300242	存出	上海银行		天津银行	天津银行	陈倩	12	2.0000	2,000.00
☐ IBD20210517300241	存入	上海银行		平安银行资管	平安资管cty	秦静	35	3.2000	3,200.00
☒ IBD20210517300240	存出	上海银行		天津银行	天津银行	陈倩	23	2.0000	2,300.00

人民币同业存款：共3笔(存入1/存出2)，0.75亿(存入0.32/存出0.43)，净融出0.11亿元

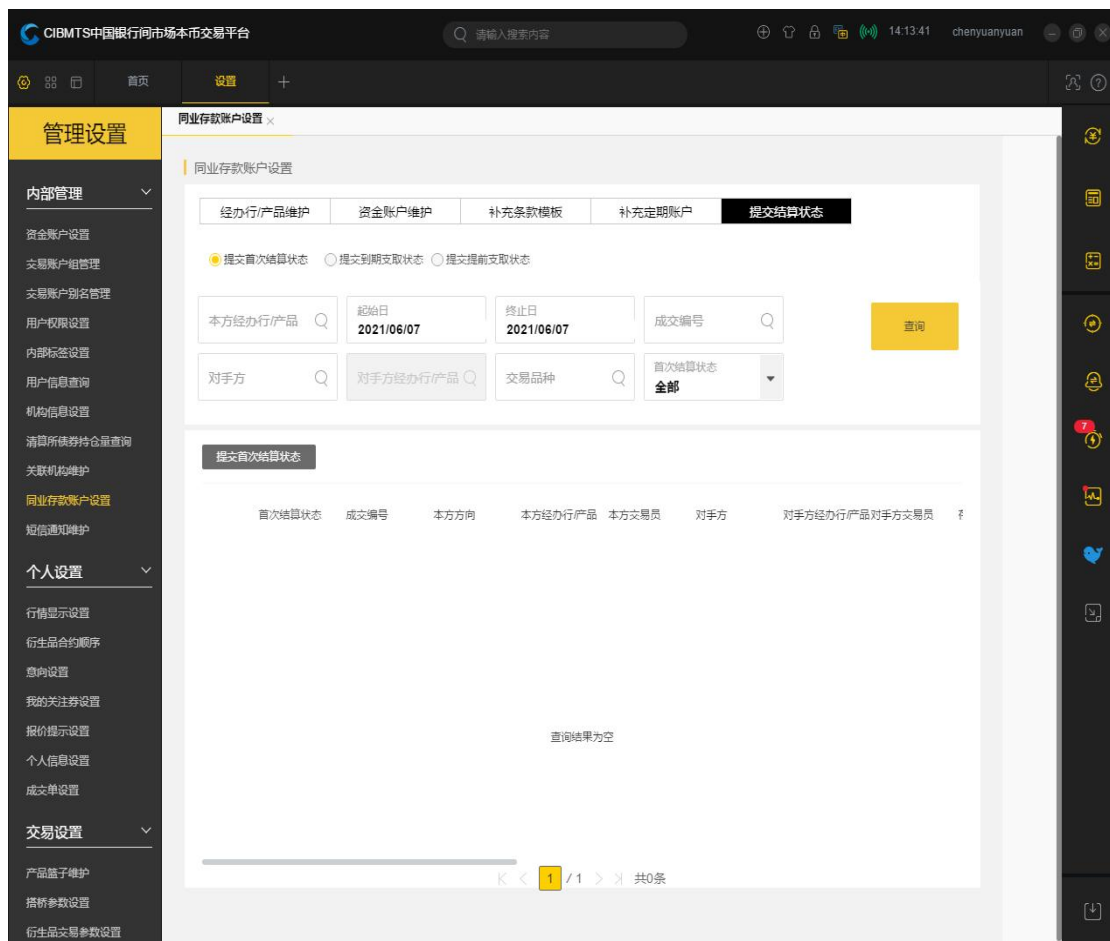
1

/ 1

6.4.10.6 提交结算状态

机构用户在自营/资管任一身份下有【清算服务-提交结算状态】权限可以在【管理设置-同业存款账户设置-提交结算状态】进行提交首次结算状态、提交到期支取状态、提交提前支取状态的操作：

6.4.9.6.1 存入方提交首次结算状态



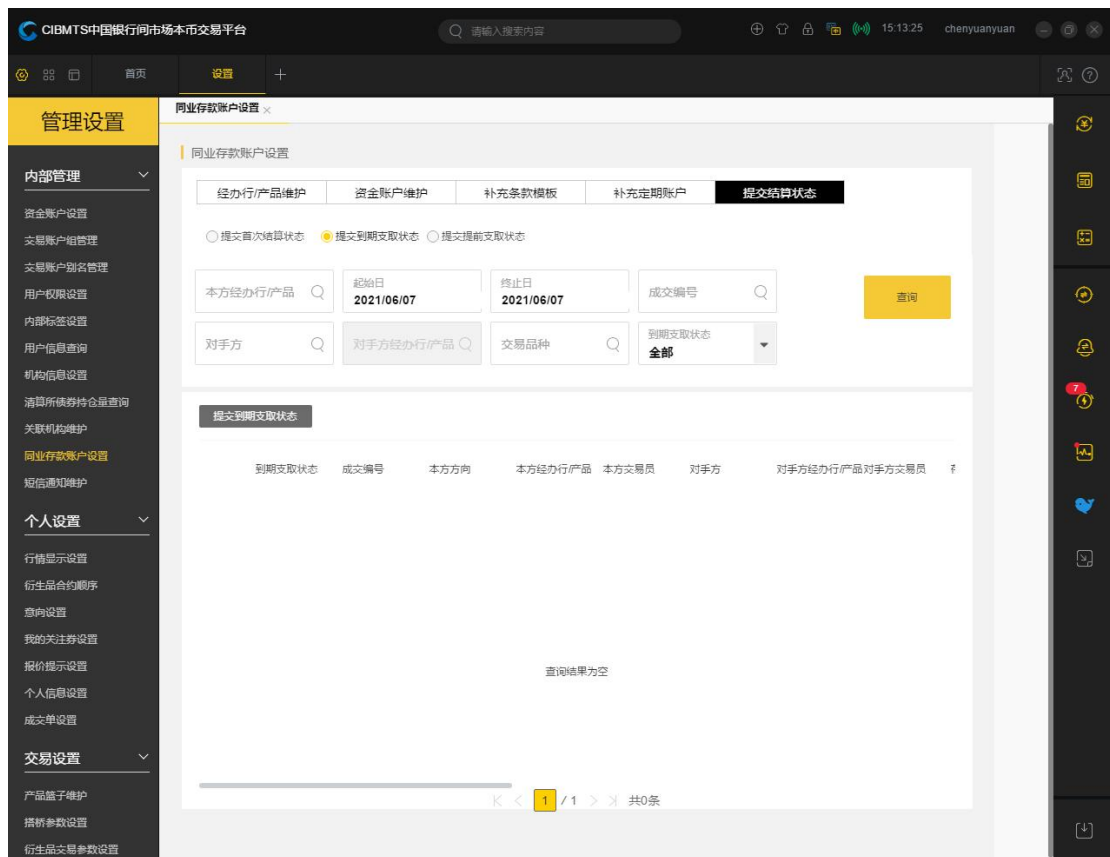
(1) 用户可在【提交首次结算状态】Tab 查询出已提交和可提交首次结算状态的成交：

- a. 已提交：本方为存入方达成的、且首次结算状态为【已结算】的成交；
- b. 可提交：当前交易日为首次结算日，且本方为存入方达成的、未到期的、首次结算状态为空的成交；

*本机构下某经办行/产品有设置白名单，仅白名单内用户可查询出该经办行/产品达成的成交；若某经办行/产品没有设置过白名单，则该机构下所有用户都能查询该经办行/产品达成的成交。

(2) 勾选可提交首次结算状态的成交，按钮 **提交首次结算状态** 高亮，点击按钮，弹窗提示“是否确认提交首次结算状态为已结算？”，点击确认则验证后提交成功，首次结算状态变为已结算；点取消则关闭弹窗窗口。

6.4.9.6.2 存出方提交到期支取状态



(1) 用户可在【提交到期支取状态】Tab 查询出已提交和可提交到期支取状态的成交：

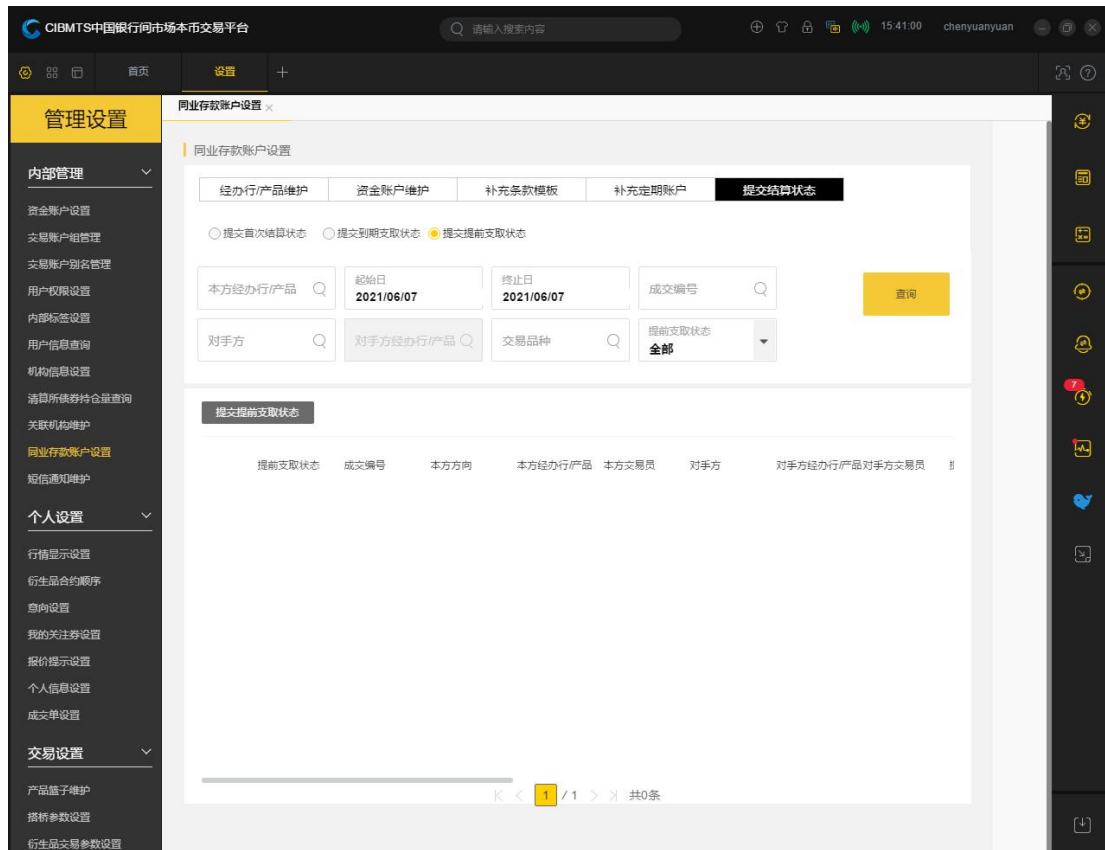
a. 已提交：本方为存出方达成的、且到期支取状态为【已支取】的成交；

b. 可提交：当前交易日为到期支取日，且本方为存出方达成的、已到期的、到期支取状态为空的成交；

*本机构下某经办行/产品有设置白名单，仅白名单内用户可查询出该经办行/产品达成的成交；若某经办行/产品没有设置过白名单，则该机构下所有用户都能查询该经办行/产品达成的成交。

(2) 勾选可提交到期支取状态的成交，按钮 **提交到期支取状态** 高亮，点击按钮，弹窗提示“是否确认提交到期支取状态为已支取？”，点击确认则验证后提交成功，到期支取状态变为已支取；点取消则关闭弹窗窗口。

6.4.9.6.3 存出方提交提前支取状态



(1) 用户可在【提交提前支取状态】Tab 查询出已提交和可提交提前支取状态的成交：

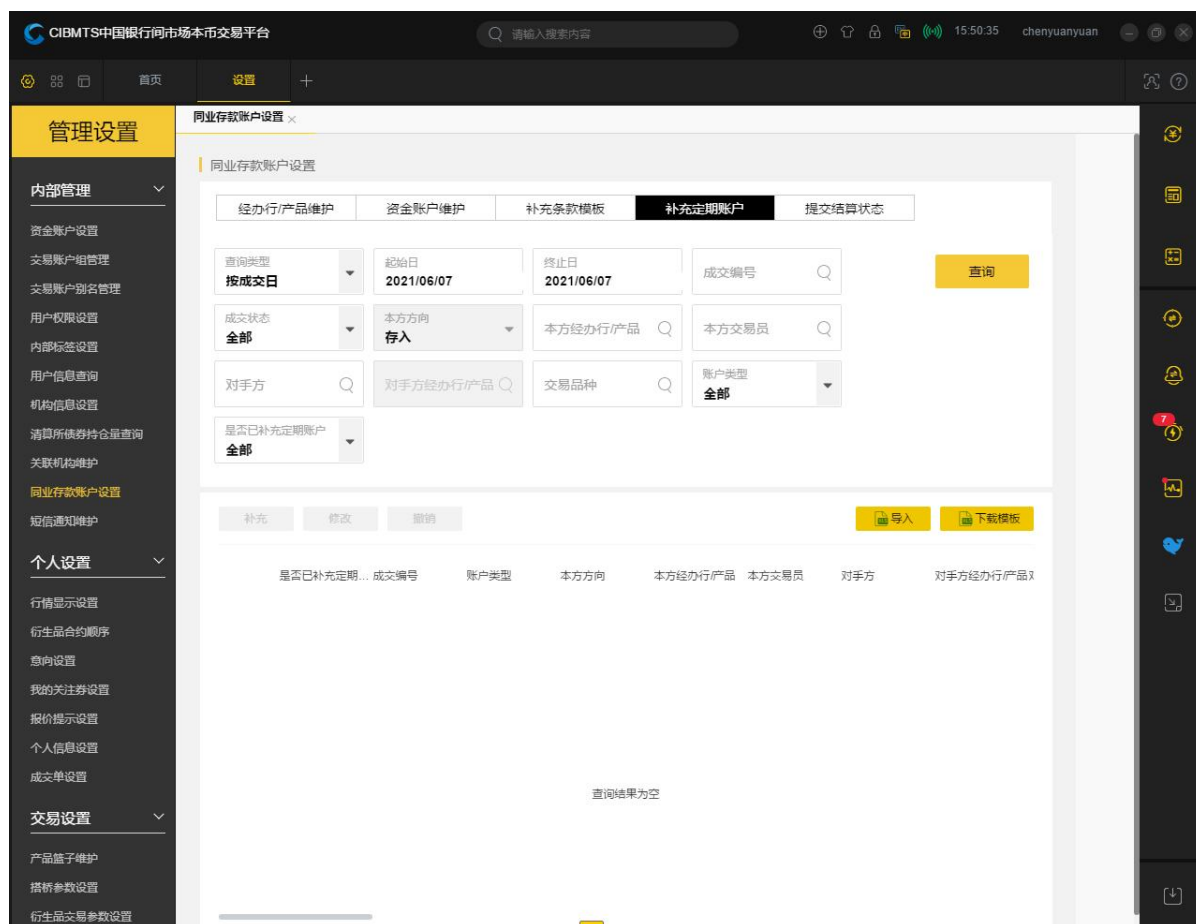
- a. 已提交：本方为存出方达成的、且提前支取状态为【已支取】的成交；
- b. 可提交：当前交易日为提前支取日，且本方为存出方达成的、未到期的、提前支取状态为空的成交；

*本机构下某经办行/产品有设置白名单，仅白名单内用户可查询出该经办行/产品达成的成交；若某经办行/产品没有设置过白名单，则该机构下所有用户都能查询该经办行/产品达成的成交。

(2) 勾选可提交提前支取状态的成交，按钮 **提交提前支取状态** 高亮，点击按钮，弹窗提示“是否确认提交提前支取状态为已支取？”，点击确认则验证后提交成功，提前支取状态变为已支取；点取消则关闭弹窗窗口。

6.4.10.7 补充定期账户

1. 机构用户在自营/资管任一身份下有【清算服务-补充定期账户】权限可对本方为存入方的未到期成交或当日到期成交进行补充定期账户操作。



2. 根据查询条件查询已补充定期账户和可补充定期账户的成交。

补充定期账户

查询类型

按首次结算日

起始日

2021/03/12

终止日

2021/03/12

成交编号

2088100

Q

查询

成交状态

全部

本方方向

本方存入

本方经办行/产品

本方交易员

Q

对手方

2021/03/12

Q

对手方经办行/产品

交易品种

Q

账户类型

全部

最小存款期限(天)

Q

最大存款期限(天)

Q

是否已补充定期账户

全部

补充

修改

撤销

导入

下载模板

☐	是否已补充定期账户	成交编号	账户类型	本方方向	本方经办行/产品	本方交易员	对手方
☒	已补充	60110228	活期户	存入	中国银行张江支行	王源	建设银行张江支行
☒	未补充	10790012	固定定期户	存出	招商银行张江支行	张易	农业银行
☐	已补充	60110228	其他	存出	中国银行张江支行	王源	建设银行张江支行
☐	未补充	10790012	活期户	存出	招商银行张江支行	张易	农业银行
☐	已补充	60110228	固定定期户	存入	中国银行张江支行	王源	建设银行张江支行
☐	未补充	10790012	其他	存入	招商银行张江支行	张易	农业银行
☐	已补充	60110228	其他	存入	中国银行张江支行	王源	建设银行张江支行

1

/ 15

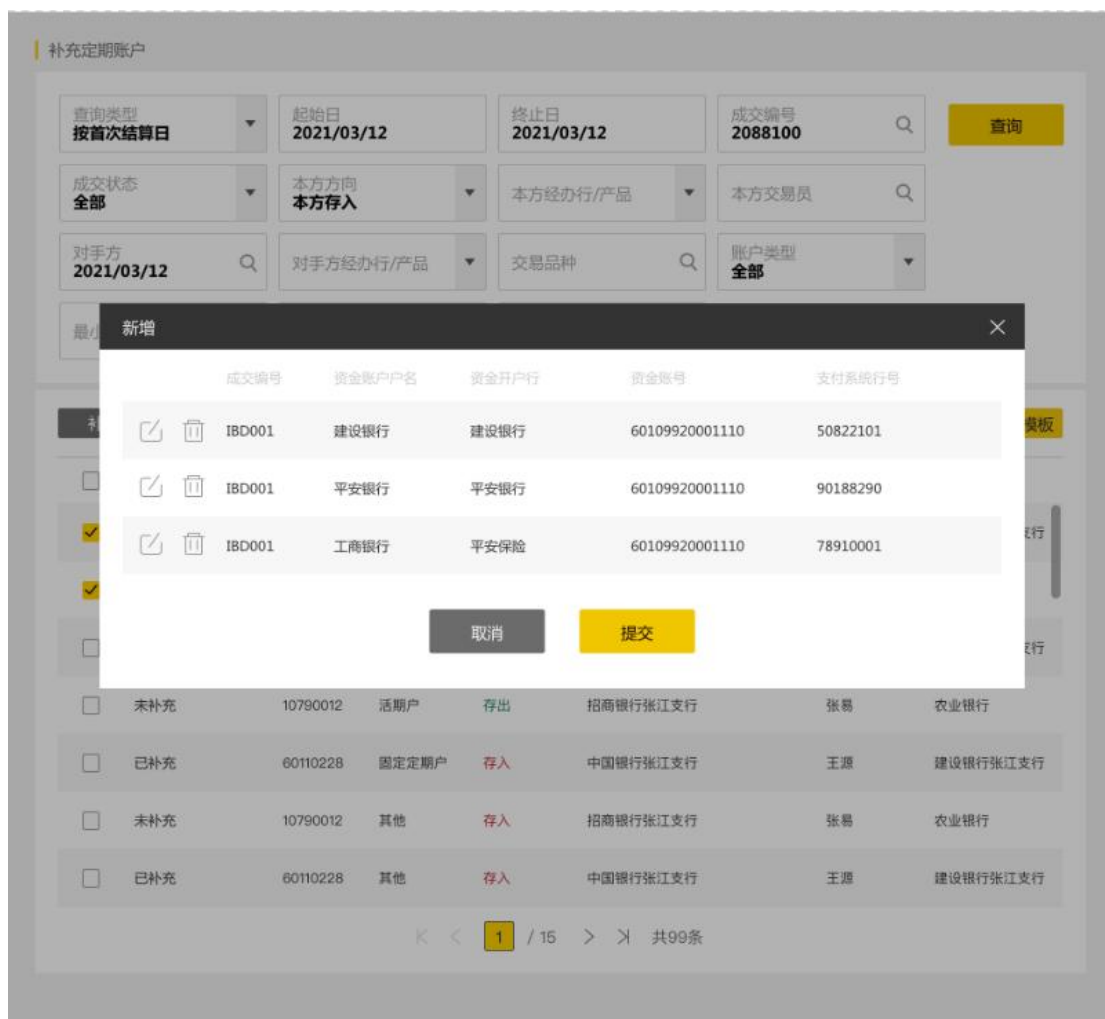
共99条

若经办行/产品设置了白名单,则用户仅可对其归属的经办行/产品达成的成交进行补充定期账户;若经办行/产品未设置白名单,则机构下所有用户都可对该经办行/产品达成的成交进行补充定期账户操作;

3. 全部勾选未补充定期账户的成交时,

补充

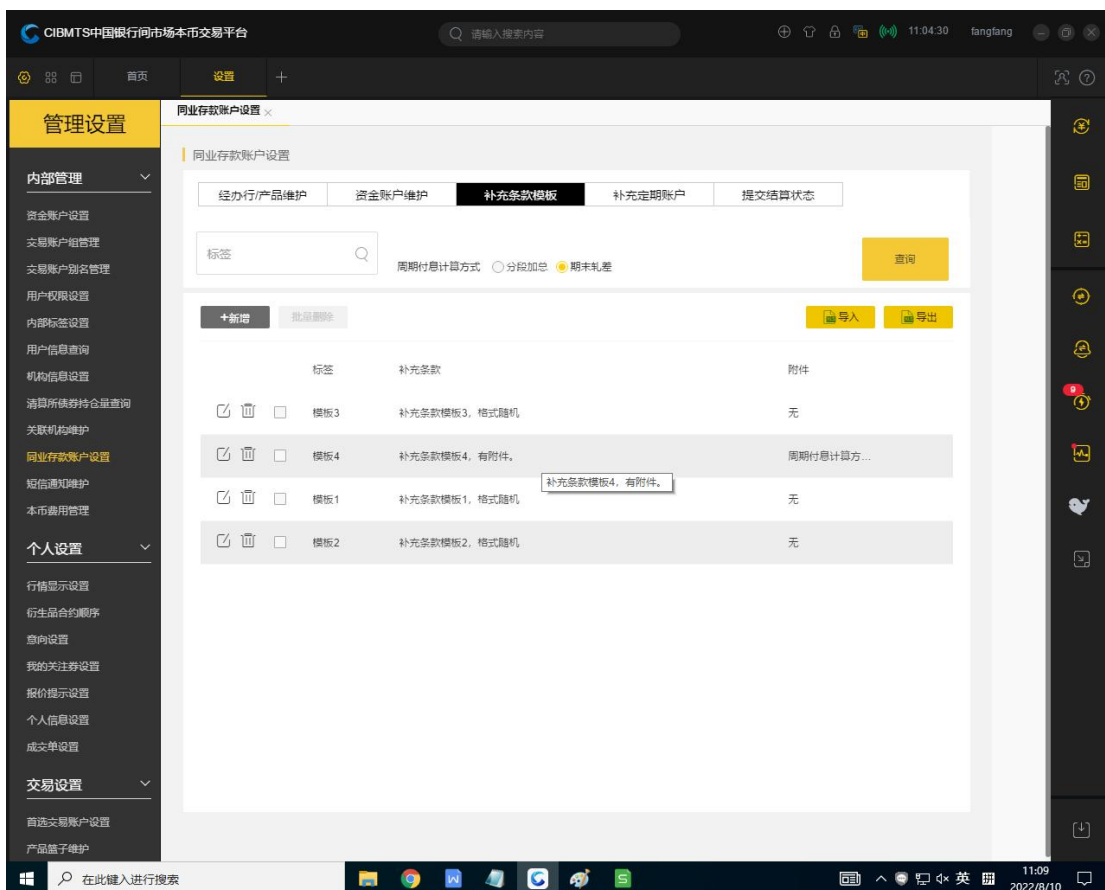
 按钮高亮可点击,

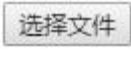


3. 全部勾选已补充定期账户的成交时，修改和撤销按钮高亮可点击。

6.4.10.8 补充条款模板

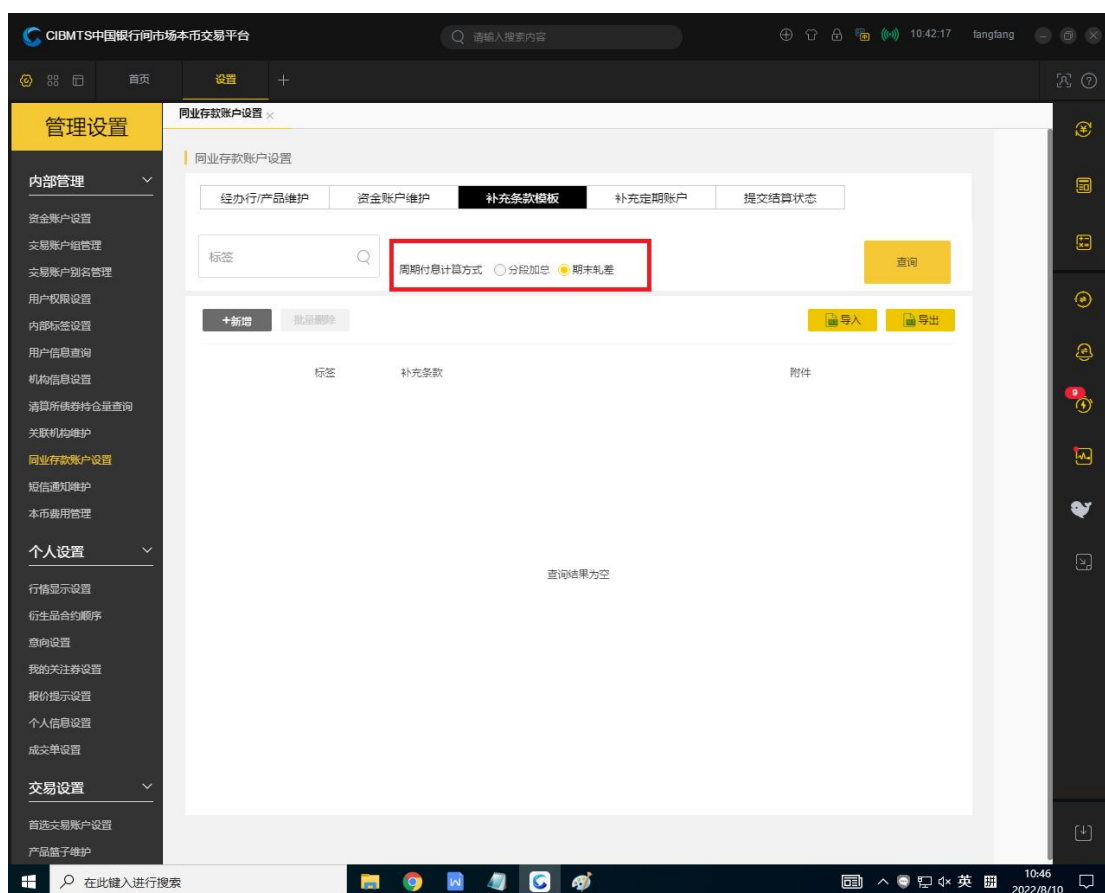
机构用户在自营/资管任一身份下有【清算服务-补充条款模板】权限可以在【管理设置-同业存款账户设置-补充条款模板】进行补充条款模板的设置。



1. 点击  按钮可查询本机构下已维护的补充条款模板。
2. 点击  按钮弹出新增补充条款对话框，输入补充条款模板标题和内容，或点击  上传文件作为补充条款模板。点击【确认】按钮保存模板，点击【重置】按钮清空当前已输入字符。

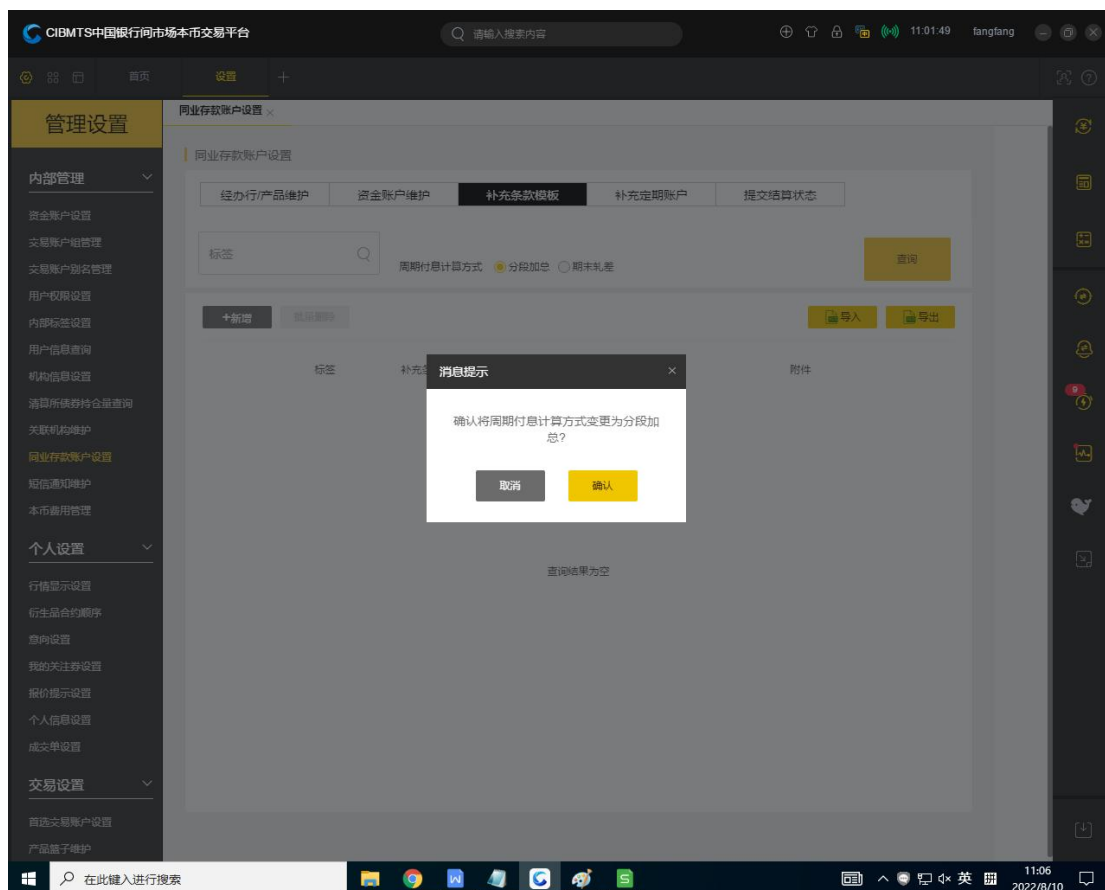
6.4.10.9 周期付息计算方式设置

机构用户在自营/资管任一身份下有【清算服务-补充条款模板】权限可以在【管理设置-同业存款账户设置-补充条款模板】页面进行周期付息计算方式的设置。



1.对“付息频率”为非“到期一次还本付息”的报价、成交，应计利息总额、到期支取金额的计算方式如下：

- 1) 若机构选择“分段加总”，则应计利息总额等于付息期间各期应计利息之和，其中期间各期应计利息按每期对应实际计息天数进行计算。
- 2) 若机构选择“期末轧差”，则最后一期应计利息等于应计利息总额减去第一期至倒数第二期应计利息之和的差额，其中应计利息总额及第一期至倒数第二期的每一期应计利息均按相应的实际计息天数进行计算。



3. 当机构在设置页面切换“周期付息计算方式”时，弹框提示“确认将周期付息计算方式变更为 XXXX?”点击确认则变更生效。

6.4.10.10 补充协议备案

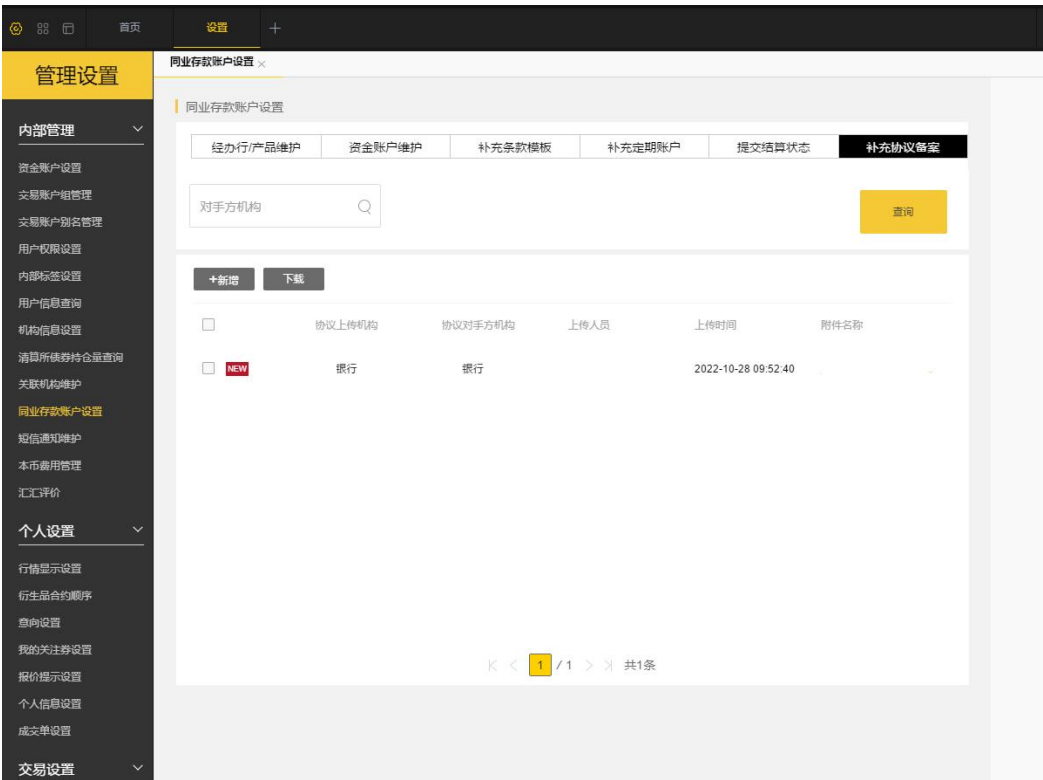
机构用户在自营/资管任一身份下有【清算服务-补充协议备案】权限可以在【管理设置-同业存款账户设置-补充协议备案】进行补充协议的上传备案。

1. 点击  按钮可查询本机构下已上传的、和其他机构上传的对手方为本机构的补充协议附件。 输入  后点击查询按钮可搜索本方与指定对手方机构的补充协议备案。

2. 点击  按钮弹出新增补充协议对话框，输入对手方机构，点击  上

传附件。点击【保存】按钮保存附件并返回查询界面，点击【重置】按钮清空当前已输入字符。

3. 本方上传或修改补充协议备案后，对手方机构可在补充协议备案界面查询，且补充协议前展示 **NEW**。



6.4.10.11 当日成交

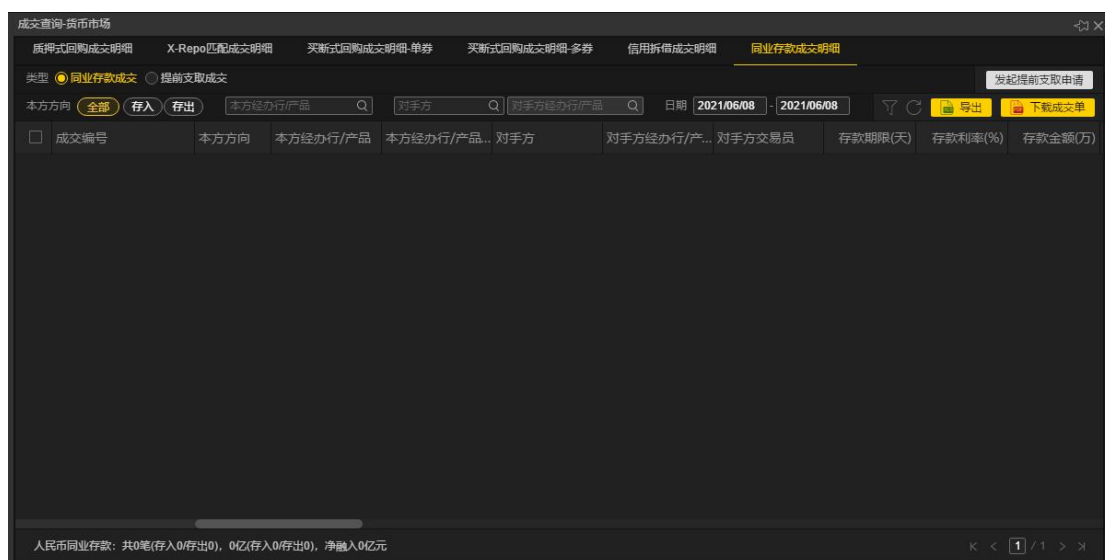
可在“--我的交易--当日成交”菜单路径下，打开【当日成交-货币市场】界面。

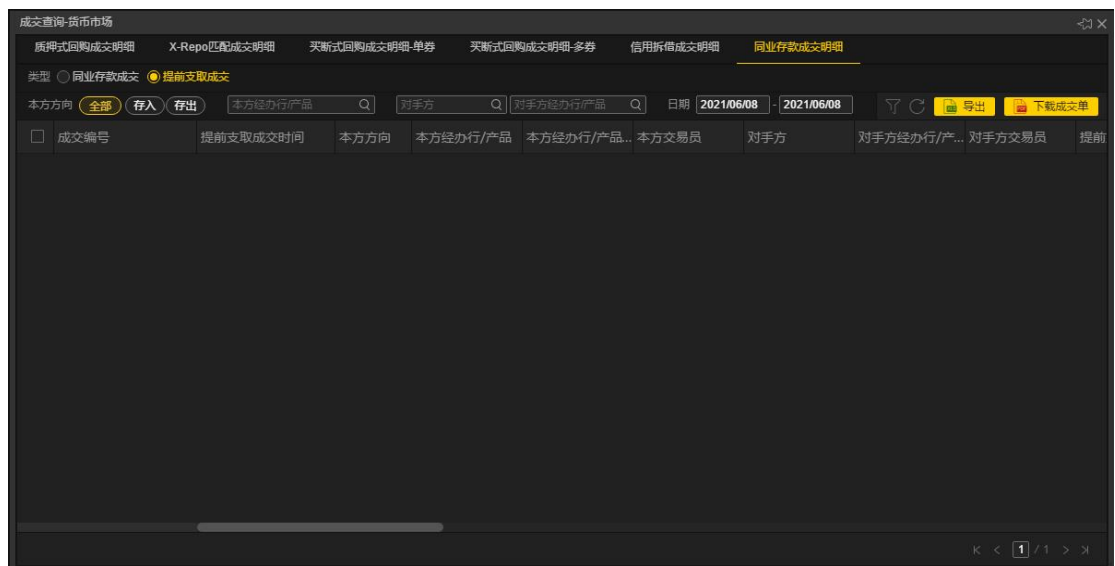
点击“同业存款”tab，可查看当日达成的同业存款成交以及当日达成的提前支取成交以及对应成交的提前支取操作流水、补充定期账户操作流水、提交结算状态等操作流水，双击选中的成交记录，可查看对应成交单。



6.4.10.12 成交查询

可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-货币市场】界面，点击“同业存款”tab，查询当日及历史同业存款成交和提前支取成交，可自行选择时间范围，可导出当前查询界面的成交信息，也可界面查看对应成交的提前支取操作流水、补充定期账户操作流水、提交结算状态等操作流水，双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。





6.4.11 iDeal 交易意向查询

任意身份下有质押式回购的监控权限或者有“质押式回购-回购交易-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-货币市场】界面，选择“iDeal 交易意向查询”，查看所有的 iDeal 交易意向报价。

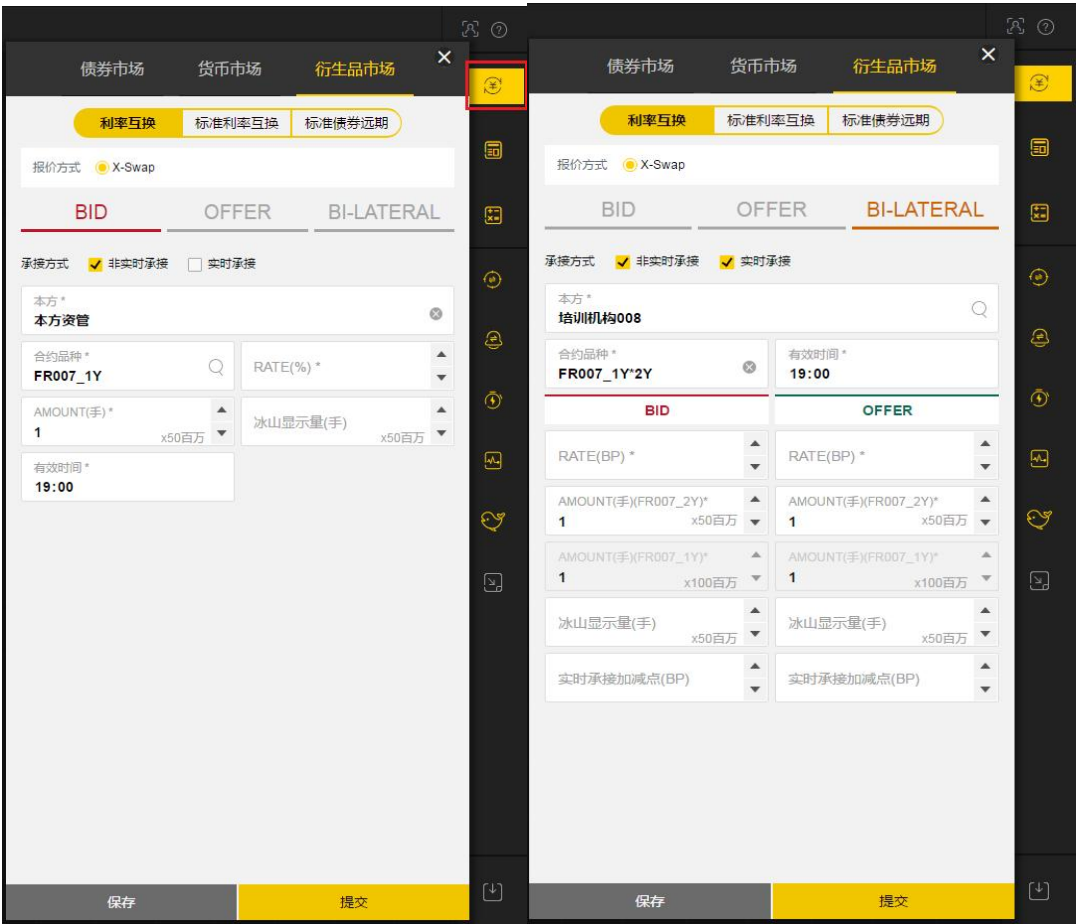


6.5 衍生品市场-利率互换

6.5.1X-Swap 订单

6.5.1.1X-Swap 订单提交

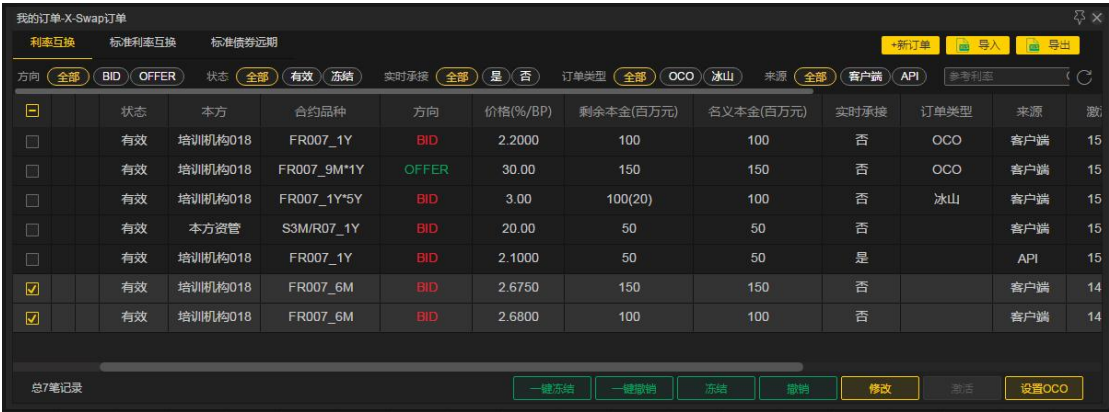
(1) 任意身份下具有“利率互换-匿名点击实时承接”或“利率互换-匿名点击非实时承接”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  或【X-Swap 订单】页面的【新订单】按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择【利率互换】市场，选择报价方式“X-Swap”，填写各报价要素后，点击  按钮，即可发送订单，支持同时发送实时承接与非实时承接订单，同时支持提交双边订单：



The screenshot displays the CIBMTS X-Swap order submission interface, divided into two panels: '非实时承接' (Non-real-time acceptance) on the left and '实时承接' (Real-time acceptance) on the right. Both panels show the '衍生品市场' (Derivatives Market) tab selected, with '利率互换' (Interest Rate Swap) chosen. The '报价方式' (Quote Method) is set to 'X-Swap'. The '承接方式' (Acceptance Method) is set to '非实时承接' (Non-real-time acceptance) on the left and '实时承接' (Real-time acceptance) on the right. The '本方' (Own Party) is '本方资管' (Own Asset Management) on the left and '培训机构008' (Training Institution 008) on the right. The '合约品种' (Contract Variety) is 'FR007_1Y' on the left and 'FR007_1Y*2Y' on the right. The '有效时间' (Valid Time) is '19:00' on the left and '19:00' on the right. The 'AMOUNT(手)' (Amount in Lots) is '1' on the left and '1' on the right. The '冰山显示量(手)' (Iceberg Display Amount in Lots) is 'x50百万' on the left and 'x50百万' on the right. The '实时承接加减点(BP)' (Real-time Acceptance Add/Subtract Points in BP) is 'x100百万' on the left and 'x100百万' on the right. The '提交' (Submit) button is highlighted in yellow at the bottom right of each panel.

报价发送成功后，点击“--我的交易-X-Swap 订单”菜单路径，可打开【我的订单-X-Swap 订单】界面，点击【利率互换】tab 页，可查看已经发出的 X-Swap 订单，或对订单进行修改和撤销操作。

(2) 提供批量提交 X-Swap 订单功能。可点击按钮，在导出模板中填写订单数据，点击按钮导入 X-Swap 订单后，批量提交。



我的订单-X-Swap 订单

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

+新订单 导入 导出

方向 全部 BID OFFER 状态 全部 有效 冻结 实时承接 全部 是 否 订单类型 全部 OCO 冰山 来源 全部 客户端 API 参考利率

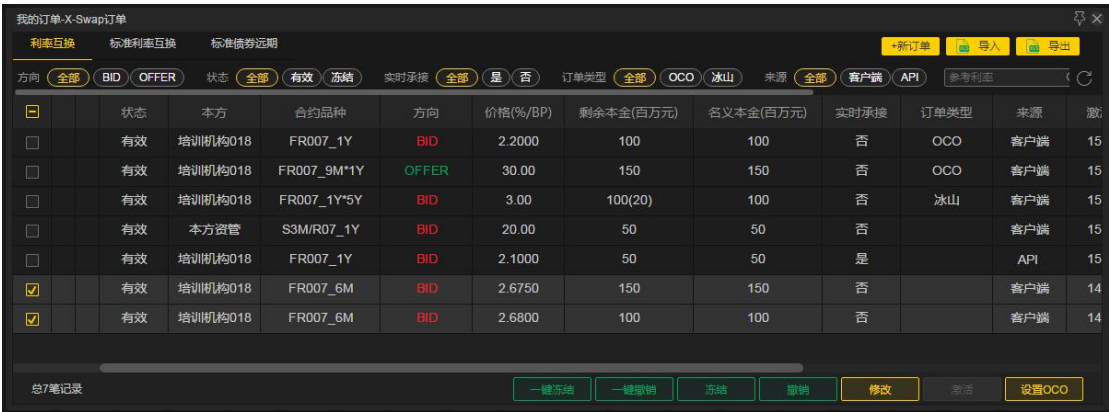
	状态	本方	合约品种	方向	价格(%/BP)	剩余本金(百万元)	名义本金(百万元)	实时承接	订单类型	来源	激活
☐	有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.2000	100	100	否	OCO	客户端	15
☐	有效	培训机构018	FR007_9M*1Y	OFFER	30.00	150	150	否	OCO	客户端	15
☐	有效	培训机构018	FR007_1Y*5Y	BID	3.00	100(20)	100	否	冰山	客户端	15
☐	有效	本方资管	S3M/R07_1Y	BID	20.00	50	50	否		客户端	15
☐	有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.1000	50	50	是		API	15
☒	有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6750	150	150	否		客户端	14
☒	有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6800	100	100	否		客户端	14

总7笔记录

一键冻结 一键撤销 冻结 撤销 修改 激活 设置OCO

6.5.1.2 订单管理

订单发送成功后，点击“--我的交易-X-Swap 订单”菜单路径，可打开【我的订单-X-Swap 订单】界面，查看已经发出的订单，或对订单进行修改和撤销操作。



我的订单-X-Swap 订单

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

+新订单 导入 导出

方向 全部 BID OFFER 状态 全部 有效 冻结 实时承接 全部 是 否 订单类型 全部 OCO 冰山 来源 全部 客户端 API 参考利率

	状态	本方	合约品种	方向	价格(%/BP)	剩余本金(百万元)	名义本金(百万元)	实时承接	订单类型	来源	激活
☐	有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.2000	100	100	否	OCO	客户端	15
☐	有效	培训机构018	FR007_9M*1Y	OFFER	30.00	150	150	否	OCO	客户端	15
☐	有效	培训机构018	FR007_1Y*5Y	BID	3.00	100(20)	100	否	冰山	客户端	15
☐	有效	本方资管	S3M/R07_1Y	BID	20.00	50	50	否		客户端	15
☐	有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.1000	50	50	是		API	15
☒	有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6750	150	150	否		客户端	14
☒	有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6800	100	100	否		客户端	14

总7笔记录

一键冻结 一键撤销 冻结 撤销 修改 激活 设置OCO

➤ 对于状态为“有效”的订单，可以选中单笔/多笔订单，点击按钮撤销订单；或点击按钮冻结订单。

我的订单-X-Swap订单

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

+新订单 导入 导出

方向 全部 BID OFFER 状态 全部 有效 冻结 实时承接 全部 是 否 订单类型 全部 OCO 冰山 来源 全部 客户端 API 参考利率

		状态	本方	合约品种	方向	价格(%/BP)	剩余本金(百万元)	名义本金(百万元)	实时承接	订单类型	来源	时间
☐		有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.2000	100	100	否	OCO	客户端	15
☐		有效	培训机构018	FR007_9M*1Y	OFFER	30.00	150	150	否	OCO	客户端	15
☐		有效	培训机构018	FR007_1Y*5Y	BID	3.00	100(20)	100	否	冰山	客户端	15
☐		有效	本方资管	S3M/R07_1Y	BID	20.00	50	50	否		客户端	15
☐		有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.1000	50	50	是		API	15
☒		有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6750	150	150	否			14
☒		有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6800	100	100	否		客户端	14

总7笔记录

一键冻结 一键撤销 冻结 撤销 修改 激活 设置OCO

➤ 对于状态为“有效”的订单，可以双击订单记录打开 iQuote，修改部分订单要素后，

点击 **提交** 按钮更新订单；或点击 **保存** 按钮，保存当前订单数据，暂不提交。

债券市场 货币市场 衍生品市场

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

报价方式 X-Swap

BID OFFER BI-LATERAL

承接方式 ☒ 非实时承接 ☐ 实时承接

本方 * 工商银行

合约品种 * FR007_3M RATE(%) * 18.7500

AMOUNT(手) * 1 冰山显示量(手) * 1

有效时间 * 19:00

保存 提交

➤ 设置 OCO 交易策略

在【我的订单-X-Swap】界面，勾选需要进行 OCO 交易策略设置的多笔订单，点击

设置OCO

按钮进行设置：

我的订单-X-Swap订单

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

+新订单 导入 导出

方向 全部 BID OFFER 状态 全部 有效 冻结 实时承接 全部 是 否 订单类型 全部 OCO 冰山 来源 全部 客户端 API 参考利率

		状态	本方	合约品种	方向	价格(%/BP)	剩余本金(百万元)	名义本金(百万元)	实时承接	订单类型	来源	撤
☐		有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.2000	100	100	否	OCO	客户端	15
☐		有效	培训机构018	FR007_9M*1Y	OFFER	30.00	150	150	否	OCO	客户端	15
☐		有效	培训机构018	FR007_1Y*5Y	BID	3.00	100(20)	100	否	冰山	客户端	15
☐		有效	本方资管	S3M/R07_1Y	BID	20.00	50	50	否		客户端	15
☐		有效	培训机构018	FR007_1Y	BID	2.1000	50	50	是		API	15
☒		有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6750	150	150	否		客户端	14
☒		有效	培训机构018	FR007_6M	BID	2.6800	100	100	否		客户端	14

总7笔记录

一键冻结 一键撤销 冻结 撤销 修改 激活 设置OCO

➤ 批量修改订单

在【我的订单-X-Swap】界面，勾选需要进行批量修改的订单，点击  按钮进入【修改页面】：

修改利率互换

	本方	合约品种	方向	剩余本金(百万元)	单位报价(百万...	名义本金(百万元)	实时承接	价格(%/BP)	名义本金(...	冰山显示量(手)
	工商银行	FR007_6M	BID	50	50	50	否	2.3100	1	
	工商银行	FR007_3M	OFFER	50	50	50	否	18.7500	1	

取消 保存 提交

点击  或  按钮，订单被展示在【我的订单-X-Swap】页面。

6.5.1.3 交易分仓

X-Swap 需要分仓的订单成交意向后，可在“--我的交易--交易分仓”菜单路径下，查看成交意向信息，分仓方可在分仓有效时间内进行分仓操作。

交易分仓									
利率互换交易分仓									
标准利率互换交易分仓									
状态	全部	待本方分仓	待对手方分仓	已分仓	失效	本方方向	全部	支付固定利率	收取固定利率
日期	2019/12/09	~	2019/12/09	本方主体	全部				
成交意向编号	成交意向时间	状态	有效时间	合约品种	本方方向	本方	本方主体	本方交易员	名义本金(万)
IRS20191209800068	2019/12/09 19:22:18	待本方分仓	21:22:18	Shibor3M_2Y	支付固定利率	—	本方代理	LinShu	5000
IRS20191209800009	2019/12/09 10:47:24	待本方分仓	14:17:23	FR007_5Y	收取固定利率	—	本方代理	LinShu	1000
IRS20191209800007	2019/12/09 10:10:06	待本方分仓	13:40:05	FR007_9M	支付固定利率	—	本方代理	LinShu	1000

点击“待本方分仓”的成交意向记录，打开分仓界面：

分仓

分配总量(万)

5000

本方	分配量(万)
江苏新扬子造船有限公司	2,000.00
江苏扬子江船厂有限公司	3,000.00
合计	5000

添加

取消

提交

在分仓界面选择分配的产品以及填写对应分配量，点击提交，若分仓成功则状态变为“已分仓”。

注意：用户需在交易中心规定的时间范围内进行分仓。当日收盘前支持提交申请应急分仓，收盘后系统不允许分仓，用户未在当日收盘前进行分仓视同违约处理。

6.5.1.4 历史订单查询

X-Swap 的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-利率互换订单查询】界面，查看历史的 X-Swap 订单。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换订单查询 标准利率互换订单查询 标债远期订单查询

订单类型: **全部** 限价 冰山 FAK 订单状态: **全部** 撤销 成交 本方: 订单日期: 2019/12/09 ~ 2019/12/09 导出

订单编号	机构	账户主体	本方	交易员	合约类型	订单来源	订单类型	订单状态	交易方向
2019120960000073	中国银行	—	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	BID
191209050201000053	中国银行	中国银行	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER
2019120960000071	中国银行	—	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	BID
191209050201000011	中国银行	中国银行	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	冰山	撤销	OFFER
2019120960000143	中国银行	—	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER
2019120960000091	中国银行	—	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER
191209050201000041	中国银行	中国银行	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	BID
2019120960000082	中国银行	—	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER
2019120960000021	中国银行	—	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	冰山	撤销	OFFER
191209050201000040	中国银行	中国银行	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER
191209050201000039	中国银行	中国银行	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER
191209050201000078	中国银行	中国银行	中国银行	晁思遥	直接合约	客户端	限价	撤销	OFFER

K < 1 / 2 > X

6.5.2X-Swap 点击成交

6.5.2.1 X-Swap 非实时承接报价行情

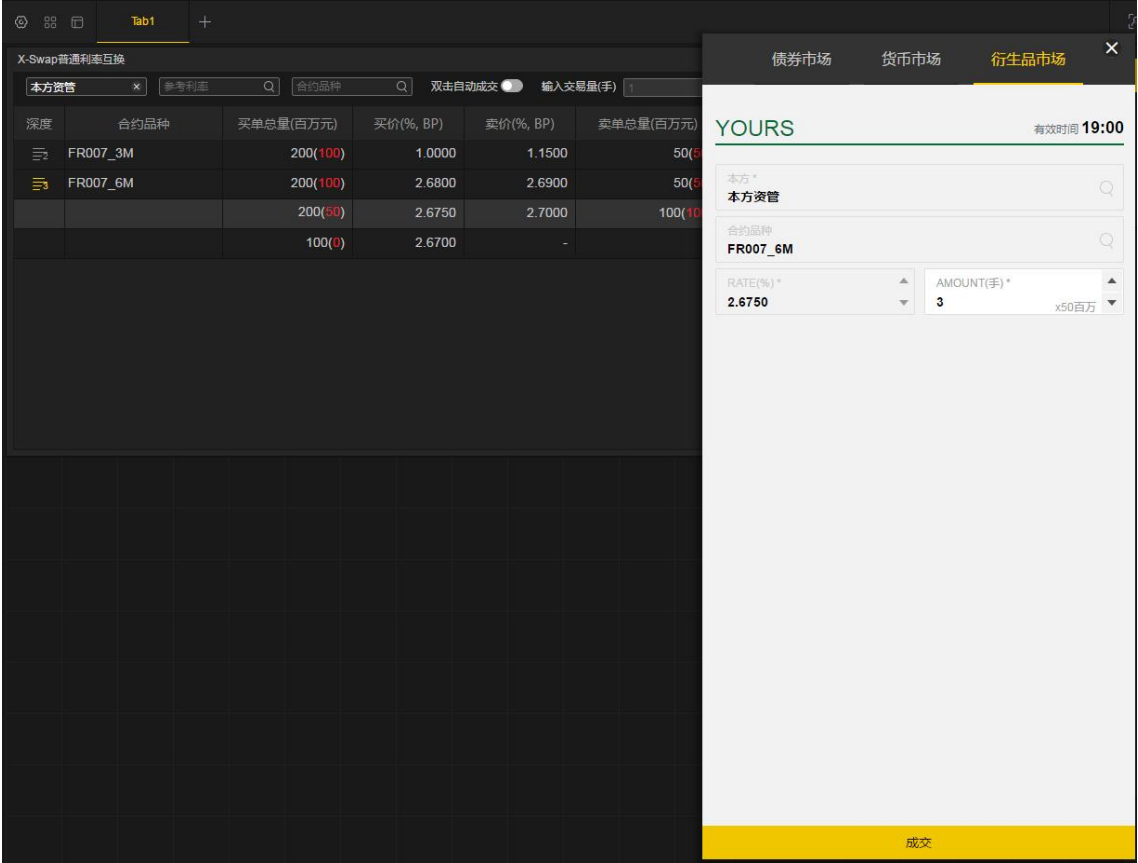
任意身份下具有“利率互换-匿名点击非实时承接”权限的用户可点击“--公开报价—X-Swap 普通报价”菜单路径，打开【X-Swap 报价】行情界面，选择“本方”的主体，可以查看该主体市场当日的利率互换非实时承接报价行情。

X-Swap普通利率互换

本方资管 参考利率: 合约品种: 双击自动成交: ☐ 输入交易量(手): 一键冻结 +新订单

深度	合约品种	买单总量(百万元)	买价(% , BP)	卖价(% , BP)	卖单总量(百万元)
2	FR007_3M	200(100)	1.0000	1.1500	50(50)
3	FR007_6M	200(100)	2.6800	2.6900	50(50)
		200(50)	2.6750	2.7000	100(100)
		100(0)	2.6700	-	-

对于有交易意向的合约，可以点击按钮查看当前合约的所有深度行情，双击价格/报价量字段，可打开 iQuote，确认“报价量”后点击按钮进行成交。



6.5.2.2 X-Swap 实时承接报价行情

自营身份下具有“利率互换-匿名点击实时承接”权限的用户可点击“--公开报价—X-Swap 利率互换实时承接”菜单路径，打开【X-Swap 报价】行情界面，可以查看市场当日的利率互换实时承接报价行情。

X-Swap利率互换实时承接

参考利率 合约品种 双击自动成交 ☐ 双击成交默认账户 输入交易量(手) 1 一键冻结 +新订单

深度	合约品种	买单总量(百万元)	买价(%, BP)	卖价(%, BP)	卖单总量(百万元)
≡	FR007_1Y	50	2.3000	2.2250	50
		100	2.2000	2.4000	50
		50	2.1000	-	-
≡	FR007_2Y	50	2.5000	-	-
≡	FR007_1Y*2Y	25	27.50	-	-

对于有交易意向的合约，可以点击  按钮查看当前合约的所有深度行情，双击价格/报价量字段，可打开 iQuote，确认“报价量”后点击  按钮进行成交。

X-Swap利率互换实时承接

参考利率 合约品种 双击自动成交 ☐ 双击成交默认账户 输入交易量(手) 1 一键冻结 +新订单

深度	合约品种	买单总量(百万元)	买价(%, BP)	卖价(%, BP)	卖单总量(百万元)
≡	FR007_1Y	50	2.3000	2.2250	50
≡	FR007_2Y	50	2.5000	-	-
≡	FR007_1Y*2Y	25	27.50	-	-

债券市场 货币市场 衍生品市场

YOURS 有效时间 19:00

本方 * 培训机构018

☒ 实时承接 合约品种 FR007_1Y*2Y

RATE(BP) * 27.50 AMOUNT(手)(FR007_2Y)* 1 x50百万

AMOUNT(手)(FR007_1Y)* 1 x100百万

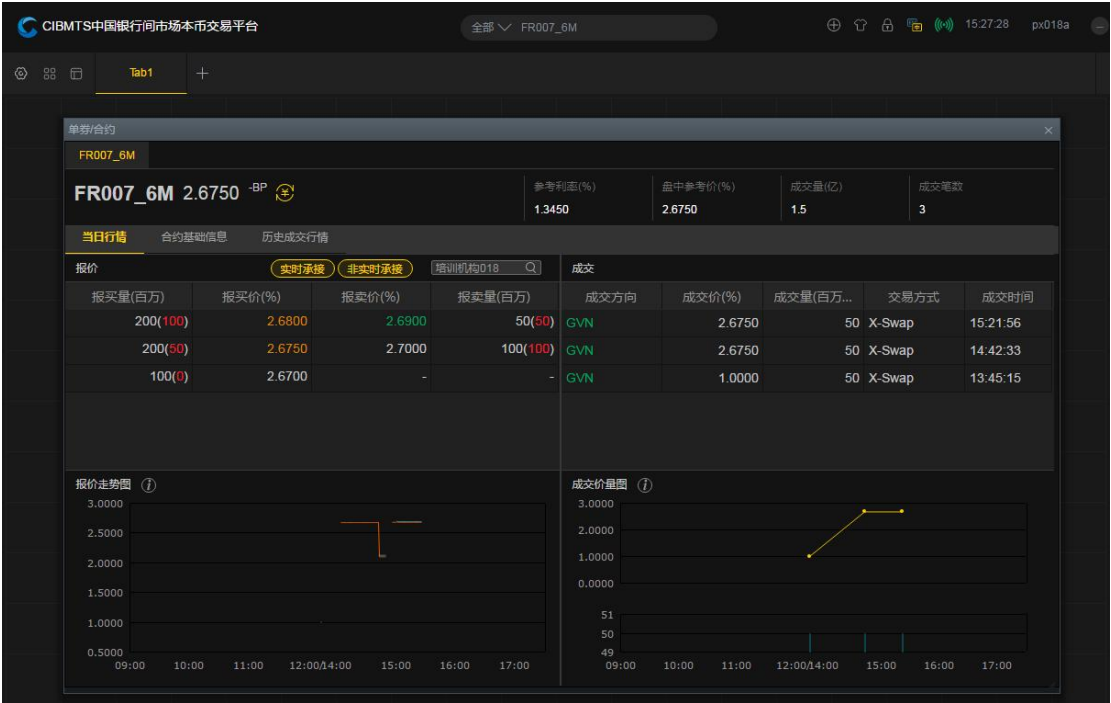
成交

6.5.2.3 X-Swap 聚合报价行情

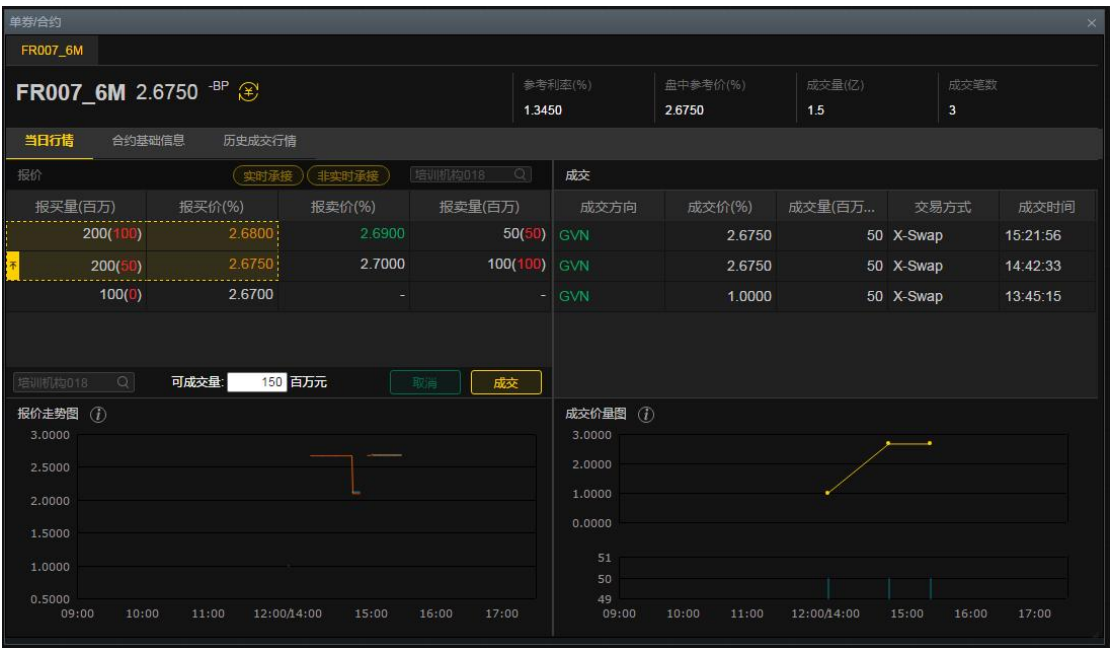
具有“利率互换-匿名点击实时承接”和“利率互换-匿名点击非实时承接”权限的用户

6.5.2.4X-Swap 单合约报价行情

客户端界面任意直接合约“合约品种”字段，双击即可打开该合约的单券/合约界面。



在“当日行情”—“报价行情”中，查看当前合约的聚合报价行情，点击价格/报价量字段，可打开下图扫单界面，输入可成交量后点击 **成交** 按钮，即可以当前选中的价格对后台进行扫单，最终成交价格将优于或等于该价格，成交量不超过扫单选中的报价量。



6.5.2.5 X-Swap 专属报价行情

具有“利率互换-点击成交”权限的用户可点击“--公开报价--X-Swap 专属行情”菜单路径，打开【X-Swap 专属报价行情】界面，可以查看本机构对应交易商的利率互换专属报价行情。

X-Swap专属报价行情

广发银行

浦发银行

富国基金公司

中国银行

平安银行

苏州银行

江苏省农联社

合约品种

参考利率

深度	合约品种	买量(百万元)	买价(%BP)	卖价(%BP)	卖量(百万元)
	FR007_6M	50	303.3000	-	-
	FR007_1Y	100	6.2000	-	-
	Shibor3M_4Y	50	46.5000	42.5000	50
		-	-	42.5000	50

对于有交易意向的合约，可以点击按钮查看当前合约的所有深度行情，双击价格/报价量字段，可打开 iQuote，确认“报价量”后点击按钮进行成交。

X-Swap 专压报价行情

广发银行

浦发银行

富国基金公司

中国银行

平安银行

苏州银行

江苏省农联社

合约品种

参考利率

深度	合约品种	买量(百万元)	买价(%BP)	卖价(%BP)
	FR007_6M	50	303.3000	-
	FR007_1Y	100	6.2000	-
	Shibor3M_4Y	50	46.5000	42.5000
		-	-	42.5000

利率互换-点击成交

YOURS

有效时间 19:00

本方*

江苏省农联社

对手方*

富国基金公司

合约品种

Shibor3M_4Y

RATE(%) *

46.5000

AMOUNT(手) *

1

x50百万

成交

6.5.3 对话报价

6.5.3.1 发起报价

1、任意身份下具有“利率互换-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧

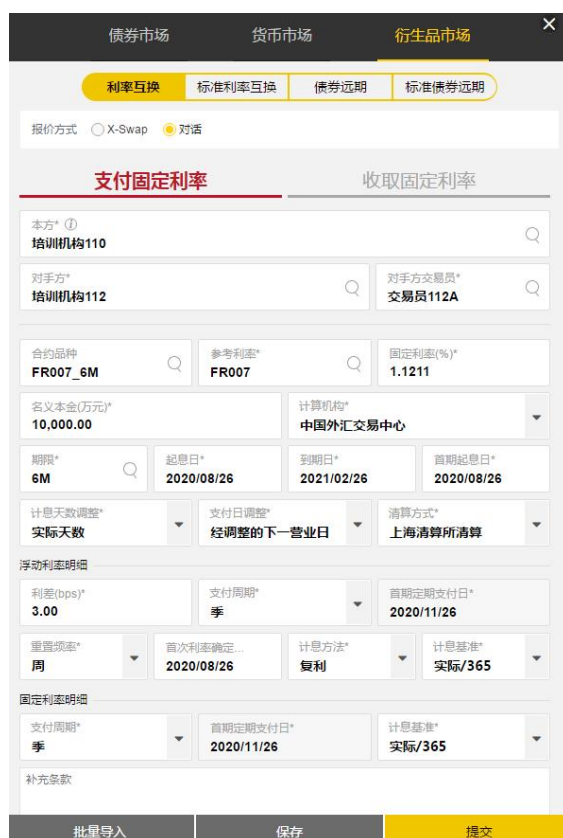


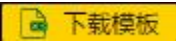
按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“对话”，填写各类报价要素

后，点击

提交

按钮，即可发送一笔利率互换对话报价：



2、也可批量提交对话报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“对话”，点击按钮，在模板中填写对话报价数据，点击按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。



报价方式	交易方向	本方状态	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	合约品种	参考利率	期限	起
☐ 对话	支付固定利率	已发送	培训机构110	培训机构112	培训机构112	交易员112A / 培训师	FR007_6M	FR007	6M	2020/08/26

6.5.3.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】界面交易方式选择“对话”，可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换 债券远期

交易方式 **对话** 导入 下载模板

交易方向 **全部** 支付固定利率 收取固定利率 本方状态 **全部** 待发送 已发送 待成交 合约品种 对手方 对手方交易员 对手方类型 **全部** 自售 资管 代理

☐	报价方式	交易方向	本方状态	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	合约品种	参考利率	期限	起
☐	对话	收取固定利率	待成交	培训机构110	培训机构112	培训机构112	交易员112A / 培训	FR007_1Y	FR007	1Y	2020/
☐	对话	支付固定利率	已发送	培训机构110	培训机构112	培训机构112	交易员112A / 培训	FR007_6M	FR007	6M	2020/

撤销 拒绝 提交 成交

1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击 **撤销** 按钮终止对话报价；或双击对话报价记录打开 iQuote，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击 **提交** 按钮更新对话报价。

债券市场 货币市场 **衍生品市场**

利率互换 标准利率互换 债券远期 标准债券远期

报价方式 ☐ X-Swap ☒ 对话

支付固定利率

本方* ① 培训机构110

对手方* 培训机构112 对手方交易员* 交易员112A

合约品种 FR007_6M 参考利率* FR007 固定利率(%)* 1.1211

名义本金(万元)* 10,000.00 计算机构* 中国外汇交易中心

期限* 6M 起息日* 2020/08/26 到期日* 2021/02/26 首期起息日* 2020/08/26

计息天数调整* 实际天数 支付日调整* 经调整的下一营业日 清算方式* 双边自行清算

浮动利率明细

利差(bps)* 3.00 支付周期* 季 首期定期支付日* 2020/11/26

重置频率* 周 首次利率确定... 2020/08/26 计息方法* 复利 计息基准* 实际/365

固定利率明细

撤销 提交

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击 **成交** 按钮进行成交，或点击 **拒绝** 按钮拒绝成交。也可双击对话报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝、修改谈判要素后进行提交。

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

X-Swap

对话

收取固定利率

16:13 交易员112A 将 固定利率 从 1.1121 修改为 1.1123 ;

本方* ①

培训机构110

对手方*

培训机构112

对手方交易员*

交易员112A

合约品种

FR007_1Y

参考利率*

FR007

固定利率(%)*

1.1123

名义本金(万元)*

20,000.00

计算机构*

中国外汇交易中心

期限*

1Y

起息日*

2020/08/26

到期日*

2021/08/26

首期起息日*

2020/08/26

计息天数调整*

实际天数

支付日调整*

经调整的下一营业日

清算方式*

双边自行清算

浮动利率明细

利率(bps)*

0.00

支付周期*

季

首期定期支付日*

2020/11/26

重置频率*

周

首次利率确定...

