

# 非金融企业债务融资工具集中簿记建档服务 操作指南（试行）

为方便各类市场参与机构开展非金融企业债务融资工具（以下简称“债务融资工具”）集中簿记建档工作，根据中国银行间市场交易商协会（以下简称“交易商协会”或“协会”）《非金融企业债务融资工具簿记建档发行规范指引》（交易商协会公告[2013]14号）、《关于非金融企业债务融资工具集中簿记建档工作有关事项的公告》（交易商协会公告[2014]3号）、《非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务操作规程》等相关自律规范性文件，制定本操作指南。

## 一、服务范围

北京金融资产交易所有限公司（以下简称“北金所”）作为非金融企业债务融资工具集中簿记建档系统（以下简称“集中簿记建档系统”或“系统”）技术支持机构，为债务融资工具集中簿记建档业务提供技术支持、信息披露服务和信息安全管理。

### （一）服务对象

本指南中的服务对象是指开展债务融资工具集中簿记建档业务的簿记管理人、主承销商、承销团成员、投资人、发行人等（以下简称“相关机构”）。

### （二）产品种类

本指南中的债务融资工具种类包括但不限于：超短期融资券（SCP）、短期融资券（CP）、中期票据（MTN）、中小企业集合票据（SMECN）、区域集优中小企业集合票据（SMECNII）、非公开定向

发行债务融资工具（PPN）、资产支持票据（ABN）和项目收益票据（PRN）。

### （三）服务内容

本指南中的服务内容是指北金所向相关机构在开户与联网准备、系统使用、簿记建档室预约与使用、线下业务、账户服务等过程中提供的支持与服务。

## 二、开户与联网准备

### （一）开户

相关机构应在开展集中簿记建档业务前签署《非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务客户服务协议》（以下简称“协议”），并将填好的《北金所债券业务参与主体信息表》（见附件 1）及其要求的相关材料、《北金所债券业务专网接入申请单》（如需，见附件 2）提交北金所会员部。

北金所会员部接收上述材料后，在 2 个工作日内与符合要求的相关机构签署《非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务客户服务协议》，为其在系统中开立系统账户及系统管理员用户，并发放《开户通知书》（见附件 3）、《系统管理员设置通知书》（见附件 4）和 Ukey 数字证书。相关机构登录集中簿记建档系统设置操作员用户及操作权限，操作员用户登陆系统进行集中簿记建档业务操作。

非金融机构合格投资人应在签署协议前，取得交易商协会出具的《非金融机构合格投资人备案通知书》。

### （二）联网准备

相关机构访问集中簿记建档系统需要安装客户端软件，客户端提供图形化通讯配置入口，包括基本设置、代理服务器设置和

重连设置。

本系统提供互联网、专线、电话拨号三种接入方式。

#### 1、互联网接入方式

相关机构可以通过互联网访问本系统。

#### 2、专网接入方式

相关机构根据业务的重要性和稳定性要求，也可以选择专线接入的方式，包括：SDH 数据专线和 PSTN 拨号方式。如需申请专线，请填写《北金所债券业务专网接入申请单》。

##### （1）SDH 数据专线

为保证数据传输的安全及效率，北金所接受相关机构采用数据专线方式接入北金所债券业务系统。专线带宽一般为 2Mb/S。

##### （2）PSTN 电话拨号

PSTN 接入方式最高带宽为 56K。目前北金所提供相关机构以 Modem 拨号方式接入，电话号码为：010-57896862。

### 三、集中簿记建档系统使用

相关机构在集中簿记建档前准备、申购、定价、配售、投资人债券额度配售等环节请使用集中簿记建档系统开展业务，北金所在上述系统使用过程中提供支持与服务。

#### （一）集中簿记建档前准备

相关机构请在集中簿记建档前准备环节中进行如下操作：

##### 1、主承销商、承销团成员组建承销团

主承销商创建计划发行项目，由主承销商与承销团成员共同进行组团工作。组团完成后，主承销商选定簿记管理人。

##### 2、发行人报备《发行方案》

发行人制作《发行方案》，并向交易商协会报备。

### 3、簿记管理人确认簿记建档项目信息

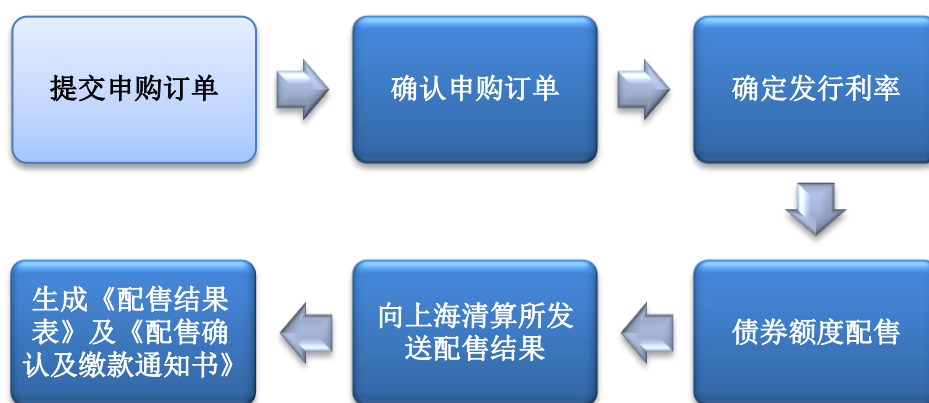
簿记管理人完善并确认北金所代其创建的簿记建档项目信息，并将簿记建档项目与相应的计划发行项目关联。

