

# 关于发布中国证券登记结算有限责任公司 《开放式基金通过上海证券交易所场内认 购、申购与赎回登记结算业务实施细则》 与《开放式基金通过深圳证券交易所场内 申购赎回登记结算业务实施细则》的通知

各证券公司、基金管理公司：

中国证券登记结算有限责任公司《开放式基金通过上海  
证券交易所场内认购、申购与赎回登记结算业务实施细则》  
与《开放式基金通过深圳证券交易所场内申购赎回登记结算  
业务实施细则》已经中国证监会核准，现予发布，并自发布  
之日起实施。

附件：1、开放式基金通过上海证券交易所场内认购、申  
购与赎回登记结算业务实施细则

2、开放式基金通过深圳证券交易所场内申购赎回  
登记结算业务实施细则

二〇〇五年七月二十七日

附件：

# 开放式基金通过深圳证券交易所场内申购 赎回登记结算业务实施细则

## 第一章 总则

1.1 为了规范开放式基金的基金份额(以下简称基金份额)通过深圳证券交易所场内申购、赎回(以下简称深交所场内申购、赎回)的登记结算业务,根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、规章和中国证券登记结算有限责任公司(以下简称本公司)有关规定,制订本实施细则。

1.2 本实施细则所称深交所场内申购、赎回,是指证券经营机构接受投资人委托,向深交所交易系统申报的申购、赎回。

1.3 开放式基金(含上市开放式基金)的深交所场内申购、赎回登记结算业务适用本实施细则。本实施细则未规定的,适用本公司其他有关规定。

1.4 本公司可根据本实施细则,制定相关登记结算业务指引和业务流程,规范相关各方的业务关系。

## 第二章 账户管理

2.1 投资人须使用本公司深圳人民币普通股票账户或

证券投资基金账户（以下简称深圳证券账户）办理深交所场内申购、赎回。

2.2 深圳证券账户开立、注销、合并及证券账户资料变更等业务，按照本公司《证券账户管理规则》办理。

2.3 投资人注销深圳证券账户时，应在确认证券账户中没有基金份额和在途基金份额后，方可办理注销业务。

### 第三章 登记托管

3.1 基金管理人在开展深交所场内申购、赎回业务前，应与本公司签订登记结算服务协议。

3.2 对于深交所场内申购、赎回，由本公司深圳分公司证券登记结算系统（以下简称深圳证券登记系统）在投资人深圳证券账户中完成基金份额的变更登记。

3.3 深交所场内认购涉及的基金份额初始登记，以及深圳证券账户中基金份额的非交易过户、司法协助及基金权益分派等业务，按照本公司《上市开放式基金登记结算业务实施细则》办理。

3.4 深交所场内申购、赎回的基金份额变更登记及相关账户资料等数据，统一由本公司开放式基金登记结算系统（以下简称TA系统）发送给基金管理人。

3.5 投资人通过深交所场内证券经营机构办理申购的，其基金份额登记在投资人深圳证券账户内，托管到该场内证券经营机构处。

3.6 托管于某一深交所场内证券经营机构处的基金份额，投资人只能委托该场内证券经营机构申报赎回。

如拟委托其他场内经营机构赎回，投资人须按本公司有关规定办理基金份额系统内转托管；如拟委托场外基金管理人或其代销机构赎回，须按本公司《上市开放式基金登记结算业务实施细则》，办理基金份额跨系统转托管。

3.7 深交所场内证券经营机构有责任保证投资人基金份额托管数据资料的真实、准确、完整，确保投资人基金资产的安全，并负有保密义务。

#### 第四章 深交所场内申购、赎回

##### 4.1 深交所场内申购、赎回处理流程：

（一）T 日，投资人通过证券经营机构向深交所交易系统申报基金申购、赎回申请，申购以金额申报，赎回以份额申报；

（二）T 日日终，深交所将日间全部场内申购、赎回申报数据传送本公司；

（三）T 日日终，本公司依据基金管理人传送的当日基金份额净值，对当日深交所场内及场外申购、赎回数据一并进行处理，生成申购、赎回交易待确认数据传送基金管理人；

（四）T+1 日，本公司根据基金管理人传送的申购、赎回确认数据，进行深交所场内申购、赎回的基金份额登记过

户处理，并生成深交所场内申购、赎回交易回报数据发送相关证券经营机构席位。

4.2 深交所场内申购所得基金份额应为整数份，不足一份基金份额部分的申购资金零头由证券经营机构返还给投资人。

## 第五章 资金结算

5.1 本公司对参与证券交易所场内及场外申购、赎回业务的结算参与者采取统一多边资金净额结算方式，通过其在本公司开立的开放式基金结算备付金账户完成相关资金交收。

5.2 本公司根据相关业务规则的规定，可对证券交易所场内、场外申购、赎回采用其他资金结算方式。

5.3 对于证券经营机构以交易席位上报的深交所场内申购、赎回申报，本公司根据申请当日的交易席位与结算参与人的对应关系，确定申请当日的资金清算路径，以及相关交易席位申购、赎回适用的代理费率。

在清算日和交收日，本公司按申请当日的资金清算路径来进行相关资金的清算和交收。

5.4 深交所场内申购、赎回资金结算流程：

（一）T 日，证券经营机构向深交所申报基金申购、赎回申请；

(二) T+1日, 本公司TA系统对T日交易所(上海和深圳证券交易所)场内及场外申购, 以及T-N+2日(N为基金管理人规定的赎回交收周期,  $N \geq 2$ )赎回申报数据进行合并, 轧差出资金清算净额, 并将相关明细到席位的资金清算结果通知结算参与人;