2020/08/26

计息方法*

复利

计息基准*

实际/365

固定利率明细

拒绝

提交

成交

6.5.3.2 历史对话报价信息查询

利率互换市场对话报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-利率互换报价查询】界面，交易方式选择“对话”，查看历史的对话报价。

报价信息查询-衍生品市场									
利率互换报价查询 标准利率互换订单查询 标准债券远期订单查询 债券远期报价查询									
交易方式: ☐ X-Swap ☒ 对话									
本方交易员	交易方向	全部	支付固定利率	收取固定利率	成交状态	全部	成交	未成交	日期 2020/08/25 - 2020/08/26
合约品种	参考利率								导出
报价编号	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	对手方机构	本方方向	报价方式	合约品种	期限
200825060201002676	培训机构110	交易员110A	培训机构112	交易员112A	培训机构112	收取固定利率	对话	FR007_1Y	1Y
200825060202002504	培训机构110	交易员110A	培训机构112	交易员112A	培训机构112	支付固定利率	对话	FR007_6M	6M
人民币利率互换 共2笔(收取固定利率1/支付固定利率1),3笔(收取固定利率2/支付固定利率1)									

6.5.4 请求报价

6.5.4.1 发送请求报价

任意身份下具有“利率互换-请求报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“请求”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔利率互换请求报价：



该截图展示了 CIBMTS 客户端中的“利率互换”请求报价界面。界面顶部有“债券市场”、“货币市场”和“衍生品市场”三个标签，当前选中的是“衍生品市场”。在“衍生品市场”下，有“利率互换”和“债券远期”两个子标签，当前选中的是“利率互换”。

界面中部是报价要素填写区域，分为“支付固定利率”和“收取固定利率”两个部分。当前选中的是“支付固定利率”。

填写要素包括：

- 本方：① 培训机构110
- 合约品种：FR007_1Y
- 参考利率：FR007
- 期限：1Y
- 名义本金(万元)：1,000
- 起息日：2020/11/17
- 到期日：2021/11/17
- 首期起息日：2020/11/17
- 清算方式：双边自行清算
- 计算机构：中国外汇交易中心
- 有效时间：11:57
- 计息天数调整：实际天数
- 支付日调整：经调整的下一营业日

下方是“浮动利率明细”和“固定利率明细”两个部分。

“浮动利率明细”部分包含：

- 利差(bps)：0.000
- 支付周期：季
- 首期定期支付日：2021/02/17
- 重置频率：周
- 首次利率确定日：2020/11/16
- 计息方法：复利
- 计息基准：实际/365

“固定利率明细”部分包含：

- 支付周期：季
- 首期定期支付日：2021/02/17
- 计息基准：实际/365

界面底部有“搜索对手方”输入框，下方有“可选对手方列表”和“CFETS智能推荐”两个区域。底部右侧有“没有添加”提示。底部有两个按钮：“保存”和“提交”。

如为资管或代理用户，可选择分仓方式“Pre-Allocation”，填写各类报价要素后，点击  按钮，发送一笔 Pre-Allocation 请求报价：

分仓交易功能包括“总回总”及“分回分”方式，“总回总”方式下，请求方在请求报价时无需对交易账户进行请求量分配，回复方总量回复后，请求方确认成交时对交易账户分配成交量。“分回分”方式下，请求方在请求报价发送时分配各交易账户请求量，回复方按照分配回复。

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

X-Swap

对话

请求

分仓方式

不分仓

Pre-Allocation

*注: Pre-allocation即以资管人/代理人身份发送请求报价, 发送前需选择拟分仓的资管/代理类产品账户。

支付固定利率

收取固定利率

合约品种

FR007_6M

参考利率*

FR007

期限*

6M

名义本金(万元)*

1,000

起息日*

2020/11/18

到期日*

2021/05/18

首期起息日*

2020/11/18

清算方式*

上海清算所清算

计算机构*

中国外汇交易中心

有效时间*

16:44

计息天数调整*

实际天数

支付日调整*

经调整的下一营业日

浮动利率明细

利差(bps)*

0.00

支付周期*

季

首期定期支付日

2021/02/19

重估频率*

周

首次利率确定日*

2020/11/16

计息方法*

复利

计息基准*

实际/365

固定利率明细

支付周期*

季

首期定期支付日

2021/02/19

计息基准*

实际/365

搜索对手方

已选2个对手方

可操作对手列表

B自营机构简称1604977836

保存

提交

6.5.4.2 请求报价管理-我的请求

请求报价发送成功后, 打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“RFQ || 我的请求”，可查看已经发出的请求报价并进行报价管理。

我的报价-衍生品市场											
利率互换 债券远期											
交易方式 ☐ 对话 ☒ RFQ 我的请求											
本方向 ☒ 全部 ☐ 支付固定利率 ☐ 收取固定利率 本方状态 ☒ 全部 ☐ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交 合约品种 本方 对手方 参考利率											
☐	本方向	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	合约品种	参考利率	固定利率(% , BP)	请求名义本金(万)	回复名义本金(万)	请求有效
☐	支付固定利率	待成交 ①	培训机构110	培训机构027	交易员027A	FR007_1Y*2Y	-	3.123BP	3,000	3,000	15:47 15:4
☐	收取固定利率	待成交 ②	培训机构110	培训机构026	交易员026A	S3M/R07_1Y	-	3.123BP	4,000	4,000	15:50 15:5
☐	收取固定利率	已发送	培训机构110	5	-	FR007_2Y	FR007	-	2,000	-	15:47 -
☐	支付固定利率	已发送	培训机构110	5	-	FR007_1Y	FR007	-	1,000	-	14:51 -

撤销

成交

提交

对于状态为“已发送”的请求报价, 可以选中单笔/多笔请求报价, 点击  按钮终止请求报价; 或双击请求报价记录打开 iQuote, 直接进行撤销。

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

债券远期

报价方式

X-Swap

对话

请求

支付固定利率

收取固定利率

本方

培训机构110

合约品种

FR007_3Y

参考利率

FR007

期限

3Y

名义本金(万元)

5,000

起息日

2020/11/17

到期日

2023/11/17

首期起息日

2020/11/17

清算方式

上海清算所清算

计算机构

中国外汇交易中心

有效时间

16:16

计息天数调整

实际天数

支付日调整

经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps)

0.000

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/17

重置频率

周

首次利率确定日

2020/11/16

计息方法

复利

计息基准

实际/365

固定利率明细

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/17

计息基准

实际/365

搜索对手方

已选2个对手方

可选对手方列表

培训机构026

培训机构027

CFETS智能推荐

建设银行

撤销

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

X-Swap

对话

请求

分合方式

不分合

Pre-Allocation

支付固定利率

收取固定利率

合约品种

FR007_6M

参考利率

FR007

期限

6M

名义本金(万元)

1,000

起息日

2020/11/18

到期日

2021/05/18

首期起息日

2020/11/18

清算方式

上海清算所清算

计算机构

中国外汇交易中心

有效时间

16:44

计息天数调整

实际天数

支付日调整

经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps)

0.00

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/19

重置频率

周

首次利率确定日

2020/11/16

计息方法

复利

计息基准

实际/365

固定利率明细

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/19

计息基准

实际/365

搜索对手方

已选2个对手方

可选对手方列表

B自营机构简称1604977836

CFETS智能推荐

撤销

对于状态为“待成交”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，点击 [成交](#) 按钮

成交回复；或点击 [撤销](#) 按钮撤销请求报价。或双击请求报价记录打开 iQuote，直接进行成交或者撤销。请求方仅可就一笔回复进行成交，不可成交多笔。已确认成交的请求报价结束，不再在“我的请求”界面展示。

利率互换-请求报价确认

请求有效时间 15:47

收取固定利率

本方

培训机构110

合约品种

FR007_2Y

参考利率

FR007

期限

2Y

名义本金(万元)

2,000

起息日

2020/11/17

到期日

2022/11/17

首期起息日

2020/11/17

清算方式

上海清算所清算

计算机构

中国外汇交易中心

计息天数调整

实际天数

支付日调整

经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps)

0

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/17

重置频率

周

首次利率确定日

2020/11/16

计息方法

复利

计息基准

实际/365

固定利率明细

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/17

计息基准

实际/365

对手方交易员

对手方

金额名义本金(万元)

固定利率(%)

计算机构

归属有效

交易员026AC/培...

培训机构...

2,000

3.1234

中国外汇交易中心

15.47

交易员027AC/培...

培训机构...

2,000

3.123

中国外汇交易中心

15.47

撤销

成交

利率互换-请求报价确认

请求有效时间 15:38

支付固定利率

合约品种

FR007_6M

参考利率

FR007

期限

6M

名义本金(万元)

1,000

起息日

2020/11/18

到期日

2021/05/18

首期起息日

2020/11/18

清算方式

上海清算所清算

计算机构

中国外汇交易中心

计息天数调整

实际天数

支付日调整

经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps)

0

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/19

重置频率

周

首次利率确定日

2020/11/16

计息方法

复利

计息基准

实际/365

固定利率明细

支付周期

季

首期定期支付日

2021/02/19

计息基准

实际/365

对手方交易员

对手方

金额名义本金(万元)

固定利率(%)

计算机构

归属有效

交易员026AC/培...

B自营机...

1,000

3.123

中国外汇交易中心

15.38

产品名称

分配请求量(万元)

分配归属量(万元)

A自营机构简称16049...

A代理机构简称16049...

合计(万元)

撤销

成交

6.5.4.3 请求报价管理-我的回复

任意身份下具有“利率互换-请求回复”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，打开【我的报价】

界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“RFQ || 我的回复”，可查看本方收到的请求报价、请求报价进行回复或进行管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换 债券远期

交易方式 对话 RFQ 我的请求 我的回复

本方方向 全部 支付固定利率 收取固定利率 本方状态 全部 待回复 待发送 已回复 合约品种 对手方 对手方机构 参考利率

☐	本方方向	本方状态	请求有效	对手方	对手方交易员	合约品种	参考利率	请求名义本金(万)	固定利率(%，BP)	回复名义本金(万)	回复有效	计算机构
☐	支付固定利率	已回复	15.50	培训机构110	交易员110A	S3M/R07_1Y	-	4,000	3.123BP	4,000	15.50	中国外汇交易...
☐	收取固定利率	待回复	15.47	培训机构110	交易员110A	FR007_1Y*2Y	-	3,000				中国外汇交易...
☐	支付固定利率	待回复	15.47	培训机构110	交易员110A	FR007_2Y	FR007	2,000				中国外汇交易...
☐	收取固定利率	待回复	14.51	培训机构110	交易员110A	FR007_1Y	FR007	1,000				中国外汇交易...

一键复制

撤销

拒绝

提交

对于状态为“待回复”的请求报价，可以通过 iQuote 进行报价回复。双击某条请求报价记录打开 iQuote，输入待回复要素后可点击 提交 按钮进行回复。对于 Pre-Allocation 的请求报价，如果请求方发送“分回分”的报价，回复方 iQuote 界面置灰显示的对手方为未授信的客户。

利率互换-回复请求报价

支付固定利率

请求有效时间 15:47

本方①
培训机构026

对手方
培训机构110

合约品种
FR007_2Y

参考利率
FR007

期限
2Y

清算方式*
上海清算所清算

固定利率(%)*
3.1234

X-Swap最优报价
进入

请求名义本金(万元)*
2,000

回复名义本金(万元)*
2,000

计算机构*
中国外汇交易中心

回复有效时间*
15:47

起息日
2020/11/17

到期日
2022/11/17

首期起息日
2020/11/17

计息天数调整
实际天数

支付日调整
经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps)
0

支付周期
季

首期定期支付日
2021/02/17

重置频率
周

首次利率确定日
2020/11/16

计息方法
复利

计息基准
实际/365

固定利率明细

支付周期
季

首期定期支付日
2021/02/17

计息基准
实际/365

补充条款

保存

拒绝

提交

利率互换-回复请求报价

收取固定利率

请求有效时间 15:38

本方①
B自营机构简称160497783

对手方机构
A自营机构简称160497468

分合方式
Pre-Allocation

合约品种
FR007_6M

参考利率
FR007

期限
6M

清算方式*
上海清算所清算

固定利率(%)*
3.1230

X-Swap最优报价
进入

请求名义本金(万元)*
1,000

回复名义本金(万元)*
1,000

计算机构*
中国外汇交易中心

回复有效时间*
15:38

起息日
2020/11/18

到期日
2021/05/18

首期起息日
2020/11/18

计息天数调整
实际天数

支付日调整
经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps)
0

支付周期
季

首期定期支付日
2021/02/19

重置频率
周

首次利率确定日
2020/11/16

计息方法
复利

计息基准
实际/365

固定利率明细

支付周期
季

首期定期支付日
2021/02/19

计息基准
实际/365

补充条款

对手方

分配请求量(万元)

分配回复量(万元)

1 A代理机构简称1604974885

保存

拒绝

提交

266

对于状态为“待回复”的请求报价，可以【我的报价】界面进行快捷回复。选中单笔/多笔请求报价，可在界面上直接填写“回复有效时间”/“固定利率”，点击

提交按钮进行快捷回复；或点击 **拒绝** 按钮终止请求报价。

我的报价-衍生品市场

利率互换 债券远期

交易方式 ☐ 对话 ☒ RFQ || 我的请求 • 我的回复

本方方向 **全部** 支付固定利率 收取固定利率 本方状态 **全部** 待回复 特发送 已回复 合约品种 Q 对手方 Q 对手方机构 Q 参考利率 Q

☐	本方方向	本方状态	请求有效	对手方	对手方交易员	合约品种	参考利率	请求名义本金(万)	固定利率(% BP)	回复名义本金(万)	回复有效	计算机构
☐	支付固定利率	已回复	15:50	培训机构110	交易员110A	S3M/R07_1Y	-	4,000	3.123BP	4,000	15:50	中国外汇交易...
☒	收取固定利率	待回复	15:47	培训机构110	交易员110A	FR007_1Y*2Y	-	3,000	3.123BP	3,000	15:47	中国外汇交易...
☒	支付固定利率	待回复	15:47	培训机构110	交易员110A	FR007_2Y	FR007	2,000	3.1234	2,000	15:47	中国外汇交易...
☐	收取固定利率	待回复	14:51	培训机构110	交易员110A	FR007_1Y	FR007	1,000				中国外汇交易...

拒绝 **提交**

对于状态为“已回复”的请求报价，可以选中单笔/多笔请求报价，快捷修改回复要素后，点击 **提交** 按钮再次回复；或点击 **拒绝** 按钮终止请求报价，亦或点击 **撤销** 按钮撤销回复。也可双击请求报价记录打开 iQuote，修改回复要素进行提交、直接拒绝或者撤销。

利率互换-回复请求报价

支付固定利率 请求有效时间 15:47

本方 ① 培训机构026

对手方机构 培训机构110 对手方 培训机构110

合约品种 FR007_2Y 参考利率 FR007 期限 2Y

清算方式* 上海清算所清算 固定利率(%)* 3.1234 X-Swap最优报价 输入

请求名义本金(万元)* 2,000 回复名义本金(万元)* 2,000 计算机构* 中国外汇交易中心

回复有效时间* 15:47 起息日 2020/11/17 到期日 2022/11/17

首期起息日 2020/11/17 计息天数调整 实际天数 支付日调整 经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps) 0.000 支付周期 季 首期定期支付日 2021/02/17

重置频率 周 首次利率确定日 2020/11/16 计息方法 复利 计息基准 实际/365

固定利率明细

支付周期 季 首期定期支付日 2021/02/17 计息基准 实际/365

补充条款

撤销 拒绝 提交

利率互换-回复请求报价

收取固定利率 请求有效时间 16:44

本方 ① B自营机构简称160497783 对手方机构 A自营机构简称160497468 分仓方式 Pre-Allocation

合约品种 FR007_6M 参考利率 FR007 期限 6M

清算方式* 上海清算所清算 固定利率(%)* 3.1234 X-Swap最优报价 输入

请求名义本金(万元)* 1,000 回复名义本金(万元)* 1,000 计算机构* 中国外汇交易中心

回复有效时间* 16:44 起息日 2020/11/18 到期日 2021/05/18

首期起息日 2020/11/18 计息天数调整 实际天数 支付日调整 经调整的下一营业日

浮动利率明细

利率(bps) 0.00 支付周期 季 首期定期支付日 2021/02/19

重置频率 周 首次利率确定日 2020/11/16 计息方法 复利 计息基准 实际/365

固定利率明细

支付周期 季 首期定期支付日 2021/02/19 计息基准 实际/365

对手方 分配请求量(万元) 分配回复量(万元)

1 A自营机构简称160497468

撤销 拒绝 提交

授信充足时，回复方回复量必须等于请求量；授信不足时，系统自动计算授信范围内的最大回复量，不可修改。

6.5.4.4 历史请求报价信息查询

请求报价的历史报价信息，可在“--信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场】界面，交易方式选择“RFQ”，查看历史的请求报价、请求回复信息。

报价信息查询-衍生品市场										
利率互换报价查询										
交易方式: ☐ X-Swap ☐ 对话 ☒ RFQ ☐ 我的请求 ☐ 我的回复										
本方方向 ☒ 全部 ☐ 支付固定利率 ☐ 收取固定利率 成交状态 ☒ 全部 ☐ 成交 ☐ 未成交 合约品种 对手方 参考利率 日期 2020/11/16										
报价编号	本方方向	本方	对手方	对手方机构	成交状态	合约品种	参考利率	固定利率(%...	请求名义本金(万)	回复名义本金(万)
201116090201000395	收取固定利率	培训机构110	5	5	未成交	S3M/R07_1Y	—	3.1230BP	4,000	4,000
201116090201000394	支付固定利率	培训机构110	5	5	成交	FR007_1Y*2Y	—	3.1230BP	3,000	3,000
201116090201000393	收取固定利率	培训机构110	5	5	成交	FR007_2Y	FR007	3.1234%	2,000	2,000
人民币利率互换: 共3笔(收取固定利率2/支付固定利率1), 0.9亿(收取固定利率0.6/支付固定利率0.3)										

6.5.5 成交查询

X-Swap、对话报价、请求报价、点击成交的成交信息，可在“--信息查询—成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-利率互换成交查询】界面查看，界面展示字段支持手动拖曳调整字段顺序，除了第一列“成交编号”字段不支持拖曳，其余字段均支持手动拖曳。

成交查询-衍生品市场										
利率互换										
交易方式 ☒ 全部 ☐ X-Swap ☐ 对话报价 ☐ 行权 ☐ RFQ ☐ 点击成交 合约品种 日期 2021/10/01 - 2021/10/29										
☐	成交编号	交易方向	合约品种	名义本金(万)	剩余名义本金(万)	固定利率(%)	本方	本方交易员	对手方	对手方机
☐	IRS20211028000017	收取固定利率	FR007_9M	1,500	1,500	10.0000	中国银行	陈天翔	平安银行	平安银行
☐	IRS20211028000016	收取固定利率	FR007_9M	1,000	1,000	11.0000	中国银行	陈天翔	平安银行	平安银行
☐	IRS20211028000015	支付固定利率	FR007_9M	3,500	3,500	10.0000	中国银行	陈天翔	平安银行	平安银行
☐	IRS20211028000003	支付固定利率	—	2,000	2,000	1.2300	中国银行	毛怡	招商银行(行)	招商银行(行)
☐	IRS20211028604050	收取固定利率	FR007_2Y	5,000	5,000	10.0000	中国银行	宋颖杰	中央对手方	中央对手方
☐	IRS20211028604049	收取固定利率	FR007_2Y	5,000	5,000	10.0000	中国银行	宋颖杰	中央对手方	中央对手方
☐	IRS20211028604048	收取固定利率	FR007_2Y	5,000	5,000	10.0000	中国银行	宋颖杰	中央对手方	中央对手方
总4133笔 (支付固定利率1654/收取固定利率2479), 2076.08亿元 (支付固定利率947.25/收取固定利率1228.83)										

用户点击，可在下拉框中手工定义需要展示或者隐藏的字段，以及定义字段顺序，

具体规则如下：

- 1、页面中勾选框一列（若有）以及勾选框后的第一列字段不支持隐藏，其他字段都可以隐藏；
- 2、隐藏后，可以重新添加回展示区；重新添加展示后，字段位置与隐藏前的该字段的展示位置相同；
- 3、添加或隐藏字段后，关闭页面。再次打开页面（包括退出客户端重新登录），系统展示关闭前页面的字段设置及展示顺序。



6.5.6 成交行情

6.5.6.1 逐笔成交行情

任意身份下具有相应利率互换市场交易执行权限的用户可以看到对应利率互换市场的逐笔成交。

利率互换成交行情								
逐笔成交 成交汇总								
交易方式 全部 X-Swap 对话报价 RFQ 实时承接 合约品种 参考利率 期限								
合约品种	成交时间	价格(%B...	成交量...	成交方向	交易方式	参考利率	期限	利差
FR007_1Y*2Y	14:19:21	3.123	30	TKN	RFQ	FR007		0.00
FR007_1Y	14:19:21	0.9688	60	GVN	RFQ	FR007	1Y	0.00
FR007_2Y	14:19:21	1.0000	30	TKN	RFQ	FR007	2Y	0.00
FR007_2Y	14:19:17	3.1234	20	GVN	RFQ	FR007	2Y	0.00
FR007_1Y	11:23:13	1.0000	10	TKN	RFQ	FR007	1Y	0.00
FR007_1Y	11:22:27	9.0000	10	TKN	RFQ	FR007	1Y	0.00
FR007_1Y	11:21:55	11.0000	10	TKN	RFQ	FR007	1Y	0.00
FR007_1Y	11:20:50	10.0000	10	TKN	RFQ	FR007	1Y	0.00
FR007_3Y	10:47:55	10.0000	10	TKN	RFQ	FR007	3Y	0.00
FR007_2Y	10:43:40	10.0000	10	TKN	RFQ	FR007	2Y	0.00
FR007_1Y	10:22:28	10.0000	411	TKN	RFQ	FR007	1Y	0.00

6.5.6.2 汇总成交行情


 用户点击“--成交行情--利率互换成交行情”菜单路径，打开【利率互换成交行情】界面，选择“成交汇总”TAB，查看成交汇总行情数据，支持查看请求、对话及 X-Swap 三种交易方式达成的所有标准及非标合约的成交汇总行情，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的汇总行情数据。

利率互换成交行情									
逐笔成交 成交汇总									
交易方式 汇总 X-Swap 对话报价 RFQ 合约品种 参考利率 期限									
合约品种	参考利率	期限	利差(bps)	最新价(%BP)	最新成交量(百万元)	最高价(%BP)	最低价(%BP)	开盘价(%BP)	成交量(百万
FR007_1Y	FR007	1Y	0.00	0.9688▼	60	11.0000	0.9688	10.0000	51'
FR007_2Y	FR007	2Y	0.00	1.0000▼	30	10.0000	1.0000	10.0000	60
FR007_3Y	FR007	3Y	0.00	10.0000	10	10.0000	10.0000	10.0000	10

6.5.7 当日成交


 用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“利率互换”TAB，查看当前交易日的成交汇总数据，支持查看对话、请求、X-Swap 及点击成交四种交易方式达成的所有标准及非标合约的成交，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据，界面展示字段支持手动拖曳调整字段顺序，除了第一列“合约品种”字段不支持

拖曳，其余字段均支持手动拖曳。

当日成交

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

方向

全部

BID

OFFER

交易方式

全部

X-Swap

对话报价

RFQ

点击成交

成交类型

全部

Outright

Spread

Basis

合约品种

参考利率

	合约品种	方向	固定利...	名义本...	对手方	参考利率	利差(bps)	本方	对手方机构	对手方交易员	成交编号
✓	FR007_2Y	OFFER	10.6725	40,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820036
✓	FR007_4Y	OFFER	2.4000	30,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820034
✓	FR007_2Y	OFFER	10.6725	5,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820030
✓	FR007_2Y	OFFER	10.6725	5,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820029
✓	FR007_4Y	OFFER	2.4000	50,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820028
✓	FR007_4Y	OFFER	2.4000	5,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820027
✓	FR007_2Y	OFFER	10.6725	50,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820026
✓	FR007_4Y	OFFER	2.4000	50,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820025
✓	FR007_2Y	OFFER	10.6725	5,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820024
✓	FR007_2Y	OFFER	301.21...	50,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820022
✓	FR007_7Y	OFFER	2.4000	20,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820021
✓	FR007_1Y	BID	4.2000	5,000	招商银(行)	FR007	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820020
✓	Shibor3M_1Y	OFFER	44.0000	5,000	招商银(行)	Shibor_3M	0.00	东北证券	招商银(行)	顾一夫	IRS20211029820019

共16笔(买入2/卖出14),35亿(买入2/卖出33)

用户点击，可在下拉框中手工定义需要展示或者隐藏的字段，以及定义字段顺序，具体规则如下：

- 4、页面中勾选框一列（若有）以及勾选框后的第一列字段不支持隐藏，其他字段都可以隐藏；
- 5、隐藏后，可以重新添加回展示区；重新添加展示后，字段位置与隐藏前的该字段的展示位置相同；
- 6、添加或隐藏字段后，关闭页面。再次打开页面（包括退出客户端重新登录），系统展示关闭前页面的字段设置及展示顺序。



6.6 衍生品市场-标准利率互换

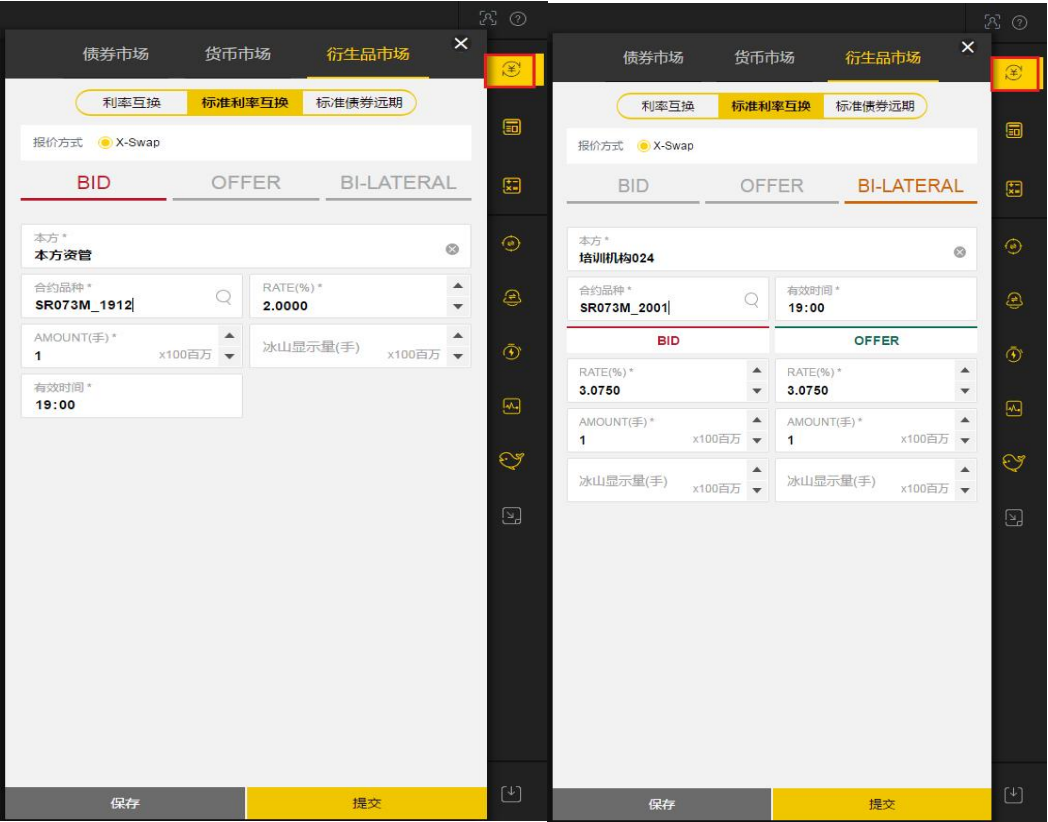
6.6.1X-Swap 订单

6.6.1.1X-Swap 订单提交

(1) 任意身份下具有“标准利率互换-匿名点击”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点

击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择【标准利率互换市场】，

报价方式选择“X-Swap”，填写各报价要素后，点击  按钮，即可发送订单，支持提交双边订单：



报价发送成功后，点击“--我的交易-X-Swap 订单”菜单路径，可打开【我的订单-X-Swap 订单】界面，点击【标准利率互换】tab 页，可查看已经发出的 X-Swap 订单，或对订单进行修改和撤销操作。

(2) 提供批量提交 X-Swap 订单功能。可点击  按钮，在导出模板中填写订单数据，点击  按钮导入 X-Swap 订单后，批量提交。

我的订单-X-Swap 订单

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

方向 全部 BID OFFER 状态 全部 有效 冻结 订单类型 全部 OCO 冰山 来源 全部 客户端 API 合约品种 Q 本方 Q

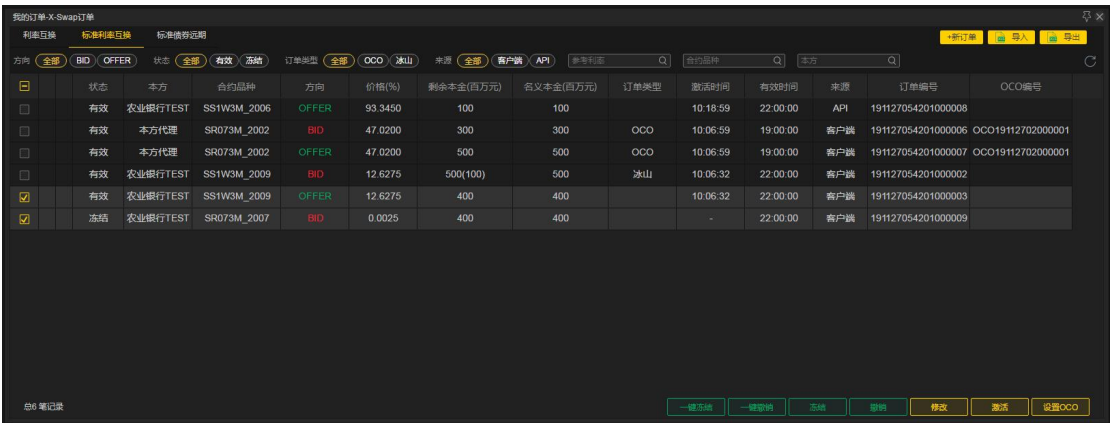
☐	状态	本方	合约品种	方向	价格(%)	剩余本金(百万元)	名义本金(百万元)	订单类型	激活时间	有效时间	来源	订单编号	OCO编号
☐	有效	农业银行TEST	SS1W3M_2006	OFFER	93.3450	100	100		10:18:59	22:00:00	API	191127054201000008	
☐	有效	本方代理	SR073M_2002	BID	47.0200	300	300	OCO	10:06:59	19:00:00	客户端	191127054201000006	OCO19112702000001
☐	有效	本方代理	SR073M_2002	OFFER	47.0200	500	500	OCO	10:06:59	19:00:00	客户端	191127054201000007	OCO19112702000001
☐	有效	农业银行TEST	SS1W3M_2009	BID	12.6275	500(100)	500	冰山	10:06:32	22:00:00	客户端	191127054201000002	
☐	有效	农业银行TEST	SS1W3M_2009	OFFER	12.6275	400	400		10:06:32	22:00:00	客户端	191127054201000003	

共5笔记录

一键冻结 一键撤销 冻结 撤销 修改 激活 设置OCO

6.6.1.2 订单管理

订单发送成功后，点击“--我的交易—X-Swap 订单”菜单路径，可打开【我的订单-X-Swap 订单】界面，【标准利率互换】市场 Tab 页，查看已经发出的订单，或对订单进行修改和撤销操作。



➢ 对于状态为“有效”的订单，可以选中单笔/多笔订单，点击按钮撤销订单；或点击按钮冻结订单。



➢ 对于状态为“有效”的订单，可以双击订单记录打开 iQuote，修改部分订单要素后，点击按钮更新订单；或点击按钮，保存当前订单数据，暂不提交。

➤ 设置 OCO 交易策略

在【我的订单-X-Swap】界面，勾选需要进行 OCO 交易策略设置的多笔订单，点击

设置OCO按钮进行设置；

我的订单-X-Swap订单

利率互换

标准利率互换

标准债券远期

新订单

挂单

持仓

导出

方向

全部

BID

OFFER

状态

全部

有效

冻结

订单类型

全部

OCO

冰山

来源

全部

客户端

API

参考价格

Q

合约品种

Q

主方

Q

☐		有效	农业银行TEST	SS1W3M_2006	OFFER	93.3450	100	100		订单类型	激活时间	有效时间	来源	订单编号	OCO编号
☐		有效	本方代理	SR073M_2002	BID	47.0200	300	300	OCO	10:06:59	19:00:00	客户端	191127054201000006	OCO19112702000001	
☐		有效	本方代理	SR073M_2002	OFFER	47.0200	500	500	OCO	10:06:59	19:00:00	客户端	191127054201000007	OCO19112702000001	
☐		有效	农业银行TEST	SS1W3M_2009	BID	12.6275	500(100)	500	冰山	10:06:32	22:00:00	客户端	191127054201000002		
☒		有效	农业银行TEST	SS1W3M_2009	OFFER	12.6275	400	400		10:06:32	22:00:00	客户端	191127054201000003		
☒		冻结	农业银行TEST	SR073M_2007	BID	0.0025	400	400		-	22:00:00	客户端	191127054201000009		

总6笔记录

一键冻结

一键撤销

冻结

撤销

修改

激活

设置OCO

➤ 批量修改订单

在【我的订单-X-Swap】界面，勾选需要进行批量修改的订单，点击 **修改** 按钮进入【修改页面】；

修改标准利率互换

本方	合约品种	方向	剩余本金(百万元)	单位报价量(百万...	名义本金(百万元)	订单类型	价格(%)	名义本金(...	冰山显示量(手)
工商银行	SR073M_2003	OFFER	100	100	100		15.5525	1	

取消

保存

提交

点击

保存

或

提交

按钮，订单被展示在【我的订单-X-Swap】页面。

6.6.1.3 交易分仓

X-Swap 需要分仓的订单成交意向后，可在“

交易分仓

—我的交易—交易分仓”菜单路径下，查看成交意向信息，分仓方可在分仓有效时间内进行分仓操作。

交易分仓

利率互换交易分仓 标准利率互换交易分仓

状态

全部

待本方分仓

待对手方分仓

已分仓

失效

 本方方向

全部

支付固定利率

收取固定利率

 日期 2019/12/09 ~ 2019/12/09 本方主体

全部

Y

C

成交意向编号	成交意向时间	状态	有效时间	合约品种	本方方向	本方	本方主体	本方交易员	名义本金
IRS20191209700019	2019/12/09 19:29:09	待本方分仓	21:28:59	SR073M_1912	收取固定利率	—	本方代理	LinShu	4000

K < 1 / 1 > X 共1条

点击“待本方分仓”的成交意向记录，打开分仓界面：

本方	分配量(万)

+ 添加 合计

取消 提交

在分仓界面选择分配的产品以及填写对应分配量,点击提交,若分仓成功则状态变为“已分仓”。

注意：用户需在交易中心规定的时间范围内进行分仓。当日收盘前支持提交申请应急分仓，收盘后系统不允许分仓，用户未在当日收盘前进行分仓视同违约处理。

6.6.1.4 历史订单查询

X-Swap 的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-标准利率互换订单查询】界面，查看历史的 X-Swap 订单。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换订单查询 标准利率互换订单查询 标准远期订单查询

订单类型: 全部 限价 冰山 FAK 订单状态: 全部 撤销 成交 本方: 订单日期: 2019/11/01 ~ 2019/12/09 导出

订单编号	机构	账户主体	本方	交易员	订单来源	订单类型	订单状态	交易方向	合约品种
191126054201000002	中国银行	中国银行	中国银行	中行零零零一	客户端	限价	撤销	OFFER	SR073M_1912
191126054201000001	中国银行	中国银行	中国银行	备用十三	客户端	限价	撤销	BID	SR073M_1912
191125054201000004	中国银行	中国银行	中国银行	田零零零二	客户端	限价	撤销	BID	SR073M_1912
191125054201000002	中国银行	中国银行	中国银行	田零零零二	客户端	限价	撤销	BID	SR073M_1912
191125054201000006	中国银行	中国银行	中国银行	田零零零二	客户端	限价	撤销	OFFER	SR073M_1912
191125054201000005	中国银行	中国银行	中国银行	田零零零二	客户端	限价	成交	BID	SR073M_1912
191125054201000001	中国银行	中国银行	中国银行	田零零零二	客户端	限价	成交	BID	SR073M_1912
191123054201000002	中国银行	中国银行	中国银行	陈天翔	客户端	限价	撤销	BID	SR073M_1912
191123054201000001	中国银行	中国银行	中国银行	陈天翔	客户端	限价	撤销	BID	SR073M_1912
191123054201000004	中国银行	中国银行	中国银行	陈天翔	客户端	限价	成交	BID	SR073M_1912
191122054201010125	中国银行	中国银行	中国银行	田零零零二	客户端	限价	撤销	BID	SR073M_1912
191122054201010257	中国银行	中国银行	中国银行	陈天翔	客户端	限价	撤销	OFFER	SS011M_1912

1 / 2

6.6.2X-Swap 点击成交

6.6.2.1 X-Swap 报价行情

任意身份下具有“标准利率互换-匿名点击”权限的用户可点击“--公开报价--X-Swap 标准利率互换”菜单路径，打开【X-Swap 报价】行情界面，选择“本方”的主体，可以查看该主体市场当日的标准利率互换报价行情。

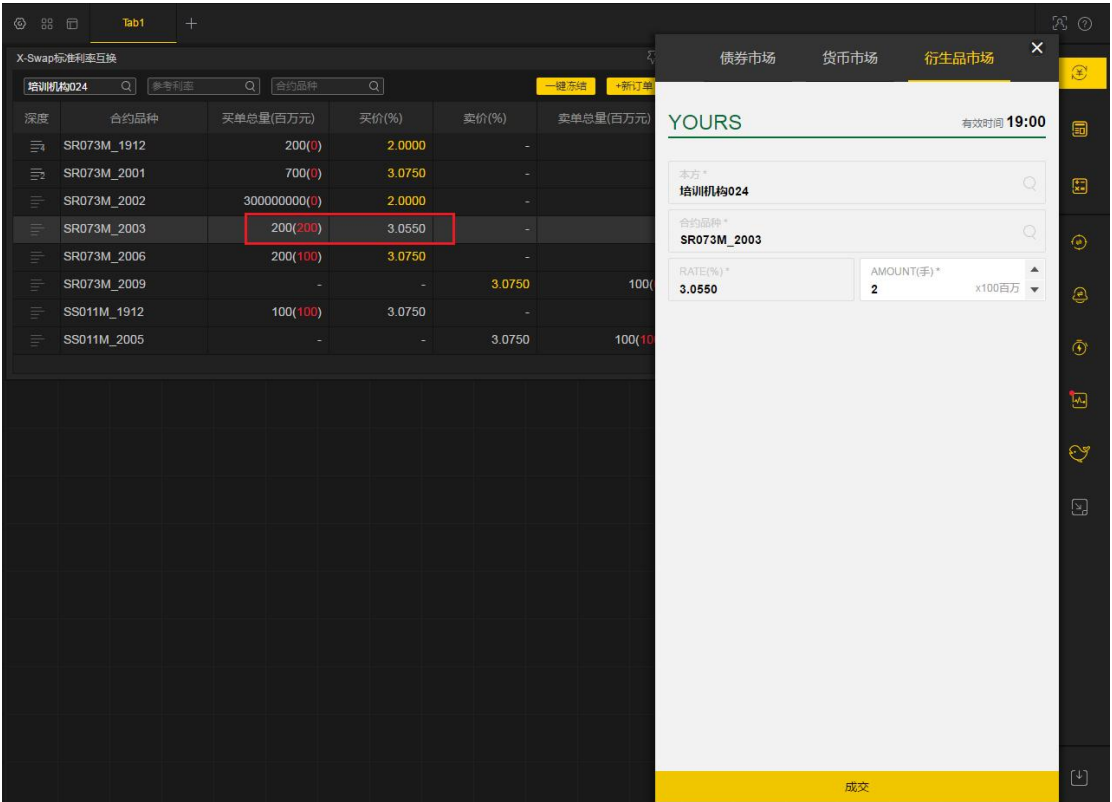
X-Swap标准利率互换

培训机构024 参考利率 合约品种 一键冻结 +新订单

深度	合约品种	买单总量(百万元)	买价(%)	卖价(%)	卖单总量(百万元)
≡ ₁	SR073M_1912	300(100)	2.0000	-	-
		600(600)	1.9925	-	-
		200(200)	1.9600	-	-
		100(0)	1.0000	-	-
≡ ₂	SR073M_2001	700(0)	3.0750	-	-
≡	SR073M_2002	300000000(0)	2.0000	-	-
≡	SR073M_2006	100(0)	3.0750	-	-
≡	SR073M_2009	-	-	3.0750	100(0)
≡	SS011M_1912	-	-	3.0750	100(100)

对于有交易意向的合约，可以点击按钮查看当前合约的所有深度行情，双击价格/报价

量字段，可打开 iQuote，确认“报价量”后点击按钮进行成交。



6.6.3 X-Swap 成交查询

6.6.3.1 X-Swap 成交查询

X-Swap 的成交信息，可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-标准利率互换成交查询】界面，查看 X-Swap 成交。

成交查询-衍生品市场

利率互换成交查询 标准利率互换成交查询 标准远期成交查询 利率互换成交情况统计

日期 2019/12/05 ~ 2019/12/09 合约品种 Q

导出 下载成交单

成交编号	成交状态	本方	本方交易员	对手方	对手方机构	对手方交易员	交易方向	账户主
IRS20191206700013	正常	农业银行	LinShu	瑞穗银行	瑞穗银行	陈颖	OFFER	农业银
IRS20191206700012	正常	农业银行	LinShu	瑞穗银行	瑞穗银行	陈颖	OFFER	农业银

总2笔(买入0/卖出2),8亿元(买入0/卖出8)

K < 1 / 1 > X

6.6.4 X-Swap 成交行情

6.6.4.1 X-Swap 逐笔成交行情

任意身份下具有“标准互换-匿名点击 or 监控权限-标准利率互换”权限且可用的交易账户具有“标准利率互换-逐笔行情”权限的用户可点击“--成交行情--标准利率互换成交行情”菜单路径，打开【标准利率互换成交行情】界面，选择“逐笔行情”TAB，查看逐笔行情数据，通过筛选合约品种和参考利率查看不同的逐笔成交行情。

标准利率互换成交行情

逐笔成交 成交汇总

合约品种 Q 参考利率 Q

合约品种	成交时间	价格	成交量(百万)	成交方向
SR073M_2009	10:15:45	12.0000	100	GVN
SR073M_2005	10:13:50	21.4975	100	GVN

6.6.4.2 X-Swap 汇总成交行情

用户点击“--成交行情--标准利率互换成交行情”菜单路径，打开【标准利率互换成交行情】界面，选择“成交汇总”TAB，查看成交汇总行情数据，通过筛选不同的合约品种和

参考利率查询不同合约品种和参考利率的汇总行情。

标准利率互换成交行情

逐笔成交

成交汇总

合约品种

参考利率

合约品种	最高价(%)	最低价(%)	开盘价(%)	最新成交价(%)	最新成交量(百万元)	成交...	笔数	加权平均价(%)
SR073M_2009	12.0000	12.0000	12.0000	12.0000	100	100	1	12.0000
SR073M_2005	21.4975	21.4975	21.4975	21.4975	100	100	1	21.4975

6.6.5X-Swap 当日成交

用户点击“我的交易—当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“标准利率互换”TAB，查看当前交易日的成交汇总数据，支持查看标准利率互换达成的所有成交，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据。

当日成交

利率互换

标准利率互换

标准远期

债券远期

方向

全部

BID

OFFER

合约品种

参考利率

对手方

	合约品种	方向	固定利...	名义本...	对手方	参考利率	本方	对手方机构	对手方交易员	成交编号	成交状态
✓	SR073M_2010	OFFER	6.6025	20000	建设银行	FR007	中信证券	建设银行	靳莉	IRS20200914700001	正常

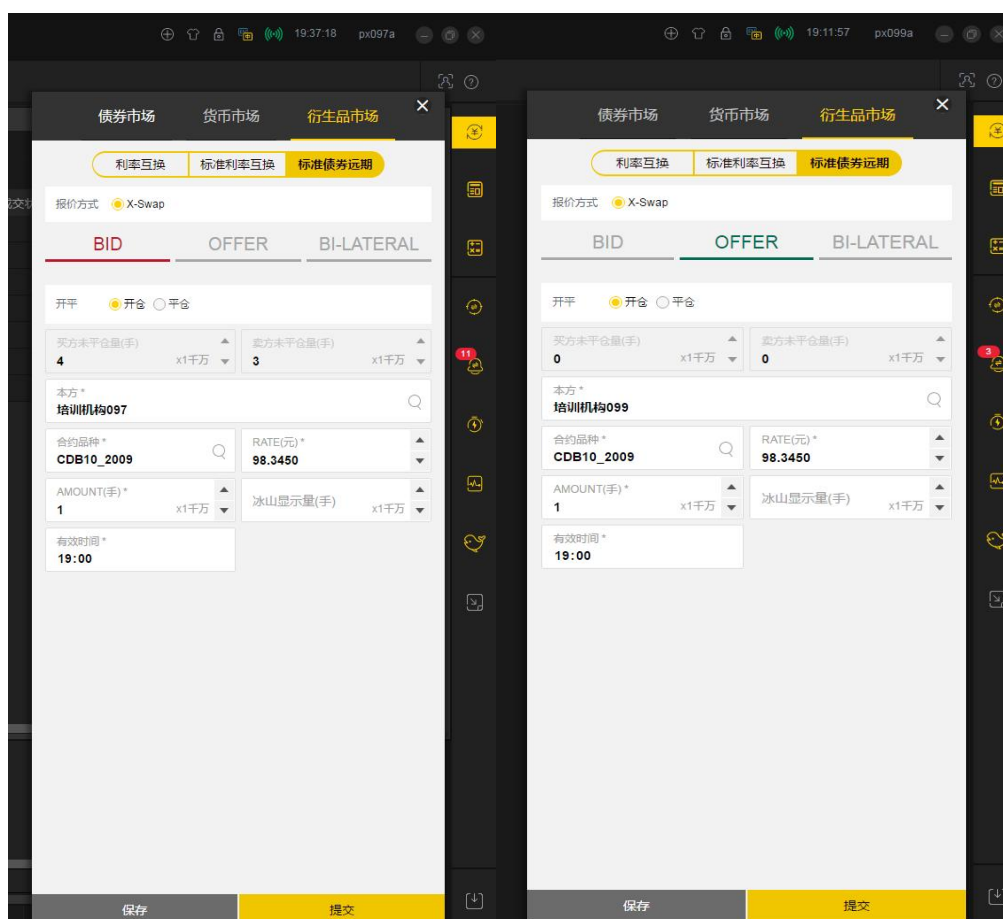
共1笔(买入0/卖出1),2亿(买入0/卖出2)

6.7 衍生品市场-标准债券远期

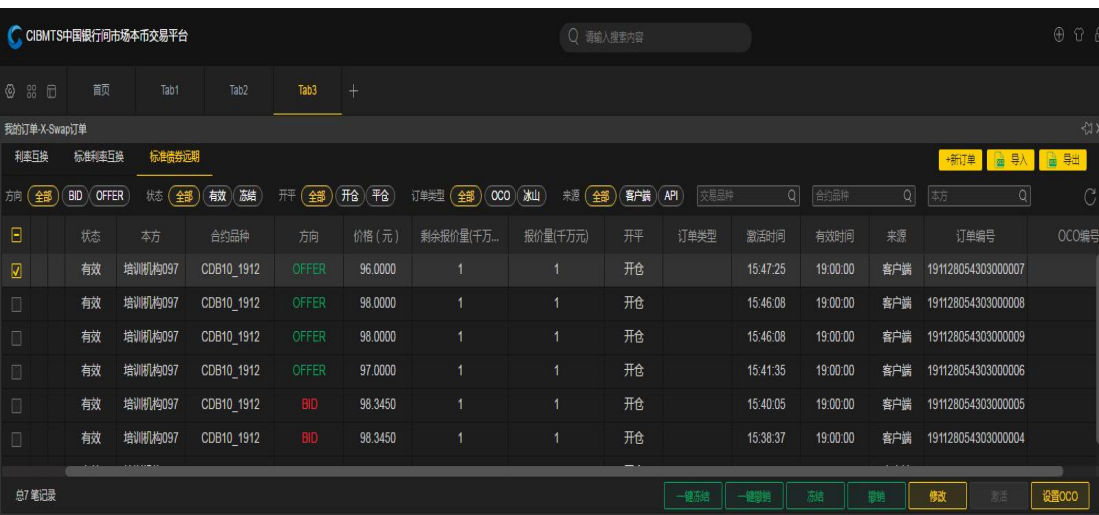
6.7.1 X-Swap 订单

6.7.1.1 X-Swap 订单提交

(1) 任意身份下具有“标准债券远期-匿名点击”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择【标准债券远期市场】，报价方式选择“X-Swap”，填写各报价要素后，点击  按钮，即可发送订单，支持提交双边订单：



报价发送成功后，点击“--我的交易-X-Swap 订单”菜单路径，可打开【我的订单



【-X-Swap 订单】界面，点击【标准债券远期】tab 页，可查看已经发出的 X-Swap 订单，或对订单进行修改和撤销操作。

（2）提供批量提交 X-Swap 订单功能。可点击

 按钮，

在导出模板中填写订单数据，点击  按钮导入 X-Swap 订单后，批量提交。

6.7.1.2 订单管理

订单发送成功后，点击“我的交易—X-Swap 订单”菜单路径，可打开【我的订单-X-Swap 订单】界面，【标准债券远期】市场 Tab 页，查看已经发出的订单，或对订单进行修改和撤销操作。



➤ 对于状态为“有效”的订单，可以选中单笔/多笔订单，点击  按钮撤销

订单；或点击  按钮冻结订单。

我的订单-X-Swap订单

方向	全部	BID	OFFER	状态	全部	有效	冻结	开平	全部	开仓	平仓	订单类型	全部	OCO	冰山	来源	全部	客户端	API	交易品种	合约品种	本方	订单编号	OCO编号
☒				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER			96.0000	1	1	开仓										191128054303000007	
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER			98.0000	1	1	开仓										191128054303000008	
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER			98.0000	1	1	开仓										191128054303000009	
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER			97.0000	1	1	开仓										191128054303000006	
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	BID			98.3450	1	1	开仓										191128054303000005	
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	BID			98.3450	1	1	开仓										191128054303000004	

总7笔记录

一键冻结 一键撤销 冻结 撤销 修改 删除 设置OCO

➤ 对于状态为“有效”的订单，可以双击订单记录打开 iQuote，修改部分订单要素后，

点击 **提交** 按钮更新订单；或点击 **保存** 按钮，保存当前订单数据，暂不提交。

债券市场 货币市场 衍生品市场

利率互换 标准利率互换 标准债券远期

报价方式: X-Swap

BID OFFER BI-LATERAL

开平: 开仓 平仓

买方未平仓量(手): 0 x1千万 卖方未平仓量(手): 0 x1千万

本方: 工商银行

合约品种: CDB5_2006 RATE(元): 99.7750

AMOUNT(手): 1 x1千万 冰山显示量(手): x1千万

有效时间: 19:00

保存 提交

➤ 设置 OCO 交易策略

在【我的订单-X-Swap】界面，勾选需要进行 OCO 交易策略设置的多笔订单，点击

设置OCO 按钮进行设置：

我的订单 X-Swap 订单

方向	全部	BID	OFFER	状态	全部	有效	冻结	开平	全部	开仓	平仓	订单类型	全部	OCO	冰山	来源	全部	客户端	API	交易品种	Q	合约品种	Q	主方	Q
☒				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER		96.0000	1	1	开仓				15.47.25	19.00.00	客户端					191128054303000007		
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER		98.0000	1	1	开仓				15.46.08	19.00.00	客户端					191128054303000008		
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER		98.0000	1	1	开仓				15.46.08	19.00.00	客户端					191128054303000009		
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	OFFER		97.0000	1	1	开仓				15.41.35	19.00.00	客户端					191128054303000006		
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	BID		98.3450	1	1	开仓				15.40.05	19.00.00	客户端					191128054303000005		
☐				有效	培训机构097	CDB10_1912	BID		98.3450	1	1	开仓				15.38.37	19.00.00	客户端					191128054303000004		

总记录数: 6

一键冻结 一键解冻 冻结 撤销 修改 撤单 设置OCO

➤ 批量修改订单

在【我的订单-X-Swap】界面，勾选需要进行批量修改的订单，点击  按钮进入【修改页面】：

修改标准债券远期

本方	合约品种	方向	剩余报价量(千...)	单位报价量(千...)	报价量(千万元)	开平	价格(元)	报价量(手)	冰山显示量(手)
工商银行	CDB5_2006	BID	1	1	1	开仓	99.7750	1	

取消 保存 提交

点击  或  按钮，订单被展示在【我的订单-X-Swap】页面。

6.7.1.3 历史订单查询

X-Swap 的历史报价信息，可在“  --我的交易--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-标债远期订单查询】界面，查看历史的 X-Swap 订单。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换订单查询 标准利率互换订单查询 标债远期订单查询

订单类型 全部 限价 冰山 FAK 订单状态 全部 撤销 成交 本方 订单日期 2019/12/09 -- 2019/12/09 导出

订单编号	机构	本方	交易员	订单来源	订单类型	订单状态	交易方向	合约品种	报价量(千万)
191209054303000020	中国银行	中国银行	晁思溢	客户端	限价	撤销	OFFER	CDB10_2003	1
191209054303000019	中国银行	中国银行	晁思溢	客户端	限价	撤销	BID	CDB10_2003	1
191209054303000016	中国银行	中国银行	晁思溢	客户端	限价	成交	BID	CDB10_2003	1
191209054303000004	中国银行	中国银行	晁思溢	客户端	限价	撤销	BID	CDB10_2003	1
191209054303000005	中国银行	中国银行	晁思溢	客户端	限价	成交	OFFER	CDB10_2003	1

6.5.2X-Swap 点击成交

6.7.1.4 X-Swap 报价行情

任意身份下具有“标准债券远期-匿名点击”权限的用户可点击“--公开报价—X-Swap 标准债券远期”菜单路径，打开【X-Swap 报价】行情界面，可以查看市场当日的标准债券远期报价行情

CIBMTS中国银行间市场本币交易平台

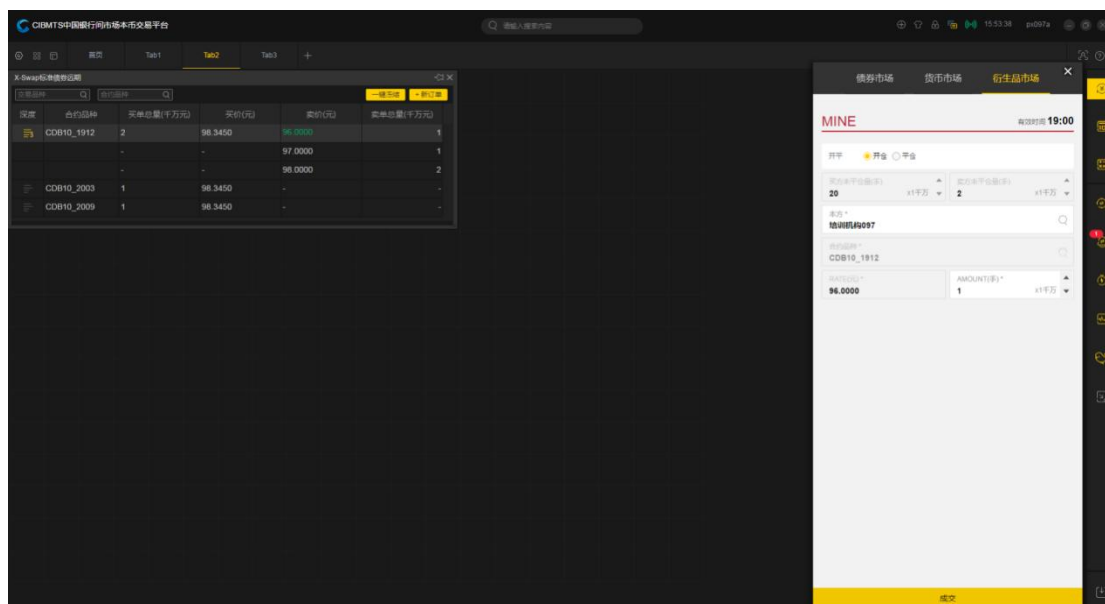
首页 Tab1 Tab2 Tab3 +

X-Swap标准债券远期

交易品种 合约品种 一键冻结 + 新订单

深度	合约品种	买单总量(千万元)	买价(元)	卖价(元)	卖单总量(千万元)
1	CDB10_1912	2	98.3450	96.0000	1
		-	-	97.0000	1
		-	-	98.0000	2
2	CDB10_2003	1	98.3450	-	-
3	CDB10_2009	1	98.3450	-	-

对于有交易意向的合约，可以点击按钮查看当前合约的所有深度行情，双击价格/报价量字段，可打开 iQuote，确认“报价量”后点击按钮进行成交。



6.7.2 实物交割

6.7.2.1 发起申报

(1) 任意身份下具有“标准债券远期-交割申报”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点

击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“交割意向”，填写各

类申报要素后，点击  按钮，即可发送一笔交割申报：

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

X-Swap

交割意向

付款方

付券方

本方*

建设银行

合约品种*

CDB10_2105P

申报合约量(手)

1

x1千万

净持仓(手)

-9

x1千万

代码*

091918002

交割债券*

19农发清发02

申报券面(万)*

1000

+

申报券面合计(万)

1,000

提交

用户在申报时应注意以下三点：

- a) 付款方在申报时，申报交割的合约数量不得超过净持仓；
- b) 付券方在申报时，可申报多只可交割债券，且申报债券券面总额应不超过净持仓；申报债券的券面总额应与申报合约量保持一致，若两者不一致则以申报券面总额为准。
- c) 在同一申报日内，同一交易账户对于同一合约只能提交一条申报记录；若多次提交，则以最新一次提交的信息为准。

(2) 申报发送成功后，打开【我的报价】界面（“--我的交易--我的报价--标债交割”路径下打开），可查看已经发出的意向申报。

我的报价-衍生品市场

利率互换

债券远期

标债交割

状态

全部

付款方

付券方

合约名称

Q

刷新

☐	本方方向	本方	申报状态	合约品种	申报合约量(千万)	代码	交割债券	申报券面(万)	托管账号	申
☐	付券方	建设银行	已提交	CDB10_2105P	1	091918002	19农发清发02	1000	0000072	21051

总1笔记录, 付款方0笔, 付券方1笔

撤销

（3）选中单笔/多笔申报，点击

撤销

按钮撤销对应申报；也可以双击某笔申报调起【我要报价】界面，修改部分申报要素后，点击

提交

按钮更新申报记录。

6.7.2.2 交割申报查询

打开衍生品市场的标债债券远期信息查询页面，选择交割申报查询所在的 tab 页，查看交割意向申报的历史申报记录、历史匹配记录、历史交割记录。双击任意一条记录，可打开交割申报单。

有标准债券远期市场监控权限的用户可查看本机构下所有的交割申报情况；仅有标债远期监控权限的用户可查看本机构的强制匹配、申报违约和权限违约；应保证本机构至少有一个用户拥有标债市场监控权限。

6.7.3 X-Swap 成交查询

6.7.3.1 X-Swap 成交查询

X-Swap 的成交信息，可在“-信息查询-成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-标债远期成交查询】界面，查看 X-Swap 成交。



成交查询-衍生品市场

利率互换成交查询 标准利率互换成交查询 标准远期成交查询 利率互换成交情况统计

日期: 2019/12/09 2019/12/09 合约品种: [搜索]

导出 下载成交单

☐	成交编号	成交状态	本方	本方交易员	对手方	对手方机构	对手方交易员	交易方向	交易品种
☐	SBF20191209600015	正常	农业银行	潘泽东	上海清算所	上海清算所	—	买入	10年期标准国
☐	SBF20191209600008	正常	农业银行	李西西	上海清算所	上海清算所	—	买入	5年期标准国开
☐	SBF20191209600005	正常	农业银行	LinShu	上海清算所	上海清算所	—	卖出	5年期标准国开
☐	SBF20191209600003	正常	农业银行	潘泽东	上海清算所	上海清算所	—	买入	10年期标准国
☐	SBF20191209600002	正常	农业银行	潘泽东	上海清算所	上海清算所	—	买入	10年期标准国
☐	SBF20191209600001	正常	农业银行	潘泽东	上海清算所	上海清算所	—	买入	10年期标准国

共6笔(买入5/卖出1),0.6亿(买入0.5/卖出0.1)

K < 1 / 1 >

6.7.4 X-Swap 成交行情

6.7.4.1 X-Swap 逐笔成交行情

任意身份下具有“标准债券远期-匿名点击 or 监控权限-标准债券远期”权限且可用的交易账户具有“标准债券远期-逐笔行情”权限的用户可点击“-成交行情-标准债券远期成交行情”菜单路径，打开【标准债券远期成交行情】界面，选择“逐笔行情”TAB，查看逐笔行情数据，通过筛选合约品种查看不同合约的逐笔成交行情。

标准债券远期成交行情

逐笔成交 成交汇总

合约品种

合约品种	成交时间	价格	成交量(千万)	成交方向	持仓量(手)
CDB5_2009	13:32:58	103.3425	3	GVN	0
CDB3_2012	11:24:16	103.5075	1	TKN	2
CDB3_2106	11:19:50	12.3300	1	GVN	2
CDB3_2012	11:15:28	103.5075	1	TKN	2
CDB3_2009	11:15:18	86.9375	1	GVN	2
CDB5_2009	11:14:57	103.3425	50	TKN	100
CDB5_2009	11:10:07	103.3425	50	TKN	100
CDB3_2012	11:07:42	103.5075	1	DONE	2
CDB5_2009	11:06:58	103.3425	50	TKN	100
CDB5_2009	11:01:41	103.3425	1	DONE	2
CDB5_2009	10:59:55	103.3425	1	TKN	2

6.7.4.2X-Swap 汇总成交行情

用户点击“--成交行情--标准债券远期成交行情”菜单路径，打开【标准债券远期成交行情】界面，选择“成交汇总”TAB，查看成交汇总行情数据，通过筛选不同的合约品种查询不同合约品种的汇总行情。

标准债券远期成交行情

逐笔成交 成交汇总

合约品种

合约品种	最高价(元)	最低价(元)	开盘价(元)	最新成交价(元)	最新成交量(千万元)	成交...	笔数	加权平均价(元)	当E
CDB5_2009	103.3425	103.3375	103.3425	103.3425	3	260	11	103.3425	
CDB3_2012	103.5075	103.5075	103.5075	103.5075	1	3	3	103.5075	
CDB3_2106	12.3300	12.3300	12.3300	12.3300	1	1	1	12.3300	
CDB3_2009	86.9375	86.9375	86.9375	86.9375	1	2	2	86.9375	
CDB3_2006	103.9550	103.9550	103.9550	103.9550	4	8	3	103.9550	
CDB10_2508	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1	1	1	1.0000	

6.7.5X-Swap 当日成交

用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“标债远期”TAB，查看当前交易日的成交汇总数据，支持查看标债远期达成的所有成交，通过

界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据。

当日成交									
利率互换		标准利率互换		标准远期		债券远期			
方向		全部		BID		OFFER		合约品种	
								对手方	
合约品种	方向	成交价格(元)	成交量(...	开平仓	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	成交编号
CDB5_2007	OFFER	100.2100	1000	平仓	中信证券	上海清算所	上海清算所	—	SBF20200914600001
共1笔(买入0/卖出1),0.1亿(买入0/卖出0.1)									

6.8 衍生品市场-债券远期

6.8.1 对话报价

6.8.1.1 发起报价

1、任意身份下具有“债券远期-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧

按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“对话”，填写各类报价要素后，点击

按钮，即可发送一笔债券远期对话报价：

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

对话

买入

卖出

代码*

zllgz

名称*

zll国债

待偿期

2.79Y

估值

2.740456

主体/债项

AAA/-

本方*

培训机构110

对手方*

培训机构112

对手方交易员*

交易员112A

远期期限(天)*

30

结算日

2020/09/24

远期净价(元)*

11.1121

远期到期收益率(%)*

90.7424

券面总额(万)*

10000

结算方式*

券款对付

补充条款

交易品种

BFD1M

应计利息(元)

0.02222

远期全价(元)

11.1343

交易金额(元)

11,112,100.00

应计利息总额(元)

22,222.22

结算金额(元)

11,134,322.22

保存

提交

6.8.1.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】界面下的债券远期市场，可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换

债券远期

本方方向

全部

买入

卖出

本方状态

全部

待发送

已发送

待成交

对手方

对手方交易员

对手方机构

代码/名称

远期期限(天)

	本方方向	债券代码	债券名称	本方状态	本方	对手方	对手方交易员	远期净价	远期到期收益率(%)	远期行权收益
☐	买入	zh1230	zh1230	待成交	培训机构110	培训机构112	交易员112A / 培i	85.1121	77.1715	
☐	买入	zllgz	zll国债	已发送	培训机构110	培训机构112	交易员112A / 培i	11.1121	90.7424	

撤销

拒绝

提交

成交

- 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击

撤销

 按钮终止对话报价；或双击对话报价记录打开 iQuote，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击

提交

 按钮更新对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

对话

买入

卖出

代码*

zllgz

名称*

zll国债

待偿期

2.79Y

估值

2.740456

主体/债项

AAA/-

本方*

培训机构110

对手方*

培训机构112

对手方交易员*

交易员112A

远期期限(天)*

30

结算日

2020/09/24

远期净价(元)*

11.1121

远期到期收益率(%)*

90.7424

券面总额(万)*

10000

结算方式*

见款付券

补充条款

交易品种

BFD1M

应计利息(元)

0.02222

远期全价(元)

11.1343

交易金额(元)

11,112,100.00

应计利息总额(元)

22,220.00

结算金额(元)

11,134,320.00

撤销

提交

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击 **成交** 按钮进行成交，或点击 **拒绝** 按钮拒绝成交。也可双击对话报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝。

债券市场

货币市场

衍生品市场

利率互换

标准利率互换

债券远期

标准债券远期

报价方式

对话

买入

卖出

zll国债

zllgz

待偿期

2.79Y

估值

2.740456

主体/债项

AAA/-

本方*

培训机构112

对手方*

培训机构110

对手方交易员*

交易员110A

远期期限(天)*

30

结算日

2020/09/24

远期净价(元)*

11.1121

远期到期收益率(%)*

90.7424

券面总额(万)*

10000

结算方式*

补充条款

交易品种

BFD1M

应计利息(元)

0.02222

远期全价(元)

11.1343

交易金额(元)

11,112,100.00

应计利息总额(元)

22,220.00

结算金额(元)

11,134,320.00

拒绝

成交

6.8.1.3 历史对话报价信息查询

债券远期市场对话报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-债券远期报价查询】界面，查看历史的对话报价。

报价信息查询-衍生品市场									
利率互换报价查询 标准利率互换订单查询 标准债券远期订单查询 债券远期报价查询									
本方方向		全部	买入	卖出	成交状态		全部	已成交	未成交
代码名称		Q		日期		2020/08/25		2020/08/25	
报价编号	最后更新时间	代码	名称	成交状态	本方方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	本方
200825060502000685	2020/08/25 18:46:14	zhy1230	zhy1230	成交	买入	培训机构112	培训机构112	交易员112A	培训机构110
200825060502000684	2020/08/25 18:41:59	zhy1231	zhy1231	未成交	买入	培训机构112	培训机构112	交易员112A	培训机构110
200825060501000680	2020/08/25 16:37:41	zllgz	zll国债	未成交	买入	培训机构112	培训机构112	交易员112A	培训机构110
总3笔(买入3/卖出0) , 3亿元(买入3/卖出0)									

6.8.2 成交查询

对话报价的成交信息，可在“-信息查询-成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-债券远期成交查询】界面，查看对话报价成交。



该截图展示了“成交查询-衍生品市场”的“债券远期成交查询”子界面。顶部有搜索和筛选功能，包括“本方方向”（全部、买入、卖出）、“对手方”搜索框、日期范围（20200825 - 20200825）以及“代码/名称”搜索框。右侧有“导出”和“下载成交单”按钮。下方是一个表格，列出了成交记录。

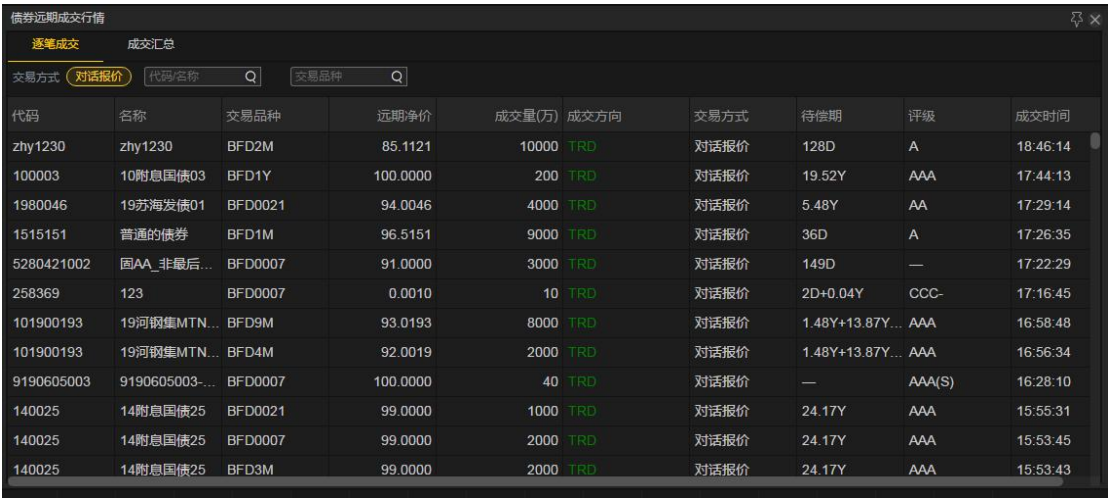
成交编号	代码	名称	本方方向	对手方	对手方机构	对手方交易员	对手方代理机构	本方	本方交易员
BFD20200825300381	zhhy1230	zhhy1230	买入	培训机构112	培训机构112	交易员112A	—	培训机构110	交易员110A

底部显示“总1笔(买入1/卖出0)，1亿元(买入1/卖出0)”。

6.8.3 成交行情

6.8.3.1 逐笔成交行情

任意身份下具有“债券远期-询价交易”或“监控权限-债券远期”权限，且可用的交易账户具有“债券远期-逐笔行情”权限的用户，可点击“-成交行情-债券远期成交行情”菜单路径，打开【债券远期成交行情】界面，选择“逐笔行情”TAB，查看逐笔行情数据。支持查看对话报价达成的逐笔成交



该截图展示了“债券远期成交行情”的“逐笔成交”子界面。顶部有“交易方式”（对话报价）和“交易品种”搜索框。下方是一个表格，列出了逐笔成交记录。

代码	名称	交易品种	远期净价	成交量(万)	成交方向	交易方式	待偿期	评级	成交时间
zhhy1230	zhhy1230	BFD2M	85.1121	10000	TRD	对话报价	128D	A	18:46:14
100003	10附息国债03	BFD1Y	100.0000	200	TRD	对话报价	19.52Y	AAA	17:44:13
1980046	19苏海发债01	BFD0021	94.0046	4000	TRD	对话报价	5.48Y	AA	17:29:14
1515151	普通的债券	BFD1M	96.5151	9000	TRD	对话报价	36D	A	17:26:35
5280421002	国AA_非最后...	BFD0007	91.0000	3000	TRD	对话报价	149D	—	17:22:29
258369	123	BFD0007	0.0010	10	TRD	对话报价	2D+0.04Y	CCC-	17:16:45
101900193	19河钢集MTN...	BFD9M	93.0193	8000	TRD	对话报价	1.48Y+13.87Y...	AAA	16:58:48
101900193	19河钢集MTN...	BFD4M	92.0019	2000	TRD	对话报价	1.48Y+13.87Y...	AAA	16:56:34
9190605003	9190605003...	BFD0007	100.0000	40	TRD	对话报价	—	AAA(S)	16:28:10
140025	14附息国债25	BFD0021	99.0000	1000	TRD	对话报价	24.17Y	AAA	15:55:31
140025	14附息国债25	BFD0007	99.0000	2000	TRD	对话报价	24.17Y	AAA	15:53:45
140025	14附息国债25	BFD3M	99.0000	2000	TRD	对话报价	24.17Y	AAA	15:53:43

6.8.3.2 汇总成交行情

用户点击“--成交行情--债券远期成交行情”菜单路径，打开【债券远期成交行情】界面，选择“成交汇总”TAB，查看成交汇总行情数据，支持查看对话报价达成的所有的成交汇总行情，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的汇总行情数据。

债券远期成交行情

逐笔成交 成交汇总

交易方式 对话报价 代码/名称 交易品种

代码	名称	交易品种	最新远期净价	涨跌	前收盘远期净价	前加权平均远期净价	开盘远期净价	最高远期净价	最低远期净价	加权平均远期
zhy1230	zhy1230	BFD2M	85.1121	—	—	—	85.1121	85.1121	85.1121	85
100003	10附息国债03	BFD1Y	100.0000	—	—	—	100.0000	100.0000	100.0000	100
1980046	19苏海发债01	BFD0021	94.0046	—	—	—	94.0046	94.0046	94.0046	94
1515151	普通的债券	BFD1M	96.5151	—	—	—	96.5151	96.5151	96.5151	96
5280421002	固AA_非最后...	BFD0007	91.0000	—	—	—	91.0000	91.0000	91.0000	91
258369	123	BFD0007	0.0010	—	—	—	0.0010	0.0010	0.0010	0
101900193	19河钢集MTN...	BFD9M	93.0193	—	—	—	93.0193	93.0193	93.0193	93
101900193	19河钢集MTN...	BFD4M	92.0019	—	—	—	92.0019	92.0019	92.0019	92
9190605003	9190605003-...	BFD0007	100.0000	—	—	—	100.0000	100.0000	100.0000	100
140025	14附息国债25	BFD0021	99.0000	—	—	—	99.0000	99.0000	99.0000	99
140025	14附息国债25	BFD0007	99.0000	—	—	—	99.0000	99.0000	99.0000	99
140025	14附息国债25	BFD3M	99.0000	—	—	—	99.0000	99.0000	99.0000	99

6.8.4 当日成交

用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“债券远期”TAB，查看当前交易日的成交汇总数据，支持查看债券远期达成的成交，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据。

当日成交

利率互换 标准利率互换 标准远期 债券远期

本方方向 全部 买入 卖出 对手方 代码/名称 交易品种 远定期限(天)

成交编号	本方方向	代码	名称	远定期收益率(%)	券面总额(万)	远期净价	应计利息	远期全价	远定期限(天)
BFD20200911300099	卖出	zllqyz	zll企业债	2.0000	10000	100.0000	0.03889	100.0389	2

6.9 债券借贷

6.9.1 意向报价

6.9.1.1 发起报价

(1) 任意身份下具有“债券借贷-意向报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，报价方式选择“意向”，填写各

类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔意向报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

现券买卖

债券借贷

债券路演

报价方式 ☒ 意向 ☐ 对话

融入

融出

本方

测试机构A

Q

☒ 标的债券代码/名称

☐ 标的债券类型

标的债券代码*

2089117

×

标的债券名称*

20兴瑞1C

Q

券面总额(万元)

借贷期限

借贷费率(%)

①

清算速度

报价有效时间

当日有效

☐ 匿名

质押券属性

☐ 利率债

☐ 政府支持机...

☐ 地方政府债

☐ 企业债

☐ 中票

☐ 同业存单

☐ 商业银行债

☐ 中债托管信...

