

# 关于为深圳证券交易所实时申购赎回货币市场基金 提供登记结算服务的通知

各基金管理人及结算参与者：

为规范深圳证券交易所（以下简称“深交所”）实时申购赎回货币市场基金（以下简称“货币基金”）的登记、存管、结算及相关业务，明确相关当事人之间的权利义务关系，防范和化解风险，根据中国证券登记结算有限责任公司有关业务规则，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“本公司”）对深交所货币基金的登记结算相关事项通知如下。

一、投资者参与货币基金的认购、申购及赎回业务的，须使用深圳证券 A 股账户和基金账户办理。

二、结算参与者使用其证券交收账户完成货币基金份额的交收，使用其资金交收账户完成货币基金份额的认购、申购及赎回的资金交收。

三、投资者用现金在认购日（以下简称“N 日”）通过深交所认购货币基金份额的，本公司于 N 日进行资金清算，于 N+1 日将认购资金划入资金认购专户，并于 N+1 日向结算参与者下发有效认购记录。结算参与者的资金交收账户余额不足的，本公司根据时间优先原则，对不足部分的认购申报于 N+2 日做无效处理。

四、货币基金募集结束后，本公司根据基金管理人和基金托管人的申请，于认购截止日后的第四个交易日，将实际收到的有效认购资金从认购资金专户划入基金托管人的资金交收账户。

本公司按企业活期存款利率和实际冻结天数计算有效认购资金冻结期间的利息, 在银行按季结息后划入基金托管人的资金交收账户。

五、货币基金募集结束, 不能满足基金设立条件的, 基金管理人承担返还认购资金及利息的责任, 本公司协助基金管理人完成相关资金的退还工作。

六、货币基金募集结束, 基金管理人应当到本公司办理货币基金份额的有关登记手续。本公司根据深交所和基金管理人提供的投资者货币基金有效明细数据办理初始登记。

七、基金管理人应当就货币基金认购、申购及赎回中涉及的登记、存管与结算事宜与本公司签订有关协议, 明确各方的权利义务及具体操作流程。

八、投资者通过托管证券公司申报货币基金份额申购及赎回的, 本公司根据相关数据及本公司组织完成的交收结果, 办理货币基金份额的变更登记。

九、货币基金份额的持有记录查询、非交易过户、持有人名册服务、质押、司法协助等业务参照交易型开放式基金(以下简称“ETF”)同类业务办理。

十、本公司根据基金管理人的委托, 为货币基金的收益分配提供代收代付服务。

十一、本公司根据基金管理人的委托, 为货币基金的申购及赎回提供净额结算服务, 最终交收时点为 T+1 日 16: 00 (T 日为申购赎回日)。

十二、T 日 16: 00, 本公司根据深交所传输的 T 日货币基金份额申购

及赎回数据进行基金份额和资金的清算，清算结果并入 T 日 A 股、基金（不含 ETF）、债券等其他证券交易的资金清算金额，形成当日证券交易的清算净额。本公司将清算结果发送相关结算参与人。

十三、T 日 16:00，本公司根据结算参与人的委托，将其名下投资者证券账户 T 日赎回的货币基金份额从投资者证券账户代为划拨至结算参与人证券交收账户，再统一划拨至本公司证券集中交收账户。

十四、T 日 16:00，本公司完成 T-1 日证券交易、认购的资金交收后，计算结算参与人资金交收账户内剩余可用资金。

如剩余可用资金不小于 T 日证券交易资金清算应付净额，或者 T 日证券交易资金清算金额为净应收的，本公司将相应货币基金份额从本公司证券集中交收账户划拨至该结算参与人的证券交收账户，完成本公司与结算参与人之间不可撤销的证券交收，并代为划拨至相应的证券账户。

如剩余可用资金小于该应付净额的，其差额部分为待交付金额。本公司根据待交付金额确定待交收证券，将其保留在集中交收账户内，并照常办理其他货币基金份额的交收。

十五、T 日 16:00，本公司根据清算结果，对结算参与人 T+1 日的资金交收账户进行簿记处理。

十六、T+1 日 16:00，本公司于完成与结算参与人之间不可撤销的证券及资金交收。

十七、T+1 日 16:00，结算参与人履行资金交收义务的，本公司将集中交收账户中相应待交收证券划拨至该结算参与人证券交收账户，完成与结算参与人之间不可撤销的证券交收，并将上述证券由结算参与人证券交

收账户代为划拨至相应的证券账户。

十八、T+1 日 16: 00, 结算参与者未能足额履行资金交收义务的, 构成结算参与者资金交收违约。本公司在集中交收账户中确定待处分证券, 将其划入专用清偿证券账户, 并照常办理其他基金份额的交收。

十九、结算参与者发生重大资金交收违约的, 本公司可采取以下措施:

(一) 暂停办理该结算参与者货币基金份额申购的结算业务, 并提请深交所于次一交易日起暂停其基金份额申购业务。

(二) 根据违约交收金额每日向结算参与者按与结算银行商定的金融同业活期存款利率收取垫付利息, 并按违约交收金额的千分之一计收违约金。

(三) 第二十一条所述的待处分证券价值不足的, 继续扣划该结算参与者的自营证券, 直至扣划的证券价值足以弥补资金交收违约。

(四) 暂停该结算参与者办理其名下相关证券账户转托管的权限, 并要求其暂停受理相关证券账户的转托管申报。

二十、T+2 日 16: 00 前, 结算参与者补足违约交收金额、利息和违约金的, 本公司将扣划的证券从本公司专用清偿账户划拨至其证券交收账户, 最终划拨至相应的证券账户。

T+2 日 16: 00, 结算参与者仍未补足违约交收金额、利息和违约金的, 本公司可从 T+3 日起开始处分待处分证券及其权益。处置所得用于弥补违约交收金额、利息和违约金。不足部分, 本公司将动用其交收履约保证金、结算互保金等, 仍不足的, 将继续追索; 有剩余的, 本公司划入结算参与者资金交收账户或证券交收账户, 并根据结算参与者申报将剩余证券代为划

拨至相应的证券账户。

二十一、基金管理人对应的结算参与人资金交收违约的，本公司可采取暂停该货币基金申购及赎回等相关措施。

二十二、T+1 日 16:00，结算参与人未能履行证券交收义务的，构成结算参与人证券交收违约。

二十三、结算参与人发生证券交收违约的，本公司暂不交付其相应的应收资金，作为待处分资金转入本公司专用清偿资金账户，并有权采取以下措施：

（一）要求结算参与人及时补购未交付证券；

（二）动用待处分资金代为补购未交付证券。待处分资金不足的，本公司将动用其交收履约保证金、结算互保金等；仍不足的，本公司将继续追索。有剩余的，交付给结算参与人；

（三）按证券交收违约金额的千分之一收取证券交收违约金。

二十四、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。

二十五、上述相关事项如有变动，本公司另行通知。

中国证券登记结算有限责任公司

深圳分公司

二零一三年三月二十日