

附件 7

ICS 35.240.40

CCS A 11

**JR**

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0230—2021

---

## 债券价格指标产品数据采集规范

Primary data collection specification for bond pricing indicator  
products

2021 - 07 - 22 发布

2021 - 07 - 22 实施

---

中国人民银行 发布

## 目 次

前言 .....	II
1 范围 .....	1
2 规范性引用文件 .....	1
3 术语和定义 .....	1
4 概念数据模型 .....	6
5 采集时效性要求 .....	7
6 数据元表示格式 .....	7
7 数据元要素定义 .....	8
7.1 债券基本要素 .....	8
7.2 浮动利率债券要素 .....	15
7.3 永续债券要素 .....	21
7.4 资产支持证券要素 .....	29
7.5 资产包要素 .....	33
7.6 资产包信息披露要素 .....	35
7.7 债券流通要素 .....	39
7.8 债券发行注册要素 .....	43
7.9 评级要素 .....	45
7.10 债券现金流要素 .....	48
7.11 债券外部编码要素 .....	62
7.12 债券存量变动要素 .....	63
7.13 债券与相关主体关系 .....	65
7.14 主体基本要素 .....	66
7.15 主体外部编码要素 .....	67
参考文献 .....	69

## 前 言

本文件按照GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由中央国债登记结算有限责任公司提出。

本文件由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）归口。

本文件起草单位：中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司、中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券投资基金业协会、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、易方达基金管理有限公司、中证指数有限公司、上海大智慧财汇数据科技有限公司、万得信息技术股份有限公司、路孚特信息服务（中国）有限公司、彭博资讯（北京）有限公司。

本文件主要起草人：牛玉锐、郑英立、王超群、赵凌、孙明洁、魏成、徐超、邬隽骁、马彤、解少飞、孙昭苏、金昌骏、张兆嘉、熊歆、汤玥玥、赵丽、刘瑞丰、纪伟伟、苏晓航、张苏林、宋震、马骏、何真、孙涛、陈映洲、史海雄、周立、程海波、蔡骏胜、诸赞松、蒋瑞杰。

# 债券价格指数产品数据采集规范

## 1 范围

本文件规定了债券价格指数产品编制过程中所涉及的债券概念数据模型、采集时效性要求、数据元表示格式、数据元要素定义相关内容。

本文件适用于债券价格指数产品的编制机构及为债券价格指数产品编制提供基础数据服务的金融信息服务商。

## 2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中，注日期的引用文件，仅该日期对应的版本适用于本文件；不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

- GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码
- GB/T 2260—2007 中华人民共和国行政区划代码
- JR/T 0065—2019 银行间市场基础数据元

## 3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

### 3.1

**概念数据模型** conceptual data model

用抽象概念表示现实世界的数据模型。

[来源：GB/T 18391—2009, 3.2.5]

### 3.2

**数据元** data element

在一定语境中不可再细分的数据单元。

[来源：GB/T 18391—2009, 3.3.8]

### 3.3

**数据元集** data element set

数据元的集合，将描述同一含义、同一事物的数据元归类形成的集合。

### 3.4

**可枚举值域** enumerated value domain

规定全部允许值列表的值域。

[来源：GB/T 18391—2009，3.3.13]

### 3.5

#### 债券 bond

反映债权债务关系的凭证，用以证明发行人有义务通过提供现金或金融工具等进行偿付，在一定程度上可以流通的金融工具。

[来源：JR/T 0229—2021，3.2]

### 3.6

#### 零息式 zero coupon

原始期限超过一年的债券，不附有息票，或是在票面上不规定利率，以低于面值的价格发行或出售转让，到期按照面值支付本息。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.19]

### 3.7

#### 贴现式 discount

原始期限不超过一年（含）的债券，不附有息票，或是在票面上不规定利率，以低于面值的价格发行或出售转让，到期按照面值支付本息。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.19]

### 3.8

#### 利随本清固定利率 fixed coupon and pay at maturity

债券存续期内不支付利息，利息和本金在债券到期时一次性偿还，附有固定利息。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.19]

### 3.9

#### 利随本清浮动利率 float coupon and pay at maturity

债券存续期内不支付利息，利息和本金在债券到期时一次性偿还，附有浮动利息。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.19]

### 3.10

#### 付息式固定利率 fixed coupon and plain vanilla

债券存续期内支付利息，附有固定利息。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.19]

### 3.11

#### 付息式浮动利率 float coupon and plain vanilla

债券存续期内支付利息，附有浮动利息。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.19]

## 3.12

**浮动利率债券** float rate bond

存续期内的票面利率均为浮动利率的债券。

## 3.13

**混合利率债券** fixed to float rate bond

在存续期内票面利率部分时间段按照浮动利率计息、部分时间段按照固定利率计息的债券。

## 3.14

**永续债券** perpetual bond

无固定期限债券。

## 3.15

**资产支持证券** asset backed security; ABS

一种具有债券性质的,向投资者支付未来本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益的金融工具。

注:广义的资产支持证券包括所有资产支持证券化产品,含住房抵押贷款资产支持证券化产品等。

## 3.16

**实际天数/实际天数** actual/actual

债券按照实际天数计算利息,年度的计息天数为年实际天数。

## 3.17

**实际天数/360** actual/360

债券按照实际天数计算利息,年度的计息天数为360天。

## 3.18

**30/360**

债券的年度计息天数为360天,月度计息天数为30天。

## 3.19

**计息年度** year of accrual of interest

债券的起息日及后续每一年的对应日期所形成的区间。

## 3.20

**计息期起息日所在的自然年度** calendar year of the interest accrual date

债券每个计息期的起始日期所在的自然年度(1月1日至12月31日)。

3.21

**普通债权 ordinary debt**

在发行人破产时，本金和利息的清偿顺序居于次级债权、混合资本债权及股权资本之前的债权。

3.22

**次级债权 subordinate debt**

在发行人破产时，本金和利息的清偿顺序居于普通债权之后，优先于混合资本债权及股权资本的债权。

3.23

**非公开发行 private offering**

债券仅针对特定的少数投资者发行。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.13，有修改]

3.24

**公开发行 public offering**

债券向不特定的投资者发行。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.13，有修改]

3.25

**交叉违约条款 cross default clause**

债券在发行时约定，当本债券的债务人未能清偿本债券以外其他债权的本金或利息，本债券也视同为发生违约事件，触发违约。

3.26

**永续条款 perpetual clause**

债券发行时未约定债券到期日，但发行人有权按照约定赎回债券的条款。

3.27

**固定摊还 fixed amortization**

资产支持证券本金的偿付在支付日期和支付金额方面具有约定的摊还计划，本金偿付需按照计划进行。

3.28

**过手摊还 pass-through amortization**

资产支持证券在每个支付日没有固定的还本金额安排，而是根据现金流的实际流入情况，在扣除相关费用后直接按照比例分配给投资者。

3.29

**静态型结构 static pool**

资产支持证券的静态池交易结构，特殊目的载体向原始权益人一次性购买基础资产后，基础资产池中的资产将固定不变。

## 3.30

**循环型结构 managed pool**

资产支持证券的动态池交易结构，基础资产池封包后，在约定的循环购买期间，基础资产池中产生的现金流可持续购买新的满足合格标准的基础资产。

## 3.31

**发行人赎回选择权 issuer call option**

发行人可在约定的日期，选择按照约定的价格将债券赎回的权利。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.10]

## 3.32

**投资人回售选择权 investor put option**

投资人可在约定的日期，选择按照约定的价格将债券回售给发行人的权利。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.10]

## 3.33

**发行人调整票面利率选择权 issuer coupon rate adjustment option**

发行人可在约定的日期，选择调整债券票面利率的权利。

[来源：JR/T 0229—2021，6.3.2.10]

## 3.34

**美式期权 American option**

在期权到期日当天以及到期日之前任何时间可执行的期权。

## 3.35

**欧式期权 European option**

在期权到期日当天执行的期权。

## 3.36

**百慕大期权 Bermuda option**

在期权到期日之前一系列约定的日期或在到期日当天执行的期权。

## 3.37

**担保 guarantee**

保证人和债权人约定，当债务人不履行债务时，保证人按照约定履行债务或者承担责任的行為。

3.38

一般保证 general guarantee

当事人在保证合同中约定，债务人不能履行债务时，由保证人承担保证责任的保证形式。

3.39

连带责任保证 joint guarantee

当事人在保证合同中约定保证人与债务人对债务承担连带责任的保证形式。

3.40

抵押 collateral

债务人或者第三方不转移某项财产的占有，将该财产作为债权的担保。

注：债务人不履行债务时，债权人有权依法将该财产折价或者以拍卖、变卖该财产的价款优先受偿。

3.41

质押 pledge

债务人或者第三方将某项财产移交债权人占有，将该财产作为债权的担保。

注：债务人不履行债务时，债权人有权依法将该财产折价或者以拍卖、变卖该财产的价款优先受偿。

4 概念数据模型

本文件中，概念数据模型基于债券价格指标产品编制基础数据及其数据之间关联关系形成。债券价格指标生产所需数据元，主要包括债券数据元和债券相关主体数据元两个部分。两个部分的数据元通过“债券与相关主体关系”这一实体关系连接，构成债券价格指标生产基础数据的概念数据模型，见下图。

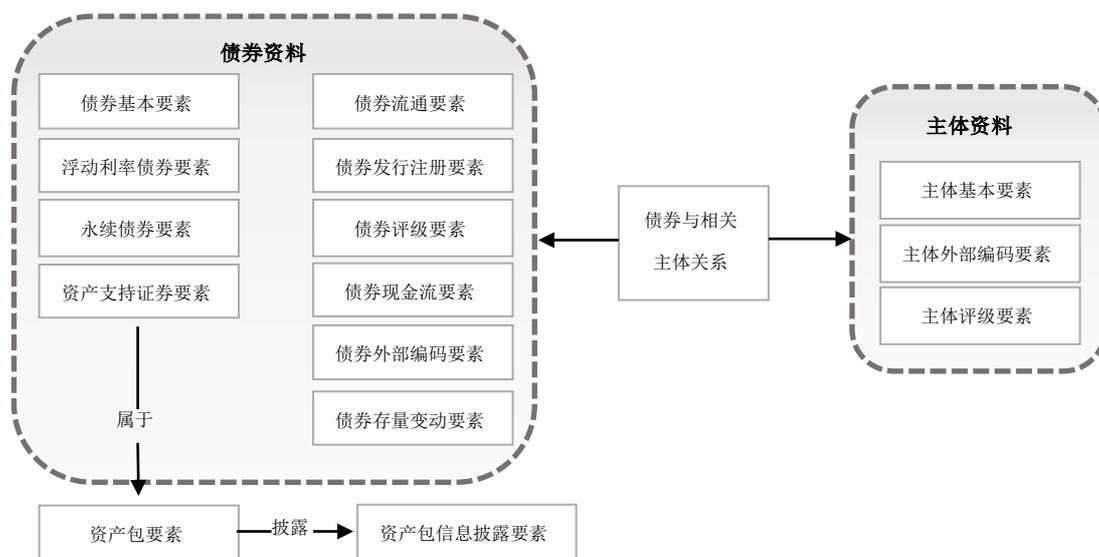


图 概念数据模型

数据元是本文件最基础的组成单位，本文件将描述同一含义、同一事物的数据元归类形成的若干个集合，定义为数据元集。

本文件中共包含15个数据元集：债券基本要素、浮动利率债券要素、永续债券要素、资产支持证券要素、资产包要素、资产包信息披露要素、债券流通要素、债券发行注册要素、评级要素、债券现金流要素、债券外部编码要素、债券存量变动要素、债券与相关主体关系、主体基本要素和主体外部编码要素，具体内容如下：

- “债券基本要素”数据元集记录债券的通用要素信息，包括债券的期限、计息方式、基本条款等，反映债券的基本特征。
- “浮动利率债券要素”数据元集记录浮动利率债券所特有的要素信息，包括基准利率种类、利率重置规则、保底上限利率等，根据债券的利率条款采集，反映债券的利率浮动特征。
- “永续债券要素”数据元集记录永续债券和可续期债券所特有的要素信息，包括重定价规则、利率跳升、利息递延条款等，根据债券的期限条款、续期条款采集，反映债券的永续/续期特征。
- “资产支持证券要素”数据元集记录资产支持证券所特有的要素信息，包括资产支持证券的现金流分配顺序、超额收益分配比例等，反映资产支持证券的基本特征。
- “资产包要素”数据元集记录资产支持证券在项目层面的相关特征和要素信息，包括资产支持证券的基础资产类型、现金流分配机制、结构类型等。
- “资产包信息披露要素”数据元集记录资产支持证券在发行文件和存续期信息披露文件中披露的现金流相关信息，包括现金流归集情况、计划还本情况、实际还本情况等。
- “债券流通要素”数据元集记录债券上市流通信息，并记录流通状态变化。
- “债券发行注册要素”数据元集记录债券发行信息，并记录债券的发行结果和发行状态。
- “评级要素”数据元集记录债券评级要素，即债券的债项评级结果，并记录主体评级要素，即债券相关主体的主体评级结果。
- “债券现金流要素”数据元集记录根据债券的发行条款和公司行为汇总得到的付息、还本、选择权等反映债券现金流情况的要素信息。
- “债券外部编码要素”数据元集记录登记托管机构、金融信息服务商等机构赋予债券的唯一识别编码。
- “债券存量变动要素”数据元集记录债券的存量规模变动情况，包括存量变动的历史情况。
- “债券与相关主体关系”数据元集记录债券与债券的发行人、担保人、主承销商、特殊目的载体管理人等相关主体的对应关系。
- “主体基本要素”数据元集记录债券相关主体的基本要素，反映债券相关主体的基本特征，包括主体的名称、所在地区等要素信息。
- “主体外部编码要素”数据元集记录国内和国际编码机构等赋予债券相关主体的唯一识别编码，包括统一社会信用代码、全球法人识别编码（LEI, Legal Entity Identifier）等。

## 5 采集时效性要求

债券价格指标生产所需的基础数据元在债券发行、存续期间披露的公告等相关文件中进行采集。

数据元采集注重时效性，数据应及时更新。根据不同的公告类型，应制定不同的数据采集时效性规定。例如，发行结果公告，应于公告发布后立即完成采集。对于债券的流通状态等相关数据元，应在披露流通状态的当日，对流通状态完成采集。

## 6 数据元表示格式

本文件的债券价格指标产品基础数据元，应按照以下结构和内容进行规范：

——名称：数据元的中文名称，必填。

——英文名称：数据元的英文名称，必填。每个英文单词之间无间隔，且每个主要英文单词首字母大写。

——编号：数据元在本文件中的唯一编号，按照债券价格指标产品分类进行顺序编号，并适当留有一定的扩展空间，必填。编号为五位，第1位为大写英文字母，本文件编号中的A、P、E分别代表资产（Asset）、资产包（Portfolio）及主体（Entity）。第2、3位为数据元集的顺序号，对资产、资产包及主体中所涉及的数据元集进行排序。第4、5位为每个数据元集中数据元的顺序号。为准确采集，当同一数据元出现在不同数据元集中时，数据元将被赋予不同编号。

——数据元集：数据元的集合，必填。

——定义：数据元的含义，必填。

——采集口径：数据元信息采集的依据，必填。

——数据类型：数据元的取值类型，必填。

——可枚举值域：用于规定当数据元可被枚举时，可供枚举的数据元值域，非必填。

——度量单位：数据元中数字型取值的单位，必填。若没有度量单位，填写无。

注：每项数据元依据债券实际披露情况，提供相关的采集示例，如果没有，不提供。债券通过债券简称表示，例如“15粤珠江MTN001”为债券简称，其中“15”为债券的发行年份。

## 7 数据元要素定义

### 7.1 债券基本要素

#### 7.1.1 币种

名称：币种

英文名称：Currency

编号：A0101

数据元集：债券基本要素

定义：标识债券现金流的币种代码

采集口径：根据发行文件中约定的债券币种采集。对于单一币种债券而言，债券的计价、本金兑付、利息支付均采用相同的币种。对于多币种债券而言，债券的计价、本金兑付、利息支付可采用不同的币种，应分别记录。

数据类型：字符型

可枚举值域：美元 USD、欧元 EUR、日元 JPY、港元 HKD、英镑 GBP、人民币 CNY、其他

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“面值：人民币 100 元”，则币种采集为“人民币 CNY”。

#### 7.1.2 起息日

名称：起息日

英文名称：InterestAccrualDate

编号：A0102

数据元集：债券基本要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即开始计算资金利息的日期，或交易双方履行资金交割与结算的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的期限条款（起息日期、起始日期等）采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“起息日：2015 年 12 月 16 日”，则起息日采集为“2015-12-16”。

### 7.1.3 到期日

名称：到期日

英文名称：MaturityDate

编号：A0103

数据元集：债券基本要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即证券本金偿还结束日或票据、存单等交易标的的到期偿付日，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的期限条款（到期日期）采集，若债券未约定到期日（永续债券），则采集为空。对于发行文件中披露多个到期日（预期到期日、法定到期日、到期日）的债券，应按照最晚日期采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“兑付日：2016 年 12 月 30 日”，则到期日采集为“2016-12-30”。

