

中国金融期货交易所 国债期货信息发布指引

(2013年8月30日发布 2020年4月8日第一次修订)

第一条 为规范中国金融期货交易所(以下简称交易所)国债期货信息发布,保障客户充分、及时、有效地获得信息,根据《中国金融期货交易所交易规则》和《中国金融期货交易所信息管理办法》等规定,制定本指引。

第二条 交易所根据有关规定和市场需求发布国债期货可交割国债信息,即时、延时、每日、每周、每月交易信息,交割信息,各类统计信息以及合约历史数据。

第三条 可交割国债信息于国债期货合约上市前一交易日发布,遇新可交割国债上市时更新,主要包括国债全称、国债代码、到期日、票面利率、转换因子等内容。

第四条 交易所于每个交易日结束后发布下列国债期货成交量、持仓量信息:

(一)活跃国债期货合约前20名期货公司结算会员的成交量、持仓量;

(二)某一国债期货品种单边持仓达到3万手以上(含),按该品种汇总的非期货公司结算会员的成交量、持仓量。

第五条 交易所发布的国债期货交割信息包括每日交割意向申报信息和合约交割信息等内容。

交易所可以根据市场需要调整国债期货交割信息的公布频率与内容。

第六条 每日交割意向申报信息包括下列主要内容：

（一）意向交割国债信息：国债全称、到期日、票面利率、申报交割量；

（二）期货公司结算会员的申报买方交割量和申报卖方交割量；

（三）所有非期货公司结算会员的申报买方交割总量和申报卖方交割总量。

第七条 国债期货合约交割信息包括下列主要内容：

（一）交割数据统计：合约代码、交割量和交割金额；

（二）交割国债信息：国债全称、到期日、票面利率、交割量、交割金额。

第八条 本指引由交易所负责解释。

第九条 本指引自 2020 年 4 月 9 日起实施。其中，第四条第（二）项自 2020 年 9 月 14 日起实施。