(三) T+2日, 结算参与人根据资金清算结果, 通过在本公司开立的开放式基金结算备付金账户完成相关资金交收。

对申购业务, T+2日结算参与人向本公司上缴扣除不足一份基金份额部分的申购资金零头之后的实际申购资金。

## 第六章 风险管理

6.1 为了控制资金结算风险, 本公司会同深交所对深交所场内申购、赎回实行参与人资格管理。拟参与深交所场内申购、赎回业务的证券经营机构, 须事先取得相关参与人资格认定。有关参与人资格认定管理办法另行制定。

6.2 申请办理深交所场内申购、赎回业务的证券经营机构必须具备中国证券监督管理委员会认定的基金代销业务资格。

6.3 证券经营机构出现下列情形之一的, 本公司会同深交所可拒绝上述参与人资格申请, 暂停或取消已取得的参与人资格:

- (一) 被相关部门列为高风险证券经营机构的;
- (二) 本公司认定为高风险结算参与人的;
- (三) 交易所和本公司认定的其他情形。

6.4 本公司对券商类结算参与者当日净申购金额实行额度控制。结算参与者当日净申购金额计算方法如下:

$T$  日净申购金额 = ( $T$  日交易所场内及场外申购金额 - 申购代理费) - ( $T-N+2$  日交易所场内及场外赎回金额 - 赎回手续费 + 赎回代理费), 其中  $N$  为基金管理人规定的赎回交收周期, 且  $N \geq 2$ 。

结算参与者净申购金额超过本公司规定额度的, 本公司将于申购申报次一工作日日初通知其超额净申购金额。结算参与者须于申购申报次一工作日 11:30 之前, 向其开放式基金结算备付金户划入相当于超额部分 100% 的担保资金(该部分资金不用于当日资金交收)。未能足额提供担保资金的, 结算参与者应于申购申报次一工作日 11:30 之前向本公司指定无效申购, 否则本公司按申购提交时间顺序, 由后向前, 对相当于超额部分金额的申购申请做无效处理。

本公司对券商类结算参与者单日净申购金额额度暂定为 5000 万元。本公司可根据券商类结算参与者资金交收总体风险情况, 对该额度进行调整, 并向券商类结算参与者公布。

本公司可根据结算参与者风险情况, 相机采取其他结算

担保品管理措施。

6.5 如券商类结算参与者出现资金交收违约，本公司可对其采取以下措施：

（一）对结算参与者发生的违约金额，按中国人民银行及本公司有关规定计收利息和交收违约金。

（二）暂停相关风险结算参与者申购类业务、转托管转出，直至经其申报的赎回累计资金足以抵补其透支金额。

（三）暂停其资金结算资格，由其他结算参与者代为与本公司进行结算或由其与相关基金直接进行资金结算。

（四）对于结算参与人的违约事件在业务不良记录中予以登记，作为评估风险程度、确定重点监控对象的依据。

6.6 如相关券商类结算参与者出现资金交收违约，在向其追讨未果的情况下，本公司将首先动用结算参与者缴存的结算保证金予以弥补，就不足部分，本公司可要求相关基金分摊。分摊原则如下：

根据该结算参与者相关资金清算数据，确定与其存在双边净申购关系的基金，然后从相关基金的结算备付金户中扣减按下列公式计算的金额（无论该基金结算备付金户余额是否为正，都按此执行）：

单只基金扣减金额=失责结算参与者交收透支总金额×  
（该结算参与者对该基金的双边净申购金额/该结算参与者对各相关基金双边净申购总金额）



在进行分摊处理前，基金管理人可委托本公司对指定账户内的基金份额做强制赎回处理。如赎回款足以弥补基金应分摊金额的，本公司不再要求相关基金分摊；如赎回款不足以弥补基金应分摊金额的，本公司就尚未弥补的差额部分继续要求相关基金分摊。

如相关结算参与人日后偿还其部分或全部透支金额，则本公司按下列公式计算的金额，对相关基金进行退还：

单只基金退还金额=失责结算参与人透支偿还金额×  
(该结算参与人对该基金的双边净申购金额/该结算参与人对各相关基金双边净申购总金额)

基金管理人可就已向其分摊且尚未得到偿还的部分，向有关违约券商进行追索。

6.7 如相关基金类结算参与人资金交收出现违约，本公司可对其采取以下措施：

(一) 对结算参与人发生的违约金额，按中国人民银行及本公司有关规定计收利息和交收违约金。

(二) 如连续2个交易日结算备付金账户透支，则本公司将相关情况报告证监会。在必要情况下，本公司可暂停为该基金提供资金结算服务，直至其补足相关透支金额，由此引发的责任由基金管理人承担。

6.8 本公司可对结算参与人业务开展情况进行定期或不定期抽查，并可要求其定期向本公司提供财务报表。

6.9 本公司对结算参与人深交所场内申购与赎回业务申报情况每日进行监控，如出现业务申报异常情况，本公司可要求结算参与人对其业务申报合理性进行说明。

6.10 对证券公司、信托公司、保险公司、基金公司、社会保障类公司和合格境外机构投资者等特殊法人机构资金交收违约，本公司可比照本章券商类结算参与人相关规定处理。

## 第七章 附则

7.1 因地震、台风、水灾、火灾、战争及其他不可抗力因素，以及不可预测或无法控制的系统故障、设备故障、通信故障、停电等突发事件给有关当事人造成损失的，本公司不承担责任。

7.2 本实施细则由本公司负责修订和解释。

7.3 本实施细则自发布之日起施行。