☐ 上清托管

☐ 非两高一剩

☐ 非永续

☐ 国企

☐ AAA及以上

☐ AA及以上

☐ AA+及以上

备注(全市场可见)

收益率高

保存

提交

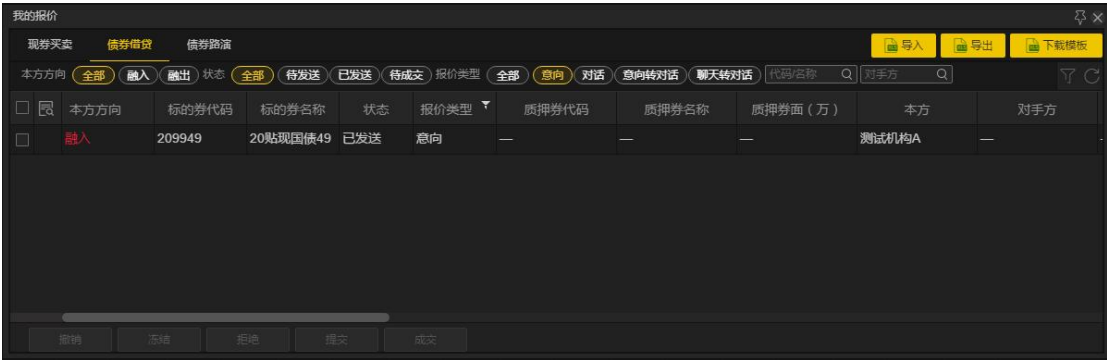
(2) 提供批量提交意向报价功能。任意身份下具有“债券借贷-意向报价”权限的用户

登录 CIBMTS 客户端，可在“--我的交易--我的报价-债券借贷”菜单路径下，打开【我的报价-债券借贷】界面，点击按钮，在意向报价模板中填写意向报价数据，点击按钮导入意向报价后，选中校验通过的意向报价，批量提交。



6.9.1.2 意向报价管理

报价发送成功后，可在“--我的交易--我的报价-债券借贷”菜单路径下，打开【我的报价-债券借贷】界面，报价类型选择“意向”，查看已经发出的意向报价，或对意向报价进行修改、激活、冻结和撤销操作。点击可将查询结果导出到本地查看。



6.9.1.3 历史意向报价信息查询

意向报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-债券借贷】界面，报价方式选择“意向/对话报价”，报价类

型选择“意向”，查看历史的意向报价。



6.9.2 意向转对话报价

6.9.2.1 发起意向转对话报价

登录 CIBMTS 客户端，可在“--公开报价--X-Lending 报价”菜单路径下，打开【债券借贷 X-Lending 报价】界面，任意身份下具有“债券借贷-对话报价”权限的用户双击一笔非本人发出的具名意向报价，进入“债券借贷-意向报价转对话报价界面”，做意向转对话保存或提交操作。

（1）意向转对话保存功能：至少需填写“标的债券代码”、“标的债券名称”、“标的券券面总额”三个报价要素，点击按钮，即可保存一笔意向转对话报价。保存成功后意向转对话报价的修改/提交/撤销功能详见“6.9.2.2 意向转对话报价管理”。保存成功后原意向报价在“X-lending 报价”展示的“券面总额”将会更新为扣除掉该笔意向转对话输入的“标的券券面总额”后的最新剩余券面总额值，若剩余券面总额值为零，则意向报价将自动冻结。

（2）意向转对话发送功能：填写所有必填的报价要素，点击按钮，即可发送一笔意向转对话报价。提交成功后原意向报价在“X-lending 报价”展示的“券面总额”将会更新为扣除掉该笔意向转对话输入的“标的券券面总额”后的最新剩余券面总额值，若剩

余券面总额值为零，则意向报价将自动冻结。

债券借贷X-Lending报价										
语言 默认 按债券 融入 融出 智能推荐 精准报价 限时报价 活跃券 具名 代码/名称 标的券类型 借贷期限 更新时										
	标的券	方向	券面总额(万)	交易员/报价方	借贷期限	借贷费率(%)	清算速度	质押券属性	备注	更新时
☆	209947 20贴现国债...	融入	2,000.00	王波 / 汇添富基...	1D/2-7D	0.4560	+0	利率债/AA及以上	-	2020/10/25
☆	112099499 20鹿城...	融出	110.00	刘亨亨 / 农业银行	1D	1.2030	+1	AAA及以上	批量-当日有效	2020/10/25
☆	209948 20贴现国债...	融入	120.00	刘亨亨 / 农业银行	1-3M/3M以上	1.2040	+0	AA及以上	批量-当日有效	2020/10/25
☆	dr102402 dr102402	融出	210.00	刘亨亨 / 农业银行	8D-1M/3M以上	1.1890	+1	AA及以上	批量-当日有效	2020/10/25
☆	209947 20贴现国债...	融出	170.00	刘亨亨 / 农业银行	2-7D	1.1730	+0	AAA及以上	批量-当日有效	2020/10/25
☆	zhys zhys	融入	120.00	刘亨亨 / 农业银行	1-3M/3M以上	1.1440	+0	AA及以上	批量-当日有效	2020/10/25
☆	112089102 20苏州...	融入	180.00	刘亨亨 / 农业银行	1D/2-7D	1.1740	+1	AA及以上	批量-开市有效	2020/10/25
☆	209949 20贴现国债...	融入	180.00	刘亨亨 / 农业银行	1D/2-7D	1.1140	+1	AA及以上	批量-开市有效	2020/10/25
☆	zhys1 zhys1	融出	110.00	刘亨亨 / 农业银行	2-7D	1.1430	+1	AAA及以上	批量-当日有效	2020/10/25
☆	209947 20贴现国债...	融出	210.00	刘亨亨 / 农业银行	8D-1M/3M以上	1.1290	+1	AA及以上	批量-当日有效	2020/10/25

债券市场

货币市场

衍生品市场

融出

原意向报价信息

标的券

209947 / 20贴现国债47

券面总额(万)

2,000

借贷期限

1D/2-7D

借贷费率(%)

0.456

清算速度

+0

质押券属性

利率债/AA及以上

本方* ①

测试机构A

对手方*

汇添富基金公司

对手方交易员*

王波

标的债券代码

209947

标的债券名称

20贴现国债47

标的券面总额(万元)*

2,000

借贷费率(%)*

0.4560

借贷期限(天)*

6

清算速度*

+0

质押债券置换安排

是

争议解决方式*

仲裁

首次结算方式*

券券对付

到期结算方式*

券券对付

补充条款

质押券代码

质押券名称

券面总额(万元)

估值净价(元)

估值全价(元)

+

1

2089228

20兴银5A

2,000

-

-

🗑

2

2089030

20德宝天元1次级

5,000

-

-

🗑

保存

提交

6.9.2.2 意向转对话报价管理

报价保存或发送成功后，在【我的报价】界面报价类型选择“意向转对话”，可查看已

经保存或发出的意向转对话报价，并进行意向转对话报价管理，点击可将查询结果导出到本地查看。

1. 对于状态为“待发送”的意向转对话报价，可以选中单笔/多笔意向转对话报价，点击按钮撤销保存的意向转对话报价；也可以双击某笔意向转对话报价，修改报价要素后，点击按钮保存意向转对话报价；也可双击某笔意向转对话报价，补充部分报价要素后，点击按钮提交意向转对话报价。

2. 对于状态为“已发送”的意向转对话报价，可以选中单笔/多笔意向转对话报价，点击按钮终止意向转对话报价；也可以双击某笔意向转对话报价，修改部分报价要素后，点击按钮更新意向转对话报价。

3. 对于状态为“待成交”的意向转对话报价：

(a) 若意向转对话报价有质押券信息，可以拒绝或达成成交。一是在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔意向转对话报价，点击按钮直接达成成交，或点击按钮拒绝意向转对话报价；二是可直接双击某条意向转对话报价记录打开iQuote，点击按钮达成一笔意向转对话成交，或点击来拒绝成交。

我的报价

现券买卖 债券借贷

本方方向 全部 融入 融出 状态 全部 待发送 已发送 待成交 报价类型 全部 意向 对话 意向转对话 聊天转对话 代码/名称 对手方

☒	本方方向	标的券代码	标的券名称	状态	报价类型	质押券代码	质押券名称	质押券面(万)	本方	对手方
☒	融入	209947	20贴现国债47	待成交	意向转对话	2	2	7000	汇添富基金公司	测试机构A
1			—			2089228	20兴银5A	2,000		
2			—			2089030	20德宝天元1次级...	5,000		

撤销 冻结 拒绝 提交 成交

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券借贷

报价方式

意向

对话

融入

本方* ①

汇添富基金公司

对手方*

测试机构A

对手方交易员*

王五

标的债券代码

209947

标的债券名称

20贴现国债47

标的券面总额(万元)*

2,000

借贷费率(%)*

0.4560

借贷期限(天)*

6

清算速度*

+0

质押债券置换安排

是

争议解决方式*

仲裁

首次结算方式*

券券对付

到期结算方式*

券券对付

补充条款

质押券代码	质押券名称	券面总额(万元)	估值净价(元)	估值全价(元)
1 2089228	20兴银5A	2,000.00	-	-
2 2089030	20德宝天元1次级	5,000.00	-	-

交易品种

L007

实际占券天数

6

首次结算日

2020/10/29

到期结算日

2020/11/04

借贷费用(元)

1,499.18

质押债券券面总额合计(万元)

7,000

质押率(估值净价,%) ①

-

质押率(估值全价,%) ①

-

质押率(券面,%) ①

350.00

拒绝

成交

(b) 若意向转对话报价无质押券信息，可以拒绝或补充质押券信息后提交。拒绝操作同上述 (a) 中描述；补充质押券信息提交操作需在【我的报价】界面双击某条意向转对话报价记录打开 iQuote，进入白屏界面，补充质押券相关要素，点击 提交 按钮提交意向转对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

报价方式

意向

对话

融入

本方* ①

建设银行

对手方*

中信证券

对手方交易员*

王玥

标的债券代码

219903

标的债券名称

21贴现国债03

标的债券面总额(万元)*

200

借贷费率(%)*

1.0000

借贷期限(天)*

2

清算速度*

+0

质押债券置换安排

是

争议解决方式*

仲裁

首次结算方式*

券券对付

到期结算方式*

券券对付

补充条款

质押券代码

质押券名称

券面总额(万元)

估值净价(元)

估值全价(元)

+

1

交易品种

L007

实际占券天数

3

首次结算日

2021/02/26

到期结算日

2021/03/01

借贷费用(元)

164.38

质押债券券面总额合计(万元)

质押率(估值净价,%) ①

-

质押率(估值全价,%) ①

-

质押率(券面,%) ①

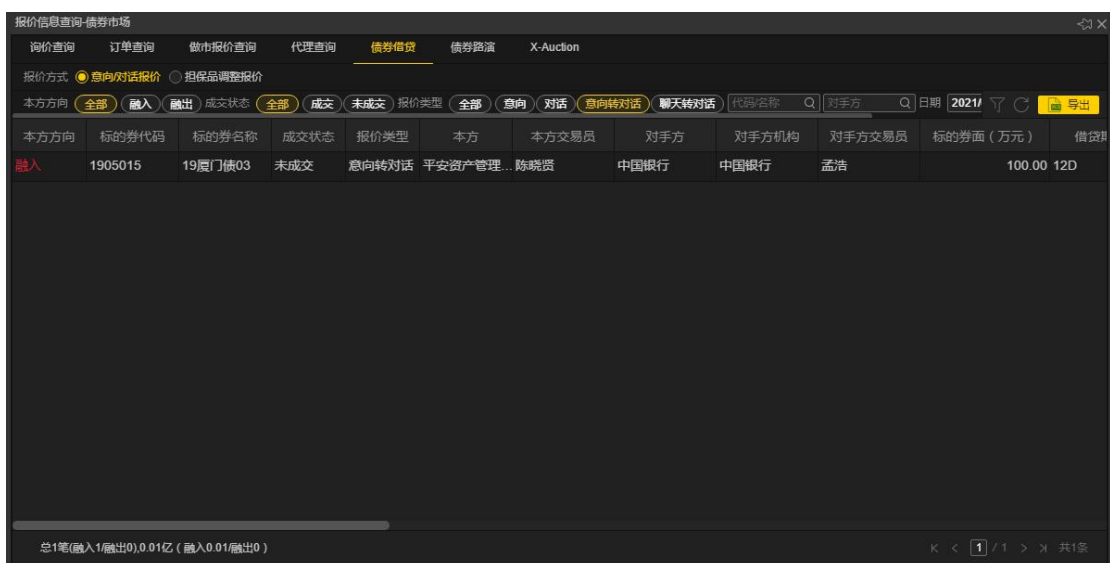
0.0000

拒绝

提交

6.9.2.3 历史意向转对话报价信息查询

对话报价的历史报价信息，可在“--信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-债券借贷】界面，报价方式选择“意向/对话报价”，报价类型选择“意向转对话”，查看历史的意向转对话报价。



6.9.3 对话报价

6.9.3.1 发起报价

(1) 任意身份下具有“债券借贷-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右



侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，报价方式选择“对话”，填写各

类报价要素(支持标的券、质押券使用不同托管机构的债券,即跨托管交易)后,点击按钮,即可发送一笔对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

报价方式

意向

对话

融入

融出

本方

测试机构A

对手方

对手方交易员

标的债券代码

2089117

标的债券名称

20兴瑞1C

标的债券总额(万元)*

2,000

借贷利率(%)*

0.4500

借贷期限(天)*

6

清算速度*

+0

质押债券置换安排

是

争议解决方式*

仲裁

首次结算方式*

券券对付

到期结算方式*

券券对付

补充条款

质押券代码

2089264

质押券名称

20建元8A3_bc

券面总额(万元)

2,000

估值净价(元)

-

估值全价(元)

-

交易品种

L007

实际占券天数

6

首次结算日

2020/10/28

到期结算日

2020/11/03

借贷费用(元)

1,479.45

质押债券券面总额合计(万元)

2,000

质押率(估值净价, %)

-

质押率(估值全价, %)

-

质押率(券面, %)

100.00

保存

提交

本方

测试机构A

对手方

对手方交易员

标的债券代码

dr102402

标的债券名称

dr102402

标的债券总额(万元)*

2,000

借贷利率(%)*

0.4500

借贷期限(天)*

6

清算速度*

+0

质押债券置换安排

是

争议解决方式*

仲裁

首次结算方式*

券券对付

到期结算方式*

券券对付

补充条款

当前为受托机构债券借贷

质押券代码

2089129

质押券名称

20建鑫2优先

券面总额(万元)

1,000

估值净价(元)

-

估值全价(元)

-

2022033

20华夏租赁债01

2,000

-

-

交易品种

L007

实际占券天数

6

首次结算日

2020/10/28

到期结算日

2020/11/03

借贷费用(元)

1,479.45

质押债券券面总额合计(万元)

3,000

质押率(估值净价, %)

-

质押率(估值全价, %)

-

质押率(券面, %)

150.00

保存

提交

(2) 提供批量提交对话报价功能。任意身份下具有“债券借贷-对话报价”权限的用户

登录 CIBMTS 客户端，可在“--我的交易--我的报价--债券借贷”菜单路径下，打开【我的报价-债券借贷】界面，点击按钮，在对话报价模板中填写对话报价数据，点击按钮导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。

我的报价

现券买卖

债券借贷

债券路演

本方方向

全部

融入

融出

状态

全部

待发送

已发送

待成交

报价类型

全部

意向

对话

意向转对话

聊天转对话

代码/名称

对手方

对手方交易员

本方方向

标的券代码

标的券名称

状态

报价类型

质押券代码

质押券名称

质押券面(万)

本方

对手方

撤销

冻结

拒绝

提交

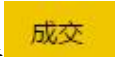
成交

6.9.3.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】界面报价类型选择“对话”，可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理，点击可将查询结果导出到本地查看。

1.对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击按钮终止对话报价；也可以双击某笔对话报价，修改部分报价要素后，点击按钮更新对话报价。

2. 对于状态为“待成交”的对话报价：

（a）若对话报价有质押券信息，可以拒绝或达成成交。一是在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔对话报价，点击按钮直接达成成交，或点击按钮拒绝对话报价；二是可直接双击某条对话报价记录打开 iQuote，点击按钮达成一笔对话成交，或点击来拒绝成交。

我的报价

现券买卖

债券借贷

债券路演

本方方向

全部

融入

融出

状态

全部

待发送

已发送

待成交

报价类型

全部

意向

对话

意向转对话

聊天转对话

代码/名称

Q

对手方

Q

导入

导出

下载模板

☐	本方方向	标的券代码	标的券名称	状态	报价类型	质押券代码	质押券名称	质押券面 (万)	本方	对手方
☒	融出	209939	20贴现国债39	待成交	对话	2	2	9000	测试机构A	汇添富基金公司
1						2089229	20兴银5B	5,000		
2						2089119	20招银和萃2C	4,000		

撤销

冻结

拒绝

提交

成交

债券市场

货币市场

衍生品市场

×

现券买卖

债券借贷

债券路演

报价方式 ☐ 意向 ☒ 对话

融出

本方* ①
测试机构A

对手方*
汇添富基金公司

对手方交易员*
王波

标的债券代码
209939

标的债券名称
20贴现国债39

标的债券面总额(万元)*
5,000

借贷费率(%)*
0.5600

借贷期限(天)*
5

清算速度*
+0

质押债券置换安排
是

争议解决方式*
仲裁

首次结算方式*
券券对付

到期结算方式*
券券对付

补充条款

	质押券代码	质押券名称	券面总额(万元)	估值净价(元)	估值全价(元)
1	2089229	20兴银5B	5,000.00	-	-
2	2089119	20招银和萃2C	4,000.00	-	-

交易品种
L007

实际占券天数
5

首次结算日
2020/10/29

到期结算日
2020/11/03

借贷费用(元)
3,835.62

质押债券券面总额合计(万元)
9,000

质押率(估值净价,%) ①
-

质押率(估值全价,%) ①
-

质押率(券面,%) ①
180.00

拒绝

提交

(b) 若对话报价无质押券信息，可以拒绝或补充质押券信息后提交。拒绝操作同上述(a)中描述；补充质押券信息提交操作需在【我的报价】界面双击某条对话报价记录打开iQuote，进入白屏界面，补充质押券相关要素，点击提交按钮提交对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

报价方式 ☐ 意向 ☒ 对话

融出

本方* ①
中信证券

对手方*
建设银行

对手方交易员*
陈峰

标的债券代码
2189012

标的债券名称
21农盈汇寓1A3

标的债券总额(万元)*
2,000

借贷利率(%)*
1.2000

借贷期限(天)*
10

清算速度*
+0

质押债券置换安排
是

争议解决方式*
仲裁

首次结算方式*
券券对付

到期结算方式*
券费对付

补充条款

质押券代码	质押券名称	券面总额(万元)	估值净价(元)	估值全价(元)
1				

交易品种
L014

实际占券天数
10

首次结算日
2021/02/26

到期结算日
2021/03/08

借贷费用(元)
6,575.34

质押债券券面总额合计(万元)
-

质押率(估值净价,%) ①
-

质押率(估值全价,%) ①
-

质押率(券面,%) ①
0.0000

拒绝

提交

6.9.3.3 历史对话报价信息查询

对话报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-债券借贷】界面，报价方式选择“意向/对话报价”，报价类型选择“对话”，查看历史的对话报价。

报价信息查询-债券市场

询价查询

订单查询

做市报价查询

代理查询

债券借贷

债券路演

X-Auction

报价方式 ☒ 意向/对话报价 ☐ 担保品调整报价

本方方向 ☒ 全部 ☐ 融入 ☐ 融出 成交状态 ☒ 全部 ☐ 成交 ☐ 未成交 报价类型 ☒ 全部 ☐ 意向 ☐ 对话 ☐ 意向转对话 ☐ 聊天转对话 代码名称 对手方 日期 2021/ 导出

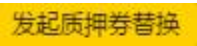
本方方向	标的券代码	标的券名称	成交状态	报价类型	本方	本方交易员	对手方	对手方机构	对手方交易员	标的券面(万元)	借贷期限
融入	552007	552007	未成交	对话	平安资产管理...	陈晓霞	1112机构lm01	1112机构lm01	陈三	2,000.00	10D

总1笔(融入1/融出0),0.2亿(融入0.2/融出0)

K < 1 / 1 > 共1条

6.9.4 担保品调整报价

6.9.4.1 发起报价

可通过发起担保品调整报价，添加附加协议替换质押券。对已经达成的债券借贷成交，同一机构下可操作达成成交对应交易账户的任一有“债券借贷-担保品调整”权限的用户，在“-我的交易-担保品调整”路径下的【债券借贷-质押券替换】界面，点击“”，打开【债券借贷-未到期成交】界面，选择需要添加附加协议的成交，双击进入【债券借贷-质押券替换】白屏界面，维护新的质押券信息后提交，即可提交一笔担保品调整报价。



担保品调整

债券借贷-未到期成交

成交编号

对手方

对手方交易员

代码/名称

成交日期

2020-02-25

2021-02-25

请点击成交记录发起质押券替换

交易方式	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	本方方向	标的券代码	标的券名称	借贷费率(%)	标的券面(万元)	质押券面(万元)	借贷
对话报价	中信证券	潘元翠	阳光资管	李琳	融入	102000153	20宁乡城投M...	0.8700	5,000.00	5,600.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融出	120020	12附息国债20	11.0000	3,000.00	3,000.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融出	120020	12附息国债20	12.0000	3,000.00	3,000.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融出	120020	12附息国债20	4.0000	3,000.00	3,000.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融出	2080100	20天源产融债	3.2300	1,000.00	1,000.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融入	120020	12附息国债20	9.9990	300,000.00	300,000.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融出	120020	12附息国债20	5.8888	3,000.00	3,000.00	
对话报价	中信证券	朱清华	平安资产管理...	陈晓霞	融入	120020	12附息国债20	5.8888	3,000.00	3,000.00	

总98笔，1990.448亿（融入1055.51/融出934.938）

<

<

1

/ 3

>

>

债券借贷-质押券替换

✕

融入

融出

本方* ①

中信证券

对手方*

平安资产管理公司

对手方交易员*

陈晓贤

标的债券代码 付息提示

120020

标的债券名称

12附息国债20

标的券券面总额(万元)*

300,000

借贷利率(%)*

9.9990

借贷期限(天)*

14

清算速度*

T+0

质押债券置换安排

是

争议解决方式*

仲裁

首次结算方式*

券券对付

到期结算方式*

券费对付

休息休息

原质押券明细

	质押券代码		质押券名称		券面总额(万元)
1	120015		12附息国债15		100,000.00
2	120020		12附息国债20		100,000.00
3	120021		12附息国债21		100,000.00

新质押券明细

	质押券代码		质押券名称		券面总额(万元)	估值净价(元)	估值全价(元)	
1	2071125		20甘肃债30		100,000.00	-	-	

保存

提交

6.9.4.2 担保品调整报价管理

1. 担保品调整报价发送成功后，可在“-我的交易-担保品调整”路径下的【债券借贷-质押券替换】界面查看已经发出的担保品调整报价，并进行担保品调整报价管理，选中需要管理的担保品调整报价双击后进入【债券借贷-质押券替换】白屏界面，修改需要变更要素后点击“”或直接点击“”，对已选担保品调整报价进行修改或撤销。

担保品调整

债券借贷-质押券替换

发起质押券替换

状态	本方	对手方	对手方交易员	本方向	标的券代码	标的券名称	借贷费率(%)	标的券面(万元)	借贷期限(天)	质押券面(万元)	
待成交	平安资产管理...	中信证券	王玥	融出	120020	12附息国债20	9.9990	300,000	14	100,000	SL2

债券借贷-质押券替换

融入融出

本方* ①
中信证券

对手方*
平安资产管理公司

对手方交易员*
陈晓贤

标的债券代码
120020

标的债券名称
12附息国债20

标的债券面总额(万元)*
300,000

借贷费率(%)*
9.9990

借贷期限(天)*
14

清算速度*
T+0

质押债券置换安排
是

争议解决方式*
仲裁

首次结算方式*
券券对付

到期结算方式*
券券对付

休息休息

原质押券明细

	质押券代码	质押券名称	券面总额(万元)
1	120015	12附息国债15	100,000.00
2	120021	12附息国债21	100,000.00
3	120020	12附息国债20	100,000.00

新质押券明细

	质押券代码	质押券名称	券面总额(万元)	估值净价(元)	估值全价(元)	
1	2071125	20甘肃债30	100,000.00	-	-	

撤销提交

6.9.4.3 历史担保品调整报价信息查询

担保品调整报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-债券借贷】界面，报价方式选择“担保品调整报价”，查看历史的担保品调整报价。

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 代理查询 **债券借贷** 债券路演 X-Auction

报价方式 ☐ 意向对话报价 ☒ 担保品调整报价

本方方向 **全部** **融入** **融出** 状态 **全部** **成交** **未成交** 代码/名称 对手方 报价日期 2021/02/26 - 2021/02/26 导出

本方方向	标的券代码	标的券名称	状态	本方	本方交易员	对手方	对手方机构	对手方交易员	标的券面(万元)	借贷期限(天)	借贷费率(%)	借贷
融出	120020	12附息国债	成交	平安资产管...	陈晓霞	中信证券	中信证券	王玥	300,000.00	14	9.9990	11

总1笔 (融入0/融出1), 30亿 (融入0/融出30)

6.9.5 X-Lending 订单

6.9.5.1 提交 X-Lending 订单

任意身份下具有“债券借贷-匿名点击”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择债券市场，债券借贷，报价方式选择“X-Lending”，填写各类报价要素后，点击 **提交** 按钮，即可发送一笔 X-Lending 订单。

Tips:

标的债券代码: X-Lending 可交易债券列表可在【文件下载】界面下载后查看。

质押券属性: 选择某类质押券属性则该笔交易仅能提交该类质押券,比如选择“利率债”,则融入方提交质押券时,仅能选择国债、政策性金融债、央行票据。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

南向通

互联互通

报价方式

☒ X-Lending

☐ 意向

☐ 对话

融入

融出

本方* ①

中国工商银行111

标的债券代码*

210307

期限*

1D

标的债券名称*

21进出07

借贷费率(%)*

3.1200

合约名称*

210307_1D_利率债

质押券属性*

利率债

标的券面总额(手)*

1

x1000万

清算速度

+0

质押券置换安排

是

争议解决方式

仲裁

首次结算日

2021/12/23

到期结算日

2021/12/25

实际占券天数

2

借贷费用(元)

1,709.59

首次结算方式

券券对付

到期结算方式

券费对付

批量导入

保存

提交

除可单笔提交订单以外，系统还提供批量提交 X-Lending 订单功能。可点击  按钮，在导出模板中填写订单数据，点击  按钮导入 X-Lending 订单后，展示在导入页面上，可勾选多笔订单批量提交。

X-Lending-我的订单-导入

共3笔校验成功 导入

☒	本方方向	本方	合约名称	标的债券代码	标的债券名称	期限	质押券属性	借贷费率(%)	标的券面总额(万)	首次结息日
☒	融入	农业银行	609016_1D_利率...	609016	609016	1D	利率债	3.1200	1000	2021/12/23
☒	融入	农业银行	210204_14D_利...	210204	21国开04	14D	利率债	12.3000	1000	2021/12/23
☒	融出	农业银行	210204_1D_利率...	210204	21国开04	1D	利率债	12.3000	1000	2021/12/23

截屏 删除 保存 提交

6.9.5.2 管理 X-Lending 订单

订单发送成功后，点击“—债券市场—我的交易—X-Lending 订单”菜单路径，可打开【我的订单】界面，查看已经发出的订单，或对订单进行冻结、激活或撤销操作

- 对于状态为“有效”的订单，可以选中单笔/多笔订单，点击按钮撤销订单；或点击按钮冻结订单。

X-Lending订单

我的订单 提券管理 +新订单 导入 导出

本方方向 全部 融入 融出 状态 全部 有效 冻结 质押券属性 全部 利率债 地方政府债 DJ01 DJ02 代码/名称 本方 期限

☒	本方	合约名称	本方方向	标的券代码	标的券名称	状态	标的券面(万)	剩余券面(万)	借贷费率(%)	借贷费用(元)
☒	农业银行	609016_1D_利率债	融入	609016	609016	有效	1,000.00	1,000.00	3.1200	854.79
☒	农业银行	210204_14D_利率债	融入	210204	21国开04	有效	1,000.00	1,000.00	12.3000	47,178.08
☒	农业银行	210204_1D_利率债	融出	210204	21国开04	有效	1,000.00	1,000.00	12.3000	3,369.86

一键冻结 解冻 撤销 激活

总3笔 (融入2/融出1) , 0.3亿 (融入0.2/融出0.1)

- 对于状态为“有效”的订单，可以双击订单记录打开 iQuote，修改部分订单要素后，点击按钮更新订单；或点击按钮，保存当前订单数据，暂不提交。

6.9.5.3 撮合成交或点击成交

- 本方已提交的订单在双边授信的前提下将按照“价格优先、时间优先”的原则与其他订单进行撮合匹配成交。
- 本方也可直接点击市场上未成交的订单进行成交。具体操作如下：

任意身份下具有“债券借贷-匿名点击”权限的用户可点击“—公开报价—债券借贷报价行情”菜单路径，打开【X-Lending】tab 界面，选择“本方”交易账户，可以查看该交易账户市场当日的债券借贷 X-Lending 报价行情。

对于有交易意向的合约，可以点击按钮查看当前合约的所有深度行情，双击费率/报价量字段，可打开 iQuote，确认“标的券面总额”后点击按钮进行成交。

Tips: 融入量/融出量中，括号里的红色数字，为系统根据双边授信计算出的本方

可成交量。

债券借贷报价						
X-Lending 意向						
农业银行 Q 代码/名称 Q 期限 全部 质押券属性 全部 利率债 一键冻结 +新订单						
深度	合约名称	融入量(万)	融入费率(%)	融出费率(%)	融出量(万)	
	609016_1D_利率债	2000(0)	1.0000	-	-	
	210204_14D_利率债	1000(0)	12.3000	-	-	
	210204_1D_利率债	20000(19000)	3.0000	12.3000	1000(0)	
	200405_7D_利率债	1000(1000)	3.0120	-	-	
	210112_14D_利率债	4000(4000)	3.0200	-	-	
	210112_7D_利率债	4000(4000)	3.0200	-	-	
	210208_1D_利率债	-	-	2.0330	15000(15000)	
	210204_7D_利率债	-	-	3.0140	1000(1000)	
	200408_1D_利率债	截屏	-	3.2000	1000(1000)	
	180009_7D_利率债	10000(10000)	3.0000	-	-	

债券借贷报价					点击成交		
X-Lending 意向					融出		
农业银行 Q 代码/名称 Q 期限 全部 质押券属性 全部 利率债							
深度	合约名称	融入量(万)	融入费率(%)	融出费率(%)			
	609016_1D_利率债	2000(0)	1.0000				
	210204_14D_利率债	1000(0)	12.3000				
	210204_1D_利率债	20000(19000)	3.0000	12			
	200405_7D_利率债	1000(1000)	3.0120				
	210112_14D_利率债	4000(4000)	3.0200				
	210112_7D_利率债	4000(4000)	3.0200				
	210208_1D_利率债	-	-	2			
	210204_7D_利率债	-	-	3			
	200408_1D_利率债	-	-	3			
	180009_7D_利率债	10000(10000)	3.0000				
产品篮子维护 搭桥参数设置 X-Bondi过桥机构参数设置 衍生品交易参数设置 衍生品专座报价商设置 机构群组维护 限额管理 对手方管理 发起报备 交易报备 交易报备确认 回购小助手					本方* ① 农业银行 Q 合约名称* 210204_1D_利率债		
					标的债券代码* 210204 标的债券名称* 21国开04 质押券属性* 利率债		
					期限* 1D 借贷费率(%)* 3.0000 标的债券面总额(手)* 1 x1000万		
					清算速度 +0 质押券置换安排 是 争议解决方式 仲裁		
					首次结息日 2021/12/23 到期结息日 2021/12/24 实际占券天数 1		
					借贷费用(元) 821.92 首次结息方式 券券对付 到期结息方式 券费对付		
					成交		

6.9.5.4 历史订单查询

X-Lending 的历史订单信息，可在“--我的交易--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券借贷市场-X-Lending】界面，查看历史的 X-Lending 订单。

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 债券借贷 债券路演 X-Auction 预发行 南向通 互联互通

报价方式 ☒ X-Lending ☐ 意向对话报价 ☐ 担保品调整报价

成交状态 ☒ 全部 ☐ 成交 ☐ 未成交 本方方向 ☒ 全部 ☐ 融入 ☐ 融出 名称/代码 Q 订单日期 2021/12/23 ~ 2021/12/23 导出

订单编号	本方方向	本方	订单状态	成交状态	标的券代码	标的券名称	合约名称	借贷费率 (%)	标的券面(万元)
211223050801000205	融出	农业银行	成交	未成交	210204	21国开04	210204_1D_利率债	2.3400	1000.00
211223050801000180	融入	农业银行	过期	未成交	609016	609016	609016_1D_利率债	3.1200	1000.00
211223050801000176	融入	农业银行	撤销	未成交	609016	609016	609016_1D_利率债	3.1200	1000.00

总3笔(融入2/融出1),0.3亿 (融入0.2/融出0.1)

K < 1 / 1 > X 共3条

6.9.5.5 提券管理

X-Lending 订单匿名撮合或者点击成交达成成交意向后，融入方尚未提交质押券的，交易双方可以点击“--我的交易-X-Lending 订单-提券管理”，打开页面默认展示当日待本方或对手方提券的订单；也可通过筛选条件的日期控件查询历史日期的配券超时订单。

X-Lending 订单

我的订单 提券管理

状态 ☒ 全部 ☐ 待提券 ☐ 配券超时 本方方向 ☒ 全部 ☐ 融入 ☐ 融出 代码/名称 Q 本方 Q 对手方 Q 对手方机构 Q 日期 2021/12/23 ~ 2021/12/23

☒	本方方向	状态	匹配成交	提券截止	成交日期	本方	合约名称	对手方	对手方交易员	借贷费率(%)	标
☒	融入	待提券 ①	15:10:57	20:05:00	2021/12/23	招商证券	210112_1D_利..	泰康资产管理...	李翀/泰康资产管理公司	1.2266	

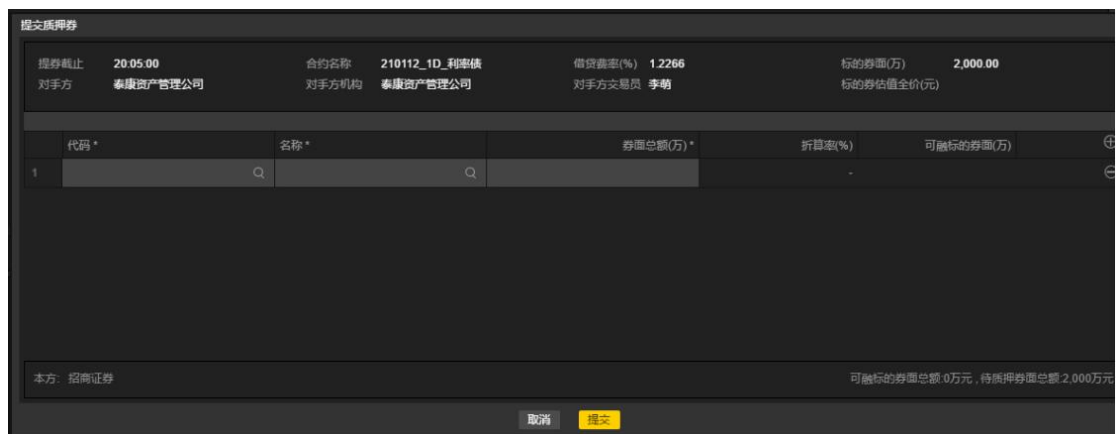
提交质押券

人民币债券借贷: 共1笔(融入1/融出0),0.2亿 (融入0.2/融出0)

融入方勾选一笔待提券订单点击“**提交质押券**”，或者双击一笔待提券订单，进入【提交质押券】页面进行提券。

6.9.5.6 提交质押券

在“--我的交易-X-Lending 订单-提券管理”页面，勾选一笔待提券的融入订单，点击**提交质押券**，进入【提交质押券】页面。



提交质押券

提券截止	20:05:00	合约名称	210112_1D_利率债	借贷费率(%)	1.2266	标的券面(万)	2,000.00
对手方	泰康资产管理公司	对手方机构	泰康资产管理公司	对手方交易员	李萌	标的券估值全价(元)	

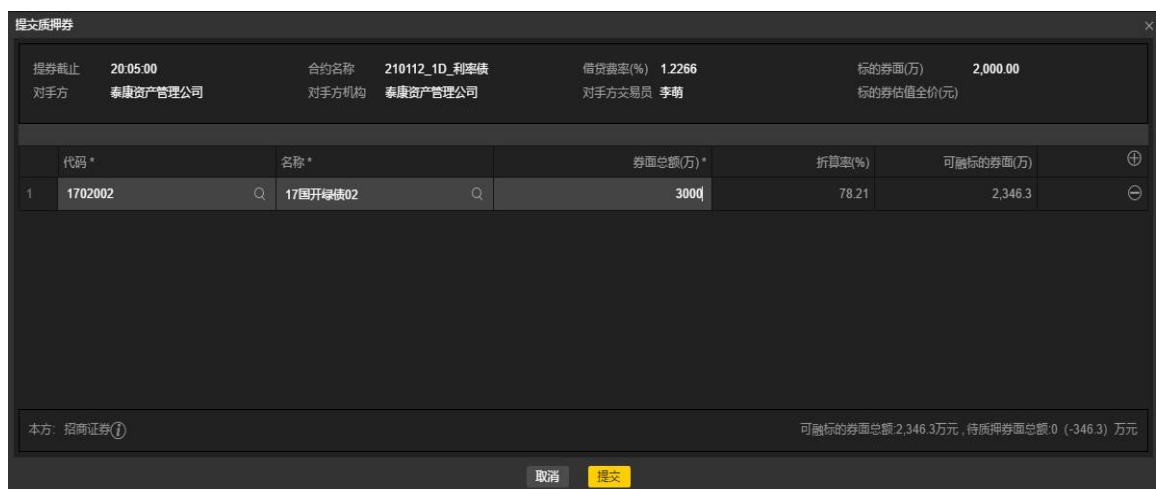
	代码 *	名称 *	券面总额(万) *	折算率(%)	可融标的券面(万)
1					

本方: 招商证券

可融标的券面总额: 0万元, 待质押券面总额: 2,000万元

取消 提交

在页面下方添加债券代码、名称等要素，填写完整后点击**提交**，提交成功的，系统会自动生成成交单。



提交质押券

提券截止	20:05:00	合约名称	210112_1D_利率债	借贷费率(%)	1.2266	标的券面(万)	2,000.00
对手方	泰康资产管理公司	对手方机构	泰康资产管理公司	对手方交易员	李萌	标的券估值全价(元)	

	代码 *	名称 *	券面总额(万) *	折算率(%)	可融标的券面(万)
1	1702002	17国开绿债02	3000	78.21	2,346.3

本方: 招商证券①

可融标的券面总额: 2,346.3万元, 待质押券面总额: 0 (-346.3) 万元

取消 提交

6.9.6 成交查询

6.9.6.1 当日成交

可在“--我的交易--当日成交”菜单路径下，打开【当日成交-债券借贷】界面，查看当日成交信息。可单击某条成交记录或点击左侧图标，展开查看质押券明细。双击选中的成交记录，可查看对应成交单。



截图显示了“当日成交-债券借贷”界面。顶部有“债券买卖”、“债券借贷”、“预发行”和“互联互通”标签。下方有“本方方向”、“全部”、“融入”、“融出”、“报价类型”、“全部”、“X-Lending”、“对话”、“意向转对话”、“聊天转对话”、“对手方”、“对手方交易员”等筛选条件。表格列出了成交记录，包括成交编号、本方方向、标的券代码、标的券名称、成交状态、报价类型、标的券面（万元）、质押券代码、质押券名称、质押券面合计等。底部显示了“总1笔(融入1/融出0),0.2亿 (融入0.2/融出0)”。

成交编号	本方方向	标的券代码	标的券名称	成交状态	报价类型	标的券面 (万元)	质押券代码	质押券名称	质押券面合计
SL20211223900004	融入	210112	21地方052	正常	X-Lending	2,000.00	1702002	17国开绿债02	3

6.9.6.2 成交查询

可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-债券借贷-成交明细】界面，查看历史的成交信息。可导出当前查询界面的成交信息，也可在筛选条件中“是否展开质押券明细”选择“是”，导出带质押券明细信息的成交记录。双击选中的单笔成交信息，可查看对应成交单。

成交查询

现券买卖-成交明细 南向通-成交明细 上市前交易意向 债券借贷-成交明细 预发行-成交明细 互联互通-成交明细

本方方向 全部 融入 融出 报价类型 全部 X-Lending 对话 意向转对话 聊天转对话 日期 2021/12/23 2021/12/23 对手方 导出 下载成交单

☐	成交编号	本方方向	标的券代码	标的券名称	成交状态	报价类型	标的券面 (万元)	质押券代码	质押券名称	质押券面1
☐	SL20211223900004	融入	210112	21地方052	正常	X-Lending	2,000.00	1702002	17国开绿债02	

总1笔(融入1融出0),0.2亿 (融入0.2融出0)

K < 1 / 1 > X 共1条

6.9.7 成交行情

6.9.7.1 实时成交行情

可在“--成交行情--债券借贷成交行情”菜单路径下，打开【债券借贷成交行情-实时行情】界面，查看实时行情数据。根据选择左上角“债券”或“交易品种”可切换查看对应实时行情信息。

债券借贷成交行情

实时行情 历史行情

债券 交易品种 交易方式 全部 X-Lending 对话报价 代码/名称

标的债券代码	标的债券名称	前收盘费率(%)	前加权平均费率(%)	开盘费率(%)	最新费率(%)	最高费率(%)	最低费率(%)	收盘费
210112	21地方052	3.0000	3.0000	1.2266	1.2266	1.2266	1.2266	
609016	609016	2.0000	2.0000	1.0000	1.1100 ▲	1.1100	1.0000	
190010	19附息国债10	-	-	2.0000	2.0000	2.0000	2.0000	
180028	18附息国债28	-	-	3.0000	3.0000	3.0000	3.0000	

成交量合计0.6000亿,成交笔数5笔

债券借贷成交行情

实时行情

历史行情

债券

交易品种

交易方式

全部

X-Lending

对话报价

交易品种

交易品种

前收盘费率(%)

前加权平均费率(%)

开盘费率(%)

最新费率(%)

最高费率(%)

最低费率(%)

收盘费率(%)

加权平均

L001

1.0000

1.5629

1.0000

1.2266 ▲

2.0000

1.0000

-

L007

1.5120

2.4360

3.0000

3.0000

3.0000

3.0000

-

成交量合计0.6000亿,成交笔数5笔

6.9.7.2 历史行情查询

可在“--成交行情--债券借贷成交行情”菜单路径下，打开【债券借贷成交行情-历史行情】界面，查看历史行情数据。根据选择左上角“债券”或“交易品种”可切换查看对应历史行情信息。

债券借贷成交行情

实时行情

历史行情

债券

交易品种

交易方式

全部

X-Lending

对话报价

日期

2021/12/23

2021/12/23

代码/名称

导出

日期

标的债券代码

标的债券名称

单券借贷余额(百万...

集中度(%)

前收盘费率(%)

前加权平均费率...

开盘费率(%)

最新费率(%)

2021/12/23

210112

21地方052

31.00

0.0189

3.0000

3.0000

1.2266

1.2266

2021/12/23

609016

609016

31.00

0.0189

2.0000

2.0000

1.0000

1.1100

2021/12/23

190010

19附息国债10

10.00

0.0045

-

-

2.0000

2.0000

2021/12/23

180028

18附息国债28

10.00

0.0048

-

-

3.0000

3.0000

成交量合计0.6000亿,成交笔数5笔

<

>

1

/ 1

>

>

共4条

债券借贷成交行情

实时行情

历史行情

债券

交易品种

交易方式

全部

X-Lending

对话报价

日期

2021/12/23

2021/12/23

交易品种

导出

日期

交易品种

前收盘费率(%)

前加权平均费率...

开盘费率(%)

最新费率(%)

最高费率(%)

最低费率(%)

收盘费率(%)

2021/12/23

L001

1.0000

1.5629

1.0000

1.2266

2.0000

1.0000

-

2021/12/23

L007

1.5120

2.4360

3.0000

3.0000

3.0000

3.0000

-

成交量合计0.6000亿,成交笔数5笔

<

>

1

/ 1

>

>

共2条

6.9.8 付息信息查询

可在“--信息查询--付息信息查询”菜单路径下，打开【付息信息查询-债券借贷】界面，查看本机构下所有成交的标的券付息信息相关数据。消息盒子也将提示当日或次日有关付息信息。

付息信息查询-债券借贷											
本方方向		全部应收应付		代码/名称	对手方	成交编号	付息日		2021/02/26 ~ 2021/02/26		
成交编号	本方方向	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	利息支付日	标的券代码	标的券名称	标的券面 (万元)	票面利率 (%)	利息总额
SL20210106000016	应付	中信证券	李亮	建设银行 / 建设银行	靳莉	2021/02/26	091900002	19新开发银...	400.00	3.3200	
总1笔 (应收0/应付1) , 13.28万元 (应收0/应付13.28)											



6.10 预发行

6.10.1 预发行债券信息查询

用户点击“--信息查询--债券信息查询”菜单路径，打开【债券信息查询-预发行

债券信息查询】界面，查看预发行债券信息。

债券信息查询										
债券信息查询 X-Bond可交易债券列表 预发行债券信息查询 预发行剩余量查询										
债券代码/名称		Q		预发行日期		2021-05-26 ~ 2021-05-26		债券类型		全部
债券代码	债券名称	债券类型	发行类型	计划发行量 (亿)	实际发行量 (亿)	面值 (元)	首发价格 (元)	招标日	发行价格 (元)	发行利率 (%)
0421001	0421001债券1	次级债	新发	100	100	100	-	2020-07-14	-	-
0421002	0421002债券	国债	新发	99900	99900	100	-	2020-04-28	-	-
0421003	0421003债券	次级债	新发	10	10	100	-	2020-04-28	-	-
11	11	国债	新发	100	110	100	-	2021-05-31	10.000000	-
11060505	11060505shch	企业债	新发	100	0	100	-	2020-11-11	-	-
123les	123les	国债	续发	10	10	100	-	2021-03-18	-	-
20210430-1	20210430-1	国债	新发	200	-	100	-	2021-05-10	-	-
20210430-2	20210430-2	国债	新发	1000	-	100	-	2021-05-10	-	-
20210430-3	20210430-3	国债	新发	2000	-	100	-	2021-05-10	-	-
20210508-11	20210508-11...	国债	新发	100	100	100	-	2021-05-08	-	-
20210508-12	20210508-1...	政策性金融债	续发	100	100	100	-	2021-05-08	10.000000	-
20210508-13	20210508-1...	国债	新发	100	100	100	-	2021-05-08	-	-
总361笔记录										

6.10.2 预发行剩余量查询

用户点击“-信息查询-债券信息查询”菜单路径，打开【债券信息查询-预发行剩余量查询】界面，查看预发行债券市场剩余净卖出量。选择交易账户后可查看本方剩余净卖出量。

债券信息查询					
债券信息查询 X-Bond可交易债券列表 预发行债券信息查询 预发行剩余量查询					
债券代码/名称		Q		交易账户	
				导出	
债券代码	债券名称	债券状态	交易账户	实时市场剩余净卖出量 (万元)	本方剩余总净卖出量 (万元)
01101	测试李远通01	禁用	-	8,991,000	-
01234a	测试lcs	禁用	-	999,990	-
0160202	0160202	禁用	-	200,000	-
02291805	0229zhaquan	禁用	-	10,000	-
0330	0330	禁用	-	7,000	-
0421001	0421001债券1	活动	-	1,000,000	-
0421002	0421002债券	活动	-	999,000,000	-
0421003	0421003债券	活动	-	100,000	-
103110612	196762729	禁用	-	999,990,000	-
11	11	活动	-	9,999,900	-
11060505	11060505shch	活动	-	9,999,900	-
111	111	禁用	-	100,000	-
总722笔记录					

6.10.3 对话报价

6.10.3.1 发起报价

任意身份下具有“预发行-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔对话报价：

债券市场

货币市场

衍生品市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

买入

卖出

本方*
建设银行

对手方*
农业银行

对手方交易员*
QTEST0021

代码*
TCS19WI01

名称*
运塔19预发行0

券面总额(万元)*
3,000.0000

结算方式*
券款对付

预期收益率(%)*
3.0000

预期全价(元)*
105.6572

结算日*
2019/07/02

补充条款

履约担保方式
无担保

担保类型

第三方集中管理机构

保证金金额(元)

总履约担保率(%)

履约担保总额(元)

保存

提交

报价发送成功后，打开【我的报价】界面（“--我的交易--我的报价--预发行”路径下打开），可查看已经发出的对话报价。

6.10.3.2 对话报价管理

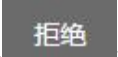
报价发送成功后，在【我的报价】界面，可查看已发出的对话报价，进行对话报价管理。

1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击 

按钮终止对话报价；也可以双击某笔对话报价，修改部分报价要素后，点击  按钮更新对话报价。



2. 对于状态为“待成交”的对话报价：

(a) 若预发行债券为国债或政策性金融债，可以补充本方履约担保信息后提交或直接拒绝。如补充本方履约担保信息，需在【我的报价】界面双击某条对话报价记录打开 iQuote，进入白屏界面进行补充，点击  按钮提交对话报价。如拒绝对话报价，可在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔对话报价，点击  按钮；也可直接双击某条对话报价记录打开 iQuote，点击  按钮。



债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

买入

卖出

本方*

农业银行

对手方*

建设银行

对手方交易员*

随便一

代码*

TCS19WI01

名称*

塔塔19预发行0

券面总额(万元)*

3,000.0000

结算方式*

券款对付

预期收益率(%)*

3.0000

预期全价(元)*

105.6572

结算日*

2019/07/02

补充条款

买入方履约担保信息

履约担保方式

无担保

担保类型

第三方集中管理机构

保证金金额(元)

总履约担保率(%)

履约担保总额(元)

卖出方履约担保信息

履约担保方式

担保类型

第三方集中管理机构

拒绝

提交

(b) 若预发行债券为国债或政策性金融债且交易双方都已补充履约担保信息，或者预发行债券非国债及政策性金融债，可以直接达成成交或拒绝。可在【我的报价】界面直接勾选单笔/多笔对话报价，点击  按钮成交，或点击  按钮拒绝；也可直接双击某条对话报价记录打开 iQuote，点击  按钮成交，或点击  按钮拒绝。

我的报价

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

本方方向

全部

买入

卖出

状态

全部

待发送

已发送

待成交

代码/名称

对手方

对手方交易员

	本方方向	债券代码	债券名称	状态	本方	对手方	对手方交易员	预期收益率(%)	预期全价(元)	券面总额(万元)	结算日
☒	卖出	TCS19WI01	塔塔19预发行...	待成交	农业银行	建设银行	随便一 / 建设银行	3.0000	105.6572	3,000.0000	2019...
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021
☐	卖出	20210511-2	20210511-2...	待成交	农业银行	建设银行	QTEST0035 / 建设银行	0.0000	100.0000	100.0000	2021

撤销

拒绝

提交

成交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

现券买卖

债券借贷

债券路演

预发行

买入

卖出

本方*
农业银行

对手方*
建设银行

对手方交易员*
QTEST0035

代码*
20210511-2

名称*
20210511-2企

券面总额(万元)*
100.0000

结算方式*
券款对付

预期收益率(%)*
0.0000

预期全价(元)*
100.0000

结算日*
2021/05/18

补充条款

拒绝

成交

6.10.3.3 历史对话报价信息查询

可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-债券市场-预发行】界面，查看历史对话报价信息。

报价信息查询-债券市场

询价查询 订单查询 做市报价查询 债券借贷 债券路演 X-Auction **预发行**

本方方向 **全部** 买入 卖出 成交状态 **全部** 成交 未成交 代码名称 Q 对手方 Q 日期 2021/05/25 - 2021/05/25 导出

本方方向	债券代码	债券名称	成交状态	预期收益率(%)	预期全价(元)	券面总额(万元)	本方	本方交易员	对手方
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行
卖出	20210511-2	20210511-2企业...	成交	0.0000	100.0000	100.0000	农业银行	QTEST0021	建设银行

共20笔 (买入3/卖出17) , 0.2亿 (买入0.03/卖出0.17)

6.10.4 成交查询

可在“-信息查询-成交查询”菜单路径下，打开【预发行-成交明细】界面，查看预发行成交明细。

成交查询

现券买卖-成交明细 上市前交易意向 债券借贷-成交明细 境外债券交易-成交明细 **预发行-成交明细**

方向 **全部** 买入 卖出 代码名称 Q 对手方 Q 日期 2021/02/01 - 2021/05/24 导出 下载成交单

	成交编号	代码	名称	本方方向	报价编号	对手方	对手方机构	对手方交易员	对手
☐	WI20210521320005	88802112	GZ88802112XN	卖出	210521061902010109	中国银行1	中国银行1	QTEST0015	-
☐	WI20210521320004	88802111	GZ88802111XN	卖出	210521061901009898	中国银行1	中国银行1	QTEST0012	-
☐	WI20210521320003	88802110	GZ88802110XN	卖出	210521061902010108	中国银行1	中国银行1	QTEST0015	-
☐	WI20210521320002	88802109	GZ88802109XN	卖出	210521061902010107	中国银行1	中国银行1	QTEST0012	-
☐	WI20210521320001	88802108	GZ88802108XN	卖出	210521061901009897	中国银行1	中国银行1	QTEST0015	-
☐	WI20210521320000	88802107	GZ88802107XN	卖出	210521061902010106	中国银行1	中国银行1	QTEST0012	-
☐	WI20210521319999	88802106	GZ88802106XN	卖出	210521061901009896	中国银行1	中国银行1	QTEST0015	-
☐	WI20210521319997	88802104	GZ88802104XN	卖出	210521061901009895	中国银行1	中国银行1	QTEST0015	-
☐	WI20210521319996	88802103	GZ88802103XN	卖出	210521061902010104	中国银行1	中国银行1	QTEST0012	-
☐	WI20210521319994	88802102	GZ88802102XN	卖出	210521061901009894	中国银行1	中国银行1	QTEST0015	-

共14185笔 (买入1/卖出14184) , 5877.3600亿 (买入9.0000/卖出5868.3600)

6.10.5 成交行情

点击“-成交行情-预发行成交行情”菜单路径，打开【预发行成交行情】界面，查看当前交易日的成交汇总行情数据。

预发行成交行情								
实时行情								
债券代码	债券名称	成交量(百万元)	笔数	最新预期收益率(%)	最高预期收益率(%)	最低预期收益率(%)	加权平均预期...	开盘预期收益率(%)
20210514-2	14-2新新价贴现	61.1000	11	70.5500 ▲	88.8800	5.6300	60.3457	54.0000
20210514-1	14-1新新价固定	34.2000	7	55.5500 ▼	55.5556	6.5432	35.5218	6.5432
TCS19W01	塔塔19预发行01	10.0000	1	10.0000	10.0000	10.0000	10.0000	10.0000
989178	989178a	10.0000	1	1年定存 (年付) ...	1年定存 (年付) 利...	1年定存 (年付) 利...	1年定存 (年... 1年定存 (年付) 利率...	

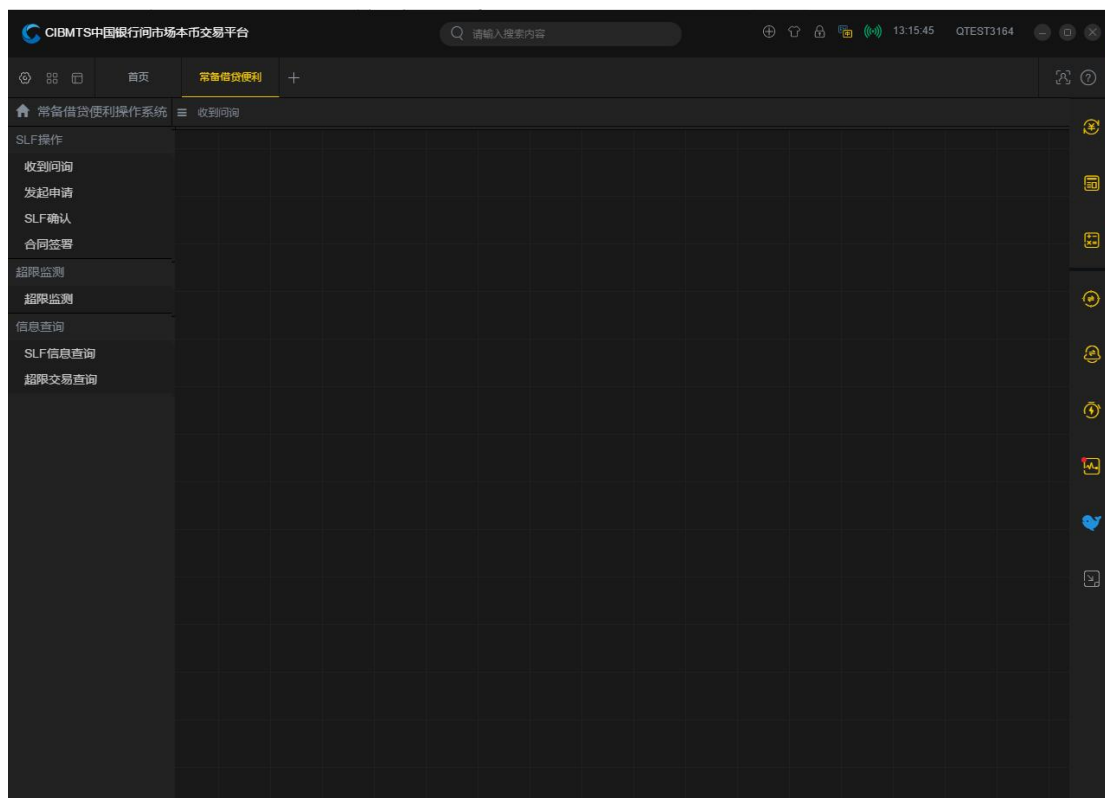
6.11 常备借贷便利

6.11.1 常备借贷便利登录

常备借贷便利操作系统，需要通过新本币的客户端进入，用户登录 CIBMTS 中国银行间市场本币交易平台客户端，点击模板管理菜单下的“常备借贷便利”菜单进入。



进入：常备借贷便利系统



6.11.2 SLF 操作

6.11.2.1 收到问询

功能描述：有“收到问询”权限的用户在“收到问询”界面，可以查询本机构已经收到的当日和历史问询。并可以对当日的问询进行接受和拒绝操作。

操作步骤：

问询查询：

用户进入收到问询页面，默认查询当日所有符合条件的问询记录；

收到问询

时间

2021-01-19

-

2021-01-20

	操作	问询编号	接收时间	发起机构	询问内容	状态	
1	接受 拒绝	SLF20210120800005	2021-01-20 09:32:14	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
2	接受 拒绝	SLF20210120800004	2021-01-20 09:32:09	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
3	接受 拒绝	SLF20210120800003	2021-01-20 09:32:04	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
4	接受 拒绝	SLF20210120800002	2021-01-20 09:31:49	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
5	接受 拒绝	SLF20210120800001	2021-01-20 09:31:37	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	

拒绝：

选中一条问询数据，点击拒绝连接。

收到问询

时间

2021-01-19

-

2021-01-20

	操作	问询编号	接收时间	发起机构	询问内容	状态	
1	接受 拒绝	SLF20210120800005	2021-01-20 09:32:14	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
2	接受 拒绝	SLF20210120800004	2021-01-20 09:32:09	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
3	接受 拒绝	SLF20210120800003	2021-01-20 09:32:04	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
4	接受 拒绝	SLF20210120800002	2021-01-20 09:31:49	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	
5	接受 拒绝	SLF20210120800001	2021-01-20 09:31:37	江苏省支行	你机构是否需要申请SLF?	待反馈	

提示

确认拒绝?

取消

确认

接受：

选中一条问询数据，点击接受连接。系统会自动打开申请页面。

收到问询

时间

2021-01-20

-

2021-01-20

刷新

	操作	问询编号	接收时间	发起机构	询问内容	状态
1	发起申请					待反馈
2		常备借贷便利申请书 打印 导出				待反馈
3		申请机构 江苏江南农村商业银行股份有限公司				待反馈
4		申请日期 2021-01-20				已拒绝
5		申请金额 (亿元)				已接受
		申请品种 1d				
		合同到期日 2021-01-21				
		到期交割日 2021-01-21				
		利率 (%)				
		抵押品种类 国债公司债券				
		国债公司托管账户 00000007041				
		资金账户 01888018224199050008				
		质押方式 自动质押				
		结算方式 券款对付				
		申请原因及资金用途				
		经办人 胡艳婷				
		修改提示				

1

>

<

共5条

逻辑：

[1] 当日问询数据可以进行“接受”和“拒绝”操作，一旦金融机构点击“拒绝”按钮，则该笔问询的“状态”由“待反馈”变为“已拒绝”；一旦机构点击“接受”按钮，则该笔问询的“状态”由“待反馈”变为“已接受”，同时自动弹出“常备借贷便利申请书”，问询已经接受和拒绝的问询不可再操作。

[2] 进入“收到问询”功能，默认查询当日收到的所有问询数据，问询数据先状态排序（待反馈排前面）再按照问询时间倒叙排列。

[3] 用户选择查询条件查询历史问询数据，查询结果问询数据先按照问询日期，再按照状态排序（待反馈排前面），最后按照接收时间倒叙排列。

[4] 有该菜单权限的用户，收到分支行问询信息的同时，若已在个人信息设置中维护了手机号码，则会收到一条手机短信，短信内容为：x月x日x时x分，收到一笔常备借贷便利意向问询。内容中的时间对应收到问询时间。在线用户同时还会收到一条相同内容的消息提醒。

[5] 查询区间最大三个月。查询结果分页显示。

6.11.2.2 发起申请

功能描述：机构可通过“发起申请”界面，点击“增加”按钮，自动弹出“常备借贷便利申请书，进行申请。

操作步骤：

用户进入 SLF 操作->发起申请菜单，进入发起申请主界面，如图：

发起申请

刷新

增加

导出

	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	质押券面总额(亿元)	申请人	状态
1	2021-04-30	SLF20210430000010	10-04-12	1.00	1d	1		孙亮	已提交
2	2021-04-30	SLF20210430000009	10-03-33	1.00	1d	1		孙亮	已提交
3	2021-04-30	SLF20210430000008	10-02-33	1.00	1d	1	22222.22	孙亮	已提交

用户点击“增加”按钮，可以弹出常备借贷便利申请书：

发起申请

常备借贷便利申请书

打印

导出

申请机构	安徽桐城农村商业银行股份有限公司					
申请日期	2021-04-30					
申请金额 (亿元)						
申请品种	1d					
合同到期日	2021-05-01					
到期交割日	2021-05-06					
利率 (%)						
抵押品种类	国债公司债					
国债公司托管账户	Z0083000000					
资金账户	340825226101060300...					
质押券	+	债券代码	债券简称	面额(万元)	基础质押率(%)	附加折扣率(%)
	-					
	-					
	-					
	-					

在弹出框中用户填写申请书信息，可以选择保存和提交；申请页面隐藏托管账户、资金账户、质押券、券面合计、评估价值几项，增加抵押品种类选项，分为国债公司债券、上海清算所债券、信贷资产。选择上海清算所债券，弹出上述隐藏项目（托管账户仅显示上海清算所托管账户和关联的 DVP 资金账户）；选择国债公司债券，若未完成 DVP 权限申请，则弹出上述隐藏项目（托管账户仅显示国债公司托管账户和关联的 DVP 资金账户）；选择国债公司债券，若完成 DVP 权限申请，则隐藏上述信息，仅显示债券账户信息及关联的资金账户，并增加展示字段“质押方式：自动质押”、“结算方式：券款对付”。选择信贷资产，隐藏上述信息，仅显示资金账户。保存申请书，不做质押券足量性验证，格式验证通过后返回保存结果；提交申请书，系统校验债券合格性和足量性以及 SLF 申请额度的足量性（若该机构的隶属支行未设置额度，则表示申请额度不限制；反之申请额度受到限制），返回错误提示信息；用户修改申请书，重新提交请求，验证通过后提示提交成功；点击“退出”按钮取消本次新增操作；

用户点击申请编号上的超链接，可以打开该申请书的详情，已提交质押书查看页面（通过申请编号链接进入，不可修改），未提交质押书查看页面（通过申请编号链接进入，读取上次保存的申请数据，还可修改）：

(1)国债非 DVP

发起申请

常备借贷便利申请书

打印 导出

申请机构	江苏江南农村商业银行股份有限公司					
申请日期	2021-01-20					
申请金额 (亿元)						
申请品种	1d					
合同到期日	2021-01-21					
到期交割日	2021-01-21					
利率 (%)						
抵押品种类	国债公司债券					
国债公司托管账户	00000007041					
资金账户	01888018224199050008					
质押券	+	债券代码	债券简称	面额(万元)	基础质押率(%)	附加折扣率(%)
	-					
	-					
	-					
	-					
	-					
券面合计 (亿元)						
评估价值 (亿元)						
申请原因及资金用途						
经办人	胡艳婷					
修改提示						

保存 提交 退出

(2)国债 DVP:

发起申请

常备借贷便利申请书

打印 导出

申请机构	江苏江南农村商业银行股份有限公司
申请日期	2021-01-19
申请金额 (亿元)	
申请品种	1d
合同到期日	2021-01-20
到期交割日	2021-01-20
利率 (%)	
抵押品种类	国债公司债券
国债公司托管账户	00000007041
资金账户	01888018224199050008
质押方式	自动质押
结算方式	券款对付
申请原因及资金用途	
经办人	胡艳婷
修改提示	

保存

提交

退出

(3)信贷资产：

发起申请

常备借贷便利申请书

打印 导出

申请机构	江苏江南农村商业银行股份有限公司
申请日期	2021-01-20
申请金额 (亿元)	
申请品种	1d
合同到期日	2021-01-21
到期交割日	2021-01-21
利率 (%)	
抵押品种类	信贷资产
资金账户	01888018224199050008
申请原因及资金用途	
经办人	胡艳婷
修改提示	

保存

提交

退出

(4) 上海清算所

发起申请

常备借贷便利申请书

打印

导出

申请机构	江苏江南农村商业银行股份有限公司				
申请日期	2021-01-20				
申请金额 (亿元)					
申请品种	1d				
合同到期日	2021-01-21				
到期交割日	2021-01-21				
利率 (%)					
抵押品种类	上海清算所债券				
上清所托管账户	B0002106				
资金账户	01888018224199050008				

质押券	+	债券代码	债券简称	面额(万元)	基础质押率(%)	附加折扣率(%)
	-					
	-					
	-					
	-					
	-					

券面合计 (亿元)	
评估价值 (亿元)	
申请原因及资金用途	
经办人	胡艳婷
修改提示	

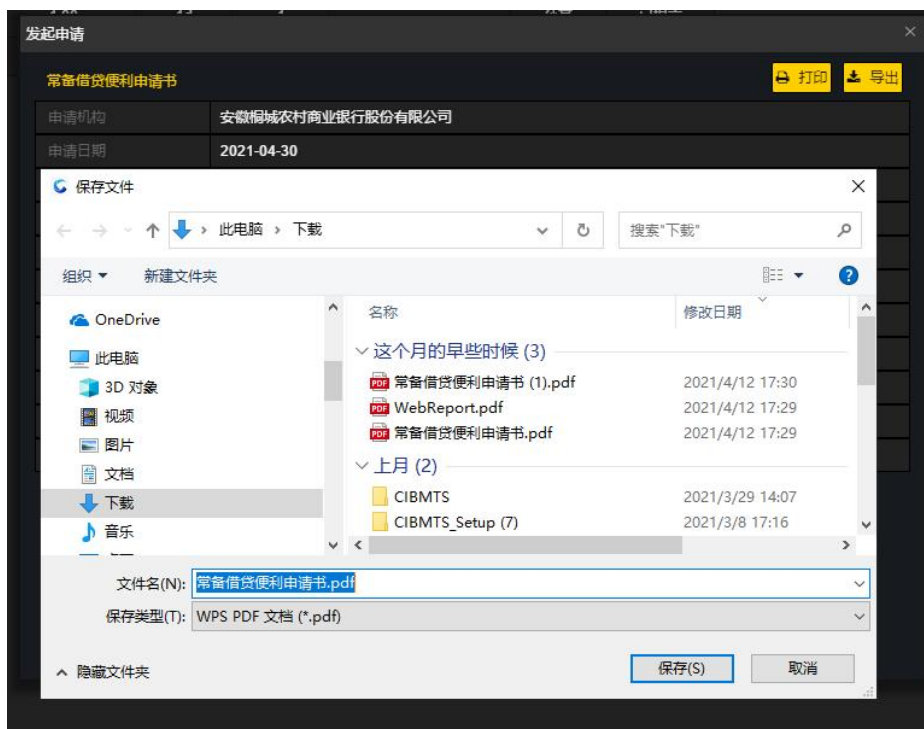
保存

提交

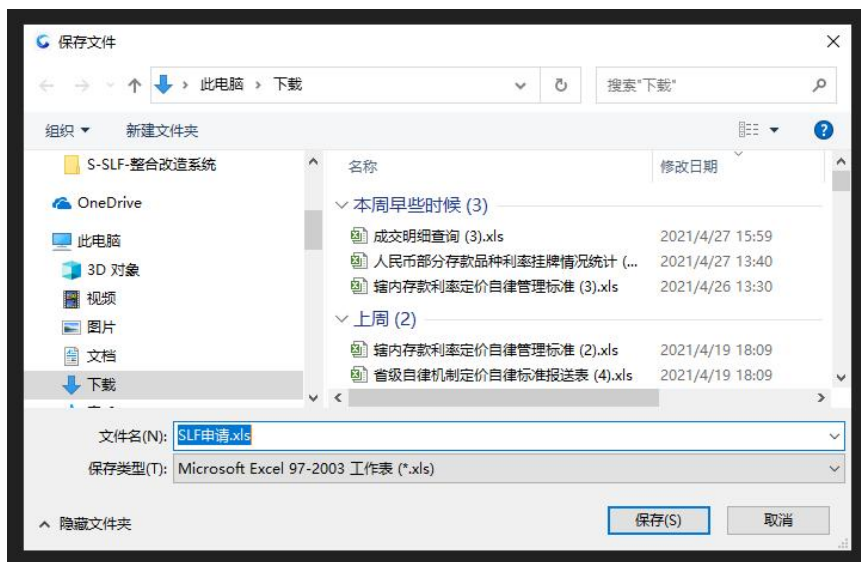
退出

点击“退出”按钮离开查看页面。

申请和查看页面，有“打印”按钮，可以打开打印信息页面。也有“导出”按钮，可以导出信息页面成 pdf 格式进行下载。



导出 excel: 点击导出按钮可以导出 excel 文件



逻辑：

[1] 申请书可以保存和提交，提交后不可修改，保存后可以修改后再提交。用户可以通过申请书查询结果页面，通过申请编号链接进入查看页面，状态为已提交的不可以再调整，未提交的可以进行修改。

[2] 点击“提交”则自动进入质押券验证程序，点击“退出”则关闭打开的“常备借贷便利申请书”。点击“提交”后的 SLF 请求，不可再修改或者拒绝，除非系统验证质押券不通过。点击“提交”后再在质押券验证的过程中，如果验证失败或者其它提示信息，在“修改提示”栏下显示出这一条提示。

[3] 质押券验证逻辑包括合格性和足量性两方面。

[4] 系统记录下 SLF 申请的各项要素，并自动填上经办人，“发起申请”界面新增这笔申请的记录，字段包括“日期”、“编号”、“申请时间”、“申请金额”、“申请期限”、“质押券面总额”、“申请人”等字段。作为申请过程中的痕迹，“历史数据”页面可查。

[5] 常备借贷便利申请书在打开的状态下，点击“打印”按钮可随时打印当前显示的内容；点击“导出”按钮可随时导出当前显示的内容。

[6] 默认提供 5 个质押券的填写表格，可以根据实际需要进行增减，最多 20 个。

[7] 查询结果页面分页显示，当日申请查询按照申请时间排序。

[8] 输入债券代码后自动校验附加折扣率，如果校验失败标红显示。

[9] SLF 申请的编码为 SLF+日期+0+5 位编码；用户只能查询到自己申请的数据；用户输入合格质押券代码能够自动匹配债券简称。

[10] 未维护托管机构的债券不可做为合格质押券，在提交的时候给出提示：***（债券代码）托管机构未知；已到期的质押券不能再做为合格质押券。

[11] 用户提交申请时，所提交的质押券必须已经选择了对应托管账户，即如果有托管机构为上清所的债券，则托管账户中必须已经选择了上清所账户。否则则给出提示：您提交的质押券对应托管机构包括上清所托管账户，请选择上清所托管账户。

[12] 申请金额设置合理区间，0 到 10000 亿元，超限 10000 亿则提示“申请金额超限”，等于 0，则提示“申请金额 >0”，低于 0，则提示“输入不合法”。

[13] 增加 SLF 额度足量性验证，当申请机构对应贷款合同签署权限的人民银行分支行 SLF 额度不足的情况下，SLF 申请操作无法进行，给出额度不足的提示信息。

[14] SLF 申请和申请修改查看页面，根据抵押品种类分为：国债公司 DVP、国债公司非 DVP、上海清算所和信贷资产四种不同逻辑。

[15] 申请页面隐藏托管账户、资金账户、质押券、券面合计、评估价值几项，增加抵押品种类选项，分为国债公司债券、上海清算所债券、信贷资产。选择上海清算所债券，弹出上述隐藏项目（托管账户仅显示上海清算所托管账户和关联的 DVP 资金账户）；选择国债公司债券，若未完成 DVP 权限申请，则弹出上述隐藏项目（托管账户仅显示国债公司托管账户和关联的 DVP 资金账户）；选择国债公司债券，若完成 DVP 权限申请，则隐藏上述信息，仅显示债券账户信息及关联的资金账户，并增加展示字段“质押方式：自动质押”、“结算方式：券款对付”选择信贷资产，隐藏上述信息，仅显示资金账户。增加、修改、查看、打印和导出页面一并修改。

[16] 根据抵押品种类的不同，只能选择托管公司是上清所或国债公司的债券，不可同时选择两种债券。

6.11.2.3 SLF 确认

功能描述：SLF 确认根据抵押品种类分为：国债公司 DVP、国债公司非 DVP、上海清算所和信贷资产四种不同逻辑,法人用户确认分支行的审核结果。

操作步骤：

用户进入 SLF 操作->SLF 确认菜单，进入 SLF 确认主界面，如图：

SLF确认									
	操作	状态	日期	编号	申请人	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)
1		申请成功	2021-01-20	SLF20210120000009	胡艳婷	11:18:42	1.00	1d	1
2	接受 拒绝	待确认	2021-01-20	SLF20210120000008	胡艳婷	09:59:13	1.00	7d	7
3	接受 拒绝	待确认	2021-01-20	SLF20210120000007	胡艳婷	09:58:59	1.00	7d	7
4		申请成功	2021-01-20	SLF20210120000006	胡艳婷	09:58:50	1.00	1d	1
5	接受 拒绝	待确认	2021-01-20	SLF20210120000005	胡艳婷	09:54:11	1.00	7d	7
6	接受 拒绝	待确认	2021-01-20	SLF20210120000004	胡艳婷	09:54:05	1.00	7d	7
7	接受 拒绝	待确认	2021-01-20	SLF20210120000003	胡艳婷	09:54:00	1.00	7d	7
8		申请成功	2021-01-20	SLF20210120000002	胡艳婷	09:53:53	1.00	1d	1

用户点击操作列的“接受”链接，可以自动弹出“常备借贷便利申请书”接受页面，用户可以调整质押券、资金账户和托管账户：

（1）点击列表的接受操作进入确认页面,国债非 DVP 流程展示界面如图，修改信息提交

:

(3) 点击列表的接受操作进入确认页面,上海清算债券流程展示界面如图, 修改信息提交

sif确认

常备借贷便利申请书
打印
导出

申请机构	江苏江南农村商业银行股份有限公司					
申请日期	2021-01-20					
申请金额 (亿元)	1.00					
申请品种	7d					
合同到期日	2021-01-27					
到期交割日	2021-01-27					
利率 (%)	3.1111					
抵押品种类	上海清算所债券					
上清所托管账户	B0002106					
资金账户	01888018224199050008					
质押券	+	债券代码	债券简称	面额(万元)	基础质押率(%)	附加折扣率(%)
	-	0001	0001	222222.00	99.0000	10.0000
券面合计 (亿元)	22.22					
评估价值 (亿元)	19.78					
申请原因及资金用途	23					
经办人	胡艳婷					
修改提示						

提交
退出

(4) 点击列表的接受操作进入确认页面,信贷资产流程展示界面如图, 修改信息提交

slf确认

常备借贷便利申请书

打印

导出

申请机构	江苏江南农村商业银行股份有限公司
申请日期	2021-01-20
申请金额 (亿元)	1.00
申请品种	7d
合同到期日	2021-01-27
到期交割日	2021-01-27
利率 (%)	3.1111
抵押品种类	信贷资产
资金账户	01888018224199050008
申请原因及资金用途	222
经办人	胡艳婷
修改提示	

提交

退出

在弹出框中用户增加质押券和面额，可以选择提交和退出，也可重新选择资金账户和托管账户；提交后台进行质押券合格性和足量性验证（包括质押券券额和 SLF 申请额度的足量性）及所提交的质押券必须已经选择了对应托管账户，验证通过后提示提交成功；点击“退出”按钮取消本次操作；

用户点击操作列的“拒绝”连接，可以自动弹出“常备借贷便利申请书”拒绝提示页面：

提示

确认拒绝?

