

关于修订《中国结算上海分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》的通知

各市场参与主体：

为支持上海证券交易所债券 ETF 场内申赎模式采用全现金替代，我对《中国结算上海分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》进行了修订，涉及“现金申赎的债券 ETF”、“回购质押品管理”等相关内容。

现予发布，特此通知。

附件：《中国结算上海分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》

二〇一八年四月二十五日

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
交易型开放式基金登记结算业务指南



中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

China Securities Depository & Clearing Corp. Ltd. Shanghai Branch

修订说明

日期	修订内容
2018-4-25	新增现金申赎的债券 ETF 相关内容 修订回购质押品管理相关内容
2015-1-13	修订跨境 ETF 结算，补充融资融券有关收益结转 账户要求
2013-7-1	新增黄金 ETF 相关内容
2013-3-20	新增单市场债券 ETF 相关内容、
2012-4-5	新增跨境、跨市场 ETF 结算、价差保证金管理等
2010-3-17	网上现金认购
2010-3-17	ETF 现金差额结算
2010-3-17	数据接口
2010-3-17	其他：调整部分文字表述

目录

第一章 账户管理	5
一、 证券账户管理.....	5
二、 交收账户管理.....	5
第二章 ETF 份额认购	6
一、 基金认购方式.....	6
二、 现金认购.....	7
三、 网下实物认购.....	9
四、 ETF 发售失败的协助工作.....	12
第三章 登记托管	12
一、 基金管理人发售前的准备工作.....	12
二、 ETF 份额的初始登记.....	13
三、 ETF 份额的变更登记.....	14
四、 ETF 的分红服务.....	15
五、 持有人名册服务.....	18
六、 其他托管业务.....	18
七、 跨市场转托管与单市场债券 ETF 申赎的关系.....	19
第四章 清算交收	19
一、 结算原则.....	19
二、 ETF 份额交易、申购、赎回的清算.....	22
三、 ETF 份额交易、申购、赎回的交收.....	23
第五章 回购质押品管理	32
第六章 风险管理	34
一、 结算资格管理.....	34
二、 证券待交收管理.....	34
三、 结算参与人价差保证金管理.....	35
四、 其他风险管理措施.....	37
第七章 数据说明	38

本指南所称交易型开放式基金（以下简称 ETF），是指经依法募集的，投资特定证券指数所对应组合证券或其他基金合同约定投资标的的开放式基金，其基金份额用组合证券、现金或基金合同约定的其他对价进行申购、赎回，并在上海证券交易所（以下简称“上交所”）上市交易。

本指南适用于 ETF 网上现金发售资金结算，组合证券发售的证券冻结和过户，ETF 份额初始登记和 ETF 份额转换以及 ETF 份额交易、申购、赎回的登记、托管及结算业务。ETF 结算参与人、基金管理人、发行协调人可参照本指南办理相关业务。

第一章 账户管理

一、证券账户管理

投资者须使用在本公司开立的合格 A 股账户和合格基金账户（以下统称为“证券账户”）办理 ETF 份额的认购、交易、申购、赎回。

二、交收账户管理

本公司设立资金及证券集中交收账户，用于与结算参与人的相关证券和资金的交收。

本公司根据结算参与人申请为其开立证券交收账户和资金交收账户（即结算备付金账户），专用证券和资金交收账户。实施分户结算的结算参与人，按自营、经纪业务类别分别设立以上各类交收账户。

本公司作为共同交收对手方，提供多边净额结算服务时，使用证券集中交收账户和资金集中交收账户完成与结算参与人之间的证券和资金的交收；本公司提供逐笔全额结算服务时，使用结算参与者专用证券交收账户和专用资金交收账户完成销售代理人与基金托管人之间的证券和资金交收；本公司提供代收代付服务时，使用开放式基金资金交收账户办理结算参与人与基金管理人之间的资金划付。

此外，本公司以结算系统名义，开立交收担保品证券账户和专用清偿证券账户，分别用于核算和存放结算参与者提交或本公司暂扣的交收担保品、交收透支后的待处分证券。

第二章 ETF 份额认购

一、基金认购方式

基金认购方式可分为网上现金认购、网下现金认购、网下实物认购和网上组合证券认购 4 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上交所网上系统以现金进行的认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。

网下实物认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以组合证券或基金合同约定的其他对价进行的认购。

网上组合证券认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理

机构用上交所网上系统以组合证券进行的认购。网上组合证券认购的具体做法另行规定。

二、现金认购

（一）网上认购资金结算流程

投资者通过结算参与人提交网上现金认购申请，由该结算参与人冻结相应的认购资金。本公司通过结算参与人资金交收账户完成现金认购资金结算，并将实际到位的认购资金划入发行协调人的资金交收账户，发行协调人再将该认购资金划入其预留收款账户。

ETF 发售的具体资金结算流程如下：

1. 认购日（以下简称“N日”）闭市后，本公司根据上交所发送的有效认购数据进行资金清算；

2. N+1日规定的交收时点，在满足当日上交所证券交易资金交收后，结算参与人的资金交收账户资金可用于ETF份额认购资金交收；本公司在当日日终将N日认购资金划至发行协调人资金交收账户，并将相关数据发送结算参与人和基金管理人。

若同期网上现金发行多只证券品种，如发生结算参与人认购资金不到位的情况，结算参与人应在16:00前向本公司书面确认当日未到位认购资金对应的证券品种（附件1），本公司根据结算参与人书面确认情况进行不到位资金分配。如果结算参与人未在16:00前提交附件1，本公司将该结算参与人未到位的认购资金按认购比例分配给同日发行的证券产品。

3. N+2 日 13 点前，本公司将结算参与人认购资金到位情况提供上交所；

4. 发售期内每一认购日均按上述业务流程滚动处理。

5. 认购截止日（以下简称“L 日”）后的第二个交易日（L+2 日）13 点前，本公司将本次发行期间的全部认购资金到位情况提供给上交所。

6. L+3 日，本公司根据上交所按照认购资金到位情况确认的有效认购数据及资金退款数据进行资金清算，并向发行协调人（相关业务的结算单元）汇总扣回前已滚动处理的 N+1 日日终划至发行协调人资金交收账户的 N 日认购资金，并入当日清算净额，同时根据有效认购数据完成网上现金认购 ETF 份额的初始登记，并将相关数据发送结算参与人和基金管理人。