### 4、主承销商、簿记管理人询价

主承销商、簿记管理人可与承销团成员、投资人进行询价操作，也可直接记录询价结果。

### （二）申购、定价、配售

相关机构请在申购、定价、配售环节中进行如下操作：



注：流程图中浅色框体表示该步骤由承销团成员或非公开定向债务融资工具投资人操作，深色框体表示该步骤由簿记管理人操作。

图 1：申购、定价、配售流程图

### 1、承销团成员或非公开定向债务融资工具投资人（以下简称“定向投资人”）提交申购订单

承销团成员或定向投资人向簿记管理人提交申购订单，在簿记管理人进行定价配售操作前承销团成员或定向投资人可以与接收方协商撤销订单。

承销团成员或定向投资人请在申购时间截止前提交申购订单。

如簿记管理人需要延长申购时间，请向市场公告后，点击确认完成延长申购时间申请。延长申购时间申请应不晚于申购时间截止前一个小时提交。

## 2、簿记管理人确认申购订单

申购时间截止后，簿记管理人确认承销团成员或定向投资人申购订单的提交情况。

## 3、簿记管理人确定发行利率

簿记管理人按照发行方案中公告的定价原则确定发行利率。

如簿记管理人需要修改利率区间，请向交易商协会报告并向市场公告后，点击确认完成修改利率区间。修改利率区间操作应不晚于申购时间截止前一个小时提交。

## 4、簿记管理人债券额度配售

簿记管理人按照发行方案中公告的配售原则进行债券额度配售。

## 5、簿记管理人发送配售结果

簿记管理人将配售结果发送至银行间市场清算所股份有限公司（以下简称“清算所”）。

## 6、簿记管理人生成打印文档

簿记管理人可在配售完成后生成并打印《配售结果表》、《配售确认及缴款通知书》、《发行款到账确认书》、《发行情况公告》等制式文本。

## （三）投资人债券额度配售

相关机构请在投资人债券额度配售环节中进行如下操作：



注：流程图中浅色框体表示该步骤由投资人操作，深色框体表示该步骤由主承销商或承销团成员操作。

图 2：主承销商、承销团成员向投资人进行投资人债券额度配售操作流程图

#### 1、主承销商、承销团成员向投资人进行投资人债券额度配售

投资人向主承销商或承销团成员提交申购订单。主承销商、承销团成员集中汇总并确认申购订单后按照事先确定的配售方式进行投资人债券额度配售，投资人债券额度配售结果可进行调整，如调整需录入调整原因。主承销商或承销团成员与投资人达成投资人债券额度配售意向后确认生成分销协议。

非金融机构合格投资人在一级市场认购债务融资工具的，须向主承销商提交申购订单，且所认购的当期债务融资工具不得在交易流通之前转售。

#### 2、投资人之间进行投资人债券额度配售

卖方投资人录入投资人债券额度配售信息，买方确认生成分销协议。

### 四、簿记建档室预约及使用

为方便簿记管理人在集中簿记建档日开展业务，北金所提供专门的簿记建档室，簿记建档室内配置与业务相关的设备，包括但不限于工作机、外网机、传真机、打印机、录音电话。

### （一）簿记建档室预约

簿记管理人启动项目发行工作后请进行簿记建档室预约，预约具体流程如下：

1、簿记管理人请在不迟于债务融资工具发行公告当日的中午十二点前（非公开定向债务融资工具不迟于集中簿记建档前一工作日中午十二点前）与北金所发行部确认簿记建档室使用时间，以邮件方式发送加盖预留印鉴的《簿记建档室使用预约单》（见附件5）及交易商协会授予的注册通知书复印件作为附件并电话确认。

2、北金所发行部在收到《簿记建档室使用预约单》及注册通知书一个工作日内以邮件方式向簿记管理人发送《簿记建档室预约确认单》（见附件6）。

簿记建档室预约工作完成后，北金所为簿记管理人创建簿记建档项目。

### （二）簿记建档室使用

1、簿记管理人工作人员请携带身份证，于簿记建档日申购工作开始前半个小时到达北金所。北金所业务人员按照《簿记建档室使用预约单》中记录的人员信息对拟进场簿记管理人工作人员进行核对，经核对无误后方可进入簿记建档室。进场人员可以携带集中簿记建档过程中需要的相关文件、资料，其他物品请放入北金所提供的专用保管箱进行统一保管。