取消

确认

在弹出框中点击“确定”按钮，提交拒绝请求；点击“退出”按钮取消操作。

用户点击编号上的超链接，可以打开该申请书的详情，点击打印或导出按钮。

(1) 国债非 DVP

slf确认

常备借贷便利申请书

打印

导出

申请机构	长春农村商业银行股份有限公司				
申请日期	2021-04-30				
申请金额 (亿元)	1.00				
申请品种	7d				
合同到期日	2021-05-07				
到期交割日	2021-05-07				
利率 (%)	3.1000				
抵押品种类	国债公司债				
国债公司托管账户	00000001786				
资金账户	000000017862001				
质押券	债券代码	债券简称	面额(万元)	基础质押率(%)	附加折扣率(%)
	1	1	222,222,222.00	1.0000	
券面合计 (亿元)	22,222.22				
申请原因及资金用途	5656565656				
经办人	高一娜				
退出					

(2) 上海上清所:

slf确认

常备借贷便利申请书

打印

导出

申请机构	长春农村商业银行股份有限公司				
申请日期	2021-04-30				
申请金额 (亿元)	1.00				
申请品种	7d				
合同到期日	2021-05-07				
到期交割日	2021-05-07				
利率 (%)	3.1000				
抵押品种类	上海清算所债券				
上清所托管账户	B0001954				
资金账户	000000017862001				
质押券	债券代码	债券简称	面额(万元)	基础质押率(%)	附加折扣率(%)
	2	上清所债券	333,333,333.00	99.0000	
券面合计 (亿元)	33,333.33				
申请原因及资金用途	7878787				
经办人	高一娜				
退出					

(3) 国债 DVP:

slf确认

常备借贷便利申请书

打印 导出

申请机构	长春农村商业银行股份有限公司
申请日期	2021-04-30
申请金额 (亿元)	1.00
申请品种	7d
合同到期日	2021-05-07
到期交割日	2021-05-07
利率 (%)	3.1000
抵押品种类	国债公司债券
国债公司托管账户	00000001786
资金账户	000000017862001
质押方式	自动质押
结算方式	券款对付
申请原因及资金用途	78787878
经办人	高一娜

退出

(4) 信贷资产:

slf确认

常备借贷便利申请书

打印 导出

申请机构	长春农村商业银行股份有限公司
申请日期	2021-04-30
申请金额 (亿元)	1.00
申请品种	7d
合同到期日	2021-05-07
到期交割日	2021-05-07
利率 (%)	3.1000
抵押品种类	信贷资产
资金账户	000000017862001
申请原因及资金用途	898989
经办人	高一娜

退出

逻辑:

[1] 若初审和审核为有修改通过，则人民银行分支机构提交审核结果后，需机构确认人民银行分支机构的“SLF 审核”结果，如果选择拒绝，则流程终止；如果选择接受，则复核质押券是否需要增加或者减少、资金账户和托管账户是否正确选择，然后确认提交。系统对质押券是否合格以及足量和所提交的质押券必须已经选择了对应托管账户进行检验，符合要求的，申请成功；否则根据系统提示修改，直到最后符合要求后，申请成功。同时，“SLF 确认”页面将记录下地方法人收到的 SLF 审核结果，以及最终发出的确认结果。

[2] 已确认的申请状态为申请成功。查询结果页面分页显示。

[3] SLF 确认过程中，用户修改质押券信息，输入债券代码后自动校验附加折扣率，如果校验失败标红显示；用户输入合格质押券代码能够自动匹配债券简称。

[4] 申请书超链接打开的查看页面，如果申请书状态为尚未确认和被拒绝则打开的是申请书信息，如果申请书已经确认则打开的是申请书确认后的结果。

[5] 用户只能查询到自己申请的数据；未维护托管机构的债券不可做为合格质押券，在提交的时候给出提示：***（债券代码）托管机构未知；已到期的质押券不能再做为合格质押券。

[6] 用户提交申请时，所提交的质押券必须已经选择了对应托管账户，即如果有托管机构为上清所的债券，则托管账户中必须已经选择了上清所账户。否则则给出提示：您提交的质押券对应托管机构包括上清所托管账户，请选择上清所托管账户。

[7] 申请书确认和查看页面，审核后的申请书与申请不一致的部分即审核阶段的最终数据与申请不一致的字段字体显示为绿色。

[8] 增加 SLF 额度足量性验证，当申请机构对应贷款合同签署权限的人民银行分支行 SLF 额度不足的情况下，SLF 申请操作无法进行，给出额度不足的提示信息。

[9] SLF 确认，根据抵押品种类分为：国债公司 DVP、国债公司非 DVP、上海清算所和信贷资产四种不同逻辑。界面要素根据发起申请、SLF 预审和 SLF 审核要素对应修改。

[10] 根据抵押品种类的不同，只能选择托管公司是上清所或国债公司的债券，不可同时选择。

[11] 当申请信息的状态更改为“申请成功”的同时，系统自动给有签署质押合同权限的用户发送一条手机短信（在个人信息设置中已维护手机号码），同时有签署质押合同权限的在线用户会收到消息提醒，内容为：×月×日×时×分（状态修改为申请成功的操作时间），已成交一笔常备借贷便利，金额××（即确认后的申请金额）亿元，期限为××（即申请品种）天，请尽快办理质押并签署合同。

6.11.2.4 合同签署

功能描述：

当日达成的状态为“申请成功”的 SLF 将立刻进入到“合同签署”界面（逆序排列，即最新的记录排在最前）。可以分别依次进行质押合同签署、质押券冻结和贷款合同签署。用户可以签署本机构下的所有合同。对于金融机构发送的抵押品为国债公司债券的 DVP 申请，审核通过后，金融机构所在地人行分支机构与金融机构签署质押合同和常备借贷便利合同。合同样本去掉抵押品相关信息。合同签署成功后，相关数据传输至国债公司。

DVP 流程和信贷资产不需要进行质押确认操作，没有质押申请书。信贷资产没有数据传输。

对于抵押品为国债公司债券的非 DVP 申请和抵押品为清算所债券的申请。合同签署流程保持不变。

债券质押合同增加账户信息。

操作步骤:

查询:

用户进入合同签署查询页面，默认查询当天所有申请成功及后续状态的记录:

	质押合同	质押申请书	质押情况	贷款合同	状态	编号	申请机构	申请时间	申请品种	期限(天)	申请金额(亿元)	利率(%)	
1	签署				申请成功	SLF20210430000006	长春农村商业银行股份有限公司	10:50:10	7d	7	1.00	3.1000	
2	签署				申请成功	SLF20210430000005	长春农村商业银行股份有限公司	10:49:04	7d	7	1.00	3.1000	
3	签署				申请成功	SLF20210430000004	长春农村商业银行股份有限公司	10:48:54	7d	7	1.00	3.1000	
4	签署				申请成功	SLF20210430000003	长春农村商业银行股份有限公司	10:48:33	7d	7	1.00	3.1000	

合同签署:

人民银行分支行和法人用户进行质押合同签署，点击确认签署的时候验证 SLF 申请额度的足量性（若该机构的隶属支行未设置额度，则表示申请额度不限制；反之申请额度受到限制）；

质押合同

债券质押合同

编号: ZY20210430000006

出质人: 长春农村商业银行股份有限公司（以下简称“甲方”）
住所: 长春市正阳街4288号
法定代表人: 马铁刚
电话: 0431-89115121
开户银行: 中央结算公司
邮政编码:
传真: 0431-89115145
账号: 00000001786

确认签署修改

人民银行分支行和法人用户进行贷款合同签署，点击确认签署的时候验证 SLF 申请额度的足量性（若该机构的隶属支行未设置额度，则表示申请额度不限制；反之申请额度受到限制）；

贷款合同

常备借贷便利合同

合同编号: DK20210430000010

一、借款方: 吉林九台农村商业银行股份有限公司

二、贷款方: 试点

三、品种: 1d , 期限: 1 天 , 自 2021 年 4 月 30 日 至 2021 年 5 月 1 日

四、利率: 2.1770 % (年利率) 计息方式: ☒ 逐笔一次计息

五、金额: (大写) 壹亿元 (小写) ¥ 100000000.00 元

六、借款方资金账户户名: 吉林九台农村商业银行股份有限公司
资金账户账号: 071040101012621009900282
贷款方支付系统行名: 1212121
支付系统行号: 1212121

七、说明: _____

确认签署

修改

(1) DVP 流程和信贷资产申请成功页面:

质押合同	质押申请书	质押情况	贷款合同	状态	编号	申请机构	申请时间	申请品种	期限(天)	申请金额(亿元)	利率(%)
签署				申请成功	SLF20210430000015	吉林九台农村商业银行股份有...	11:21:55	1d	1	1.00	2.1770
签署				申请成功	SLF20210430000014	吉林九台农村商业银行股份有...	11:18:29	1d	1	1.00	2.1770
签署				申请成功	SLF20210430000013	吉林九台农村商业银行股份有...	11:16:57	1d	1	1.00	2.1770
签署				申请成功	SLF20210430000012	吉林九台农村商业银行股份有...	11:16:44	1d	1	1.00	2.1770
签署			签署	签署完毕	SLF20210430000010	吉林九台农村商业银行股份有...	11:02:06	1d	1	1.00	2.1770
签署	签署	质押成功	签署	签署完毕	SLF20210430000009	吉林九台农村商业银行股份有...	11:01:57	1d	1	2.00	2.1770
签署	签署	质押成功	签署	签署完毕	SLF20210430000007	吉林九台农村商业银行股份有...	11:01:28	1d	1	1.00	2.1770

(2) DVP 流程和信贷资产，签署质押合同后的页面，国债 DVP 和信贷资产没有质押申请书:

	质押合同	质押申请书	质押情况	贷款合同	状态	编号	申请机构	申请时间	申请品种	期限(天)	申请金额(亿元)	利率(%)
1	签署				申请成功	SLF20210430000015	吉林九台农村商业银行股份有...	11:21:55	1d	1	1.00	2.1770
2	查看			查看	贷款合同待签署	SLF20210430000014	吉林九台农村商业银行股份有...	11:18:29	1d	1	1.00	2.1770
3	签署				申请成功	SLF20210430000013	吉林九台农村商业银行股份有...	11:16:57	1d	1	1.00	2.1770
4	签署				申请成功	SLF20210430000012	吉林九台农村商业银行股份有...	11:16:44	1d	1	1.00	2.1770
5	查看			查看	签署完毕	SLF20210430000010	吉林九台农村商业银行股份有...	11:02:06	1d	1	1.00	2.1770
6	查看	查看	质押成功	查看	签署完毕	SLF20210430000009	吉林九台农村商业银行股份有...	11:01:57	1d	1	2.00	2.1770
7	查看	查看	质押成功	查看	签署完毕	SLF20210430000007	吉林九台农村商业银行股份有...	11:01:28	1d	1	1.00	2.1770

(3) 对于 DVP 流程,法人机构签署完质押合同后,可以不用等待所属分支行签署质押合同,而直接签署贷款合同。法人机构签署完质押合同和贷款合同后,合同的状态会变为“质押合同待签署”:

	质押合同	质押申请书	质押情况	贷款合同	状态	编号	申请机构	申请时间	申请品种	期限(天)	申请金额(亿元)	利率(%)
1	签署				申请成功	SLF20210430000015	吉林九台农村商业银行股份有...	11:21:55	1d	1	1.00	2.1770
2	查看			查看	质押合同待签署	SLF20210430000014	吉林九台农村商业银行股份有...	11:18:29	1d	1	1.00	2.1770
3	签署				申请成功	SLF20210430000013	吉林九台农村商业银行股份有...	11:16:57	1d	1	1.00	2.1770
4	签署				申请成功	SLF20210430000012	吉林九台农村商业银行股份有...	11:16:44	1d	1	1.00	2.1770
5	查看			查看	签署完毕	SLF20210430000010	吉林九台农村商业银行股份有...	11:02:06	1d	1	1.00	2.1770
6	查看	查看	质押成功	查看	签署完毕	SLF20210430000009	吉林九台农村商业银行股份有...	11:01:57	1d	1	2.00	2.1770
7	查看	查看	质押成功	查看	签署完毕	SLF20210430000007	吉林九台农村商业银行股份有...	11:01:28	1d	1	1.00	2.1770

(4) 如果法人机构所在分支行签署完质押合同和贷款合同后,法人机构的合同签署界面,会显示合同的状态为“签署完毕”。

(5) 对于国债非 DVP 和上海清算所流程,在法人机构签署完质押合同后,系统会自动生成相应的质押合同书。

逻辑:

[1] 当日达成的状态为“申请成功”的 SLF 将立刻进入到“合同签署”界面(申请时间逆序排列,即最新的记录排在最前)。可以分别依次进行质押合同签署、质押券冻结和贷款合同签署。质押合同和贷款合同未签署操作为“签署”,已经签署后为“查看”,质押合同签署成功之后,质押申请书自动也操作完成(不用再操作),显示成查看。

质押合同签署：

[2] 本币用户可点击质押合同下的“签署”超链接，打开质押合同书，核对信息点击下方“确认签署”按钮后，显示提示信息“确认成功，请尽快完成质押登记和签署贷款合同”；若信息不符，则点击下方“修改”按钮后，显示提示信息“请在用户设置界面修改相关信息后再行打开质押合同书；若仍有问题，请联系同业拆借中心场务工作人员”。

[3] 在打开的质押合同书中点击了“确认签署”按钮后，当前状态由“申请成功”自动变为“质押合同待签署”（如果分支机构用户先签署了质押合同书，则状态变为“质押合同已签署”）。只有状态变为“质押合同已签署”时，质押合同书右上角的“打印”和“导出”按钮才能生效，用户才能进行相关操作。

[4] 闭市后，所有最终状态为“质押合同待签署”的SLF申请的状态均变为“质押合同签署失败”。

质押申请书：

[5] 当质押合同签署成功之后，质押申请书也操作完成（不用再操作），显示成查看。

质押成功确认：

[6] 当质押合同签署成功之后，人民银行分支机构用户的质押情况栏下会显示“质押情况确认”超链接。只有分支机构用户点击了质押成功确认的操作，后续的贷款合同才能进行操作。

贷款合同签署：

[7] 当状态为“质押中”及后续的其他状态时，人民银行分支机构用户和本币用户才能点击“贷款合同”的超链接，打开贷款合同。

[8] 人民银行分支机构用户和本币用户分别确认签署贷款合同书，打开贷款合同书界面，核对信息点击下方“确认签署”按钮后，显示提示信息“确认成功”；若信息不符，则点击下

方“修改”按钮后，显示提示信息“请在用户设置界面修改相关信息后再行打开质押合同书；若仍有问题，请联系同业拆借中心场务工作人员”。

[9] 在打开的贷款合同书中点击了“确认签署”按钮后，当前状态由“质押中”自动变为“贷款合同待签署”（如果分支机构用户先签署了贷款合同书，则状态变为“签署完毕”）。

[10] 只有状态变为“签署完毕”时，贷款合同书右上角的“打印”和“导出”按钮才能生效，用户才能进行相关操作。闭市后数据转历史批处理，所有最终状态为“贷款合同待签署”的 SLF 申请的状态均变为“贷款合同签署失败”。

[11] 如果质押合同尚未签署完成，当质押合同签署机构信息进行了更新，则质押合同需要重新签署；如果借贷合同尚未签署完成，当借贷合同签署机构信息进行了更新，则借贷合同需要重新签署。

[12] 增加 SLF 额度足量性验证（若该机构的隶属支行未设置额度，则表示申请额度不限制；反之申请额度受到限制），当申请机构对应贷款合同签署权限的人民银行分支行 SLF 额度不足的情况下，SLF 申请操作无法进行，给出额度不足的提示信息。

[13] 对于金融机构发送的抵押品为国债公司债券的 DVP 申请，审核通过后，金融机构所在地人行分支机构与金融机构签署质押合同和常备借贷便利合同。合同样本去掉抵押品相关信息。合同签署成功后，相关数据传输至国债公司。传输字段包括：业务种类、成交日、成交时间、成交编号、金融机构托管账号、人民银行托管账号、质押方式、利率、首次结算金额、到期结算金额、首次结算方式、到期结算方式、首次交割日、到期交割日。

[14] 对于抵押品为国债公司债券的非 DVP 申请和抵押品为清算所债券的申请，合同签署流程保持不变。

[15] 债券质押合同上账户信息：对于人民银行分支机构，债券质押合同显示的债券账户为签署质押合同的人行分支机构债券账户，支付系统行名为签署贷款合同的人行分支机构的支

付系统行名,支付系统行号为签署贷款合同的人行分支机构的支付系统行号。对于金融机构,合同上的账户信息为申请时填写的账户信息。

信贷资产质押合同只增加资金账户信息:签署贷款合同的人行分支机构资金账户。

[16] 国债 DVP 流程和信贷资产流程,不需要进行质押确认操作,没有质押申请书,

[17] 首期结算失败后,合同仅可以查看,不可以打印下载。

[18] 国债非 DVP、上海清算所:有质押确认权限的人民银行分支行签署质押合同,并进行质押成功确认。

[19] 针对 DVP 流程,分支行签署完质押合同后,不需要等对方签署质押合同,可以直接签署贷款合同。[20] 国债非 dvp、上海清算所申请流程:质押成功确认的同时,系统会给有合同签署权限的该法人用户发送一条短信提醒(在个人信息设置中已维护手机号码),内容为‘×月×日×时×分(质押成功确认时的操作时间),已完成一笔常备借贷便利质押券冻结,请尽快签署贷款合同。’。信贷资产申请流程:质押合同签署完成的同时,系统会给有合同签署权限的该法人用户发送一条短信提醒(在个人信息设置中已维护手机号码),内容为‘×月×日×时×分(状态修改为质押合同已签署的操作时间),已完成一笔常备借贷便利质押券冻结,请尽快签署贷款合同。’。

6.11.3 超限监测

6.11.3.1 超限监测

功能描述: 法人用户实时监控本机构的货币市场超限交易。

操作步骤:

用户选择超限监测菜单,默认展示当日的所有超限交易数据,如图:

三 超限监测								
								导出
	市场	交易品种	成交编号	融入方	融入方交易员	融出方	融出方交易员	成
1	质押式回购	R007	CR20210429300003	山东威海农村商业银行股份...	xuzhanbin	平顶山银行股份有限公司	913019	

点击左侧的超限监测菜单，实时刷新最新的数据；

点击导出按钮，可以导出所有的超限交易数据。

逻辑：

- [1] 超限监测页面首次进入会自动刷新查询符合条件的记录，后续会 3 分钟自动刷新一次。
- [2] 超限监测的货币市场成交只展示融入方为本机构的当日超限成交数据，可导出查询结果；
- [3] 该功能提供超限交易短信提醒功能，已在个人信息设置中维护了手机号码的用户能够接收到本机构的超限监测短信；
- [4] 短信提醒内容：“×月×日×时×分，××（机构简称）通过××（交易品种）融入资金××（即融入额）亿元，成交利率××%”。

6.11.4 信息查询

6.11.4.1 SLF 信息查询

功能描述：查询自己申请的数据信息。单击申请编号超链接，系统打开的页面根据国债

DVP、国债非 DVP、上清所流程、信贷资产有所不同。

操作步骤：

用户进入信息查询->SLF 信息查询菜单，展示 SLF 信息查询主界面，如图：输入查询条件，点击查询按钮，查询对应 SLF 信息：

SLF 信息查询														
申请日期		起止时间	2021-04-30	2021-04-30	申请品种	状态		全部						
	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押券面总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期结算金额	实际占款天数(天)	流程状态
1	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
2	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
3	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01:...	2	1d	1	2.177	67.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	申请成功
4	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01:...	2	1d	1	2.177	67.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	签署完毕
5	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30 11:02:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
6	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30 11:02:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
7	2021-04-30	SLF20210430000011	2021-04-30 11:12:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	发出申请
8	2021-04-30	SLF20210430000012	2021-04-30 11:16:...	1	1d	1	2.177	6767.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
9	2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30 11:16:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
10	2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30 11:18:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功

点击“导出”按钮，弹出 Excel 下载页面：

SLF 信息查询

申请日期

起止时间

2021-04-30

2021-04-30

申请品种

全部

导出

	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押券面总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期结算金额	实际占款天数(天)	流程状态
1	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
2	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
3	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01:...	2	1d	1	2.177	67.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	申请成功
4	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01:...	2	1d	1	2.177	67.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	签署完毕
5	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30 11:02:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
6	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30 11:02:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
7	2021-04-30	SLF20210430000011	2021-04-30 11:12:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	发出申请
8	2021-04-30	SLF20210430000012	2021-04-30 11:16:...	1	1d	1	2.177	6767.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
9	2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30 11:16:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
10	2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30 11:18:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功

保存文件

名称: SLF 信息查询.xls

保存类型: Microsoft Excel 97-2003 工作簿 (*.xls)

保存(S)

取消

点击申请编号，查看对应的申请书：

状态是申请成功（预审、审核无修改通过时）的申请，单击申请编号超链接，根据不同流程展示不同的常备借贷便利申请书：

（1）国债 DVP：

SLF 信贷管理

申请日期

起止时间

2021-04-30

2021-04-30

申请品种

全部

状态

全部

刷新

导出

	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押资产总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期结算金额	实际放款天数(天)	流程状态
1	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
2	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
3	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	申请成功
4	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	签署完毕
5	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
6	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
7	2021-04-30	SLF20210430000011	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	发起申请
8	2021-04-30	SLF20210430000012	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
9	2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
10	2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功

查看

打印

导出

申请机构

吉林九台农村商业银行股份有限公司

申请日期

2021-04-30

申请金额 (亿元)

1.00

申请品种

1d

合同到期日

2021-05-01

到期交割日

2021-05-04

利率 (%)

2.1770

质押资产种类

国债公司债

质押资产总额

00000004346

资金账户

071040101012621009900282

质押方式

自动质押

结算方式

转账支付

申请原因及资金使用

67676767

经办人

QTEST3164

提交

(2) 国债非 DVP:

SLF 信贷管理

申请日期

起止时间

2021-04-30

2021-04-30

申请品种

全部

状态

全部

刷新

导出

	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押资产总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期结算金额	实际放款天数(天)	流程状态
1	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
2	2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
3	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01:...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	申请成功
4	2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	签署完毕
5	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
6	2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
7	2021-04-30	SLF20210430000011	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	发起申请
8	2021-04-30	SLF20210430000012	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
9	2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
10	2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功

查看

打印

导出

申请机构

吉林九台农村商业银行股份有限公司

申请日期

2021-04-30

申请金额 (亿元)

1.00

申请品种

1d

合同到期日

2021-05-01

到期交割日

2021-05-04

利率 (%)

2.1770

质押资产种类

国债公司债

质押资产总额

00000004346

资金账户

071040101012621009900282

质押方式

自动质押

结算方式

转账支付

申请原因及资金使用

111111111111

经办人

QTEST3164

提交

(3) 信贷资产:

SLF管理查询

申请日期

起止时间

2021-04-30

2021-04-30

申请品种

全部

日期

申请编号

申请时间

申请金额(亿元)

申请品种

期限(天)

利率(%)

质押券面总额(亿元)

起息日

合同到期日

到期交割日

到期清算金额

实际占款天数(天)

流程状态

1

2021-04-30

SLF20210430000007

2021-04-30 11:01...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

2

2021-04-30

SLF20210430000007

2021-04-30 11:01...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

签署完毕

3

2021-04-30

SLF20210430000009

2021-04-30 11:01...

2

1d

1

2.177

67.68

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

200048377.78

4

申请成功

4

2021-04-30

SLF20210430000009

2021-04-30 11:01...

2

1d

1

2.177

67.68

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

200048377.78

4

签署完毕

5

2021-04-30

SLF20210430000010

2021-04-30 11:02...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

6

2021-04-30

SLF20210430000010

2021-04-30 11:02...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

签署完毕

7

2021-04-30

SLF20210430000011

2021-04-30 11:12...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

退出申请

8

2021-04-30

SLF20210430000012

2021-04-30 11:16...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

9

2021-04-30

SLF20210430000013

2021-04-30 11:18...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

10

2021-04-30

SLF20210430000014

2021-04-30 11:18...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

查看

质押借贷便利申请书

申请机构

吉林九台农村商业银行股份有限公司

申请日期

2021-04-30

申请金额(亿元)

2.00

申请品种

1d

合同到期日

2021-05-01

到期交割日

2021-05-04

利率(%)

2.1770

质押品种类

信贷资产

质押资产账户

071040101012621009900282

质押券

债券代码

债券名称

票面(万元)

基础质押率(%)

附加折扣率(%)

数量合计(亿元)

67.68

申请率及资金用途

6666666666666666

经办人

QTES13164

退出

(4)上海清算所：

SLF管理查询

申请日期

起止时间

2021-04-30

2021-04-30

申请品种

全部

日期

申请编号

申请时间

申请金额(亿元)

申请品种

期限(天)

利率(%)

质押券面总额(亿元)

起息日

合同到期日

到期交割日

到期清算金额

实际占款天数(天)

流程状态

1

2021-04-30

SLF20210430000007

2021-04-30 11:01...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

2

2021-04-30

SLF20210430000007

2021-04-30 11:01...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

签署完毕

3

2021-04-30

SLF20210430000009

2021-04-30 11:01...

2

1d

1

2.177

67.68

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

200048377.78

4

申请成功

4

2021-04-30

SLF20210430000009

2021-04-30 11:01...

2

1d

1

2.177

67.68

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

200048377.78

4

签署完毕

5

2021-04-30

SLF20210430000010

2021-04-30 11:02...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

6

2021-04-30

SLF20210430000010

2021-04-30 11:02...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

签署完毕

7

2021-04-30

SLF20210430000011

2021-04-30 11:12...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

退出申请

8

2021-04-30

SLF20210430000012

2021-04-30 11:16...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

9

2021-04-30

SLF20210430000013

2021-04-30 11:16...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

10

2021-04-30

SLF20210430000014

2021-04-30 11:18...

1

1d

1

2.177

11111111.11

2021-04-30

2021-05-01

2021-05-04

100024188.89

4

申请成功

查看

质押借贷便利申请书

申请机构

吉林九台农村商业银行股份有限公司

申请日期

2021-04-30

申请金额(亿元)

2.00

申请品种

1d

合同到期日

2021-05-01

到期交割日

2021-05-04

利率(%)

2.1770

质押品种类

上海清算所债券

质押资产账户

B0001891

资金账户

071040101012621009900282

质押券

债券代码

债券名称

票面(万元)

基础质押率(%)

附加折扣率(%)

数量合计(亿元)

67.68

申请率及资金用途

6666666666666666

经办人

QTES13164

退出

状态是 签署完毕的申请，单击申请编号超链接，展示国债 DVP、上清所、国债非 DVP、信贷资产流程相关的合同信息：

(1) 国债非 DVP：

SLF信息查询

申请日期

起止时间

2021-01-20

2021-01-20

申请品种

状态

全部

导出

	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押券面总额(亿元)	起息日
1	2021-01-20	SLF20210120000002	2021-01-20 09:53:53	1.00	1d	1	2.8888		2021-01-21
2	2021-01-20	SLF20210120000002	2021-01-20 09:53:53	1.00	1d	1	2.8888		2021-01-21
3	2021-01-20	查看合同							2021-01-21
4	2021-01-20	打印 导出							2021-01-21
5	2021-01-20								2021-01-21
6	2021-01-20								2021-01-21
7	2021-01-20								2021-01-21
8	2021-01-20								2021-01-21
9	2021-01-20								2021-01-21
10	2021-01-20								2021-01-21

债券质押冻结登记申请书

质押日期

2021-01-20

出质人名称

江苏江南农村商业银行股份有限公司

出质人托管账号

00000007041

质权人名称

分支机构全称

质权人托管账号

js005

质押原因

质押情况

序号

1

债券代码

01

债券名称

中央国债

质押面额(万元)

22222.00

质押到期日

2021-01-21

退出

(2) 国债 DVP:

SLF信息查询

申请日期

起止时间

2021-04-30

2021-04-30

申请品种

状态

全部

导出

	日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押券面总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期清算金额	实际占款天数(天)	流程状态
11	2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30 11:16:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
12	2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30 11:18:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
13	2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30 11:18:...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕
14	2021-04-30	SLF20210430000015	2021-04-30 11:18:...	查看合同							2021-05-04	100024188.89	4	申请成功
15	2021-04-30	SLF20210430000015	2021-04-30 11:18:...	打印 导出							2021-05-04	100024188.89	4	签署完毕

债券质押合同

编号: ZY20210430000014

出质人: 吉林九台农村商业银行股份有限公司 (以下简称“甲方”)
住所: 吉林省长春市高新区蔚山路2559号九台农商行
法定代表人: 高兵
电话: 0431-89250527

退出

(3) 信贷资产:

SLF质押查询

申请日期: 2021-04-30 2021-04-30 申请品种: 全部 状态: 全部

日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押券面总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期清算金额	实际占款天数(天)	质押券面
2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30 11:16...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30 11:18...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000014	2021-04-30 11:18...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000015	2021-04-30 11:18...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000015	2021-04-30 11:18...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功

查看合同

打印 导出

债券质押合同

编号: ZY20210430000015

出质人: 吉林九台农村商业银行股份有限公司 (以下简称“甲方”)

住所: 吉林省长春市高新区蔚山路2559号九台农商银行

法定代表人: 高兵

电话: 0431-89250527

退出

(4) 上海清算所:

SLF质押查询

申请日期: 2021-04-30 2021-04-30 申请品种: 全部 状态: 全部

日期	申请编号	申请时间	申请金额(亿元)	申请品种	期限(天)	利率(%)	质押券面总额(亿元)	起息日	合同到期日	到期交割日	到期清算金额	实际占款天数(天)	质押券面
2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000007	2021-04-30 11:01...	1	1d	1	2.177	11111111.11	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01...	2	1d	1	2.177	67.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000009	2021-04-30 11:01...	2	1d	1	2.177	67.68	2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	200048377.78	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30 11:02...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000010	2021-04-30 11:02...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000011	2021-04-30 11:12...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000012	2021-04-30 11:16...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000012	2021-04-30 11:16...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功
2021-04-30	SLF20210430000013	2021-04-30 11:16...	1	1d	1	2.177		2021-04-30	2021-05-01	2021-05-04	100024188.89	4	质押成功

查看合同

打印 导出

银行间市场清算所股份有限公司

质押登记申请表

出质人名称 (全称)	吉林九台农村商业银行股份有限公司
质权人名称 (全称)	试点
出质人持有人账户名称	吉林九台农村商业银行股份有限公司
出质人持有人账号	B0001891
质押合同编号	ZY20210430000012

退出

点击申请书右上角，导出按钮，可以“导出” pdf 格式的申请书文件；点击申请书右上角，打印按钮，可以“打印”申请书文件。

逻辑:

[1] 查询可以按照时间区间、期限和交易状态可分别筛选查看，可导出 EXCEL。

[2] 时间区间查询分为申请日期、到期日、未到期三种类型进行查询。选择申请日期，查询数据为申请时间在开始日期和终止日期之间的申请数据；选择到期日,查询数据为到期日在开始日期和终止日期之间的申请数据；选择未到期会置灰开始日期，查询数据为到期日在指

定的终止日期之后并且还未到期的申请数据。

[3] 发出申请指尚未被初审的申请；审核中指在初审阶段的申请；未通过指初审或审核中被拒绝的申请；机构拒绝指法人在确认阶段拒绝的申请；申请成功指初审和预审均无修改通过或法人确认阶段接受成功的申请；待确认指申请成功后，分支机构用户和本币用户都未进行质押合同签署操作；质押合同待签署指分支机构用户或本币用户只有一方进行了质押合同的签署操作；质押合同已签署指分支机构用户和本币用户都已完成了质押合同的签署操作；质押合同签署失败指分支机构和本币用户只有一方进行了质押合同的签署操作，另一方未进行质押合同的签署操作，直至合同签署失效；质押中指分支机构用户已点击冻结质押券的操作；质押失败指分支机构用户点击了已冻结质押券的操作，但贷款合同双方一直未进行签署操作，直至合同签署失效；贷款合同待签署指分支机构用户或本币用户只有一方进行了贷款合同的签署操作；贷款合同签署失败指分支机构和本币用户只有一方进行了贷款合同的签署操作，另一方未进行贷款合同的签署操作，直至合同签署失效；签署完毕指双方共同进行了完整的合同签署操作，合同签署完成。

[4] 当日未完成的 SLF 申请、预审、审核和确认，次日全部转历史，不可再操作。查询结果分页显示。

[5] 对于所有进入到申请成功阶段后的 SLF，仅再多保留一条查询记录，用于记录查询时刻的最新状态，因而每笔 SLF 申请，至多有两条记录。

[6] 状态为“申请成功”的 SLF 记录，点击编号超链接，可打开最终的申请书，可打印、导出 PDF 功能；状态为“签署完毕”的 SLF 记录，点击编号超链接，可打开最终的质押申请书+质押合同+贷款合同，可打印、导出 PDF 功能。

[7] 已放款/放款失败/已还款/还款失败，当日“签署完毕”的申请数据，如果没有进行“已放款”操作，系统服务时间结束后，统一处理为“已放款”；当日待维护还款的申请数据，如果没有进行“已还款”操作，系统服务时间结束后，统一处理为“已还款”。

[8] 状态是申请成功（预审、审核无修改通过时）的申请，单击申请编号超链接，查看页面展现的字段值与发出申请完全一致。

[9] 状态是申请成功（预审或审核有修改通过时）的申请，单击申请编号超链接，展示国债 DVP、上清所、国债非 DVP、信贷资产流程相关的申请信息时，展现的字段值与 SLF 确认页面完全一致。

[10] 状态是签署完毕的申请，单击申请编号超链接，展示国债 DVP、上清所、国债非 DVP、信贷资产流程相关的合同信息，系统展示的字段值及内容与合同签署一致。不展示常备借贷便利完成确认书及常备借贷便利到期完成确认书。

国债 DVP 和信贷资产不展示质押申请书信息。

[11] 首期结算失败后，合同仅可以查看，不可以打印下载。

6.11.4.2 超限交易查询

功能描述：法人用户查询本机构的货币市场历史超限交易。

操作步骤：

用户选择信息查询->超限交易查询菜单，点击查询按钮默认展示上一日的所有历史超限交易数据，如图：



超限交易查询							
时间							
2021-04-22		2021-04-29					
	市场	交易品种	成交编号	融入方	融入方交易员	融出方	融出方交易员
1	质押式回购	R007	CR20210429300003	山东威海农村商业银行股份...	xuzhanbin	平顶山银行股份有限公司	913019
2	买断式回购	OR4M	OR20210427300003	山东威海农村商业银行股份...	xuzhanbin	平顶山银行股份有限公司	913019

点击导出按钮，可以导出所有已查询出的超限交易数据。

逻辑：

[1]超限交易查询展示货币市场融入方为本机构的历史超限交易，可导出查询结果；查询结果按照成交日到序排列，同一交易日按照市场（买断式回购/信用拆借/质押式回购）排序，相同市场内按照成交编号倒叙排列；查询结果分页显示。最大查询范围 3 个月。

6.12 衍生品市场-信用违约互换

6.12.1 对话报价

6.12.1.1 发起报价

当交易员身份下具有“信用违约互换-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“衍生品市场”-“信用违约互换”-“对话”，选择方向（“买入”或“卖出”），输入本方、对手方和对手方交易员后，选择合约类型(“标准”或“普通”)并填写各报价要素，并确保“债务种类”、“债务特征”、“信用事件”和“结算方式”四个页签的内容均已填写且未读红点消失，即可点击  按钮，保存一笔信用违约互换对话报价;或者点击  按钮，发送一笔信用违约互换对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

报价方式

对话

双向

买入

卖出

本方

中国银行

对手方

招商银行

对手方交易员

王天贝

合约类型

普通

标准

清算方式

双边自行清算

参考债券名称

参考债券代码

起息日

期限

约定到期日

名义本金(万元)

CNY

币种

利率(bps)

票面(标准票息(bps))

支付频率

计息频率

实际/365

计息天数调整

实际天数

计息天数调整

实际天数

交付金额(元)

首期交付金额(元)

前续费(元)

期初返还金额(元)

交付金额支付日

首期交付日

参考期限比例(%)

计算机构

债券种类

债券特征

信用事件

清算方式

付款义务

偿债款项

担保

融资工具

贷款或融资工具

仅为参考债券

非金融企业债券融资工具

其他

补充条款

履约担保条款

重置

保存

提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

报价方式

对话

双向

买入

卖出

本方

中国银行

对手方

招商银行

对手方交易员

王天贝

合约类型

普通

标准

清算方式

双边自行清算

参考债券名称

参考债券代码

起息日

期限

约定到期日

名义本金(万元)

CNY

币种

利率(bps)

票面(标准票息(bps))

支付频率

计息频率

实际/365

计息天数调整

实际天数

计息天数调整

实际天数

交付金额(元)

首期交付金额(元)

前续费(元)

期初返还金额(元)

交付金额支付日

首期交付日

参考期限比例(%)

计算机构

债券种类

债券特征

信用事件

清算方式

付款义务

偿债款项

担保

融资工具

贷款或融资工具

仅为参考债券

非金融企业债券融资工具

其他

补充条款

履约担保条款

重置

保存

提交

6.12.1.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】界面交易方式选择“对话”，可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

远期利率协议

交易方式

对话

双向

交易方向

全部

买入

卖出

本方状态

全部

待发送

已发送

待成交

合约类型

全部

普通

标准

清算方式

全部

双边自行清算

上海清算所集中清算

上海清算

交易方向	状态	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	合约类型	名义本金(万元)	参考实体	参考实体
买入	待发送	中国银行	招商银行	招商银行	王天贝 / 招商银行	普通	4,200	北京市农业融资...	
卖出	待成交	中国银行	招商银行	招商银行	王天贝 / 招商银行	普通	4,100	TCL科技集团股...	
买入	已发送	中国银行	招商银行	招商银行	王天贝 / 招商银行	标准	1,500	国家电网有限公司	0100071

撤销

拒绝

提交

1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击
- 撤销
- 按钮终止对话报价；或双击对话报价记录打开【我要报价】，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击
- 提交
- 按钮更新对话报价。

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击  按钮拒绝成交。也可双击对话报价记录打开【我要报价】，然后点击成交或者拒绝。

6.12.1.3 历史对话报价信息查询

信用违约互换市场对话报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-信用违约互换报价查询】界面，交易方式选择“对话”，查看历史的对话报价。



报价信息查询-衍生品市场

利率互换 标准债券远期 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换 远期利率协议

交易方式 ☒ 对话 ☐ 双向

本方交易员 交易方向 ☒ 全部 ☐ 买入 ☐ 卖出 成交状态 ☒ 全部 ☐ 成交 ☐ 未成交 合约类型 ☒ 全部 ☐ 标准 ☐ 普通

报价编号	交易方向	报价状态	成交状态	本方	本方交易员	对手方	对手方机构	对手方交易员	合约类型	名义本金(万元)	参考
210707064401000082	卖出	成交	成交	中国银行	孙菲	招商银行	招商银行	王天贝/招商银行	普通	4,100	TCL
210707064401000081	买入	已撤销	未成交	中国银行	孙菲	招商银行	招商银行	王天贝/招商银行	标准	1,500	国家

共2笔 (买入1笔/卖出1笔), 0.56亿 (买入0.15亿/卖出0.41亿)

6.12.2 双向报价

6.12.2.1 发起报价

任意身份下具有“信用违约互换-双向报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“双向”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔信用违约互换双向报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

报价方式

☐ 对话
 ☒ 双向

本方*

招商银行

参考实体*

期限*

有效时间*

3M

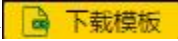
20:00

买入利差(bps)*

卖出利差(bps)*

☒ 对全市场可见

也可通过批量提交双向报价。

- a. 打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），选择“信用违约互换”后，交易方式选择“双向”，点击按钮，在模板中填写对话报价数据，点击按钮。导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。亦可以先将已有的报价导出之后，作为导入模板进行导入。

我的报价-衍生品市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

远期利率协议

交易方式

☐ 对话
 ☒ 双向

参考实体

期限

对全市场可见

☒ 是
 ☐ 否

☒ 导入
 ☐ 导出
 ☐ 下载模板

☐	本方	参考实体	期限	买入利差(bps)	卖出利差(bps)	对全市场可见	报价编号	有效时间	报价时
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.05	38.27	是	210720104401000007	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.04	38.26	是	210720104401000006	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	1Y	35.03	38.25	是	210720104401000005	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.02	38.24	是	210720104401000004	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.01	38.23	是	210720104401000003	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.00	38.22	是	210720104401000002	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.00	38.00	是	210720104401000001	20:00	17:48

- b. 打开【CDS 双向报价行情】，点击，选择已做好的报价文件，提交即可。

CDS双向报价行情

参考实体: 期限: 全部 ≤ 1Y (1Y-2Y) (2Y-5Y) >5Y 导入

报价方	参考实体	期限	买入利差(bps)	卖出利差(bps)	有效时间
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.10	38.10	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.09	38.09	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.08	38.08	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	1Y	35.07	38.29	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.06	38.28	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.05	38.27	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.04	38.26	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	1Y	35.03	38.25	19:00
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.02	38.24	19:00

6.12.2.2 双向报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】界面交易方式选择“双向”，可查看已经发出的双向报价，并进行报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 远期利率协议

交易方式: 对话 双向 参考实体: 期限: 全部 ≤ 1Y (1Y-2Y) (2Y-5Y) >5Y 对全市场可见: 全部 是 否 导入 导出 下载模板

☐	本方	参考实体	期限	买入利差(bps)	卖出利差(bps)	对全市场可见	报价编号	有效时间	报价时
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.05	38.27	是	210720104401000007	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.04	38.26	是	210720104401000006	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	1Y	35.03	38.25	是	210720104401000005	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.02	38.24	是	210720104401000004	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.01	38.23	是	210720104401000003	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.00	38.22	是	210720104401000002	19:00	17:54
☐	中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.00	38.00	是	210720104401000001	20:00	17:48

对于状态为“已发送”的双向报价，可以选中单笔/多笔报价，点击 撤销 按钮终止报价；或双击报价记录打开【我要报价】，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击 提交 按钮更新报价。

6.12.2.3 历史双向报价信息查询

信用违约互换市场双向报价的历史报价信息，可在“ 历史数据 -信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-信用违约互换报价查询】界面，交易方式选择“双向”，查看历史的双向报价。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换标准债券远期利率期权信用违约互换信用风险缓释凭证债券远期标准利率互换远期利率协议

交易方式 ☐ 对话 ☒ 双向

报价状态

全部过期撤销

参考实体

期限

全部≤1Y(1Y-2Y)(2Y-5Y)>5Y

 对全市场可见

全部是否

 日期

2021/07/072021/0

导出

报价编号	报价状态	本方	参考实体	期限	买入利差(bps)	卖出利差(bps)	对全市场可见	报价日期
210707104401000206	撤销	中国银行	企业银行（中国）有限公司	3M	100.00	200.00	是	2021/07/07
210707104401000207	撤销	中国银行	上海紫江企业集团股份有限公司	3M	200.00	300.00	是	2021/07/07
210707104401000208	撤销	中国银行	新希望集团有限公司	3M	330.00	421.00	否	2021/07/07
210707104401000200	过期	中国银行	911005	10Y	198.00	-2.99	是	2021/07/07
210707104401000198	撤销	中国银行	911005	3Y	196.00	-2.98	否	2021/07/07
210707104401000201	撤销	中国银行	911005	20Y	199.00	-100.00	是	2021/07/07
210707104401000199	撤销	中国银行	911005	5Y	197.00	-99.00	是	2021/07/07
210707104401000202	撤销	中国银行	911005	30Y	200.00	-2.10	否	2021/07/07
210707104401000144	撤销	中国银行	911005	1Y	144.00	-2.72	否	2021/07/07

共10笔

< >

1 / 1

< >

6.12.2.4 双向报价行情

信用违约互换市场双向报价的报价行情版，可通过“-衍生品市场—CDS 双向报价行情”菜单路径打开，此处可查看当前有效的所有“发送全市场可见”的双向报价。

CDS双向报价行情						
参考实体 期限 全部 ≤1Y (1Y-2Y) (2Y-5Y) >5Y 刷新 导入						
报价方	参考实体	期限	买入利差(bps)	卖出利差(bps)	有效时间	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.10	38.10	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.09	38.09	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.08	38.08	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	1Y	35.07	38.29	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.06	38.28	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	6M	35.05	38.27	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	3M	35.04	38.26	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	1Y	35.03	38.25	19:00	
中国银行	民企CDS指数 S1 V1	9M	35.02	38.24	19:00	

6.12.3 成交查询

对话报价的成交信息，可在“-信息查询—成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-信用违约互换成交查询】界面查看。



6.12.4 当日成交

用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“信用违约互换”TAB，查看当前交易日的成交汇总数据，支持查看交易方式为对话报价达成的所有标准及普通合约的成交，通过界面其它不同的筛选条件查询不同的成交数据。

6.12.5 逐笔成交行情

点击“--成交行情--信用违约互换成交行情”菜单路径，打开【信用违约互换逐笔成交行情】界面，查看逐笔行情数据。支持查看对话报价达成的逐笔成交。



6.12.6 CDS 指数查询

6.12.6.1 CDS 指数查询

点击“--信息查询--CDS 指数查询”菜单路径，打开【CDS 指数查询】TAB 页面，
可以查看当前有效的 CDS 指数。

CDS指数查询

CDS指数信用曲线

指数名称

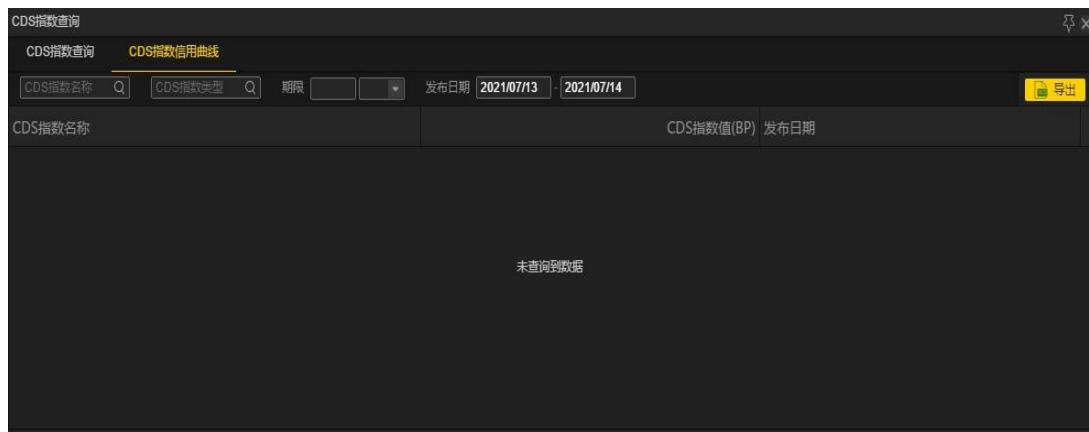
指数类型

状态

指数代码	指数名称	指数类型	指数序列	参考实体	参考债务名称
爱迪生	长江太瀚投资	西方达	1010	中国银行股份有限公司	01国开14
122135	dj	未知	201	4	4
1456	12223331	5458	阿斯蒂a	2	2
12311111111	345355	11111111111111111111111111111111...	55555555555555555555555555555555...	2	2
970805	王甜甜	王11	12311	970805	01国开16
0005	000005	aa2222222222222222222222222222...	11231111111111111111111111111111...	中国工商银行股份有限公司	01国开14
1y	2121	213465644444444444444444444444...	565885111111114455555555555555...	中国银行股份有限公司	01国开16
民企CDS指数 S1.V1	民企CDS指数 S1.V1	民企CDS指数	S1.V1	3	3

6.12.6.2 CDS 指数信用曲线

点击“-信息查询—CDS 指数查询”菜单路径，打开【CDS 信用指数曲线】TAB 页面，可以查看当前有效的 CDS 指数。可根据 CDS 指数名称、类型、期限和发布日期对 CDS 指数信用曲线进行筛选查看。



6.

13 衍生品市场-信用风险缓释凭证

6.13.1 对话报价

6.13.1.1 发起报价

(1) 任意身份下具有“信用风险缓释凭证-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，

点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

买入

卖出

本方*
测试机构1

对手方*
21020wl主机机构

凭证代码*
2021071209

凭证简称*
数仓信用风险缓释凭证测试

价格(元)*
100.0000

名义本金总额(万元)*
100,000

结算方式*
券款对付

清算速度*
+0

结算日*
2021/07/12

结算金额(元)*
2,000,000,000.00

补充条款

买入

卖出

本方*
测试机构

对手方*
21020wl主机机构

凭证代码*
2021071209

凭证简称*
数仓信用风险缓释凭证测试

价格(元)*
100.0000

名义本金总额(万元)*
100,000

结算方式*
券款对付

清算速度*
+0

结算日*
2021/07/12

结算金额(元)*
2,000,000,000.00

补充条款

保存

提交

保存

提交

(2) 提供批量提交对话报价功能。任意身份下具有“信用风险缓释凭证-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，可在“--我的交易--我的报价-信用风险缓释凭证”菜单路径下，选中通过 iQuote 保存的对话报价，批量提交。

我的报价-衍生品市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

远期利率协议

本方方向

全部

买入

卖出

状态

全部

待发送

已发送

待成交

代码/简称

对手方

对手方交易员

价格(元)

名义本金总额(万元)

清算速

☒	本方方向	凭证代码	凭证简称	状态	本方	对手方	对手方交易员	价格(元)	名义本金总额(万元)	清算速
☒	买入	shucang0706	数仓04706	待发送	测试机构	1112机构lm01	陈三 / 1112机构lm01	100.0000	10,000	T+1
☒	买入	shucang0706	数仓04706	待发送	测试机构	1112机构lm01	陈三 / 1112机构lm01	100.0000	10,000	T+1
☒	买入	shucang0706	数仓04706	待发送	测试机构	1112机构lm01	陈三 / 1112机构lm01	100.0000	10,000	T+1

撤销

拒绝

提交

成交

6.13.1.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

买入

卖出

本方*

测试机构1

对手方*

测试机构2

对手方交易员*

陈峰

凭证代码*

ODS202107051047

凭证简称*

1ODS202107051047

价格(元)*

100.0000

名义本金总额(万元)*

10,000

结算方式*

券款对付

清算速度*

+1

结算日*

2021/07/13

结算金额(元)*

100,000,000.00

补充条款

拒绝

成交

6.13.1.3 历史对话报价信息查询

信用风险缓释凭证市场对话报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-信用风险缓释凭证】界面，查看历史的对话报价。（a.对于有监控权限的交易员可查看对应身份下绑定账户组，在该交易账户组内所有交易账户的报价 b.对于无监控权限的交易员仅能查看本方交易员自己报价）

报价信息查询-衍生品市场

利率互换 标准债券远期 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换 远期利率协议

本方方向 **全部** 买入 卖出 成交状态 **全部** 已成交 未成交 代码/简称 Q 对手方 Q 日期 2021/07/12 - 2021/07/12 导出

本方方向	凭证代码	凭证简称	成交状态	价格(元)	名义本金总额(万元)	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	
卖出	ODS202107051...	1ODS20210705...	未成交	100.0000	10,000	测试机构1	张三	中国银行	符安妮	T+2
卖出	ODS202107051...	1ODS20210705...	成交	100.0000	10,000	测试机构1	张三	中国银行	符安妮	T+1

总2笔(买入0/卖出2), 2亿(买入0/卖出2)

6.13.2 成交查询

对话报价的成交信息，可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-信用风险缓释凭证成交查询】界面，查看对话报价成交。可导出当前查询界面的成交信息，双击选中的单笔成交信息，可查看下载对应成交单。（a.对于有监控权限的交易员可查看对应身份下绑定账户组，在该交易账户组内所有交易账户达成的成交 b.对于无监控权限的交易员仅能查看本方交易员自己的成交）

成交查询-衍生品市场

利率互换

利率互换成交统计

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

方向

全部

买入

卖出

凭证代码/名称

Q

对手方

Q

日期

2021/07/12

—

2021/07/12

Y

C

导出

下载成交单

☐	成交编号	本方方向	凭证代码	凭证名称	对手方	对手方机构	对手方交易员	本方	本方交易员	价格C
☐	CRM20210712300024	卖出	ODS202107051045 1ODS202107051...	测试机构1	测试机构2	张三	测试机构2	李四	100.0000	

总1笔(买入0/卖出1), 1亿(买入0/卖出1)

中国银行

K < 1 / 1 >

6.13.3 成交行情

6.13.3.1 逐笔成交行情

可点击“--成交行情--信用风险缓释凭证成交行情”菜单路径，打开【信用风险缓释凭证成交行情】界面，选择“逐笔行情”TAB，查看逐笔行情数据。支持查看对话报价达成的逐笔成交

信用风险缓释凭证成交行情

逐笔行情

凭证代码/名称

凭证代码	凭证名称	价格(元)	名义本金总额(万元)	成交时间
021800049	18浙商银行CRM...	10.0000	100	11:16:35
ODS202107051...	10DS20210705...	0.0000	100	10:33:54
002143	管理里	100.0000	10	10:20:13
022100025	21杭州银行CRM...	10.0000	10	10:19:31
02121545	蓝思科技02121...	1.2336	10	09:04:02

6.13.4 当日成交

用户点击“—我的交易—当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“信用风险缓释凭证”TAB，查看当前交易日的成交汇总数据，支持查看信用风险缓释凭证达成的成交，通过界面不同的筛选条件查询不同的成交数据。

当日成交

利率互换 标准债券远期 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换

凭证代码/名称 方向 全部 买入 卖出 对手方

方向	凭证代码	凭证名称	本方	对手方	对手方机构	对手方交易员	价格(元)	名义本金总额...	结算金额(元)	清除
未查询到数据										

共0笔, (买入0/卖出0), 0亿 (买入0/卖出0)

6.13.5 衍生品交易工具查询

用户点击“—信息查询—衍生品交易工具查询”菜单路径，打开【衍生品交易工具查询】界面，选择“信用风险缓释凭证”TAB，查看凭证的基础信息，通过界面其它的筛选条件查询不同的数据。

衍生品交易工具查询

利率互换合约基础信息

标准利率互换合约基础信息

标准债券远期集中清算-合约基础信息

信用风险缓释凭证

查询类型

基本信息

代码/名称

Q

状态

全部

凭证代码	凭证名称	凭证全称	单位名义本金 (元)	创设价格 (元)	名义本金总额 (亿元)
shucang070801	数仓测试070801	数仓测试0708	5.31	2.31	0.000003
shucang070601	shucang07060112	shucang070601212123	12321	12321	0.000003209999999999
shucang0706	数仓04706	数仓04706	12312	12312	0.00121312
ODS202107051047	1ODS202107051047	2ODS202107051047	100	100	3
ODS202107051045	1ODS202107051045	2ODS202107051045	100	100	5
ODS202107051040	1ODS202107051040	2ODS202107051040	100	100	1.5
ODS202107051028	1ODS202107051028	2ODS202107051028	100	100	2

总312笔记录

K

<

1

/ 7

>

X

共312条

6.14 衍生品市场-远期利率协议

6.14.1 对话报价

6.14.1.1 发起报价

（1）任意身份下具有“远期利率协议-对话报价”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，填写各类报价要素后，点击按钮，即可发送一笔对话报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

本方支付固定

本方收取固定

本方* ①

测试机构1

Q

对手方*

21020w1主机构

对手方交易员*

qiao九

Q

产品名称

协议1

清算方式

双边自行清算

▼

固定利率(%) *

10.0000

名义本金(万元) *

1000

远期期限*

5D

×

远期期限+合约期限 *

5D

▼

参考利率*

FR007

Q

贴现利率*

FR007

Q

利率确定日 *

2021/07/16

起息日 *

2021/07/18

到期日 *

2021/07/18

支付日 *

2021/07/19

支付日调整 *

下一营业日

计息基准 *

实际/365

争议解决方式

仲裁

计算机构

交易双方

▼

补充条款

提交

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

×

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

本方支付固定

本方收取固定

本方* ①

测试机构1

Q

对手方*

21020w1主机构

对手方交易员*

qiao九

Q

产品名称

协议1

清算方式

双边自行清算

▼

固定利率(%) *

10.0000

名义本金(万元) *

1000

远期期限*

5D

×

远期期限+合约期限 *

5D

▼

参考利率*

FR007

Q

贴现利率*

FR007

Q

利率确定日 *

2021/07/16

起息日 *

2021/07/18

到期日 *

2021/07/18

支付日 *

2021/07/19

支付日调整 *

下一营业日

计息基准 *

实际/365

争议解决方式

仲裁

计算机构

交易双方

▼

补充条款

提交

6.14.1.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价】可查看已经发出的对话报价。

我的报价-衍生品市场

利率互换

标准交割

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

远期利率协议

本方向	产品名称	状态	本方	对手方	对手方交易员	名义本金(万元)	固定利率(%)	期限	起息日	到期日
收取固定利率	测试名称	已发送	测试机构	21020w1主机...	qiao九/21020w1主机构	10	10.0000	1Dx5D	2021/07/14	2021/07/18

2. 对于状态为“已发送”的对话报价，报价方可以双击单笔对话报价记录打开 iQuote，直接进行撤销报价。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

本方支付固定

本方收取固定

本方 ①
测试机构

对手方*
21020wl主机构

对手方交易员*
qiao九

产品名称
123

清算方式
双边自行清算

固定利率 (%) *
10.0000

名义本金 (万元) *
10

远期期限*
1D

远期期限+合约期限 *
2D

参考利率 *
1年定存 (年付) 利率互换收盘曲线(均0

贴现利率 *
1年定存 (年付) 利率互换收盘曲线(均0

利率确定日 *
2021/07/13

起息日 *
2021/07/14

到期日 *
2021/07/15

支付日 *
2021/07/14

支付日调整 *
上一营业日

计息基准 *
30E/360

争议解决方式
仲裁

计算机构
交易双方

补充条款

撤销

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以双击对话报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

本方支付固定

本方收取固定

本方* ①
测试机构1

对手方*
测试机构2

对手方交易员*
杨过

产品名称
测试1

清算方式
双边自行清算

固定利率 (%) *
10.0000

名义本金 (万元) *
1000

远期限*
5D

远期限+合约期限 *
6D

参考利率*
FR007

贴票利率*
FR007

利率确定日 *
2021/07/16

起息日 *
2021/07/18

到期日 *
2021/07/19

支付日 *
2021/07/19

支付日调整 *
经调整的下一营业

计息基准 *
实际/365

争议解决方式
诉讼

计算机构
交易双方

补充条款

拒绝

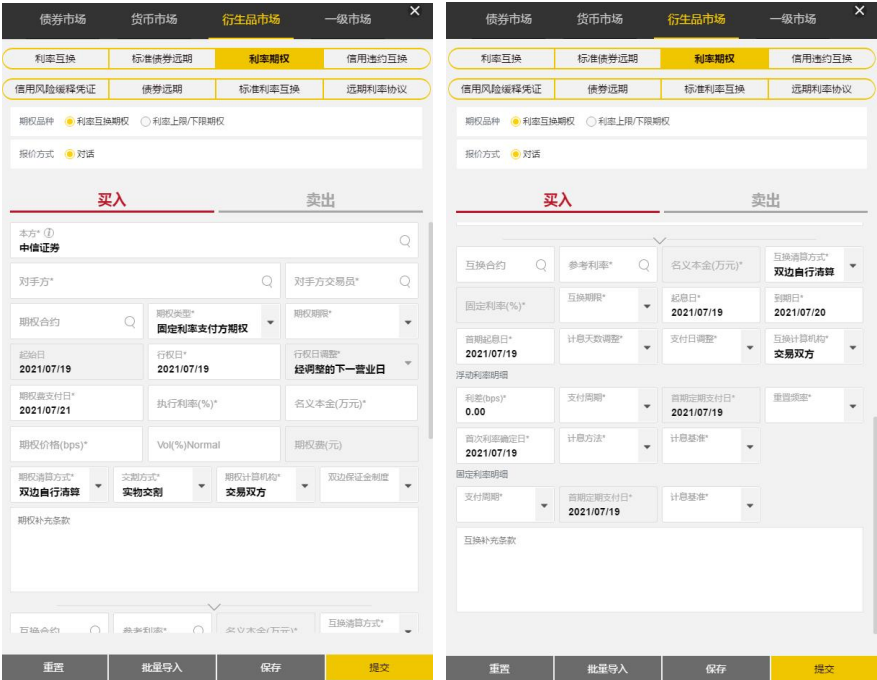
成交

6.14.1.3 历史对话报价信息查询

远期利率协议市场对话报价的历史报价信息，可在“—信息查询—报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-远期利率协议】界面，查看历史的对话报价。可导出当前查询界面报价信息。

报价信息查询-衍生品市场												🔍 X													
利率互换		标准债券远期		利率期权		信用违约互换		信用风险缓释凭证		债券远期		标准利率互换		远期利率协议											
本方向		全部		支付固定利率		收取固定利率		成交状态		全部		成交		未成交											
		产品名称		成交状态		固定利率 (%)		名义本金 (万元)		本方		本方交易员		对手方											
		测试机构		韩笑		测试机构2		陈峰		7Dx10D		1年定存 (年...		1年定存											
		支付固定利率		qqw		未成交		10.0000		10		测试机构		韩笑		测试机构2		胡晓雯		6Dx7D		1年定存 (年...		CDB'	
		支付固定利率		12		未成交		10.0000		10		测试机构		韩笑		测试机构2		谢昶		1Dx5D		1年定存 (年...		CDB'	
		收取固定利率				成交		9.0000		9000		测试机构		王阳		测试机构2		本币a		1Dx2D		1年定存 (年...		1年定存	
		收取固定利率		202107		成交		9.0000		900		测试机构		王阳		测试机构2		本币a		1Dx2D		1年定存 (年...		1年定存	
		支付固定利率		20210701001		成交		9.0000		900		测试机构		王阳		测试机构2		本币a		1Dx4D		1年定存 (年...		1年定存	
共6笔(支付固定利率3收取固定利率3), 1.182亿(支付固定利率0.092/收取固定利率1.09)																									
K < 1 / 1 > X																									

或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“利率期权”，期权品种选择“利率互换期权”，报价方式选择“对话”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔利率互换期权对话报价：



该图展示了两个并排的利率互换期权报价界面。左侧界面为“买入”状态，右侧为“卖出”状态。两个界面均包含以下要素：

- 顶部导航栏：债券市场、货币市场、衍生品市场（当前选中）、一级市场。
- 子菜单：利率互换、标准债券远期、利率期权（当前选中）、信用违约互换。
- 期权品种：利率互换期权（选中）、利率上限/下限期权。
- 报价方式：对话（选中）。
- 交易方向：买入/卖出。
- 交易对手：本方（中德证券）、对手方（交易员*）。
- 期权合约：固定利率支付方期权。
- 期限：起息日 2021/07/19，行权日 2021/07/19，行权日调整 经调整的下一营业日。
- 期权费支付日：2021/07/21。
- 执行利率：执行利率(%)。
- 名义本金：名义本金(万元)。
- 期权价格：期权价格(bps)。
- Volatility：Vol(%)Normal。
- 期权费(元)。
- 期权清算方式：双边自行清算。
- 交割方式：实物交割。
- 期权计算机构：交易双方。
- 双边保证金制度。
- 期权补充条款。
- 底部按钮：重置、批量导入、保存、提交。

2、也可批量提交对话报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“对话”，期权品种选择“利率互换期权”，点击  按钮，在模板中填写对话报价数据，点击  按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。



该图展示了利率互换期权导入界面。界面顶部有“利率互换期权导入”标题和“导入”按钮。下方是一个表格，用于填写导入数据。表格列包括：

期权要素明细	本方方向*	本方*	对手方*	对手方交易员*	期权类型*	期权合约	执行利率(%)*	名义本金(万元)*	期限
未查询到数据									

底部有“删除”、“保存”、“提交”按钮。

6.15.1.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价-衍生品市场-利率期权】界面交易方式选择“对话”，期权品种选择“利率互换期权”，可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理。



1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击  按钮终止对话报价；或双击对话报价记录打开 iQuote，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击  按钮更新对话报价。

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击  按钮

钮进行成交，或点击  按钮拒绝成交。也可双击对话报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝、修改交谈要素后进行提交。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

期权品种

利率互换期权

利率上限/下限期权

报价方式

对话

卖出

本方* ①

招商银行

对手方*

中信证券

对手方交易员*

黄青

期权合约

SWPT_FDR001_1M1Y

期权类型*

固定利率支付方期权

期权期限*

1M

起始日

2021/07/19

行权日*

2021/08/19

行权日调整*

经调整的下一营业日

期权费支付日*

2021/07/20

执行利率(%)*

62.2000

名义本金(万元)*

8,000

期权价格(bps)*

89.00

Voi(%)Normal

期权费(元)

712000.00

期权清算方式*

双边自行清算

交割方式*

实物交割

期权计算机构*

中国外汇交易中

双边保证金制度

期权补充条款

拒绝

提交

成交

6.15.1.3 历史对话报价信息查询

利率互换期权市场对话报价的历史报价信息，可在 “-信息查询-报价信息查询” 菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-利率期权报价查询】界面，交易方式选择“对话”， 期权品种选择“利率互换期权”， 查看历史的对话报价。

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

期权品种

利率互换期权

利率上限/下限期权

对话报价

期权类型

全部

固定利率支付方期权

固定利率收取方期权

交易方向

全部

买入

卖出

成交状态

全部

成交

未成交

日期

2021/07/19

2021/07/19

导出

导出

交易方向

成交状态

对手方

执行利率(%)

期权价格(bps)

期权合约

对手方交易员

期权类型

期权期限

名义 报价编号

卖出

未成交

中信证券

62.2000

89.00 SWPT_FDR001_1M1YC

黄霄 / 中信证券

固定利率支付方期权

1M

210719061501000003

人民币利率互换期权：共1笔(买入0/卖出1)，0.8亿(买入0/卖出0.8)，净卖出0.8亿

1

1

6.15.2 指示性报价

6.15.1.1 发起报价

1.任意身份下具有“【利率互换期权】市场-对话报价交易执行权限，且同时具有【利率互换】市场对话报价交易执行权限”的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“利率期权”，期权品种选择“利率互换期权”，报价方式选择“指示性”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔利率互换期权指示性报价；其中，【档位】字段可以自定义可选的执行利率档位数，例如【档位】填写 1，则【执行利率】下拉框中将展示 ATM 和上下一档的执行利率；【档位】默认为空，【执行利率】展示所有可报价的执行利率。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

期权品种

☒ 利率互换期权
☐ 利率上限/下限期权

报价方式

☐ 对话
☒ 指示性

买入

卖出

双边

本方* ①

测试机构

期权合约*

SWPT_FDR001_1M1YC

期权类型*

固定利率支付方期权

期权期限*

1M

互换合约*

FDR001_1Y

执行利率 (%) *

3.9000

档位

期权价格 (bps) *

Vol (%) Normal

保存

提交

2、支持批量提交指示性报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“指示性”，期权品种选择“利率互换期权”，点击按钮，可自定义选择需导出 ATM 及上下 N 档的执行利率，默认为上下 1 档。在模板中填写指示性报价数据，点击按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入指示性报价后，选中校验通过的指示性报价，批量提交。

利率互换期权指示性报价导入

2笔报价校验成功, 0笔报价校验失败, 具体提示信息可在对应红色框处或红色感叹号处查看

导入

☒	交易方向*	本方*	期权合约*	执行利率 (%) *	期权价格 (bps) *	Vol (%) Normal	期权类型*	期权期限*	
☒	买入	测试机构	SWPT_FDR001_1M1YC	3.9000	990.00	77.8088	固定利率支付方期权	1M	F
☒	卖出	测试机构	SWPT_FDR001_1M1YC	3.9000	790.00	58.5305	固定利率支付方期权	1M	F

删除 保存 提交

6.15.1.2 指示性报价行情

- 任意身份下具有“【利率互换期权】市场-对话报价交易执行权限，且同时具有【利率互换】市场对话报价交易执行权限”的用户，可以查看【利率互换期权报价行情】。
- 本行情页面可以按照【参考利率】进行筛选，筛选后行情展示该参考利率下的期权合约的报价行情。此外，点击【互换合约】旁的档位按钮，可以查看不同的执行利率档位，点击执行利率旁的档位按钮可以查看期权合约在该执行利率下的深度行情。
- 双击某一档行情的价格时，页面会跳转【利率互换期权-对话报价】的【我要报价】页面，从而转入对话报价流程。
- 用户还可以在行情页面上通过按住 Ctrl 单击鼠标或拖拽鼠标选择多笔档位行情，然后操作 Ctrl+C，系统将打开【利率互换期权-对话报价】导入中间页面，即可批量对指示性报价进行询价。

利率互换期权报价行情															
互换合约		期权期限		报价机构		执行利率档位		报价机构		最新执行利率		ATM			

6.15.1.3 指示性报价管理

报价发送成功后，在【我的报价-衍生品市场-利率期权】界面交易方式选择“指示性”，期权品种选择“利率互换期权”，可查看已经发出的指示性报价，并进行指示性报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换利率期权信用违约互换信用风险缓释凭证债券远期远期利率协议G-Swap

利率互换利率期权利率上限/下限期权||·对报价·指示性报价

期权品种利率互换期权利率上限/下限期权||·对报价·指示性报价

期权类型全部固定利率支付方期权固定利率收取方期权交易方向全部买入卖出本方状态全部待发送有效期权合约

交易方向

本方状态

本方

期权合约

执行利率(%)

期权价格(bps)

Vol(%)Normal

期权类型

期权期限

互换合约

买入

有效

测试机构

SWPT_FDR001_1M1YC

3.9000

990.00

77.8088

固定利率支付方期权

1M

FDR001_1Y

卖出

有效

测试机构

SWPT_FDR001_1M1YC

3.9000

790.00

58.5305

固定利率支付方期权

1M

FDR001_1Y

询价

提交

人民币利率互换期权: 共2笔 (买入1/卖出1)

6.15.1.4 历史指示性报价信息查询

利率互换期权市场指示性报价的历史报价信息，可在“--信息查询--报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-利率期权报价查询】界面，交易方式选择“指示性”，期权品种选择“利率互换期权”，查看历史的指示性报价。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

G-Swap

期权品种

利率互换期权

利率上限/下限期权

 || · 对话报价 · 指示性报价

期权类型

全部

固定利率支付方期权

固定利率收取方期权

交易方向

全部

买入

卖出

日期

2023/02/02

2023/02/02

期权合约

6.15.3 成交查询

对话报价的成交信息，可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-利率期权】界面，期权品种选中“利率互换期权”，查询利率互换期权市场当日及历史的成交明细，可通过界面筛选条件组合查询。

成交查询-衍生品市场

利率互换利率互换成交统计标准债券远期利率期权信用违约互换信用风险缓释凭证债券远期标准利率互换远期利率协议

期权品种利率互换期权利率上限/下限期权对话报价

交易方向全部买入卖出期权类型全部固定利率支付方期权固定利率收取方期权期权合约参考利率日期2023/2/2导出下载成交单

交易方向	对手方	执行利率(%)	期权价值(bps)	期权合约	对手方交易员	期权类型	期权期限	交易方式	名! 期权成交编号
未查询到数据									

总0笔(买入0/卖出0)，0亿(买入0/卖出0)，固定利率支付方期权0亿(买入0/卖出0)，固定利率收取方期权0亿(买入0/卖出0)

K < 1 / 1 > X

6.15.4 成交行情

可点击“--成交行情--利率期权成交行情”菜单路径，打开【利率期权成交行情】菜单

的“逐笔成交”tab 页面，期权品种选中“互换期权”，支持查看利率互换期权对话报价达成的逐笔成交。

当期权品种选中“全部”时，支持同时查看利率互换期权和利率上限/下限期权对话报价达成的逐笔成交。



期权合约	参考利率	期权类型	期权期限	名义本金(万元)	期权价格(bps)	执行利率(%)	Vol(%)Normal	互换合约	互换期限
SWPT_FDR001_1M6MC	FDR001	固定利率支付方期权	1M	100	12.000	2.7000	2.0480	FDR001_6M	6M
SWPT_FDR001_1M6MC	FDR001	固定利率支付方期权	1M	100	12.000	2.7000	2.0480	FDR001_6M	6M
SWPT_FDR001_1M6MC	FDR001	固定利率支付方期权	1M	100	12.000	2.7000	2.0480	FDR001_6M	6M
SWPT_FDR001_1M6MC	FDR001	固定利率支付方期权	1M	100	12.000	2.7000	2.0480	FDR001_6M	6M

6.15.5 当日成交

用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“利率期权”TAB，期权品种选中“利率互换期权”，查看利率互换期权当前交易日的成交汇总数据，可通过界面筛选条件组合查询当日达成的成交。



交易方向	对手方	执行利率(%)	期权价格(bps)	期权合约	对手方交易员	期权类型	期权期限	名义本: 订单/报价编号
未查询到数据								

总0笔(买入0/卖出0), 0亿(买入0/卖出0), 固定利率支付方期权0亿(买入0/卖出0), 固定利率收取方期权0亿(买入0/卖出0)

6.15.6 行权管理

任意身份下具有【利率互换期权】市场的对话报价交易执行权限，或行权权限，或监控权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击“--我的交易--行权管理”菜单路径，打开【行权管理】菜单，包含 3 个 tab 页面，分别为“本方行权”、“对手方行权”和“历史行权记

录查询”；

1、打开菜单页面默认选中“本方行权”TAB 页，本页面默认展示所有本方当日以及未来待行权的记录，以及当日本方已行权的记录；针对行权日为当日的本方待行权记录，交易员首次登录会收到相应的行权提醒，并可以通过点击本 tab 页面相应记录前面的“行权”按钮进行行权；行权成功后，行权状态会更新为“已行权”，并生成对应的行权编号，以及 IRS 成交编号，点击行权编号或 IRS 成交编号，可以打开对应记录的行权单以及行权产生的 IRS 成交单。

利率互换期权-行权管理										
本方行权		对手方行权		历史行权记录查询						
	行权日	行权状态	期权成交编号	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	行权日调整	期权类型	期权期限
行权	2021/09/22	待行权	SWT20210621000060	中信证券	张惠梓	建设银行11	冬瓜一七	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	3M
行权	2023/05/22	待行权	SWT20210621000056	中信证券	张惠梓	建设银行11	冬瓜一七	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1Y11M
行权	2023/08/21	待行权	SWT20210621000062	中信证券	张惠梓	建设银行11	冬瓜一七	经调整的下一营业日	固定利率收取方期权	2Y2M

2、当选中“对手方行权”tab 页，本页面展示本机构作为期权卖方的所有对手方当日及未来待行权的记录，以及当日对手方已行权记录；

利率互换期权-行权管理										
本方行权		对手方行权		历史行权记录查询						
行权日	行权状态	期权成交编号	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	行权日调整	期权类型	期权期限	名义本
2021/08/01	待行权	SWT20210701000056	中信证券	zxzhya	中国银行1	zg	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1M	
2022/05/10	待行权	SWT20210621000055	中信证券	张惠梓	建设银行11	冬瓜一七	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	10M19D	

3、当选中“历史行权记录查询”tab 页，本页面展示所有行权日小于等于当前交易日的历史行权记录，包括历史已行权和不行权的记录；支持通过行权状态、本方、对手方等筛选条件组合查询符合条件的数据；

利率互换期权-行权管理

本方行权 对手方行权 历史行权记录查询

行权状态 全部 待行权 已行权 不行权 本方 本方 对手方 对手方 行权日 2020/07/28 2021/07/27

行权日	行权状态	期权成交编号	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	行权日调整	期权类型	期权期限	名义本
2021/06/23	不行权	SWT20210621000086	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1D	
2021/06/23	不行权	SWT20210621000080	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1D	
2021/07/19	不行权	SWT20210617000021	中信证券	张惠梓	建设银行	冬瓜一七	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1M	
2021/07/20	不行权	SWT20210621000095	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	29D	
2021/07/21	不行权	SWT20210621000087	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1M	
2021/07/21	不行权	SWT20210621000079	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1M	
2021/07/21	不行权	SWT20210621000054	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1M	
2021/07/22	不行权	SWT20210622000004	中信证券	张媛	兴业银行	滕巧	经调整的下一营业日	固定利率支付方期权	1M	

6.15.7 报价团报价

具有交易执行-【利率互换期权】权限的交易员，登录 CIBMTS 客户端，点击菜单【衍生品市场】-【我的交易】-【报价团报价】，选择【利率互换期权】可以进入报价团报价功能。

点击  按钮，导出报价团报价模板，在模板中分别填写对应合约标的及执行利率的

【买入隐含波动率】、【卖出隐含波动率】，然后点击  按钮，导入该文档进行报价团报价。提交后的报价会展示在客户端页面上，界面如下图所示：

报价团报价

利率互换期权利率上限/下限期权

☐ ATM☐ 最新执行利率

导入

导出

	合约标的	期权期限	执行利率(%)	买入(隐含波动率%)	卖出(隐含波动率%)
	LPR1Y_2Y	1M	25.2000		
	LPR1Y_2Y	1Y	25.2000		
	LPR1Y_2Y	2M	25.1000		
	LPR1Y_2Y	3M	25.1000		
	LPR1Y_2Y	6M	25.0000		
	LPR1Y_2Y	9M	25.1000		
	LPR1Y_6M	1M	22.2000		
	LPR1Y_6M	1Y	22.2000		
	LPR1Y_6M	2M	22.1000		
	LPR1Y_6M	3M	22.1000		
	LPR1Y_6M	6M	22.0000		
	LPR1Y_6M	9M	22.1000		
	LPR1Y_3Y	1M	26.2000		

其中，勾选 ☐ ATM 勾选框以及 ☐ 最新执行利率 勾选框，可以筛选 ATM 或最新执行利率对应的报价团报价。

6.15.8 全市场波动率收盘价

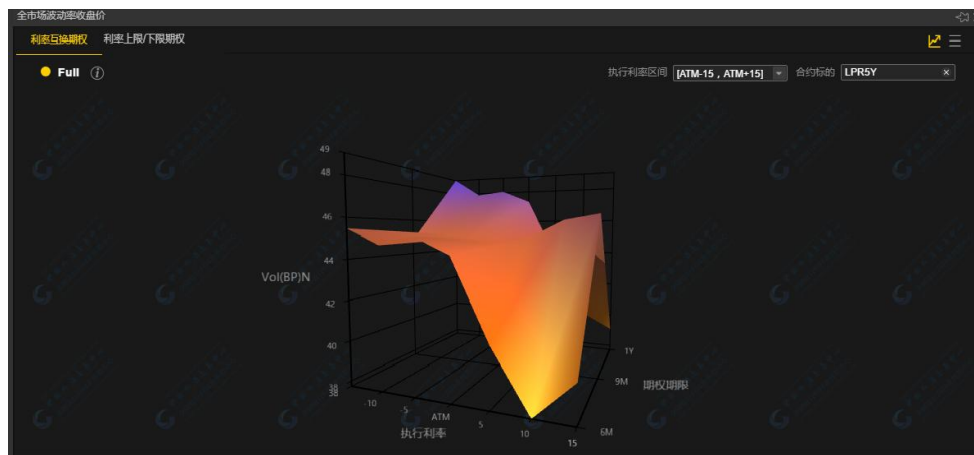
具有交易执行-【利率互换期权】权限的交易员，登录 CIBMTS 客户端，点击菜单【衍生品市场】-【信息查询】-【全市场波动率收盘价】，选择【利率互换期权】可以进入全市场波动率收盘价查询页面。

全市场波动率收盘价						
利率互换期权		利率上限/下限期权				
日期 2021/08/02 - 2021/08/02		导出				
合约标的	期权期限	执行利率(%)	波动率报买(%)	波动率均值(%)	波动率报卖(%)	日期
未查询到数据						

用户可以按照日期进行查询，并可以通过点击 按钮来导出查询结果。

此外，点击页面右上角的  图标，可以查看利率期权波动率曲面图。用户可以选择【执

行利率区间】以及【合约标的】来查看曲面图，其中，曲面图的三个坐标轴分别为期权期限、执行利率、Vol(BP)N。



6.16 衍生品市场-利率上限/下限期权

6.16.1 对话报价

6.16.1.1 发起报价

1、任意身份下具有“【利率上限/下限期权】市场对话报价交易执行”权限的用户登录 CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“对话”，期权品种选择“利率上限/下限期权”填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔利率上下限期权对话报价：

2、也可批量提交对话报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“对话”，期权品种选择“利率上限/下限期权”，点击  按钮，在模板中填写对话报价数据，点击  按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入对话报价后，选中校验通过的对话报价，批量提交。

6.16.1.2 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价-衍生品市场-利率期权】界面交易方式选择“对话”，

期权品种选择“利率上限/下限期权”，可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率互换 标准交割 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 远期利率协议

期权品种 ☐ 利率互换期权 ☒ 利率上限/下限期权 ☐ 对话报价

期权类型 ☒ 全部 ☐ 利率上限 ☐ 利率下限 交易方向 ☒ 全部 ☐ 买入 ☐ 卖出 本方状态 ☒ 待发送 ☐ 已发送 ☐ 待成交

☐ 交易方向	本方状态	对手方	执行利率(%)	期权价格(bps)	期权合约	对手方交易员	期权类型	期权期限	报价编号
☒ 买入	已发送	中信证券	59.1500	99.00	Cap_FDR001_3M	黄菁 / 中信证券	利率上限	3M	210719061601000002

撤销 拒绝 提交 成交

人民币利率上下限期权：共1笔（买入1/卖出0），0.9亿（买入0.9/卖出0），净买入0.9亿

1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击  按钮终止对话报价；或双击对话报价记录打开 iQuote，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击  按钮更新对话报价。

债券市场 货币市场 衍生品市场 一级市场

利率互换 标准债券远期 利率期权 信用违约互换

信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换 远期利率协议

期权品种 ☐ 利率互换期权 ☒ 利率上限/下限期权

报价方式 ☒ 对话

买入

本方* ① 招商银行

对手方* 中信证券

对手方交易员* 黄菁

期权合约 Cap_FDR001_3M

期权类型* 利率上限

参考利率* FDR001

起始日* 2021/07/19

到期日* 2021/10/19

期权期限* 3M

首期起息日* 2021/07/19

执行利率(%)* 59.1500

名义本金(万元)* 9,000

期权价格(bps)* 99.00

Vol(%)Normal

期权费(元) 891000.00

期权费支付日* 2021/07/20

期权清算方式* 双边自行清算

交割方式* 现金交割

双边保证金制度

期权计算机构* 中国外汇交易中

利率(bps)* 0.00

支付周期* 季

重置频率* 天

计息方法* 复利

撤销 提交

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以选中单笔/多笔报价记录，点击  按

钮进行成交，或点击  按钮拒绝成交。也可双击对话报价记录打开 iQuote，直接成交、拒绝、修改交谈要素后进行提交。

债券市场

货币市场

衍生品市场

一级市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

期权品种

利率互换期权

利率上限/下限期权

报价方式

对话

卖出

本方* ①

中信证券

对手方*

招商银行

对手方交易员*

马杰

期权合约

Cap_FDR001_3M

期权类型*

利率上限

参考利率*

FDR001

起始日*

2021/07/19

到期日*

2021/10/19

期权期限*

3M

首期起息日*

2021/07/19

执行利率(%)*

59.1500

名义本金(万元)*

9,000

期权价格(bps)*

99.00

Vol(%)Normal

期权套(元)

891000.00

期权费支付日*

2021/07/20

期权清算方式*

双边自行清算

交割方式*

现金交割

双边保证金制度

期权计算机构*

中国外汇交易中

利率(bps)*

0.00

支付周期*

季

重置频率*

天

计息方法*

复利

拒绝

提交

成交

6.16.1.3 历史对话报价信息查询

利率上下限期权市场对话报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-利率期权报价查询】界面，交易方式选择“对话”，期权品种选择“利率上限/下限期权”，查看历史的对话报价。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换

标准债券远期

利率期权

信用违约互换

信用风险缓释凭证

债券远期

标准利率互换

远期利率协议

期权品种

利率互换期权

利率上限/下限期权

 || · 对话报价

期权类型

全部

利率上限

利率下限

 交易方向

全部

买入

卖出

 成交状态

全部

成交

未成交

 日期

2021/07/19

2021/07/19

 期权合约

</

6.16.2 指示性报价

6.16.1.1 发起报价

1.任意身份下具有“【利率上限/下限期权】市场-对话报价交易执行权限”的用户登录

CIBMTS 客户端，点击右侧  按钮，或通过快捷键 F8 打开【我要报价】界面，选择“利率期权”，期权品种选择“利率上限/下限期权”，报价方式选择“指示性”，填写各类报价要素后，点击  按钮，即可发送一笔利率上限/下限期权指示性报价；其中，【档位】字段可以自定义可选的执行利率档位数。例如【档位】填写 1，则【执行利率】下拉框中将展示 ATM 和上下一档的执行利率；【档位】默认为空，【执行利率】展示所有可报价的执行利率。