### 7.1.4 实际到期日

名称：实际到期日

英文名称：ActualMaturityDate

编号：A0104

数据元集：债券基本要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即实际的证券到期日，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据兑付公告、提前兑付公告中披露的债券实际兑付完毕日期（券面总额减为 0）采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：13 黔南债在《2013 年黔南州国有资本营运有限责任公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“2018 年 5 月 30 日提前兑付剩余本金并支付本期债券的应计利息”，实际到期日采集为“2018-05-30”。

### 7.1.5 计息类型

名称：计息类型

英文名称：CouponType

编号：A0105

数据元集：债券基本要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即利息计算时使用的不同利息分类和付息方式分类

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，若债券未约定利息且期限小于一年（含），则采集为贴现式；若债券未约定利息且期限超过一年，则采集为零息式；若债券附有固定/浮动利息，且存续期内不支付利息，到期一次性兑付本息，则采集为利随本清固定利率/利随本清浮动利率；若债券附有固定/浮动利息，且存续期内分多次支付利息，则采集为付息式固定利率/付息式浮动利率。

数据类型：字符型

可枚举值域：贴现式、零息式、利随本清固定利率、利随本清浮动利率、附息式固定利率、附息式浮动利率

度量单位：无

示例：13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“发行利率：本期中期票据采用浮动利率，即基准利率加利差，基准利率为 6 个月美元 Libor。6 个月美元 Libor：本期中期票据定息日伦敦时间上午 11:00 伦敦银行家协会公布的伦敦同业拆借市场的 6 个月美元拆放利率（USD-LIBOR-BBA）。定息日：本期中期票据起息日前两个工作日”，则计息类型采集为“附息式浮动利率”。

### 7.1.6 计息基准

名称：计息基准

英文名称：InterestBasis

编号：A0106

数据元集：债券基本要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券计算利息时计算天数的规则，包含计息年度天数规则和计息天数规则两部分内容

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款和利息计算公式采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：实际天数/实际天数、实际天数/实际天数 ICMA、实际天数/实际天数 ISDA、实际天数/365（2 月 29 日计息）、实际天数/365（2 月 29 日不计息）、实际天数/360、30/360 US、30/360 ICMA、30/360 ISDA、30E/360 ISDA

注：1. 实际天数/365（2 月 29 日计息）指债券按照实际天数（2 月 29 日计息）计算利息，年度的计息天数为 365 天。

2. 实际天数/365（2 月 29 日不计息）指债券按照实际天数（2 月 29 日不计息）计算利息，年度的计息天数为 365 天。

3. ICMA：国际资本市场协会（International Capital Market Association）；ISDA：国际掉期与衍生工具协会（International Swaps and Derivatives Association）；US：美国（United States）；E：欧洲债券（Eurobond）。

度量单位：无

示例：13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“本期中期票据的利息按照每年 360 天和实际发生天数（包括每个计息期起始日但不包括每个计息期结束之日）计算，即 actual/360”，则计息基准采集为“实际天数/360”。

### 7.1.7 债券付息周期

名称：债券付息周期

英文名称：CouponCycle

编号：A0107

数据元集：债券基本要素

定义：存续期间多次付息的债券，以每隔 N 个月（或日、年）付息一次表示

采集口径：根据募集说明书、发行文件采集，与债券付息周期单位配合使用。对于规则付息的债券，应按照发行文件采集债券付息周期。对于不规则付息的债券，有两种情况：

——如债券仅在第一个或最后一个付息期不规则，而其他付息期的付息周期是规则的，则根据其他规则付息期的长度采集债券付息周期。

——如债券存在两个及以上付息期的付息周期不一致，则债券付息周期采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：与债券付息周期单位配合使用

示例：08 国开 06 在发行文件中约定“起息日为 2008 年 3 月 20 日，兑付日为 2015 年 3 月 20 日。第一次付息日为 2008 年 9 月 20 日，以后每年 3 月 20 日、9 月 20 日为债券结息日和利率调整日，如遇节假日，则支付日顺延”，则债券付息周期采集为“6”（债券付息周期单位为“月/次”）。

### 7.1.8 债券付息周期单位

名称：债券付息周期单位

英文名称：CouponCycleUnit

编号：A0108

数据元集：债券基本要素

定义：存续期间多次付息的债券，付息间隔的单位

采集口径：根据募集说明书、发行文件采集，与债券付息周期配合使用。

数据类型：字符型

可枚举值域：日/次、周/次、月/次

度量单位：无

示例：08 国开 06 在发行文件中约定“起息日为 2008 年 3 月 20 日，兑付日为 2015 年 3 月 20 日。第一次付息日为 2008 年 9 月 20 日，以后每年 3 月 20 日、9 月 20 日为债券结息日和利率调整日，如遇节假日，则支付日顺延”，则债券付息周期单位采集为“月/次”（债券付息周期为“6”）。

### 7.1.9 年实际天数类型

名称：年实际天数类型

英文名称：ActualType

编号：A0109

数据元集：债券基本要素

定义：债券计息基准的年实际天数计算规则

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：计息年度、计息期起息日所在的自然年度

度量单位：无

示例：14 工元 1A 在发行文件中约定“优先 A 档资产支持证券的计息方式为优先 A 档资产支持证券在计息期间之初的未偿本金余额×票面利率×计息期间实际天数÷计息期间起始日所在公历年全年的实际天数”，则年实际天数类型采集为“计息期起息日所在的自然年度”。

### 7.1.10 利息分布方式

名称：利息分布方式

英文名称：CouponAllocationType

编号：A0110

数据元集：债券基本要素

定义：债券付息周期小于 12 个月的附息式固定利率、附息式浮动利率债券的利息分配方式，全年利息按照付息频率在各计息期间平均分配或按照各计息期的实际天数计算和分配

采集口径：根据发行文件推断和采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：平均分配利息分布方式、实际天数分配利息分布方式

注：1. 平均分配利息分布方式指债券全年利息按照付息频率在各计息期间平均分配的分布方式。

2. 实际天数分配利息分布方式指债券全年利息按照在各计息期间的实际天数的分布方式。

度量单位：无

示例：14 工元 1A 在发行文件中约定“优先 A 档资产支持证券的计息方式为优先 A 档资产支持证券在计息期间之初的未偿本金余额×票面利率×计息期间实际天数÷计息期间起始日所在公历年全年的实际天数”，则利息分布方式采集为“实际天数分配利息分布方式”。

#### 7.1.11 分期还本条款标志

名称：分期还本条款标志

英文名称：SerialBondIndicator

编号：A0111

数据元集：债券基本要素

定义：标识债券是否为分期还本

采集口径：根据发行文件中约定的还本条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：是、否

度量单位：无

示例：13 黔南债在发行文件中约定“本期债券设置提前还本条款，在债券存续期的第 3、4、5、6、7 年末分别按照债券发行总额 20%、20%、20%、20%、20%的比例偿还债券本金”，则分期还本条款标志采集为“是”。

#### 7.1.12 担保类型

名称：担保类型

英文名称：CollateralType

编号：A0112

数据元集：债券基本要素

定义：债券的担保方式

采集口径：根据发行文件采集。当债券存在多种担保方式时，均应采集和提供，并用“|”隔开。

保证、质押、抵押、其他作为一级分类。一般保证和连带责任保证作为保证的二级分类。动产质押、权利质押作为质押的二级分类。当有二级分类的时候，只采集二级分类即可。其中：

——动产质押指：不包含土地以及房屋、林木等地上定着物以外之物。

——权利质押包含：

- a) 汇票、支票、本票、债券、存款单、仓单、提单。
- b) 依法可转让的股份、股票。
- c) 依法可转让的商标专用权，专利权、著作权中的财产权。
- d) 依法可质押的其他权利。

数据类型：字符型

可枚举值域：保证、一般保证、连带责任保证、质押、动产质押、权利质押、抵押、其他

度量单位：无

示例：13 黔南债在发行文件中约定“发行人以其拥有的国有土地使用权为本期债券提供抵押担保”，则担保类型采集为“抵押”。

#### 7.1.13 清偿顺序

名称：清偿顺序

英文名称：PaymentRank

编号：A0113

数据元集：债券基本要素

定义：债务清偿的先后次序

采集口径：根据发行文件采集。对于特殊目的载体为发行主体的债券，应按照债券的分级结构确定清偿次序，例如，资产支持证券的优先档按照“普通债权”采集，次级档按照“次级债权”采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：普通债权、次级债权、混合债权、优先股、普通股

注：混合债权指满足混合资本工具的要求，所募资金可计入二级资本，清偿顺序居于普通债权、次级债权之后，优先于股权资本的债权。

度量单位：无

示例：18 榆次农商二级 01 在发行文件中约定“本期债券与发行人已发行的与本期债券偿还顺序相同的其他次级债务处于同一清偿顺序，与未来可能发行的与本期债券偿还顺序相同的其他二级资本工具同顺位受偿”，则清偿顺序采集为“次级债权”。

#### 7.1.14 公开发行标志

名称：公开发行标志

英文名称：PublicOfferingIndicator

编号：A0114

数据元集：债券基本要素

定义：标识债券的发行方式是否为公开发行

采集口径：根据发行文件采集，定向发行、私募发行、非公开发行均属于“非公开发行”。

数据类型：字符型

可枚举值域：是、否

度量单位：无

示例：13 黔南债在发行文件中约定“承销团成员设置的发行网点向中华人民共和国境内机构投资者（国家法律、法规另有规定除外）公开发行和通过上海证券交易所向机构投资者（国家法律、法规禁止购买者除外）公开发行”，则公开发行标志采集为“是”。

#### 7.1.15 抵质押品

名称：抵质押品

英文名称：Collateral

编号：A0115

数据元集：债券基本要素

定义：债券的担保方式为抵押或质押时，抵质押人提供的担保财产

采集口径：根据发行文件采集，应采集抵质押品的描述和抵质押品实际所有人/债务人的信息。

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：15 瀚瑞 CP002 在发行文件中约定“应收账款：根据发行人（作为应收账款债权人、出质人）与镇江新区管理委员会（作为应收账款债务人）签署的《工程代建资金还款协议》，用于质押的应收账款总额为 9.19 亿元”，则抵质押品采集为“镇江新区管理委员会（应收账款债务人）应收账款总额 9.19 亿元”。

#### 7.1.16 违约罚息率

名称：违约罚息率

英文名称：PenaltyRate

编号：A0116

数据元集：债券基本要素

定义：债券发生逾期等违约事件时，对违约部分资金应额外支付的罚息利率

采集口径：根据发行文件采集，统一按照日利率采集，不必年化。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“公司如未履行中期票据还本付息义务或未按照中期票据发行办法规定的时间支付手续费，应对未偿付部分以万分之二点一（0.21%）的日利率向投资者支付违约金”，则违约罚息率采集为“0.021”。

#### 7.1.17 节假日处理规则

名称：节假日处理规则

英文名称：HolidayRule

编号：A0117

数据元集：债券基本要素

定义：付息、还本、行权等债券现金流遇节假日时的处理规则

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：未做约定、遇节假日顺延、遇节假日提前、遇周末提前、遇法定节假日顺延

度量单位：无

示例：13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“付息日如遇法定节假日顺延至下一个工作日。兑付日：2016 年 12 月 30 日（如遇法定节假日，则顺延至其后的一个工作日）”，则节假日处理规则采集为“遇法定节假日顺延”。

#### 7.1.18 交叉违约条款标志

名称：交叉违约条款标志

英文名称：CrossDefaultClauseIndicator

编号：A0118

数据元集：债券基本要素

定义：标识债券是否约定交叉违约条款

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：是、否

度量单位：无

示例：18 建银 SCP001 在发行文件中约定“如果发行人及其合并范围内子公司未能清偿到期应付的本债项以外的其他债务融资工具、公司债、企业债或境外债券的本金或利息，应在 2 个工作日内予以公告，并立即启动如下保护机制”，则交叉违约条款标志采集为“是”。

#### 7.1.19 宽限期

名称：宽限期

英文名称: GracePeriod

编号: A0119

数据元集: 债券基本要素

定义: 发行人未能按照约定履行其支付义务时, 根据发行文件约定所享有的宽限期

采集口径: 根据发行文件采集。

数据类型: 数字型

度量单位: 日

示例: 18 银建 SCP001 在发行文件中约定“发行人在第 4.1 条的触发情形发生之后有 10 个工作日的宽限期, 若发行人在该期限内对第 4.1 条中的债务进行了足额偿还, 则不构成发行人在本期债务融资工具项下的违反约定”, 则宽限期采集为“10”。

### 7.1.20 永续条款类型

名称: 永续条款类型

英文名称: PerpetualType

编号: A0120

数据元集: 债券基本要素

定义: 债券的续期条款种类

采集口径: 根据发行文件采集。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 无、可续期条款、永续条款

注: 可续期条款指债券在发行时约定债券到期日以及发行人有权延长债券期限的条款。

度量单位: 无

示例: 15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“于发行人依照发行条款的约定赎回之前长期存续, 并在发行人依据发行条款的约定赎回时到期”, 则永续条款类型采集为“永续条款”。

## 7.2 浮动利率债券要素

### 7.2.1 浮动利率债券类型

名称: 浮动利率债券类型

英文名称: FloatType

编号: A0201

数据元集: 浮动利率债券要素

定义: 债券为浮动利率债券或混合利率债券时, 根据浮动区间是否完整覆盖债券的全生命周期, 对浮动利率债券进行的分类

采集口径: 根据发行文件采集。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 浮动利率债券、混合利率债券

度量单位: 无

示例: 13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“票面利率: 浮动利率。本期中期票据采用浮动利率, 即基准利率加利差, 基准利率为 6 个月美元 Libor”, 则浮动利率债券类型采集为“浮动利率债券”。

### 7.2.2 浮动区间起始日

名称: 浮动区间起始日

英文名称: FloatStartDate

编号: A0202

数据元集: 浮动利率债券要素

定义: 浮动利率债券利率浮动日期区间的起始日, 格式为 YYYY-MM-DD

采集口径: 根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型: 日期型

度量单位: 无

示例: 13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“本期中期票据采用浮动利率。自缴款日开始计息, 计息期: 从缴款日开始每 6 个月计息一次。缴款日为 2013 年 12 月 30 日”, 该债券为浮动利率债券, 浮动区间起始日为起息日期, 则浮动区间起始日采集为“2013-12-30”。

### 7.2.3 浮动区间结束日

名称: 浮动区间结束日

英文名称: FloatEndDate

编号: A0203

数据元集: 浮动利率债券要素

定义: 浮动利率债券利率浮动日期区间的结束日, 格式为 YYYY-MM-DD

采集口径: 根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型: 日期型

度量单位: 无

示例: 13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“本期中期票据采用浮动利率。自缴款日开始计息, 计息期: 从缴款日开始每 6 个月计息一次。缴款日为 2013 年 12 月 30 日。本金自兑付日起不另计利息, 兑付日为 2016 年 12 月 30 日”, 该债券为浮动利率债券, 浮动区间结束日为到期兑付日期, 则浮动区间结束日采集为“2016-12-30”。

### 7.2.4 基准利率名称

名称: 基准利率名称

英文名称: BenchmarkInterestRate

编号: A0204

数据元集: 浮动利率债券要素

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即用来确定浮动利率债券或永续债券利率水平的利率指标

采集口径: 根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 中债国债-到期-3Y-5D、中债国开-到期-3Y-20D、中债国开-到期-7Y-20D、隔夜回购定盘利率 FR001、7 天回购定盘利率 FR007、一年以内(含一年)贷款利率、一至五年(含五年)贷款利率、五年以上贷款基准利率、五年以下(含五年)个人住房公积金贷款、五年期以上个人住房公积金贷款、SHIBOR-1W-120、SHIBOR-1W-750、SHIBOR-1W-1250、SHIBOR-3M、SHIBOR-3M-5、SHIBOR-3M-10、SHIBOR-3M-120、SHIBOR-6M-5、SHIBOR-6M-7、SHIBOR-6M-20、SHIBOR-1Y-5、SHIBOR-1Y-10、SHIBOR-1Y-15、SHIBOR-1Y-20、SHIBOR-1Y-30、LIBOR-USD-3M、LIBOR-USD-6M

度量单位: 无

示例: 13 沪城投美元 MTN001 在发行文件中约定“基准利率为 6 个月美元 Libor”, 则基准利率名称采集为“LIBOR-USD-6M”。

### 7.2.5 利率下限/上限条款标志

名称：利率下限/上限条款标志

英文名称：Floor/CapRateIndicator

编号：A0205

数据元集：浮动利率债券要素

定义：标识浮动利率债券或永续债券是否约定票面利率或基准利率的上限或下限

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：无、有下限条款但无上限条款、有上限条款但无下限条款、有下限条款和上限条款  
度量单位：无