2、簿记管理人工作人员信息临时变更导致进场人员与《簿记建档室使用预约单》中的申请人员信息不符的，需征得簿记管理人现场负责人同意并登记后方可进场。

3、在集中簿记建档过程中，簿记管理人工作人员出入簿记建

档室请进行登记；如使用手机与外界通话，请登记通话信息。

4、在簿记建档室内配置的工作机已安装相关的办公、应用和安全软件，外网机已安装 QQ 等通讯软件，如需其他业务软件，请于集中簿记建档开始前告知北金所。

## **五、线下业务办理**

相关机构出现因技术故障暂时无法使用系统正常开展业务、需要变更配售结果或其他业务需要等情况的，可委托北金所进行线下业务办理。

若相关机构因技术故障等原因无法正常开展业务，可根据具体事项填制相关业务凭单（见附件 8 和附件 9），加盖预留印鉴，以传真方式发送至北金所发行部并电话确认。相关机构应不晚于相应业务结束前半个小时提交业务凭单，并及时将原件寄送至北金所。北金所对业务凭单的预留印鉴等进行核验。如有预留印鉴不符，要素填写不清晰、不完整，签字或盖章不清等情况，北金所有权要求重新提交。

若簿记管理人需变更已发送的配售结果，请填写配售结果变更申请单（见附件 10），加盖预留印鉴，以传真方式发送至北金所发行部并电话确认，由北金所将变更情况传至清算所。

相关机构因其他业务需要向北金所申请线下业务的，可根据具体事项经协会确认后办理。

## **六、账户服务**

### **（一）账户管理**

若相关机构申请机构名称、联系方式等基本信息变更的，应将填好的《基本信息变更申请单》（见附件 11）加盖预留印鉴后连同其附件一并提交北金所会员部。

若相关机构因业务范围发生变更、终止营业或其他情况，申请账户变更、暂停、注销或恢复，应将填好的《账户变更/注销申请单》（见附件 12）加盖预留印鉴后提交北金所会员部。其中，账户注销服务需由相关机构在已履行协议中约定的所有应承担的责任和义务，且无存续期内债券的前提下，向北金所会员部提出申请。

## （二）系统管理员管理

若相关机构申请新增系统管理员，应将填好的《集中簿记建档系统管理员设置申请单》（见附件 13）加盖预留印鉴后提交北金所会员部。

若相关机构申请系统管理员密码重置、暂停、恢复、注销或权限变更，应将填好的《系统管理员变更/注销申请单》（见附件 14）加盖预留印鉴后提交北金所会员部。

## （三）Ukey 管理

若相关机构申请新增 Ukey，应将填好的《Ukey 新增申请单》（见附件 15）加盖预留印鉴后提交北金所会员部。

若相关机构因 Ukey 损坏、丢失、无法正常使用等情况申请 Ukey 补办，应将填好的《Ukey 补办申请单》（见附件 16）加盖预留印鉴后提交北金所会员部。

# 七、其他

（一）相关机构在集中簿记建档服务过程中如有任何疑问，请与北金所联系，联系方式详见附件 17。

（二）相关机构如遇特殊情况，需要办理集中簿记建档业务，可按照北金所有关规定办理。

（三）本指南最终解释权归北金所所有。

（四）本指南自发布之日起实施。

## 八、附件

## 附件 1 :

北金所债券业务参与主体信息表

| 基本信息                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|----|
| 机构全称                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                          | 机构简称                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 组织机构代码                                  |    |
| 联系人                                                                                                  | 部门及职务                                                                                                                                                                                                                                    | 手机                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 座机                                      | 邮箱 |
|                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
|                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
| 邮寄地址及邮编                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
| 账户申请                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
| 登记托管（上清所）<br>账户全称                                                                                    | 登记托管账户<br>简称                                                                                                                                                                                                                             | 登记托管<br>账号                                                                                                                                                                                                                                                                  | 资金账户名称                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 资金账户账号                                  |    |
|                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
| 业务申请                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
| 业务权限                                                                                                 | <input type="checkbox"/> 集中簿记建档                                                                                                                                                                                                          | <input type="checkbox"/> 信息披露                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <input type="checkbox"/> 非金融机构合格投资人债券交易 |    |
|                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                          | <input type="checkbox"/> 债务融资工具及其他产品信息披露                                                                                                                                                                                                                                    | <input type="checkbox"/> 信贷资产支持证券信息披露                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                         |    |
| 业务角色                                                                                                 | <input type="checkbox"/> 发行人<br><input type="checkbox"/> 簿记管理人<br><input type="checkbox"/> 主承销商<br><input type="checkbox"/> 承销团成员<br><input type="checkbox"/> 投资人<br>（ <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 非金融机构合格投资人） | <input type="checkbox"/> 发行人<br><input type="checkbox"/> 主承销商<br><input type="checkbox"/> 信用增进机构<br><input type="checkbox"/> 资产评估机构<br><input type="checkbox"/> 信用评级机构<br><input type="checkbox"/> 会计师事务所<br><input type="checkbox"/> 律师事务所<br><input type="checkbox"/> 投资人 | <input type="checkbox"/> 发起机构<br><input type="checkbox"/> 受托机构<br><input type="checkbox"/> 承销机构<br><input type="checkbox"/> 贷款服务机构<br><input type="checkbox"/> 资金保管机构<br><input type="checkbox"/> 信用增进机构<br><input type="checkbox"/> 律师事务所<br><input type="checkbox"/> 会计师事务所<br><input type="checkbox"/> 信用评级机构<br><input type="checkbox"/> 资产评估机构<br><input type="checkbox"/> 财务顾问机构<br><input type="checkbox"/> 投资人 | <input type="checkbox"/> 投资人            |    |
| 开户材料                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |
| 1. 协议/信息披露承诺函<br>2. 北金所债券业务参与主体基本信息表<br>3. 法人营业执照副本/执业许可证复印件<br>4. 登记托管机构开户证明文件（如有）<br>5. 备案证明文件（如有） |                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                         |    |