衍生品市场

一级市场

×

利率期权

期权品种

☒利率上限/下限期权

报价方式

☐对话
☒指示性

买入

卖出

双边

本方* ①

测试机构

🔍

期权合约*

Cap_FDR001_1M

🔍

期权类型*

利率上限

▼

期权期限*

1M

参考利率*

FDR001

执行利率 (%) *

6.8000

▼

档位

8

期权价格 (bps) *

99.00

Vol (%) Normal

113.8578

保存

提交

2、也可批量提交指示性报价。打开【我的报价】界面（“—我的交易—我的报价—衍生品市场”路径下打开），交易方式选择“指示性”，期权品种选择“利率上限/下限期权”，点击按钮，可自定义选择需导出 ATM 及上下 N 档的执行利率，默认为上下 1 档。在模板中填写指示性报价数据，点击按钮（或在【我要报价】界面点击“批量导入”）导入指示性报价后，选中校验通过的指示性报价，批量提交。

利率上下限期权指示性报价导入

☐

交易方向*

本方*

期权合约*

执行利率 (%) *

期权价格 (bps) *

Vol (%) Normal

期权类型*

导入

未查询到数据

删除

保存

提交

6.16.1.2 指示性报价行情

1. 任意身份下具有“【利率上限/下限期权】市场-对话报价交易执行权限”的用户，可以查看【利率上限/下限期权报价行情】。
2. 本行情页面可以按照【参考利率】进行筛选，筛选后行情展示该参考利率下的期权合约的报价行情。此外，点击【期限】旁的档位按钮, 可以查看不同的执行利率档位，点击执行利率旁的档位按钮可以查看期权合约在该执行利率下的深度行情。
3. 双击某一档行情的价格时，页面会跳转【利率上限/下限期权-对话报价】的【我要报价】页面，从而转入对话报价流程。
4. 用户还可以在行情页面上通过按住 Ctrl 单击鼠标或拖拽鼠标选择多笔档位行情，然后操作 Ctrl+C，系统将打开【利率上限/下限期权-对话报价】导入中间页面，即可批量对指示性报价进行询价。

利率上/下限期权报价行情

LPR1Y

期限

执行利率档位

0

报价机构

☐ 最新执行利率

☐ ATM

利率上限								利率下限							
买入				卖出				买入				卖出			
	期限	报买方	Vol(%) Normal(买)	期权买价 (bps)	期权卖价 (bps)	Vol(%) Normal(卖)	报卖方	执行利率(%)	报买方	Vol(%) Normal(买)	期权买价 (bps)	期权卖价 (bps)	Vol(%) Normal(卖)	报卖方	
≡	6M	浦发银行香港分行		99.00				1.2000	浦发银行香港分行		97.00				
≡	9M	浦发银行香港分行		92.00				1.2000	浦发银行香港分行		90.00				
≡	1Y	浦发银行香港分行		94.00				1.2000	浦发银行香港分行		92.00				

6.16.1.3 指示性报价管理

报价发送成功后，在【我的报价-衍生品市场-利率期权】界面交易方式选择“指示性”，期权品种选择“利率上限/下限期权”，可查看已经发出的指示性报价，并进行指示性报价管理。

我的报价-衍生品市场

利率期权

期权品种 利率上限/下限期权 对货报价 指示性报价 导入 导出 下载模板

期权类型 全部 利率上限 利率下限 交易方向 全部 买入 卖出 本方状态 全部 待发送 有效 期权合约 参考利率

	交易方向	本方状态	本方	期权合约	执行利率(%)	期权价值(bps)	Vol(%)Normal	期权类型	期权期限	参考利率	报价来源
☐	买入	有效	测试机构	Cap_FDR001_1M	6.8000	99.00	113.8578	利率上限	1M	FDR001	客户端

撤销 提交

人民币利率上下限期权: 共1笔 (买入1/卖出0)

对于状态为“待发送”、“有效”的指示性报价，可以选中单笔/多笔指示性报价，点击按钮终止指示性报价；或双击指示性报价记录打开 iQuote，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击按钮更新指示性报价。

6.16.1.4 历史指示性报价信息查询

利率上限/下限期权市场指示性报价的历史报价信息，可在“-信息查询-报价信息查询”菜单路径下，打开【报价信息查询-衍生品市场-利率期权报价查询】界面，交易方式选择“指示性”，期权品种选择“利率上限/下限期权”，查看历史的指示性报价。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换 标准债券远期 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换 远期利率协议 G-Swap

期权品种 ☒ 利率互换期权 ☐ 利率上限/下限期权 ☐ 对话报价 ☐ 指示性报价

期权类型 ☒ 全部 ☐ 固定利率支付方期权 ☐ 固定利率收取方期权 交易方向 ☒ 全部 ☐ 买入 ☐ 卖出 日期 2023/02/02 - 2023/02/02 期权合约

交易方向	本方状态	本方	期权合约	执行利率 (%)	期权价格(bps)	Vol(%)Normal	期权类型	期权期限	互换合约
买入	撤销	测试机构	SWPT_FDR001_1M1YC	3.9000	990.00	77.8088	固定利率支付方期权	1M	FDR001_1Y
卖出	撤销	测试机构	SWPT_FDR001_1M1YC	3.9000	790.00	58.5305	固定利率支付方期权	1M	FDR001_1Y

人民币利率互换期权: 共2笔 (买入1/卖出1)

K < 1 / 1 > X

6.16.3 成交查询

对话报价的成交信息，可在“-信息查询-成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-利率期权】界面，期权品种选中“利率上限/下限期权”，查询利率上限/下限期权市场当日及历史的成交明细，可通过界面筛选条件组合查询。

成交查询-衍生品市场

利率互换 利率互换成交统计 标准债券远期 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换 远期利率协议

期权品种 ☐ 利率互换期权 ☒ 利率上限/下限期权 ☐ 对话报价

交易方向 ☒ 全部 ☐ 买入 ☐ 卖出 期权类型 ☒ 全部 ☐ 利率上限 ☐ 利率下限 期权合约 参考利率 日期 2021/07/14 - 2021/07/14

☐	交易方向	对手方	执行利率(%)	期权价格(bps)	期权合约	对手方交易员	期权类型	期权期限	交易方式	名: 成交编号
未查询到数据										

总0笔(买入0/卖出0), 0亿(买入0/卖出0), 利率上限0亿(买入0/卖出0), 利率下限0亿(买入0/卖出0)

K < 1 / 1 > X

6.16.4 成交行情

可点击“-成交行情-利率期权成交行情”菜单路径，打开【利率期权成交行情】菜单的“逐笔成交”tab 页面，期权品种选中“上限/下限期权”，支持查看利率上限/下限期权对话报价达成的逐笔成交。

当期品种选中“全部”时，支持同时查看利率互换期权和利率上限/下限期权对话报价达成的逐笔成交。



6.16.5 当日成交

用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“利率期权”TAB，期权品种选中“利率上限/下限期权”，查看利率上限/下限期权当前交易日的成交汇总数据，可通过界面筛选条件组合查询当日达成的成交。



6.16.6 报价团报价

具有交易执行-【利率上下限期权】权限的交易员，登录 CIBMTS 客户端，点击菜单【衍生品市场】-【我的交易】-【报价团报价】，选择【利率上限/下限期权】可以进入报价团报价功能。点击按钮，导出报价团报价模板，在模板中分别填写对应合约标的及执行利率的【买入隐含波动率】、【卖出隐含波动率】，然后点击按钮，导入该文档进行报价团报价。提交后的报价会展示在客户端页面上，界面如下图所示：

报价团报价

利率互换期权 利率上限/下限期权

☐ ATM ☐ 最新执行利率

	合约标的	期权期限	执行利率(%)	买入(隐含波动率%)	卖出(隐含波动率%)
🏠	LPR1Y_2Y	1M	25.2000		
🏠	LPR1Y_2Y	1Y	25.2000		
🏠	LPR1Y_2Y	2M	25.1000		
🏠	LPR1Y_2Y	3M	25.1000		
🏠	LPR1Y_2Y	6M	25.0000		
🏠	LPR1Y_2Y	9M	25.1000		
🏠	LPR1Y_6M	1M	22.2000		
🏠	LPR1Y_6M	1Y	22.2000		
🏠	LPR1Y_6M	2M	22.1000		
🏠	LPR1Y_6M	3M	22.1000		
🏠	LPR1Y_6M	6M	22.0000		
🏠	LPR1Y_6M	9M	22.1000		
🏠	LPR1Y_3Y	1M	26.2000		

其中，勾选  ATM 勾选框以及  最新执行利率 勾选框，可以筛选 ATM 或最新执行利率对应的报价团报价。

6.16.7 全市场波动率收盘价

具有交易执行-【利率上下限期权】权限的交易员，登录 CIBMTS 客户端，点击菜单【衍生品市场】-【信息查询】-【全市场波动率收盘价】，选择【利率上下限期权】可以进入全市场波动率收盘价查询页面。

全市场波动率收盘价

利率互换期权 利率上限/下限期权

日期 2021/02/02 - 2021/08/02

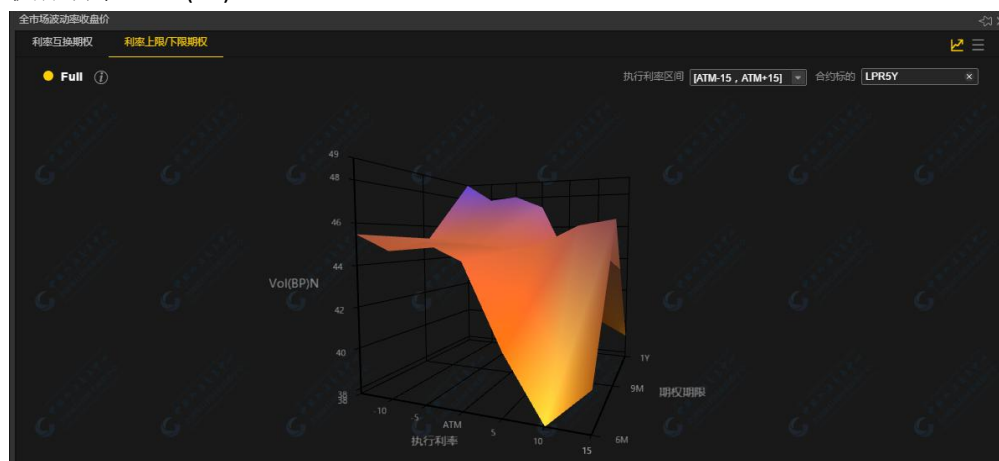
	合约标的	期权期限	执行利率(%)	波动率报买(%)	波动率均值(%)	波动率报卖(%)	日期
	FDR007	1M	2.5500	25.8000	30.0000	44.5800	2021/02/18
	FDR007	1Y	2.8000	15.5800	48.8700	99.0000	2021/02/18
	FDR001	3M	2.3000	12.0000	11.0000	22.0000	2021/02/07
	FDR007	9M	2.1000	13.0000	14.0000	55.0000	2021/02/07
🏠	FDR001	1Y	31.0000	22.0000	31.0000	51.0000	2021/02/05
	FDR001	1Y	2.2000	12.0000	21.0000	11.0000	2021/02/05

1 / 1 共5页

用户可以按照日期进行查询，并可以通过点击  导出 按钮来导出查询结果。

此外，点击页面右上角的  图标，可以查看利率期权波动率曲面图。用户可以选择【执行利率区间】以及【合约标的】来查看曲面图，其中，曲面图的三个坐标轴分别为 **期权期限**、

执行利率、Vol(BP)N。



6.17 衍生品市场-G-Swap

6.17.1 对话报价

6.17.1.1 发起报价

任意身份下具有“【G-Swap】市场-对话报价交易执行权限”的用户登录 CIBMTS 客户端，点击左侧“功能列表”按钮，可打开【G-Swap 报价】界面。

在【G-Swap 报价】界面中，可根据实际业务需要，决定是否填写“交易方向说明”、“名义本金(万)”和“本方托管账户”等字段，以及是否需要上传附件。

此外，“交易要素确认单名称”为必填，可以通过选择交易中心提供的模板自动带出，也可以自行选择“交易要素确认单名称”，并在添加“自定义交易要素”后保存为当前机构的模板。

“自定义交易要素”可通过三种方式添加：

1. 【G-Swap 报价】界面左侧为交易中心提供的交易要素，可通过点击添加
2. 可通过单击 **+ 添加自定义交易要素** 进行添加，然后输入交易要素名等信息
3. 可通过填写 **下载自定义模板** 下载的模板后，通过 **导入自定义模板** 进行导入

选“挂钩标的”之后，可通过点击“提交”，完成报价发送。

首页

+

	货币市场	债券市场	衍生品市场
公开报价	报价行情	综合报价	X-Swap利率互换聚合行情
	存单路演	活跃券报价	X-Swap利率互换实时承接
		优选报价	X-Swap普通利率互换
		热点关注券	X-Swap专属报价行情
		X-Bond报价	X-Swap标准利率互换
		债券借贷报价	X-Swap标准债券远期
		债券路演	CDS双向报价行情
		X-Auction报价行情	
		南向通指示性报价行情	
成交行情	实时行情	综合成交	利率互换成交行情
	历史行情	活跃券成交	标准利率互换成交行情
		X-Bond成交	标准债券远期成交行情
		债券借贷成交行情	债券远期成交行情
		预发行成交行情	信用风险缓释凭证成交行情
			信用违约互换成交行情
			利率期权成交行情
我的交易	我的报价	我的报价	我的报价
	担保品调整	我的订单	X-Swap订单
	当日成交	担保品调整	G-Swap报价
	回购违约处置	交易分仓	交易分仓
		当日成交	当日成交
		X-Auction报价管理	清算方式变更
		X-Lending订单	报价团报价
		X-Bargain	行权管理

G-Swap

可通过点击以下菜单，添加自定义交易要素至模板生成区

基本条款

交易日期

起息日

到期日

名义本金 (万元)

挂构标的

结算日

估值基准

估值日

期初价格

期末价格

营业日

营业日准则

计息机构

结算币种

支付条款

信用事件条款

交易方向

买入

卖出

交易方向说明

如有必要，可在此填写买入和卖出方向的具体含义

名义本金(万)

名义本金(万)

*本方

中国银行

*对手方

建设银行

*对手方交易员

赵今麦

*本方资金账号

符号设置符号银行/luhaoshezhi/123456

本方托管账户

输入格式为：上海所：托管账号 | 托管账户名称；国债登：托管账号

模板搜索

下载自定义模板

模板名称

保存模板

删除模板

*交易要素确认单名称

CFETS碳中和指数交易确认单

挂构标的

*已选挂构标的列表

添加附件

附件支持格式：pdf、jpg、png、bmp、jpeg，附件大小：小于2M

模板生成区（可通过表格左侧按钮进行拖拽）

添加自定义交易要素

导入自定义模板

交易要素名	交易要素定义	交易要素值

未查询到数据

保存

提交

重置

6.17.1.2 自定义模板管理

在【G-Swap 报价】界面，同样可以对自定义模板进行管理，可进行的操作有：新增模板，另存为模板，修改已有模板以及删除已有模板。

新增模板：选择正确的“交易要素确认单名称”、以及在下方“模板生成区”添加完成“自定义交易要素”之后，在“模板名称”中输入想要保存的模板名字，点击“保存模板”按钮，即可新增一个模板。

另存为模板：在“模板搜索”中选择一个已有模板，修改“模板名称”（以及“交易要素确认单名称”和/或“自定义交易要素”）后点击“保存模板”，即可将原模板另存为一个新模板。

修改已有模板：在“模板搜索”中选择一个已有模板，修改“交易要素确认单名称”和/或“自定义交易要素”后点击“保存模板”，即可完成修改已有模板。

删除已有模板：在“模板搜索”中选择一个已有模板，点击“删除模板”，即可对该模板完成删除操作。

6.17.1.3 对话报价管理

报价发送成功后，在【我的报价-衍生品市场-G-Swap】界面可查看已经发出的对话报价，并进行对话报价管理。



1. 对于状态为“已发送”的对话报价，可以选中单笔/多笔对话报价，点击  按钮终止对话报价；或双击对话报价记录打开【G-Swap 报价】，直接进行撤销报价或修改部分报价要素后，点击  按钮更新对话报价。

2. 对于状态为“待成交”的对话报价，可以双击打开报价记录，点击 **成交** 按钮进行成交，或点击 **拒绝** 按钮拒绝成交。

G-Swap

可通过点击以下菜单，添加自定义交易要素至模板生成区

- 基本条款
- 支付条款
- 信用事件条款

交易方向: **买入** **卖出** 交易方向说明: 如有必要，可在此填写买入和卖出方向的具体含义

名义本金(万):

*本方: *对手方: *对手方交易员:

*本方资金账号: ☒ 本方托管账户

模板搜索:

模板名称:

*交易要素确认单名称:

挂构标的:

*已选挂构标的列表:

模板生成区 (可通过表格左侧按钮进行拖拽)

交易要素名	交易要素定义	交易要素值
交易日	交易当天的日期	
起息日		2022/09/19

拒绝 **成交**

6.17.1.3 历史对话报价信息查询

G-Swap 市场对话报价的历史报价信息，可在“**信息查询**—**报价信息查询**”菜单路径下，打开【**报价信息查询-衍生品市场-G-Swap**】界面，查看历史的对话报价。

报价信息查询-衍生品市场

利率互换 标准债券远期 利率期权 信用违约互换 信用风险缓释凭证 债券远期 标准利率互换 远期利率协议 **G-Swap**

本方交易员: 对手方: 本方方向: **全部** **买入** **卖出** 挂构标的: 成交状态: **全部** **已成交** **未成交** 日期: 2022/08/03 — 2022/09/01

报价编号	交易方向	报价状态	成交状态	挂构标的	名义本金(万)	本方	本方交易员	对手方	对手方机构
220816062001000005	卖出	撤销	未成交	zlyqz1 zll企业...	1000	中国银行	杨敏生	建行香港	建设银行
220815062001000005	买入	过期	未成交	CFETS银行间...	100	中国银行	白娟	建设银行	建设银行
220812062001003449	卖出	撤销	未成交	上市前1215 上...	-	中国银行	中银男一	建设银行	建设银行
220812062001003452	卖出	过期	未成交	zlyqz1 zll企业...	-	中国银行	中银男一	建设银行	建设银行
220812062001003453	卖出	撤销	未成交	CFETS银行间...	-	中国银行	中银男一	建设银行	建设银行
220812062001003450	卖出	拒绝	未成交	zlyp1 zll央票	-	中国银行	中银男一	建设银行	建设银行
220812062001003451	卖出	拒绝	未成交	上市前1215 上...	-	中国银行	中银男一	建设银行	建设银行
220812062001003448	买入	成交	成交	CFETS银行间...	-	中国银行	中银男一	建设银行	建设银行

K < 1 / 1 > X

6.17.2 成交查询

对话报价的成交信息，可在“--信息查询--成交查询”菜单路径下，打开【成交查询-衍生品市场-G-Swap】界面，查询 G-Swap 市场当日及历史的成交明细，可通过界面筛选条件组合查询，并可双击打开成交单预览。

成交查询-衍生品市场

利率互换利率互换成交统计标准债券远期利率期权信用违约互换信用风险缓释凭证债券远期标准利率互换远期利率协议G-Swap

本方

对手方

挂标的

交易方向全部买入卖出

日期2022/08/012022/09/01

导出下载成交单

成交编号	交易方向	本方	本方交易员	对手方	对手方交易员	对手方机构	本方代理机构	对手方代理机构	挂
GS20220823300001	卖出	中国银行	中银男一	东方证券	牛雪帆	东方证券			上
GS20220820300002	卖出	中国银行	中银男一	东方证券	牛雪帆	东方证券			上
GS20220818300004	卖出	中国银行	白娟	建设银行	胡施聪	建设银行			C
GS20220817300009	买入	中国银行	王天贝	建设银行	任静	建设银行			上
GS20220812303103	买入	中国银行	中银男一	建设银行	高珏	建设银行			C
GS20220812303102	买入	中国银行	中银男一	建设银行	高珏	建设银行			C

共6笔 (买入3笔/卖出3笔) , 0.3亿 (买入0亿/卖出0.3亿)

<1>

1

>

6.17.3 当日成交

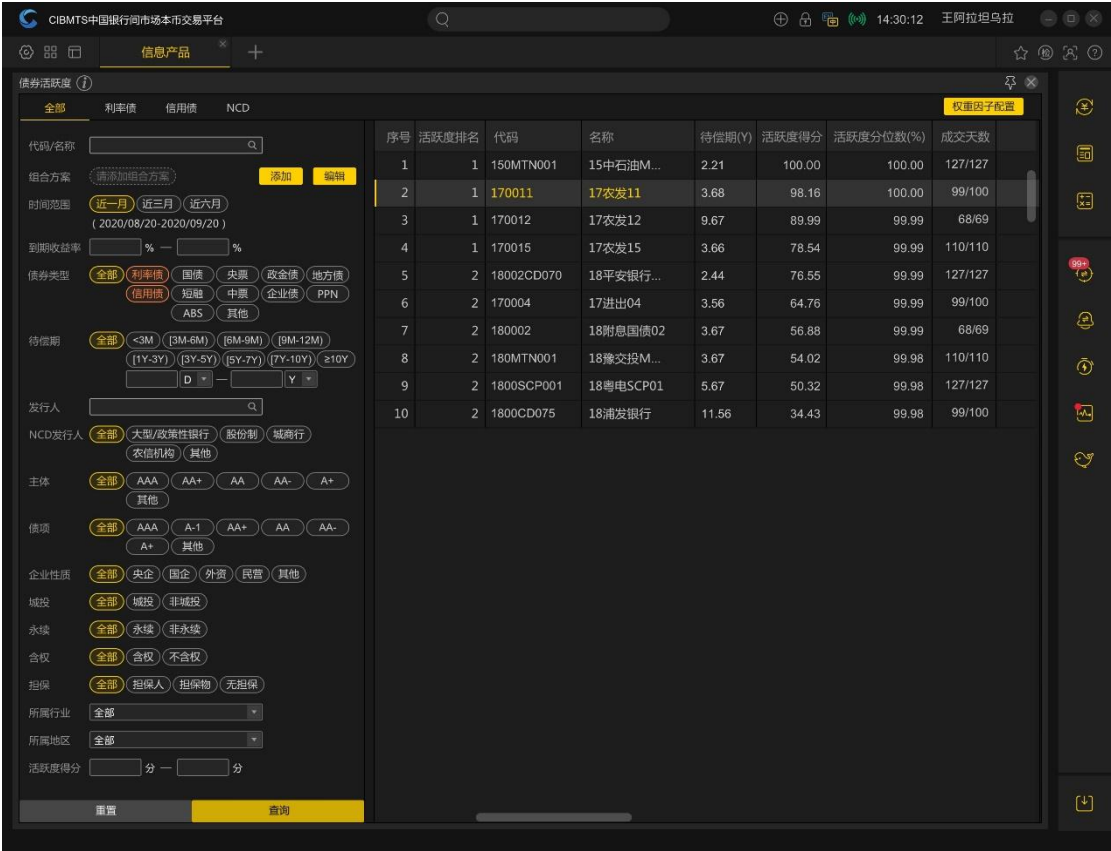
用户点击“--我的交易--当日成交”菜单路径，打开【当日成交】界面，选择“G-Swap”TAB，可通过界面筛选条件组合查询当日达成的成交。

当日成交							
利率互换		标准债券远期		利率期权		信用违约互换	
信用风险缓释凭证		债券远期		标准利率互换		G-Swap	
对手方		交易方向		全部		买入	
卖出		日期		2022/08/01		2022/09/01	
交易方向	本方	对手方	对手方交易员	成交编号	成交时间	挂标的	成交状态
买入	中国银行	建设银行	赵今麦	GS20220901300001	2022/09/01 15:21:59	CFETS银行间绿色债...	正常

7 债券活跃度及 iData

7.1 债券活跃度

用户可登录 CIBMTS 客户端在“--信息查询--债券活跃度”菜单路径下，打开【债券活跃度-债券市场】界面，查看当日债券活跃度信息。



债券活跃度产品纳入现券成交、X-Bond 报价、做市报价和货币经纪报价等 4 大类数据源，提炼了 13 个活跃度因子，用户可根据个人偏好设置具体的活跃度因子及权重，权重因子配置总值为 100。

权重因子配置

成交天数	10.0	%	成交笔数	10.0	%
换手率	10.0	%	流通量	10.0	%
交易机构数	10.0	%	成交量	5.0	%
X-Bond报价天数	2.5	%	X-Bond报价笔数	5.0	%
做市报价天数	5.0	%	做市报价机构数	10.0	%
货币经纪双边报价天数	10.0	%	货币经纪双边报价笔数	10.0	%
是否关键期限	2.5	%	合计	100	%

重置

取消

确认

7.2 iData

用户可登录 CIBMTS 客户端在“--信息查询--iData”路径下双击调起“互联网数据信息服务系统”。

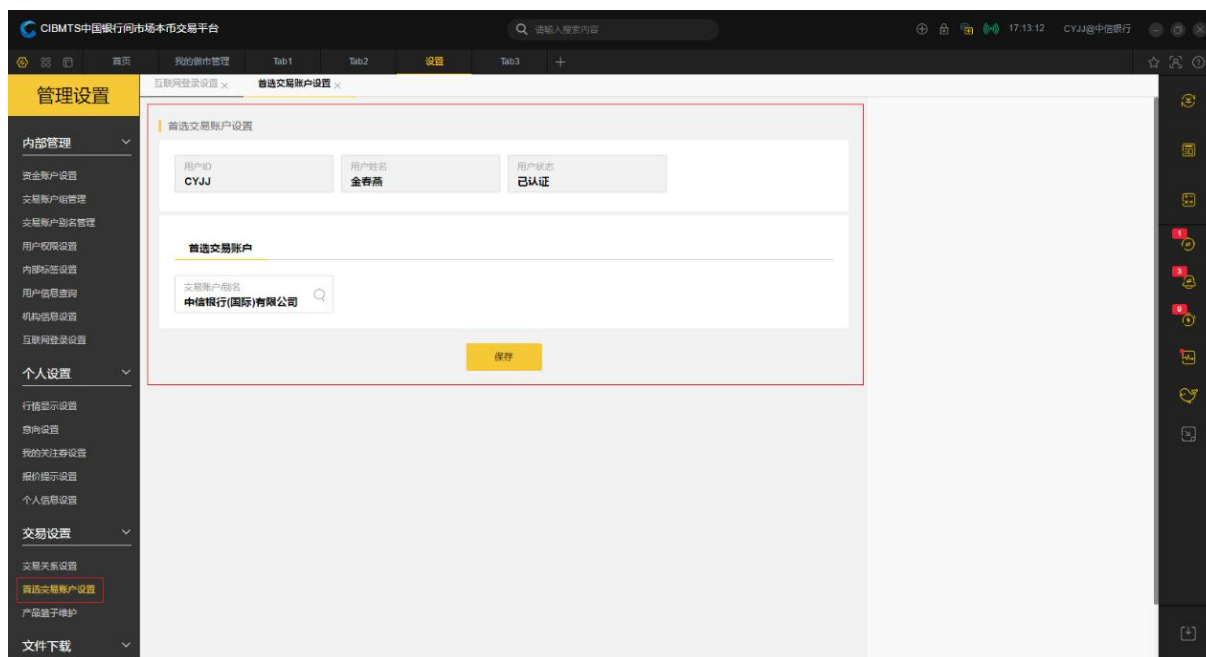
8 交易设置功能

用户可通过交易设置功能，完成首选交易账户、产品篮子、机构群组、限额管理、对手方管理、货币小助手以及衍生品交易参数的维护。

8.1 首选交易账户设置

用户可设置首选交易账户，也可以对其交易接口参数进行设置。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“首选交易账户设置”进入。



1. 首选交易账户

用户可以设置首选交易账户，在各报价界面将默认显示设置的首选交易账户。



现券买卖

报价方式

☐ X-Bond
☐ 做市
☐ 指示性
☐ 请求
☐ 意向
☒ 对话

买入

卖出

代码*

名称*

待偿期

估值

主体资质

本方*

中国平安保险

对手方*

对手方交易员*

清算速度*

清算日

净价(元)*

到期收益率(%)

券面总额(万元)*

结算方式*

券款对付

清算类型*

全额清算

内部标签 (仅本方可见)

保存

提交

2. 交易接口参数设置

具有交易接口权限的用户如需通过交易接口进行交易，可切换到“交易接口参数设置”界面，勾选需要通过交易接口完成交易的功能点，点击【保存】按钮后完成。

用户个人设置

用户个人设置

用户ID
zhaopan

用户姓名

用户状态
未认证/未确认

首选交易账户

交易接口参数设置

接口权限

交易执行

质押式回购

询价

意向报价

对话报价

现券买卖

询价

意向报价

对话报价

点击成交

保存

8.2 产品篮子维护

资产管理人可以维护产品篮子，可分别维护现券买卖市场、质押式回购市场和利率互换市场产品篮子，供发送 Pre-alloc 请求报价时便捷选择。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“产品篮子维护”进入。

CIEMTS中国银行间市场本币交易平台

管理设置

产品篮子维护

质押式回购 现券买卖 利率互换

产品篮子名称

产品名称

查询

批量删除

下载模板

导入

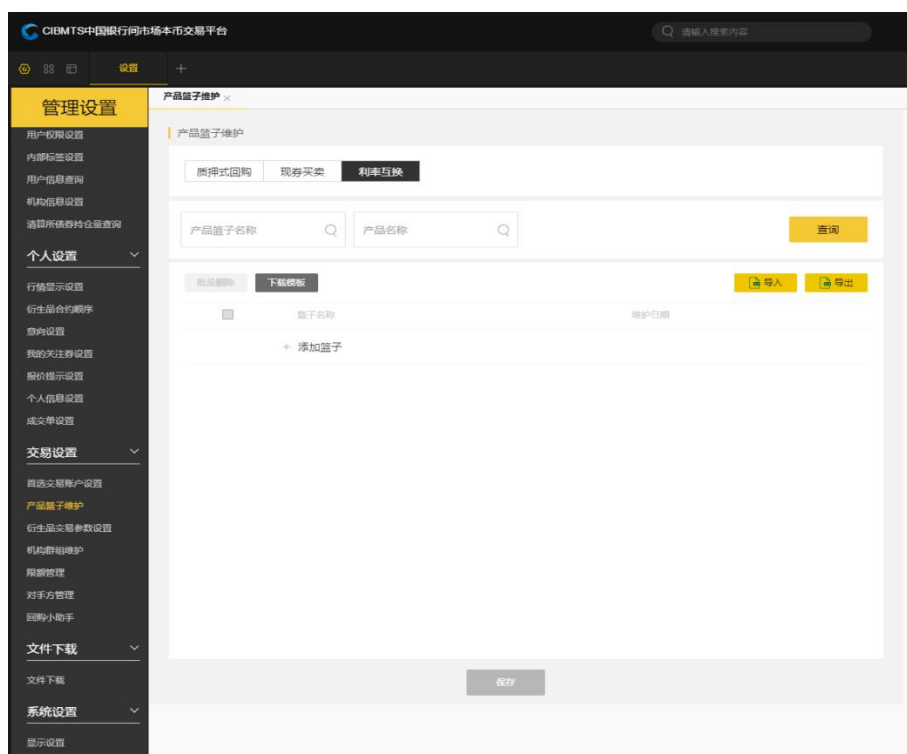
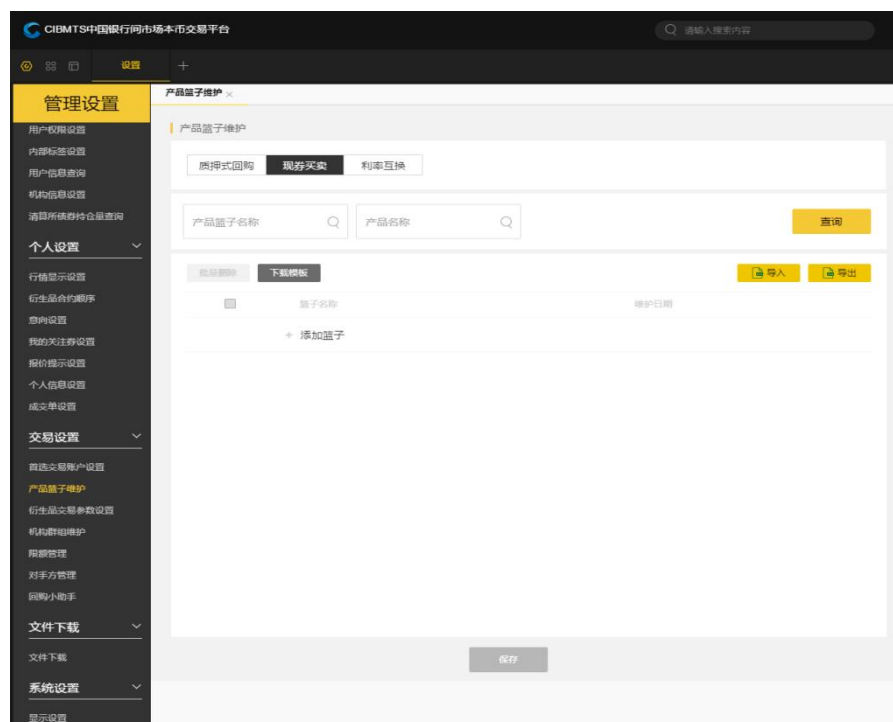
导出

篮子名称

维护日期

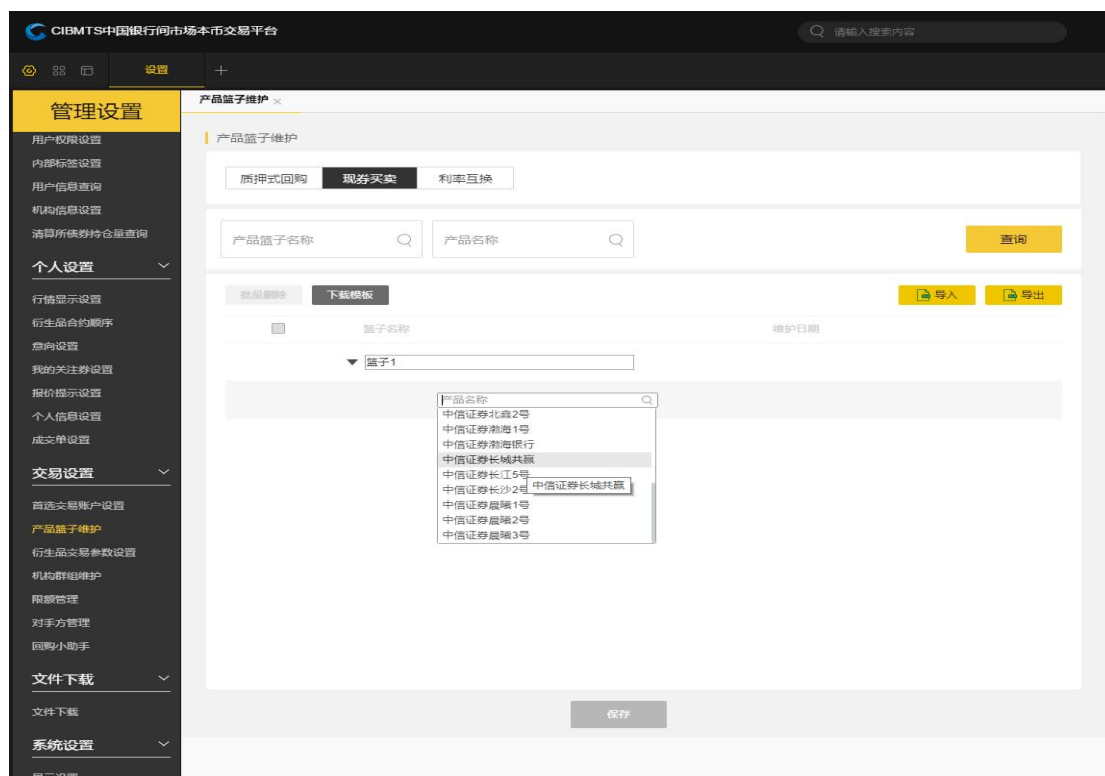
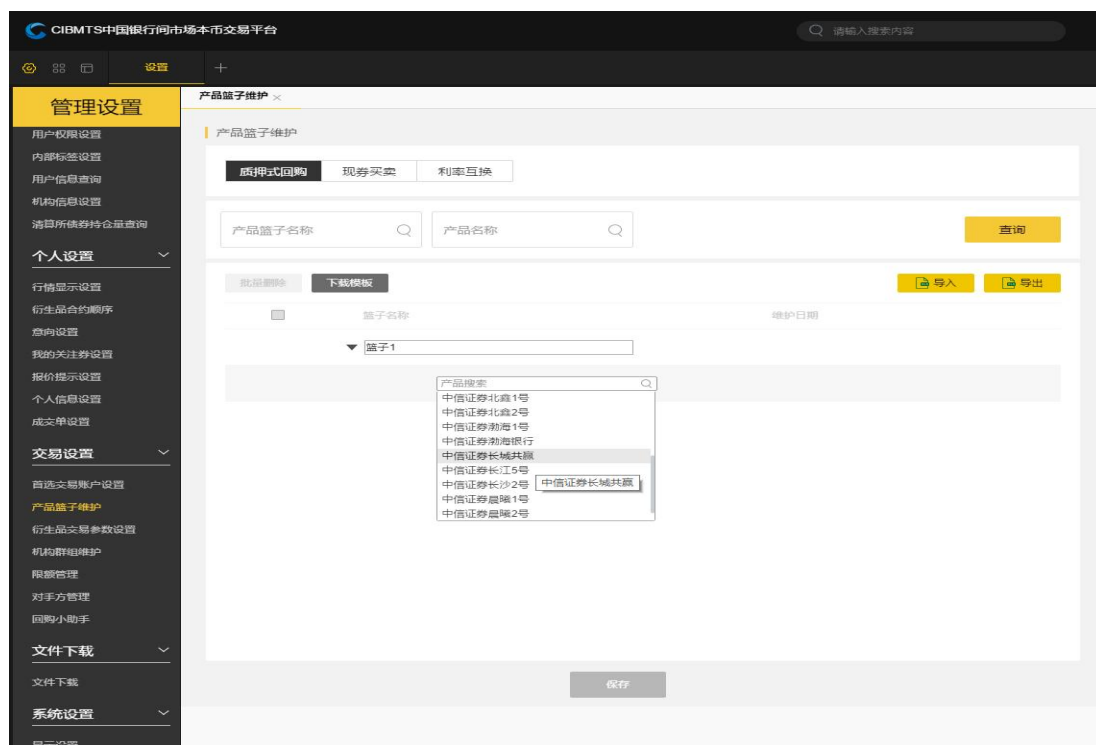
+ 添加篮子

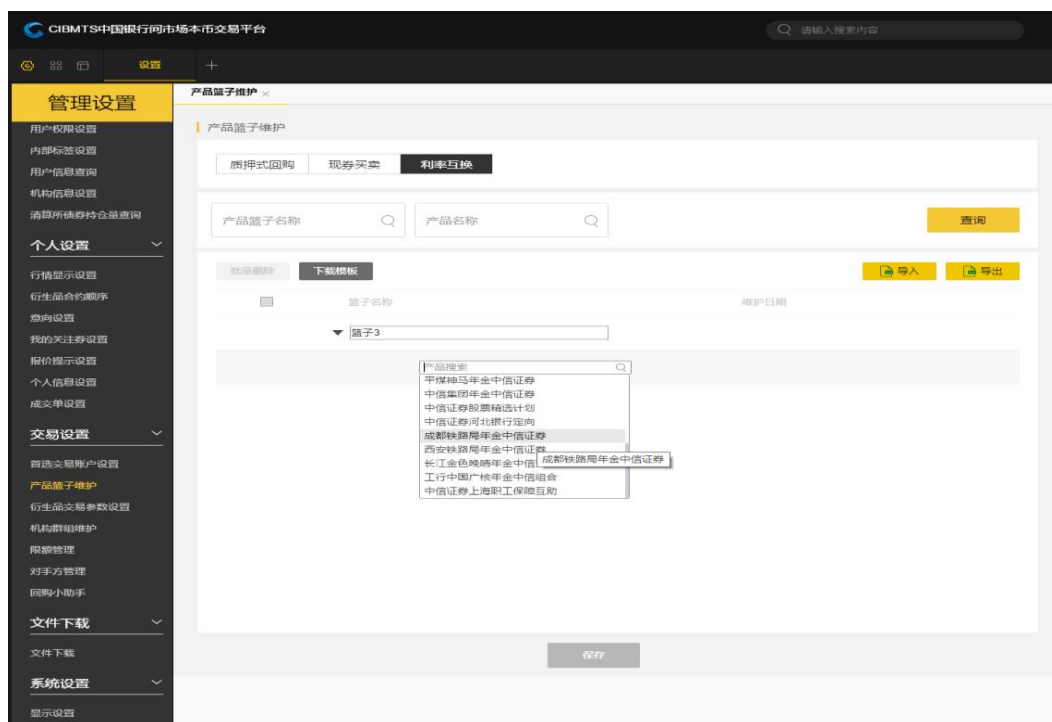
保存



1. 通过界面添加、管理产品篮子

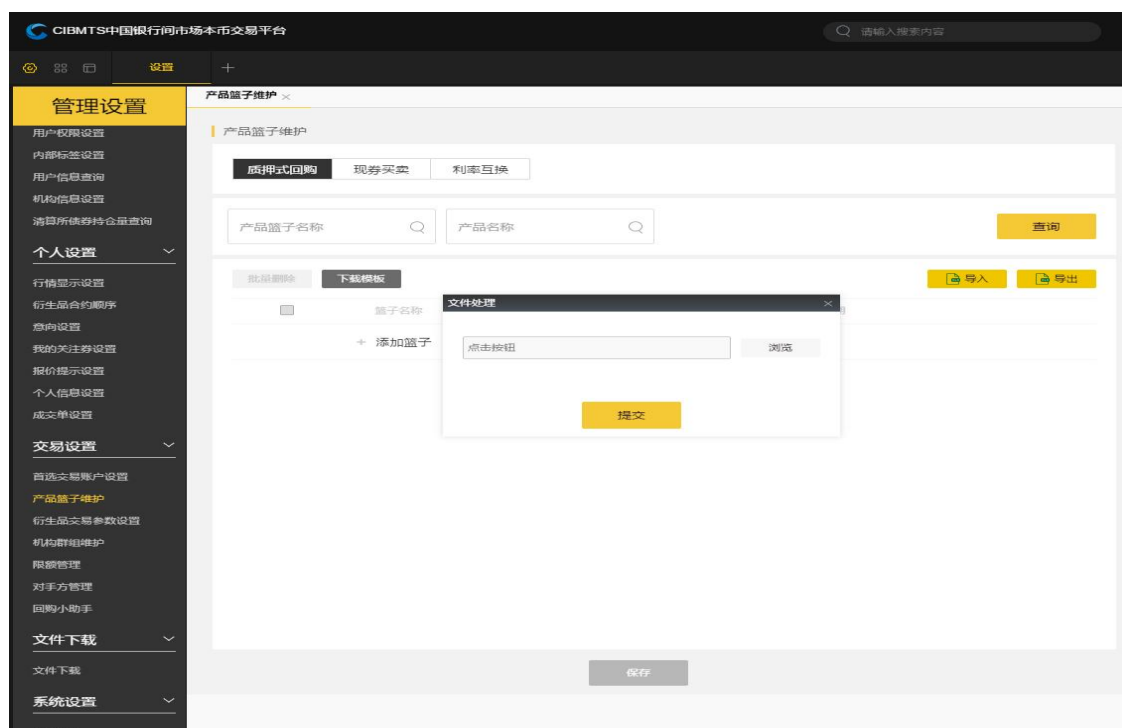
点击“添加篮子”新建一个产品篮子，填写篮子名称，并在篮子下逐一添加产品；也可修改、删除篮子和篮子里的产品。

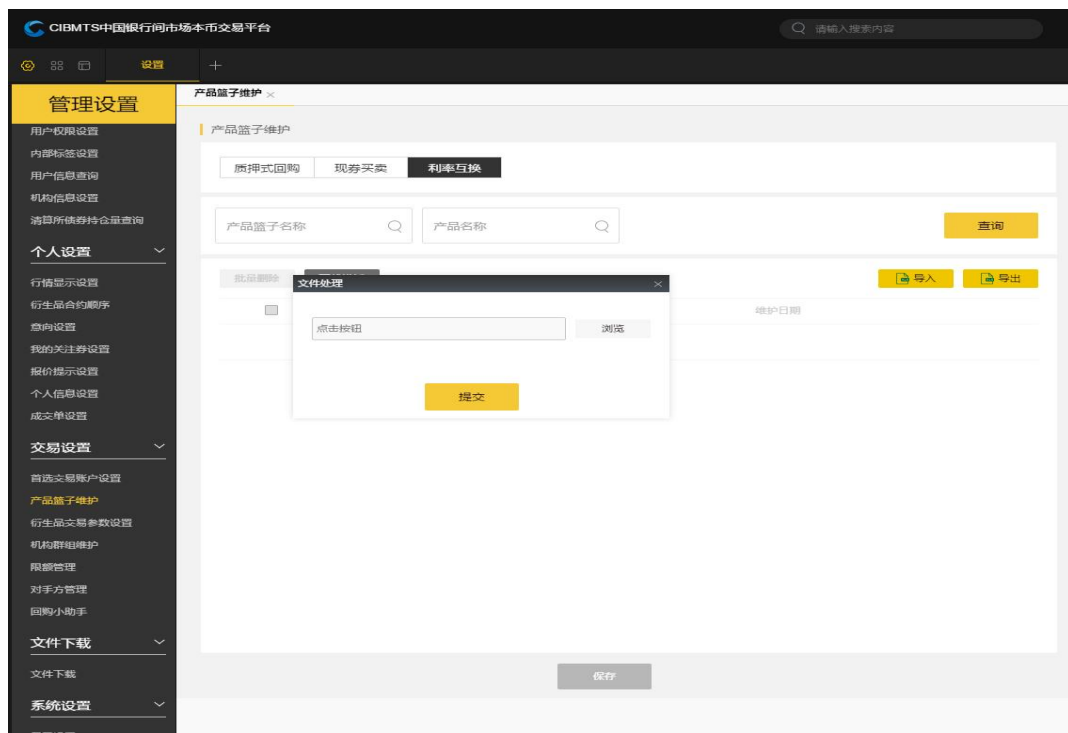
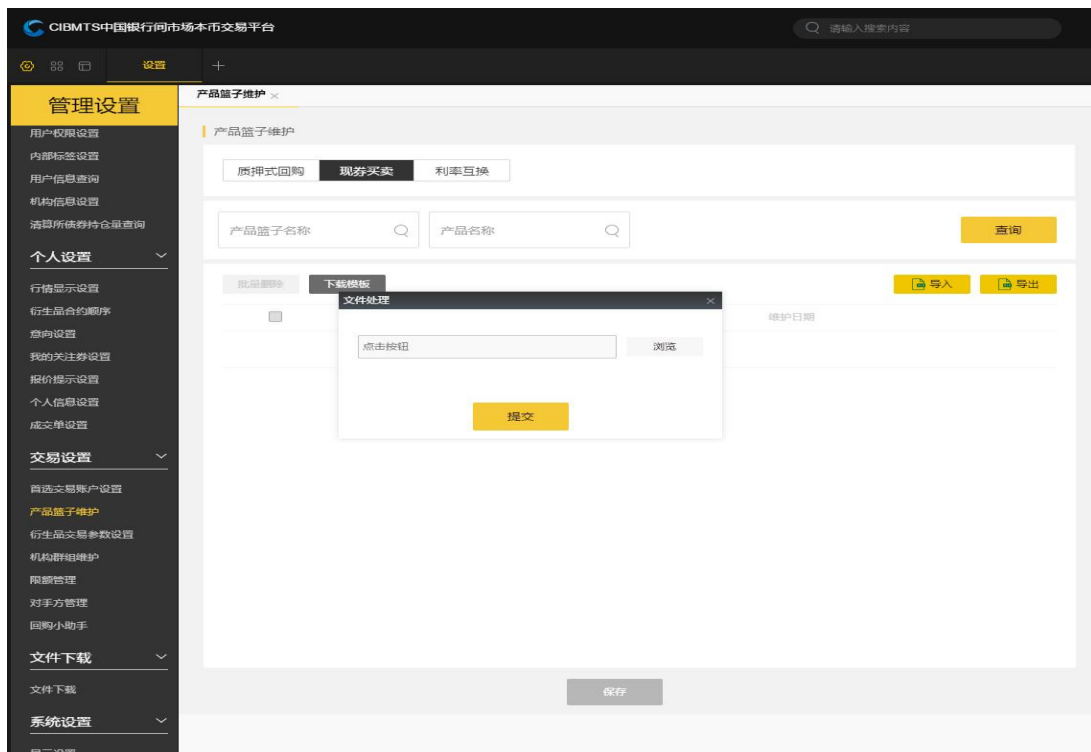




2. 通过 excel 批量导入产品篮子

点击 **下载模板** ，在模板中填写新增篮子名称和产品名称后可批量导入，支持新增篮子及产品导入和对已有篮子新增导入新的产品，点击提交后导入。

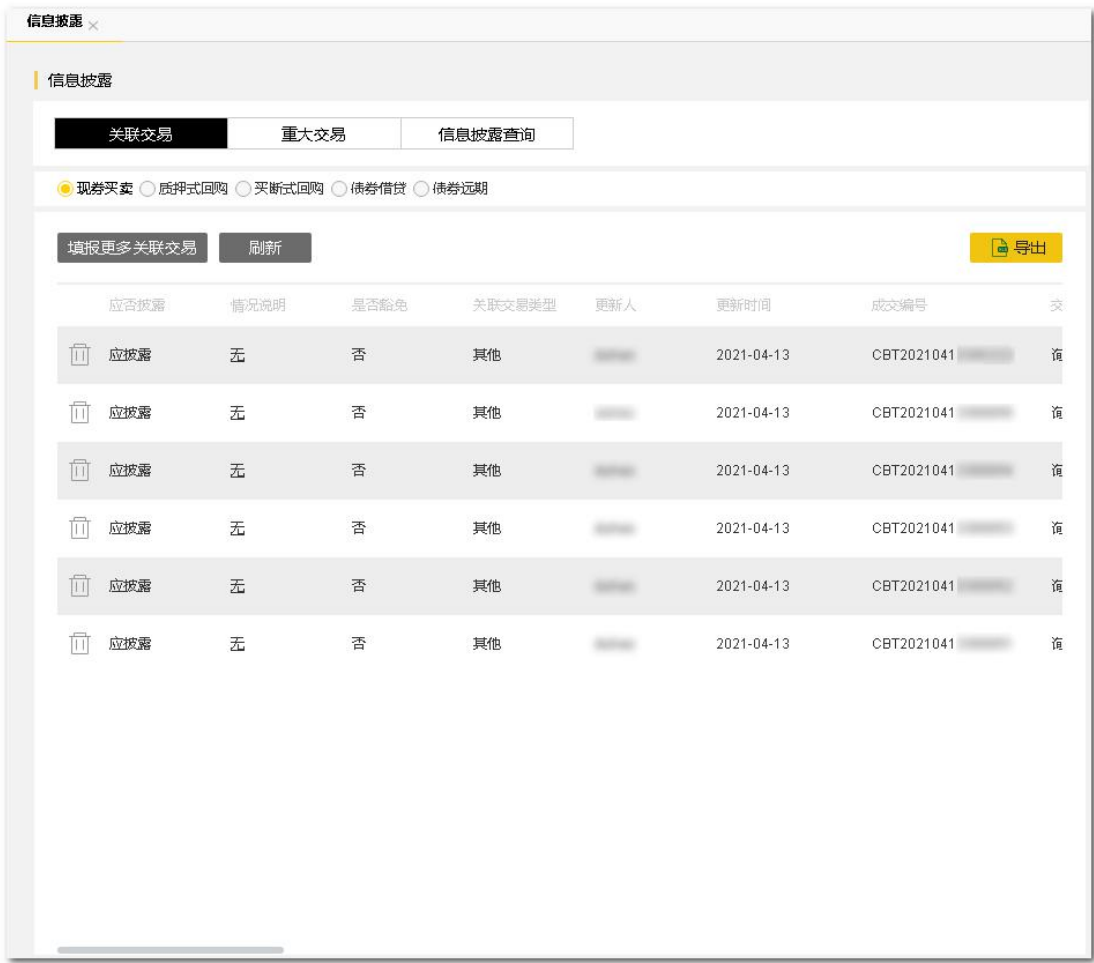




8.3 信息披露

8.3.1 信息披露-关联交易

具有“机构权限-交易设置-信息披露”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“信息披露”进入关联交易 Tab 页。



- 1) 用户可选择市场查询关联交易；同时可以点击 [导出](#) 下载当前查询结果。
- 2) 用户可点击 [填报更多关联交易](#) 按钮进入信息披露添加界面；

交易信息披露-添加

市场

现券买卖

成交编号

起始日

2021-04-13

终止日

2021-04-13

本方

本方交易员

查询

添加

	成交编号	交易方式	本方	本方交易员	对手方	对手
☐	CBT2021041	询价				陈
☐	CBT2021041	询价				陈
☐	CBT2021041	询价				郭
☐	CBT2021041	询价				郭
☐	CBT2021041	询价				郭

1 / 1

共5条

选择查询记录后，点击 [添加](#)，即可添加新的信息披露交易。

1) 用户可点击情况说明字段，弹出信息披露情况说明界面；输入情况说明后，点击提交，即完成信息披露操作。

信息披露情况说明

剔除披露

清除

提交

8.3.2 信息披露-重大交易

具有“机构权限-交易设置-信息披露”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“信息披露”进入重大交易 Tab 页。

信息披露

信息披露

关联交易

重大交易

信息披露查询

☒ 现券买卖
 ☐ 质押式回购
 ☐ 买断式回购
 ☐ 债券借贷
 ☐ 债券远期

重大交易明细

导出

成交日期	本方	对手方	交易方向	代码	名称	交易笔数 (笔)	交易量合计 (亿元)
------	----	-----	------	----	----	----------	------------

1 / 1

共0条

合并交易明细

导出

情况说明	更新人	更新时间	成交编号	交易方式	本方	本方交易员	对手方
------	-----	------	------	------	----	-------	-----

1 / 1

共0条

用户可选择市场查询重大交易；同时可以点击  下载当前查询结果。

8.3.3 信息披露-信息披露查询

具有“机构权限-交易设置-信息披露”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“信息披露”进入信息披露查询 Tab 页。

信息披露

信息披露

关联交易

重大交易

信息披露查询

☒ 关联交易
 ☐ 逆回购方为交易标的发行人交易

刷新

导出

市场名称	交易日期	买入方/正回购方/融资方	卖出方/逆回购方/融券方	期限品种/标的	交易金额 (亿)
------	------	--------------	--------------	---------	----------

用户可通过  关联交易  逆回购方为交易标的发行人交易 选择查询信息披露月报或信息披露日报；同时可以点击  导出 下载当前查询结果。

8.4 发起报备

具有“机构权限-交易设置-发起报备”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“发起报备”进入。



发起报备

发起报备

市场：现券买卖

起始日：2021/03/01

终止日：2021/04/01

债券代码

查询

债券名称

成交编号

本方

本方交易员

添加报备记录

交易方式

成交编号

本方

本方交易员

对手方

对手方交易员

交易方

用户可选择查询出来的记录，点击  添加报备记录 按钮，发起新的报备。

8.5 交易报备

具有“机构权限-交易设置-交易报备”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“交易报备”进入。

交易报备

交易报备

市场
现券买卖

起始日
2021/03/01

终止日
2021/04/02

债券代码

债券名称

成交编号

报备状态
全部

查询

刷新

导出

	报备状态	报备内容	更新人	更新时间	成交编号	交易方式	本方
	待报备	无	马永波	2021-04-02 13:45:57	CBT20210402300007	对话报价	大成国际资产管...
	待报备	无	交易中心场务	2021-03-31 10:49:50	CBT20210331300018	对话报价	农业银行
	待报备	无	交易中心场务	2021-03-31 10:49:50	CBT20210331300018	对话报价	中国农业银行(卢...
	待报备	无		2021-03-31 10:16:12	CBT20210331300009	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-31 10:10:35	CBT20210331300008	对话报价	农业银行
	待报备	无	交易中心场务	2021-03-31 10:12:15	CBT20210331300006	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-30 14:57:11	CBT20210330900003	X-Bond	农业银行
	待报备	无		2021-03-29 10:10:02	CBT20210329300196	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 10:21:09	CBT20210326705807	RFQ	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 10:12:05	CBT20210326300007	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 09:21:18	CBT20210326200004	RFQ	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 09:21:18	CBT20210326200003	RFQ	农业银行

1

 / 2
 共24条

机构用户可点击报备内容弹出

报备内容

请输入1000字以内的情况说明

导入附件

清除

提交

输入文字或导入附件，点击

提交

按钮即完成交易报备填报。

8.6 交易报备确认

具有“机构权限-交易设置-交易报备确认”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“交易报备确认”进入。

交易报备确认

交易报备确认

市场
现券买卖

起始日
2021/02/01

终止日
2021/04/02

债券代码

债券名称

成交编号

报备状态
全部

查询

审核通过

退回修改

刷新

导出

☐	报备状态	报备内容	更新人	更新时间	成交编号	交易方式	本方
☐	待确认	需要报备一下子	马永波	2021-04-02 14:08:59	CBT20210331300018	对话报价	农业银行
	待报备	无	交易中心场务	2021-03-31 10:49:50	CBT20210331300018	对话报价	中国农业银行(卢森堡)
	待报备	无		2021-03-31 10:16:12	CBT20210331300009	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-31 10:10:35	CBT20210331300008	对话报价	农业银行
	待报备	无	交易中心场务	2021-03-31 10:12:15	CBT20210331300006	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-30 14:57:11	CBT20210330900003	X-Bond	农业银行
	待报备	无		2021-03-29 10:10:02	CBT20210329300196	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 10:21:09	CBT20210326705807	RFQ	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 10:12:05	CBT20210326300007	对话报价	农业银行
	待报备	无		2021-03-26 09:21:18	CBT20210326200004	RFQ	农业银行

1

/ 2 > 共23条

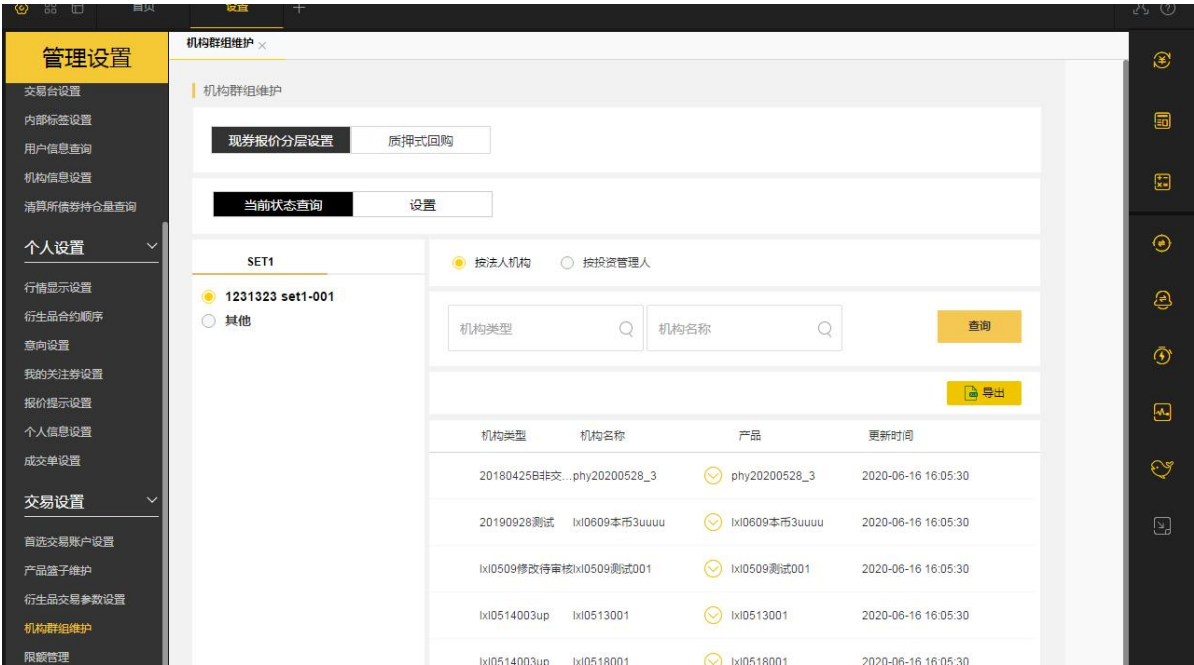
用户勾选“待确认”报备交易，点击 **审核通过** 按钮，则完成提交报备；用户勾选“待确认”报备交易，点击 **退回修改** 按钮，则退回报备交易，需机构用户重新填写报备内容。

8.7 机构群组维护

8.7.1 现券报价分层设置

用户所在机构任一交易账户具有做市机构业务资格，且分层报价属性为“是”时，用户可以对现券报价分层进行查询和设置操作。

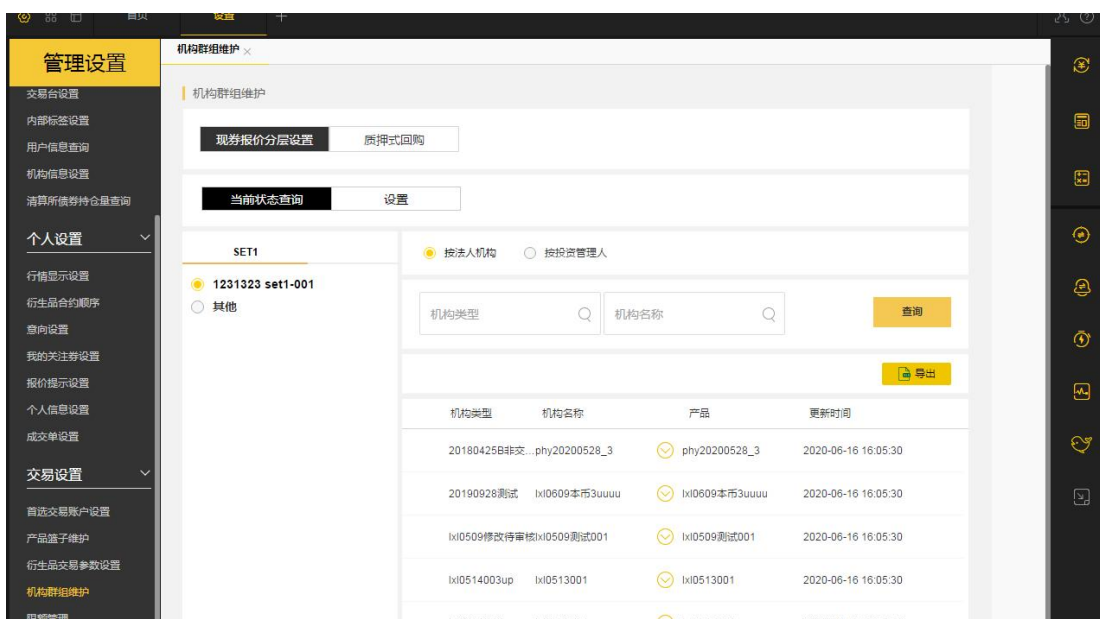
用户可点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“机构群组维护”->现券报价分层设置进行群组查询或设置。



1、当前状态查询

允许本机构用户按照法人机构或投资管理人机构分类，查询机构维护的分层信息，其中左侧“SET1”中默认展示本机构当前已经维护的分层群组列表，通过点击群组名称前的单选框按钮查看对应群组中的机构名单。右侧展示对应群组中的机构详细信息，同步配合左侧群组名单进行信息联动。用户可以通过法人机构或投资管理人维度，以机构类型、机构名称为

查询条件，获取当前已经维护的群组信息。用户可以通过点击导出 下载当前的群组查询结果。

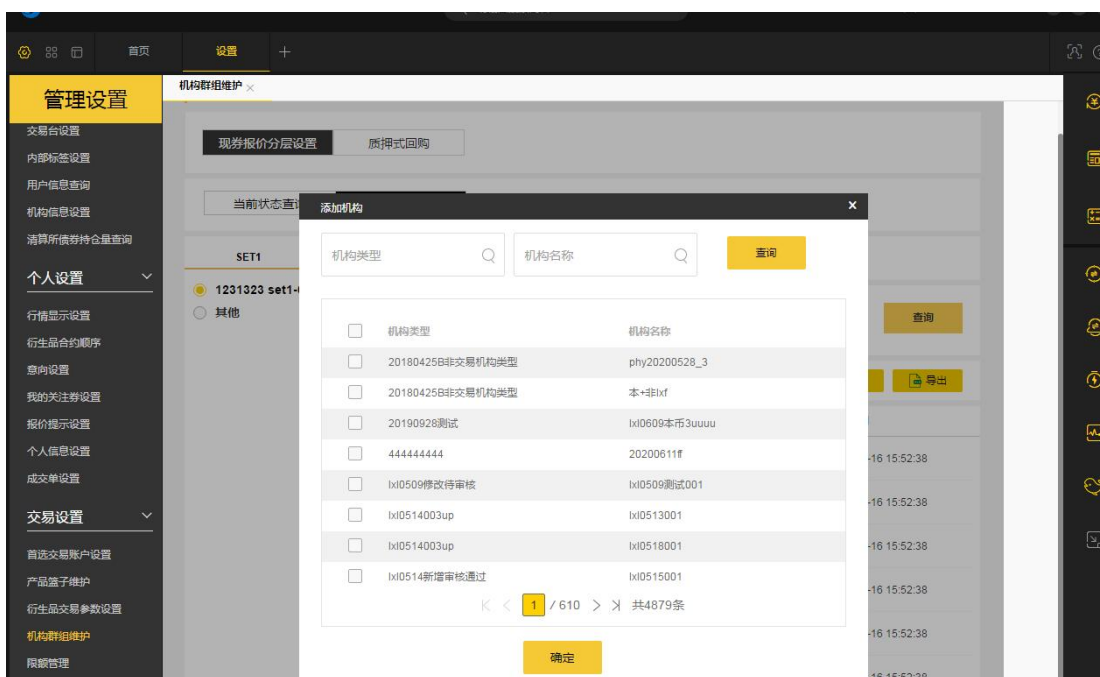


2、机构群组设置

允许本机构用户点击 **设置**，进入做市报价分层维护界面。左侧“SET1”

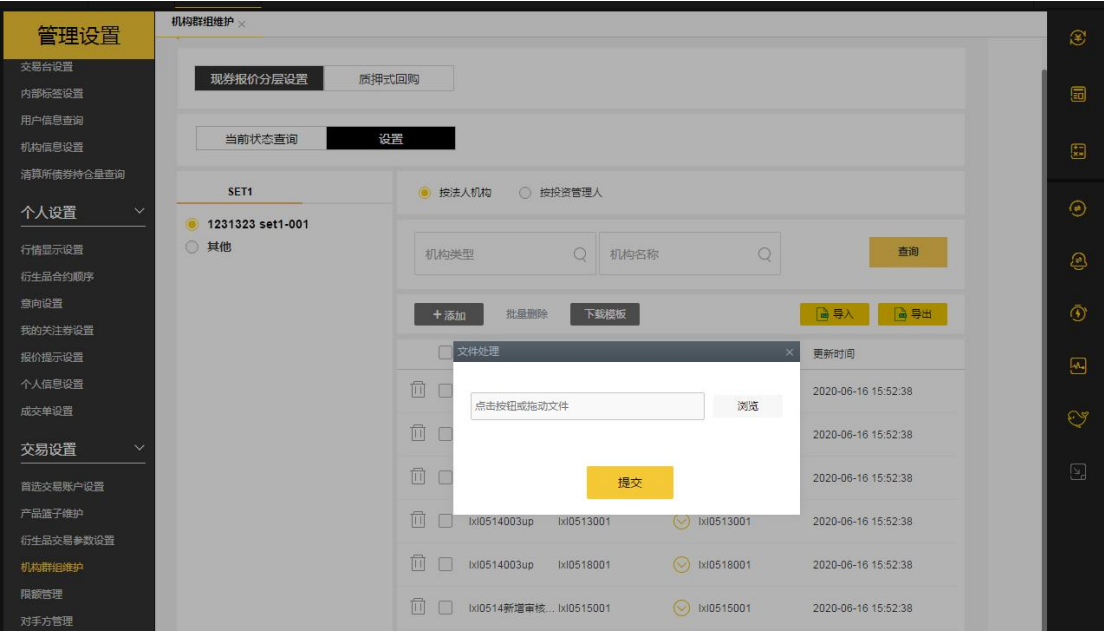
中允许用户通过点击 **+** 新增群组，通过选择现有群组，点击 **-** 对现有群组进行删除操作。

用户选择某一个群组后，可以在右侧窗口中选择 **+ 添加**，根据“机构类型”或“机构名称”查询需要添加的机构并进行确认提交。



3、机构群组导入

在做市报价分层设置中，用户通过点击 ，在模板中填写群组名称和机构名称后，通过点击  进行机构信息批量导入操作。



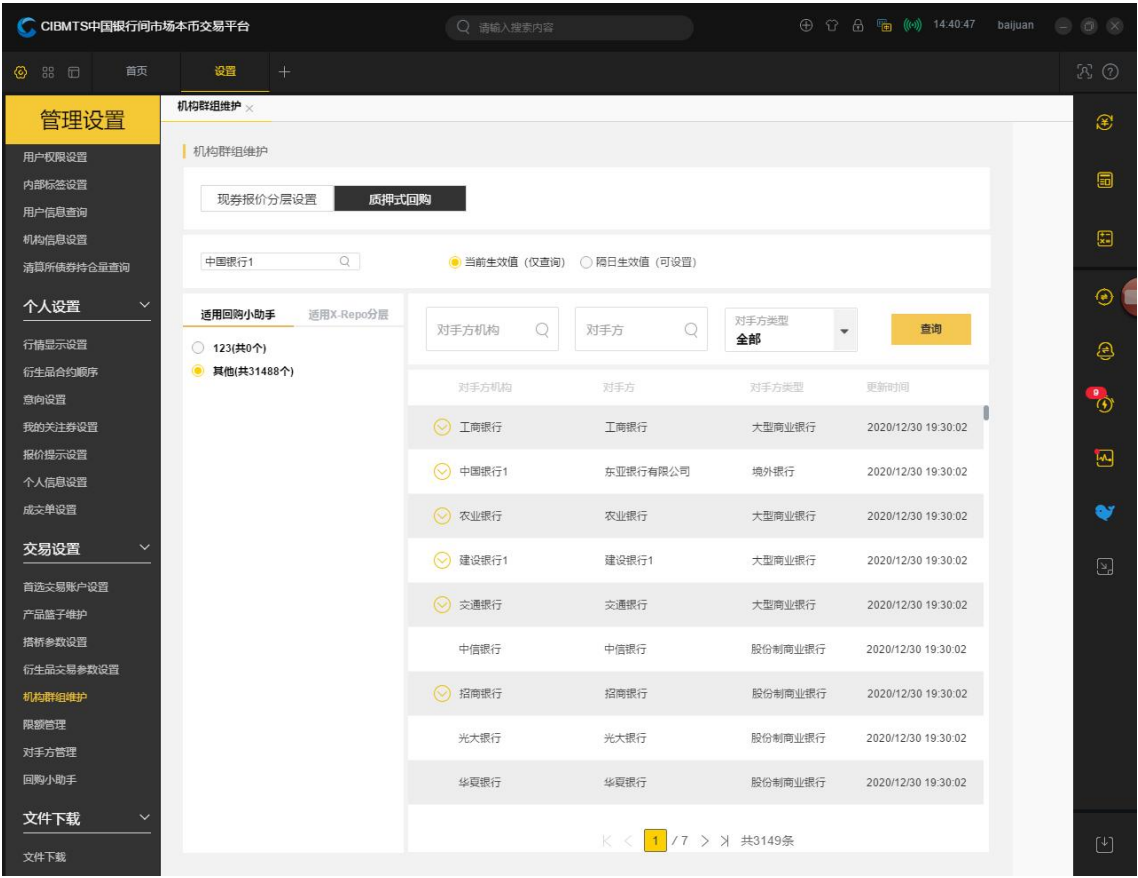
Excel 批量导入文档，填写格式如下：

群组名称	机构名称
基金组	**基金 1
基金组	**基金 2
基金组	**基金 3
基金组	**基金 4
VIP 群组	**机构 1
VIP 群组	**机构 2
VIP 群组	**机构 3

8.7.2 质押式回购

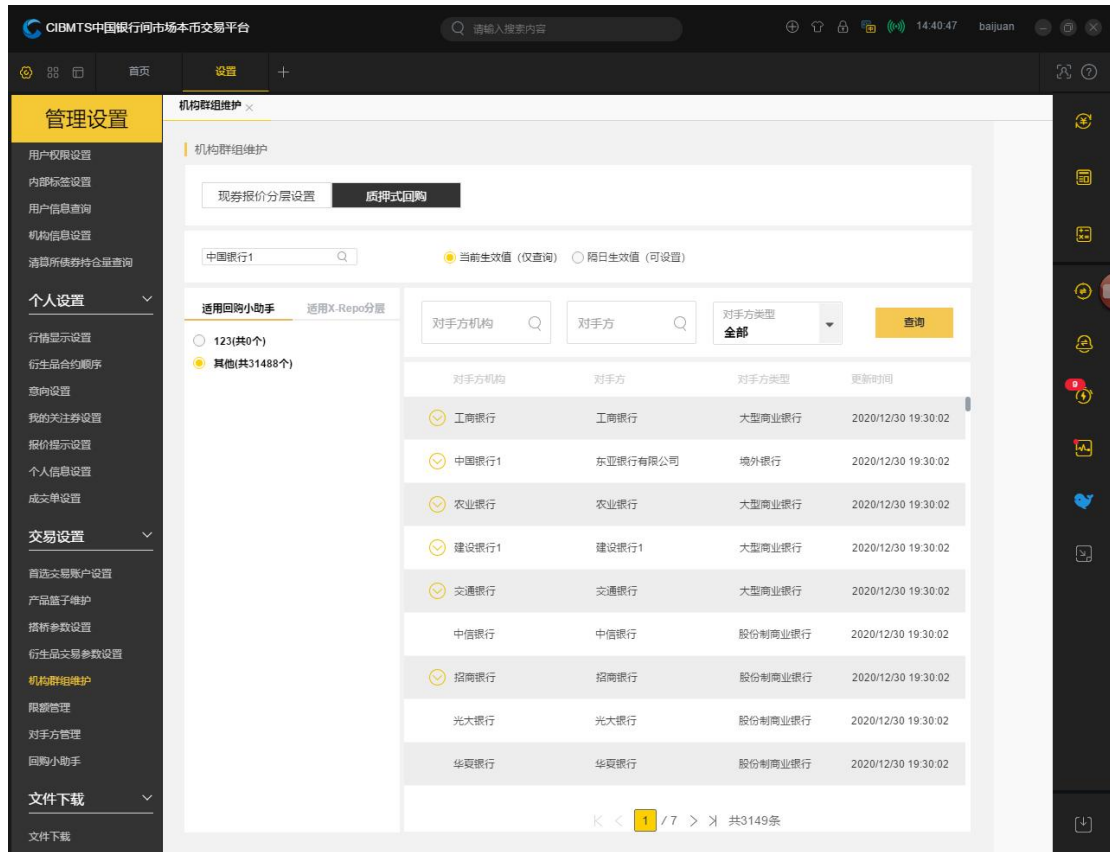
维护质押式回购群组可用于设置回购小助手时选择到适用的群组或 X-Repo 报价分层, 用户任一身份下有请求报价权限、对话报价权限、请求回复、匿名点击权限任一权限时, 用户可以对质押式回购群组进行查询和设置操作。

用户可点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“机构群组维护”->质押式回购进行群组查询或设置。



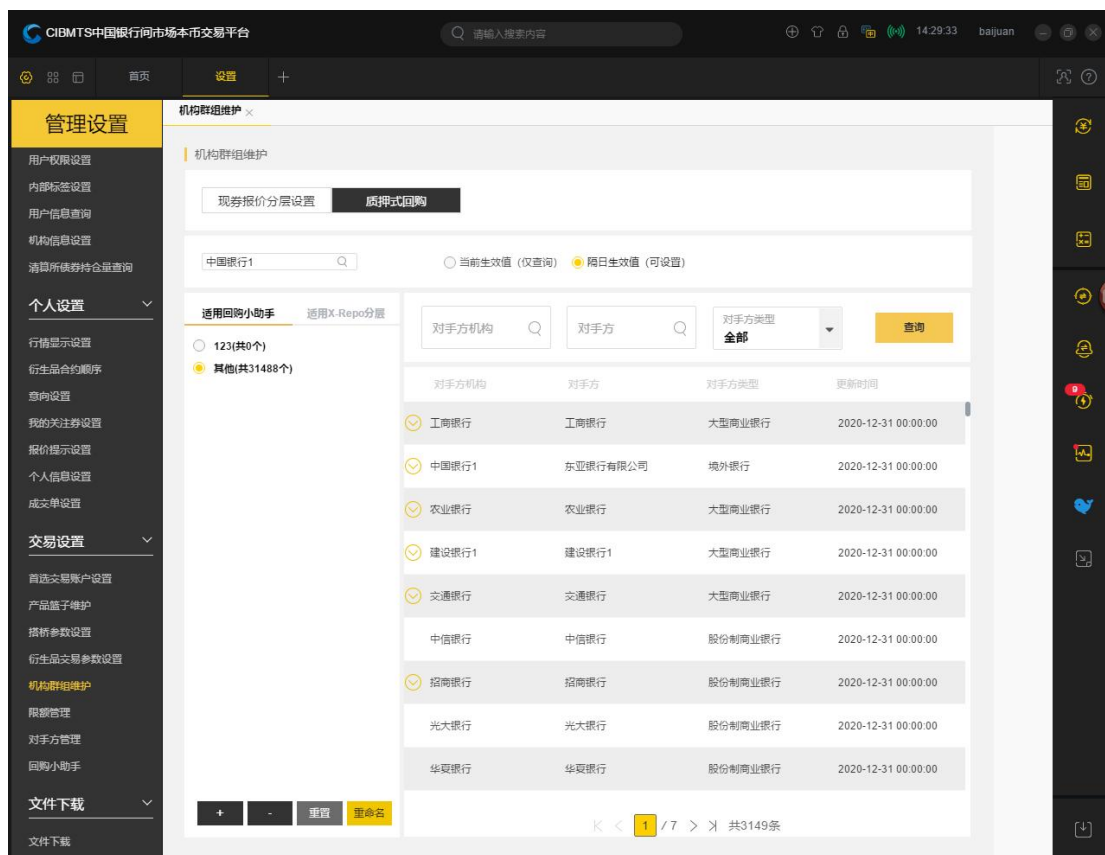
1. 当前生效值（仅查询）

当前生效值（仅查询）界面只可进行查询操作, 其中左侧 SET 页可选择适用回购小助手或 X-Repo, 默认展示本机构已维护生效的群组设置情况, 点击群组名称前的单选框按钮可在右侧联动展示该群组已添加的对手方列表, 选择“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”, 点击 , 查询展示本方的质押式回购群组设置情况。