7. L+4 日，发行协调人可将有效认购资金划入基金管理人募集资金账户。

网上现金认购冻结资金利息由发行协调人负责计算并划付给基金管理人。

（二）网下现金认购

网下现金认购的，由基金管理人负责有效认购资金的结算，不通过本公司办理。

（三）现金认购 ETF 份额的确定

发售结束后，网上现金认购的 ETF 份额，由上交所传送给本公司；网下现金认购的 ETF 份额，由基金管理人制作网下现金认购 ETF 份额

清单。

三、网下实物认购

（一）沪市组合证券认购的冻结

网下沪市组合证券认购的，ETF 发售结束日终，参与券商将当日的沪市组合证券认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人根据 ETF 招募说明书的有关规定，初步确认各成份证券的认购数量后，向本公司提交以下材料，申请办理沪市组合证券网下认购的冻结：

1. 认购 ETF 组合证券冻结申请表；
2. 证券冻结清单；
3. 指定联络人身份证原件及复印件；
4. 本公司要求的其他材料。

本公司对上述资料审核后，将投资者账户内相应的证券进行冻结，并将认购冻结数据发送给基金管理人。

本公司在 ETF 初始登记日根据基金管理人报上交所确认的投资者有效认购沪市组合证券数据，解除认购组合证券的冻结，并过户至 ETF 基金管理人沪市证券账户。

（二）上海市场跨市场 ETF 网下认购涉及深市组合证券的过户

上海市场跨市场 ETF 网下组合证券认购涉及深圳市场组合证券过户的，ETF 认购截止日（L 日）的次一工作日 9:00 前，基金管理人向中国结算公司总部（以下简称“公司总部”）申请进行投资者沪深

证券账户的同一性检查，公司总部将检查结果反馈相关基金管理人。

L+1 日，基金管理人向公司总部提交以下材料，申请办理将涉及深圳市场组合证券划转至中国结算公司深圳分公司（以下简称“深圳分公司”）为其开立的证券认购专户：

1. 深市组合证券调入证券认购专户申请表（附件 2），证券调账清单及批量调账电子申报数据（附件 3）；
2. 中国证监会关于基金募集的核准文件；
3. 加盖公章的基金管理人法人营业执照副本复印件；
4. 法定代表人证明书；
5. 指定联络人授权委托书（附件 4）；
6. 指定联络人身份证原件及复印件；
7. 中国结算要求的其他材料。

日间（下午 14:00 前），公司总部将深市投资者组合证券批量调账数据发送给深圳分公司，深圳分公司据此将投资者账户内相应的组合证券划入证券认购专户，对有瑕疵的证券保留在原投资者证券账户，并将批量调账结果发送给公司总部。公司总部根据深圳分公司发送的批量调账结果，打印组合证券批量调账清单交由基金管理人盖章确认。

如果投资者使用应纳税的已解除限售的组合证券认购 ETF，适用按 20% 的比例税率征收个人所得税，深圳分公司在将深市组合证券划入到证券认购专户时，通知结算参与人按照有关规定扣收相关税款。

L+2 日，公司总部根据深圳分公司批量调账结果向基金管理人出具深市证券认购专户组合证券证明。

L+3 日前，基金托管人按照《证券投资基金开立账户须知》到本公司和深圳分公司分别申请开立 ETF 证券账户。

L+3 日，基金管理人到公司总部申请办理上海市场跨市场 ETF 网下认购涉及深圳市场组合证券的过户，申请材料如下：

1. 认购 ETF 深市组合证券过户申请表（附件 5）、认购 ETF 深市组合证券股份过户清单及深市组合证券过户电子申报数据（附件 6）；
2. 中国结算要求的其他材料。

日间（下午 14:00 前），公司总部将上述申请材料传真给深圳分公司，并将深市组合证券批量调账数据发送给深圳分公司，深圳分公司据此将深市组合证券过户至跨市场 ETF 基金管理人深市 ETF 证券账户。处理完毕后深圳分公司将认购组合证券过户结果发送给公司总部。公司总部根据深圳分公司发送的认购组合证券过户结果，打印组合证券股份过户清单交由基金管理人盖章确认。次一工作日，公司总部根据认购组合证券过户结果向基金管理人出具深市股份过户证明。

L+4 日，公司总部根据深圳分公司发送的 ETF 证券账户的持股余额数据，打印 ETF 证券账户的深市持股余额清单。持股余额清单包含 ETF 深市证券账户号、账户名称，以及 ETF 证券账户中证券持有余额（包括证券代码、证券简称和持有余额）。公司总部在持股余额清单上加盖基金业务专用章，提供给会计师事务所作网下证券认购的验资证明。

（三）实物认购份额的确定

ETF 发售结束，基金管理人根据网下实物认购份额情况，制作股票/债券/黄金认购 ETF 份额清单。

（四）实物认购冻结期间的证券权益归属

实物认购如涉及沪市或深市组合证券，认购冻结期间的证券权益归属原则如下：

沪市组合证券认购冻结期间的股票权益包括除息、送股（转增）、配股等，债券权益包括债券兑息等，按照权益与所有权一致的原则，在认购的股票或债券过户前，股票或债券的权益仍属于认购人，因此，本公司不冻结沪市组合证券在认购冻结期间产生的权益，即股票或债券权益自动保留在认购人的证券账户中。

深市组合证券在 ETF 证券认购专户期间，如遇上市公司派发红股或红利，红股红利归基金资产。基金管理人须于 L+4 日向公司总部提交《权益转移申请表》（附件 7），公司总部审核后通知深圳分公司将认购专户中红利转移至基金托管人的结算备付金账户，将红股转移至 ETF 证券账户。

四、ETF 发售失败的协助工作

ETF 发售失败，基金管理人应承担返还认购资金的责任，本公司协助基金管理人将现金认购款退还有关结算参与人；以组合证券认购的，本公司根据基金管理人的申请解除组合证券的冻结。

第三章 登记托管

一、基金管理人发售前的准备工作

（一）与本公司签订证券登记及服务协议

基金管理人在 ETF 份额发售前，须与本公司签订《证券登记及服务协议》及其相关附加协议，本公司根据协议内容向基金管理人提供 ETF 份额登记、投资者名册信息等相关服务。

（二）提供其他相关材料：

1. 指定联络人授权委托书；
2. 加盖公章的基金管理人法人营业执照副本复印件；
3. ETF 专用账户报备表；
4. 中国证监会关于基金募集的核准文件；
5. 基金管理人委托发行协调人办理相关登记业务的，需提供委托书以及相关协议。

二、ETF份额的初始登记

（一）初始登记所需资料

ETF 募集成立后，基金管理人向本公司提交以下材料，申请办理：

1. 证券登记表；
2. 网下现金和组合证券认购 ETF 份额清单；
3. 经具有从事证券业务资格的注册会计师签字的基金募集资金的验资报告；
4. 基金合同；
5. 本公司要求提供的其他材料。

（二）初始登记的办理

本公司对上述资料审核无误后，办理 ETF 份额的初始登记。

1. ETF 份额的初始登记

本公司根据上交所传送的有效认购结果，办理网上现金认购 ETF 份额的初始登记；根据以上提及的认购 ETF 份额清单，通过网下托管方式，对网下现金和实物认购的 ETF 份额进行初始登记。登记业务完成后向基金管理人提供《证券登记证明》。