6. 北金所债券业务预留印鉴卡（如需）

所有材料均加盖本机构公章

本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律 responsibility，承诺遵守相关法律法规，接受中国银行间市场交易商协会自律管理，遵守北金所债券业务相关制度、合同、协议等的要求及约束。

本机构将妥善保管相应系统账户信息及 Ukey，按照既定程序登陆系统，因本机构人员故意或过失导致账户信息或 Ukey 遗失、泄露或遭盗用、冒用、伪造、篡改时，本机构对由此造成的损失和后果承担相应法律责任。

机构盖章（公章）

填表日期： 年 月 日

## 附件 2:

## 集中簿记建档业务专网接入申请单

(专线接入申请机构填写)

|                        |                                                                |       |                                                                |    |  |
|------------------------|----------------------------------------------------------------|-------|----------------------------------------------------------------|----|--|
| 机构全称                   |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 联系人                    |                                                                | 区号+电话 |                                                                | 电邮 |  |
| 技术联系人                  |                                                                | 区号+电话 |                                                                | 电邮 |  |
| 接入方式选择                 | <input type="checkbox"/> 拨号接入<br>(PSTN, 速率 56K)                |       | <input type="checkbox"/> 专线接入                                  |    |  |
| 如选择拨号方式无需填写下述信息        |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 机房详细地址<br>(具体到楼层)      |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 现有运营商光纤资源<br>(铜缆资源不可用) | <input type="checkbox"/> 中国电信 2M SDH                           |       | <input type="checkbox"/> 中国联通 2M SDH                           |    |  |
| 速率                     | <input type="checkbox"/> 2M <input type="checkbox"/> 其它 ____ M |       | <input type="checkbox"/> 2M <input type="checkbox"/> 其它 ____ M |    |  |
| 接口类型                   | <input type="checkbox"/> G. 703 <input type="checkbox"/> 其它    |       | <input type="checkbox"/> G. 703 <input type="checkbox"/> 其它    |    |  |
| 线路申请方式                 | <input type="checkbox"/> 自行申请 <input type="checkbox"/> 代为申请    |       | <input type="checkbox"/> 自行申请 <input type="checkbox"/> 代为申请    |    |  |
| 以下由北金所填写               |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 线路编号                   |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 网络配置                   | 电信                                                             |       |                                                                |    |  |
|                        | 联通                                                             |       |                                                                |    |  |
| 局域网配置                  |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 路由配置                   |                                                                |       |                                                                |    |  |
| 分配人员                   |                                                                |       | 分配时间                                                           |    |  |

备注:如采用代为申请专线方式:选择使用中国电信 SDH 网络与北金所实现专线连接的, 请附《中国电信 SDH 数字电路申请表》一式一份; 选择使用中国联通 SDH 网络专线连接的, 请附《中国联通 SDH 国内数字电路业务新装申请单》一式四份; 选择拨号方式连接或自行申请专线的, 无需另外附表。

附件 3:

集中簿记建档系统开户通知书

(客户全称):

根据双方签署的《非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务客户服务协议》，我司已为贵单位开通系统账户并设置相应的业务权限，受理结果如下：

| 账户信息   |                     |
|--------|---------------------|
| 系统账户   |                     |
| 机构全称   |                     |
| 业务权限信息 |                     |
| 业务资格   | 非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务 |
| 业务角色   |                     |

贵单位可根据本开户通知书及系统超级管理员设置通知书中用户信息登录业务系统客户端开展业务。

特此通知。

如有需要可与北金所会员部联系。

联系人：王蕾

联系电话：010-57896651

电子邮箱：[hyb@cfae.cn](mailto:hyb@cfae.cn)

(盖章)

北京金融资产交易所有限公司

年月日

附件 4:

集中簿记建档系统管理员设置通知书

（客户名称）：

根据贵单位提交的《系统管理员设置申请单》，我司已为贵单位开通系统管理员用户，受理结果如下：

| 系统管理员  |                     |
|--------|---------------------|
| 用户信息   |                     |
| 法人机构全称 |                     |
| 用户名    |                     |
| 密码     |                     |
| 业务权限   |                     |
| 业务资格   | 非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务 |
| 业务角色   |                     |
| 可分配账户  |                     |

请贵单位在接到本通知后登录业务系统客户端进行密码修改，并妥善保管ukey。

特此通知。

如有需要可与北金所会员部联系。

联系人：王蕾

联系电话：010-57896651

电子邮箱：[hyb@cfae.cn](mailto:hyb@cfae.cn)