示例：09 国开 04 在发行文件中约定“本期债券设立基准利率保底条款，当调息日执行的一年期定期存款利率低于 1.98%时，基准利率按照 1.98%执行”，且未约定上限利率，则利率下限/上限条款标志采集为“有下限条款但无上限条款”。

### 7.2.6 利率下限

名称：利率下限

英文名称：FloorRate

编号：A0206

数据元集：浮动利率债券要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即浮动利率债券或永续债券的最低票面利率

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：10 常德经投债在发行文件中约定“本期债券存续期内，若基准利率加上基本利差不高于 6.1%，则当期利率为 6.1%，若基准利率加上基本利差高于 6.1%，则当期利率为基准利率加上基本利差”，则利率下限采集为“6.1”。

### 7.2.7 利率上限

名称：利率上限

英文名称：CapRate

编号：A0207

数据元集：浮动利率债券要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即浮动利率债券或永续债券的最高票面利率

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

### 7.2.8 基准利率下限

名称：基准利率下限

英文名称：FloorBenchmarkRate

编号：A0208

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券或永续债券约定的最低基准利率。当实际基准利率低于基准利率下限时，以基准利率下限作为执行基准利率

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：09 国开 04 在发行文件中约定“本期债券设立基准利率保底条款，当调息日执行的一年定期存款利率低于 1.98%时，基准利率按照 1.98%执行”，则基准利率下限采集为“1.98”。

### 7.2.9 基准利率上限

名称：基准利率上限

英文名称：CapBenchmarkRate

编号：A0209

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券或永续债券约定的最高基准利率。当实际基准利率高于基准利率上限时，以基准利率上限作为执行基准利率

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

### 7.2.10 发行定息基准日

名称：发行定息基准日

英文名称：BenchmarkFixDate

编号：A0210

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券披露的发行时确定所用基准利率数值的基准日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件或发行结果文件采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：05 建元 1A 在发行文件中约定“首个计息期间所采用的优先级资产支持证券基准利率为：自 2005 年 12 月 14 日往前 20 个交易日的 7 天回购加权利率的算术平均值（即 12 月 14 日的 B\_1M 数据）”，此处明确披露使用“12 月 14 日的 B\_1M 数据”作为第一个计息期间的基准利率，则发行定息基准日采集为“2005-12-14”。

### 7.2.11 发行定息基准时点

名称：发行定息基准时点

英文名称：BenchmarkFixTime

编号：A0211

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券披露的发行时确定所用基准利率数值的基准时点（仅针对每日多次发布的基准利率种类）

采集口径：根据发行文件或发行结果文件采集，当基准利率每日只发布一次、不区分布布时点时，不做采集。

数据类型：时间型

度量单位：无

### 7.2.12 首次利率重置日

名称：首次利率重置日

英文名称：FirstRecouponDate

编号：A0212

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券约定的首次进行利率重置的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：13 淮安新城 SCP001B 在发行文件中约定“第一个利率调整日为 2018 年 7 月 11 日”，则首次利率重置日采集为“2018-07-11”。

### 7.2.13 利率重置日类型

名称：利率重置日类型

英文名称：RecouponDateType

编号：A0213

数据元集：浮动利率债券要素

定义：根据对利率重置日约定方式的不同，为方便区分而做的分类

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：付息期的起息日期、指定日期间隔、指定日期

度量单位：无

示例：18 淮安新城 SCP001B 在发行文件中约定“自第一个利率调整日起每三个月为一个计息周期，每个计息周期对应一个利率调整日；自第一个利率调整日起每满三个月的对应日为利率调整日，第一个利率调整日为 2018 年 7 月 11 日，第二个利率调整日为 2018 年 10 月 11 日，第三个利率调整日为 2019 年 1 月 11 日；利率调整日如为国家法定假日，则调整到前一个工作日”，该债券的计息周期和付息周期重合，则利率重置日类型采集为“付息期的起息日期”。

### 7.2.14 利率重置日期间隔

名称：利率重置日期间隔

英文名称：RecouponInterval

编号：A0214

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券各利率重置日期之间的日期间隔长度

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，仅在发行文件中利率重置日类型为指定日期间隔时，对利率重置日期间隔进行采集。

数据类型：数字型

度量单位：与利率重置日期间隔单位配合使用

### 7.2.15 利率重置日期间隔单位

名称：利率重置日期间隔单位

英文名称：RecouponIntervalUnit

编号：A0215

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券各利率重置日期之间的日期间隔长度单位

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，仅在发行文件中利率重置日类型为指定日期间隔时，对利率重置日期间隔单位进行采集。与利率重置日期间隔配合使用。

数据类型：字符型

可枚举值域：日、月、年

度量单位：无

#### 7.2.16 利率重置日

名称：利率重置日

英文名称：RecouponDate

编号：A0216

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券约定的进行利率重置的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，仅在发行文件中利率重置日类型为指定日期时，对利率重置日进行采集。若存在多个利率重置日，均应采集和提供，并用“|”隔开。

数据类型：日期型

度量单位：无

#### 7.2.17 利率重置基准日偏移

名称：利率重置基准日偏移

英文名称：RecouponBenchmarkDateOffset

编号：A0217

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券基准日相对于利率重置日（不含首次定息）之间的间隔天数

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，与工作日日历类型配合使用。

数据类型：数字型

度量单位：无

示例：15 雅安 MTN001B 在发行文件中约定“基准利率为发行首日和其他各计息年度起息日前 20 个工作日，中国债券信息网公布的 7 年期中债银行间固定利率政策性金融债（国开行）到期收益率算数平均值（四舍五入计算到 0.01%）”，因利率重置日为各计息年度起息日，基准日不包含该起息日，则利率重置基准日偏移采集为“-1”。

#### 7.2.18 工作日日历类型

名称：工作日日历类型

英文名称：CalendarType

编号：A0218

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券约定的基准日相对于利率重置日（不含首次定息）之间的间隔天数所使用的工作日惯例

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：自然日、中国银行间市场（现券交易）工作日、中国银行间市场（信用拆借）工作日、

中国交易所市场工作日、伦敦银行工作日、中国银行间市场（现券交易）工作日和伦敦银行工作日、中国交易所市场工作日和伦敦银行工作日、中国银行间市场（现券交易）工作日和中国交易所市场工作日  
度量单位：无

示例：15 雅安 MTN001B 在发行文件中约定“基准利率为发行首日和其他各计息年度起息日前 20 个工作日，中国债券信息网公布的 7 年期中债银行间固定利率政策性金融债（国开行）到期收益率算术平均值（四舍五入计算到 0.01%）”，该债券在银行间市场交易流通，则工作日日历类型采集为“中国银行间市场（现券交易）工作日”。

## 7.2.19 利率重置基准时点

名称：利率重置基准时点

英文名称：RecouponBenchmarkTime

编号：A0219

数据元集：浮动利率债券要素

定义：浮动利率债券披露的利率重置时确定所用基准利率数值的基准时点（仅针对每日多次发布的基准利率种类）

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，当基准利率每日只发布一次、不区分布时点时，不做采集。

数据类型：时间型

度量单位：无

## 7.3 永续债券要素

### 7.3.1 首次重定价日

名称：首次重定价日

英文名称：FirstResetDate

编号：A0301

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券存续期内首次重定利率的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，若未直接约定日期，则按照约定的利率重置周期推算首次重定价日。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“首个票面利率重置日：2020 年 9 月 25 日”，则首次重定价日采集为“2020-09-25”。

### 7.3.2 重定价周期

名称：重定价周期

英文名称：ResetCycle

编号：A0302

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券在首次重定价日期后，各重定价日之间间隔长度

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集。

数据类型：数字型

度量单位：与重定价周期单位配合使用

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“自第 4 个计息年度起，每 3 年重置一次票面利率”，则重定价周期采集为“3”（重定价周期单位为“年”）。

### 7.3.3 重定价周期单位

名称：重定价周期单位

英文名称：ResetCycleUnit

编号：A0303

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券在首次重定价日期后，各重定价日之间间隔长度单位

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，与重定价周期配合使用。

数据类型：字符型

可枚举值域：日、月、年

度量单位：无

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“自第 4 个计息年度起，每 3 年重置一次票面利率”，则重定价周期单位采集为“年”（重定价周期为“3”）。

### 7.3.4 基准利率名称

名称：基准利率名称

英文名称：BenchmarkInterestRate

编号：A0304

数据元集：永续债券要素

定义：同 7.2.4 的定义

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，如永续债券重定价与基准利率无关，则不必采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：同 7.2.4 的可枚举值域

度量单位：无

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“当期基准利率为票面利率重置日前 5 个工作日中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）或中央国债登记结算有限责任公司认可的其他网站公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 3 年的国债收益率算术平均值（四舍五入计算到 0.01%）”，则基准利率名称采集为“中债国债-到期-3Y-5D”。

### 7.3.5 重定价基准日偏移

名称：重定价基准日偏移

英文名称：ResetBenchmarkDateOffset

编号：A0305

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券基准日相对于重定价日之间的间隔天数

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，与工作日日历类型配合使用。

数据类型：数字型

度量单位：无

示例：17 中交二航 MTN001，其基准利率取重定价前一工作日的五日中债国债收益率曲线移动平均值，则重定价基

准日偏移采集为“-1”。

### 7.3.6 工作日日历类型

名称：工作日日历类型

英文名称：CalendarType

编号：A0306

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券在重定价时，基准日相对于重定价日偏移所使用的工作日惯例

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：同 7.2.18 的可枚举值域

度量单位：无

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“工作日：每周一至周五，不含中国法定节假日或休息日”，该债券在银行间市场交易流通，则工作日日历类型采集为“中国银行间市场（现券交易）工作日”。

### 7.3.7 重定价基准时点

名称：重定价基准时点

英文名称：ResetBenchmarkTime

编号：A0307

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券披露的重定价时确定所用基准利率数值的基准时点

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，当基准利率每日只发布一次、不区分发布时点时，不做采集。只有当基准利率种类每日多次发布时，采集发布的时点。

数据类型：时间型

度量单位：无

### 7.3.8 利率下限/上限条款标志

名称：利率下限/上限条款标志

英文名称：Floor/CapRateIndicator

编号：A0308

数据元集：永续债券要素

定义：同 7.2.5 的定义

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：同 7.2.5 的可枚举值域

度量单位：无

示例：17 厦国贸集 MTN001 在发行文件中约定“加点后的票面利率以 18%为限”，且未约定利率下限，则利率下限/上限条款标志采集为“有上限条款但无下限条款”。

### 7.3.9 利率下限

名称：利率下限

英文名称：FloorRate

编号：A0309

数据元集：永续债券要素

定义：同 7.2.6 的定义

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

### 7.3.10 利率上限

名称：利率上限

英文名称：CapRate

编号：A0310

数据元集：永续债券要素

定义：同 7.2.7 的定义

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：17 厦国贸集 MTN001 在发行文件中约定“加点后的票面利率以 18%为限”，则利率上限采集为“18”。

### 7.3.11 基准利率下限

名称：基准利率下限

英文名称：FloorBenchmarkRate

编号：A0311

数据元集：永续债券要素

定义：同 7.2.8 的定义

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

### 7.3.12 基准利率上限

名称：基准利率上限

英文名称：CapBenchmarkRate

编号：A0312

数据元集：永续债券要素

定义：同 7.2.9 的定义

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

### 7.3.13 首次赎回/续期日

名称：首次赎回/续期日

英文名称：FirstCallable/ExtendableDate

编号：A0313

数据元集：永续债券要素

定义：发行人首次可选择全部赎回（对未约定到期日的永续债券而言）或续期（对约定到期日的可续期债券而言）的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的期限条款或选择权条款采集，在约定赎回/续期日期时，通常枚举有限次不规则的赎回/续期日期，再给出规则的无限部分，如 15 山煤 MTN001 约定“于本期中期票据第 3 个、第 6 个和其后每个付息日，发行人有权按照面值加应付利息赎回本期中期票据”，首次赎回/续期日采集的是其中枚举部分的首次赎回/续期日。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：1. 17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“起息日为 2017 年 9 月 25 日，付息日在债券存续期内的每年 9 月 25 日。于本期中期票据第 3 个和其后每第 3 个付息日，发行人有权按照面值加应付利息（包括所有递延支付的利息）赎回本期中期票据”，则首次赎回/续期日采集为“2020-09-25”。

2. 15 中电投可续期债在发行文件中约定“起息日为 2015 年 6 月 8 日，每 3 年为一个重定价周期，在本次债券每个重定价周期末，发行人有权选择将本次债券期限延长 1 个重定价周期，或全额兑付本次债券”，则首次赎回/续期日采集为“2018-06-08”。

### 7.3.14 第二次赎回/续期日

名称：第二次赎回/续期日

英文名称：SecondCallable/ExtendableDate

编号：A0314

数据元集：永续债券要素

定义：发行人第二次可选择全部赎回（对未约定到期日的永续债券而言）或续期（对约定到期日的可续期债券而言）的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的期限条款或选择权条款采集，在约定赎回/续期日期时，通常枚举有限次不规则的赎回/续期日期，再给出规则的无限部分，如 15 山煤 MTN001 约定“于本期中期票据第 3 个、第 6 个和其后每个付息日，发行人有权按照面值加应付利息赎回本期中期票据”，第二次赎回/续期日采集的是其中枚举部分的第二次赎回/续期日。未披露时，则采集为空。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：15 山煤 MTN001 在发行文件中约定“按年付息，在债券存续期内，每年的 9 月 9 日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间不另计息。起息日为 2015 年 9 月 9 日。于本期中期票据第 3 个、第 6 个和其后每个付息日，发行人有权按照面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回本期中期票据”，则第二次赎回/续期日采集为“2021-09-09”。

### 7.3.15 赎回/续期周期

名称：赎回/续期周期

英文名称：Callable/ExtendableCycle

编号：A0315

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的首次和第二次赎回/续期日之后，发行人可选择全部赎回（对未约定到期日的永续债券而言）或续期（对约定到期日的可续期债券而言）的日期之间间隔长度

采集口径：根据发行文件中约定的期限条款或选择权条款采集，在约定赎回/续期日期时，通常枚

举有限次不规则的赎回/续期日期，再给出规则的无限部分，如 15 山煤 MTN001 约定“于本期中期票据第 3 个、第 6 个和其后每个付息日，发行人有权按照面值加应付利息赎回本期中期票据”，赎回/续期周期采集的是赎回/续期日之间的间隔长度。

数据类型：数字型

度量单位：与赎回/续期周期单位配合使用

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“于本期中期票据第 3 个和其后每第 3 个付息日，发行人有权按照面值加应付利息（包括所有递延支付的利息）赎回本期中期票据”，则赎回/续期周期采集为“3”（赎回/续期周期单位为“年”）。

### 7.3.16 赎回/续期周期单位

名称：赎回/续期周期单位

英文名称：Callable/ExtendableCycleUnit

编号：A0316

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的首次和第二次赎回/续期日之后，发行人可选择全部赎回（对未约定到期日的永续债券而言）或续期（对约定到期日的可续期债券而言）的日期之间间隔长度单位

采集口径：根据发行文件中约定的期限条款或选择权条款采集，在约定赎回/续期日期时，通常枚举有限次不规则的赎回/续期日期，再给出规则的无限部分，如 15 山煤 MTN001 约定“于本期中期票据第 3 个、第 6 个和其后每个付息日，发行人有权按照面值加应付利息赎回本期中期票据”，赎回/续期周期单位采集的是赎回/续期日之间的间隔长度单位。

数据类型：字符型

可枚举值域：日、月、年

度量单位：无

示例：17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“于本期中期票据第 3 个和其后每第 3 个付息日，发行人有权按照面值加应付利息（包括所有递延支付的利息）赎回本期中期票据”以及“付息日：在债券存续期内，每年的 9 月 25 日。（如遇法定节假日，则顺延至下一工作日，顺延期间不另计息）”，则赎回/续期周期单位采集为“年”（赎回/续期周期为“3”）。

### 7.3.17 无限次利率跳升标志

名称：无限次利率跳升标志

英文名称：InfiniteCouponStepIndicator

编号：A0317

数据元集：永续债券要素

定义：标识永续债券是否约定利率跳升的次数

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，无限次利率跳升一般有两种披露形式，一种表述为，后续的票面利率=基准+初始利差+跳升次数×跳升基点；另一种表述形式为，每个重定价日均进行跳升，跳升后的利差=跳升前的利差+跳升基点。

数据类型：字符型

可枚举值域：是、否

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“则自第 6 个计息年度起，票面利率每 3 年重置一次，重置后的票面利率为当期基准利率加初始利差加上调基点，上调基点为前一期上调基点加 300BP”，则无限次利率跳升标志采集为“是”。

### 7.3.18 利率首次跳升日

名称：利率首次跳升日

英文名称：FirstCouponStepDate

编号：A0318

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的首次利率跳升的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“则自第 6 个计息年度起，票面利率每 3 年重置一次，重置后的票面利率为当期基准利率加初始利差加上调基点，上调基点为前一期上调基点加 300BP。起息日：2015 年 12 月 16 日”，则利率首次跳升日采集为“2020-12-16”。