2. 认购 ETF 份额对应组合证券的变更登记

本公司根据基金管理人提供上交所确认的组合证券认购 ETF 份额的有效数据，对认购冻结的全部证券解除冻结，将与认购份额对应的证券划入 ETF 的证券账户。未被基金管理人或上交所确认为有效认购的证券冻结将被解冻。

3. ETF 联接基金特殊申购份额的登记

ETF 初始份额登记完成之后，上市之前，若申请 ETF 联接基金特殊申购份额的登记，基金管理人需先向上交所提出联接基金特殊申购申请。上交所确认后，基金管理人向本公司提供以下申请材料：

- (1) 证券变更登记表；
- (2) 联接基金网下特殊申购 ETF 份额清单；
- (3) 本公司要求提供的其他材料。

本公司根据基金管理人提供的上述申请材料办理 ETF 联接基金特殊申购的份额登记，并向基金管理人提供《证券变更登记证明》。

三、ETF 份额的变更登记

（一）ETF 份额转换的变更登记

ETF 建仓结束上市交易前，为使 ETF 净值与跟踪的标的指数收盘市值一定的比例基本一致，初始登记的 ETF 份额可作相应转换。基金管理人申请 ETF 份额转换的变更登记，须向本公司提交以下资料：

1. 证券变更登记表；
2. ETF 份额转换清单；
3. 本公司要求提供的其他材料。

本公司根据证券变更登记表内容与 ETF 份额转换清单，完成标准化 ETF 份额的登记，并向基金管理人提供《证券变更登记证明》。

（二）ETF 份额的交易、申购、赎回的变更登记

本公司每日根据上交所成交记录的 ETF 份额清算结果，在结算参与人完成资金交收后，办理其名下投资者 ETF 份额的交易、申购、赎回的变更登记。

（三）其他情况的变更登记

法律法规和本公司业务规则规定的其他情况，如司法扣划及本公司业务规则规定的赠与、继承、财产分割等情况引起的非交易过户。

四、ETF 的分红服务

ETF 权益分派可采取场内现金分红、场外现金分红、收益结转份额等方式。

（一）场内现金分红

本公司可为场内现金分红提供代理发放红利服务。ETF 的代发红

利业务参照封闭式基金的代发红利业务办理（详见本公司《证券登记业务指南》），基金管理人应在委托代理发放现金红利前与本公司签订《代理发放股票、ETF 现金红利协议》。代理发放现金红利流程如下：

1. 基金管理人应在实施权益分派公告日五个交易日前向本公司提交以下材料：

- （1）《委托发放现金红利申请表》；
- （2）基金管理人公告；
- （3）本公司要求提供的其他文件；

2. 本公司在公告日三个交易日前审核申报材料并作出答复。

3. 基金管理人接到本公司核准答复后，应在确定的权益登记日三个交易日前向上交所申请信息披露。当公告内容与本公司核准的权益登记内容不一致时，应及时与本公司联系确认。需修改权益登记内容的，应解除前次申请，重新办理权益登记申请。

本公司根据申报材料在权益登记日完成权益登记，并按当日登记结果计算代发红利金额及相关手续费。

4. 基金管理人根据本公司提供的权益数据及持有人名册对委托代发现金红利款进行确认，并在本公司发送数据下一个交易日闭市前提交《委托发放红利确认表》，并主动与本公司经办人员进行联系，确保在现金红利发放日前的第二个交易日的交收截止时点前将发放款项汇至本公司指定的银行账户。

5. 基金管理人、ETF 托管人不能按时将现金红利款总额汇至本公司指定的银行账户时，应及时通知本公司并在中国证监会指定报刊上

发布公告。

6. 本公司收到相应款项后，在现金红利发放日前的第一个交易日闭市后通过资金结算系统将现金红利款划付给指定的证券公司，投资者可在发放日领取现金红利。未办理指定交易的投资者，其持有的现金红利暂由本公司保管，不计息。一旦投资者办理指定交易，本公司结算系统自动将尚未领取的现金红利划付给指定的证券公司。

（二）场外现金分红

当进行场外现金分红时，基金管理人可通过本公司 PROP 文件交换系统（PROP File Exchange，简称“PFX 系统”），将相关收益明细数据发送至结算参与人的 PROP 信箱（结算参与人也可要求基金管理人通过深圳通系统传输数据），本公司可提供场外现金分红资金代收代付服务。

（三）收益结转份额

当进行收益结转份额时，本公司可根据基金管理人委托，依据基金管理人送达的收益结转基金份额文件办理相应的基金份额变更登记，收益结转份额文件通过 PROP 系统向本公司提供。基金管理人应充分知晓收益结转份额模式的具体处理流程和各项规范要求并承诺在业务开展期间严格按照数据接口规范的要求，于收益结转分配日 12:00 前向本公司提供收益结转文件（多次申报的，以最后一次申报为准），本公司于当日日终办理收益结转基金份额的变更登记。基金管理人应对收益结转数据的真实、准确、完整性负责，若基金管理人提供的数据有误，则由基金管理人承担相应责任。

基金管理人在进行收益结转份额时，涉及投资者将基金份额作为融资融券业务担保品的，应当将收益结转的基金份额计入投资者信用

证券账户中，基金管理人可以通过 PROP 系统查询融资融券和转融通担保账户明细数据。具体查询方式详见我公司《中国结算上海分公司证券发行人业务指南》。

（四）特别说明

目前，对于单市场股票 ETF、单市场债券 ETF、跨市场股票 ETF、跨境股票 ETF、黄金 ETF 均适用场内分红方式。

货币 ETF 根据申赎价格波动情况，可分为申赎价格恒定和申赎价格变动两种类型。

其中，对于申赎价格恒定的货币 ETF，可采用场外现金分红和收益结转份额两种模式相结合的方式。对于申赎价格变动的货币 ETF，可采用场内现金分红方式。

五、持有人名册服务

本公司于每日上交所闭市后，通过参与人远程操作平台（PROP）向基金管理人发送当日登记在册的 ETF 全体持有人名册，数据内容包括：投资者账号、投资者名称（全称）、投资者简称、通讯地址、邮政编码、性别、投资人类别、国籍代码、联系电话、指定交易单元号、指定券商简称、证券代码、持有数量。

六、其他托管业务

当 ETF 认购期间发生认购冻结的证券被司法冻结或扣划的，如协助人为指定交易证券公司，证券公司应于当日向本公司书面传真认购证券冻结的解冻申请和相关司法文书，本公司审核通过的，由本公司