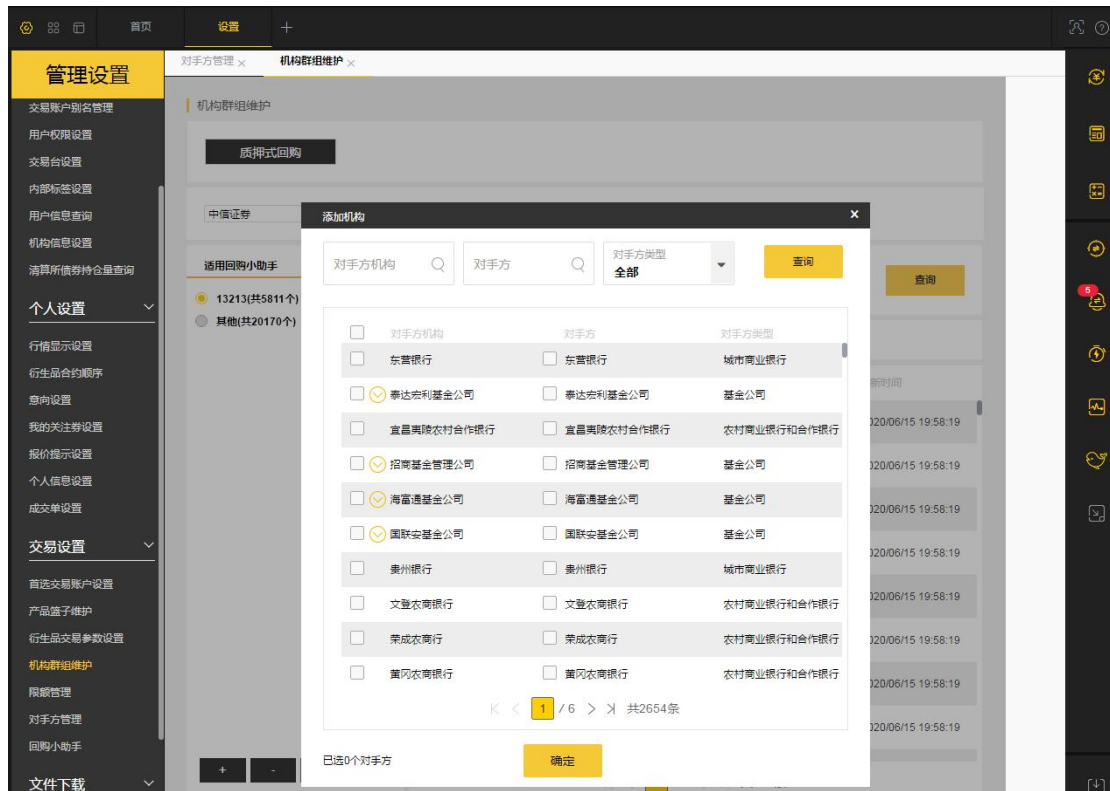
2. 隔日生效值(可设置)

允许本机构用户点击隔日生效值（可设置）按钮，进入质押式回购群组维护界面，选择本方后，左侧的 SET 页适用回购小助手和 X-Repo 集合下初始化两个群组，一个为存款类机构，其中群组中的对手方为市场上所有有质押式回购市场对话报价权限，请求报价、请求回复、匿名点击任一权限的活动的存款类对手方，一个为非存款类机构，其中群组中的对手方为市场上所有有质押式回购市场对话报价权限，请求报价、请求回复、匿名点击任一权限的活动的非存款类对手方。



(1) 左侧 SET 页适用回购小助手和 X-Repo 中允许用户点击 **+** 新增群组，通过选择现有群组，点击 **-** 对现有群组进行删除操作、点击 **重命名** 可对选中群组进行重命名操作，点击 **重置** 按钮可重置为初始化的存款类机构和非存款类机构群组。

(2) 用户选择某个新建的群组后，可以在右侧窗口中选择 **+ 添加**，进入添加机构界面，可根据“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”查询需要添加的机构进行添加，点击确定即可添加成功。查询界面选中已添加的对手方点击 **批量删除** 按钮可进行批量删除操作。



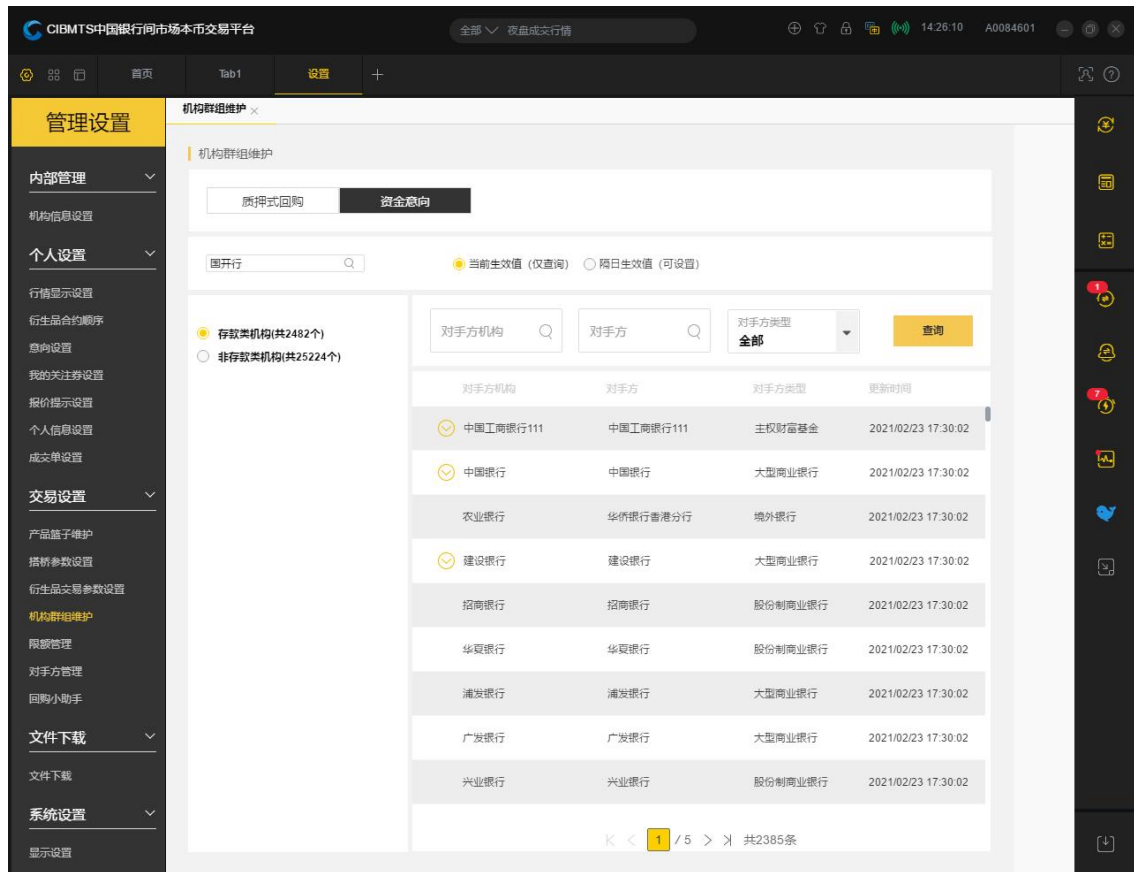
8.7.3 资金意向

资金意向的机构群组维护，用于在资金意向市场发布资金需求时可指定群组发布；用户任一身份下有信用拆借市场对话报价权限或质押式回购市场对话报价权限且用户可用的交易账户有对应市场的询价权限时，可以对资金意向的群组进行查询和设置。

用户可点击  系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“机构群组维护”->资金意向进行群组查询或设置。

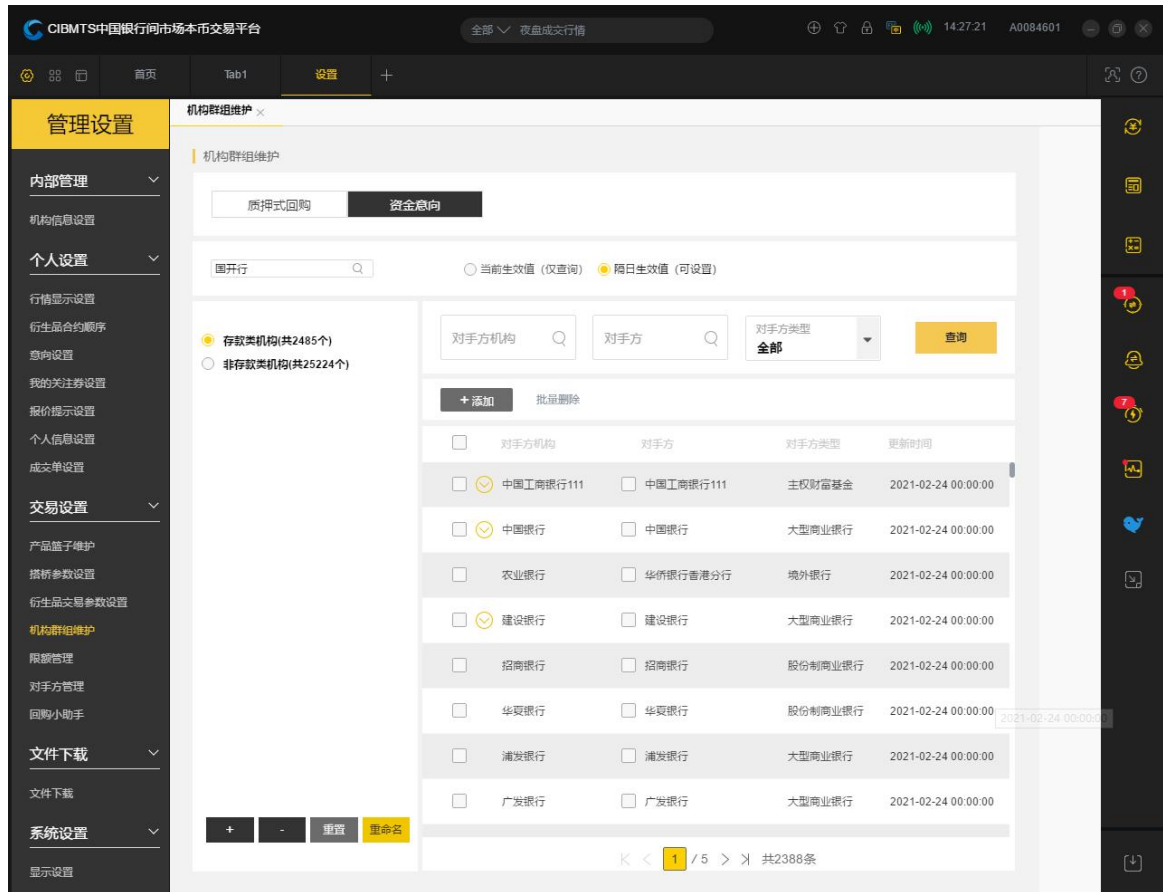
1. 当前生效值（仅查询）

当前生效值（仅查询）界面只可进行查询操作，默认展示当前交易员可操作且有相应权限的交易账户对应的当前生效群组设置情况，点击群组名称前的单选框按钮可在右侧联动展示该群组已添加的对手方列表，选择“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”，点击 ，查询展示本方的资金意向群组设置情况。

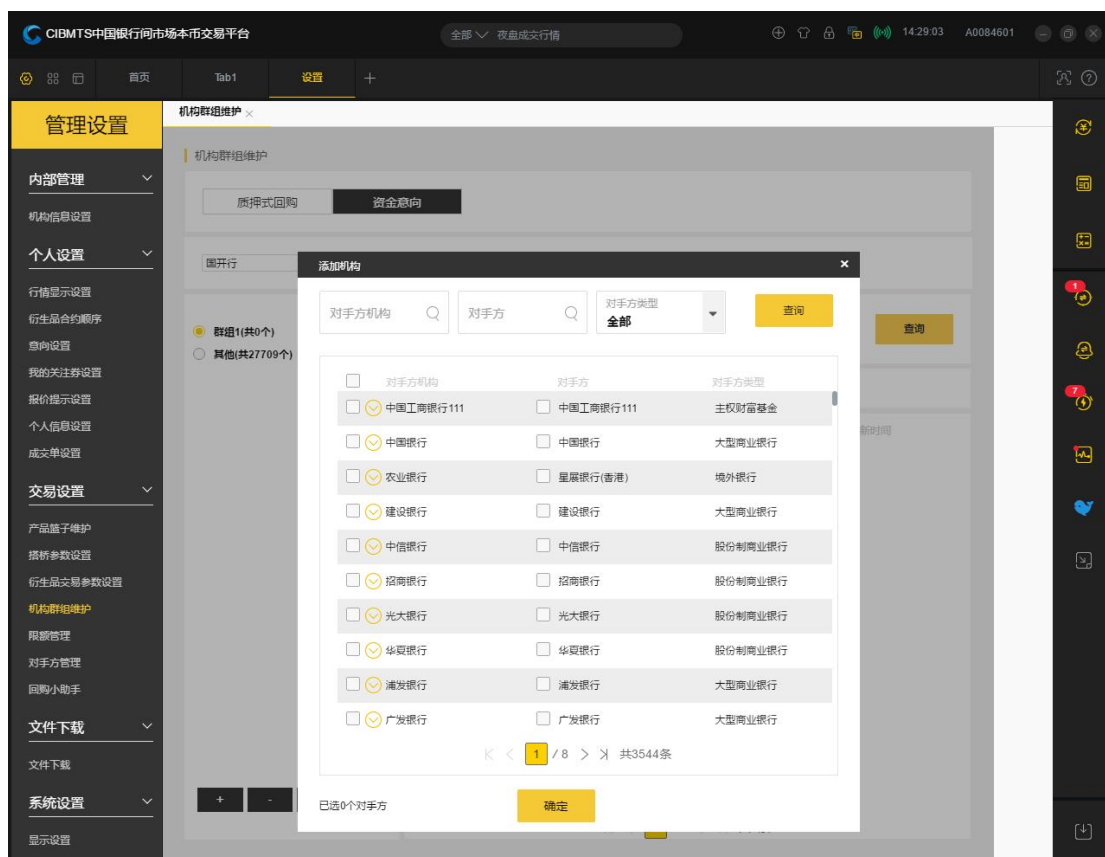


2. 隔日生效值(可设置)

允许本机构有权限用户点击隔日生效值（可设置）按钮，进入资金意向群组维护界面，选择本方后，左侧默认展示初始化的两个群组，一个为存款类机构，其中群组中的对手方为市场上所有有信用拆借市场询价权限，或有质押式回购市场询价权限的活动的存款类对手方；一个为非存款类机构，其中的对手方为市场上所有有信用拆借市场询价权限，或有质押式回购市场询价权限的活动的非存款类对手方。



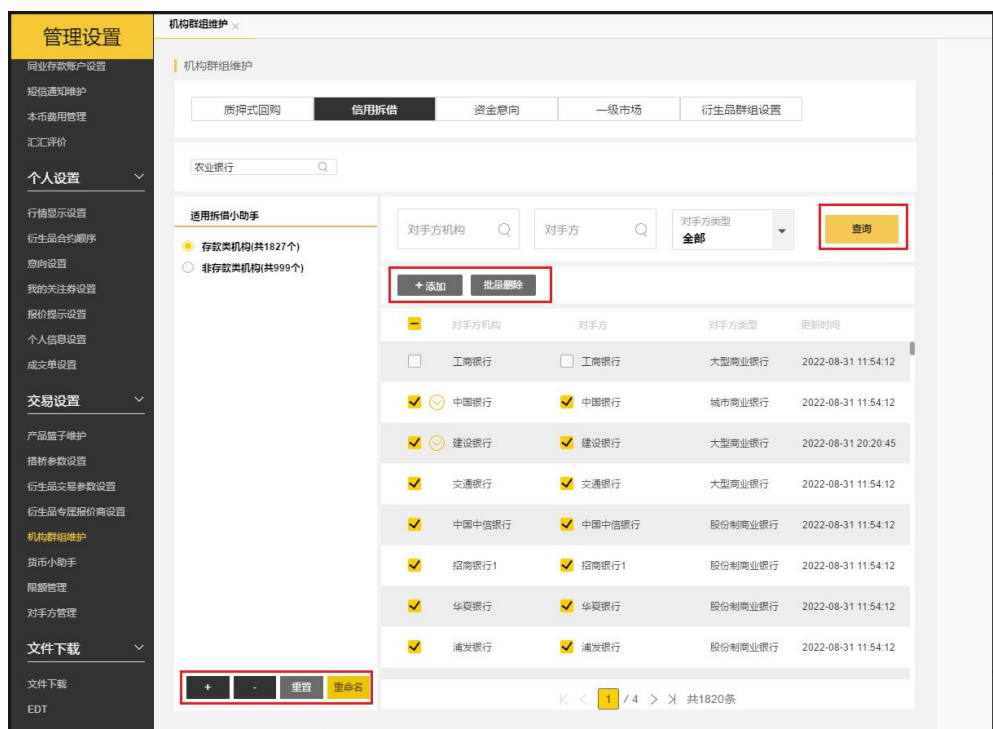
- 1) 左侧区域允许用户点击 **+** 新增群组，通过选择现有群组，点击 **-** 对现有群组进行删除操作、点击 **重命名** 可对选中群组进行重命名操作，点击 **重置** 按钮可重置为初始化的存款类机构和非存款类机构群组。
- 2) 用户选择某个新建的群组后，可以在右侧窗口中选择 **+ 添加**，进入添加机构界面，可根据“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”查询需要添加的机构进行添加，点击确定即可添加成功。查询界面选中已添加的对手方点击 **批量删除** 按钮可进行批量删除操作。



8.7.4 信用拆借

维护信用拆借群组可用于设置拆借小助手时选择到适用的群组，用户任一身份下有信用拆借对话报价权限权限时，用户可以对信用拆借群组进行查询和设置操作。

用户可点击  系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“机构群组维护”->信用拆借进行群组查询或设置。



(1) 左侧 SET 页可选择适用拆借小助手，默认展示本机构已维护生效的群组设置情况，点击群组名称前的单选框按钮可在右侧联动展示该群组已添加的对手方列表，选择“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”，点击 **查询**，查询展示本方的信用拆借群组设置情况。

(2) 左侧 SET 页适用拆借小组手允许用户点击 **+** 新增群组，通过选择现有群组，点击 **-** 对现有群组进行删除操作、点击 **重命名** 可对选中群组进行重命名操作，点击 **重置** 按钮可重置为初始化的存款类机构和非存款类机构群组，所有操作实时生效。

(3) 用户选择某个新建的群组后，可以在右侧窗口中选择 **+ 添加**，进入添加机构界面，可根据“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”查询需要添加的机构进行添加，点击确定即可添加成功。查询界面选中已添加的对手方点击 **批量删除** 按钮可进行批量删除操作。

8.8 限额管理

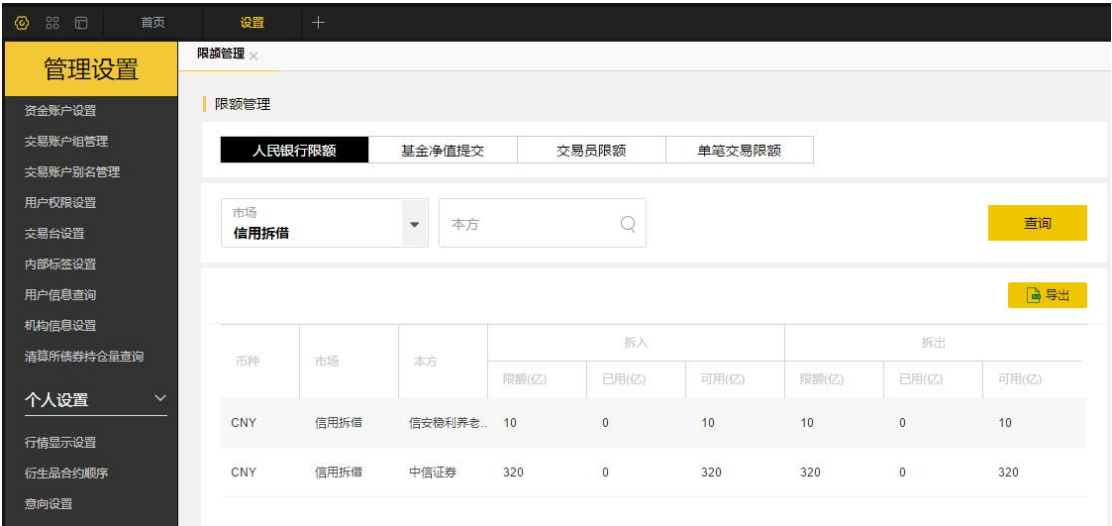
具备相应额度查看权限的用户可对人民银行限额、基金净值提交、交易员限额、单笔交易限额进行查询。具备额度编辑或基金净值提交权限的用户才可对交易员限额、单笔交易限额或基金净值提交进行设置。

用户可点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“限额管理”进行额度查询或设置。

1. 查询人民银行限额

有【限额查询-人民银行限额】权限的用户可查询人民银行限额。选择市场和本方，点击“查询”，可查询该市场该交易账户下人民银行限额各交易方向的初始限额、已用情况和

剩余可用限额。用户可以点击导出下载查询结果。

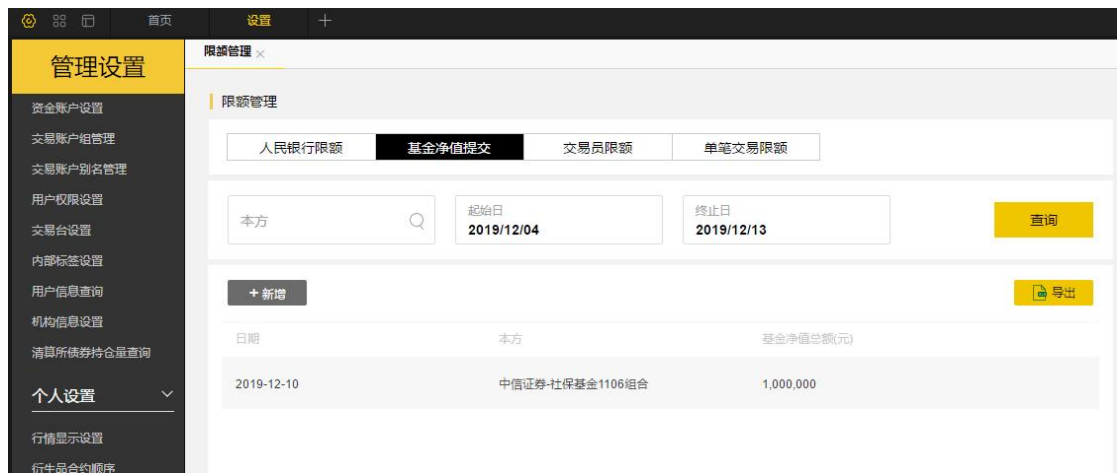


币种	市场	本方	拆入			拆出		
			限额(亿)	已用(亿)	可用(亿)	限额(亿)	已用(亿)	可用(亿)
CNY	信用拆借	信安稳利养老...	10	0	10	10	0	10
CNY	信用拆借	中信证券	320	0	320	320	0	320

2. 查询基金净值总额

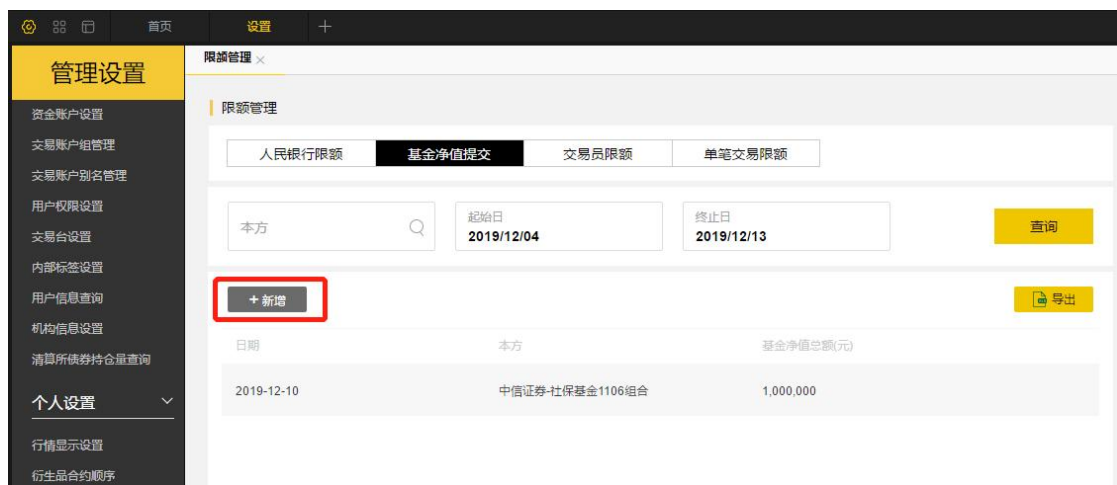
有【信息提交-基金净值提交】权限的用户可查询基金净值总额。选择本方，输入起始日和终止日，点击“查询”，可查询该交易账户在起始日到终止日区间内提交的基金净值总

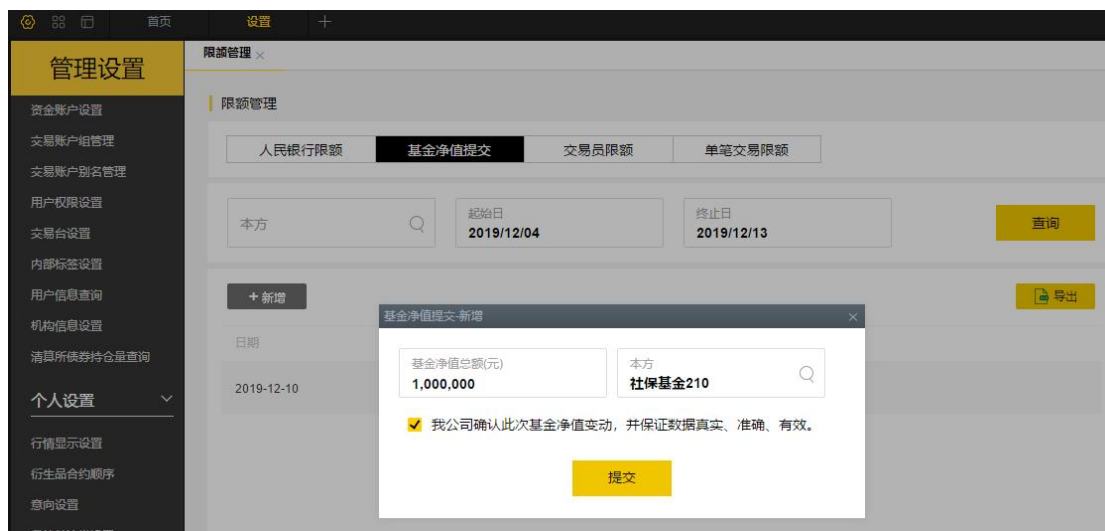
额，同一天只能看到最新提交的基金净值。用户可以点击导出下载查询结果。



3. 提交基金净值总额

有【信息提交-基金净值提交】权限的机构用户可进入菜单查询基金净值，并可提交基金净值。点击“新增”，选择本方，提示句打勾，点击“提交”，可提交基金净值总额。机构用户可以多次重新提交基金净值。





4. 查询交易员限额

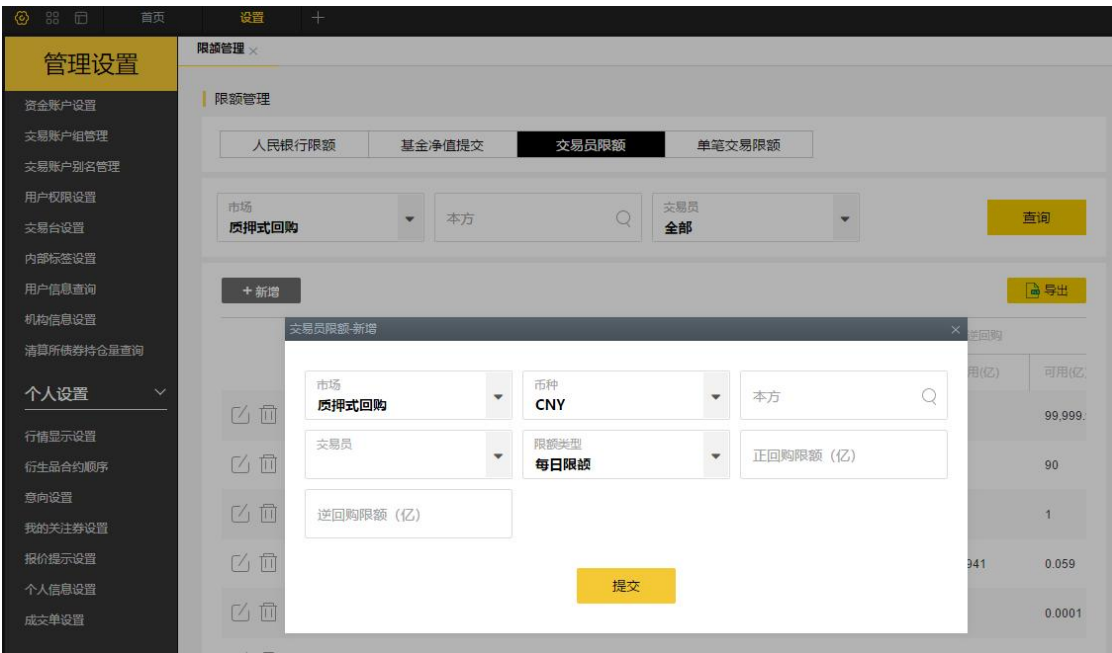
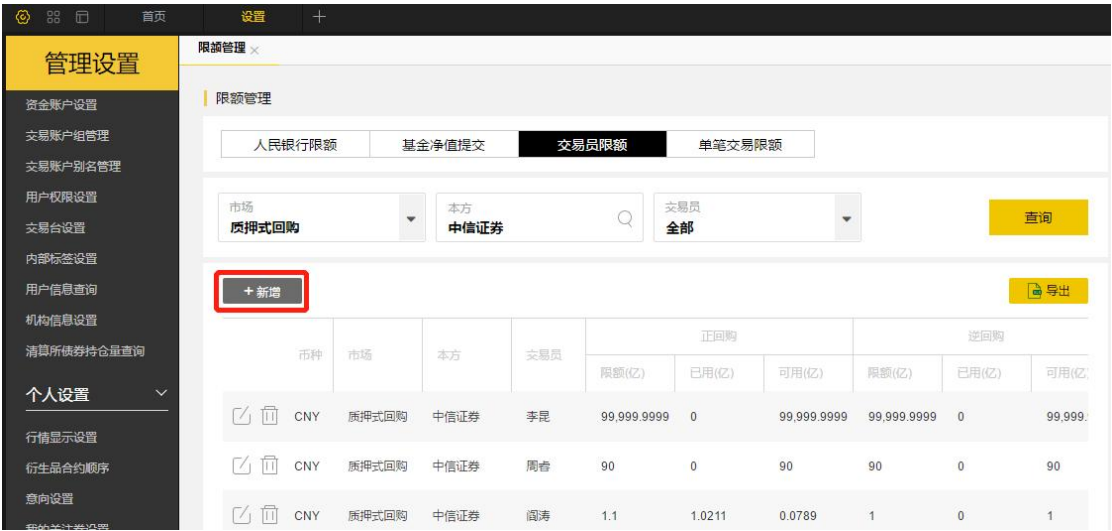
有【限额查询-交易限额】的用户可查询交易员限额。选择市场、本方、交易员，点击“查询”，可查询该市场、交易员使用该交易账户的各交易方向限额初始值、已用情况和剩余可用限额。用户可以点击  下载查询结果。

币种	市场	本方	交易员	正回购			逆回购		
				限额(亿)	已用(亿)	可用(亿)	限额(亿)	已用(亿)	可用(亿)
CNY	质押式回购	中信证券	李昆	99,999.9999	0	99,999.9999	99,999.9999	0	99,999.9999
CNY	质押式回购	中信证券	周青	90	0	90	90	0	90
CNY	质押式回购	中信证券	阎涛	1.1	1.0211	0.0789	1	0	1
CNY	质押式回购	中信证券	阎涛	1.2	1.1857	0.0143	1	0.941	0.059
CNY	质押式回购	中信证券	戴玮	0.0001	0	0.0001	0.0001	0	0.0001
CNY	质押式回购	中信证券	戴玮	0.0002	31.042	-31.0418	0.0002	1	-0.9998
CNY	质押式回购	中信证券	戴玮yi	10	0	10	10	0	10
CNY	质押式回购	中信证券	戴玮yi	10	1	9	10	0	10

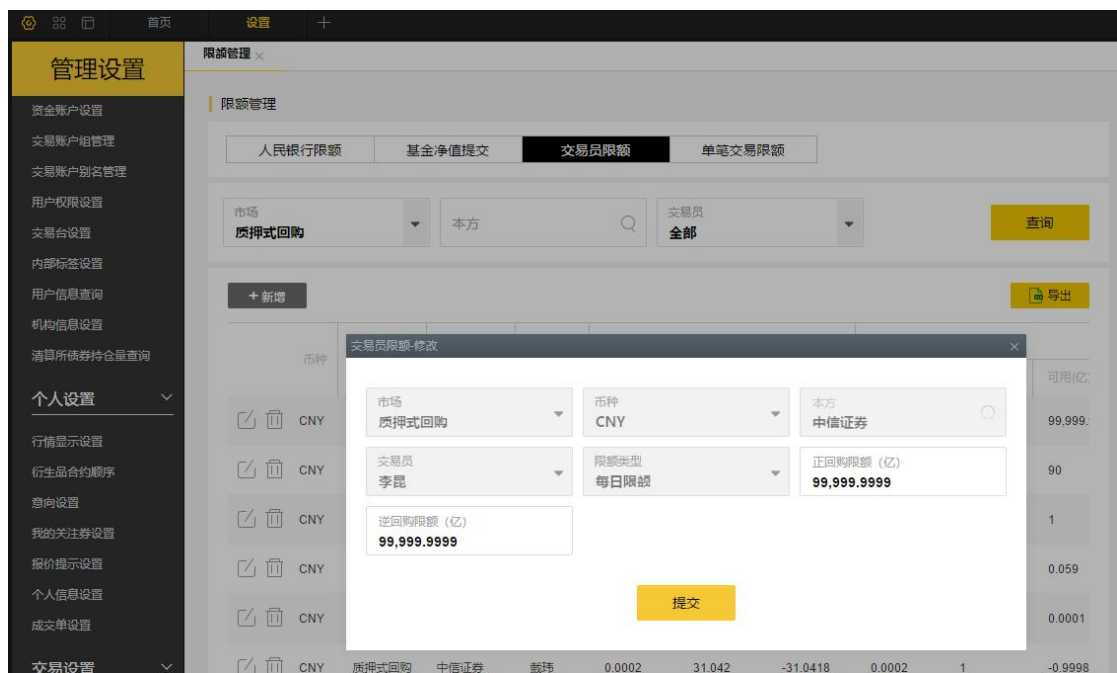
5. 设置交易员限额

有【限额管理-交易限额】的用户可设置交易员限额。

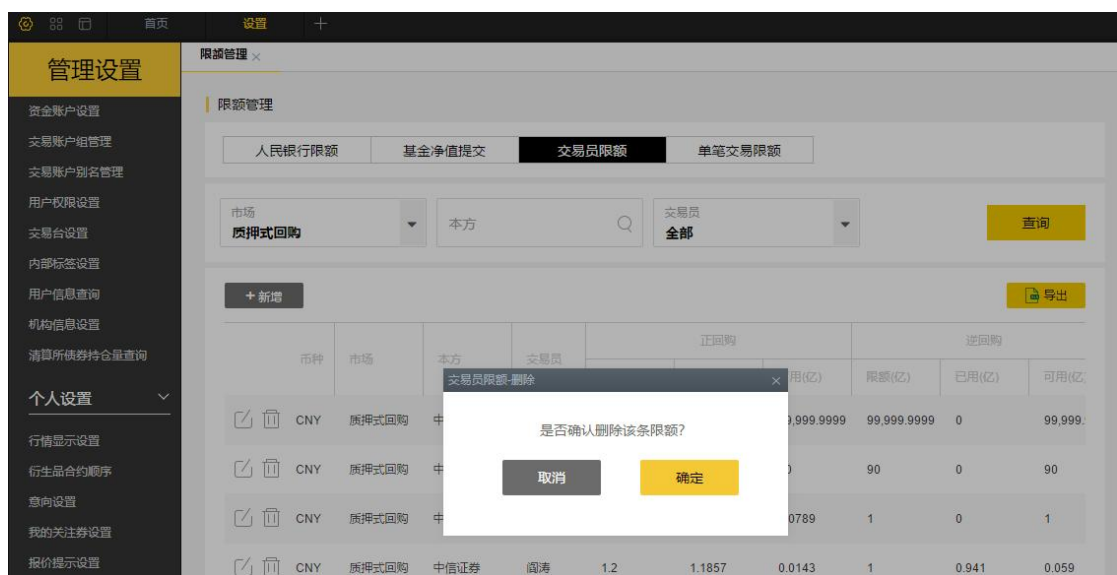
(1) 点击“新增”，选择市场、币种、本方、交易员、限额类型，新增限额。点击“提交”。



(2) 点击  可修改交易员限额。



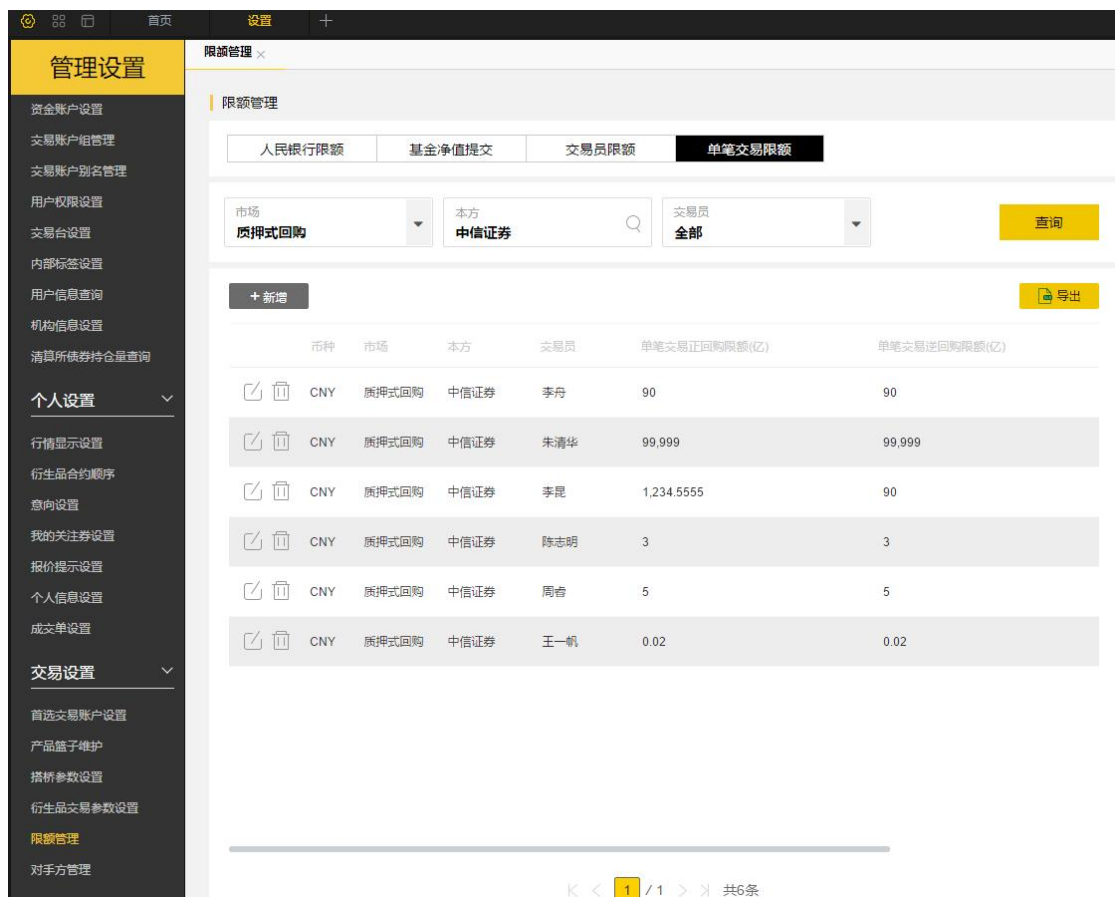
(3) 点击  可删除交易员限额记录。



6. 查询单笔交易限额

有【限额查询-单笔交易限额】的用户可查询单笔交易限额。

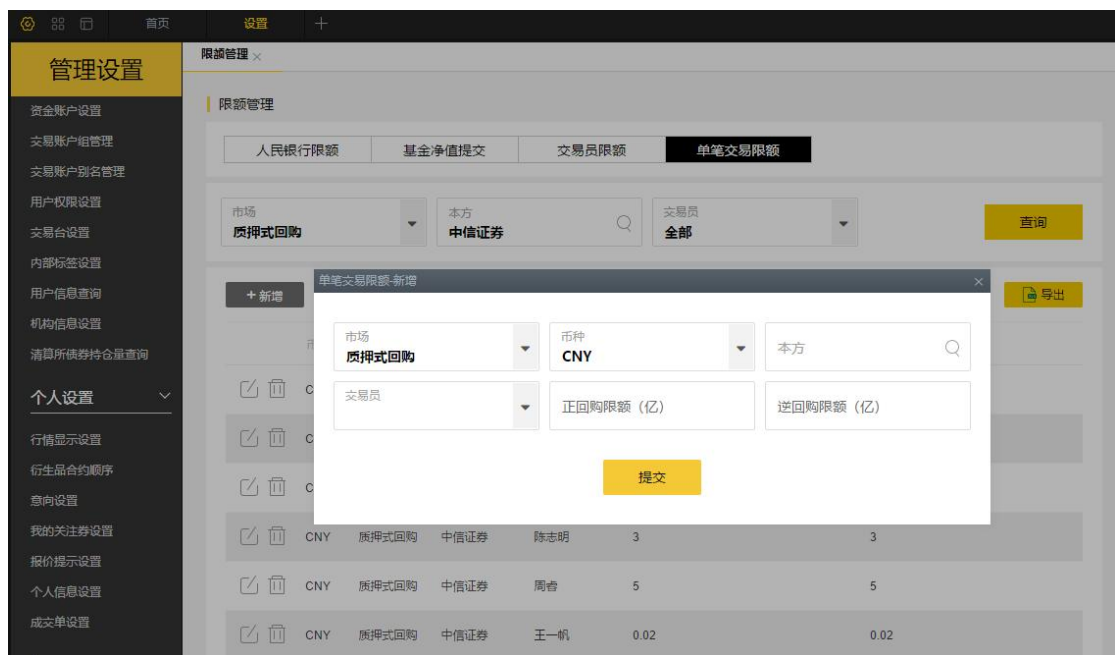
选择市场、本方、交易员，点击“查询”，可查询该市场、交易员使用该交易账户的各交易方向单笔交易限额。用户可以点击  导出 下载查询结果。



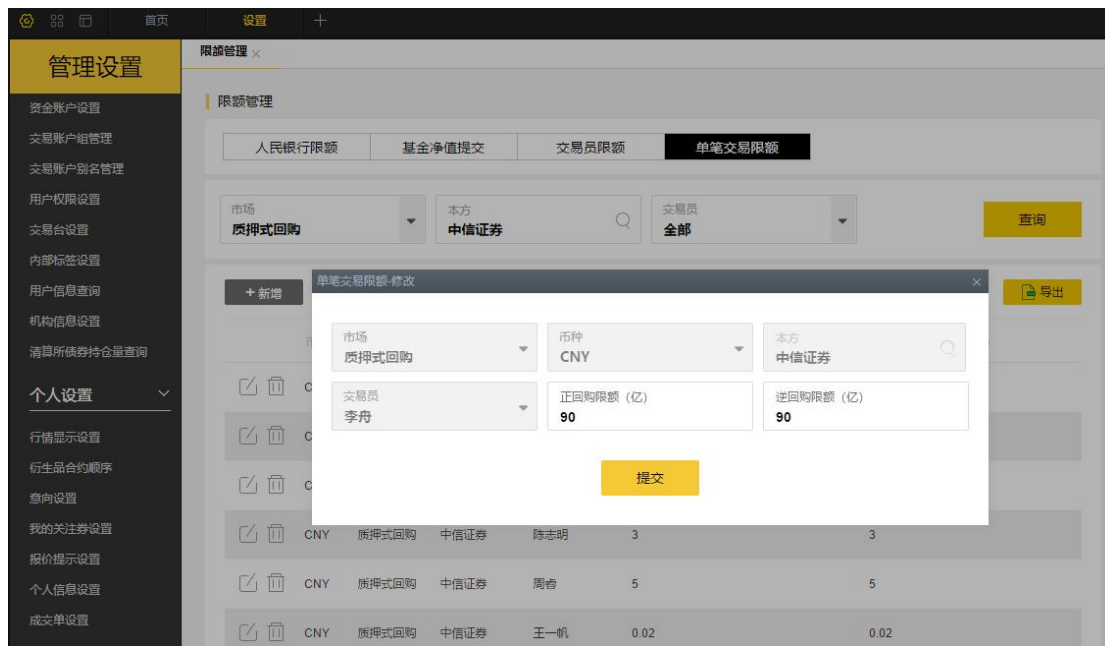
7. 设置单笔交易限额

有【限额管理-单笔交易限额】的用户可设置单笔交易限额。

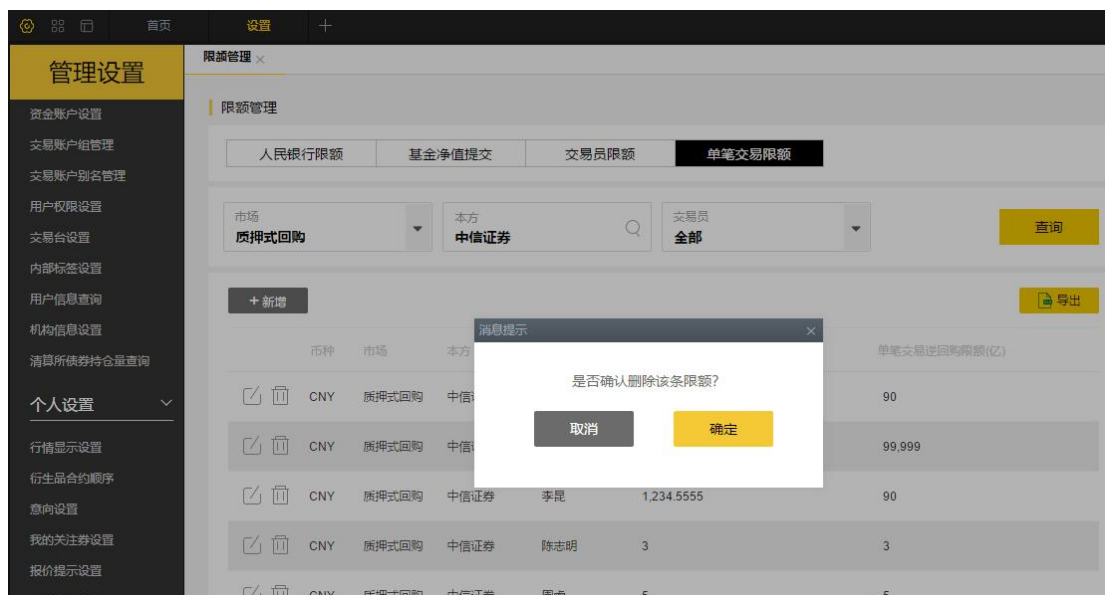
(1) 点击“新增”，选择市场、币种、本方、交易员，填写限额。点击“提交”。



(2) 点击  可修改单笔交易限额。



(3) 点击  可删除单笔交易限额记录。

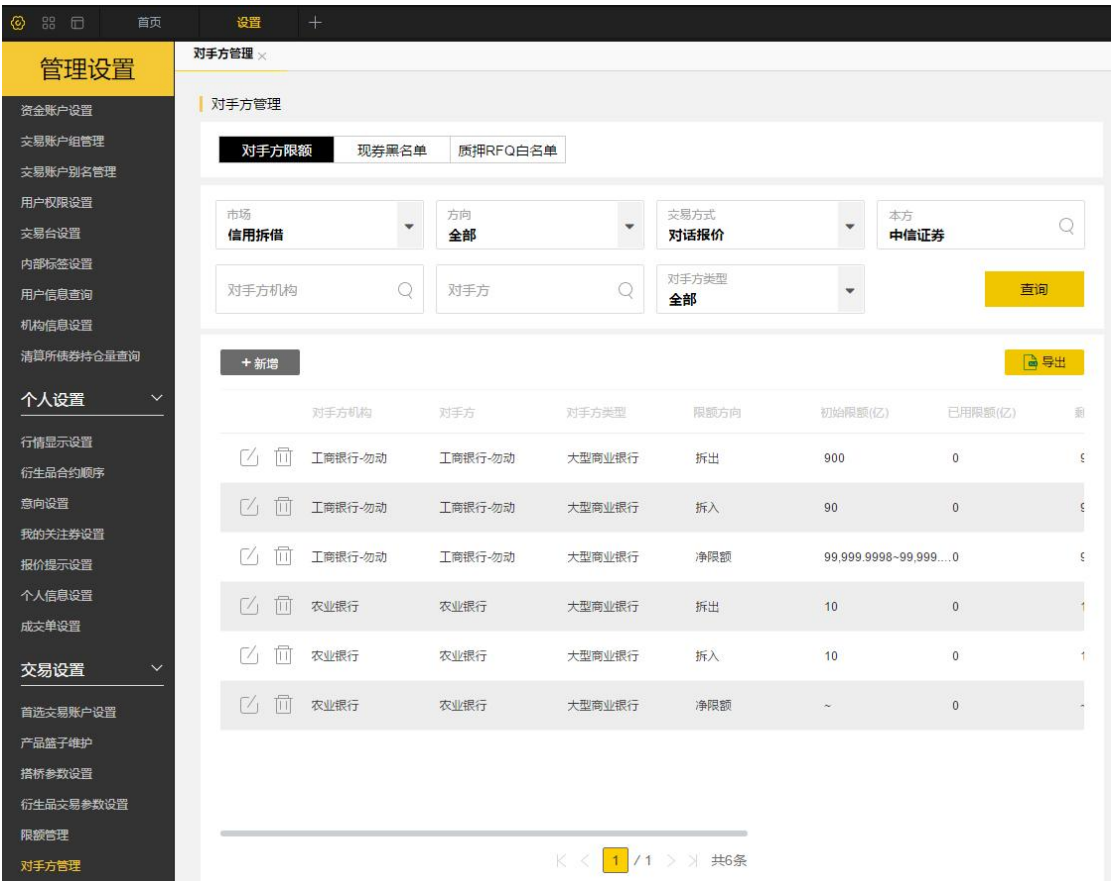


8.9 对手方管理

8.9.1 对手方限额

具备相应额度查看权限的用户可查询对手方限额；具备额度设置权限的用户可查询或设置对手方限额。

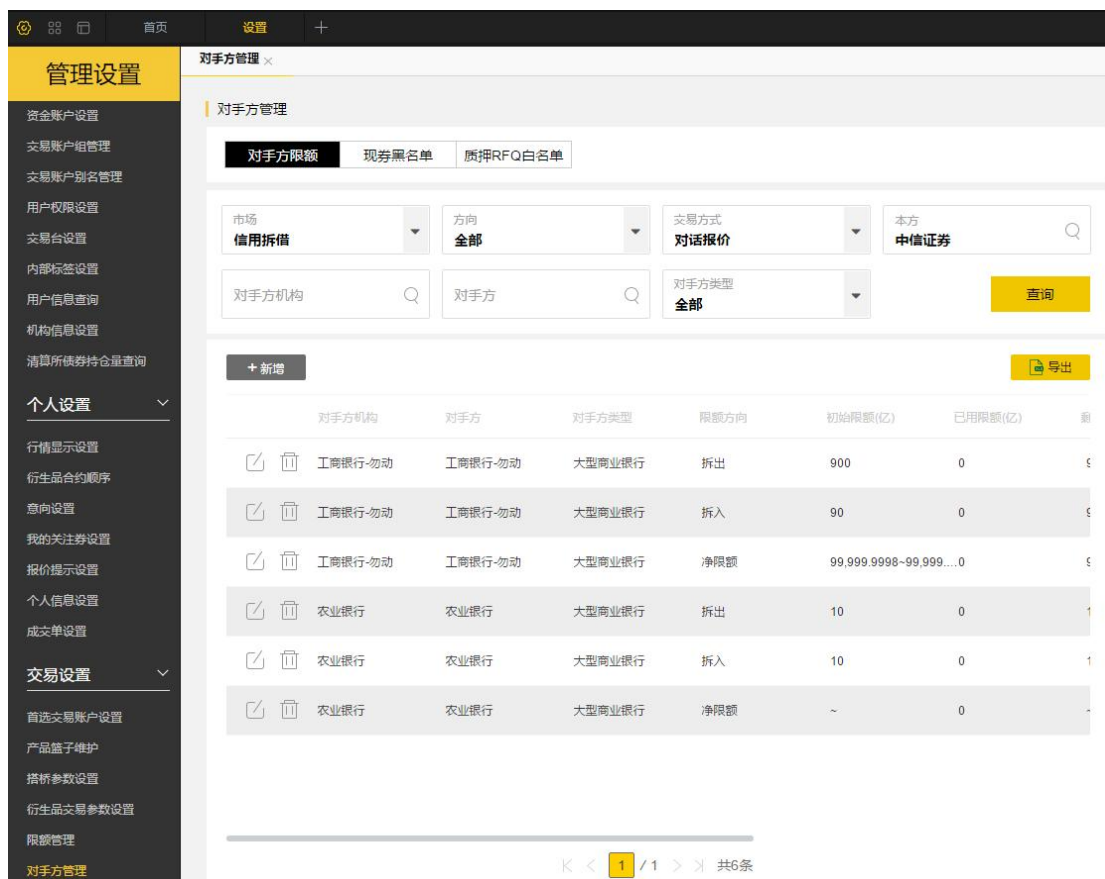
用户可点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“对手方管理”->“对手方限额”进入。



1. 查询对手方限额

具有【限额查询-对手方限额】或【限额管理-对手方限额】权限的用户可查询对手方限额。选择市场和其他查询条件，点击“查询”，可查询本方设置的对手方限额。用户可以点

击  导出 下载查询结果，保存至本地。

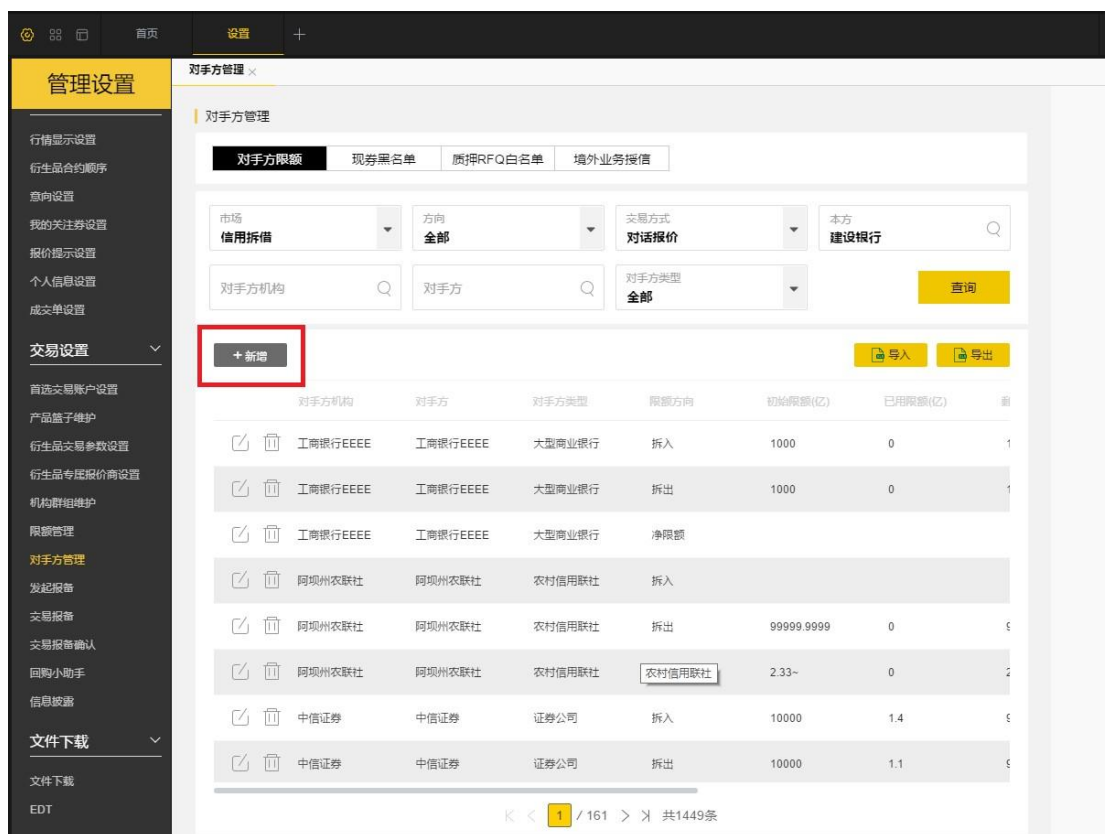


2. 设置对手方限额

具有【限额管理-对手方限额】权限的机构用户可设置对手方限额。

8.9.1.1 信用拆借市场

点击“新增”，填写对手方限额要素，点击“提交”即可新增成功。也可查询到额度记录后，点击左侧的修改  按钮进行修改，或点击删除  按钮删除额度记录。



点击“导入”，选择并上传对手方限额数据文件，校验通过后则可导入成功。可以通过点击“导出”下载并查看模板。

8.9.1.2 质押式回购市场

具有【限额查询-对手方限额】查询权限的客户端用户可进入菜单查询对手方限额。若用户具有【限额管理-对手方限额】编辑权限和相应交易权限，可以设置对应的质押式回购对手方限额(总额度及 X-Repo 额度)；若用户仅具备匿名点击交易权限时，仅可在不超过对手方总额度范围内对 X-Repo 限额进行维护操作，无法对对手方总额度进行调整。选择本方向后，点击“新增”，维护对手方限额信息后点击“提交”即可新增成功。也可查询到额度记录后，点击  按钮进行修改，或点击删除  按钮删除额度记录。对具有匿名点击权限的对手方仅可以通过点击  的方式清除本方对对手方设置的质押式回购-逆回购限额，无法从查询列表中删除该对手方记录。质押式回购市场逆回购方向按照额度进行设置，正回购方向按照黑名单或白名单形式（二者只能选其一）进行设置。质押式回购额度设置变更会

触发 X-Repo 报价订单冻结。具体地：

（1）质押式回购逆回购方向额度设置。市场选择质押式回购，交易方向选择逆回购。

点击“查询”展示本方维护的对手方限额记录。用户可以在新增页面设置未维护过的对手方限额，或通过点击修改对维护过的对手方限额记录进行修改。“逆回购限额”可选择在左侧方框打“√”或者在右侧数值框填写初始限额数值，其中 X-Repo 额度设置应不大于总额度。

对手方管理

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场
质押式回购

本方方向
逆回购

交易方式
全部

本方
中信证券

查询

对手方机构

对手方

对手方类型
全部

对手方是否有X-Repo权限
全部

+ 新增

导入

导出

	对手方机构	对手方	对手方类型	资管人及产品 是否共享额度	初始(亿)		已用(亿)	
					总额度	其中X-Repo	总额度	其中X-Repo
新增 修改 删除	工商银行	工商银行	大型商业银行	不适用	500	500	0	0
新增 修改 删除	中国银行1	中国银行1	大型商业银行	不适用	✓	500	0	0
新增 修改 删除		中行香港	境外银行	不适用	✓	500	0	0
新增 修改 删除		浙商银行资管	商业银行资管	不适用	✓	/	0	/
新增 修改 删除	农业银行	农业银行	大型商业银行	不适用	✓	✓	0	0
新增 修改 删除		农行香港	境外银行	不适用	✓	500	0	0
新增 修改 删除		伊春市住房公积...	非金融机构	不适用	✓	0	0	0

<

>

1

/ 49

>

>

共961条

管理设置

用户权限设置

用户信息查询

机构信息设置

清算所债券持仓查询

个人设置

行情显示设置

衍生品合约顺序

意向设置

我的关注设置

报价提示设置

个人信息设置

成交单设置

交易设置

首选交易账户设置

产品篮子维护

搭桥参数设置

衍生品交易参数设置

机构群组维护

限额管理

对手方管理

回购小助手

文件下载

对手方管理

对手方限额-新增

市场

质押式回购

本方方向

逆回购

本方

招商银行

对手方机构

中信信托

对手方

币种

CNY

查询

对手方机构	对手方	对手方类型	资管人及产品 是否共享额度	初始(亿)		到期日	币种
				总额度	其中X-Repo		
中信信托	中信信托	信托投资公司	全部不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信渤海银行1501...	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信信托成都农商...	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信信托财富成长...	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信信托财富成长...	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信信托集团综合...	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信信托蓝筹1号	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY
	中信信托配置1号	信托公司的金融产品	不共享	☐	/	9998/12/31	CNY

取消

提交

招商银行

招商银行

股份制商业银行

不适用

0

0

0

1

48

共941条

(2) 【对手方限额-质押式回购-逆回购】支持通过设置“资管人及其产品是否共享额度”的形式来设置逆回购限额，可选择全部共享/部分共享/全部不共享。

(a) 全部共享模式

本方设置对手方资管人及产品是否共享额度为【全部共享】，则本方可以设置对手方初始总额度和 X-Repo 额度为√或者具体值(其中 X-Repo 额度设置应不大于总额度)。当资管人及产品是否共享额度选为【全部共享】时，对应资管产品资管共享模式自动替换为【共享】，资管产品额度无需单设，与对手方资管人共享总额度和 X-Repo 额度。

对手方限额-修改

市场

质押式回购

本方方向

逆回购

本方

中信证券

对手方机构

中金公司

对手方

中金公司

币种

CNY

查询

对手方	对手方类型	资管人及产品 是否共享额度	初始(亿)		到期日	币种	更新时间
			总额度	其中 X-Repo			
中金公司	证券公司	全部共享 ☒	1700	☐	9998/12/31	CNY	2020/12/31 13:24:50
中石油年金中金组合	企业年金	共享	-	-	9998/12/31	CNY	
南方电网年金中金...	企业年金	共享	-	-	9998/12/31	CNY	
2020121801	境外证券公司非法...	共享	-	-	9998/12/31	CNY	
徐州矿务年金中金...	企业年金	共享	-	/	9998/12/31	CNY	
工行年金中金组合	企业年金	共享	-	/	9998/12/31	CNY	
成都飞机年金中金...	企业年金	共享	-	/	9998/12/31	CNY	
工行统筹外基金中金	证券公司的证券资...	共享	-	/	9998/12/31	CNY	

取消

提交

（b）部分共享模式

本方设置对手方资管人及产品是否共享额度为【部分共享】，则本方可以设置对手方初始总额度和 X-Repo 额度为√或者具体值（其中 X-Repo 额度设置应不大于总额度）。当资管人及产品是否共享额度选为【部分共享】时，对应资管产品资管共享模式可以设置为“共享”或者“不共享”。【部分共享】模式下，填写“共享”的对应资管产品共享该资管机构额度，资管产品额度无须单设；填写“不共享”的对应资管产品适用自设额度，初始总额度和 X-Repo 额度须自行设置为√或具体值，未设置额度资管产品适用默认额度规则（即总额度不受限，X-Repo 额度为 0）；

对手方限额-修改

市场

质押式回购

本方方向

逆回购

本方

中信证券

对手方机构

中金公司

对手方

中金公司

币种

CNY

查询

对手方	对手方类型	资管人及产品 是否共享额度	初始(亿)		到期日	币种	更新时间
			总额度	其中X-Repo			
中金公司	证券公司	部分共享	☐ / 6000	☐ / 2000	9998/12/31	CNY	2020/12/31 13:24:50
中石油年金中金组合	企业年金	共享	-	-	9998/12/31	CNY	
南方电网年金中金...	企业年金	共享	-	-	9998/12/31	CNY	
2020121801	境外证券公司非法...	不共享	☒ /	☐ / 1300	9998/12/31	CNY	
徐州矿业年金中金...	企业年金	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	
工行年金中金组合	企业年金	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	
成都飞机年金中金...	企业年金	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	
工行统筹外基金中金	证券公司的证券资...	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	

取消

提交

（c）全部不共享模式

本方设置对手方资管人及产品是否共享额度为【全部不共享】，则对应资管产品均不共享资管机构额度，资管产品资管共享模式自动替换为【不共享】。【全部不共享】模式下，本方需要单独设置对手方资管人及产品的初始总额度和 X-Repo 额度为√或者具体值（其中 X-Repo 额度设置应不大于总额度），未设置额度记录的资管产品适用默认额度规则（即总额度不受限，X-Repo 额度为 0）。

对手方限额-修改

市场
质押式回购

本方方向
逆回购

本方
招商银行

对手方机构
中信证券

对手方
中信证券

币种
CNY

查询

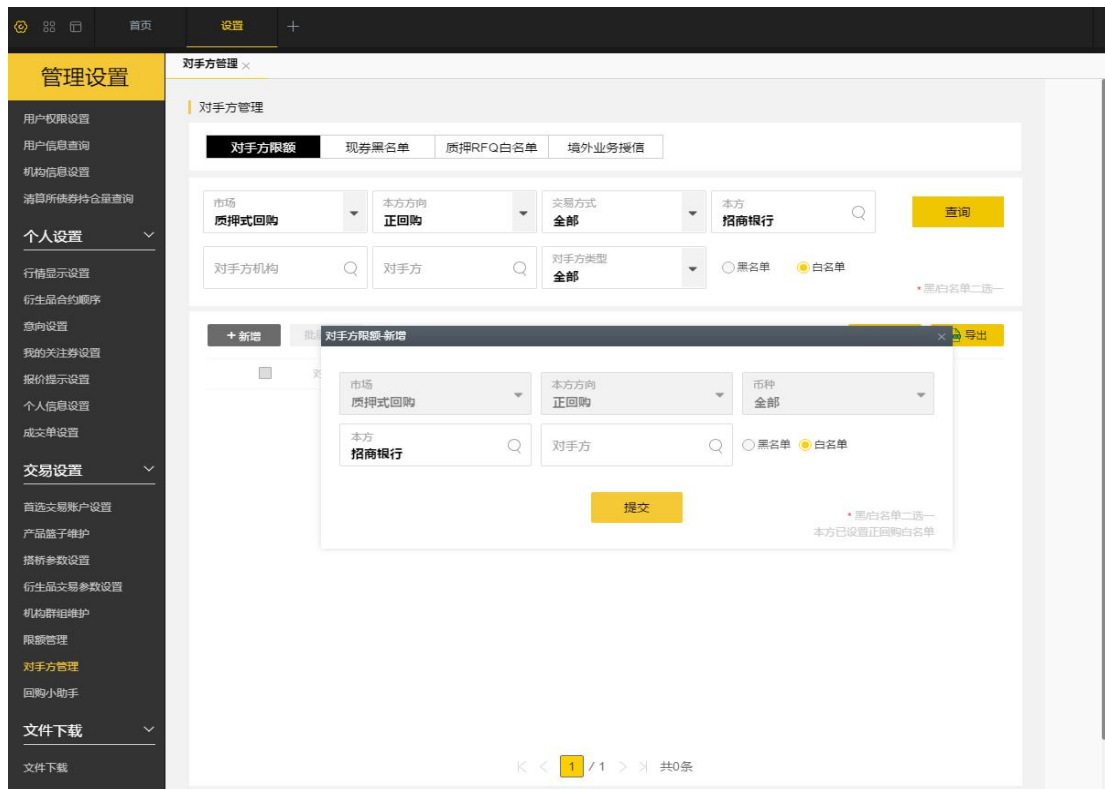
对手方	对手方类型	资管人及产品 是否共享额度	初始(亿)		到期日	币种	更新时间
			总额度	其中X-Repo			
中信证券	证券公司	全部不共享	☒ /	☒ /	9998/12/31	CNY	2020/12/29 12:06:10
社保基金210	社保基金	不共享	☐ /	☐ /	9998/12/31	CNY	2020/11/13 06:33:37
社保基金911	社保基金	不共享	☐ /	☐ /	9998/12/31	CNY	2020/11/13 06:33:37
湖南电力年金中信...	企业年金	不共享	☒ /	☐ /	9998/12/31	CNY	
中信证券理财2号	证券公司的证券资...	不共享	☒ /	☐ /	9998/12/31	CNY	
南方电网年金中信...	企业年金	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	
工行统筹外基金中信	证券公司的证券资...	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	
湖南机场年金中信...	企业年金	不共享	☒ /	/	9998/12/31	CNY	

取消

提交

补充说明：因质押式回购对手方限额设置后涉及共享额度的计算规则，当用户批量对1000 条以上数据进行维护时，系统需要一定的处理时间，为避免影响交易，建议用户批量额度设置在非交易时段内操作。

正回购方向名单设置。市场选择质押式回购，交易方向选择正回购。黑名单或白名单仅可选择其中一种方式，也可不设置。如选择了白名单且设置了具体名单机构，再选择黑名单并点击“新增”并提交时系统会弹出提示框，如确认提交，则已设置的白名单将会清空，并将新增的黑名单机构添加至黑名单中，反之亦然。



8.9.1.3 买断式回购市场

选择本方方向后，点击“新增”，维护对手方限额信息后点击“提交”即可新增成功。

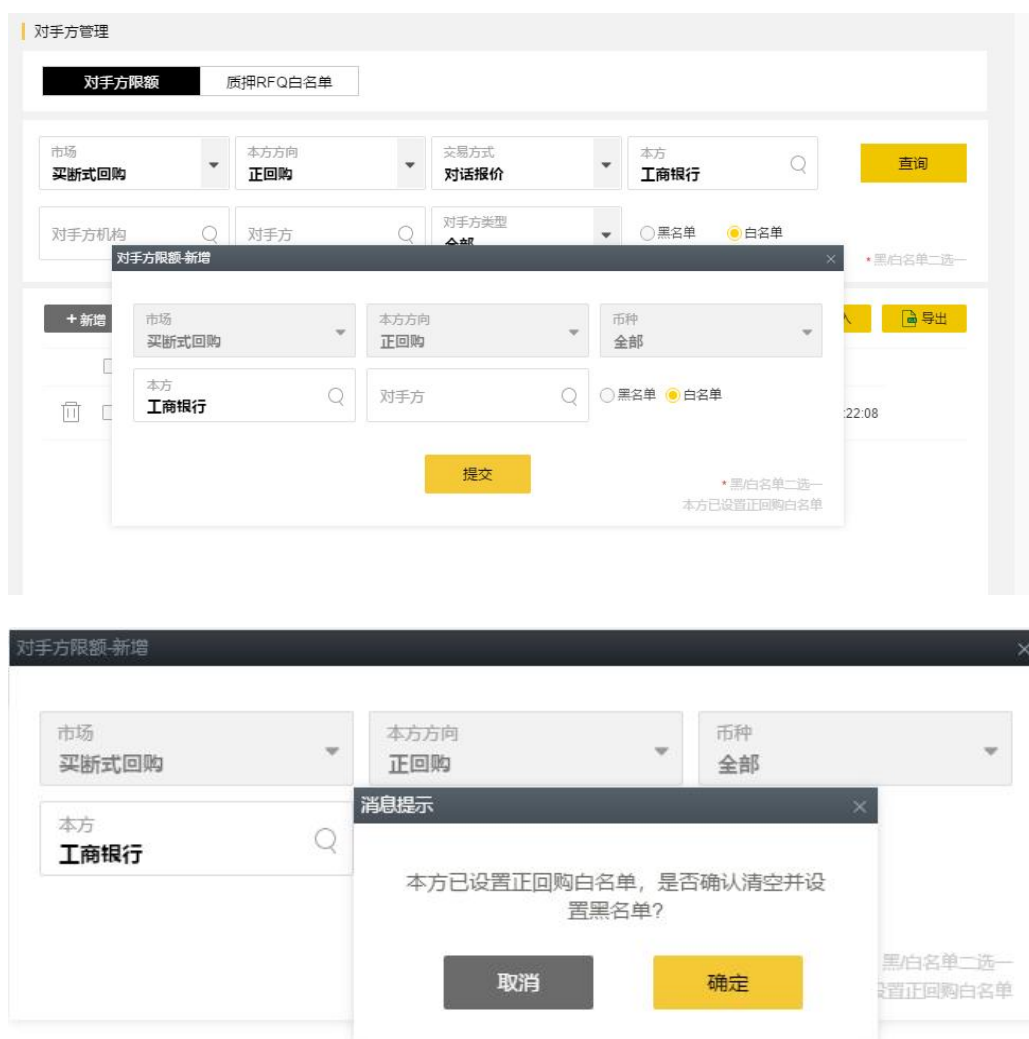
也可在查询到额度记录后，点击  按钮进行修改，或点击删除  按钮删除额度设置记录。逆回购方向按照额度进行设置，正回购方向按照黑名单或白名单形式（二者只能选其一）进

行设置。具体如下：

（1）逆回购方向额度设置。市场选择买断式回购，交易方向选择逆回购。新增或修改界面，“逆回购限额”可选择在左侧方框打“√”或者在右侧数值框填写初始限额数值。

The screenshot displays the '对手方管理' (Counterparty Management) interface. At the top, there are tabs for '对手方限额' (Counterparty Limits) and '质押RFQ白名单' (Collateralized RFQ Whitelist). Below these are search filters for '市场' (Market) set to '买断式回购' (Buyout Repurchase), '本方向' (This Direction) set to '逆回购' (Reverse Repurchase), '交易方式' (Transaction Method) set to '对话报价' (Dialogue Quotation), and '本方' (This Party) set to '工商银行' (ICBC). There are also search boxes for '对手方机构' (Counterparty Institution) and '对手方' (Counterparty), and a dropdown for '对手方类型' (Counterparty Type) set to '全部' (All). A '+ 新增' (Add) button is visible. Below the filters is a table with columns: '对手方机构', '对手方', '对手方类型', '逆回购限额(亿)' (Reverse Repurchase Limit in 100 million), '已用(亿)' (Used in 100 million), '可用(亿)' (Available in 100 million), '到期日' (Maturity Date), '币种' (Currency), and '更新人' (Updater). A modal window titled '对手方限额-新增' (Counterparty Limit-Add) is open, showing fields for '市场' (Market) set to '买断式回购', '本方向' (This Direction) set to '逆回购', '币种' (Currency) set to 'CNY', '本方' (This Party) with a search box, '对手方' (Counterparty) with a search box, '逆回购限额' (Reverse Repurchase Limit) with a checkbox checked and a value input field, and '到期日' (Maturity Date) set to '9998/12/31'. A '提交' (Submit) button is at the bottom of the modal.