（盖章）

北京金融资产交易所有限公司

年月日

附件 5:

簿记建档室使用预约单

北京金融资产交易所有限公司:

(簿记管理人机构全称)拟在贵公司进行非金融企业债务融资工具集中簿记建档工作,特预约簿记建档室。

具体信息如下:

|                        |            |                      |
|------------------------|------------|----------------------|
| 债券信息                   | 债券全称       |                      |
|                        | 债券简称       |                      |
|                        | 债券代码       |                      |
| 工作人员信息(请各单位根据实际需要自行加行) | 簿记管理人现场负责人 | 姓名: 身份证号:<br>电话: 邮箱: |
|                        | 工作人员 1     | 姓名: 身份证号:<br>电话: 邮箱: |
|                        | 工作人员 2     | 姓名: 身份证号:<br>电话: 邮箱: |
|                        |            |                      |
| 时间安排                   | 簿记建档日期     |                      |
|                        | 簿记建档时间     | 时至 时                 |
|                        | 分销截止时间     |                      |

预留印鉴:

年 月 日

附件 6:

簿记建档室预约确认单

\_\_\_\_\_(簿记管理人名称):

贵公司于        年        月        日提交的《簿记建档室使用预约单》已收悉。经研究，现同意贵公司于        年        月        日使用簿记建档室        开展非金融企业债务融资工具集中簿记建档工作，建议提前半个小时到达北金所。

簿记建档室联系电话:        、        、        、        ;

簿记建档室传真电话号码为:        、        。

特此函达。

北京金融资产交易所有限公司

年        月        日

## 附件 7:

### 集中簿记建档系统有效按比例配售算法

鉴于债券定价和配售是债券簿记建档的核心环节，为方便市场成员了解非金融企业债务融资工具集中簿记建档系统中定价、配售结果的计算方式，更好地使用集中簿记建档系统，现将有关情况说明如下。

#### 一、术语定义

**1、簿记管理人：**指根据《承销协议》约定受发行人委托负责簿记建档具体运作的主承销商。

**2、发行金额：**指在《募集说明书》中约定的本期债务融资工具计划发行金额。

**3、基本承销额：**指主承销方组建某期债务融资工具承销团时，在《组团邀请函》中明确，并由承销商在《参团回函》中确认的参与某期债务融资工具承销团时承诺的当期债务融资工具按发行利率/价格认购的最低承销金额，该金额同时也是承销商应获得配售的最低限额。

**4、簿记建档总额：**即本期债务融资工具发行金额扣减基本承销额（如有）之后的部分。

**5、合规申购总金额：**本期债务融资工具所有合规申购订单的申购金额总和。其中，合规申购订单指符合簿记管理人格式要求的申购订单于规定截止时间前发送至簿记管理人处，其申购价位位于《申购说明》所确定的申购区间内，且其他内容亦符合《申购说明》要求的申购订单。

**6、有效申购金额：**每一有效申购订单中在最终确定的发行利率以下/发行价格以上（含）的申购数量总和。其中，有效申购订单指在最终确定的发行利率以下/发行价格以上（含）仍有申购数量的合规申购订单。

注：上述术语定义仅适用于本附件。

## 二、定价算法

### （一）募满发行金额的情况

在该情形下，目前集中簿记建档系统将取募满簿记建档总额对应的边际利率/价格作为最终发行利率/价格。具体操作步骤如下：

1、簿记管理人将收到的申购订单录入系统后，系统将按照《申购说明》要求的申购区间剔除不合规的申购订单，筛选出全部合规申购订单；

2、系统将所有合规申购订单中的全部申购，按照申购利率（价格）由低（高）到高（低）逐一排列；

3、系统取募满簿记建档总额对应的申购利率（价格）作为边际利率（价格），即作为本期债务融资工具的发行利率（价格）。

算法示例：

XX 公司 XX 年度第一期短期融资券发行利率确定情况

| 项目基本情况 | 项目名称  | XX 公司 XX 年度第一期短期融资券 |           |       |
|--------|-------|---------------------|-----------|-------|
|        | 发行金额  | 15 亿元               | 簿记金额      | 13 亿元 |
| 申购情况   | 申购利率  | 申购金额（亿）             | 累计申购金额（亿） | 申购机构  |
|        | 5.40% | 1.6                 | 1.6       | A 银行  |

|  |       |     |             |           |
|--|-------|-----|-------------|-----------|
|  | 5.50% | 0.5 | 2.1         | B 银行、S 证券 |
|  | 5.60% | 7.7 | <u>9.8</u>  | C 银行      |
|  | 5.70% | 3.7 | <u>13.5</u> | D 银行、S 证券 |
|  | 5.80% | 0.5 | 14          | T 证券      |
|  | 5.90% | 0.5 | 14.5        | D 银行      |