### 7.3.19 利率跳升周期

名称：利率跳升周期

英文名称：CouponStepCycle

编号：A0319

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的利率首次跳升日期之后，各利率跳升日之间间隔长度

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，与利率跳升周期单位配合使用。

数据类型：数字型

度量单位：与利率跳升周期单位配合使用

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“则自第 6 个计息年度起，票面利率每 3 年重置一次，重置后的票面利率为当期基准利率加初始利差加上调基点，上调基点为前一期上调基点加 300BP”，则利率跳升周期采集为“3”（利率跳升周期单位为“年”）。

### 7.3.20 利率跳升周期单位

名称：利率跳升周期单位

英文名称：CouponStepCycleUnit

编号：A0320

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的利率首次跳升日期之后，各利率跳升日之间间隔长度单位

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款采集，与利率跳升周期配合使用。

数据类型：字符型

可枚举值域：日、月、年

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“则自第 6 个计息年度起，票面利率每 3 年重置一次，重置后的票面利率为当期基准利率加初始利差加上调基点，上调基点为前一期上调基点加 300BP”，则利率跳升周期单位采集为“年”（利率跳升周期为“3”）。

### 7.3.21 利率/利差变动

名称：利率/利差变动

英文名称: FixedCouponAdjustment

编号: A0321

数据元集: 永续债券要素

定义: 永续债券约定的各次利率跳升的利率/利差跳升基点值

采集口径: 根据发行文件中约定的利率条款采集。

数据类型: 数字型

度量单位: BP

注: BP: 基点 (Basis Point)。

示例: 15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“则自第 6 个计息年度起, 票面利率每 3 年重置一次, 重置后的票面利率为当期基准利率加初始利差加上调基点, 上调基点为前一期上调基点加 300BP”, 则利率/利差变动采集为“300”。

### 7.3.22 利息递延条款标志

名称: 利息递延条款标志

英文名称: DeferredInterestIndicator

编号: A0322

数据元集: 永续债券要素

定义: 标识永续债券是否约定利息递延条款, 允许发行人在一定条件下延迟支付利息

采集口径: 根据发行文件中约定的利息递延条款采集。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 无利息递延条款、有利息递延条款

度量单位: 无

示例: 17 中交二航 MTN001 在发行文件中约定“除非发生强制付息事件, 发行人在每个利息支付日前, 可以自行选择将全部或部分当期利息和按照本条款已经递延的利息及其孳息推迟至下一利息支付日支付”, 则利息递延条款标志采集为“有利息递延条款”。

### 7.3.23 递延利息计息标志

名称: 递延利息计息标志

英文名称: DeferredInterestAccrualIndicator

编号: A0323

数据元集: 永续债券要素

定义: 标识永续债券是否约定递延的利息按照某个利率计息 (支付利息)

采集口径: 根据发行文件中约定的利息递延条款采集。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 递延利息不计息、递延利息计息

度量单位: 无

示例: 15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“每笔递延利息在递延期间应按照当期票面利率累计计息”, 递延利息计息标志采集为“递延利息计息”。

### 7.3.24 债券利差上限

名称: 债券利差上限

英文名称: SpreadCap

编号：A0324

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的最高利差，当实际利差高于利差上限时，以利差上限作为执行利差

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

### 7.3.25 债券利差下限

名称：债券利差下限

英文名称：SpreadFloor

编号：A0325

数据元集：永续债券要素

定义：永续债券约定的最低利差，当实际利差低于利差下限时，以利差下限作为执行利差

采集口径：根据发行文件中约定的利率条款（重定价）采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

## 7.4 资产支持证券要素

### 7.4.1 结构档次代码

名称：结构档次代码

英文名称：OrderofStructure

编号：A0401

数据元集：资产支持证券要素

定义：标识资产支持证券在资产包现金流分配机制中的现金偿还次序，同时也指资产支持证券在分级、分档结构中所属的结构档次

采集口径：根据资产支持证券发行文件中约定的结构档次采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：优先档、中间档、次优先档、次级档、优先 A 档、优先 B 档、优先 C 档等

度量单位：无

示例：17 融汇 1A1 为“A-1 级资产支持证券”，则结构档次代码采集为“优先 A 档”。

### 7.4.2 本金偿付次序

名称：本金偿付次序

英文名称：TrancheOrder

编号：A0402

数据元集：资产支持证券要素

定义：资产支持证券在资产包现金流分配机制中违约前的本金偿付顺序

采集口径：根据发行文件中约定的现金流分配机制采集，按照分配次序编号。若存在多个资产支持证券的本金偿付次序相同时，则编为相同次序号。

数据类型：数字型

度量单位：无

示例：17 融汇 1A1 在发行文件中约定“按照《信托合同》附件八约定的 A-1 级资产支持证券本金摊还计划支付 A-1

级资产支持证券的计划还本金额，直至 A-1 级资产支持证券的未偿本金余额为零；然后支付 A-2 级资产支持证券的本金，直至 A-2 级资产支持证券的未偿本金余额为零”，则本金偿付次序采集为“1”。

#### 7.4.3 预期到期日

名称：预期到期日

英文名称：ExpectedMaturityDate

编号：A0403

数据元集：资产支持证券要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即按照计划向投资者偿付本金完毕的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中披露的预期到期日采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：17 融汇 1A1 在发行文件中约定预期到期日为“2017 年 10 月 26 日”，则预期到期日采集为“2017-10-26”。

#### 7.4.4 法定到期日

名称：法定到期日

英文名称：LegalMaturityDate

编号：A0404

数据元集：资产支持证券要素

定义：预期到期日起根据届时有有效的法律所规定的诉讼时效届满之日，通常晚于预期到期日两年或三年，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中披露的法定到期日采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 邮元 1A 在发行文件中约定法定到期日为 2039 年 12 月 31 日，则法定到期日采集为“2039-12-31”。

#### 7.4.5 本金初始金额

名称：本金初始金额

英文名称：OriginalAmount

编号：A0405

数据元集：资产支持证券要素

定义：资产支持证券的发行规模

采集口径：根据发行结果文件、上市文件，采集资产支持证券的实际发行规模。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 融汇 1A1 在发行文件中约定的发行金额为“1 000 000 000 元”，则本金初始金额采集为“1000000000”。

#### 7.4.6 还本类型

名称：还本类型

英文名称：PrincipalPaymentType

编号：A0406

数据元集：资产支持证券要素

定义：标识资产支持证券约定的还本方式

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：固定摊还、过手摊还、到期一次还本

度量单位：无

示例：17 融汇 1A1 在发行文件中约定“A-1 级资产支持证券为固定摊还型的证券”，则还本类型采集为“固定摊还”。

#### 7.4.7 超额收益分配比例

名称：超额收益分配比例

英文名称：ExcessReturnProportion

编号：A0407

数据元集：资产支持证券要素

定义：根据现金流分配机制，基础资产回收款完成各分级、各分档期间收益和本金分配后的超额收益分配部分，在各分级、各分档的分配比例

采集口径：根据发行文件中约定的现金流分配机制采集。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：17 融汇 1A1 在发行文件中约定“将所有余额作为次级资产支持证券的收益，转入信托分配（证券）账户”，则各优先档的超额收益分配比例采集为“0”，次级资产支持证券的超额收益分配比例采集为“100”。

#### 7.4.8 本期期初本金金额

名称：本期期初本金金额

英文名称：OpeningBalance

编号：A0408

数据元集：资产支持证券要素

定义：资产支持证券在本次收益分配前的存量规模（剩余本金余额）

采集口径：根据资产支持证券的受托机构报告、收益分配公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 融汇 1A2 在《融汇 2017 年第一期租赁资产证券化信托受托机构报告第 6 期》中约定“本金期初余额为 1 784 160 000 元”，对于第 6 期受托机构报告，则本期期初本金金额采集为“1784160000”。

#### 7.4.9 本期兑付本金金额

名称：本期兑付本金金额

英文名称：PrincipalDistributed

编号：A0409

数据元集：资产支持证券要素

定义：资产支持证券在本次收益分配的兑付本金金额

采集口径：根据资产支持证券的受托机构报告、收益分配公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 融汇 1A2 在《融汇 2017 年第一期租赁资产证券化信托受托机构报告第 6 期》中约定“本期兑付本金总额为 198 180 000 元”，对于第 6 期受托机构报告，则本期兑付本金金额采集为“198180000”。

#### 7.4.10 本期期末本金金额

名称：本期期末本金金额

英文名称：ClosingBalance

编号：A0410

数据元集：资产支持证券要素

定义：资产支持证券在本次收益分配后的存量规模（剩余本金余额）

采集口径：根据资产支持证券的受托机构报告、收益分配公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 融汇 1A2 在《融汇 2017 年第一期租赁资产证券化信托受托机构报告第 6 期》中约定“本金期末余额为 1 585 980 000 元”，对于第 6 期受托机构报告，则本期期末本金金额采集为“1585980000”。

#### 7.4.11 计划现金流日

名称：计划现金流日

英文名称：PlannedCashFlowDate

编号：A0411

数据元集：资产支持证券要素

定义：预计还本现金流日期（过手摊还）或约定的计划还本日期（固定摊还），格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件、收益分配公告、受托机构报告采集。计划现金流日为时间序列时，应进行多行采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：18 中盈 2A1 在发行文件中约定本金计划摊还表，其中给出各个支付日的目标余额，第一个计划现金流日采集为“2018-08-26”，第二个计划现金流日采集为“2018-09-26”，第三个计划现金流日采集为“2018-10-26”，以此类推。

#### 7.4.12 计划本金偿还金额

名称：计划本金偿还金额

英文名称：PlannedPrincipalPayment

编号：A0412

数据元集：资产支持证券要素

定义：预计还本金额（过手摊还）或约定的计划还本金额（固定摊还）

采集口径：根据发行文件、收益分配公告、受托机构报告采集。多个支付日表示有多个计划本金偿还金额，应进行多行采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：18 中盈 2A1 在发行文件中约定本金计划摊还表，其中给出各个支付日的目标余额，计划本金偿还金额等于上一期目标余额与本期目标余额的差，第一个支付日对应的计划本金偿还金额采集为“70000000”，第二个支付日对应的计划本金偿还金额采集为“70000000”，以此类推。

## 7.5 资产包要素

### 7.5.1 基础资产类型

名称：基础资产类型

英文名称：UnderlyingAssetType

编号：P0101

数据元集：资产包要素

定义：标识资产包所包含基础资产的种类

采集口径：根据发行文件采集，采集时按照二级明细分类填写。基础资产类型有两个层级：第一层级分为银行信贷资产、企业债权资产/企业收益权资产、企业不动产。第二层级在第一层级划分下做明细分类。

数据类型：字符型

可枚举值域：银行信贷资产、企业贷款、汽车贷款、个人住房抵押贷款、消费性贷款、租赁资产、铁路专项贷款、不良贷款、信用卡贷款、工程机械贷款、企业债权资产/企业收益权资产、租赁租金、基础设施收费、应收账款、信托受益权、小额贷款、住房公积金贷款、保理融资债权、融资融券债权、门票收入、BT 项目回购款、股票质押回购债权、航空票款、委托贷款、棚改/保障房、保单贷款、企业不动产、不动产投资信托

注：BT：建设（Build）、移交（Transfer）。

度量单位：无

示例：18 建元 10A1 在发行文件中约定“建元 2018 年第十期个人住房抵押贷款资产支持证券”，则基础资产类型采集为“个人住房抵押贷款”。

### 7.5.2 分级标志

名称：分级标志

英文名称：SubPrimeIndicator

编号：P0102

数据元集：资产包要素

定义：标识资产证券化过程中是否在现金流分配机制设计中进行分级

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：未分级、分级

度量单位：无

示例：18 建元 10A1 在发行文件中约定“本期资产支持证券分为优先 A-1 档资产支持证券、优先 A-2 档资产支持证券及次级档资产支持证券三种，相应代表本期信贷化托项下的优先档信托受益权和次级”，该示例有优先级和次级档之分，则分级标志采集为“分级”。

### 7.5.3 信用增级方式

名称：信用增级方式

英文名称：CreditEnhancement

编号：P0103

数据元集：资产包要素

定义：资产约定的信用保护方式

采集口径：根据发行文件采集，采集时按照二级明细分类填写。信用增级方式有两个层级：第一层级分为内部信用增级和外部信用增级，第二层级在第一层级划分下做明细分类。若有多种信用增级方式，均应采集和提供，并用“|”隔开。

数据类型：字符型

可枚举值域：内部增级、优先/次级分层结构、超额抵押、储备金账户、超额利差、信用触发机制、其他内部信用增级、外部增级、信用证、第三方担保、保险合同、差额补足承诺、回购承诺、基础资产抵质押、其他外部信用增级

度量单位：无

示例：18 建元 10A1 在发行文件中约定信用增级措施包括“分层结构设计、储备账户设置、偿付结构安排、触发机制安排”，则信用增级方式采集为“优先/次级分层结构|储备金账户|信用触发机制”。

#### 7.5.4 资产包结构类型

名称：资产包结构类型

英文名称：AssetPoolStructureType

编号：P0104

数据元集：资产包要素

定义：标识资产包的结构类型

采集口径：根据发行文件采集。静态型结构和循环型结构，根据存续期间是否循环购买进行区分。

数据类型：字符型

可枚举值域：静态型结构、循环型结构

度量单位：无

示例：17 和享 1A1 在发行文件中约定“在持续购买期内，受托人（作为持续购买的买方）有权以资产池的本金回收款向招商银行（作为持续购买的卖方）持续购买新的资产”，则资产包结构类型采集为“循环型结构”。

#### 7.5.5 现金流账户类型

名称：现金流账户类型

英文名称：CashFlowAccountType

编号：P0105

数据元集：资产包要素

定义：标识资产包现金流分配机制中是否区分本金账和收入账

采集口径：根据发行文件采集。“分别归集和分配基础资产的本金回收款和利息回收款”视为区分本金账和收入账。

数据类型：字符型

可枚举值域：不区分本金账和收入账、区分本金账和收入账并分别记录

度量单位：无

示例：17 融汇 1A1 在发行文件中约定“收入分账户”和“本金分账户”的资金分配，则现金流账户类型采集为“区分本金账和收入账并分别记录”。

#### 7.5.6 次级收益率

名称：次级收益率

英文名称：SubordinatedYield

编号：P0106

数据元集：资产包要素

定义：现金流分配机制条款中约定的次级档资产支持证券期间收益率，当收入账支付完优先档利息并填补历史本金账转入收入账金额后仍有剩余时，按照不超过次级档期间收益率计算并支付次级收益

采集口径：根据发行文件现金流分配机制中约定的“次级档期间收益率”采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：17 和享 1A1 在发行文件中约定“在优先档资产支持证券的本金完全清偿完毕前，按照不超过 2%/年的收益率计算当个计息期间次级档资产支持证券的期间收益，将该等收益记入信托分配（证券）账户”，则次级收益率采集为“2”。

### 7.5.7 摊还期起始日

名称：摊还期起始日

英文名称：ManagedPoolStartDate

编号：P0107

数据元集：资产包要素

定义：循环型结构资产支持证券的摊还期起始日期，格式为 YYYY-MM-DD

注：从摊还起始日（当天）开始，不再循环购买基础资产。

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：19 和智 3 在发行文件中约定“持续购买终止日为信托生效日起满 1 年的对应日、加速清偿事件发生之日、违约事件发生之日、贷款服务机构解任事件发生之日、提前摊还事件发生之日中较早的日期”，因 19 和智 3 的信托生效日为 2019-07-23，上述表述中的“信托生效日起满 1 年的对应日”为正常情况时的日期，应按照该日期后推，则摊还期起始日采集为“2020-07-23”。

## 7.6 资产包信息披露要素

### 7.6.1 本期本金账转入收入账金额

名称：本期本金账转入收入账金额

英文名称：TransferAmount

编号：P0201

数据元集：资产包信息披露要素

定义：现金流分配机制区分本金账、收入账的资产包，在存续期披露的各期本金账转入收入账的实际金额

采集口径：根据收益分配公告、受托机构报告中披露的账户现金流流入和分配情况采集。当资金由本金账流入收入账时，用正数表示；当资金由收入账流入本金账时，用负数表示。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：16 沪公积金 2A 在第 25 期受托机构报告中约定“本次报告期本金分账户回补为 679 462.37 元”，则本期本金账转入收入账金额采集为“679462.37”。

