

关于在深圳证券交易所上市的国债交易型 开放式基金计入回购质押库的通知

(深证会〔2014〕63号)

各会员单位、基金管理人、结算参与机构：

为促进国债交易型开放式基金（以下简称“国债ETF”）市场发展，更好地满足投资者的投资交易需求，深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）决定自2014年7月2日起，将国债ETF计入现有债券质押式回购质押库。现就有关事项通知如下：

一、根据中国结算发布的《质押式回购资格准入标准及标准券折扣系数取值业务指引》，所有标的债券均为深交所上市国债的国债ETF可申报计入回购质押库并进行质押式回购交易。

国债ETF管理人应当按照《质押式回购资格准入标准及标准券折扣系数取值业务指引》等相关规定做好投资管理工作，确保投资标的债券均为深交所上市国债。中国结算可商深交所，取消不符合上述要求的国债ETF回购质押券资格。

二、国债ETF的标准券折算率按照中国结算《标准券折算率（值）管理办法》（2013年修订版）的规定进行计算、发布和管理。

计算公式中的折扣系数按照中国结算《关于调整部分回购质押券折扣系数取值的通知》（中国结算发字〔2014〕24号）的规定取

值。

中国结算对相关业务规则进行修订或对国债 ETF 折扣系数取值进行调整的，按照修订或调整后的内容执行。

三、投资者当日买入或者申购的国债 ETF 份额可申报进入回购质押库；投资者当日申报出库的国债 ETF 份额可以卖出或者赎回。

四、投资者当日申报出库的国债可用于申购国债 ETF，当日赎回国债 ETF 获得的国债可以申报入库。

五、各会员单位、结算参与机构应严格做好客户风险管理，进行相关前端控制，确保客户在库质押券足额，并完成相应资金交收义务。

六、直接拥有或者租用深交所交易单元的机构，在未通过深交所与中国结算组织的测试之前，不得开展国债 ETF 的回购业务。

特此通知

深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司

2014年6月27日