边际利率



## （二）未募满发行金额的情况

在该情形下，集中簿记建档系统默认将取簿记建档利率区间上限/价格区间下限作为最终发行利率/价格。

## 三、配售算法

### （一）募满发行金额的情况

结合市场实际操作，在募满发行金额的情况下，目前系统提供了两种配售模型供用户选择使用<sup>1</sup>。

#### 1、模型一：边际按比例配售

如簿记管理人在系统中选择了“边际按比例配售”的模型，系统将按如下方法计算配售结果：

（1）对于边际利率以下/边际价格以上的全部合规申购，予以全额配售，即以其申购量作为配售量；

（2）对于等于边际利率/价格的合规申购，则按照比例进行配售，其对应的配售量等于：

$$\text{该笔申购金额} * \frac{\text{簿记建档总额} - \text{边际利率以下(或边际价格以上)的申购量总和}}{\text{边际利率(或边际价格)上的申购金额之和}}$$

（3）对于边际利率以上/边际价格以下的合规申购，不予配售；

<sup>1</sup>簿记管理人按《发行方案》事先约定未使用下述模型进行配售的，可在系统任选某一模型，当系统计算出配售结果后，再按照事先约定的配售方法进行调整。

(4) 完成上述初步计算后，系统将计算每家承销商的最终获配量，即：该承销商全部有效申购对应的获配量总和 + 该承销商的基本承销额（如有）。

此外，簿记管理人可以按照《发行方案》中事先约定的方式，在系统中对上述计算结果进行调整。

## 2、模型二：有效按比例配售

如簿记管理人在系统中选择了“有效按比例配售”的模型，系统将按如下方法计算配售结果：

(1) 对于不高于边际利率/不低于边际价格的全部申购（即有效申购），均按照比例配售，每笔申购对应的配售量等于：

$$\text{该笔申购金额} * \frac{\text{簿记建档总额}}{\text{有效申购总和}}$$

(2) 对于边际利率以上/边际价格以下的申购，不予配售；

(3) 完成上述初步计算后，系统将计算每家承销商的最终获配量，即：该承销商全部有效申购对应的获配量总和 + 该承销商的基本承销额（如有）。

此外，簿记管理人可以按照《发行方案》中事先约定的方式，在系统中对上述计算结果进行调整。

### （二）未募满发行金额的情况

在该情形下，集中簿记建档系统默认取各承销商的申购量和基本承销额（如有）之和作为配售量。

附件 8:

集中簿记建档业务申购订单线下业务凭单

北京金融资产交易所有限公司:

我单位现申请办理申购订单线下业务, 并保证所发送的本凭单内容真实、准确、完整、有效。

|                                                                                                                                         |     |           |       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|-------|
| 债券信息                                                                                                                                    |     |           |       |
| 债券全称                                                                                                                                    |     | 债券代码      |       |
| 申购方信息 (申请方)                                                                                                                             |     |           |       |
| 类型: 主承销商 <input type="checkbox"/> / 承销团成员 <input type="checkbox"/> / 投资人 <input type="checkbox"/> / 非金融机构合格投资人 <input type="checkbox"/> |     |           |       |
| 机构全称                                                                                                                                    |     | 系统账户      |       |
| 登记托管户名                                                                                                                                  |     | 登记托管账号    |       |
| 联系人                                                                                                                                     |     | 联系电话      |       |
| 销售佣金收款                                                                                                                                  | 户名  |           | 账号    |
| 账户信息                                                                                                                                    | 开户行 |           | 大额支付号 |
| 配售方信息                                                                                                                                   |     |           |       |
| 类型: 簿记管理人 <input type="checkbox"/> / 主承销商 <input type="checkbox"/> / 承销团成员 <input type="checkbox"/>                                     |     |           |       |
| 机构全称                                                                                                                                    |     | 系统账户      |       |
| 申购明细                                                                                                                                    |     |           |       |
| 申购标位 ( %或 元/百元面值)                                                                                                                       |     | 申购金额 (万元) |       |
| 标位 1                                                                                                                                    |     | 投标量       |       |
| 标位 2                                                                                                                                    |     | 投标量       |       |
| 标位 3                                                                                                                                    |     | 投标量       |       |
| 标位 4                                                                                                                                    |     | 投标量       |       |
| 标位 5                                                                                                                                    |     | 投标量       |       |
| 合计                                                                                                                                      |     |           |       |

(注: 标位不够可自行添加)

预留印鉴:

年 月 日

附件 9:

集中簿记建档业务投资人债券额度配售线下业务凭单

北京金融资产交易所有限公司:

我单位现申请办理投资人债券额度配售线下业务,并保证所发送的本凭单内容真实、准确、完整、有效。

| 申请方信息              |       |                                                             |  |
|--------------------|-------|-------------------------------------------------------------|--|
| 申请方角色类型            |       | 配售方 <input type="checkbox"/> / 申购方 <input type="checkbox"/> |  |
| 机构全称               |       | 系统账户                                                        |  |
| 登记托管户名             |       | 登记托管账号                                                      |  |
| 联系人                |       | 联系电话                                                        |  |
| 结算银行账户信息           | 户名    |                                                             |  |
|                    | 账号    |                                                             |  |
|                    | 开户行   |                                                             |  |
|                    | 大额支付号 |                                                             |  |
| 对手方信息              |       |                                                             |  |
| 托管账户户名             |       |                                                             |  |
| 托管账户账号             |       |                                                             |  |
| 债券信息               |       |                                                             |  |
| 债券全称               |       | 债券代码                                                        |  |
| 投资人债券额度配售信息        |       |                                                             |  |
| 成交日期               |       | 缴款日期                                                        |  |
| 结算方式               |       |                                                             |  |
| 投资人债券额度配售份额 (万份)   |       |                                                             |  |
| 投资人债券额度配售款项金额 (万元) |       |                                                             |  |