### 7.6.2 触发加速清偿标志

名称：触发加速清偿标志

英文名称：EarlyAmortizationIndicator

编号：P0202

数据元集：资产包信息披露要素

定义：标识资产包是否已触发加速清偿条款

采集口径：根据资产存续期信息披露采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：未触发、已触发

度量单位：无

示例：PR 镇小 1A 在第 3 期收益分配公告中约定“本专项计划现进入加速清偿期”，则触发加速清偿标志采集为“已触发”。

### 7.6.3 现金流归集日

名称：现金流归集日

英文名称：CashFlowDate

编号：P0203

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包现金流归集表中披露的各现金流归集日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据资产支持证券发行文件、受托机构报告、收益分配公告中披露的现金流归集情况采集。现金流归集日可能有多种表述形式，例如日期、计算日、核算日等。当现金流归集表中填写的日期是时间段时，填写时间段的截止日期。当现金流归集表中填写的日期仅精确到月份时，填写所在月份的最后一个自然日。现金流归集日为日期序列时，应进行多行采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：17 和享 1A1 在第 17 期受托机构月度报告的资产池现金流归集表中约定“计算日（收款期间期末日期），对应的日期有 2019/1/31、2019/2/28、2019/3/31”，则第一个现金流归集日采集为“2019-01-31”，第二个现金流归集日采集为“2019-02-28”，以此类推。

### 7.6.4 期初本金总金额

名称：期初本金总金额

英文名称：PreviousBalance

编号：P0204

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包现金流归集表中披露的各现金流归集日期的归集前基础资产本金余额

采集口径：根据资产支持证券发行文件、受托机构报告、收益分配公告中披露的现金流归集情况采集。若未直接披露，则根据本金归集情况累加推算。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 和享 1A1 在第 17 期受托机构月度报告的资产池现金流归集表中约定“计算日为 2019/1/31 的期初本金总余额为 3 856 081 366 元”，则期初本金总金额采集为“3856081366”。

### 7.6.5 本期应收本金

名称：本期应收本金

英文名称：PrincipalReceivable

编号：P0205

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包现金流归集表中披露的各现金流归集日期的当期应收本金金额

采集口径：根据资产支持证券发行文件、受托机构报告、收益分配公告中披露的现金流归集情况采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 和享 1A1 在第 17 期受托机构月度报告的资产池现金流归集表中约定“计算日为 2019/1/31 的本期应收本金为 850 678 402.77 元”，则本期应收本金采集为“850678402.77”。

#### 7.6.6 本期应收利息

名称：本期应收利息

英文名称：InterestReceivable

编号：P0206

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包现金流归集表中披露的各现金流归集日期的当期应收利息金额

采集口径：根据资产支持证券发行文件、受托机构报告、收益分配公告中披露的现金流归集情况采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 和享 1A1 在第 17 期受托机构月度报告的资产池现金流归集表中约定“计算日为 2019/1/31 的本期应收手续费为 81 472 864.78 元”，则本期应收利息采集为“81472864.78”。

#### 7.6.7 期末本金总金额

名称：期末本金总金额

英文名称：EndofPeriodTotalOutstandingAmount

编号：P0207

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包现金流归集表中披露的各现金流归集日期的归集后基础资产本金余额

采集口径：根据资产支持证券发行文件、受托机构报告、收益分配公告中披露的现金流归集情况采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：17 和享 1A1 在第 17 期受托机构月度报告的资产池现金流归集表中约定“计算日为 2019/1/31 的期末本金总金额为 3 005 402 963.23 元”，则期末本金总金额采集为“3005402963.23”。

#### 7.6.8 早偿率假设

名称：早偿率假设

英文名称：PrepaySpeedAssumption

编号：P0208

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包披露的测算基础资产现金流所使用的早偿率假设（现金流归集情况的测算依据）

采集口径：根据资产支持证券发行文件、受托机构报告、收益分配公告中披露的现金流归集情况采集。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：18 建元 10A1 在发行文件中约定“根据发起机构所提供的还款计划，并且假设不存在拖欠、违约回收情况下，对每个收款期间现金流以不同的早偿率假设进行归集，早偿率=0%”，则早偿率假设采集为“0”。

#### 7.6.9 逾期状态

名称：逾期状态

英文名称：OverdueStatus

编号：P0209

数据元集：资产包信息披露要素

定义：标识根据逾期天数划分的逾期状态

采集口径：根据受托机构报告的贷款状态特征相关内容进行采集。若有多个逾期状态时，应全部采集。

数据类型：字符型

度量单位：无

可枚举值域：正常、逾期 1 至 30 天、逾期 31 至 60 天、逾期 61 至 90 天、逾期 91 至 180 天，逾期 180 天以上、违约贷款、其他

示例：18 兴银 2C 在受托机构报告中约定“资产池贷款状态特征，正常、逾期 1 至 30 天、逾期 31 至 60 天、逾期 61 至 90 天、违约贷款”，则逾期状态分别采集为“正常”“逾期 1 至 30 天”“逾期 31 至 60 天”“逾期 61 至 90 天”“违约贷款”。

#### 7.6.10 贷款笔数

名称：贷款笔数

英文名称：NumberofLoan

编号：P0210

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包的基础资产在每种逾期状态下的贷款笔数

采集口径：根据受托机构报告的贷款状态特征相关内容进行采集。

数据类型：数字型

度量单位：无

示例：18 兴银 2C 在第二期信贷资产证券化信托受托机构报告中约定“资产池贷款处于正常状态的贷款笔数为 32”，当逾期状态为“正常”时，则贷款笔数采集为“32”。

#### 7.6.11 占期末资产池贷款笔数百分比

名称：占期末资产池贷款笔数百分比

英文名称：EndofPeriodPercentofNumberofLoan

编号：P0211

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包在每种逾期状态下的贷款笔数与期末总贷款笔数的比例

采集口径：根据受托机构报告的贷款状态特征相关内容进行采集。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：18 兴银 2C 在第二期信贷资产证券化信托受托机构报告中约定“资产池贷款处于正常状态的占期末资产池贷款笔数百分比为 100%”，当逾期状态为“正常”时，则占期末资产池贷款笔数百分比采集为“100”。

#### 7.6.12 占期末资产池贷款余额百分比

名称：占期末资产池贷款余额百分比

英文名称：EndofPeriodPercentofAmountofLoan

编号：P0212

数据元集：资产包信息披露要素

定义：资产包在每种逾期状态下的贷款金额与期末贷款余额的比例

采集口径：根据受托机构报告的贷款状态特征相关内容进行采集。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：18 兴银 2C 在第二期信贷资产证券化信托受托机构报告中约定“资产池贷款处于正常状态的占期末资产池贷款余额百分比为 100%”，当逾期状态为“正常”时，则占期末资产池贷款余额百分比采集为“100”。

### 7.7 债券流通要素

#### 7.7.1 流通场所

名称：流通场所

英文名称：Exchange

编号：A0501

数据元集：债券流通要素

定义：标识债券的可流通场所

采集口径：根据发行文件中披露的债券拟上市流通场所采集，并依据待上市公告、流通要素公告进行更新。

数据类型：字符型

可枚举值域：银行间债券市场、商业银行柜台市场、深圳证券交易所、上海证券交易所、上海自贸区债券市场、北京金融资产交易所、其他

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在发行文件中约定“本期中期票据在债权债务登记日的次一工作日，即可以在全国银行间债券市场机构投资者之间流通转让”，则流通场所采集为“银行间债券市场”。

#### 7.7.2 债券代码

名称：债券代码

英文名称：BondCode

编号：A0502

数据元集：债券流通要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券流通托管机构公布的代码

采集口径：根据流通要素公告采集。

## JR/T 0230—2021

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在上市公告中约定“中期票据代码 101554093”，则债券代码采集为“101554093”。

### 7.7.3 债券全称

名称：债券全称

英文名称：BondFullName

编号：A0503

数据元集：债券流通要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券发行时的全称

采集口径：根据募集说明书、流通要素公告采集。

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在上市公告中约定“中期票据全称：广州珠江实业集团有限公司 2015 年度第一期中期票据”，则债券全称采集为“广州珠江实业集团有限公司 2015 年度第一期中期票据”。

### 7.7.4 债券简称

名称：债券简称

英文名称：BondShortName

编号：A0504

数据元集：债券流通要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券的简称

采集口径：根据流通要素公告采集。

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：15 粤珠江 MTN001 在上市公告中约定“中期票据简称 15 粤珠江 MTN001”，则债券简称采集为“15 粤珠江 MTN001”。

### 7.7.5 流通状态

名称：流通状态

英文名称：ListingStatus

编号：A0505

数据元集：债券流通要素

定义：标识债券的流通状态

采集口径：根据发行说明书、流通要素公告、停牌公告、复牌公告、摘牌公告等相关公告采集。若募集说明书注明债券将在相应流通场所上市，则采集为计划流通；若流通要素已发布但未到上市流通日，则采集为待流通；若已到流通要素公告中披露的上市流通日，则采集为已流通；若停牌公告中披露暂停交易，则采集为暂停流通；若复牌公告中披露恢复上市，则采集为恢复流通；若上市时限定流通范围，则采集为限制性流通；若发布摘牌公告，则采集为终止流通。

数据类型：字符型

可枚举值域：计划流通、待流通、已流通、限制性流通、暂停流通、恢复流通、终止流通

度量单位：无

示例：1. 12 松江债根据 2012 年 8 月 14 日发布的《上海松江城镇建设投资开发有限公司公司债券募集说明书》内容，则流通状态采集为“待流通”。

2. 12 松江债根据 2012 年 8 月 28 日发布的《债券交易流通要素公告（12 松江债）》内容，则流通状态采集为“已流通”。

3. 12 松江债根据 2018 年 8 月 3 日发布的《2012 年上海松江城镇建设投资开发有限公司公司债券 2018 年付息兑付暨摘牌公告》内容，则流通状态采集为“终止流通”。

#### 7.7.6 流通状态变动生效日

名称：流通状态变动生效日

英文名称：ListingEffectiveDate

编号：A0506

数据元集：债券流通要素

定义：债券流通状态变更生效的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据流通要素公告、停牌公告、复牌公告、摘牌公告等相关公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：1. 12 松江债根据 2012 年 8 月 14 日发布的《上海松江城镇建设投资开发有限公司公司债券募集说明书》内容，则流通状态为“待流通”，流通状态变动生效日采集为“2012-08-15”。

2. 12 松江债根据 2012 年 8 月 28 日发布的《债券交易流通要素公告（12 松江债）》内容，则流通状态为“已流通”，流通状态变动生效日采集为“2012-08-29”。

3. 12 松江债根据 2018 年 8 月 3 日发布的《2012 年上海松江城镇建设投资开发有限公司公司债券 2018 年付息兑付暨摘牌公告》内容，则流通状态为“终止流通”，流通状态变动生效日采集为“2018-08-15”。

#### 7.7.7 流通状态变动生效时间

名称：流通状态变动生效时间

英文名称：ListingEffectiveTime

编号：A0507

数据元集：债券流通要素

定义：债券流通状态变更生效的时间

采集口径：根据流通要素公告、停牌公告、复牌公告、摘牌公告等相关公告采集，未指定生效时间的为空。

数据类型：时间型

度量单位：无

示例：12 宁宝源的临时停牌公告约定“12 宁宝源(124133)今日上午交易出现异常波动。根据《上海证券交易所交易规则》《上海证券交易所证券异常交易实时监控细则》的有关规定，本所决定，自 2019 年 02 月 27 日 10 时 38 分开始暂停 12 宁宝源(124133)交易，自 2019 年 02 月 27 日 11 时 08 分起恢复交易”，则流通状态为“暂停流通”对应的流通状态变动生效时间采集为“10:38:00”。

#### 7.7.8 上市日

名称：上市日

英文名称：ListingDate

编号：A0508

数据元集：债券流通要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券或其他证券正式发行后在市场上交易的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据流通要素公告、上市公告进行采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：16 渝钢 01 在上市公告中约定“挂牌日为 2016 年 11 月 4 日”，则上市日采集为“2016-11-04”。

### 7.7.9 停牌起始日

名称：停牌起始日

英文名称：SuspendStartDate

编号：A0509

数据元集：债券流通要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券暂停交易的起始日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据流通要素公告、停牌公告、复牌公告、摘牌公告等相关公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：17 首旅 Y1 在债券暂停上市公告中约定“17 首旅 Y1、17 首旅 Y2、17 首旅 Y3 和 17 首旅 Y4 将于 2019 年 5 月 14 日起暂停在上海证券交易所上市”，则停牌起始日采集为“2019-05-14”。

### 7.7.10 复牌日

名称：复牌日

英文名称：ResumptionDate

编号：A0510

数据元集：债券流通要素

定义：暂停交易后，债券开始恢复交易的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据流通要素公告、停牌公告、复牌公告、摘牌公告等相关公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：16 渝钢 01 在《重庆钢铁集团矿业有限公司关于公司债券恢复上市的公告》中约定“自 2019 年 6 月 19 日起在上海证券交易所恢复上市。债券简称由‘渝钢暂停’变更为‘16 渝钢 01’，债券代码为 136740 不变”，则复牌日采集为“2019-06-19”。

### 7.7.11 摘牌日

名称：摘牌日

英文名称：DelistingDate

编号：A0511

数据元集：债券流通要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券在交易所摘牌，停止交易的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据流通要素公告、停牌公告、复牌公告、摘牌公告等相关公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：11 桂东 02 在《广西桂东电力股份有限公司 2011 年公司债券(第二期)本息兑付和摘牌公告》中约定“摘牌日：2019 年 6 月 20 日”，则摘牌日采集为“2019-06-20”。

## 7.8 债券发行注册要素

### 7.8.1 发行起始日

名称：发行起始日

英文名称：IssueStartDate

编号：A0601

数据元集：债券发行注册要素

定义：债券各次发行（首发和续发）的发行起始日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：18 华夏银行 01 在发行文件中约定“八、发行期限：从 2018 年 4 月 20 日至 2018 年 4 月 24 日，共 3 个工作日”，则发行起始日采集为“2018-04-20”。

### 7.8.2 发行结束日

名称：发行结束日

英文名称：IssueEndDate

编号：A0602

数据元集：债券发行注册要素

定义：债券各次发行（首发和续发）的发行结束日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：18 华夏银行 01 在发行文件中约定“八、发行期限：从 2018 年 4 月 20 日至 2018 年 4 月 24 日，共 3 个工作日”，则发行结束日采集为“2018-04-24”。

### 7.8.3 缴款日

名称：缴款日

英文名称：PaymentDate

编号：A0603

数据元集：债券发行注册要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券发行过程中的机构缴款日期，用于预发行，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：18 华夏银行 01 在发行文件中约定“九、缴款日：2018 年 4 月 24 日”，则缴款日采集为“2018-04-24”。

### 7.8.4 计划发行量

名称：计划发行量

英文名称：IssuesSizeforPlan

编号：A0604

数据元集：债券发行注册要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券、证券、大额存单等交易标的正式招标之前计划发行的数量

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：18 华夏银行 01 在发行文件中约定“三、发行规模：本期债券的发行总额为不超过人民币 180 亿元”，则计划发行量采集为“18000000000”。

### 7.8.5 实际发行量

名称：实际发行量

英文名称：IssueSize

编号：A0605

数据元集：债券发行注册要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券正式招标之后实际发行的债券量

采集口径：根据发行结果公告、发行情况公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：18 华夏银行 01 在发行结果公告中约定“本期债券发行总额为人民币 180 亿元，为 3 年期固定利率品种，票面利率为 4.30%”，则实际发行量采集为“18000000000”。

### 7.8.6 发行价格

名称：发行价格

英文名称：IssuePrice

编号：A0606

数据元集：债券发行注册要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券、证券、存单等交易标的的出售价格或购买价格。发行价格不一定是票面值，它可以低于或高于票面值发行，按照债券发行价格与其票面值的关系，可分为平价发行、折价发行和溢价发行三种发行价格

采集口径：根据发行结果公告、发行情况公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：18 华夏银行 01 在发行情况公告中约定“发行价格 100 元/百元面值”，则发行价格采集为“100”。

### 7.8.7 发行参考收益率

名称：发行参考收益率

英文名称：ReferenceYieldonIssueDate

编号：A0607

数据元集：债券发行注册要素

定义：债券各次发行（首发和续发）的发行价格所对应的参考收益率

采集口径：根据发行结果公告、发行情况公告采集，若未直接披露，则根据发行价格推算。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：18 国开 06 在发行结果公告中约定“参考收益率 4.3677%”，则发行参考收益率采集为“4.3677”。

### 7.8.8 发行所在地国家

名称：发行所在地国家

英文名称：IssueCountry

编号：A0608

数据元集：债券发行注册要素

定义：债券各次发行（首发和续发）所在的国家

采集口径：根据发行文件采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：该数据元的可枚举值域采用 GB/T 2659—2000 中的 2 位国家代码

度量单位：无

示例：15 附息国债 01 的发行所在地国家为中国，则发行所在地国家采集为“CN”。

### 7.8.9 认购倍率

名称：认购倍率

英文名称：SubscriptionRatio

编号：A0609

数据元集：债券发行注册要素

定义：债券各次发行（首发和续发）的认购倍率

采集口径：根据发行结果公告、发行情况公告采集， $\text{认购倍率} = \text{投标量} / \text{计划发行总量}$ 。

数据类型：数字型

度量单位：无

示例：15 附息国债 01 在《中国债券信息网 2015 年记账式附息（一期）国债招标情况》中披露“计划招标发行总量：200 亿元，投标量：709 亿元，实际发行总量：200 亿元”，则认购倍率采集为“3.545”。