解除认购证券冻结，再由证券公司通过 PROP 系统申报司法冻结；如协助人为本公司，本公司根据司法文书解除认购证券冻结，并协助司法冻结。本公司当日将解冻数据发送证券公司和基金管理人，基金管理人根据本公司发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

ETF 份额的持有记录查询、非交易过户、司法协助等业务参照《中国结算上海分公司参与人证券托管业务指南》、《中国结算上海分公司营业大厅业务指南》办理。

七、跨市场转托管与单市场债券ETF申赎的关系

跨市场发行上市的债券（包括国债、地方政府债、企业债等）可以在本公司与中国结算深圳分公司之间、本公司与中央国债公司之间、本公司与银行柜台市场之间办理市场间转托管。有关债券跨市场转托管业务按照《中国结算上海分公司参与人证券托管业务指南》中相关规定办理。

债券通过转托管成功转入场内后，投资者可用于申购单市场债券 ETF；基金管理人可用于应对单市场债券 ETF 的赎回。

第四章 清算交收

一、 结算原则

（一）ETF 二级市场交易的清算交收原则

ETF 二级市场交易由本公司作为共同对手方，按照货银对付的原则，提供多边净额结算服务（以下简称“净额结算服务”）。

（二）ETF 申购赎回的清算交收原则

1. 单市场ETF(包括单市场股票ETF、单市场债券ETF(不包括现金申赎的债券ETF))申购赎回的清算交收

对于投资标的为沪市组合证券的单市场 ETF，其申购、赎回涉及的组合证券及其现金替代，本公司提供净额结算服务；对申购赎回涉及的现金差额、现金替代退补款，本公司提供代收代付服务。

2. 跨市场 ETF 申购赎回的清算交收

对于投资标的涉及沪深市场组合证券的跨市场 ETF，其申购、赎回涉及的沪市组合证券及其现金替代，以及申购当日卖出的跨市场 ETF 申购涉及的深市组合证券的现金替代，本公司提供净额结算服务。

对于申购当日未卖出的跨市场 ETF 申购涉及的深市组合证券的现金替代，本公司提供逐笔全额结算服务；对于跨市场 ETF 赎回涉及的深市组合证券的现金替代，以及跨市场 ETF 申购赎回涉及的现金差额、现金替代退补款，本公司提供代收代付服务。

对于赎回的跨市场 ETF 份额，本公司在申报赎回当日日终根据上交所传输的有效数据办理赎回份额的注销。

3. 跨境 ETF 申购赎回的清算交收

对于跨境 ETF 申购涉及的非沪市（境外）组合证券的现金替代，本公司提供逐笔全额结算服务（T+0 或 T+1 日日终）；对于跨境 ETF 赎回涉及的非沪市组合证券的现金替代，以及跨境 ETF 申购赎回的现

金差额、现金替代退补款，本公司提供代收代付服务。

对于赎回的跨境 ETF 份额，本公司结合上交所传输的有效数据以及申报赎回证券账户中可用的跨境 ETF 数量办理赎回份额的注销。对于采用 T 日日终全额逐笔结算的跨境 ETF，注销时点为申报赎回日当日日终；对于采用 T+1 日全额逐笔结算的跨境 ETF，注销时点为申报赎回的次一交易日日终。

4. 货币 ETF 申购赎回的清算交收

对于货币 ETF，本公司比照跨境 ETF 结算模式，提供相关结算服务。

其中，对货币 ETF 申购所涉及的现金替代，本公司提供逐笔全额结算服务；对于货币 ETF 赎回涉及的现金替代，以及货币 ETF 申购赎回可能涉及的现金差额、现金替代退补款，基金管理人可通银行转账划入结算参与者指定账户或使用本公司提供的代收代付服务，结算参与者应及时将相关代收付款项划至投资者账户。对于申赎价格恒定的货币 ETF，相关代收付款项涉及的明细数据由基金管理人向相关结算参与者提供。

对于赎回的货币 ETF 份额，本公司结合上交所传输的有效数据以及申报赎回证券账户中可用的货币 ETF 数量在申报赎回的次一交易日日终办理赎回份额的注销。

5. 黄金 ETF 申购赎回的清算交收

黄金 ETF 申购赎回分为现金申购赎回和实物申购赎回。

(1) 黄金 ETF 现金申购赎回

对于黄金 ETF 现金申购所涉及的现金替代，本公司提供 T+0 逐笔全额结算服务；对于黄金 ETF 赎回涉及的现金替代，以及现金申购赎回涉及的现金差额、现金替代退补款，本公司提供代收代付服务。

对于现金赎回的黄金 ETF 份额，本公司结合上交所传输的有效数据以及申报赎回证券账户中可用的黄金 ETF 数量在申报赎回的当日日终办理赎回份额的注销。

（2）黄金 ETF 实物申购赎回

对于黄金 ETF 实物申购赎回，本公司根据上交所传输的黄金 ETF 实物申购赎回有效数据对 ETF 份额进行变更登记。

6. 现金申赎的债券 ETF 申购赎回时的清算交收

对于现金申赎的债券 ETF，其申购涉及的现金替代，本公司提供逐笔全额结算服务（T+0 日日终）；对赎回涉及的现金替代以及申购赎回中涉及的现金差额、现金替代退补款，本公司提供代收代付服务。

对于当日赎回的 ETF 份额，本公司将结合上交所传输的有效数据以及申报赎回证券账户中可用的现金申赎的债券 ETF 的数量在申报赎回的当日日终办理赎回份额的注销。

二、ETF 份额交易、申购、赎回的清算

ETF 份额交易、申购、赎回涉及的清算事项主要有：ETF 份额、组合证券、现金替代。T 日（交易日）日终，本公司对上交所有效传输的 ETF 份额交易、申购、赎回数据进行清分，分别进行净额结算、逐笔全额结算或代收代付的明细清算；对于提供净额结算的 ETF 交易、

申购、赎回数据，本公司在 T 日日终将清算结果并入 T 日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和基金管理人。

T+1 日，本公司根据 ETF 基金管理公司申报的 T 日现金差额数据，完成 T 日 ETF 申购赎回对应的现金差额清算，并将相关数据通过结算明细等数据文件发送相关基金管理公司和销售代理人，相关数据不并入当日资金清算净额。各 ETF 基金管理公司和销售代理人可使用本公司 PROP 系统中的“ETF 申赎资金代收代付”功能模块、通过开放式基金结算账户办理 ETF 现金差额资金划付业务。

三、ETF 份额交易、申购、赎回的交收

（一）净额交收

1. 资金交收

T 日本公司完成 T-1 日所有证券交易、有效认购的资金交收后，进行 T+0 资金预交收。结算参与人的资金交收账户内可用资金小于当日清算应付净额的，或当日清算应收净额不足抵补历史透支的，该参与人 T+0 预交收资金不足，其差额为待交付金额，必须在 T+1 日交收截止时点前补入其资金交收账户内。