预留印鉴:

年 月 日

附件 10:

集中簿记建档业务配售结果变更申请单

北京金融资产交易所有限公司:

我方已在集中簿记建档系统上完成配售结果发送工作, 现向贵所申请配售结果变更, 具体申请内容如下:

|        |      |         |
|--------|------|---------|
| 申请人信息  | 机构名称 |         |
|        | 联系人  |         |
|        | 联系方式 | 电话: 传真: |
| 债券信息   | 债券全称 |         |
|        | 债券简称 |         |
|        | 债券代码 |         |
| 申请处理事项 |      |         |
| 申请理由   |      |         |
| 备注     |      |         |

预留印鉴:

年 月 日

## 附件 11:

## 集中簿记建档业务基本信息变更申请单

|                                                                                                                                                                                                                        |  |      |  |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|------|--|
| 申请机构全称                                                                                                                                                                                                                 |  |      |  |
| 系统账号                                                                                                                                                                                                                   |  |      |  |
| 需变更信息:                                                                                                                                                                                                                 |  |      |  |
| 变更为:                                                                                                                                                                                                                   |  |      |  |
| 经办人                                                                                                                                                                                                                    |  | 联系电话 |  |
| 联系邮箱                                                                                                                                                                                                                   |  |      |  |
| 附件材料<br>(更名时需提交)                                                                                                                                                                                                       |  |      |  |
| 1. 更名说明书;<br>2. 关于更名的监管部门批文等相关材料复印件;<br>3. 银行间市场清算所股份有限公司开户证明文件复印件;<br>4. 新业务参与机构投资者签署的《非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务客户服务协议》(一式两份)及其附件;<br>5. 原《非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务客户服务协议》。<br>所有材料均加盖本单位公章。                                     |  |      |  |
| 本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律<br>责任, 承诺遵守银行间市场法律法规, 依据银行间市场交易商协会相关自律规则使用系统参与相关业务。<br><br><div style="text-align: right;">           经办人签字:<br/>           预留印鉴(签章):<br/>           年      月      日         </div> |  |      |  |

## 附件 12:

## 集中簿记建档系统账户变更/注销申请单

|                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|--|
| 申请机构全称                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 系统账号                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 申请项目                                                                                                                                                                                                                           | <input type="checkbox"/> 业务权限变更 <input type="checkbox"/> 注销<br><input type="checkbox"/> 暂停 <input type="checkbox"/> 恢复                                                                                                               |      |  |
| 业务权限变更                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 业务资格                                                                                                                                                                                                                           | 非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务                                                                                                                                                                                                                  |      |  |
| 业务角色<br>(原)                                                                                                                                                                                                                    | <input type="checkbox"/> 发行人 <input type="checkbox"/> 簿记管理人<br><input type="checkbox"/> 主承销商 <input type="checkbox"/> 承销团成员<br><input type="checkbox"/> 投资人      ( <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 非金融机构合格投资人) |      |  |
| 业务角色<br>(变更为)                                                                                                                                                                                                                  | <input type="checkbox"/> 发行人 <input type="checkbox"/> 簿记管理人<br><input type="checkbox"/> 主承销商 <input type="checkbox"/> 承销团成员<br><input type="checkbox"/> 投资人      ( <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 非金融机构合格投资人) |      |  |
| 经办人                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                      | 联系电话 |  |
| 联系邮箱                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| <p>本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律责任，承诺遵守银行间市场法律法规，依据银行间市场交易商协会相关自律规则使用系统参与相关业务。</p> <p style="text-align: right;">经办人签字：</p> <p style="text-align: right;">预留印鉴（签章）：</p> <p style="text-align: right;">年      月      日</p> |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |

## 附件 13:

## 集中簿记建档系统管理员设置申请单

| 申请信息                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|--|
| 机构全称                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 联网方式                                                                                                                                                                                                                                                 | <input type="checkbox"/> 互联网 <input type="checkbox"/> 专线 <input type="checkbox"/> 拨号                                                                                                                                         |      |  |
| 系统管理员申请数量                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| Ukey 申请数量                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 经办人                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                              | 联系电话 |  |
| 联系邮箱                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 业务权限                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 系统权限                                                                                                                                                                                                                                                 | <input type="checkbox"/> 非金融企业债务融资工具集中簿记建档系统                                                                                                                                                                                 |      |  |
| 业务角色                                                                                                                                                                                                                                                 | <input type="checkbox"/> 发行人 <input type="checkbox"/> 簿记管理人 <input type="checkbox"/> 主承销商 <input type="checkbox"/> 承销团成员<br><input type="checkbox"/> 投资人 ( <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 非金融机构合格投资人) |      |  |
| 可分配账户                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 系统管理员负责人信息                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 姓名                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                              | 所属部门 |  |
| 身份证号                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              | 电子邮箱 |  |
| 办公电话                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              | 联系手机 |  |
| 指定 Ukey 保管人信息                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |
| 姓名                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                              | 所属部门 |  |
| 身份证号                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              | 电子邮箱 |  |
| 办公电话                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                              | 联系手机 |  |
| <p>本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律<br/>           责任，承诺遵守银行间市场法律法规，依据银行间市场交易商协会相关自律<br/>           规则使用系统参与相关业务。</p> <p style="text-align: right;">             经办人签字：<br/>             预留印鉴（签章）：<br/>             年      月      日           </p> |                                                                                                                                                                                                                              |      |  |