### 7.8.10 发行手续费率

名称：发行手续费率

英文名称：UnderwriterFees

编号：A0610

数据元集：债券发行注册要素

定义：债券各次发行（首发和续发）支付给有关债券中介机构和服务机构费用的费率

采集口径：根据发行文件、发行结果公告、发行情况公告采集，未披露时，则采集为空。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：09 国开 04 在发行文件中约定“承揽费及兑付手续费：债券承揽费为认购债券面值的 0.15%，无兑付手续费”，则发行手续费率采集为“0.15”。

## 7.9 评级要素

### 7.9.1 评级公司/信用评级机构

名称：评级公司/信用评级机构

英文名称: RatingCorporation/CreditRatingInstitution

编号: A0701

数据元集: 评级要素

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即依法设立的从事信用评级业务的社会中介机构, 由专门的经济、法律、财务专家组成的对证券发行人和证券信用进行等级评定的组织

采集口径: 根据评级报告采集。

数据类型: 字符型

度量单位: 无

可枚举值域: 东方金诚国际信用评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中证鹏元资信评估股份有限公司、联合资信评估股份有限公司、大公国际资信评估有限公司、联合信用评级有限公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、中债资信评估有限责任公司、标普全球 (S&P Global)、穆迪投资者服务公司 (Moody's Investors Service)、惠誉评级 (Fitch Ratings)

示例: 18 华夏银行 01 在发行文件中约定“经中诚信国际信用评级有限责任公司综合评定, 发行人的主体信用等级为 AAA 级, 本期债券的评级为 AAA 级”, 则主体评级的评级公司/信用评级机构采集为“中诚信国际信用评级有限责任公司”, 债项评级的评级公司/信用评级机构采集为“中诚信国际信用评级有限责任公司”。

### 7.9.2 评级生效日

名称: 评级生效日

英文名称: RatingEffectiveDate

编号: A0702

数据元集: 评级要素

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即信用评级的开始日期, 适用于标的实体 (主体、创设机构) 和标的债务, 格式为 YYYY-MM-DD

采集口径: 根据评级报告盖章处的日期采集。评级生效日为时间序列时, 应进行多行采集。

数据类型: 日期型

度量单位: 无

示例: 15 锡交 01 在 2015 年公布的信用评级报告文本盖章处的日期为“2015 年 7 月 13 日”, 主体评级生效日采集为“2015-07-13”, 债项评级生效日采集为“2015-07-13”; 2016 年公布的信用评级报告标题下方的评级时间为“2016 年 6 月 24 日”, 该债券第二个主体评级生效日采集为“2016-06-24”, 债项评级生效日采集为“2016-06-24”。

### 7.9.3 主动评级标志

名称: 主动评级标志

英文名称: SolicitedRatingIndicator

编号: A0703

数据元集: 评级要素

定义: 标识评级是否由评级机构或债券的投资人主动发起

采集口径: 根据评级报告采集。受发行人委托开展的评级为委托评级, 评级机构或债券投资人主动发起的评级为主动评级。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 委托评级、主动评级

度量单位: 无

示例: 18 华夏银行 01 在《中诚信国际信用评级有限责任公司信用评级报告》中约定“华夏银行股份有限公司: 受贵

公司委托，中诚信国际信用评级有限责任公司对贵公司拟发行的 2018 年第一期不超过人民币 180 亿元金融债券的信用状况进行了综合分析”，因此主动评级标志采集为“委托评级”。

#### 7.9.4 评级类型

名称：评级类型

英文名称：RatingType

编号：A0704

数据元集：评级要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即按照评级对象进行的分类，按照主体、债务等予以分类

采集口径：根据评级报告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：长期债务评级、短期债务评级、主体信用评级、本币主权信用评级、外币主权信用评级

度量单位：无

示例：18 华夏银行 01 在《中诚信国际信用评级有限责任公司信用评级报告》中约定“经中诚信国际信用评级委员会最后审定，贵公司主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定，本期金融债券的信用等级为 AAA”，发行文件中约定“债券期限和品种：本期债券为 3 年期品种”，则主体评级的评级类型采集为“主体信用评级”，债券评级的评级类型采集为“长期债务评级”。

#### 7.9.5 信用评级符号

名称：信用评级符号

英文名称：CreditRating

编号：A0705

数据元集：评级要素

定义：债券和主体的信用评级结果

采集口径：根据评级报告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：AAA+、AAA、AAA-、AA+、AA、AA-、A+、A、A-、Aa1、Aa2、Aa3、A1、A-1、A2、A-2、A3、A-3、BBB+、BBB、BBB-、BB+、BB、BB-、B+、B、B-、Baa1、Baa2、Baa3、Ba1、Ba2、Ba3、B1、B2、B3、CCC+、CCC、CCC-、CC、C、Caa1、Caa2、Ca、Caa3、D、F1、F2、F3、NP、P-1、P-2、P-3、RD、SD

度量单位：无

示例：18 华夏银行 01 在发行文件中约定“经中诚信国际信用评级有限责任公司综合评定，发行人的主体信用级别为 AAA 级，本期债券的评级为 AAA 级”，则主体评级的信用评级符号采集为“AAA”，债项评级的信用评级符号采集为“AAA”。

#### 7.9.6 评级展望

名称：评级展望

英文名称：RatingOutlook

编号：A0706

数据元集：评级要素

定义：标识评级机构对主体或债券信用评级状况未来走向的判断结果

采集口径：根据评级报告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：稳定、正面、负面、待定

度量单位：无

示例：18 华夏银行 01 在《中诚信国际信用评级有限责任公司信用评级报告》中约定“经中诚信国际信用评级委员会最后审定，贵公司主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定，本期金融债券的信用等级为 AAA”，则评级展望采集为“稳定”。

### 7.9.7 评级观察名单

名称：评级观察名单

英文名称：RatingWatch

编号：A0707

数据元集：评级要素

定义：反映主体或债券信用评级的未来级别可能修正的情况

采集口径：根据评级报告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：列入观察（上调）、列入观察（下调）、列入观察（不确定）、撤出观察名单

度量单位：无

示例：14 宁宝塔 MTN001、14 宁宝塔 MTN002 根据联合资信评估股份有限公司发布的《关于下调宝塔石化集团有限公司主体和相关债项信用等级并继续将其列入可能下调信用等级观察名单》的约定“将 14 宁宝塔 MTN001 和 14 宁宝塔 MTN002 的信用等级由 BB 下调至 CCC，并继续将其列入可能下调信用等级的观察名单”，则债项的评级观察名单采集为“列入观察（下调）”。

## 7.10 债券现金流要素

### 7.10.1 计息区间起始日

名称：计息区间起始日

英文名称：InterestAccrualStartDate

编号：A0801

数据元集：债券现金流要素

定义：本次付息所对应的付息区间起始日期（计息起始日期），格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件采集，存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 永州城建债根据 2015 年和 2016 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息公告》、2017 年和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》对还本付息情况的约定，以及《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“本年度计息期限：2018 年 4 月 2 日至 2018 年 8 月 8 日（算头不算尾）”，则计息区间起始日分别采集为“2014-04-02”“2015-04-02”“2016-04-02”“2017-04-02”“2018-04-02”。

### 7.10.2 计息区间截止日

名称：计息区间截止日

英文名称：InterestAccrualEndDate

编号：A0802

数据元集：债券现金流要素

定义：本次付息所对应的付息区间结束日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件采集，存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 永州城建债根据 2015 年和 2016 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息公告》、2017 年和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》对还本付息情况的约定，以及《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“本年度计息期限：2018 年 4 月 2 日至 2018 年 8 月 8 日（算头不算尾）”，则计息区间截止日分别采集为“2015-04-01”“2016-04-01”“2017-04-01”“2018-04-01”“2018-08-07”。

### 7.10.3 权益登记日

名称：权益登记日

英文名称：ExRightDate

编号：A0803

数据元集：债券现金流要素

定义：本次付息的权益登记日期，即除息日/债权登记日，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中披露的权益登记日期采集，不做节假日顺延或提前。若未直接披露权益登记日期，但已披露基准日期并给出根据基准日期推算权益登记日期的规则，则根据推算规则推算并采集。存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 永州城建债在《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“兑付债权登记日：2018 年 8 月 7 日”，权益登记日采集为“2018-08-07”。

### 7.10.4 理论付息日

名称：理论付息日

英文名称：InterestPaymentDate

编号：A0804

数据元集：债券现金流要素

定义：发行人承诺的付息日，如遇节假日不考虑顺延或提前，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中披露的付息日期、收益分配日期采集，不做节假日顺延或提前。若未直接披露付息日期、收益分配日期，但已披露基准日期并给出根据基准日期推算付息日期的规则，则根据推算规则推算并采集。当理论付息日为时间序列时，应进行多行采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 永州城建债在发行文件中约定“付息日：2015 年至 2021 年每年的 4 月 2 日为上一个计息年度的付息日。如遇国家法定节假日或休息日则顺延至其后的第一个工作日”，则理论付息日应分别采集为“2015-04-02”“2016-04-02”“2017-04-02”“2018-04-02”“2019-04-02”“2020-04-02”“2021-04-02”。

### 7.10.5 付息日期

名称：付息日期

英文名称: ActualPaymentDate

编号: A0805

数据元集: 债券现金流要素

定义: 按照 JR/T 0065—2019, 即支付利息的具体日期, 如遇节假日考虑顺延或提前, 格式为 YYYY-MM-DD

采集口径: 根据付息兑付公告、收益分配公告、受托机构报告采集。当付息日期为时间序列时, 应进行多行采集。

数据类型: 日期型

度量单位: 无

示例: 14 永州城建债在《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年付息公告》中约定“将于 2018 年 4 月 2 日开始支付自 2017 年 4 月 2 日至 2018 年 4 月 1 日期间的利息”, 则付息日期采集为“2018-04-02”。

#### 7.10.6 利率生效日

名称: 利率生效日

英文名称: CouponRateEffectiveDate

编号: A0806

数据元集: 债券现金流要素

定义: 利率变动后生效的日期, 格式为 YYYY-MM-DD

采集口径: 根据发行结果公告采集, 对于存续期间利率发生变化的债券, 应在变动发生时完成采集 (例如浮动利率债券应在利率重置日, 按照发行文件中约定的基准利率种类, 给出重置后的利率结果; 永续债券应在重定价日, 按照发行文件中约定的重定价规则, 给出重定价后的利率结果), 并在付息兑付时根据实际付息的利率进行修正。

数据类型: 日期型

度量单位: 无

示例: 18 建元 10A1 在发行文件中约定“资产支持证券于证券起息日 2018 年 5 月 30 日 (含该日) 开始计息”, 则利率生效日采集为“2018-05-30”。

#### 7.10.7 本期基准利率

名称: 本期基准利率

英文名称: BenchmarkRate

编号: A0807

数据元集: 债券现金流要素

定义: 利率变动后生效的基准利率值

采集口径: 根据发行结果公告采集, 对于存续期间利率发生变化的债券, 应在变动发生时完成采集 (例如浮动利率债券应在利率重置日, 按照发行文件中约定的基准利率种类, 给出重置后的利率结果; 永续债券应在重定价日, 按照发行文件中约定的重定价规则, 给出重定价后的利率结果), 并在付息兑付时根据实际付息的利率进行修正。

数据类型: 数字型

度量单位: %

示例: 18 建元 10A1 在发行文件中约定“基准利率 4.9%, 基本利差-0.10%”, 起息日为 2018 年 6 月 14 日, 对应的基准利率为 4.9%, 则本期基准利率采集为“4.9”。

#### 7.10.8 本期利差

名称：本期利差

英文名称：Spread

编号：A0808

数据元集：债券现金流要素

定义：利率变动后生效的利差值

采集口径：根据发行结果公告采集，对于存续期间利率发生变化的债券，应在变动发生时完成采集（例如浮动利率债券应在利率重置日，按照发行文件中约定的利差，给出重置后的利差；永续债券应在重定价日，按照发行文件中约定的重定价规则，给出重定价后的利差结果），并在付息兑付时根据实际付息的利差进行修正。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：18 建元 10A1 在发行文件中约定“基准利率 4.9%，基本利差-0.10%”，起息日为 2018 年 6 月 14 日，对应的利差为-0.10%，则本期利差采集为“-0.10”。

#### 7.10.9 本期固定利率

名称：本期固定利率

英文名称：FixedCouponRate

编号：A0809

数据元集：债券现金流要素

定义：利率变动后生效的固定利率值

采集口径：根据发行结果公告采集，对于存续期间利率发生变化的债券，应在变动发生时完成采集，并在付息兑付时根据实际付息的利率进行修正。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：14 永州城建债在《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券簿记建档结果公告》中约定“票面利率为 7.90%”，则本期固定利率采集为“7.90”。

#### 7.10.10 本期补偿利率

名称：本期补偿利率

英文名称：CompensationRate

编号：A0810

数据元集：债券现金流要素

定义：利率变动后生效的补偿利率值

采集口径：根据相关利率补偿公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：15 恒大 01、15 恒大 02、15 恒大 03 在公告中约定“恒大地产将通过上调本期债券利率的方式支付利息补偿”“本次各期债券的上调利率为 0.10%”，本期补偿利率采集为“0.10”。

#### 7.10.11 本期执行利率

名称：本期执行利率

英文名称：CouponRate

编号：A0811

数据元集：债券现金流要素

定义：利率变动后生效的执行利率值，本期执行利率=本期基准利率+本期利差+本期补偿利率，或，本期执行利率=本期固定利率+本期补偿利率

采集口径：根据发行结果公告采集，对于存续期间利率发生变化的债券，应在变动发生时完成采集，并在付息兑付时根据实际付息的利率进行修正。

数据类型：数字型

度量单位：%

示例：18建元10A1在发行文件中约定“票面利率/浮动债首次票面利率(%)为4.8%，首次基准利率为4.9%，利差(%)为-0.10%”，则本期执行利率采集为“4.8”。

#### 7.10.12 调整原因

名称：调整原因

英文名称：AdjustmentReason

编号：A0812

数据元集：债券现金流要素

定义：记录本次利率变动的原因

采集口径：根据发行结果公告、付息兑付公告、提前兑付公告、票面利率调整选择权行使公告等相关公告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：发行结果、利率重置、利率调整选择权、发行时约定的递进利率、利率补偿生效、利率补偿失效

度量单位：无

示例：16劲嘉02在《深圳市劲嘉创业投资有限公司关于16劲嘉02票面利率调整及投资者回售实施办法第三次提示性公告》中约定“利率调整：16劲嘉02发行人选择上调票面利率102个基点，本期债券自第四个计息年度起票面利率调整为8%”，则调整原因采集为“利率调整选择权”。

#### 7.10.13 本金扣减日期

名称：本金扣减日期

英文名称：PrincipalReductionDate

编号：A0813

数据元集：债券现金流要素

定义：本次兑付的本金或面值从总本金/总面值中扣除的日期，本次兑付的本金或面值从本金扣减日期开始不再计息/算息，大部分债券的本金扣减日期与发行文件约定的理论还本日为同一天，格式为YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件采集，存续期间若因提前兑付或其他情况导致本金扣减日期调整，应根据相关公告进行更新，并根据付息兑付公告采集实际日期。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14永州城建债的起息日为2014年4月2日，每年付息一次。在发行文件中约定“在债券存续期的第3年至第7年每年分别偿还本金的20%，当期利息随本金一起支付”。在2017和2018年发布的《2014年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》中约定“付息日：2017年4月2日”和“付息日：2018年4

月2日”。在《2014年永州市零陵城建投资有限公司公司债券2018年提前兑付兑息公告》中约定“将于2018年8月8日提前偿还本期债券剩余本金及利息”，则本金扣减日期分别采集为“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”。

#### 7.10.14 兑付前本金值

名称：兑付前本金值

英文名称：PrincipalBeforePayment

编号：A0814

数据元集：债券现金流要素

定义：在本次兑付前的单位债券的剩余本金值

采集口径：根据发行文件采集，存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：14永州城建债的起息日为2014年4月2日，每年付息一次。在发行文件中约定“在债券存续期的第3年至第7年每年分别偿还本金的20%，当期利息随本金一起支付”。在2017和2018年发布的《2014年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》中约定“付息日：2017年4月2日”和“付息日：2018年4月2日”。在《2014年永州市零陵城建投资有限公司公司债券2018年提前兑付兑息公告》中约定“将于2018年8月8日提前偿还本期债券剩余本金及利息”，则还本日期为“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”的兑付前本金值分别采集为“100”“80”“60”。

#### 7.10.15 剩余本金值

名称：剩余本金值

英文名称：RemainPrincipal

编号：A0815

数据元集：债券现金流要素

定义：针对按照减托管量的方式进行本金值兑付（分期还本）的债券，记录本次兑付前托管量剩余比例

采集口径：根据发行文件采集，存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：10寿光债在发行文件中对分期还本约定“2013年至2017年每年分别偿还本金的10%”“2018年至2020年分别偿还2017年兑付日后剩余本金的20%、40%和40%”及减托管量操作约定“每次还本时按照债权登记日日终在债权登记托管机构托管名册上登记的各债权持有人所持面值占当年债券存续余额的比例进行分配”，则2013-2020年各还本日期的剩余本金值分别采集为“100”“90”“80”“70”“60”“50”“40”和“20”。