T+1 日交收截止时点本公司进行资金交收，将结算参与人应付净额由其资金交收账户划拨至本公司资金集中交收账户，在结算参与人已完成证券交收义务的前提下，将应收净额由资金集中交收账户划入其资金交收账户。

2. ETF 份额和组合证券交收

本公司根据 ETF 份额交易、申购、赎回的清算结果，按照货银对付的原则，将处于交收状态的 ETF 份额和组合证券在结算参与者证券交收账户和证券集中交收账户之间进行划拨。

(1) 证券集中交收账户的证券划入

T 日日终，本公司按照结算参与者委托，将以下证券从投资者证券账户划拨至结算参与者证券交收账户，再统一划拨至证券集中交收账户：

1) 结算参与人名下证券账户 T 日卖出的 ETF 份额、T 日赎回所用的沪市单市场 ETF 份额，申购所用的组合证券；

2) 由于 T 日赎回需从基金管理人 ETF 证券账户付出的组合证券。

(2) 证券集中交收账户的证券划出

T 日本公司完成 T-1 日交易的资金交收后，结算参与者资金交收账户内日终可用资金不小于 T 日所有证券交易的资金清算后的应付净额，或者 T 日所有证券交易的资金清算后为净应收的，本公司将以下证券从证券集中交收账户划拨至结算参与者证券交收账户，完成与结算参与人间不可撤销的证券交收，并将上述证券按照结算参与者委托由结算参与者证券交收账户最终划拨至相应的投资者证券账户：

1) 结算参与人名下证券账户 T 日买入的 ETF 份额和申购并纳入净额结算的 ETF 份额，赎回的组合证券；

2) 由于 T 日申购而需转入基金管理人 ETF 证券账户的组合证券。

T 日日终本公司完成 T-1 日所有证券交易、有效认购的资金交收

后，结算参与人的资金交收账户内剩余可用资金小于 T 日所有证券交易的资金清算后的应付净额，本公司结合其待处分证券价值和质押式融资回购净应付款情况，对结算参与人自营证券账户或其名下投资者证券账户 T 日通过交易系统买入、申购纳入净额结算的 ETF 份额、买入 ETF 份额后赎回组合证券（基金托管人所托管 ETF 的证券账户 T 日净买入组合证券）实施待交收措施。

T+1 日结算参与人履行资金交收义务的，本公司将相应待交收证券及其产生的权益划拨至该结算参与人证券交收账户，最终划拨至相应的证券账户。T+1 日，若结算参与人资金交收违约，本公司根据一定规则确定待处分证券，本公司对待处分证券及其权益依法拥有处置权。证券待交收的具体内容见第五章。

（3）ETF 总份额增减的处理

ETF 总份额随申购、赎回而变动，T 日本公司将当日纳入净额结算的净申购或净赎回 ETF 份额计入证券集中交收账户。

（二）逐笔全额交收

1. 跨市场 ETF 申购的逐笔全额交收

T+1 日 14 点，本公司根据 T 日跨市场 ETF 申购的逐笔全额清算数据，按照 T 日申报的先后顺序，逐笔检查该时点应付资金结算参与人专用资金交收账户中资金是否足额。结算参与人应付资金足额的，本公司将相应资金从应付资金结算参与人专用资金交收账户划出，并划付至应收资金结算参与人（基金托管人）专用资金交收账户；同时，本公司记增 ETF 总份额，并划拨至结算参与人名下的相应证券账户。

本公司在办理申购资金足额检查时的最小单位是单笔申购应付的资金金额，结算参与者应付资金不足的，相应的申购交收失败，不办理部分交收。应付资金足额是指结算参与者专用资金交收账户处理时点的可用余额不低于相应申购清算的应付金额。专用资金交收账户涉及司法冻结的，冻结金额不计入可用余额。

跨市场 ETF 申购交收失败的，基金管理人可与相关结算参与者协商补记基金份额或返还相应组合证券。基金管理人与结算参与者协商一致并在申购交收失败次一交易日起的 5 个交易日内向本公司提出共同申请的，本公司可根据其申请协助办理基金份额补记或返还组合证券事宜；超出该期限后，本公司只接受返还组合证券的申请。

2. 现金申赎的债券 ETF 的申购、跨境 ETF 申购和货币 ETF 申购的逐笔全额交收

本公司根据基金产品方案为现金申赎的债券 ETF 涉及的申购提供 T+0 逐笔全额交收服务，为跨境 ETF 申购提供 T+0 逐笔全额交收或 T+1 逐笔全额交收服务，为货币 ETF 提供 T+1 逐笔全额交收服务。

T 日 16 点（对于采取 T+0 逐笔全额交收模式的跨境 ETF 和现金申赎的债券 ETF）或 T+1 日 16 点（对于采取 T+1 逐笔全额交收模式的跨境 ETF 和货币 ETF），本公司根据 T 日现金申赎的债券 ETF、跨境 ETF 以及货币 ETF 申购所涉及的逐笔全额清算数据，按照 T 日申报的先后顺序，逐笔检查该时点应付资金结算参与者专用资金交收账户中资金是否足额。结算参与者应付资金足额的，本公司将相应资金从应付资金结算参与者专用资金交收账户划出，并划付至应收资金结算参

与人（基金托管人）专用资金交收账户；同时，本公司记增现金申赎的债券 ETF、跨境 ETF 和货币 ETF 的总份额，并划拨至结算参与人名下的相应证券账户。

本公司办理申购资金是否足额的判断条件同跨市场 ETF 申购业务。如果结算参与者办理了资金交收账户与专用资金交收账户的关联交收业务，资金交收账户内完成当日资金交收及预交收之后的多余资金可用于现金申赎的债券 ETF 的申购、跨境 ETF 的申购和货币 ETF 的申购所涉及的逐笔全额交收。

3. 黄金 ETF 现金申购的逐笔全额交收

T 日 16 点，本公司根据 T 日黄金 ETF 现金申购的逐笔全额清算数据，按照 T 日申报的先后顺序，逐笔检查该时点应付资金结算参与者专用资金交收账户中资金是否足额。结算参与者应付资金足额的，本公司将相应资金从应付资金结算参与者专用资金交收账户划出，并划付至应收资金结算参与者（基金托管人）专用资金交收账户；同时，本公司记增黄金 ETF 总份额，并划拨至结算参与人名下的相应证券账户。

黄金 ETF 现金申购的交收批次与跨境 ETF 申购、货币 ETF 申购相同。其中，在同一交收批次中，先完成跨境 ETF 申购和货币 ETF 申购交收，再完成黄金 ETF 现金申购的交收。

