



# 中华人民共和国国家标准

GB/T 42505—2023

## 债券价格指标产品数据采集规范

Primary data collection specification for bond pricing indicator products

2023-03-17 发布

2023-03-17 实施

国家市场监督管理总局  
国家标准化管理委员会 发布

## 目 次

前言 .....	I
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 .....	5
5 采集时效性要求 .....	6
6 数据元表示格式 .....	6
7 数据元要素定义 .....	7
7.1 债券基本要素 .....	7
7.2 浮动利率债券要素 .....	13
7.3 永续债券要素 .....	19
7.4 资产支持证券要素 .....	27
7.5 资产包要素 .....	31
7.6 资产包信息披露要素 .....	33
7.7 债券流通要素 .....	38
7.8 债券发行注册要素 .....	41
7.9 评级要素 .....	44
7.10 债券现金流要素 .....	46
7.11 债券外部编码要素 .....	60
7.12 债券存量变动要素 .....	61
7.13 债券与相关主体关系 .....	62
7.14 主体基本要素 .....	63
7.15 主体外部编码要素 .....	65
8 证实方法 .....	65
参考文献 .....	66

## 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。

本文件由全国金融标准化技术委员会(SAC/TC 180)提出并归口。

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、中国金融电子化集团有限公司、中国外汇交易中心(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、易方达基金管理有限公司、中证指数有限公司、万得信息技术股份有限公司、上海大智慧财汇数据科技有限公司、彭博资讯(北京)有限公司上海分公司、路孚特信息服务(中国)有限公司北京分公司、中国长江三峡集团有限公司、攀钢集团有限公司。

本文件主要起草人：敖一帆、郑英立、魏成、牛玉锐、刘峰、王超群、赵凌、孙明洁、徐超、邬隽骁、马彤、解少飞、孙昭苏、邓琳莹、刘运、曹琰、侯蕴涵、张兆嘉、陈晓、熊歆、汤玥玥、詹思宇、赵丽、刘迁迁、潘泽东、张苏林、纪伟伟、苏晓航、马骏、何真、孙涛、周立、史海雄、吴志强、刘灿、渠荟璇、诸赞松、周亚妮、刘希普、刘杰克、缪书武。

# 债券价格指标产品数据采集规范

## 1 范围

本文件规定了债券价格指标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,并描述了相关实证方法。

本文件适用于债券价格指标产品的编制机构及为债券价格指标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 2260—2007 中华人民共和国行政区划代码

GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码

GB/T 7408—2005 数据元和交换格式 信息交换 日期和时间表示法

GB/T 12406 表示货币的代码

GB/T 18391.5—2009 信息技术 元数据注册系统(MDR) 第5部分:命名和标识原则

## 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库模型。

[来源:GB/T 18391.1—2009,3.2.5]

### 3.2

**数据元 data element**

由一组属性规定其定义、标识、表示和允许值的数据单元。

[来源:GB/T 18391.1—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**

所有允许值由一个列表进行规定的值域。

[来源:GB/T 18391.1—2009,3.3.14]

### 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,并在一定