#### 7.10.16 兑付本金值

名称：兑付本金值

英文名称：PrincipalPayment

编号：A0816

数据元集：债券现金流要素

定义：本次兑付的本金值

采集口径：根据发行文件采集，存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：14 永州城建债的起息日为 2014 年 4 月 2 日，每年付息一次。在发行文件中约定“分次还本，在债券存续期的第 3 年至第 7 年每年分别偿还本金的 20%，当期利息随本金一起支付”。在 2017 和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》中约定“付息日：2017 年 4 月 2 日”和“付息日：2018 年 4 月 2 日”。在《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“将于 2018 年 8 月 8 日提前偿还本期债券剩余本金及利息，债券面值：60 元/百元面值”，则实际还本日“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”对应的兑付本金值分别采集为“20”“20”“60”。

#### 7.10.17 兑付净价

名称：兑付净价

英文名称：SettledinCleanPrice

编号：A0817

数据元集：债券现金流要素

定义：本次兑付的价格，包含兑付的本金值和补偿、不包含支付的利息。按照本金值兑付时，价格等于本次兑付的本金值

采集口径：根据付息兑付公告、持有人大会相关公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：10 寿光债在 2018 年提前兑付兑息公告中约定“本次提前偿还以 101.5638 元/百元面值作为兑付净价”，则兑付净价采集为“101.5638”。

#### 7.10.18 还本处理方式

名称：还本处理方式

英文名称：PrincipalPaymentMethod

编号：A0818

数据元集：债券现金流要素

定义：标识分期还本的债券在进行本金兑付时所采取的处理方式

采集口径：根据发行文件采集，存续期间根据付息兑付公告更新。

数据类型：字符型

可枚举值域：减本金值处理、减托管量处理

注：1. 减本金值处理指债券按照减本金的方式处理分期还本，减本金处理后，债券的托管面额不变，每张债券对应的本金值减少。

2. 减托管量处理指债券按照减托管量的方式处理分期还本，减托管量处理后，债券的托管面额减少，每张债券对应的本金值不变。

度量单位：无

示例：10 寿光债在发行文件中对减托管量操作约定“每次还本时按照债权登记日日终在债权登记托管机构托管名册上登记的各债权持有人所持面值占当年债券存续余额的比例进行分配”，则 2013-2020 年各还本日期的还本处理方式采集为“减托管量处理”。

#### 7.10.19 还本日

名称：还本日

英文名称：PrincipalPaymentDate

编号：A0819

数据元集：债券现金流要素

定义：债券本次兑付的理论还本日期（理论支付日期），格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件直接披露的兑付日采集，不做节假日顺延或提前；若发行文件未直接披露兑付日，仅给出根据基准日推算兑付日的规则，则应根据推算规则采集理论还本日期，并在存续期间随工作日日历调整而更新；若存续期间因提前兑付或其他情况导致理论还本日期调整，应根据相关公告更新，并根据付息兑付公告采集实际日期。还本日为时间序列时，应进行多行采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 永州城建债在发行文件中约定“兑付日：2017 年至 2021 年每年的 4 月 2 日”，则还本日分别采集为“2017-04-02”“2018-04-02”“2019-04-02”“2020-04-02”“2021-04-02”。

### 7.10.20 实际还本日

名称：实际还本日

英文名称：ActualPrincipalPaymentDate

编号：A0820

数据元集：债券现金流要素

定义：债券本次兑付的实际还本日期（实际支付日期），格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据付息兑付公告披露的兑付款项实际支付日期采集，尚未披露本次兑付的相关公告时，则采集为空。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：10 寿光债在 2016 年 8 月发布的付息及分期还本偿还本金公告中约定“实际还本日期为 2016 年 9 月 1 日”，则实际还本日采集为“2016-09-01”。

### 7.10.21 含权类型

名称：含权类型

英文名称：Option-EmbeddedType

编号：A0821

数据元集：债券现金流要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即债券中所包含的不同权利的分类

采集口径：根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：发行人赎回选择权、发行人利息递延支付选择权、发行人续期选择权、发行人合并债券选择权、投资人回售选择权、发行人调整票面利率选择权、投资人定向转让选择权、第三方优先收购权、投资人延期兑付选择权、投资人调换债券选择权、投资人可转换选择权

- 注：1. 发行人利息递延支付选择权指发行人可选择将某一付息日应支付的全部或部分利息，推迟至下一付息日支付。  
 2. 发行人续期选择权指发行人可在约定的日期，选择将本债券期限延长，或选择全额兑付本债券。  
 3. 发行人合并债券选择权指发行人可在约定的日期，选择增发或合并债券。  
 4. 投资人定向转让选择权指投资人可在约定的日期，选择一定时间点将持有的全部或部分债券转让给第三方。  
 5. 第三方优先收购权指债券发行人、投资人以外的第三方可在约定的日期，选择按照约定的价格将债券赎回。  
 6. 投资人延期兑付选择权指债券到期后，投资人可选择要求发行人延期兑付债券。

7. 投资人调换债券选择权指投资人可在约定的日期，选择将持有的全部或部分债券按照规定的价格和比例调换为另一只债券。

8. 投资人可转换选择权指投资人可在约定的日期，选择将持有的全部或部分债券按照规定的价格或比例转换为股票。

度量单位：无

示例：18 平湖国资 MTN001 在发行文件中约定“在第 3 年末附加发行人调整票面利率选择权及投资者回售选择权”，含权类型分别采集为“投资人回售选择权”“发行人调整票面利率选择权”。

#### 7.10.22 债券行权类型

名称：债券行权类型

英文名称：BondExerciseType

编号：A0822

数据元集：债券现金流要素

定义：标识选择权的履约方式

采集口径：根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：美式期权、欧式期权、百慕大期权

度量单位：无

示例：12 愉悦债在《2012 年愉悦家纺有限公司公司债券回售公告》中约定“回售部分债券兑付日为 2016 年 12 月 20 日”，则债券行权类型采集为“欧式期权”。

#### 7.10.23 选择权状态

名称：选择权状态

英文名称：OptionStatus

编号：A0823

数据元集：债券现金流要素

定义：标识选择权的行使状态（是否可行使及行使的结果）

采集口径：根据选择权行使公告、行使结果公告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：未表态、发行人已表态行使赎回选择权、发行人已表态不行使赎回选择权、发行人已行使赎回选择权、发行人已表态行使递延选择权、发行人已表态不行使递延选择权、发行人已行使递延选择权、发行人表态续期、发行人表态不续期、发行人已表态行使合并选择权、发行人已表态不行使合并选择权、发行人已行使合并选择权、发行人已表态投资人可行使回售权、发行人已表态投资人不可行使回售权、投资人未行使回售选择权、投资人已行使回售选择权且部分行使、投资人已行使回售选择权且全部行使、发行人已明确行权后利率、发行人已表态投资人可行使定向转让选择权、发行人已表态投资人不可行使定向转让选择权、投资人未行使定向转让选择权、投资人已行使定向转让选择权且部分行使、受让方表态行使定向转让选择权、受让方已行使定向转让选择权、发行人已表态投资人可行使延期兑付选择权、发行人已表态投资人不可行使延期兑付选择权、投资人未行使延期兑付选择权、投资人已行使延期兑付选择权且部分行使、投资人已行使延期兑付选择权且全部行使、发行人已表态投资人可行使转换和调换选择权、发行人已表态投资人不可行使转换和调换选择权、投资人未行使转换和调换选择权、投资人已行使转换和调换选择权且部分行使、投资人已行使转换和调换选择权且全部行使

度量单位：无

示例：16 景瑞 01 在《景瑞地产（集团）有限公司关于“16 景瑞 01”公司债放弃行使赎回权的公告》中约定“根据

公司实际情况及当前的市场环境，本公司决定放弃行使赎回权”，则选择权状态采集为“发行人已表态不行使赎回选择权”。

#### 7.10.24 区间初始行权日

名称：区间初始行权日

英文名称：ExerciseIntervalStartDate

编号：A0824

数据元集：债券现金流要素

定义：行权类型为美式期权或百慕大期权的选择权，约定的选择权行使日期区间起始日期，格式为YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

#### 7.10.25 区间最后行权日

名称：区间最后行权日

英文名称：ExerciseIntervalEndDate

编号：A0825

数据元集：债券现金流要素

定义：行权类型为美式期权或百慕大期权的选择权，约定的选择权行使日期区间结束日期，格式为YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集，算头不算尾。

数据类型：日期型

度量单位：无

#### 7.10.26 理论行权日

名称：理论行权日

英文名称：ExerciseDate

编号：A0826

数据元集：债券现金流要素

定义：行权类型为欧式期权的选择权，约定的选择权行使日期，格式为YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：12愉悦债在《2012年愉悦家纺有限公司公司债券回售公告》中约定“回售部分债券兑付日为2016年12月20日”，则理论行权日采集为“2016-12-20”。

#### 7.10.27 实际行权日

名称：实际行权日

英文名称：ActualExerciseDate

编号：A0827

数据元集：债券现金流要素

定义：行权类型为欧式期权的选择权，选择权实际行使的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据选择权行使公告、行使结果公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：10 中钢债在《2010 年中国钢铁股份有限公司公司债券回售选择权行使公告》中约定“行权日：2017 年 8 月 21 日”，则实际行权日采集为“2017-08-21”。

#### 7.10.28 行权止息日

名称：行权止息日

英文名称：LastExpiryDateforCoupon

编号：A0828

数据元集：债券现金流要素

定义：在行使选择权兑付债券面额时，用于计算相应应付利息的最后一个计息日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：在发行时行权止息日期根据发行文件采集或推算，行权结果等相应公告发布后，行权止息日期根据上述公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：15 东旭债在《关于 15 东旭债票面利率调整和投资者回售实施办法的第一次提示性公告》中约定“回售部分债券享有 2017 年 5 月 19 日至 2018 年 5 月 18 日期间利息”，理论行权日为 2018 年 5 月 18 日，则行权止息日采集为“2018-05-18”。

#### 7.10.29 触发性条款类型

名称：触发性条款类型

英文名称：TriggeringClauseType

编号：A0829

数据元集：债券现金流要素

定义：标识选择权条款中是否约定触发条件

注：选择权需在满足触发条件的状况下才可行使。

采集口径：根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：非触发性选择权条款、触发性选择权条款、可转债有条件赎回条款、可转债有条件回售条款

度量单位：无

示例：17 鲁晨鸣 SCP003 在发行文件中约定“1.1 触发情形（财务指标承诺）发行人在本期债务融资工具存续期间应当确保发行人的合并财务报表资产负债率不超过 80%。第 1.1 条中的触发情形发生之日起 30 个工作日内召开债务融资工具持有人会议。债务融资工具持有人有权对如下处理方案进行表决：无条件豁免违反约定；持有人对本期债务融资工具享有回售选择权”，因该券为非可转债，有回售选择权，有触发条件，则触发性条款类型采集为“触发性选择权条款”。

#### 7.10.30 触发条款

名称：触发条款

英文名称: TriggeringClause

编号: A0830

数据元集: 债券现金流要素

定义: 触发性选择权在条款中约定的触发条件文本

采集口径: 根据发行文件中约定的投资人选择权、发行人选择权等条款采集, 对于可转债的有条件赎回条款, 应按照“触发满足天数、触发计算天数、触发比例、触发频率限制(次/年)”的格式采集; 若对触发频率无限制, 采集0; 对于可转债的有条件回售条款, 应按照“触发满足天数、触发比例、触发频率限制(次/年)”的格式采集; 对于其他一般性触发性条款(无结构化需求), 应采集触发条件的文本内容。

数据类型: 字符型

度量单位: 无

示例: 17 鲁晨鸣 SCP003 在发行文件中约定“1.1 触发情形(财务指标承诺)发行人在本期债务融资工具存续期间应当确保发行人的合并财务报表资产负债率不超过 80%。第 1.1 条中的触发情形发生之日起 30 个工作日内召开债务融资工具持有人会议。债务融资工具持有人有权对如下处理方案进行表决: 无条件豁免违反约定; 持有人对本期债务融资工具享有回售选择权”, 则触发条款采集上述文本内容。

#### 7.10.31 触发状态

名称: 触发状态

英文名称: TriggeringStatus

编号: A0831

数据元集: 债券现金流要素

定义: 标识触发性选择权是否已触发

采集口径: 发行时按照未触发采集, 存续期间根据选择权触发相关公告采集。

数据类型: 字符型

可枚举值域: 未触发、已触发

度量单位: 无

示例: 17 鲁晨鸣 SCP003 在发行文件中约定“1.1 触发情形(财务指标承诺)发行人在本期债务融资工具存续期间应当确保发行人的合并财务报表资产负债率不超过 80%。第 1.1 条中的触发情形发生之日起 30 个工作日内召开债务融资工具持有人会议。债务融资工具持有人有权对如下处理方案进行表决: 无条件豁免违反约定; 持有人对本期债务融资工具享有回售选择权”, 因发行公告约定时, 未达到触发情形, 则触发状态采集为“未触发”。

#### 7.10.32 利率/利差变动方向

名称: 利率/利差变动方向

英文名称: CouponAdjustmentDirection

编号: A0832

数据元集: 债券现金流要素

定义: 标识票面利率调整选择权条款中约定的利率/利差调整方向, 包含上调、下调或调整等

采集口径: 根据发行文件中约定的利率条款、期限条款和票面利率调整选择权条款采集, 具体如下: ——若利率调整选择权条款未披露调整区间且条款名称中仅包含“上调”或相同含义的词语, 且利率调整选择权条款、利率条款、期限条款的条款内容中也包含“上调”或相同含义的词语, 未出现相矛盾的词语(如“下调”“减”等), 表述利率调整方向时未出现模糊表述(如“调整”等)时, “利率调整方向”按照“明确上调”采集。

- 若利率调整选择权条款未披露调整区间且条款名称中包含“上调”或相同含义的词语，但利率调整选择权条款、利率条款、期限条款的条款内容在表述利率调整方向时使用模糊表述（如“调整”等）时，“利率调整方向”按照“模糊上调1”采集。
- 若利率调整选择权条款未披露调整区间且条款名称中包含“上调”或相同含义的词语，但未给出明确的条款内容时，“利率调整方向”按照“模糊上调2”采集。
- 若利率调整选择权条款未披露调整区间且条款名称中未包含“上调”或相同含义的词语，但利率调整选择权条款、利率条款、期限条款的条款内容中明确为上调（如发行人可选择上调票面利率、第4年及第5年票面利率为本期中期票据存续期前3年票面年利率加发行人提升的基点）时，按照“明确上调”采集。该种情形下如条款内容表述模糊，则不认可为采集条件（如第4年及第5年票面利率为本期中期票据存续期前3年票面年利率加发行人调整的基点，不因存在“加”这个字而认为是上调）。
- 若“利息调整方向”为“明确下调”“模糊下调1”“模糊下调2”，比照“明确上调”“模糊上调1”“模糊上调2”执行。
- 若利率调整选择权条款未披露调整区间且条款名称中未包含“上调”或“下调”或相同含义的词语，未从名称中体现出利率的调整方向，且利率调整选择权条款、利率条款、期限条款的条款内容中也未明确说明调整方向或未披露条款内容时，“利率调整方向”按照“明确调整”采集。
- 若利率调整选择权条款披露调整区间，采集规则如下：上限大于0、下限大于等于0，判断为“明确上调”；上限大于0、下限小于0，判断为“明确调整”；上限小于等于0、下限小于0，判断为“明确下调”。
- 若利率调整选择权条款披露上调基点，则按照“明确上调”采集；若利率调整选择权条款披露下调基点，则按照“明确下调”采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：明确调整、明确下调、模糊下调1、模糊下调2、明确上调、模糊上调1、模糊上调2  
度量单位：无

示例：1. 14浙证债的选择权条款名称为“发行人上调票面利率选择权”，且在条款内容中约定“发行人可选择上调票面利率，债券票面年利率为债券存续期前3年票面年利率加上上调基点”，条款内容与条款名称一致，且不存在歧义，采集为“明确上调”。

2. 14山西交投MTN001在利率条款的条款内容中约定“第6年及第7年票面年利率为本期中期票据存续期前5年票面年利率加或减发行人提升或降低的基点”，从内容上否定“上调”的概念，应采集为“明确调整”。

3. 16威海临港小微债在利率调整选择权条款的条款内容中约定“发行人有权决定在本期债券存续期的第三年末上调本期债券最后一年的票面利率，调整幅度为-300至300个基点”，从调整范围上否定“上调”的概念，应采集为“明确调整”。