本公司办理申购资金是否足额的判断条件同跨境 ETF 申购业务。如果结算参与者办理了资金交收账户与专用资金交收账户的关联交收业务，资金交收账户内完成当日资金交收及预交收之后的多余资金

可用于黄金 ETF 现金申购的逐笔全额交收。

（三）代收代付

本公司通过基金管理人及结算参与人的相关资金交收账户办理资金的代收代付。基金管理人及结算参与人已开立开放式基金资金交收账户的，可直接使用该账户进行资金划付。

基金管理人负责向本公司发送资金结算指令，应基金管理人要求，本公司可代为转发相关结算参与者结算明细数据。基金管理人或结算参与者对于核对无误的资金结算指令向本公司发出确认，完成资金划付。

因资金不足导致的资金划付失败，由相关责任方协商解决后续处理事宜，本公司不承担相关法律责任。

（四）案例

1. 跨市场 ETF 申购、赎回的清算交收

T 日，X 结算参与者跨市场 ETF 部分申购和成交明细如下：

10: 00am	A 账户卖出跨市场 ETF 份额 250 万份
1: 30pm	A 账户申购跨市场 ETF 份额 100 万份
1: 45pm	A 账户申购跨市场 ETF 份额 300 万份
2: 10pm	A 账户申购跨市场 ETF 份额 100 万份
2: 30pm	B 账户赎回跨市场 ETF 份额 200 万份

当日交收前 A 账户下跨市场 ETF 份额为 300 万份，初始沪市组合证券甲股票 300 万元，B 账户下跨市场 ETF 份额为 300 万份。跨市场 ETF 最小申赎单位为 100 万份，每 100 万份中非沪市现金替代 40 万元，沪市现金替代为 10 万元、沪市甲股票 50 万元。卖出 250 万份跨

市场 ETF 净应收 250 万元。

(1) 当日 A 账户下申购且卖出的跨市场 ETF 申购份额为 250 万份,记增相应份额;当日 B 账户下赎回的跨市场 ETF 份额为 200 万份,注销相应份额。

X 结算参与人对应的纳入净额结算的跨市场 ETF 申购非沪市现金替代金额= $250 \times 40/100=100$ 万元;所有申购份额对应的沪市现金替代纳入净额结算,应付金额= $500 \times 10/100=50$ 万元;所有赎回份额对应的沪市现金替代纳入净额结算,应收金额= $200 \times 10/100=20$ 万元。

当日 T-1 日交收完成后, T 日除跨市场 ETF 交易外, X 结算参与人其他纳入净额结算净应付金额为 200 万元,则该日清算纳入净额结算的净应付金额总计为 200 万元(其他净应付)-250 万元(跨市场 ETF 卖出净应收)+100 万元(纳入净额结算的跨市场 ETF 非沪市现金替代)+50 万元(跨市场 ETF 申购沪市现金替代)-20 万元(跨市场 ETF 赎回沪市现金替代)=80 万元。

当日交收后, A 账户跨市场 ETF 份额=300 万份(初始余额)-250 万份(卖出)+250 万份(纳入净额的跨市场 ETF 份额)=300 万份,但 A 账户申购所需的甲股票 $500 \times 50/100=250$ 万元都被过户到基金账户, A 账户的甲股票余额为 50 万元。

当日交收后, B 账户跨市场 ETF 份额=300 万份(初始余额)-200 万份(赎回注销)=100 万份,同时增加赎回得到的甲股票余额 100 万元(假定该结算参与人当日日终结算备付金账户余额超过 80 万元,如果不到 80 万元,则有可能出现部分赎回得到的甲股票被待交收的

情况)。

对于跨市场 ETF 赎回的非沪市现金替代，结算公司提供参考清算服务（本案例中为参与者应收 80 万元），其实际金额和交收时点以基金管理人计算的为准。

(2) 当日 A 账户下申购未卖出的跨市场份额为 250 万份对应的非沪市现金替代，纳入 T+1 日逐笔全额交收。

T+1 日逐笔全额交收前，X 结算参与者专用资金交收账户可用余额为 50 万。根据逐笔全额交收的规则，每笔交收结果如下：

1) T 日 1:45pm A 账户申购的跨市场 ETF 份额中的 150 万份对应的非沪市现金替代纳入逐笔全额结算应付金额 60 万元，交收失败；

2) T 日 2:10pm A 账户申购的跨市场 ETF 份额 100 万份对应的非沪市现金替代应付金额 40 万元，交收成功。

A 账户交收完毕后跨市场 ETF 份额为 400 万份（假定 A 账户 T+1 日无新发生交易），专用资金交收账户可用余额为 10 万元。

由于 150 万份跨市场 ETF 申购涉及的甲股票已于 T 日完成过户，基金管理人可与 X 结算参与者协商采用补登记 ETF 份额还是返还组合证券来进行后续处理。

2. 跨境 ETF 申购、赎回的清算交收

T 日，Y 结算参与者跨境 ETF 部分申购和成交明细如下：

1:30pm	C 账户申购跨境 ETF 份额 100 万份
1:45pm	C 账户申购跨境 ETF 份额 300 万份
2:10pm	C 账户申购跨境 ETF 份额 100 万份
2:45pm	D 账户赎回跨境 ETF 份额 100 万份

跨境 ETF 最小申赎单位为 100 万份，每 100 万份中非沪市现金替代 100 万元。T+1 日逐笔全额交收前 C 账户下跨境 ETF 份额为 200 万份，D 账户跨境 ETF 份额为 300 万份。Y 结算参与人专用资金交收账户可用余额为 300 万元。

T+1 日，根据逐笔全额交收的规则，每笔交收结果如下：

(1) T 日 1:30pm C 账户申购的跨境 ETF 份额 100 万份对应的非沪市现金替代应付金额 100 万元，交收成功；

(2) T 日 1:45pm C 账户申购的跨境 ETF 份额 300 万份对应的非沪市现金替代应付金额 300 万元，交收失败；

(3) T 日 2:10pm C 账户申购的跨境 ETF 份额 100 万份对应的非沪市现金替代应付金额 100 万元，交收成功；

(4) T 日 2:45pm D 账户赎回的跨境 ETF 份额 100 万份，注销份额 100 万份，交收成功；

跨境 ETF 申购、赎回交收完毕后，C 账户跨境 ETF 份额为 400 万份，D 账户跨境 ETF 份额为 200 万份。Y 结算参与人专用资金交收账户可用余额=300 万元（初始余额）-200 万元（申购的非沪市现金替代）=100 万元。

对于跨境 ETF 赎回的非沪市现金替代，结算公司提供参考清算服务（本案例中为参与人应收 100 万元），其实际金额和交收时点以基金管理人计算的为准。

第五章 回购质押品管理

单市场国债ETF（简称“国债ETF”）可计入现有债券质押式回购质押库，参与质押式回购交易。其中，国债ETF指跟踪沪市国债指数的ETF，或虽然跟踪跨市场指数但基金通过抽样复制技术选取的申赎组合证券仅包含上交所上市交易国债的ETF。

