1. Source. תלמוד בבלי מסכת ברכות דף נד עמוד ב - אמר רב יהודה: שלשה צריכין שימור, ואלו הן: חולה, חתן, וכלה, במתניתא תנא: חולה, חיה, חתן, וכלה. ויש אומרים: אף אבל. ויש אומרים: אף תלמידי חכמים בלילה.
2. The שיטמ"ק כתובות ה. בשם רמב"ן quotes a מדרש that he can’t even go outside with an entourage because he is like a king who is אינו יוצא מפתח פלטרין. However, the פרקי דר"א explicitly says אינו יוצא לשוק לבדו, implying that he can go with others.
3. Halacha. The פרישה אה"ע סימן סד says that the חתן וכלה can’t go out alone even if just to go to shul. The מנהג of a חתן not going to shul is probably based on this (because it is difficult to find somebody who will bring him to and from shul each day). יעב"ץ (מגדל עוז דף יא) adds that it is also אסור to go out alone for other דבר מצוה.
4. Quoted by the Rama - שולחן ערוך אבן העזר הלכות קידושין סימן סד סעיף א - וחתן אסור בעשיית מלאכה, ואסור לצאת יחידי בשוק) (ר"ן פ"ק דכתובות ובפרקי ר"א).
5. Even at home shouldn’t be alone ערוך השולחן אבן העזר הלכות קידושין סימן סד סעיף ג - וגם בגמ' אמרו חז"ל שחתן צריך שימור [ברכות נ"ד ב] וכיון שצריך שימור ממילא שלא יצא יחידי וכן משמע בש"ס שלא יעשה מלאכה אם כי אינו מבואר שם בפירוש שאסור מ"מ משמע כן [כתו' ה'. משכים לאומנותו והולך] ולשון הש"ס שצריך שימור משמע דגם בביתו לא ישב לבדו ואף ביום צריך שימור
6. Going out in broad daylight – נישואין כהלכתה פרק טו הערה 69 quotes Rav Elyashiv that for Ashkenazim we don’t go out alone even in public places because of כבודו של חתן but ספרדים are lenient.
7. What about the כלה? From the גמרא it is obvious that she too needs שימור so same should apply. מנהג חב"ד (הובא בנישואין כהלכתה פרק טו הערה 73 is that even together they need a third person with them, but most others are מקיל including Rav Elyashiv.
8. On day of the wedding. מכתם בברכות שם says that שמירה is needed to prevent יחוד between the חתן וכלה. רבינו יונה adds that the שטן is מקטרג בשעת הסכנה ובשעת השמחה (probably for different reasons – also referring to the יצר הרע at this time). But there are other things that are an עצה טובה to do for the חתן:
9. What the חתן needs to be doing.
10. מקוה
11. Remembers the ring
12. Encourage him to write to his parents
13. Get him there on time for pictures
14. Let גבאי in shul know that he is a חתן
15. Most won’t say תחנון
16. חיוב for עליה on a leining day
17. Keep him calm – everybody else in his life is on edge.