4. 16赣铁债02的选择权条款名称为“发行人调整票面利率选择权”，且在条款内容中约定“本期债券在债券存续期的第5和第10个计息年末，发行人有权选择上调该品种票面利率或者下调该品种票面利率”，应采集为“明确调整”。

### 7.10.33 行权后利率/利差变动上限

名称：行权后利率/利差变动上限

英文名称：CouponAdjustmentUpperBound

编号：A0833

数据元集：债券现金流要素

定义:票面利率调整选择权条款中约定的利率/利差调整范围上限(相对于调整前利率/利差的变动)

采集口径:根据发行文件中约定的票面利率调整选择权条款采集,未设定上限时采集为空。若条款中约定调整范围为确定值,例如“从第4个计息年度开始,后2个计息年度的票面年利率在初始发行票面年利率的基础上提高200个基点”,则“行权后利率/利差变动上限”“行权后利率/利差变动下限”为空,“行权后利率/利差变动”采集确定的调整值;若条款中约定的调整范围为区间范围,例如“发行人有权决定在本期债券存续期的第5年末上调本期债券后5年的票面利率,上调幅度为0至100个基点(含本数)”,则“行权后利率/利差变动上限”“行权后利率/利差变动下限”分别采集调整区间的上限和下限。

数据类型:数字型

度量单位:BP

示例:16苏园建MTN001A在发行文件中约定“附第5年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售权。在第5年末,发行人可选择上调票面利率0至100个基点,债券票面年利率为前5年票面利率加上上调基点,在债券存续期后2年固定不变”,则行权后利率/利差变动上限采集为“100”。

#### 7.10.34 行权后利率/利差变动下限

名称:行权后利率/利差变动下限

英文名称:CouponAdjustmentLowerBound

编号:A0834

数据元集:债券现金流要素

定义:票面利率调整选择权条款中约定的利率/利差调整范围下限(相对于调整前利率/利差的变动)

采集口径:根据发行文件中约定的票面利率调整选择权条款采集,未设定下限时采集为空。若条款中约定调整范围为确定值,例如“从第4个计息年度开始,后2个计息年度的票面年利率在初始发行票面年利率的基础上提高200个基点”,则“行权后利率/利差变动上限”“行权后利率/利差变动下限”为空,“行权后利率/利差变动”采集确定的调整值;若条款中约定的调整范围为区间范围,例如“发行人有权决定在本期债券存续期的第5年末上调本期债券后5年的票面利率,上调幅度为0至100个基点(含本数)”,则“行权后利率/利差变动上限”“行权后利率/利差变动下限”分别采集调整区间的上限和下限。

数据类型:数字型

度量单位:BP

示例:16苏园建MTN001A在发行文件中约定“附第5年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售权。在第5年末,发行人可选择上调票面利率0至100个基点,债券票面年利率为前5年票面利率加上上调基点,在债券存续期后2年固定不变”,则行权后利率/利差变动下限采集为“0”。

#### 7.10.35 行权后利率/利差变动

名称:行权后利率/利差变动

英文名称:FixedCouponAdjustment

编号:A0835

数据元集:债券现金流要素

定义:票面利率调整选择权条款中约定的利率/利差调整值(相对于调整前利率/利差的变动)或票面利率调整公告中披露的利率/利差调整确定值

采集口径:根据发行文件中约定的票面利率调整选择权条款采集,未设定明确的调整值时采集为空;存续期间根据票面利率调整公告,采集披露的行权后利率/利差调整实际值。

数据类型：数字型

度量单位：BP

示例：14 昆钢 MTN001 在《昆明钢铁控股有限公司 2014 年度第一期中期票据票面利率调整及投资者回售实施办法的公告》中约定“未回售部分债券利率：6.73%，为前两年票面利率加 0 个基点”，则行权后利率/利差变动采集为“0”。

#### 7.10.36 行权价格

名称：行权价格

英文名称：ExercisePrice

编号：A0836

数据元集：债券现金流要素

定义：按照 JR/T 0065—2019，即含权债行使权利时交易的价格

采集口径：根据发行文件中披露的选择权条款采集，存续期间，根据披露的选择权行使公告更新。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：14 昆钢 MTN001 在《昆明钢铁控股有限公司 2014 年度第一期中期票据票面利率调整及投资者回售实施办法的公告》中约定“回售价格为 100 元/百元面值”，则行权价格采集为“100”。

#### 7.10.37 转让价格

名称：转让价格

英文名称：TransferPrice

编号：A0837

数据元集：债券现金流要素

定义：含第三方定向转让权债券行使权利时的净价，并扣除当日因分期还本兑付的本金值，不包含应计利息

采集口径：根据发行文件中披露的选择权条款采集，存续期间，根据披露的选择权行使公告更新。

数据类型：数字型

度量单位：元/百元面值

示例：15 银川大桥项目 NPB 在发行文件中约定“本期债券投资人享有在第 5、10、15 个计息年度末 3 次全部或部分转让本期债券给受让人的权利，转让净价为本期债券面值”，则转让价格采集为“100”。

### 7.11 债券外部编码要素

#### 7.11.1 债券外部编码

名称：债券外部编码

英文名称：ExternalSecurityIdentifier

编号：A0901

数据元集：债券外部编码要素

定义：债券的识别编码

采集口径：根据各机构披露的编码进行采集，若有多个编码，应进行多行采集，并用债券外部编码类型进行标识。

数据类型：字符型

度量单位：无

注：ISIN：国际证券识别码（International Securities Identification Number）；FIGI：金融工具全球识别码

(Financial Instrument Global Identifier)。

示例：12 吉首华泰债有 ISIN 码和 FIGI 码，分别为 CND1000063Y9 和 BBG003Q1PWY7，则债券外部编码分别采集为“CND1000063Y9”“BBG003Q1PWY7”。

### 7.11.2 债券外部编码类型

名称：债券外部编码类型

英文名称：ExternalSecurityIdentifierType

编号：A0902

数据元集：债券外部编码要素

定义：标识全球债券识别编码的类型

采集口径：与债券外部编码配合使用。

数据类型：字符型

可枚举值域：FIGI 码、ISIN 码、CUSIP 码、SEDOL 码

注：CUSIP：统一证券识别程序委员会（Committee on Uniform Security Identification Procedures）；SEDOL：证券交易所每日牌价证券号码（Stock Exchange Daily Official List）。

度量单位：无

示例：12 吉首华泰债有 ISIN 码和 FIGI 码，分别为 CND1000063Y9 和 BBG003Q1PWY7，因此债券外部编码分别采集为“CND1000063Y9”“BBG003Q1PWY7”，则对应的债券外部编码类型分别采集为“ISIN 码”“FIGI 码”。

## 7.12 债券存量变动要素

### 7.12.1 变动日期

名称：变动日期

英文名称：ChangingDate

编号：A1001

数据元集：债券存量变动要素

定义：债券存量发生变动的日期，格式为 YYYY-MM-DD

采集口径：根据发行结果公告、付息兑付公告、行权结果公告、受托机构报告、提前兑付公告等相关公告采集。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：14 永州城建债根据《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券簿记建档结果公告》、2017 和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》对还本付息情况的约定，以及《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“将于 2018 年 8 月 8 日提前偿还本期债券剩余本金及利息”，则变动日期分别采集为“2014-04-01”“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”。

### 7.12.2 存量变动金额

名称：存量变动金额

英文名称：ChangeofAmountOutstanding

编号：A1002

数据元集：债券存量变动要素

定义：债券存量本次变动的金额

采集口径：根据发行结果公告、付息兑付公告、行权结果公告、受托机构报告、提前兑付公告等相

关公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：14 永州城建债根据《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券簿记建档结果公告》、2017 和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》对还本付息情况的约定，以及《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“将于 2018 年 8 月 8 日提前偿还本期债券剩余本金及利息”，变动日期为“2014-04-01”“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”，则对应的存量变动金额分别采集为“1800000000”“3600000000”“3600000000”“1080000000”。

### 7.12.3 存量余额

名称：存量余额

英文名称：RemainofAmountOutstanding

编号：A1003

数据元集：债券存量变动要素

定义：债券本次变动后的余额

采集口径：根据发行结果公告、付息兑付公告、行权结果公告、受托机构报告、提前兑付公告等相关公告采集。

数据类型：数字型

度量单位：元

示例：14 永州城建债根据《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券簿记建档结果公告》、2017 和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》对还本付息情况的约定，以及《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“将于 2018 年 8 月 8 日提前偿还本期债券剩余本金及利息”，变动日期为“2014-04-01”“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”，则对应的存量余额分别采集为“1800000000”“1440000000”“1080000000”“0”。

### 7.12.4 存量变动原因

名称：存量变动原因

英文名称：ReasonforChangeofAmountOutstanding

编号：A1004

数据元集：债券存量变动要素

定义：标识债券存量变动的原因

采集口径：根据发行结果公告、付息兑付公告、行权结果公告、受托机构报告、提前兑付公告等相关公告采集。

数据类型：字符型

可枚举值域：首次发行、追加发行、提前兑付、到期兑付完毕、逾期兑付、延期兑付（投资人延期兑付选择权）、回售（投资人回售选择权）、赎回（发行人赎回选择权）、转股（投资人可转换选择权）、并入（发行人合并债券选择权）、并出（发行人合并债券选择权）、换入（投资人调换债券选择权）、换出（投资人调换债券选择权）

度量单位：无

示例：14 永州城建债根据《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券簿记建档结果公告》、2017 和 2018 年发布的《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券付息及分期偿还本金兑付公告》对还本付息情况的约定，以及《2014 年永州市零陵城建投资有限公司公司债券 2018 年提前兑付兑息公告》中约定“将于 2018 年 8 月 8 日提前偿还本期债券剩余本金及利息”，变动日期为“2014-04-01”“2017-04-02”“2018-04-02”“2018-08-08”，则对

应的存量变动原因分别采集为“首次发行”“提前兑付”“提前兑付”“提前兑付”。

## 7.13 债券与相关主体关系

### 7.13.1 关系类型

名称：关系类型

英文名称：EntityRelationType

编号：A1101

数据元集：债券与相关主体关系

定义：标识债券与相关主体之间的关系

采集口径：根据债券发行文件中披露的相关主体信息采集，存续期间若发生关系变化，根据相关公告更新，并记录变化的日期。

数据类型：字符型

可枚举值域：发行人、债务人、担保机构、主承销商、原始权益人/发起人、实际融资人、登记托管机构

度量单位：无

示例：15工元1A1在发行文件中的本次发行有关当事方部分罗列各相关机构，则关系类型分别采集为“发行人”“主承销商”“原始权益人/发起人”“登记托管机构”。

### 7.13.2 关系生效日

名称：关系生效日

英文名称：RelationEffectiveDate

编号：A1102

数据元集：债券与相关主体关系

定义：债券与相关主体建立关系的开始日期，格式为YYYY-MM-DD

采集口径：对于债权类资产，债券与相关主体的关系从债券起息日开始生效；如发生债务继承，则从债务继承公告日期开始生效。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：15工元1A1在发行文件中约定“资产支持证券于信托设立日2015年2月10日（含该日）开始计息”，则关系类型为“发行人”“主承销商”“原始权益人/发起人”对应的关系生效日均采集为“2015-02-10”。

### 7.13.3 关系终止日

名称：关系终止日

英文名称：RelationExpiringDate

编号：A1103

数据元集：债券与相关主体关系

定义：债券与相关主体终止关系的日期，格式为YYYY-MM-DD

采集口径：对于债权类资产，债券与相关主体的关系至债券实际到期日终止，如债券未实际到期，则采集为空；如发生债务继承，则关系终止日为债务继承公告当日。

数据类型：日期型

度量单位：无

示例：15工元1A1在《工元2015年第一期信贷资产证券化信托受托机构报告-第十一期》中约定“15工元1A1在

2017年10月26日已兑付完毕”，则关系类型为“发行人”“主承销商”“原始权益人/发起人”对应的关系终止日均采集为“2017-10-26”。

## 7.14 主体基本要素

### 7.14.1 主体全称

名称：主体全称

英文名称：EntityLegalName

编号：E0101

数据元集：主体基本要素

定义：发行文件、主体信息变更公告、工商登记信息等信息来源采集的主体名称

采集口径：以债券公告披露为准。

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：12 愉悦债在《2012 年愉悦家纺有限公司公司债券募集说明书》中约定的发行人为“愉悦家纺有限公司”，则主体全称采集为“愉悦家纺有限公司”。

### 7.14.2 主体简称

名称：主体简称

英文名称：EntityShortName

编号：E0102

数据元集：主体基本要素

定义：发行文件、主体信息变更公告等信息来源采集的主体简称

采集口径：以债券公告披露为准。如果公告中未披露，可采集主体官网中使用的简称。若均未披露，则采集为空。

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：12 愉悦债的发行人在公告中未做披露，可在其官网上采集，采集为“愉悦家纺”。

### 7.14.3 主体英文全称

名称：主体英文全称

英文名称：EntityEnglishFullName

编号：E0103

数据元集：主体基本要素

定义：发行文件、主体信息变更公告等信息来源采集的主体英文全称

采集口径：以债券公告披露为准。

数据类型：字符型

度量单位：无

示例：12Z 招商 02 在发行文件的发行人基本情况中约定发行人英文名称为“China Merchants Securities Co. Ltd.”，则主体英文全称采集为“China Merchants Securities Co. Ltd.”。

### 7.14.4 主体国家和地区代码

名称：主体国家和地区代码

英文名称: CountryandRegionCode

编号: E0104

数据元集: 主体基本要素

定义: 标识主体的所在国家或地区的编码

采集口径: 该数据元的可枚举值域采用 GB/T 2659—2000 中的 2 位国家代码。

数据类型: 字符型

度量单位: 无

示例: 12 愉悦债根据《2012 年愉悦家纺有限公司公司债券募集说明书》中披露的本次债券发行的有关机构, 发行人主体为“愉悦家纺有限公司”, 登记机关为滨州高新技术产业开发区市场监督管理局, 所在国家为中华人民共和国, 则主体国家和地区代码采集为“CN”。

#### 7.14.5 主体注册所在地代码

名称: 主体注册所在地代码

英文名称: CountryCodeofIncorporation

编号: E0105

数据元集: 主体基本要素

定义: 记录主体的注册地使用的编码

采集口径: 对于境外地区采用 GB/T 2659—2000 中的 2 位国家代码, 对于境内地区采用 GB/T 2260—2007 的行政区划代码, 具体填写规则如下:

——财政部和中国人民银行, 注册地区填写“000000”。

——地方政府, 注册地区按照地方政府所属行政级别填写。采用 GB/T 2260—2007 的行政区划代码, 共 6 位数字。第 1、2 位, 为省级代码; 第 3、4 位, 为地级代码; 第 5、6 位, 为县级代码。

——境内机构, 依据机构注册地填报至区县一级。采用 GB/T 2260—2007 的行政区划代码, 共 6 位数字。第 1、2 位, 为省级代码; 第 3、4 位, 为地级代码; 第 5、6 位, 为县级代码。

——境外机构采用 GB/T 2659—2000 的 2 位国家代码进行采集。

数据类型: 字符型

度量单位: 无

示例: 12 愉悦债根据《2012 年愉悦家纺有限公司公司债券募集说明书》中披露的本次债券发行的有关机构, 发行人主体为“愉悦家纺有限公司”, 登记机关为滨州高新技术产业开发区市场监督管理局, 则主体注册所在地代码采集为“371601”。

#### 7.15 主体外部编码要素

##### 7.15.1 主体外部编码

名称: 主体外部编码

英文名称: EntityIdentifier

编号: E0201

数据元集: 主体外部编码要素

定义: 全球主体的识别编码

采集口径: 根据各机构披露的主体编码进行采集, 若有多个编码, 应进行多行采集, 并用主体外部编码类型进行标识。

数据类型: 字符型

度量单位: 无

示例：12 愉悦债根据工商信息的披露，发行人愉悦家纺有限公司的统一社会信用代码为 91371600757461407H，则主体外部编码采集为“91371600757461407H”。

### 7.15.2 主体外部编码类型

名称：主体外部编码类型

英文名称：EntityIdentifierType

编号：E0202

数据元集：主体外部编码要素

定义：标识全球主体识别编码的类型

采集口径：与主体外部编码配合使用。

数据类型：字符型

可枚举值域：统一社会信用代码、全球法人识别编码（LEI, Legal Entity Identifier）

度量单位：无

示例：12 愉悦债根据工商信息的披露，发行人愉悦家纺有限公司的统一社会信用代码为 91371600757461407H，则主体外部编码类型采集为“统一社会信用代码”。

### 参 考 文 献

- [1] GB/T 18391—2009 信息技术 元数据注册系统 (MDR)
  - [2] JR/T 0229—2021 债券价格指标产品描述规范
  - [3] ISO 6166: 2013 Securities and related financial instruments—International securities identification numbering system (ISIN)
  - [4] ISO 17442:2020 Financial services—Legal entity identifier (LEI)
  - [5] 中国人民银行 中国证券监督管理委员会关于印发债券统计制度的通知(银发〔2014〕320号), 2014年11月1日
-