国债ETF计入现有债券质押式回购质押库后，标准券仍按证券账户进行核算，回购质押品出入库申报和欠库主要处理原则保持不变。由于国债ETF与债券等原回购质押品产品特性不同，涉及新增或调整的业务内容具体如下：

一、国债ETF的质押式回购业务准入资格

符合下列条件的国债ETF可申报计入现有债券质押式回购质押库并进行质押式回购交易：

- （一）国债ETF的净资产规模不低于5亿元人民币；
- （二）有两个及以上证券公司按照《上海证券交易所交易型开放式指数基金流动性服务业务指引》的要求为其提供流动性服务。

相关国债ETF不再符合上述条件的，本公司可商上交所停止其回购质押券资格。

二、折算值管理和标准券核算

折算率管理和标准券核算相关内容参见《标准券折算率（值）管理办法》《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》

(www.chinaclear.cn→法律规则→业务规则→债券业务)、《结算账户管理及资金结算业务指南》-第三篇 结算风险管理-第二章 回购业务的风险防范 (www.chinaclear.cn→法律规则→业务规则→清算与交收→上海市场)。

三、国债ETF出入库申报处理

投资者申报入库的国债ETF 的单位为份;申报数量为100 份或其整数倍,单笔申报最大数量不超过10 万份。

投资者当日买入或者申购后由上交所交易系统确认记增的国债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。

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。

已进入回购质押库的国债ETF 份额,不得卖出和赎回。

直接拥有或者租用上交所交易业务单元的机构,在未通过上交所与本公司组织的测试之前,不得开展国债ETF 的回购业务。

四、质押国债ETF的现金分红

库内质押国债ETF现金分红时,结算系统根据质押国债ETF原出质账户按照现有方式进行现金红利发放。

在国债ETF现金分红清算日,对于库内质押国债ETF的现金分红,结算系统按原出质账户生成明细现金红利权,现金红利划拨方式与库

外国债ETF的现金红利发放方式一致。

第六章 风险管理

一、结算资格管理

(一) 本公司根据相关业务规则关于结算参与者资格和条件的规定，对结算参与者申购、赎回结算业务实施风险控制，仅与符合本公司风险控制要求的结算参与者直接完成申购、赎回结算；不符合本公司风险控制要求的结算参与者，必须选择符合本公司风险控制要求的结算参与者代理其申购、赎回的结算业务。

(二) 上交所将拟成为基金代办证券公司的名单知会本公司，本公司将其中有资格成为申购、赎回结算参与人的代办证券公司的情况反馈上交所。

(三) 本公司可对结算参与者业务开展情况进行定期审核或不定期抽查，并可以要求其定期向本公司报送财务报表，对不再符合本公司风险控制要求的结算参与者，可暂停或终止与其直接进行结算业务。

二、证券待交收管理

待交收相关业务处理原则参见《结算账户管理及资金结算业务指南》-第三篇 结算风险管理-第一章 现券结算的风险防范-第一节 本金风险及其防范（www.chinaclear.cn → 法律规则 → 业务规则 → 清算与交收 → 上海市场）。

三、结算参与人价差保证金管理

结算参与人（跨市场 ETF 代办券商）应根据向上交所提交申请的跨市场 ETF 净申购额度（注：“跨市场 ETF 净申购额度”为该代办券商下所有证券账户跨市场 ETF 申购未卖出份额所涉及的深市现金替代额度），按规定的价差保证金比例向本公司缴纳跨市场 ETF 价差保证金，本公司每个交易日日终将下一交易日代办券商的价差保证金可用余额发送上交所，上交所根据价差保证金可用余额和价差保证金比例对代办券商申购未卖出的跨市场 ETF 额度进行管理。

$T+1$ 日价差保证金可用余额 = $\text{Min}(\text{价差保证金余额} - T \text{ 日申购未卖出跨市场 ETF 份额所涉及的深市现金替代金额} \times \text{价差保证金比例}, \text{跨市场 ETF 申报净申购额度} \times \text{价差保证金比例})$

如果代办券商已开立交收价差保证金账户，该账户可用于存放 ETF 申购赎回价差保证金。本公司结合价差保证金留足与当日申购未卖出部分跨市场 ETF 份额所涉及的深市现金替代和下一交易日跨市场 ETF 申报净申购额度对应价值相当的保证金余额确定下一交易日价差保证金可划出金额，并日终发送代办券商。代办券商可在价差保证金可划出金额范围内申报办理资金划付。

$T+1$ 日价差保证金可划出金额 = $\text{Max}[\text{价差保证金余额} - (T \text{ 日申购未卖出跨市场 ETF 份额所涉及的深市现金替代金额} + \text{跨市场 ETF 申报净申购额度}) \times \text{价差保证金比例}, 0]$

基金管理人 T 日根据上交所传输的申购指令实时买入深圳市场

组合证券时，如果代办券商 T+1 日逐笔全额交收违约，基金管理人卖出深圳市场组合证券有价差损失的，可以向本公司申请动用该价差保证金弥补价差损失。此种情形下，本公司将根据基金管理人的要求办理价差保证金的划付。

案例：跨市场 ETF 代办券商 ETF 价差保证金管理

假设 T 日跨市场 ETF 某代办券商 A，其自营价差保证金账户余额为 400 万元，其向上交所申报的自营业务跨市场 ETF 净申购额度为 1,000 万元。该参与人当日自营业务申购未卖出的跨市场 ETF 所涉及的深市现金替代金额为 900 万元。假设跨市场 ETF 价差保证金比例为 20%。

T+1 日该参与人自营价差保证金可用余额 = $\text{Min}(\text{自营价差保证金余额} - \text{T 日自营业务申购未卖出跨市场 ETF 份额所涉及的深市现金替代金额} \times \text{价差保证金比例}, \text{跨市场 ETF 申报自营业务净申购额度} \times \text{价差保证金比例}) = \text{Min}(400 - 900 \times 20\%, 1000 \times 20\%) = 200$ 万元。

该参与人 T+1 日自营业务的净申购额度 = $200 / 20\% = 1000$ 万元。

T+1 日结算参与人自营价差保证金账户可划出金额 = $\text{Max}[\text{自营价差保证金余额} - (\text{T 日自营业务申购未卖出跨市场 ETF 份额所涉及的深市现金替代金额} + \text{跨市场 ETF 申报自营业务净申购额度}) \times \text{价差保证金比例}, 0] = \text{Max}[400 - (900 + 1000) \times 20\%, 0] = 20$ 万元。