注：机构可根据自身需求设置多个系统管理员及相应内容。

## 附件 14:

## 集中簿记建档系统管理员变更/注销申请单

|                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|--|
| 申请机构全称                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 法人机构账号                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 用户名                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 申请办理                                                                                                                                                                                                                                                            | <input type="checkbox"/> 业务权限变更 <input type="checkbox"/> 密码重置<br><input type="checkbox"/> 注销 <input type="checkbox"/> 暂停 <input type="checkbox"/> 恢复                                                                                 |      |  |
| 业务权限变更                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 系统权限                                                                                                                                                                                                                                                            | 非金融企业债务融资工具集中簿记建档系统                                                                                                                                                                                                                  |      |  |
| 业务角色（原）                                                                                                                                                                                                                                                         | <input type="checkbox"/> 发行人 <input type="checkbox"/> 簿记管理人<br><input type="checkbox"/> 主承销商 <input type="checkbox"/> 承销团成员<br><input type="checkbox"/> 投资人      （ <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 非金融机构合格投资人） |      |  |
| 业务角色（变更为）                                                                                                                                                                                                                                                       | <input type="checkbox"/> 发行人 <input type="checkbox"/> 簿记管理人<br><input type="checkbox"/> 主承销商 <input type="checkbox"/> 承销团成员<br><input type="checkbox"/> 投资人      （ <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 非金融机构合格投资人） |      |  |
| 可操作账户（原）                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 可操作账户（变更为）                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| 经办人                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                      | 联系电话 |  |
| 联系邮箱                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |
| <p>本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律<br/>           责任，承诺遵守银行间市场法律法规，依据银行间市场交易商协会相<br/>           关自律规则使用系统参与相关业务。</p> <p style="text-align: right;">经办人签字：</p> <p style="text-align: center;">预留印鉴（签章）：</p> <p style="text-align: right;">年      月      日</p> |                                                                                                                                                                                                                                      |      |  |

附件 15:

集中簿记建档系统 Ukey 新增申请单

|                                                                                                                                                    |  |      |  |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|------|--|
| 申请机构全称                                                                                                                                             |  |      |  |
| 法人机构账户号                                                                                                                                            |  |      |  |
| 新增 Ukey 数量                                                                                                                                         |  |      |  |
| 新增事由                                                                                                                                               |  |      |  |
| 经办人                                                                                                                                                |  | 联系电话 |  |
| 联系邮箱                                                                                                                                               |  |      |  |
| 邮寄地址及邮编                                                                                                                                            |  |      |  |
| <p>本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律<br/>责任，承诺遵守银行间市场法律法规，依据银行间市场交易商协会相关自律规则使用系统参与相关业务。</p> <p>经办人签字：</p> <p>预留印鉴（签章）：</p> <p>年      月      日</p> |  |      |  |

附件 16:

集中簿记建档系统 Ukey 补办申请单

|                                                                                                                                                    |  |      |  |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|------|--|
| 申请机构全称                                                                                                                                             |  |      |  |
| 法人机构账号                                                                                                                                             |  |      |  |
| 原 Ukey 编号                                                                                                                                          |  |      |  |
| 补办 Ukey 数量                                                                                                                                         |  |      |  |
| 补办事由                                                                                                                                               |  |      |  |
| 经办人                                                                                                                                                |  | 联系电话 |  |
| 联系邮箱                                                                                                                                               |  |      |  |
| 邮寄地址及邮编                                                                                                                                            |  |      |  |
| <p>本机构对本表中填写内容的真实性、准确性、完整性和有效性负有完全的法律<br/>责任，承诺遵守银行间市场法律法规，依据银行间市场交易商协会相关自律规则使用系统参与相关业务。</p> <p>经办人签字：</p> <p>预留印鉴（签章）：</p> <p>年      月      日</p> |  |      |  |

附件 17:

北金所集中簿记建档业务联系方式

(一) 集中簿记建档业务咨询电话:

联系电话: 010-57896516, 010-57896722;

传真: 010-57896726;

邮箱: [fxb@cfae.cn](mailto:fxb@cfae.cn)。

(二) 集中簿记建档系统技术支持电话:

联系电话: 010-57896715 , 010-57896761;

邮箱: [pychen@cfae.cn](mailto:pychen@cfae.cn)

(三) 北金所网站及联系信息:

网址: <http://www.cfae.cn> ;

联系地址: 北京市西城区金融大街乙 17 号;

邮编: 100032 。