（2）正回购方向名单设置。市场选择买断式回购，交易方向选择正回购。黑名单或白名单仅可选择其中一种方式，也可不做设置。如选择了白名单且设置了具体名单机构，再选择黑名单并点击“新增”提交时系统会弹出提示框，如确认提交，则已设置的白名单将会清空，并将新增的黑名单机构添加至黑名单中，反之亦然。



8.9.1.4 利率互换-批量授信

以利率互换为例，选择本方，选择渠道后（交易方式为“X-SWAP”或“对话报价&请求报价”的，渠道选择“银行间”；交易方式为“点击成交”的，渠道选择“专属报价商”），点击“编辑”，选择按关系授信，勾选需要授信的机构，点击“保存”即可新增成功。用户也可以选择按额度授信，手动输入授信要素，点击“保存”即可新增成功，按额度授信的机构可选择合约额度扣减方式。

按关系设置

管理设置

内部管理

机构信息设置

同业存款账户设置

短信通知维护

本币费用管理

个人设置

行情显示设置

衍生品合约顺序

意向设置

我的关注券设置

报价提示设置

个人信息设置

成交单设置

交易设置

产品篮子维护

搭桥参数设置

衍生品交易参数设置

衍生品专属报价商设置

机构群组维护

限额管理

对手方管理

回购小助手

文件下载

对手方管理

对手方限额

质押RFQ白名单

市场

利率互换

方向

不限

渠道

银行间

交易方式

X-Swap

查询

本方

农业银行自营主体

对手方

主体类型

全部

合约额度扣减方式

编辑

按关系设置

按额度设置

X-Swap双边授信采用主体授信方式, 请对手方机构的自营主体、资管主体和代理主体分别设置授信

导出

	对手方类型	对手方机构	主体类型	交易账户主体	交易账户	授信关系	
✓	大型商业银行	工商银行	自营主体	工商银行自营主体	工商银行	是	
✓	大型商业银行	工商银行	代理主体	工商银行代理主体	前融雅苑资本立方基金	否	
✓	大型商业银行	中国银行	自营主体	中国银行自营主体	中国银行	否	
✓	大型商业银行	中国银行	代理主体	中国银行代理主体	测试0708-05	否	
✓	大型商业银行	中国银行	资管主体	中国银行资管主体	wyn中行资管交易账户	否	
✓	大型商业银行	建设银行	自营主体	建设银行自营主体	建设银行	是	
✓	大型商业银行	建设银行	代理主体	建设银行代理主体	hm66666	否	
✓	大型商业银行	建设银行	资管主体	建设银行资管主体	建行湖南	否	

按额度设置

管理设置

内部管理

机构信息设置

同业存款账户设置

短信通知维护

本币费用管理

个人设置

行情显示设置

衍生品合约顺序

意向设置

我的关注券设置

报价提示设置

个人信息设置

成交单设置

交易设置

产品篮子维护

搭桥参数设置

衍生品交易参数设置

衍生品专属报价商设置

机构群组维护

限额管理

对手方管理

回购小助手

文件下载

对手方管理

对手方限额

质押RFQ白名单

市场

利率互换

方向

不限

渠道

银行间

交易方式

X-Swap

查询

本方

农业银行自营主体

对手方

主体类型

全部

合约额度扣减方式

编辑

按关系设置

按额度设置

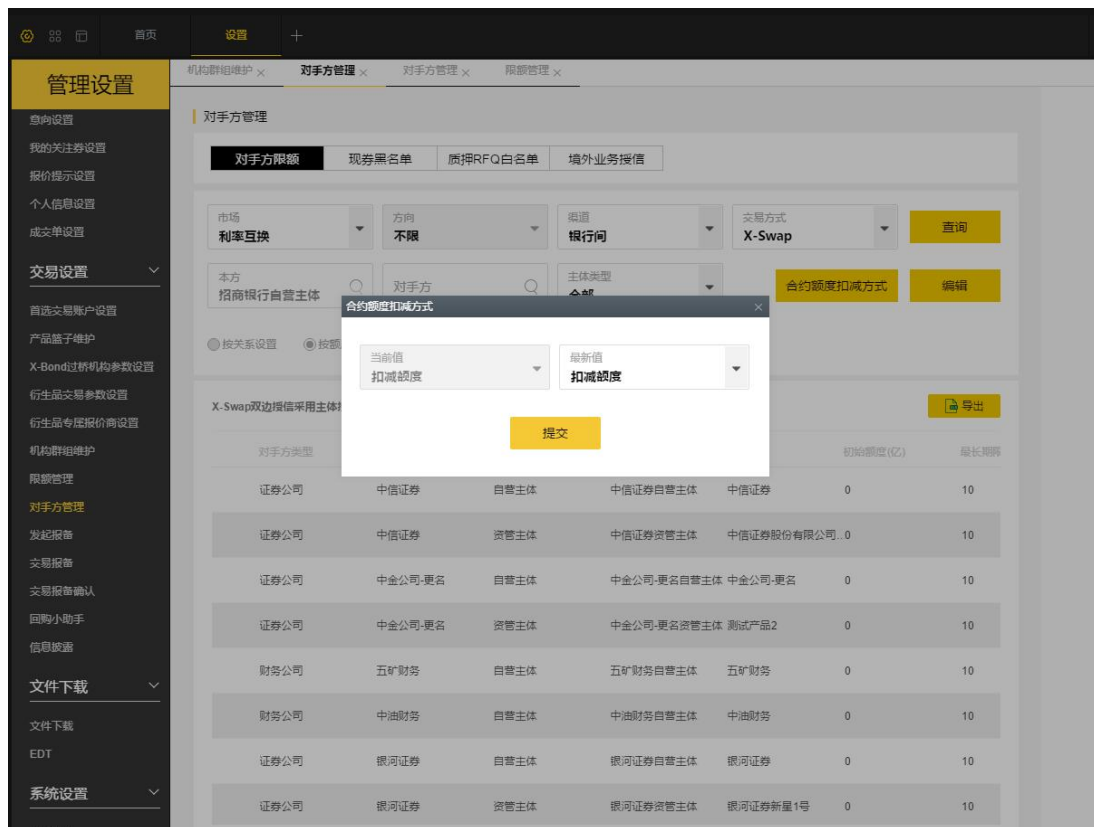
限额类型

X-Swap双边授信采用主体授信方式, 请对手方机构的自营主体、资管主体和代理主体分别设置授信

导入

导出

	对手方类型	对手方机构	主体类型	交易账户主体	交易账户	初始额度(亿)	最
✓	大型商业银行	工商银行	自营主体	工商银行自营主体	工商银行	0	
	大型商业银行	工商银行	代理主体	工商银行代理主体	前融雅苑资本立方基金	0	
	大型商业银行	中国银行	自营主体	中国银行自营主体	中国银行	0	
	大型商业银行	中国银行	代理主体	中国银行代理主体	测试0708-05	0	
	大型商业银行	中国银行	资管主体	中国银行资管主体	wyn中行资管交易账户	0	
	大型商业银行	建设银行	自营主体	建设银行自营主体	建设银行	0	
	大型商业银行	建设银行	代理主体	建设银行代理主体	hm66666	0	
	大型商业银行	建设银行	资管主体	建设银行资管主体	建行湖南	0	

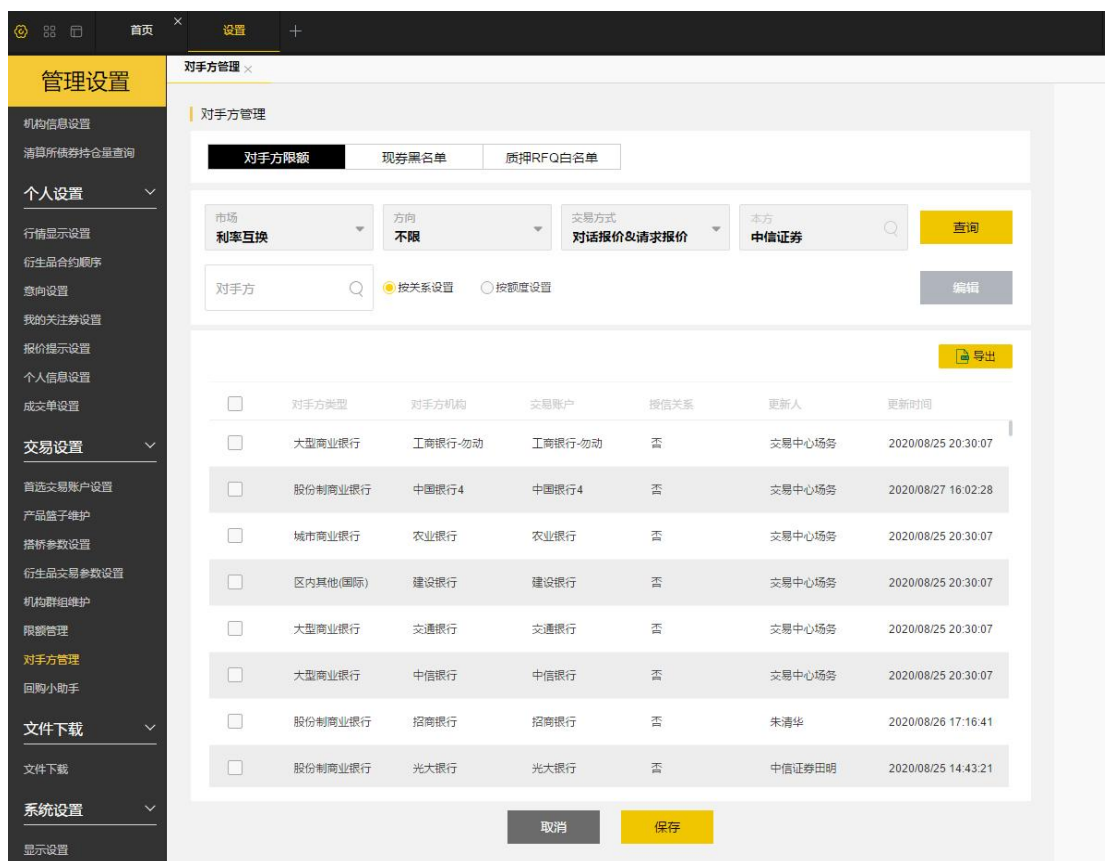


8.9.1.5 利率互换-对话报价&请求报价

当利率互换的交易方式选择“对话报价&请求报价”时，选择本方，点击“编辑”，选择关系授信或额度授信进行编辑。授信设置实时生效。

按关系设置

选择按关系授信，勾选需要授信的机构，点击“保存”即可新增成功。



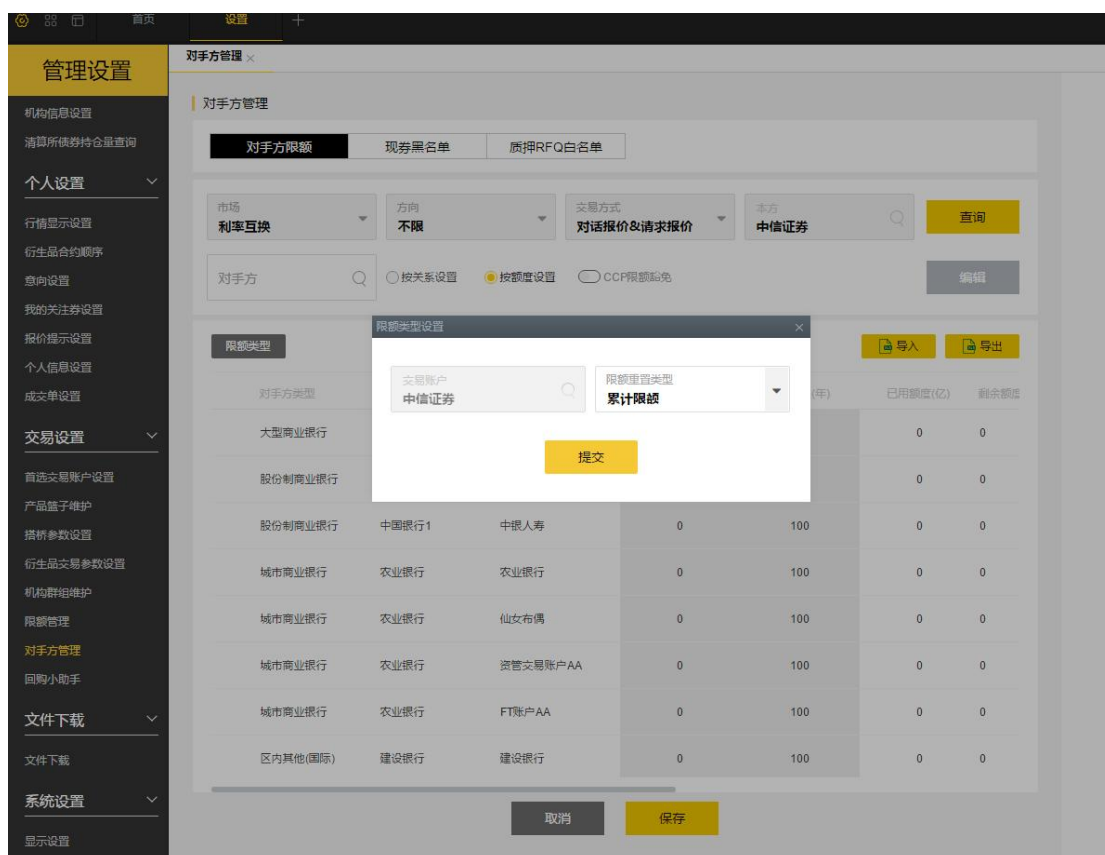
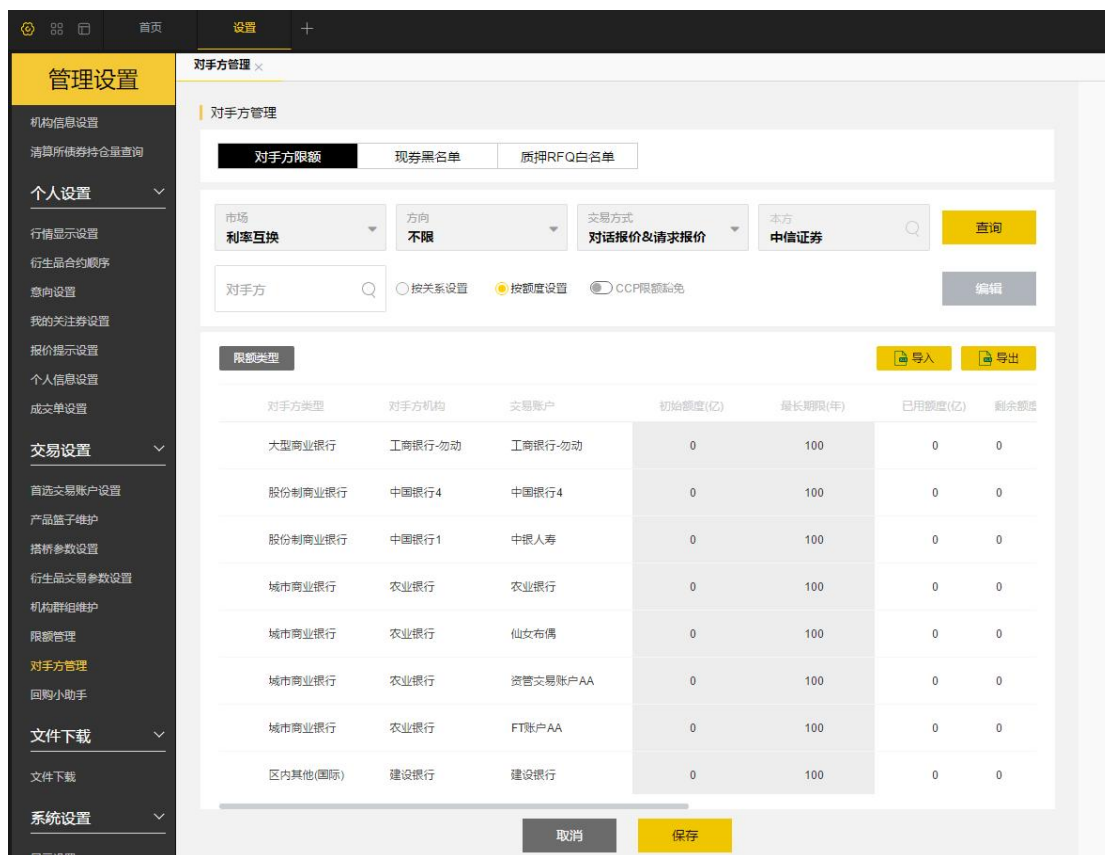
按额度设置

用户也可以选择按额度授信，手动输入授信要素，点击“保存”即可新增成功，按额度授信的机构可选择限额重置类型，以及是否开启 CCP 限额豁免。

选择限额类型为“每日限额”的，系统自动于每日开市前将剩余额度置为所设额度；选择限额类型为“累计限额”的，当日剩余额度在前一日剩余额度的基础上扣减。

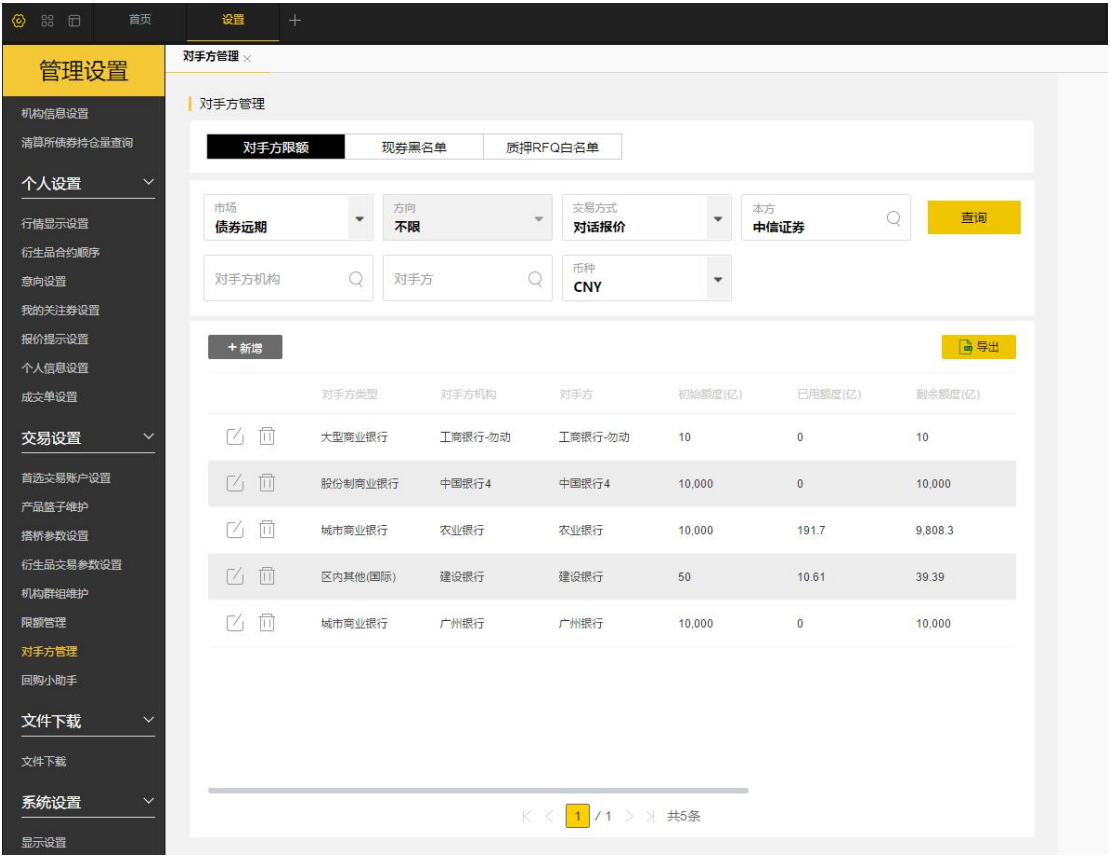
设置为 CCP 豁免状态下，机构选择清算方式为集中净额清算的对话报价成交时，对手方已用额度不扣减，（双边清算的对话成交仍正常扣减额度）。若用户设置非 CCP 豁免，则达成清算方式为集中净额清算或双边清算的对话报价成交时，均扣减对手方额度。

修改“初始额度”后，“已用额度”及“剩余额度”清零。

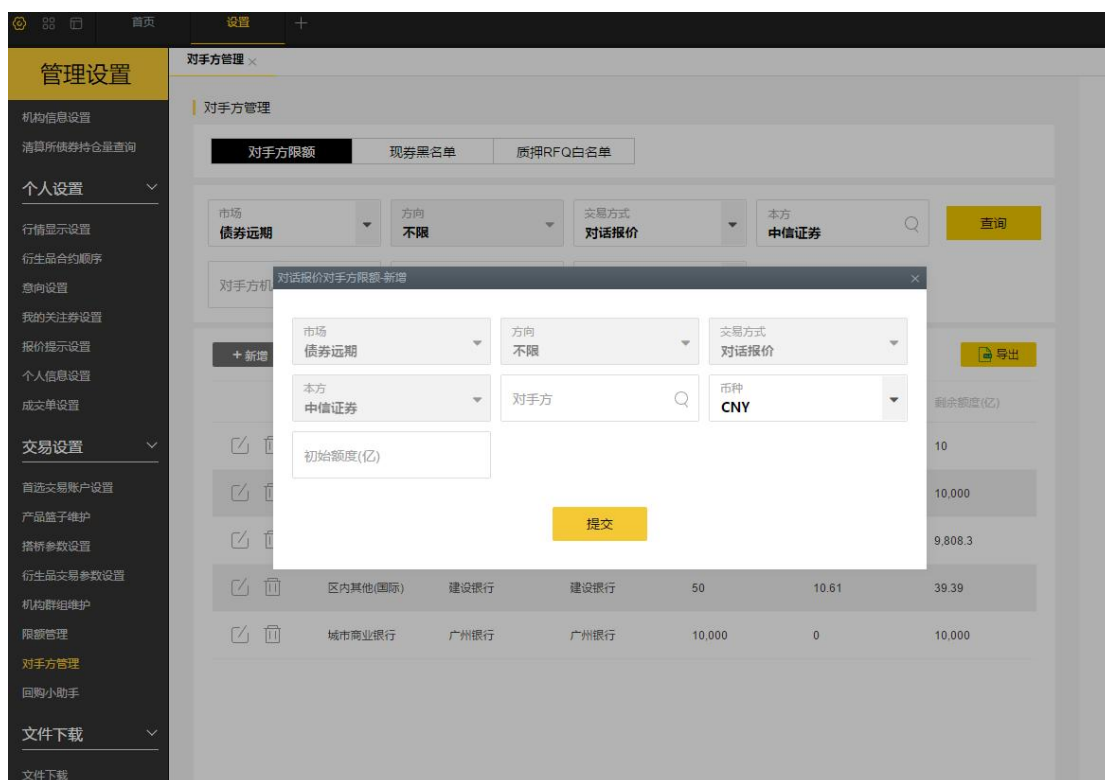


8.9.1.6 债券远期

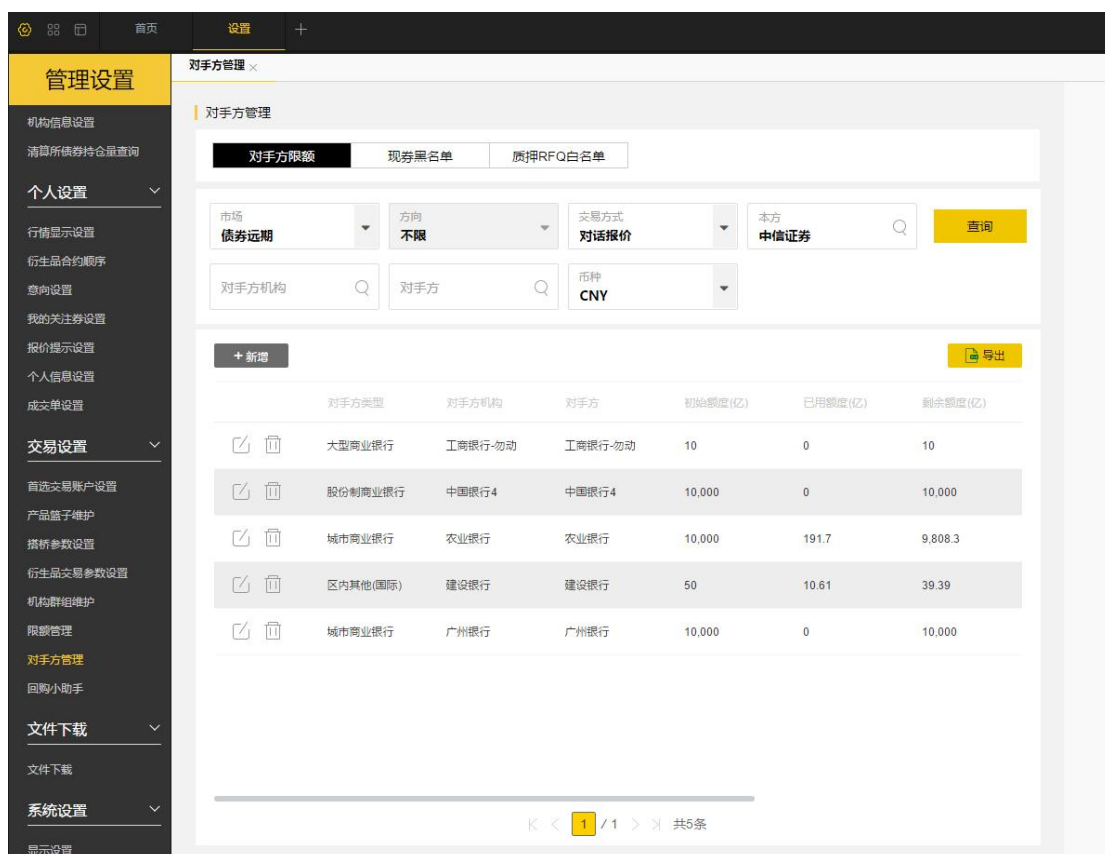
债券远期市场选择本方交易账户后，点击“查询”，显示本方交易账户设置超额度的对手方机构额度使用情况。

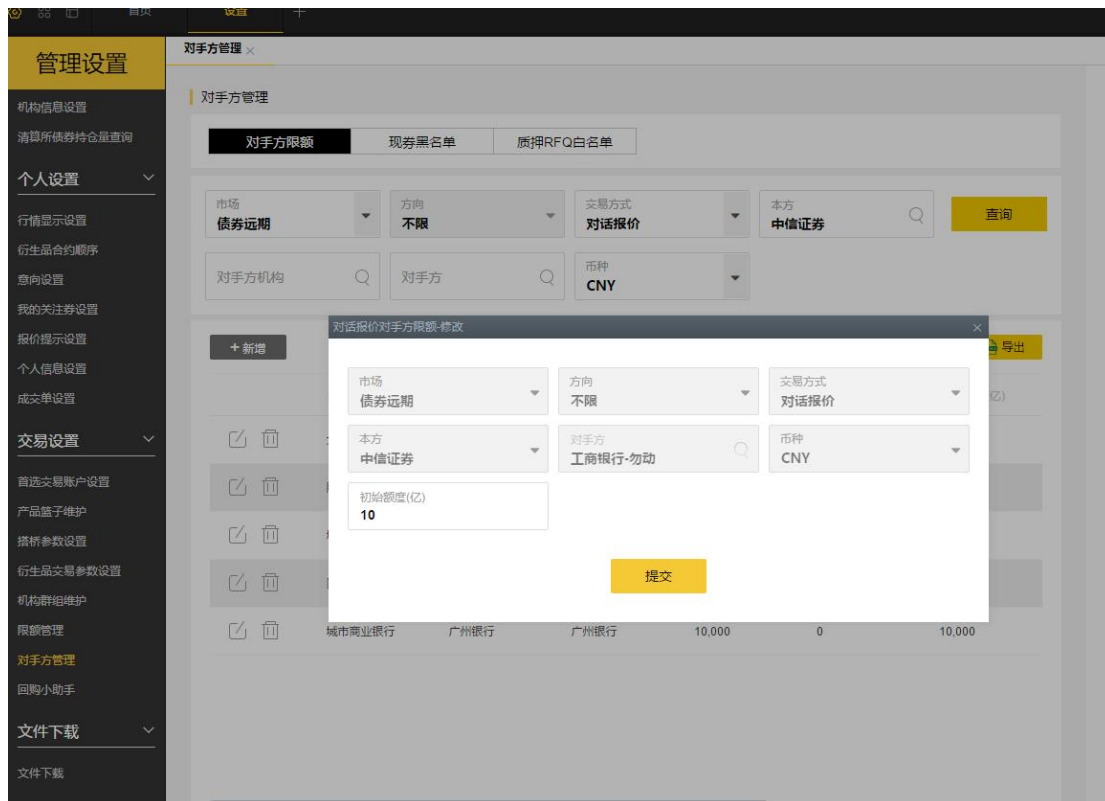


用户点击“新增”，选择对手方、币种，设置初始额度（亿），点击“提交”即可成功设置对手方债券远期限额，若用户未设置对手方限额，则系统默认对手方限额无限大。



在对手方限额查询结果清单中，可以点击左侧的修改  按钮进行修改，或点击删除  按钮删除额度记录。





用户可以点击  下载查询结果，保存至本地。

8.9.1.7 债券借贷-对话报价

“债券借贷”市场交易方式选择“对话报价”，点击“添加”后填写对手方限额要素，点击“确认”即可新增成功。也可点击  按钮，在模板中填写对手方限额数据，点击  按钮，检验通过后则可导入成功。同时可查询到额度记录后，点击左侧的修改  按钮进行修改，或点击删除  按钮删除额度记录。用户点击  后，可下载查询结果至本地查看。

☺

📄

🏠

首页

设置

+

管理设置

内部管理

机构信息设置

个人设置

行情显示设置

衍生品合约顺序

意向设置

我的关注券设置

报价提示设置

个人信息设置

成交单设置

交易设置

产品篮子维护

衍生品交易参数设置

机构群组维护

限额管理

对手方管理

回购小助手

文件下载

系统设置

显示设置

对手方管理

对手方限额

质押RFQ白名单

市场

债券借贷

方向

全部

交易方式

对话报价

本方

测试机构A

对手方机构

对手方

对手方类型

全部

查询

+ 添加

下载模板

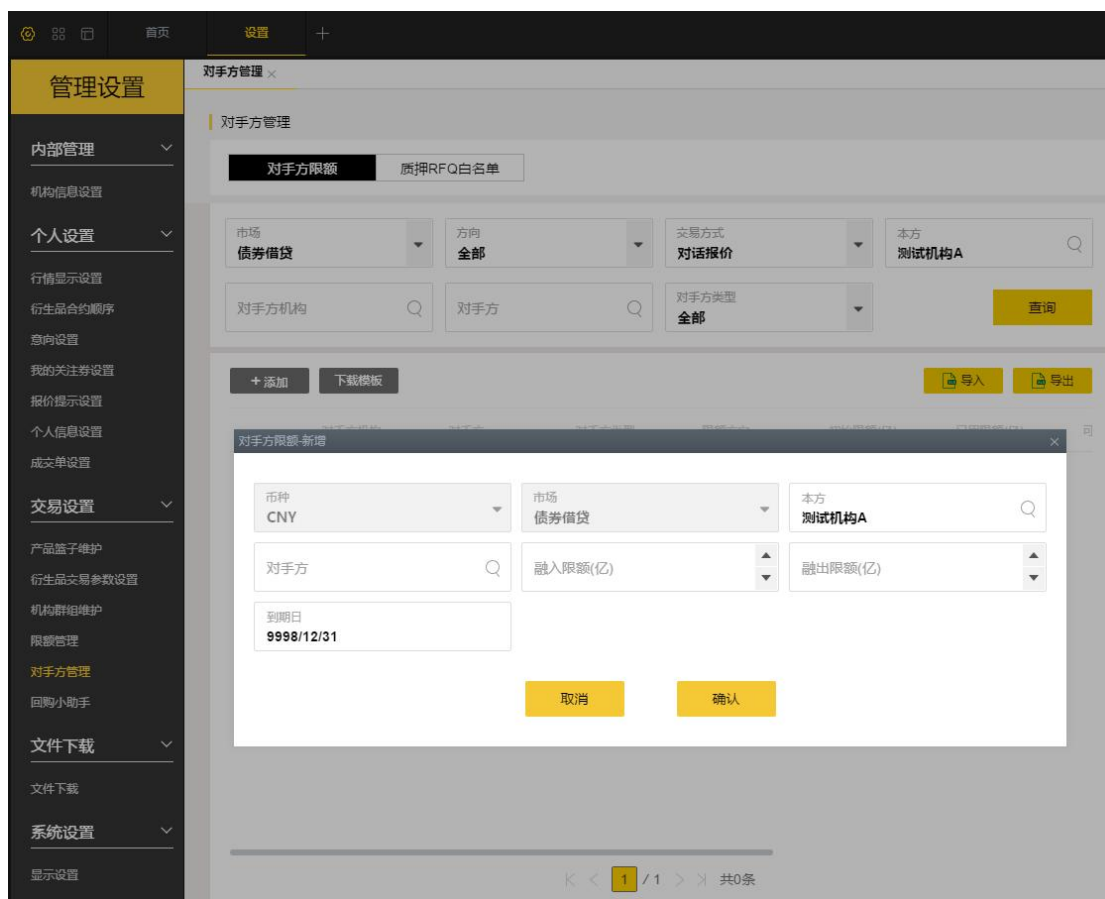
导入

导出

	对手方机构	对手方	对手方类型	限额方向	初始限额(亿)	已用限额(亿)	可
 	汇添富基金公司	汇添富基金公司	基金公司	融出	10	0.7	9.3
 	汇添富基金公司	汇添富基金公司	基金公司	融入	10	0	10

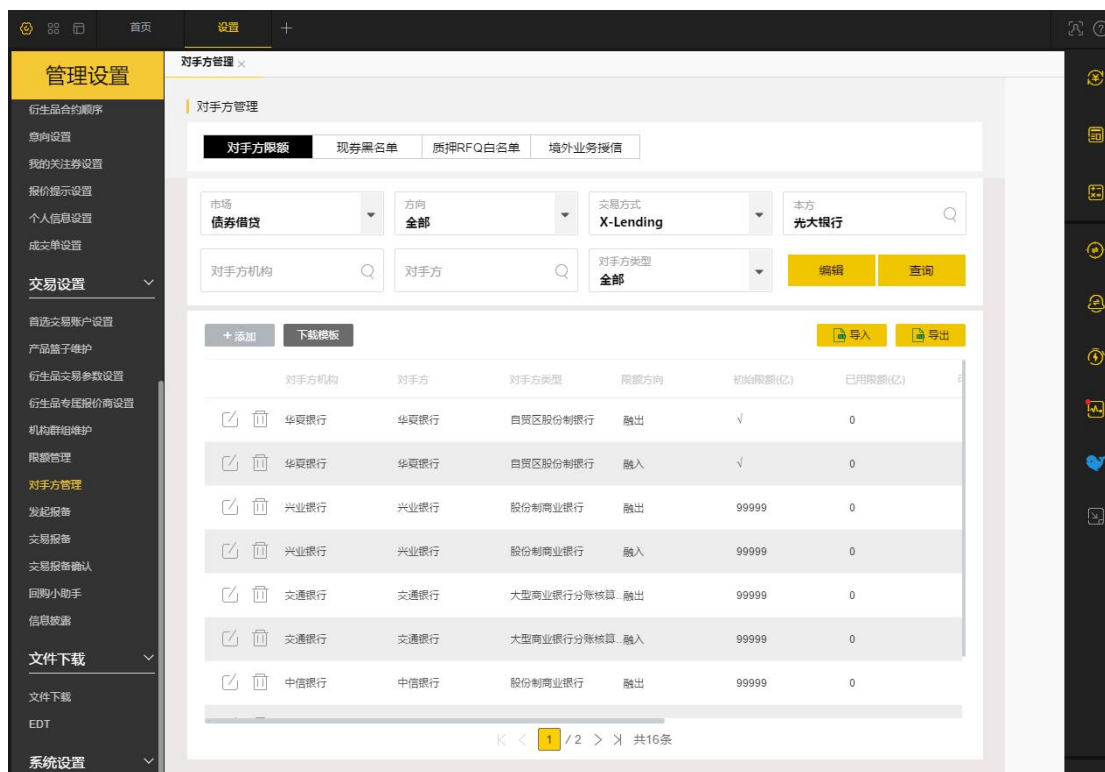
1 / 1

共2条



8.9.1.8 债券借贷-X-Lending

“债券借贷”市场交易方式选择“X-Lending”，输入本方交易账户后点击  按钮，可查看当前本方设置了对对手方限额的对手方列表，点击 ，可下载查询结果至本地查看。



点击 **编辑** 按钮，系统弹出提示“**修改对手方限额将冻结当前本方所有订单，是否确认修改？**”，点击确定则进入 X-Lending 对手方限额编辑模式，该模式下添加、修改、删除功能可用。

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场

债券借贷

方向

全部

交易方式

X-Lending

本方

光大银行

对手方机构

对手方

对手方类型

全部

编辑

查询

+ 添加

下载模板

消息提示

修改对手方限额将冻结当前本方所有订单，是否确认修改？

取消

确定

导入

导出

对手方机构	对手方	对手方类型	初始限额(亿)	已用限额(亿)	
华夏银行	华夏银行		√	0	
华夏银行	华夏银行		√	0	
兴业银行	兴业银行	股份制商业银行	融出	99999	0
兴业银行	兴业银行	股份制商业银行	融入	99999	0
交通银行	交通银行	大型商业银行分账核算...	融出	99999	0
交通银行	交通银行	大型商业银行分账核算...	融入	99999	0
中信银行	中信银行	股份制商业银行	融出	99999	0

1 / 2

共16条

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场

债券借贷

方向

全部

交易方式

X-Lending

本方

光大银行

对手方机构

对手方

对手方类型

全部

编辑

查询

+ 添加

下载模板

导入

导出

对手方机构	对手方	对手方类型	限额方向	初始限额(亿)	已用限额(亿)
华夏银行	华夏银行	自贸区股份制银行	融出	√	0
华夏银行	华夏银行	自贸区股份制银行	融入	√	0
兴业银行	兴业银行	股份制商业银行	融出	99999	0
兴业银行	兴业银行	股份制商业银行	融入	99999	0
交通银行	交通银行	大型商业银行分账核算...	融出	99999	0
交通银行	交通银行	大型商业银行分账核算...	融入	99999	0
中信银行	中信银行	股份制商业银行	融出	99999	0

退出编辑

在编辑模式下，点击按钮，填写对手方限额要素，融入/融出限额可择在左侧方框打“√”或者在右侧数值框填写初始限额数值；点击“确认”即可新增成功。

对手方限额-新增

币种

CNY

市场

债券借贷

本方

光大银行

对手方

融入限额

☐ / 亿

融出限额

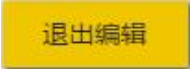
☐ / 亿

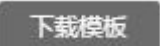
到期日

9998/12/31

取消

确认

在编辑模式下，点击左侧的修改按钮进行修改，或点击删除按钮将相应方向的对手方额度置为 0，新增、修改、删除操作完成后，需点击按钮，退出编辑模式后，本方才能进行 X-Lending 匿名交易。

点击  按钮，在模板中填写对手方限额数据，或者直接修改导出的数据后，在非编辑模式下点击  按钮，校验通过后可导入成功。

8.9.1.9 同业存款

“同业存款”市场选择本方后，点击“新增”后填写对手方限额要素，点击“确认”即可新增成功。同时可查询到额度记录后，点击左侧的修改  按钮进行修改，或点击删除  按钮删除额度记录。用户点击  后，可下载查询结果至本地查看。

管理设置

内部标签设置

用户信息查询

机构信息设置

清算所债券持仓量查询

关联机构维护

同业存款账户设置

个人设置

行情显示设置

衍生品合约顺序

意向设置

我的关注券设置

报价提示设置

个人信息设置

成交单设置

交易设置

首选交易账户设置

产品篮子维护

搭桥参数设置

衍生品交易参数设置

机构群组维护

限额管理

对手方管理

发起报备

交易报备

同业存款账户设置 ×

对手方管理 ×

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场

同业存款

交易方式

对话报价

本方

西安银行

对手方机构

对手方类型

全部

查询

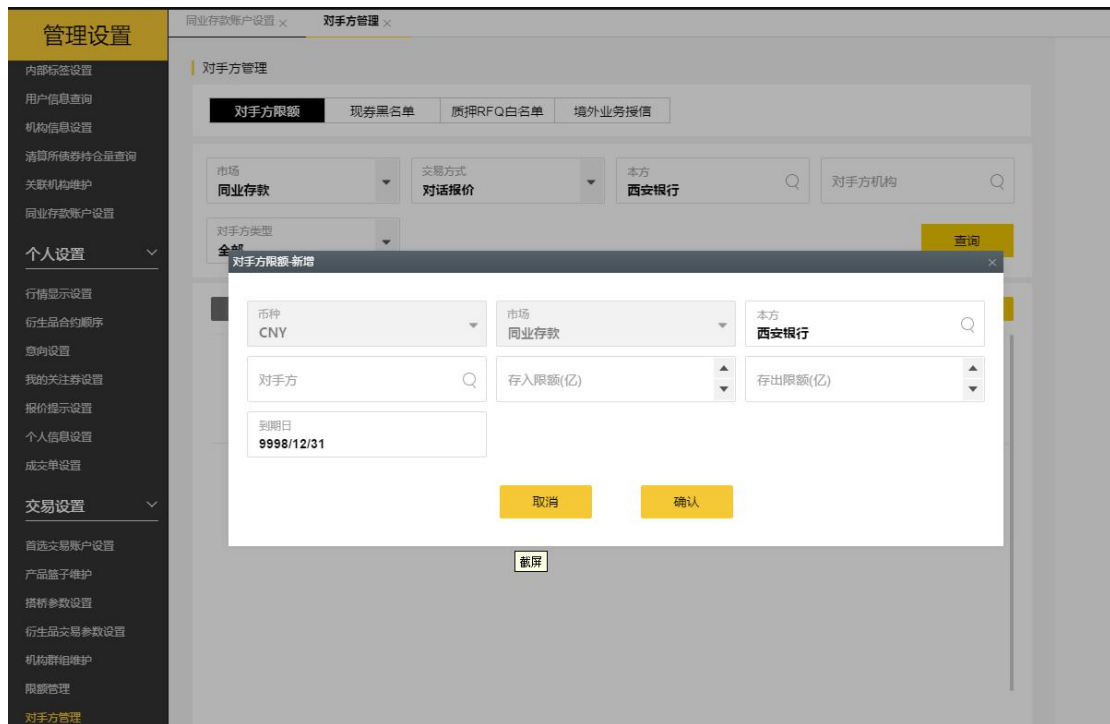
+ 新增

导出

对手方机构	对手方类型	存入			存出			到期日
		限额 (亿)	已用 (亿)	可用 (亿)	限额 (亿)	已用 (亿)	可用 (亿)	

1 / 1

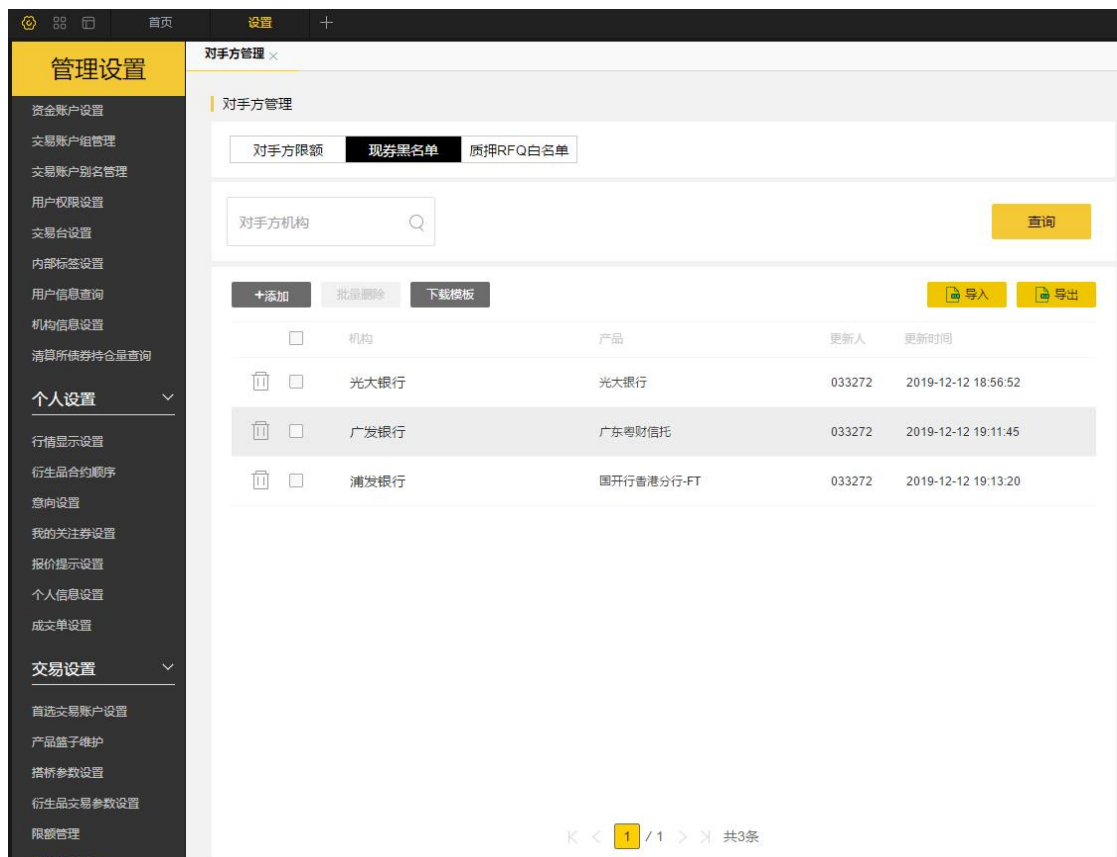
共0条



8.9.2 现券黑名单

用户可查询或设置现券黑名单。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“对手方管理”->“现券黑名单”进入。



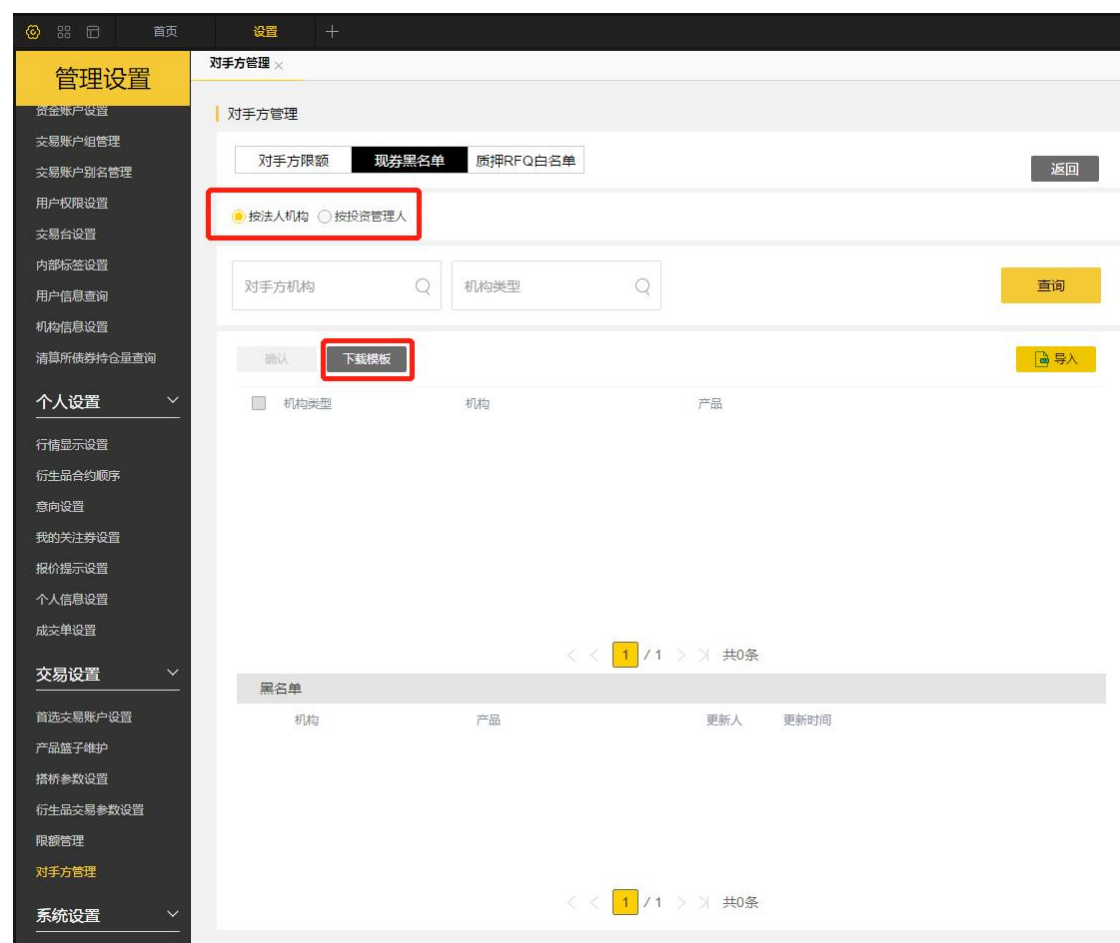
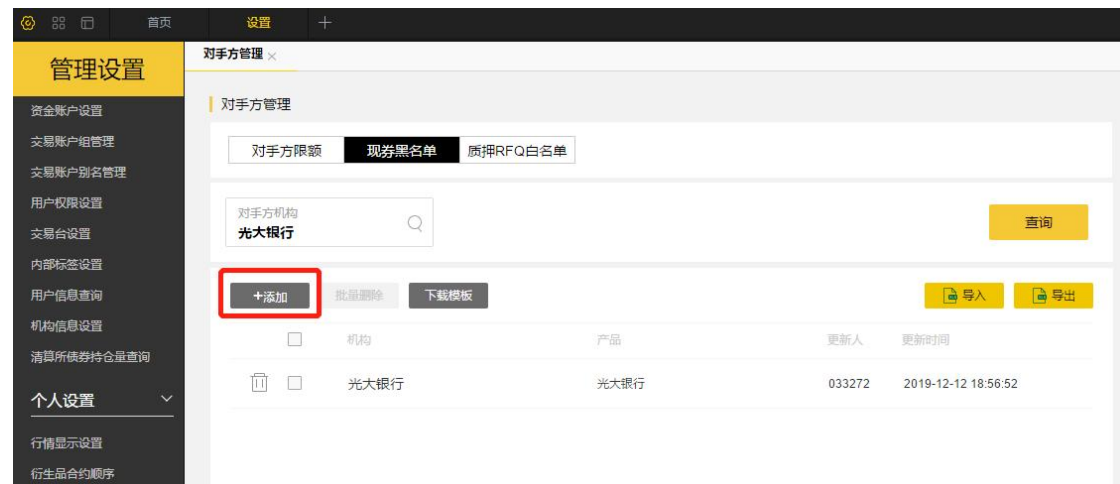
1. 查询现券黑名单

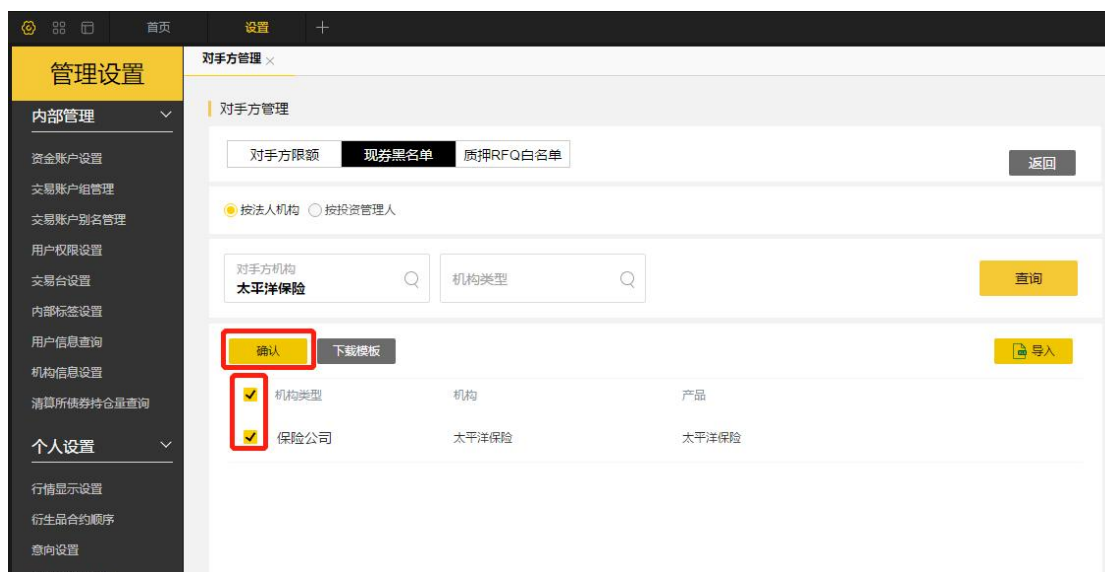
用户所在的交易账户具有任一做市机构、指示性报价机构的业务资格或者交易账户有匿名点击的权限才可查询现券黑名单。选择“对手方机构”，点击“查询”，查询界面展示对应账户维护黑名单信息，按照机构和其下交易账户展示黑名单。用户可以点击下载查询结果，保存至本地。



2. 新增现券黑名单

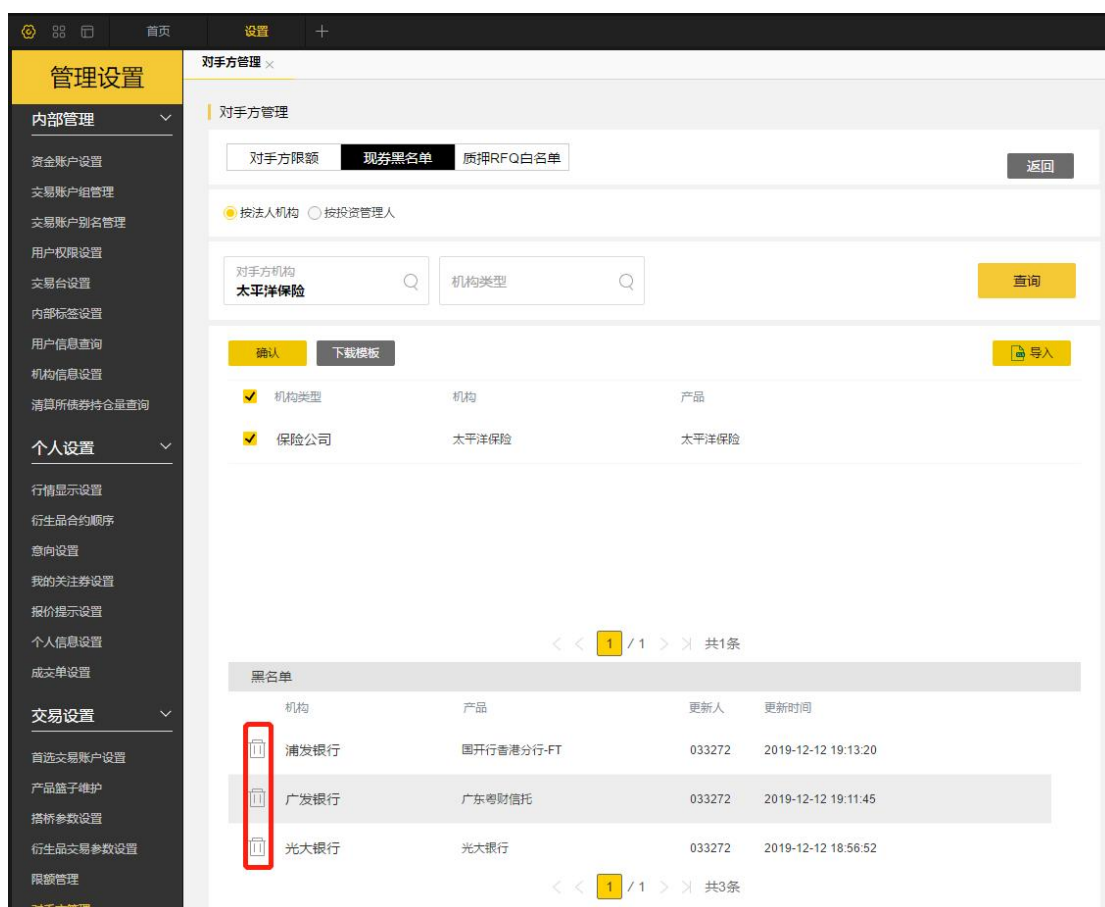
点击“添加”，选择“按法人机构”或“按投资管理人”设置。用户可以选择“对手方机构”、“机构类型”直接搜索添加，或者选择“下载模板”通过“导入”批量添加。点击“确认”即添加成功。

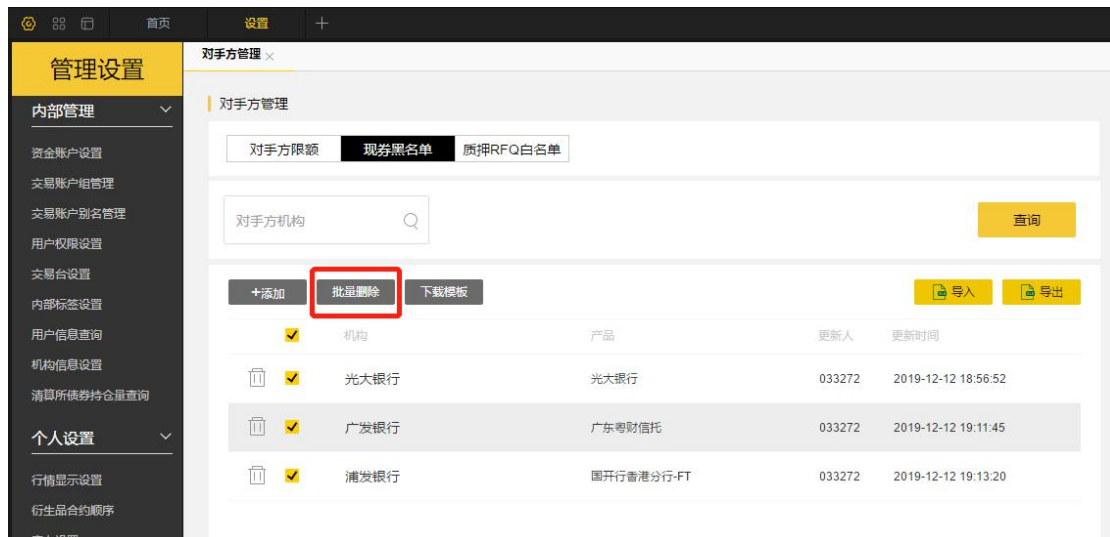




3. 删除现券黑名单

用户可在添加页面或者查询页面通过点击黑名单列表  图标删除黑名单，用户也可选择批量打勾进行批量删除。





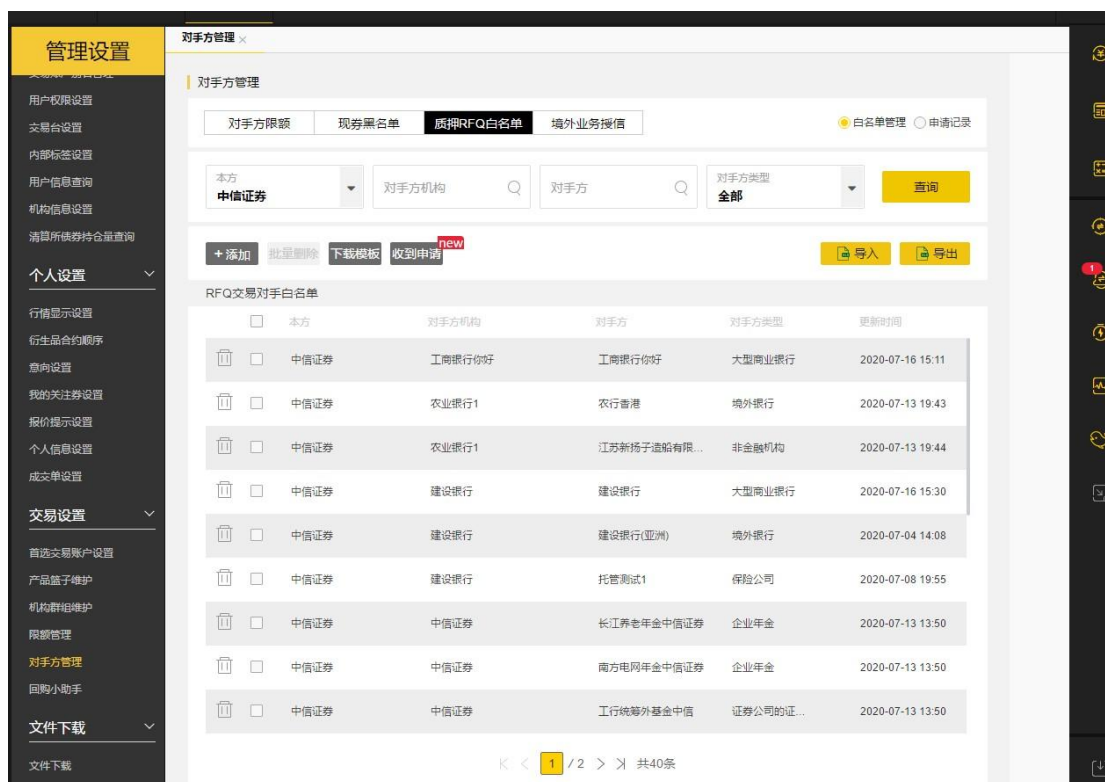
8.9.3 质押 RFQ 白名单

8.9.3.1 白名单管理

用户所属交易账户必须具备“资金交易商”业务资格，同时自身需具备限额查询-对手方限额权限时，才能进行 RFQ 白名单维护或处理收到的添加白名单申请。用户可通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“对手方管理”->“质押 RFQ 白名单”->“白名单管理”进入。

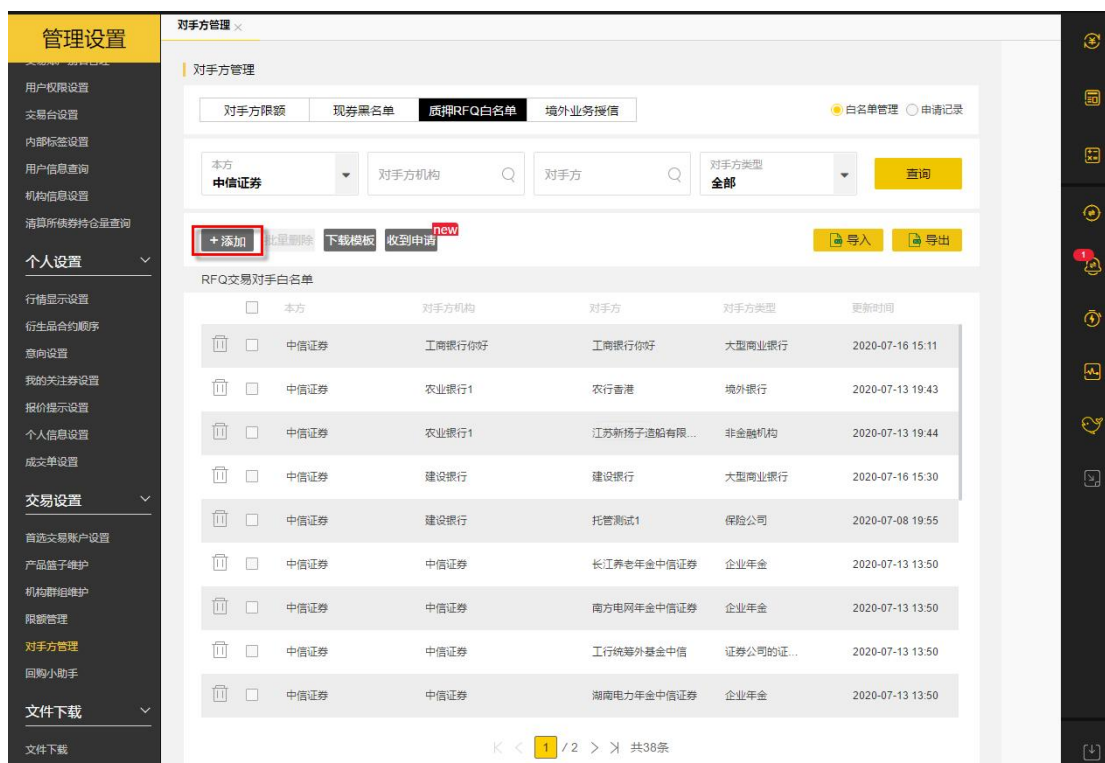
1. 查询质押 RFQ 白名单

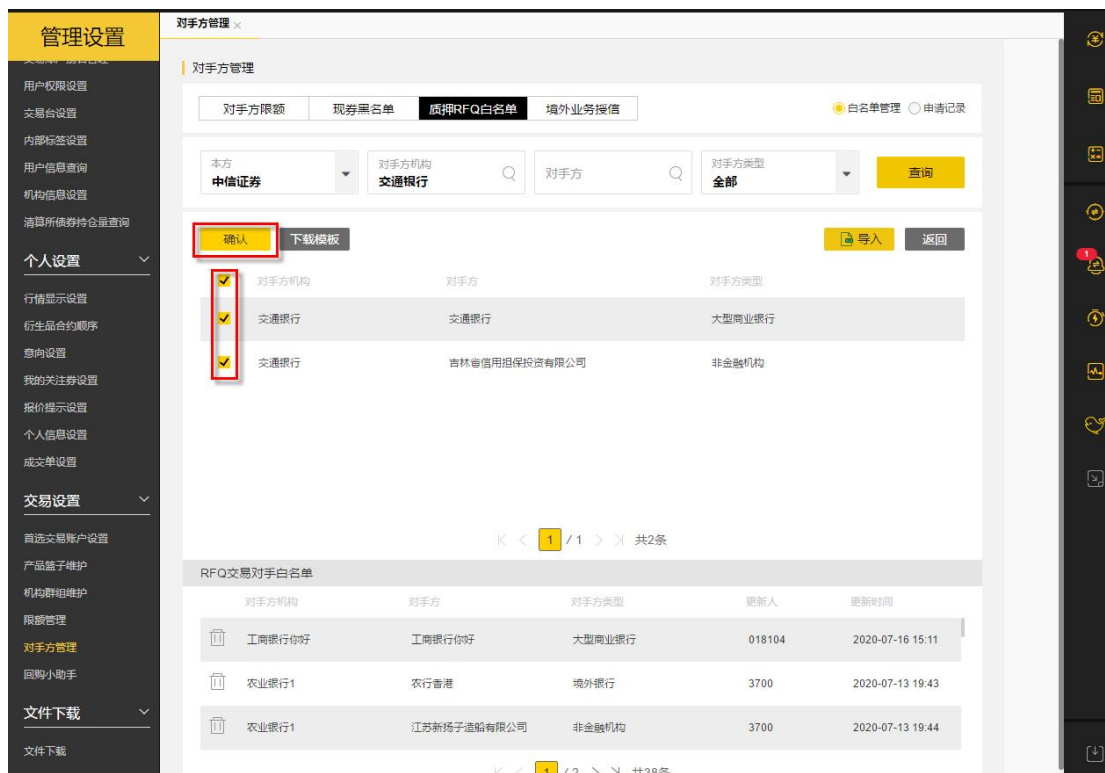
选择“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”，点击“查询”，查询展示本方的 RFQ 交易对手白名单。用户可以点击  下载查询结果，保存至本地。



2. 添加质押 RFQ 白名单

点击“添加”，选择“对手方机构”或“对手方”或“对手方类型”，点击“查询”，勾选需要添加的对手方，点击确认即可添加成功。用户也可选择点击“下载模板”下载模板，再通过“导入”按钮批量导入。

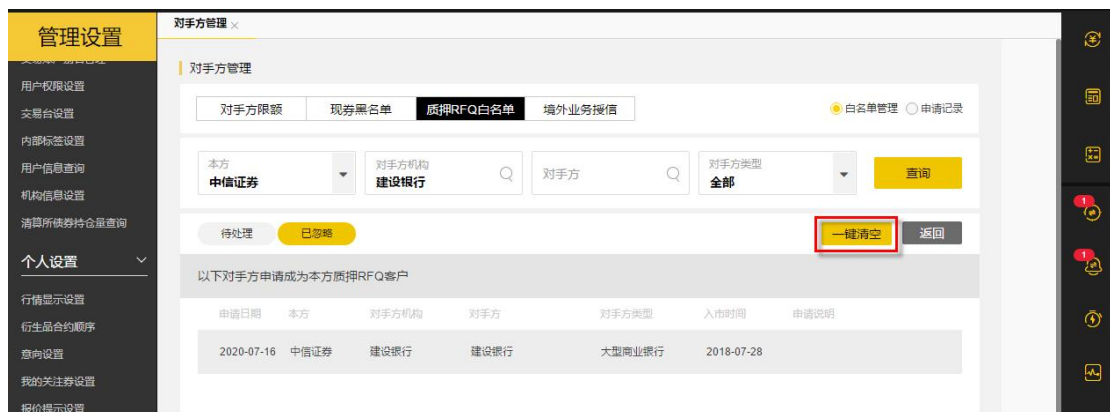
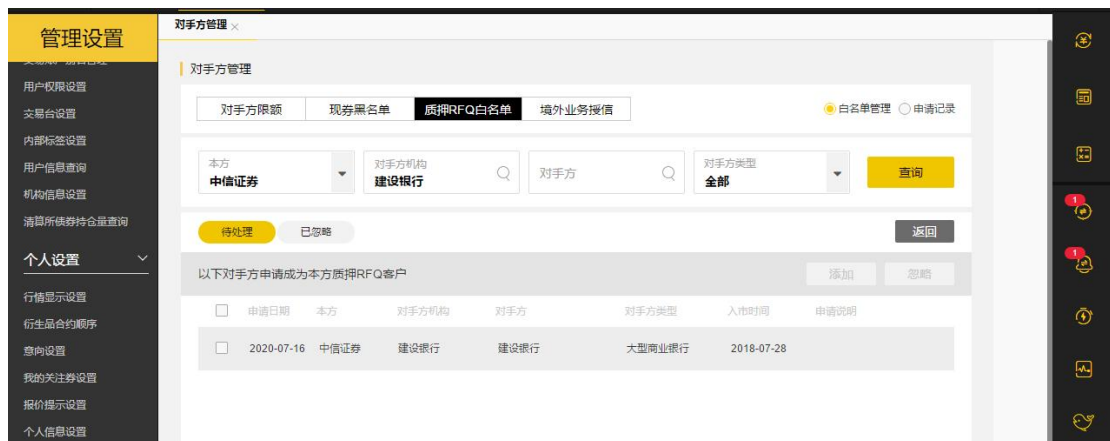




3. 处理收到的添加白名单申请

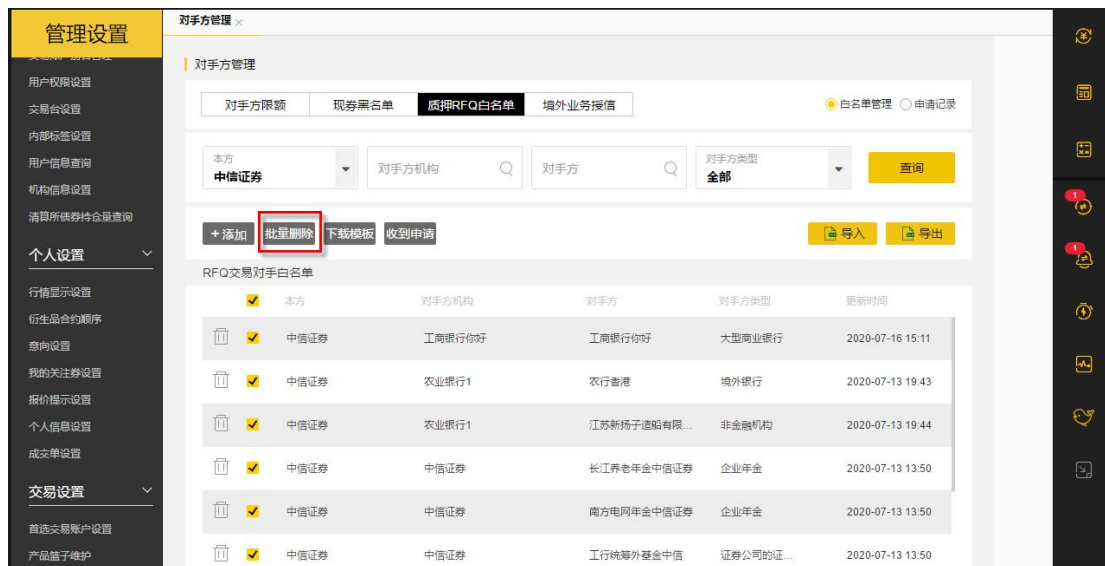
用户可通过两种方式进入白名单申请处理页面并进行操作：一是在收到对手方的白名单申请后，通过对手方管理进入“质押 RFQ 白名单”下，点击白名单中的“收到申请”进入待处理界面，进行白名单添加操作，二是在消息盒子中双击收到的白名单申请提示跳转至“质押 RFQ 白名单”下的待处理界面，进行白名单添加操作。

在跳转至白名单添加操作页面后，用户可选择“对手方机构”、“对手方”、“对手方类型”，通过“查询”展示申请成为本方质押 RFQ 客户的对手方列表。用户通过点击“待处理”、“已忽略”按钮来进行机构状态区分，通过勾选对手方申请记录，点击“添加”或者“忽略”进行操作。点击“添加”则对手方添加至白名单，点击“忽略”则对手方加入已忽略列表。点击“已忽略”进入忽略列表，用户可点击“一键清空”清空忽略列表。



4. 删除质押 RFQ 白名单

在查询页面，用户可点击  删除白名单列表，用户也可勾选列表，点击“批量删除”进行批量删除。

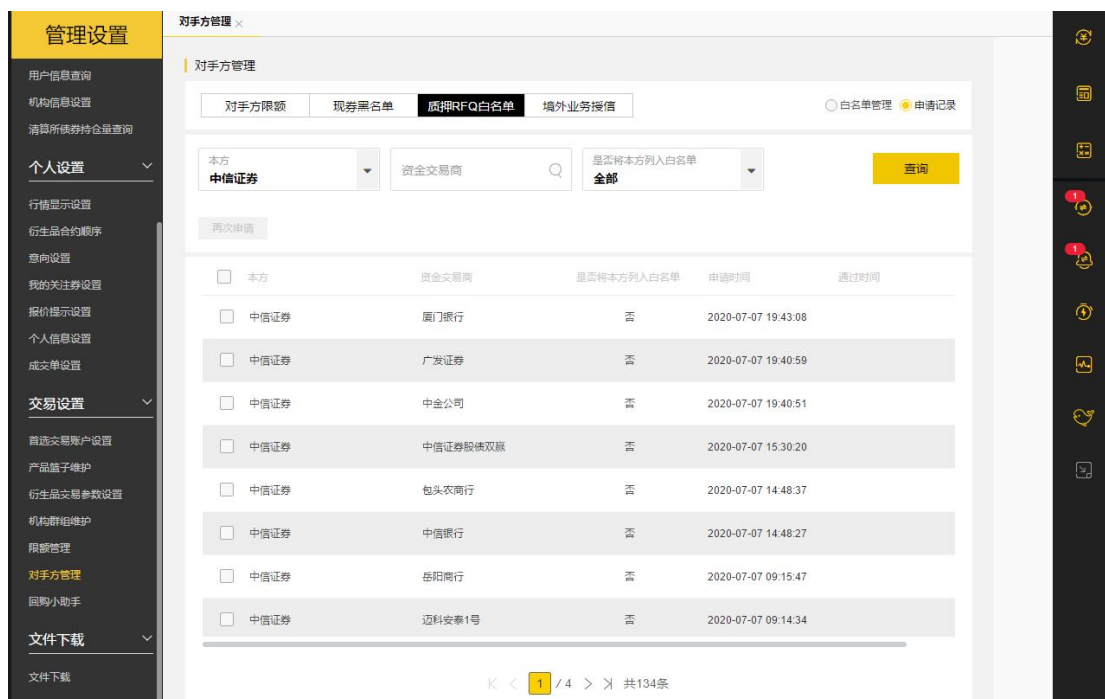


8.9.3.2 申请记录

用户有质押式回购请求报价权限，才能进行 RFQ 白名单申请记录查询以及再次申请成为资金交易商的白名单。用户可通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“对手方管理”->“质押 RFQ 白名单”->“申请记录”进入。

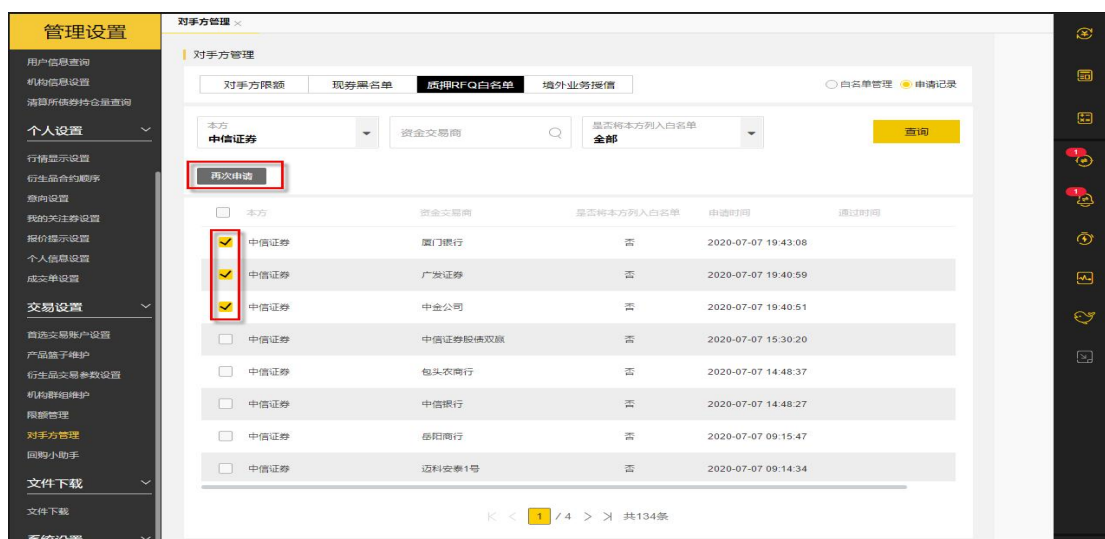
1. 查询质押 RFQ 白名单申请记录

选择“本方”或“资金交易商”或“是否将本方列入白名单”，点击 **查询**，展示市场上所有的资金交易商是否将本方列入质押 RFQ 白名单的查询记录。



2. 再次发起质押 RFQ 白名单申请

选中是否将本方列入白名单为否且申请时间不为当日或是否将本方列入白名单为否且申请时间为空的记录，点击 **再次申请**，可单个或批量申请加入为选中资金交易商的白名单。



8.9.4 境外业务授信

在做市商或尝试做市商机构下的用户，有机构权限-交易设置-境外业务授信权限时，可以查看并维护本做市机构的授信信息。用户可通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“对手方管理”->“境外业务授信”进入。

1. 查询

做市机构用户可以通过查询功能，查看本机构对境外机构的授信情况，当收到境外机构的授信请求时，也可通过查询功能获取并处理授信请求。

选择“境外机构”以及“渠道”和“第三方平台”，点击“查询”，查看对应的境外机构授信信息。

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场
现券买卖

机构名称

渠道
全部

第三方平台
全部

状态
全部

查询

确认授信

拒绝

取消授信

☐	机构简称	机构全称	状态	渠道	第三方平台	付费方式	境/
☐	浦发银行	上海浦东发展银行	已确认	Direct	TW	Client Pay	
☐	建设银行B	中国建设银行股份有...	待确认	债券通	TW		
☐	建行香港	中国建设银行股份有...	已确认	Direct	TW		
☐	中银香港资管-bc	中银香港资产管理有...	已确认	债券通	TW		
☐	信银（香港）资本-bc	信银（香港）资本有...	待确认	债券通	TW		
☐	华夏基金香港-bc	华夏基金(香港)有限...	已确认	债券通	TW		
☐	博时基金国际-bc	博时基金（国际）有...	已确认	债券通	TW		
☐	富邦华一银行	富邦华一银行有限公司	已确认	债券通	TW		