接上例，假设该参与人最新向本公司申报自营业务跨市场 ETF 净申购额度为 1,200 万元，其他条件不变。T+1 日价差保证金可用余额 = $\text{Min}(\text{自营价差保证金余额} - \text{T 日自营业务申购未卖出跨市场 ETF 份$

额所涉及的深市现金替代金额 × 价差保证金比例，跨市场 ETF 申报自营业务净申购额度 × 价差保证金比例) = $\text{Min}(400-900 \times 20\%, 1200 \times 20\%) = 220$ 万元。

该参与人 T+1 日的净申购额度 = $220/20\% = 1100$ 万元。

T+1 日结算参与人价差保证金账户可划出金额 = $\text{Max}[\text{自营价差保证金余额} - (\text{T 日自营业务申购未卖出跨市场 ETF 份额所涉及的深市现金替代金额} + \text{跨市场 ETF 申报自营业务净申购额度}) \times \text{价差保证金比例}, 0] = \text{Max}[400 - (900 + 1200) \times 20\%, 0] = 0$ 万元。

四、其他风险管理措施

(一) 依据风险共担的原则，结算参与人应当按本公司规定缴纳结算保证金和最低结算备付金。

(二) 结算参与人结算保证金账户的日末余额不得低于本公司核定的结算保证金应缴纳额度。结算保证金应缴纳额度的计算公式及其调整按照本公司规定执行。

结算参与人资金交收账户的日末余额不得低于本公司核定的最低结算备付金限额。最低结算备付金缴存比例及其调整按照本公司规定执行。

(三) 对结算参与人(代办券商)当日净买入跨市场 ETF 并于当日净赎回的，如果代办券商交收透支，本公司将要求基金管理人协助将该违约结算参与人赎回上述跨市场 ETF 所得的深市现金替代资金划付到结算参与人资金交收账户，优先用于弥补买入跨市场 ETF 的交收透支。

(四) T日本公司提请上交所对有待交收证券的结算参与人名下相关证券账户限制转指定。

(五) 结算参与者出现资金交收违约的, 本公司根据其违约金额, 按中国人民银行及本公司有关规定计收利息及交收违约金, 并提请证券上交所暂停该结算参与者申购、赎回业务资格。

第七章 数据说明

关于单市场 ETF、跨市场 ETF、跨境 ETF、货币 ETF、现金申赎的债券 ETF 以及黄金 ETF 的业务数据说明请详见我公司《登记结算数据接口规范(结算参与者版)》中的相关描述。该接口文档可从我公司网站 www.chinaclear.cn 或从 PROP 系统公告板-->“技术资料”中下载。

附件 1、申购（认购）资金不到位情况确认表

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司：

现就 x 月 x 日申购（认购）资金不到位情况确认如下：

认购日（T 日）：

认购资金交收日（T+1 日）：

序号	申购（认购）资金代码	申购（认购）简称	申购（认购）资金总量	未到位资金金额
1				
2				
3				

注：如有新股等其它证券品种与 ETF 同日发行，所填信息须包含新股其它证券品种，此表须于 T+1 日 16:00 前提交。

xx 公司

X 年 x 月 x 日

附件 3、深市批量调账电子申报数据接口

深市 ETF 网下实物股票认购委托（文件名：TZQDK.dbf）

字段名称	类型	长度	备注
TZWTCGD	C	10	申请认购股东的证券账户， 必填字段
TZWTRGD	C	10	ETF 发行认购专户
TZWTCXW	C	6	申请认购的股东的托管单元
TZWTRXW	C	6	专用席位“XXXXXX”
TZWZQDH	C	6	申请认购的成分股证券代号
TZWGFXZ	C	2	流通股“00”
TZWTZGS	N	12,0	申请认购的成分股股数
TZWxcbz	C	1	下传标志，N=不下传结算数据
TZWclbz	C	1	处理标志，填入空格

该接口由基金管理公司提供。用于 ETF 的网下实物认购。

附件 4、指定联络人授权委托书

指定联络人授权委托书

中国证券登记结算有限责任公司：

兹委派我公司基金事务代表_____为我公司与贵公司之间的指定联络人，请贵公司接受该指定联络人代表我公司办理有关_____基金网下认购组合证券业务过户登记及其他相关事宜。如因此产生任何纠纷，由我公司承担一切法律责任，与贵公司无关。

有关指定联络人具体情况如下：

基金全称			
基金简称		证券代码	
基金事务代表姓名			
身份证号码			
联系电话			
手机号码			
通讯地址			
邮政编码			
传真号码			
电子邮箱			
备 注			

法定代表人签章：

_____ 基金管理公司(公章)

年 月 日

附件 5、认购 ETF 深市组合证券过户申请表

认购 ETF 深市组合证券过户申请表

中国证券登记结算有限责任公司：

_____（以下简称本公司）XX 基金已于 年 月 日发行结束，并于 年 月 日宣布成立，现申请将认购人用于网下认购 ETF 份额的深市组合证券共计 户 股自证券认购专户（账户名称：账户号码：_____）转移到深市 ETF 证券账户（账户名称：_____ 账户号码：_____）。

本公司保证所提供的证券过户数据和有关资料（详见附件）完整、真实、准确、合法，并符合贵公司的要求。

本公司法定代表人_____授权本公司_____至贵公司办理认购证券的过户申请事宜，包括其对本公司提供的证券过户数据打印书面清单进行确认。

附件：组合证券过户清单

基金管理公司（盖章）

法定代表人（签章）

或指定联络人（签章）

联系电话/传真

_____年 ____ 月 ____日

（以下由中国结算公司填写）

接单人：

复核人：

附件 6、深市组合证券过户电子申报数据接口

深市组合证券过户委托 (TZQDK.dbf)

字段名称	类型	长度	备注
TZWTCGD	C	10	ETF 发行认购专户
TZWTRGD	C	10	ETF 基金专户, 必填字段
TZWTCXW	C	6	XXXXXX
TZWTRXW	C	6	ETF 基金托管单元
TZWZQDH	C	6	成分股证券代号
TZWGFXZ	C	2	流通股“00”
TZWZGS	N	12,0	成分股股数
TZWxcbz	C	1	下传标志, N=不下传结算数据
TZWCLBZ	C	1	处理标志, 填入空格

该接口由基金管理公司提供。用于 ETF 组合证券的到账。

附件 7、权益转移申请表

权益转移申请表

中国证券登记结算有限责任公司：

现申请将 _____ 证券认购专户中的证券所产生的权益调入我公司
相关账户。

具体调账内容如下：

红股	证券代码	调出账户	调入账户	调入托管单元	调账股数
红利	证券代码				
	证券简称				
	调入结算备付金账户名称				
	调入结算备付金账户账号				
	调入金额（元）				

基金管理公司（公章）

年 月 日