1

/ 1

共10条

2. 确认授信

针对状态为“待确认”的记录，通过机构前面的全选按钮，或者逐条勾选需要确认的授

信请求，点击 **确认授信**，可批量或者逐条确认境外机构的授信申请。

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场

现券买卖

机构名称

渠道

全部

第三方平台

全部

状态

全部

查询

确认授信

拒绝

取消授信

☐	机构简称	机构全称	状态	渠道	第三方平台	付款方式	境外
☐	浦发银行	上海浦东发展银行	已确认	Direct	TW	Client Pay	
☒	建设银行B	中国建设银行股份有...	待确认	债券通	TW		
☐	建行香港	中国建设银行股份有...	已确认	Direct	TW		
☐	中银香港资管-bc	中银香港资产管理有...	已确认	债券通	TW		
☐	信银（香港）资本-bc	信银（香港）资本有...	待确认	债券通	TW		
☐	华夏基金香港-bc	华夏基金(香港)有限...	已确认	债券通	TW		
☐	博时基金国际-bc	博时基金（国际）有...	已确认	债券通	TW		
☐	富邦华一银行	富邦华一银行有限公司	已确认	债券通	TW		

1 / 1

共10条

3. 拒绝授信

针对状态为“待确认”的记录，通过机构前面的全选按钮，或者逐条勾选需要拒绝的授信请求，点击

拒绝

，可批量或者逐条拒绝境外机构的授信申请。

已拒绝的请求不可再进行任何其它操作，已拒绝的境外机构可再次向本机构发送授信请求。

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场

现券买卖

机构名称

渠道

全部

第三方平台

全部

状态

全部

查询

确认授信

拒绝

取消授信

☐	机构简称	机构全称	状态	渠道	第三方平台	付款方式	境外
☐	浦发银行	上海浦东发展银行	已确认	Direct	TW	Client Pay	
☒	建设银行B	中国建设银行股份有...	待确认	债券通	TW		
☐	建行香港	中国建设银行股份有...	已确认	Direct	TW		
☐	中银香港资管-bc	中银香港资产管理有...	已确认	债券通	TW		
☐	信银（香港）资本-bc	信银（香港）资本有...	待确认	债券通	TW		
☐	华夏基金香港-bc	华夏基金(香港)有限...	已确认	债券通	TW		
☐	博时基金国际-bc	博时基金（国际）有...	已确认	债券通	TW		
☐	富邦华一银行	富邦华一银行有限公司	已确认	债券通	TW		

1

/ 1

>

<

共10条

4. 取消授信

针对状态为“已确认”的记录，通过机构前面的全选按钮，或者逐条勾选需要拒绝的授信请求，点击 **取消授信**，可批量或者逐条取消对境外机构的授信。

机构状态为已取消的记录不可再做任何其它操作，已取消的境外机构可再次向本机构发送授信请求。

对手方管理

对手方限额

现券黑名单

质押RFQ白名单

境外业务授信

市场
现券买卖

机构名称

渠道
全部

第三方平台
全部

状态
全部

查询

确认授信

拒绝

取消授信

☐	机构简称	机构全称	状态	渠道	第三方平台	付费方式	境外
☒	浦发银行	上海浦东发展银行	已确认	Direct	TW	Client Pay	
☐	建设银行B	中国建设银行股份有...	待确认	债券通	TW		
☐	建行香港	中国建设银行股份有...	已确认	Direct	TW		
☐	中银香港资管-bc	中银香港资产管理有...	已确认	债券通	TW		
☐	信银（香港）资本-bc	信银（香港）资本有...	待确认	债券通	TW		
☐	华夏基金香港-bc	华夏基金(香港)有限...	已确认	债券通	TW		
☐	博时基金国际-bc	博时基金（国际）有...	已确认	债券通	TW		
☐	富邦华一银行	富邦华一银行有限公司	已确认	债券通	TW		

<

<

1

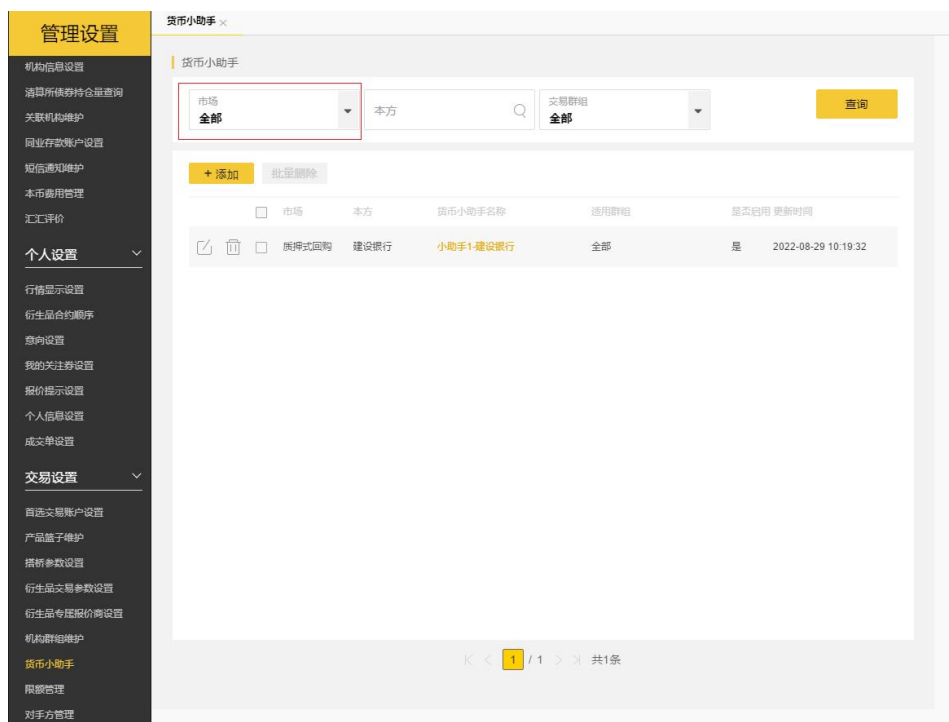
>

>

共10条

8.10 货币小助手

货币小助手用于质押式回购市场和信用拆借市场数据校验。可以根据选择市场不同进入不同市场小助手设置和查询界面。



8.10.1 质押式回购小助手

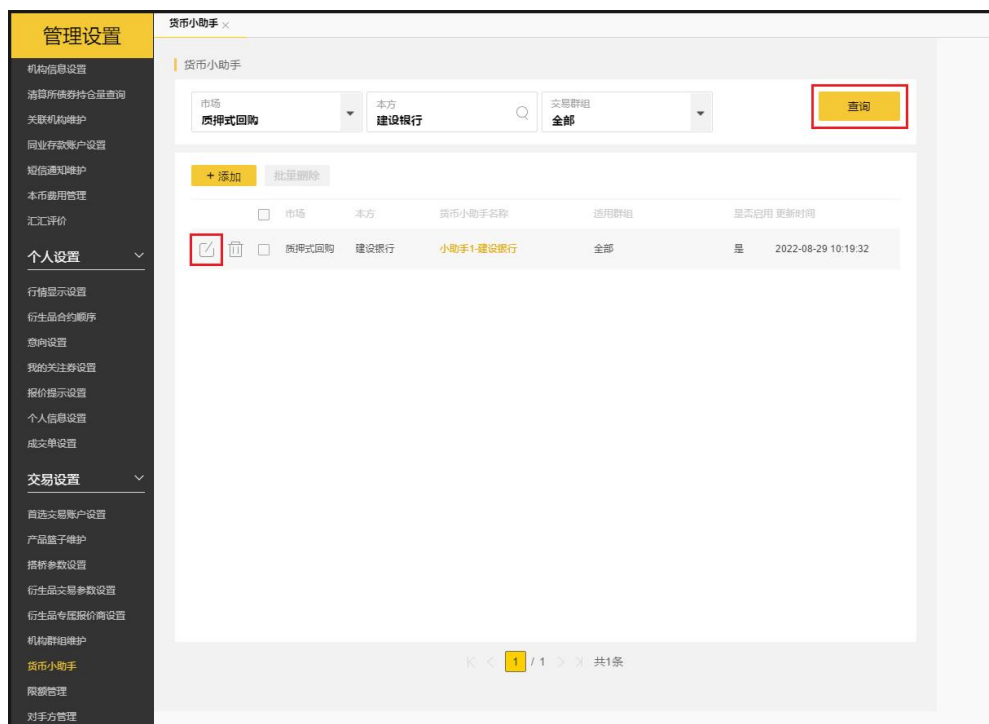
回购小助手主要用于在质押式回购提券管理和提券白屏时的数据校验。

用户任一身份下有请求报价、请求回复、对话报价任一权限时用户可对回购小助手进行查询和设置操作。

登录系统后，用户可通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“货币小助手”“市场”选择“质押式回购”进入。

1. 回购小助手查询

用户选择“本方”、“交易群组”后，点击 **查询**，可查看当前设置的回购小助手情况。

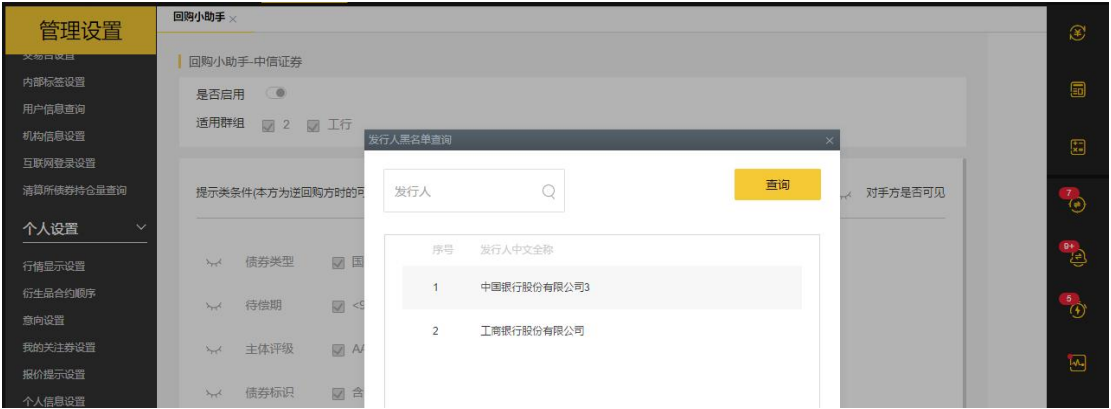


点击查询结果中，“回购小助手名称”的具体名称，可查看对应本方设置的回购小助手详情。



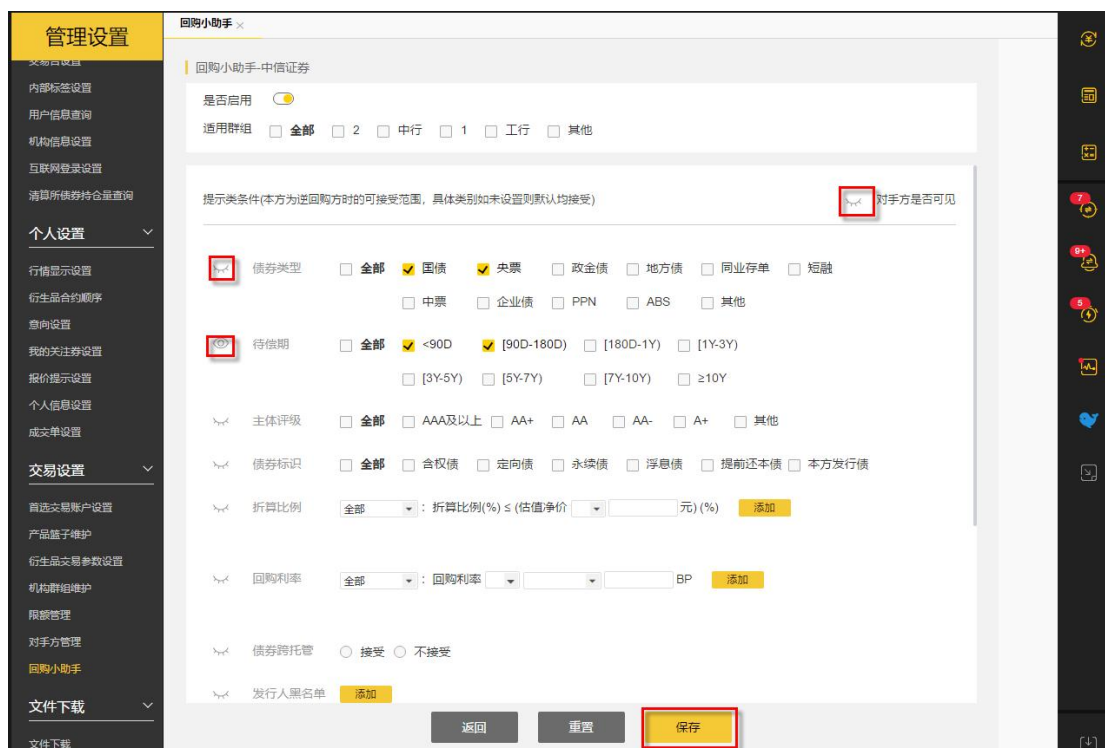
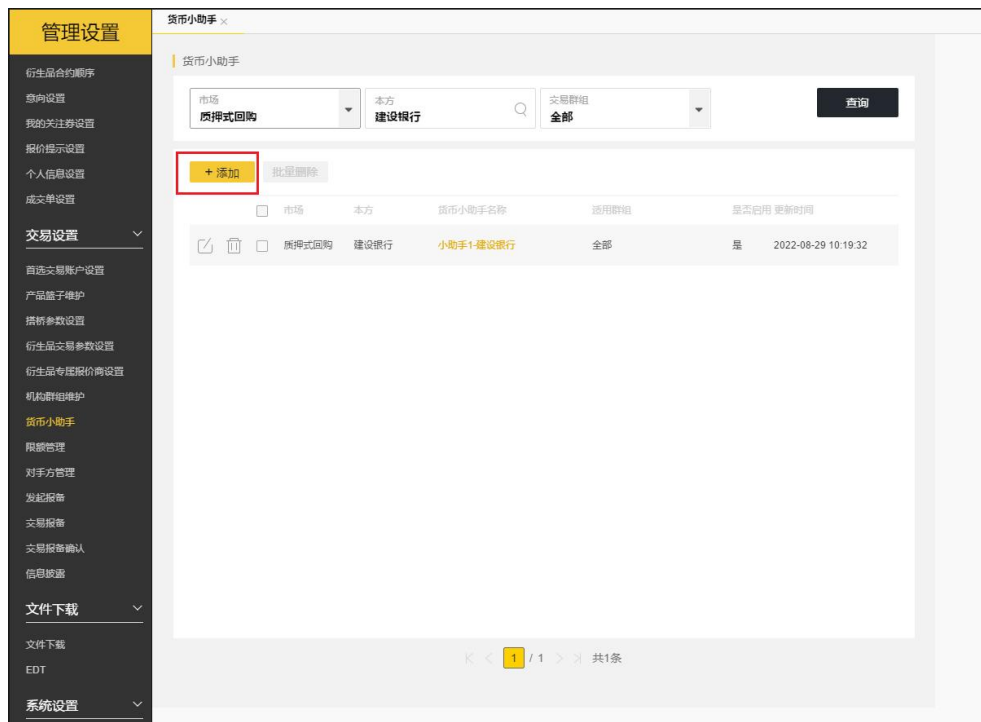
在详情界面点击发行人黑名单后 **查询** 可查看设置的发行人黑名单，点击债券黑名单后的 **查询** 可查看设置的债券黑名单，点击查询界面  可对对应的回购小助手进行修改

操作，修改后点击保存生效。



2. 回购小助手添加

用户在回购小助手查询界面选择本方后，点击 **+ 添加**，进入回购小助手设置界面。

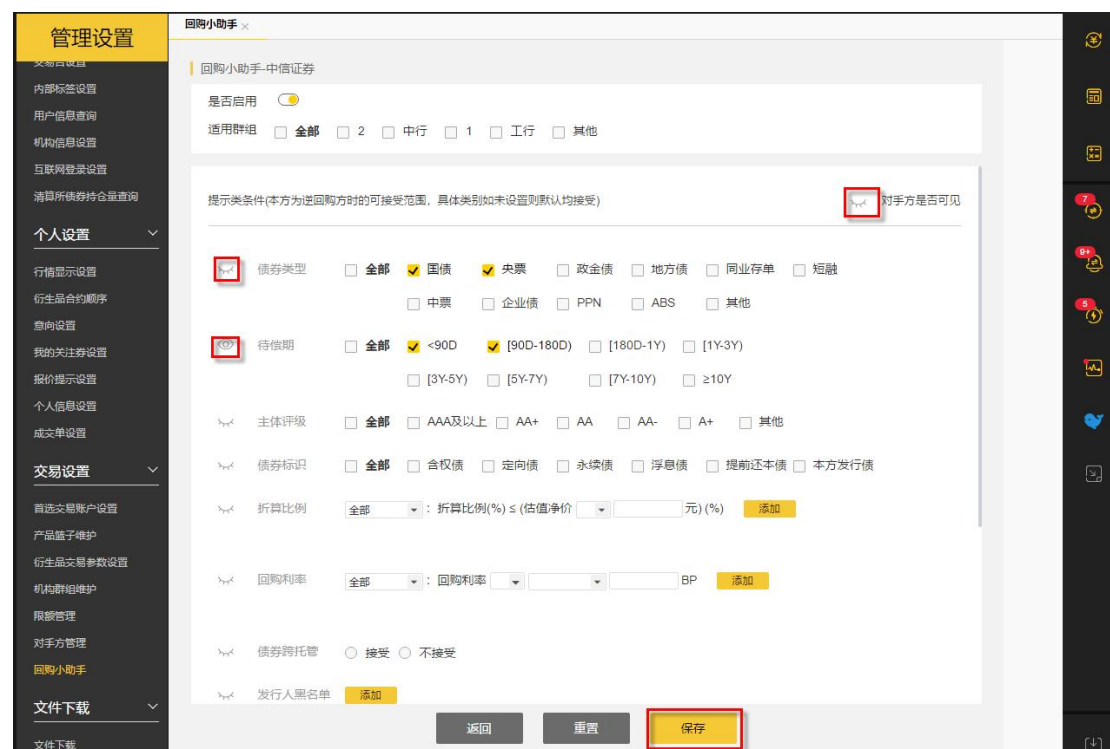


用户在回购小助手设置界面可对各个条件进行设置，并可添加发行人黑名单和债券黑名单。设置条件包含为提示类及控制类条件两种，其中提示类条件是为本方为逆回购方时的可接受范围，若用户未设置则默认为均接受。用户可以点击单个提示类条件前的标志来进行单独

设置，点击每个提示类条件前的  可设置对手方是否可见， 为可见（即生效）、 为不可见（不生效），对于设置为对手方可见的提示类条件，对手方在正回购报价时会根据设置的提示类范围，对不符合条件的交易要素进行高亮显示。

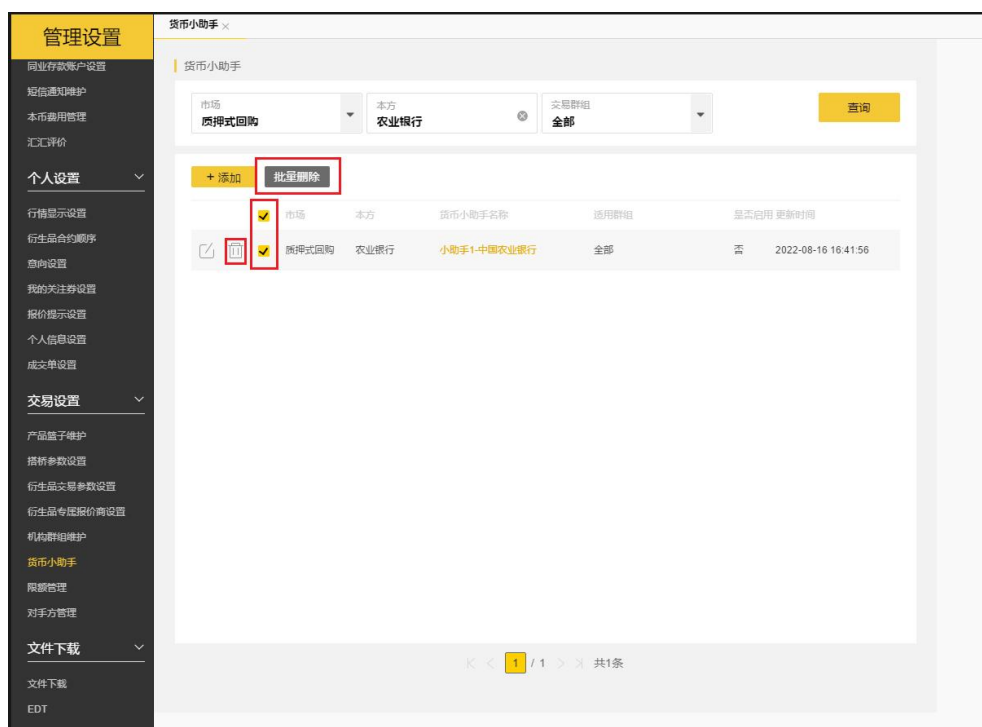
针对控制类条件，不受是否可见的条件控制，设置之后，在成交时，如果存在不符合控制类条件的交易要素时，对应成交无法提交。

在回购小助手设置界面点击是否启用后  图标可设置是否启用该回购小助手设置， 为启用、 不启用。各个回购小助手条件设置后需点击保存才会生效。



3. 回购小助手删除

用户在回购小助手查询页面，可点击  删除设置的回购小助手，也可勾选设置的回购小助手列表，点击“批量删除”进行批量删除。



8.10.2 信用拆借小助手

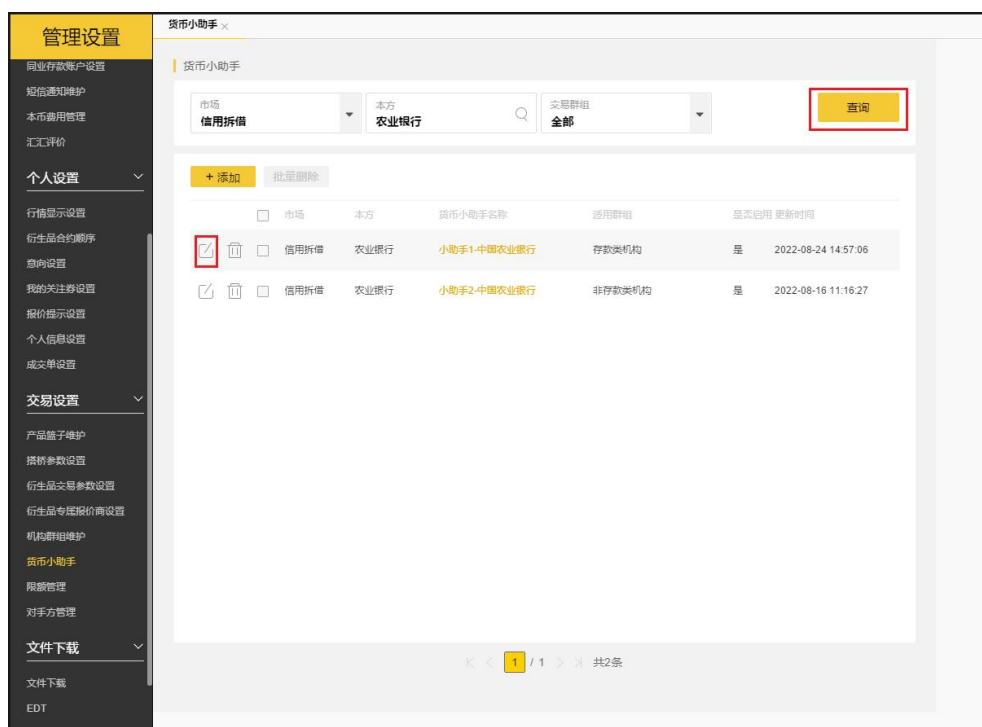
拆借小助手主要用于在信用拆借提交或成交时的数据校验。

用户任一身份下有对话报价权限时用户可对拆借小助手进行查询和设置操作。

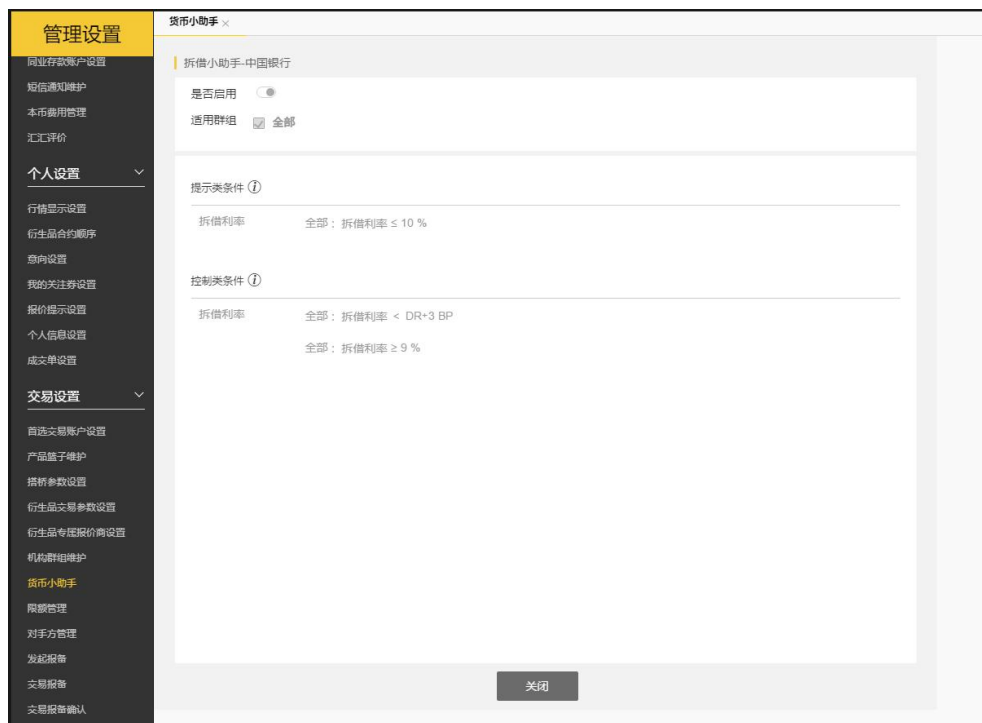
登录系统后，用户可通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“货币小助手”“市场”选择“信用拆借”进入。

1. 拆借小助手查询

用户选择“本方”、“交易群组”后，点击 **查询**，可查看当前设置的拆借小助手情况。

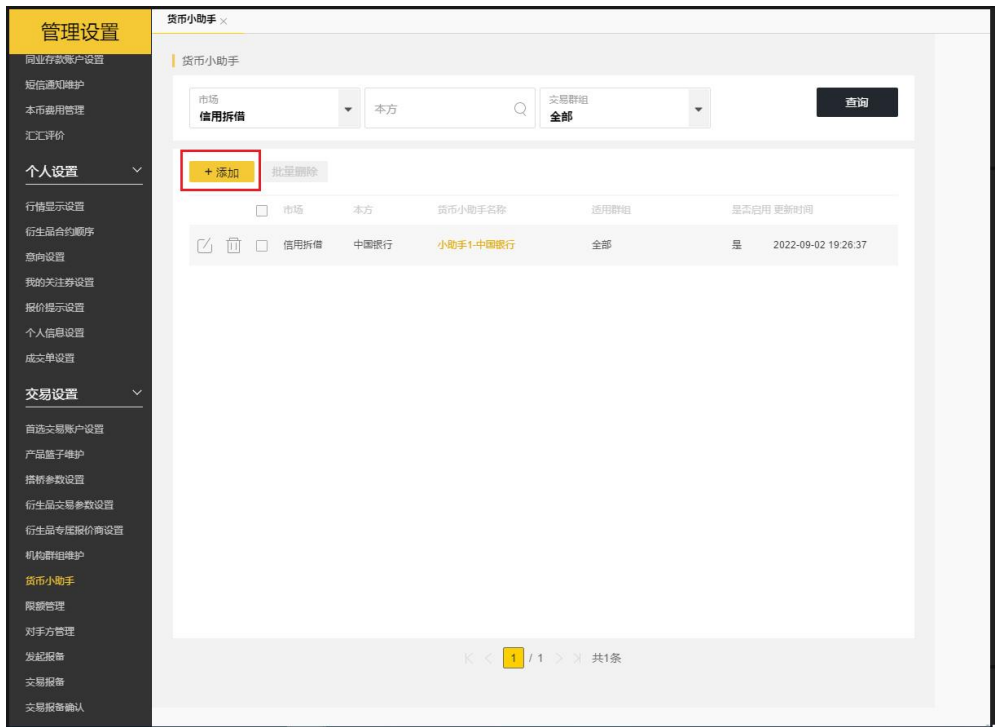


点击查询结果中，“拆借小助手名称”的具体名称，可查看对应本方设置的拆借小助手详情。



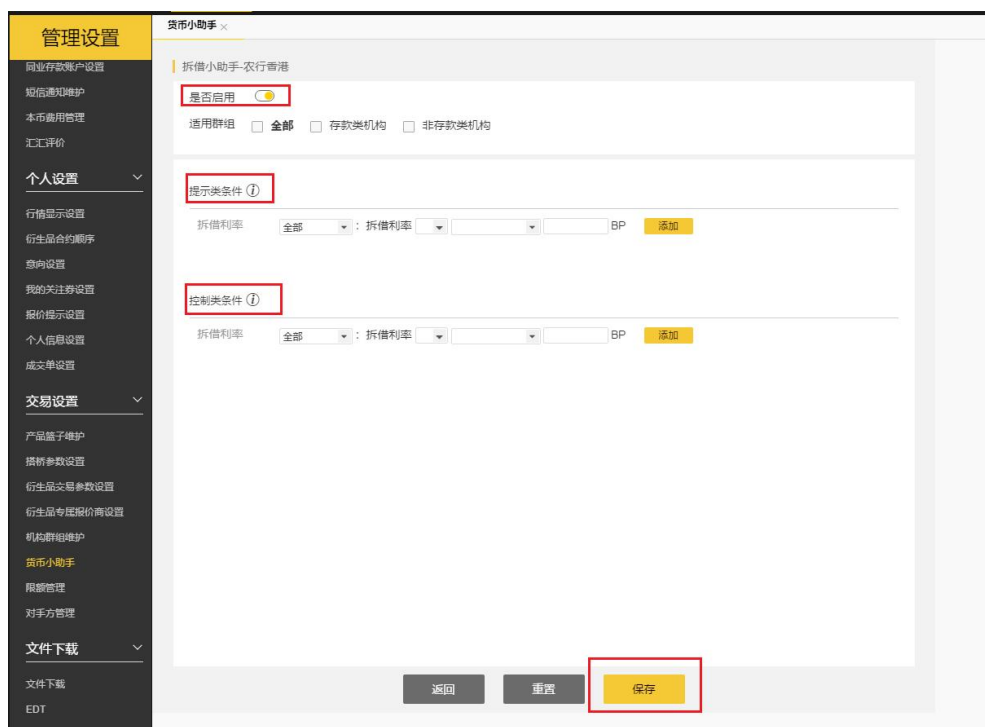
2. 拆借小助手添加

用户在拆借小助手查询界面选择本方后，点击 **+ 添加**，进入拆借小助手设置界面。



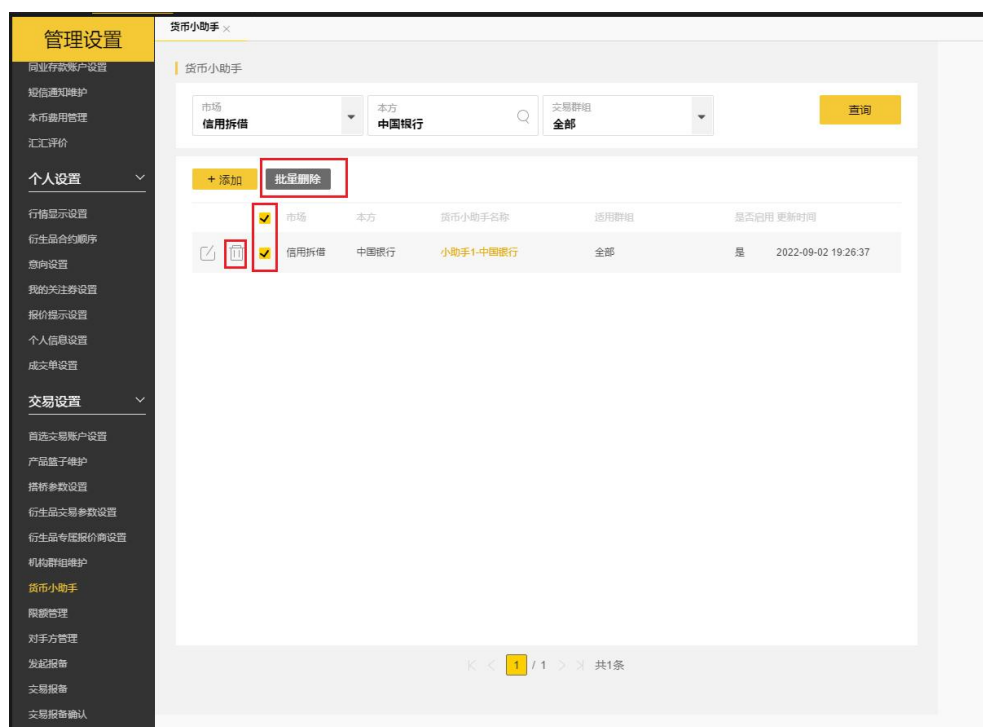
用户在拆借小助手设置界面可对各个条件进行设置。设置条件包含为提示类及控制类条件两种：针对提示类条件，设置之后，在提交或成交时，如果存在不符合提示类条件的交易要素时，给出对应提示；针对控制类条件，设置之后，在提交或成交时，如果存在不符合控制类条件的交易要素时，对应成交无法提交。

在拆借小助手设置界面点击是否启用后  图标可设置是否启用该拆借小助手设置，  为启用、  不启用。各个拆借小助手条件设置后需点击保存才会生效。



3. 拆借小助手删除

用户在拆借小助手查询页面，可点击  删除设置的回购小助手，也可勾选设置的拆借小助手列表，点击“批量删除”进行批量删除。



8.11 衍生品交易参数设置

本菜单下包含 2 个功能设置，分别为：衍生品交易参数、衍生品首选资金账户。

8.11.1 衍生品交易参数

具备相应衍生品交易参数设置权限的用户才可查看菜单下的“衍生品交易参数”标签页，用户可点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“衍生品交易参数设置”->“衍生品交易参数设置”标签页进入。

衍生品交易参数设置包括单位变动点的设置、以及价格上下限的设置，相应参数设置完

成后点击 ，提示保存成功则设置或更新参数值成功；点击 ，则取消设置或更新，恢复为修改前的值。

衍生品交易参数设置仅适用于 X-SWAP 交易机制。

衍生品交易参数设置

衍生品交易参数设置

衍生品首选资金账户

* 单位变动点设置 (完成本设置后，点击 调整价格或名义本金时，点击1次，价格或名义本金的+/-为您所设置的数值)

利率互换：

价格单位变动量

1

x 0.0025%

名义本金单位变动量

1

x 手

标准利率互换：

价格单位变动量

1

x 0.0025%

名义本金单位变动量

1

x 手

标准债券远期：

价格单位变动量

1

x 0.0025元

名义本金单位变动量

1

x 手

* 价格上下限设置

利率互换：

盘中参考价+/-

BP

标准利率互换：

每日结算利率+/-

BP

标准债券远期：

每日结算价+/-

%

取消

保存

495

8.11.2 衍生品首选资金账户

用户通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“衍生品交易参数设置”->“衍生品首选资金账户”标签页进入。用户可设置适用于本交易员在某一交易账户下的利率互换交易资金账户，可选择本交易账户衍生品首选资金账户，也可选择其他资金账户。用户首选资金账户设置实时生效。

1. 查询首选资金账户

可通过“交易账户”模糊匹配点选用户有权限操作的活动的有利率互换市场询价权限及

点击成交权限的交易账户，点击  按钮，对当前交易账户的首选资金账户进行查询查看。

查询时，如果交易员未设置首选资金账户，或者设置的首选资金账户已不存在，则默认选中“使用本机构衍生品首选资金账户”。

衍生品交易参数设置 ×

衍生品交易参数设置

衍生品交易参数设置

衍生品首选资金账户

市场
利率互换

交易账户
中国银行

币种类别
本币

查询

设置

本方资金账户信息(注：所选账户作为本交易员利率互换对话报价和点击成交的资金账户)

☒ 使用本机构衍生品首选资金账户

标识	资金账号	资金开户行名称	资金账户户名	支付系统行号	生效日
衍生品首选	110400392	中国银行股份有限公司北京市分行	中国银行股份有限公司北京市分行	104100004013	2021/07/12

☐ 使用其他资金账户

标识	资金账号	资金开户行名称	资金账户户名	支付系统行号	生效日
----	------	---------	--------	--------	-----

2. 设置首选资金账户

用户点击  按钮，可对当前交易账户的首选资金账户进行设置或修改，当设置为“使用其他资金账户”时，可通过“资金账号”模糊匹配点选可用的资金账号，选中后自动带出资金账户的其他信息。

点击“保存”按钮，校验通过则设置实时生效，该设置仅对当前交易员生效。

点击“取消”按钮，则取消本次操作的修改，恢复到默认或者修改前的设置。

资金账户设置 ×

衍生品交易参数设置 ×

衍生品交易参数设置

衍生品交易参数设置

衍生品首选资金账户

市场
利率互换

交易账户
中国银行

币种类别
本币

查询

设置

本方资金账户信息(注：所选账户作为本文交易员利率互换对话报价和点击成交的资金账户)

☐ 使用本机构衍生品首选资金账户

标识	资金账号	资金开户行名称	资金账户户名	支付系统行号	生效日
衍生品首选	110400392	中国银行股份有限公司北京市分行	中国银行股份有限公司北京市分行	104100004013	2021/07/12

☒ 使用其他资金账户

标识	资金账号	资金开户行名称	资金账户户名	支付系统行号	生效日
	资金账号 A2132443 MUZH110400... 中行-资金账号 AAA111 910290000036				

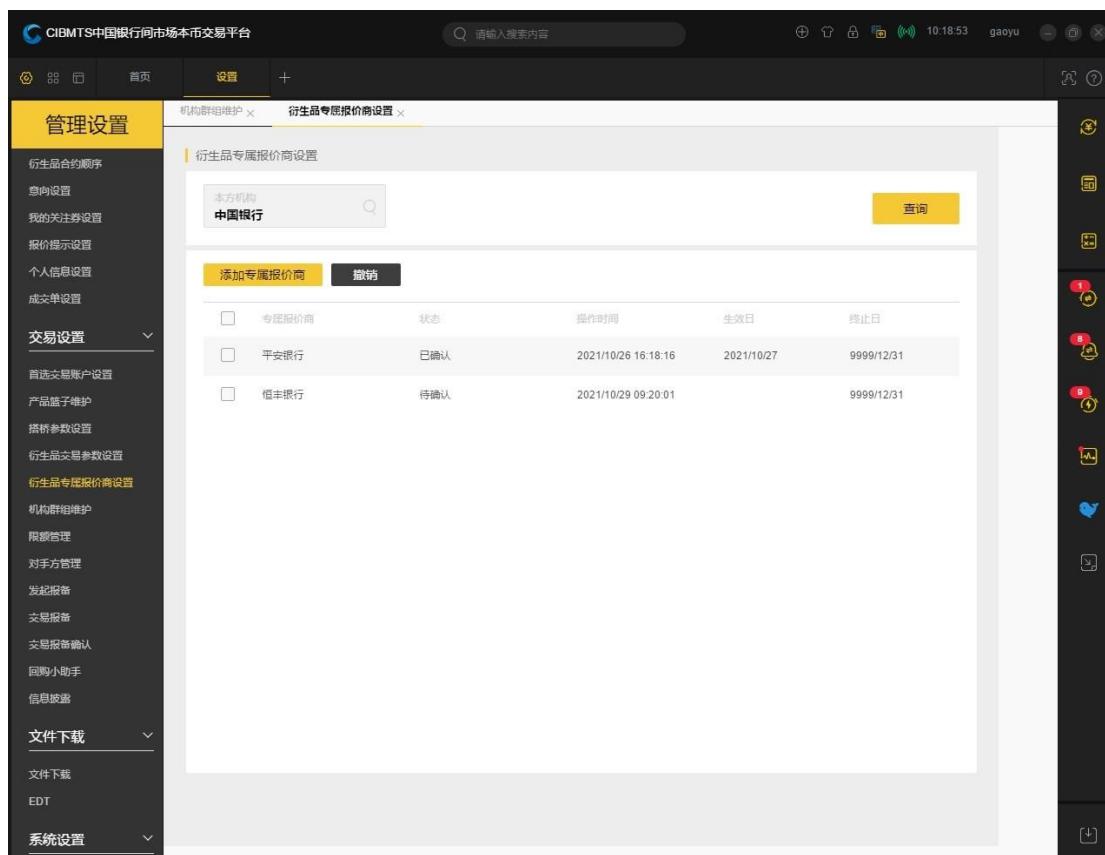
取消

保存

8.12 衍生品专属报价商设置

衍生品专属报价商设置页面可供用户添加衍生品专属报价商及撤销添加申请。用户自营、资管、代理任一身份下有“衍生品专属报价商设置”权限时，可以对当前页面进行查看和编辑操作。用户自营、资管、代理任一身份下有“利率互换-普通交易-点击成交”权限时，可以查看当前页面。

用户可点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“衍生品专属报价商设置”进入该页面。



1、当前状态查询

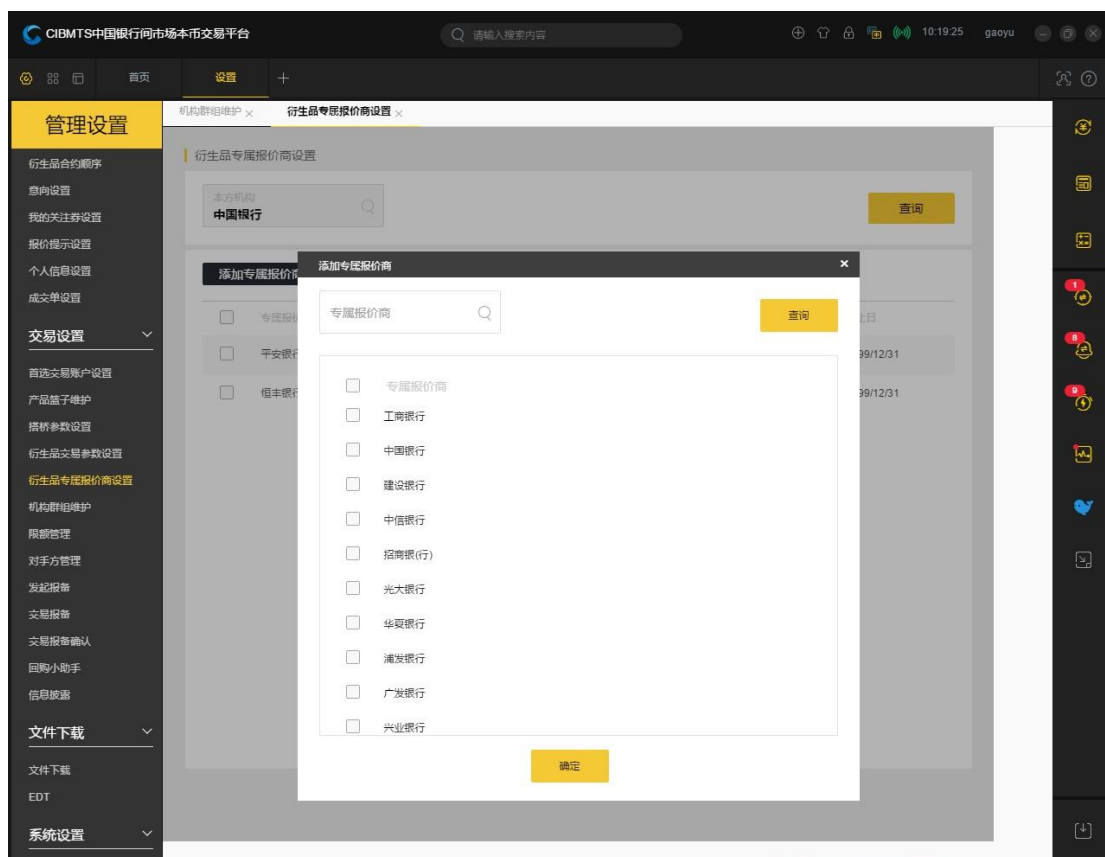
进入当前页面后，默认展示当前已申请的专属报价商及状态。页面展示本方机构名称、专属报价商机构名称、状态、操作时间、生效日、终止日。

用户添加专属报价商成功后，页面会实时更新该条记录。在报价商未确认时，状态展示为“待确认”；当报价商将本方机构下交易账户维护进群组后，当前页面该报价商对应状态实时更新为“已确认”，次日生效。当报价商将所有本方机构下已生效的交易账户移出群组后，状态实时更新为“待确认”，终止日为次日。

用户可点击页面 **查询** 按钮，手动刷新查看实时状态。

2、添加专属报价商

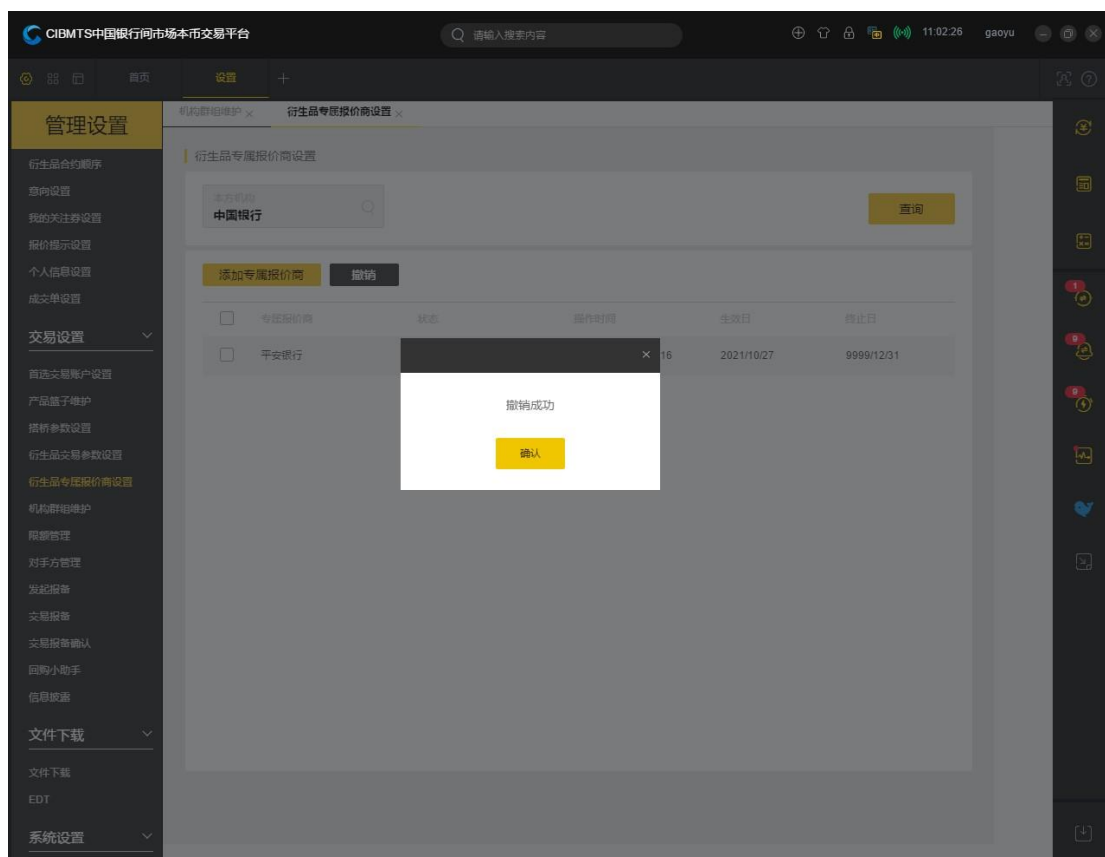
用户点击页面 **添加专属报价商** 按钮，可进行添加专属报价商操作。



页面默认展示所有有报价商权限的报价商机构，用户也可以通过模糊搜索查找指定的报价商，在报价商前的勾选框勾选并点击确定后，即完成添加专属报价商操作。

3、撤销添加申请

当报价商对应的状态为“待确认”时，用户可以进行撤销添加申请操作，勾选该报价商并点击 **撤销** 按钮，即可撤销对该报价商的添加申请。

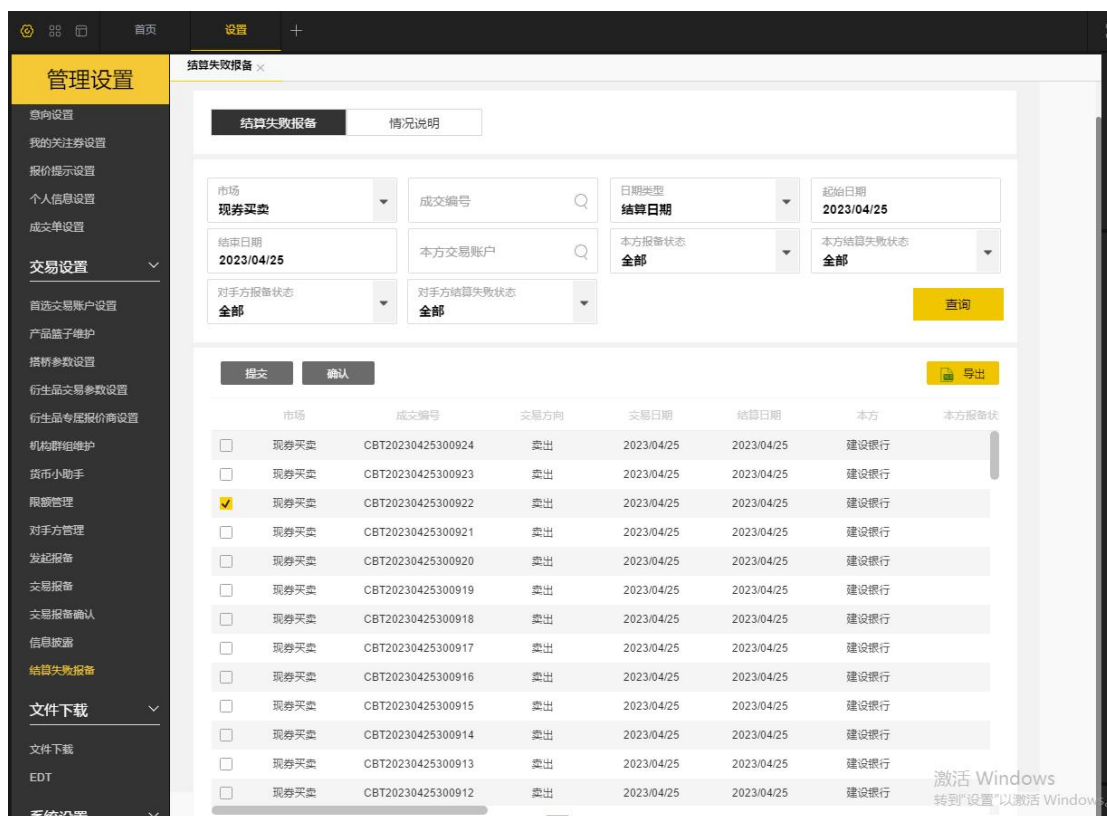


8.13 结算失败报备

8.13.1 结算失败报备

具有“机构权限-交易设置-结算失败报备/结算失败报备确认”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“结算失败报备->结算失败报备 tab”进入。

用户需要结算失败报备时，请在“管理设置-交易设置-结算失败报备”界面提交报备信息，本机构其他有“结算失败报备确认”权限的用户可审核确认，交易双方提交且确认报备后，交易中心可根据报备信息操作结算失败或退回，若操作结算失败，报备状态更新为已完成，报备流程结束；若退回，用户可在当前页面重新提交。其中单方报备的交易，未报备一方会收到消息盒子提醒。



1、结算失败报备查询

相应身份下具有“结算失败报备/结算失败报备确认”权限的用户，通过对市场、成交编号、日期类型、起始日期、截止日期等输入项的选择，可查看相应身份下自己达成/提交的成交/结算失败报备信息；相应身份下具有“结算失败报备/结算失败报备确认”权限，且有监控权限的用户，可查看相应身份对应的本机构所有成交/报备数据。

2、结算失败报备提交

管理设置

意向设置
我的关注券设置
报价提示设置
个人信息设置
成交单设置

交易设置

首选交易账户设置
产品篮子维护
搭桥参数设置
衍生品交易参数设置
衍生品专属报价商设置
机构群组维护
货币小助手
限额管理
对手方管理
发起报备
交易报备
交易报备确认
信息披露
结算失败报备

文件下载

文件下载
EDT

系统设置

结算失败报备

情况说明

市场: 现券买卖
成交编号:
日期类型: 结算日期
起始日期: 2023/04/25
结束日期: 2023/04/25
本方交易账户:
本方报备状态: 全部
本方结算失败状态: 全部

对手方报备状态: 全部
对手方结算失败状态: 全部

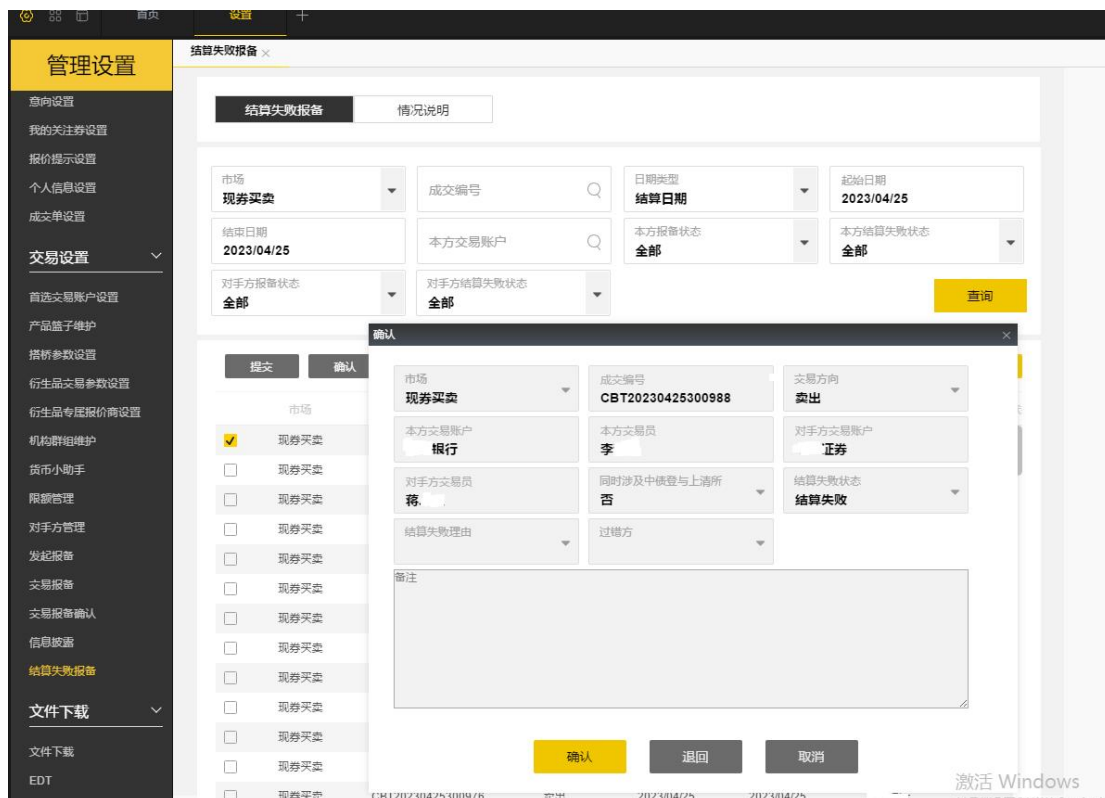
提交

市场: 现券买卖
成交编号: CBT20230425300922
交易方向: 卖出
本方交易账户: 银行
本方交易员: 李
对手方交易账户: 中信证券
同时涉及中债登与上清所: 否
结算失败理由:
过错方:
备注:
提交 取消

现券买卖 CBT20230425300913 卖出 2023/04/25 2023/04/25 建设银行
现券买卖 CBT20230425300912 卖出 2023/04/25 2023/04/25 建设银行

具有“机构权限-交易设置-结算失败报备”权限的用户可勾选“本方报备状态”为“空”、“已退回”的记录，提交发起报备。提交后状态更新为已提交。

3、结算失败报备确认



具有“机构权限-交易设置-结算失败报备确认”权限的用户可勾选“本方报备状态”为“已提交”的记录进行确认，可在弹窗中点击 **确认**，状态更新为“已确认”；点击 **退回** 按钮，则退回结算失败报备，状态更新为“已退回”，需机构用户重新填写结算失败报备内容。仅支持确认其他用户提交的报备。

4、结算失败报备导出

点击 **导出** 将结算失败报备的查询结果保存至本地。

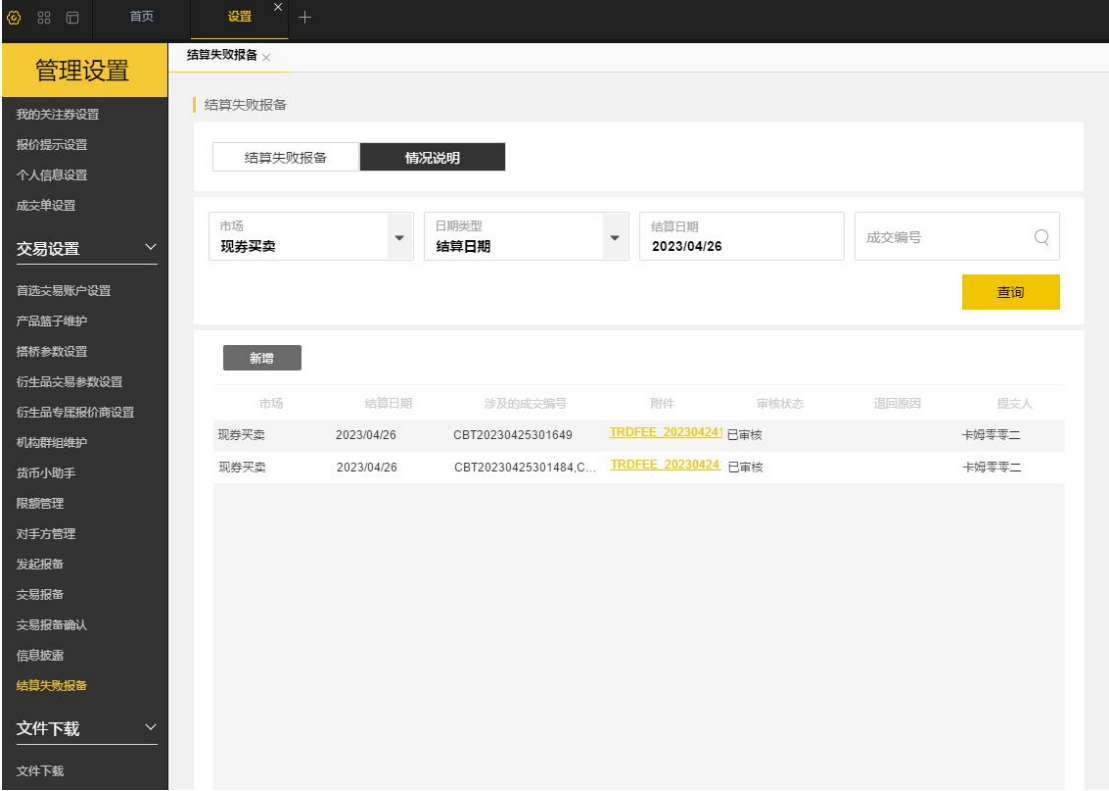
8.13.1 情况说明

具有“机构权限-交易设置-结算失败报备/结算失败报备确认”权限的用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“交易设置”->“结算失败报备->情况说明 tab”进入。

用户需要提交情况说明时，请在“管理设置-交易设置-情况说明”页面新增情况说明信息并上传附件，交易中心根据提交信息进行审核，若审核通过，状态更新为“已审核”，若审核退回，状态更新为“已退回”，用户可双击当前记录重新提交。对同一结算日 / 首期结

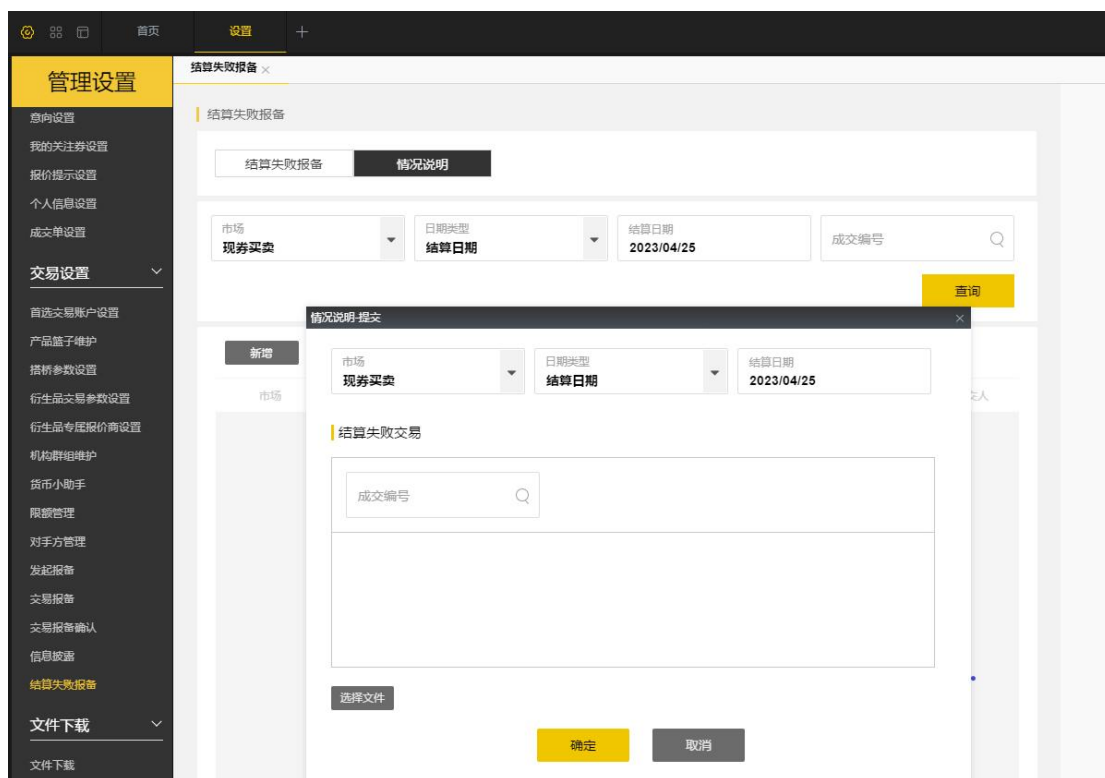
算日 / 到期结算日 结算失败报备同一过错方大于等于 4 笔的交易, 过错方机构有 " 结算失败报备 / 结算失败报备确认 " 权限的用户会收到消息盒子提醒。

1、情况说明查询



通过对市场、日期类型、结算日期等输入项的选择，查看情况说明信息。

2、情况说明新增



点击 **新增** 按钮，选择成交编号，上传 8M 以下 PDF、word 等格式附件，点击确定后状态更新为“待审核”。同一成交编号仅能提交一次说明。

3、情况说明修改

可双击修改“待审核”“已退回”状态的数据，可修改成交编号，修改后需重新上传附件，确定后状态更新为“待审核”。

4、附件下载

点击附件链接，可将一年以内附件下载至本地。

9 个人设置

所有用户均可通过个人设置，完成与行情、交易相关的偏好设置。

9.1 行情显示设置

用户可通过行情显示设置，修改行情展示的方式：价格净价或收益率展示；涨跌的规则为红涨绿跌或绿涨红跌。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“个人设置”->“行情显示设置”进入。

行情显示设置 ×

偏好设置

净价/收益率

☒ 净价 ☐ 收益率

涨跌标识设置 (涨跌颜色针对到期收益率)

☐ 红涨绿跌 ☒ 红跌绿涨

银行间自贸区设置

☒ 银行间 ☐ 自贸区

保存

用户选择个人偏好的行情展示方式即可。

9.2 意向设置

用户可通过意向设置，选择自己感兴趣的债券范围，设置完成 5 分钟后消息盒子-交易机会推送将根据意向设置的范围推送符合条件的意向报价和债券路演信息。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“个人设置”->“意向设置”进入。

意向设置

意向设置

现券买卖

债券路演

交易方向

☒全部

☐买入

☐卖出

债券类型

☒全部

☐利率债

☐国债

☐央票

☐政金债

☐信用债

☐短融

☐中票

☐企业债

☐地方债

☐PPN

☐NCD

☐ABS

☐其他

主体评级

☐全部

☒AAA

☐AA+

☐AA

☐AA-

☐A+

☐其他

待偿期

☐全部

☒<90D

☒[90D-180D)

☐[180D-1Y)

☐[1Y-3Y)

☐[3Y-5Y)

☐[5Y-7Y)

☐[7Y-10Y)

☐≥10Y

企业性质

☐全部

☒中央国有企业

☒地方国有企业

☐外资企业

☐民营企业

☐其他企业

发行人行业

☐全部

☒能源

☒原材料

☐工业

☐非日常生活消费品

☐日常消费品

☐金融

☐医疗保健

☐信息技术

☐电信业务

☐公用事业

用户勾选条件后，系统后续会推荐符合条件的交易机会。

9.3 我的关注券设置

用户可通过我的关注券设置收藏债券，亦可通过行情页面的  图标关注，设置的关注券将集中展示在【公开报价】->【热点关注券】界面，方便用户查看关注券最优的行情和走势图。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“个人设置”->“我的关注券设置”进入。

我的关注券设置

关注券设置

关注标识

全部

债券代码/中文简称

债券类型

全部

评级:

☒全部
☐AAA
☐AA+
☐AA
☐AA-
☐A+
☐其他

查询

导出

	债券代码	债券中文字简称
★	010214	01国开14
☆	010216	01国开16
★	010221	01国开21
☆	010011	01国债11
☆	020205	02国开05
☆	020005	02国债05



表示已经设置为关注券，点击后可以取消关注；



标识尚未设置为关注券，点击后可以设置为关注券。

全系统各界面中，展示的、，均可实现以上关注/取消关注操作。

9.4 报价提示设置

用户可通过报价提示设置自定义债券最优价提示，当设置债券的最优报价超出了设置的提示范围，则会通过消息盒子-实时预警对进行提醒。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“个人设置”->“报价提示设置”进入。

报价提示设置

代码\名称 查询

+添加 批量删除

代码	名称	债券状态	报买价最低价格	报买价最高价格	报卖价最低价格	报卖价最高价格	债券币种
☐	100018	10附息国债18 有效	1%	5%	2%	6%	CNY

新增报价提示设置

债券代码 100019 债券中文简称 10附息国债19

当前最优报价不在以下范围时，触发价格波动预警。

价格类型 ☐ 收益率(%) ☒ 净价(元)

报买价最低价格 报买价最高价格

报卖价最低价格 报卖价最高价格

提交

用户针对关注的债券分别设置报买价和报卖价区间，可根据用户习惯按照净价、收益率二选一进行设置。设置后，当该券的最优报价超出设置价格的区间，实时通过消息盒子-实时预警提示

9.5 个人信息设置

用户可通过个人信息设置功能完善个人信息，部分个人信息可选择公开或不公开。同时还可通过该功能查看个人绑定的交易账户信息及所有权限。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“个人设置”->“个人信息设置”进入。

1. 基本信息设置

用户填写完善个人基本信息，选择是否公开，点击保存按钮即可。

个人信息设置

个人信息设置

基本信息

权限及交易账户组

用户姓名

蒋人杰

用户代码

021793

交易员资格证书号

163478

实名认证状态

已认证

机构

中信证券

部门*

-

性别

-

全市场可见机

仅自己可见

职务

-

全市场可见机

仅自己可见

邮箱

jiangrenjie@citic.com

全市场可见机

仅自己可见

座机*

010-60833054

手机

-

全市场可见机

仅自己可见

微信号

-

全市场可见机

仅自己可见

备注

-

个人标签

债券通

结算代理

做市

债券一级

一级存单

信用债

利率债

CDS

IRS

标债远期

债券借贷

回购

拆借

衍生品

保存

2. 权限及交易账户组

用户点击“权限及交易账户组”Tab 页，可以查看个人所属的交易账户组及权限。

9.6 自动打印设置

用户可通过成交单设置功能，设置“自动打印成交单”及“自动下载成交单”功能。

登录系统后，可以通过点击系统菜单“管理设置”->“个人设置”->“成交单设置”进

成交单设置

成交单设置

自动打印成交单

自动下载成交单

文件下载地址

C:\Users\WH\Downloads

(请在下载管理设置默认下载路径)

取消

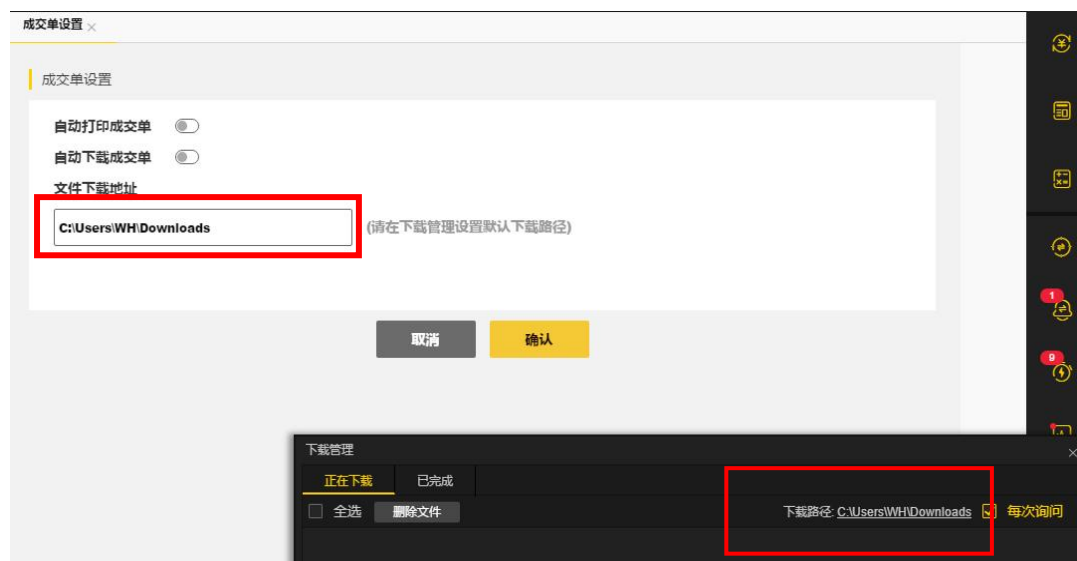
确认

入。

如需自动打印，则打开“自动打印成交单”开关即可。注意，打开自动打印后，自动下载成交单默认打开，如下图所示：



如需设置“文件下载地址”，可在客户端“下载管理”功能下设置默认下载路径，以及是否需要“每次询问”选项。



10 系统设置

10.1 锁屏时间

可设置用户的锁屏时间和密码

用户登录系统后，可以通过点击系统菜单“系统设置”->“锁屏时间”进入。

锁屏时间

☐ 永不

☒ 2小时

☐ 3小时

☐ 4小时

锁屏密码

锁屏密码:

确认锁屏密码:

确认

- 1、锁屏时间为“永不”的时候无需设置“锁屏密码”。
- 2、“锁屏密码”和“确认锁屏密码”必须一致。

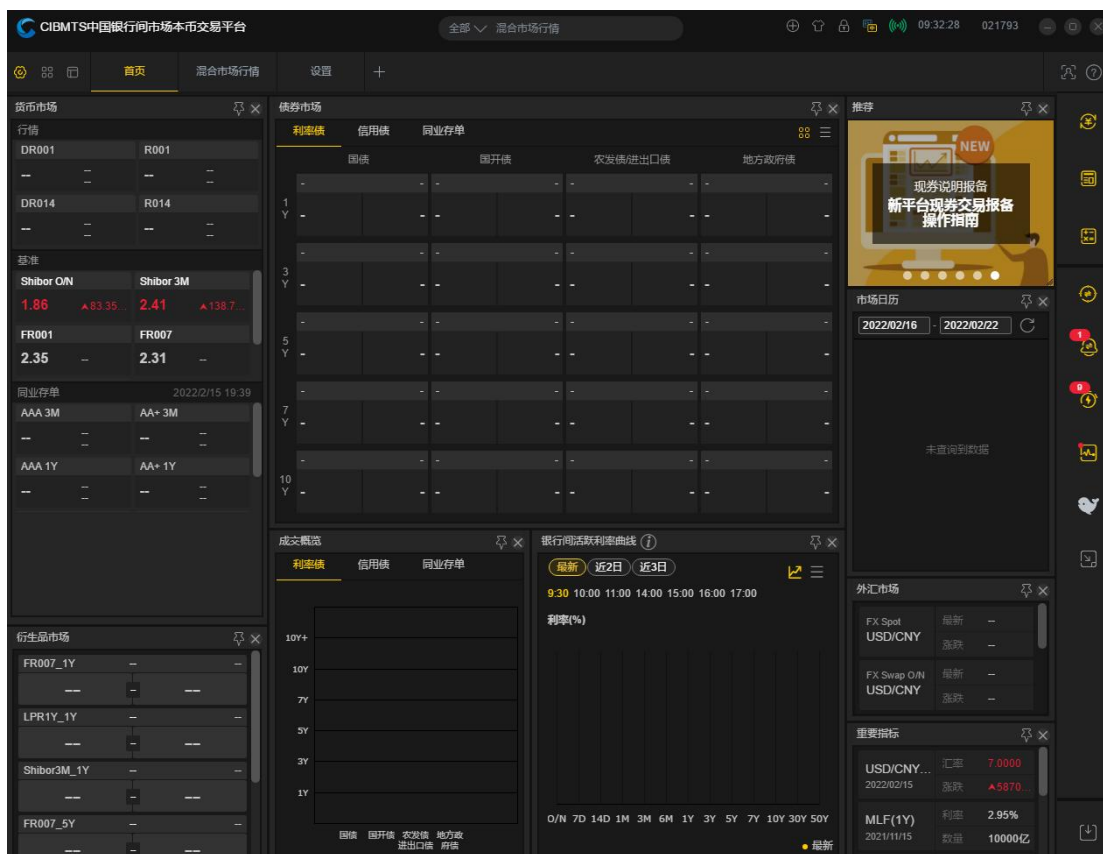
10.2 主题色切换

点击主界面右上角的衣服图标，可切换主题颜色。

11 投资经理展示页面

投资经理用户拥有投资经理默认权限，登录后查看以下菜单

- 1) 默认投资经理可查看首页菜单，如下图：

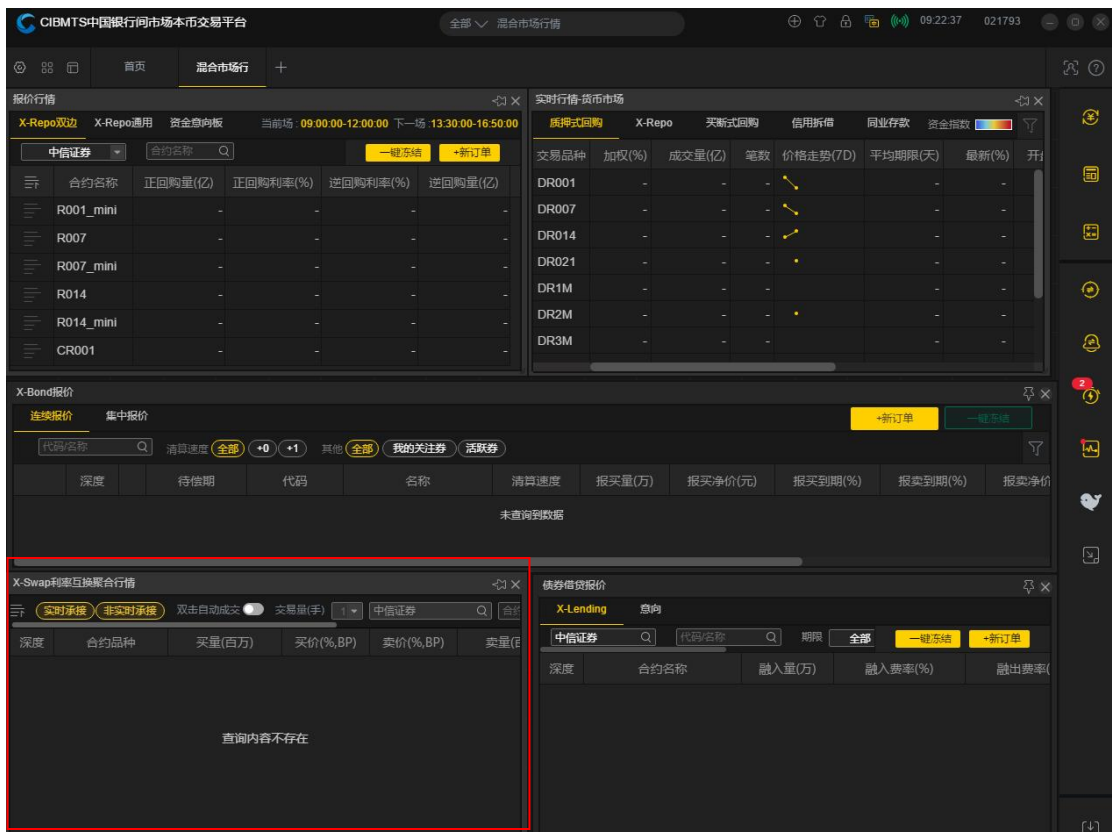


2) 默认投资经理可以通过点击模板管理中的混合市场行情来查看交易账户对应的

X-Repo 报价行情 (X-Repo 双边、资金意向板)、货币市场成交行情 (质押式回购、X-Repo、买断式回购、信用拆借、同业存款五大市场成交行情)、X-Bond 报价行情 (连续报价、集中报价)，如下图：



3) 若用户具备行情浏览下的衍生品市场报价行情权限, 且适用交易账户组下至少存在一个活动的交易账户有利率互换-实时承接或者利率互换-非实时承接交易账户业务权限, 还可查看 X-Swap 报价行情, 如下图:



4) 若用户具备行情浏览下的**债券借贷市场**报价行情权限, 且适用交易账户组下至少存

在一个活动的交易账户有**债券借贷-匿名点击业务权限**，还可查看债券借贷报价行情，

如下图

