

# 关于修订并发布《中国证券登记结算有限责任公司 深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南 (2019年修订)》的通知

中国结算深业字〔2019〕19号

各市场参与机构:

为配合深市 ETF 结算模式调整项目开展,结合近期深市 ETF 业务变化情况,本公司对《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》(以下简称《指南》)进行了修订,主要修订内容概括如下:

一、调整《指南》中关于 ETF 交易申赎业务所涉及担保结算的相关规定,由 T+1DVP 结算模式统一调整为 A 股结算模式。

二、调整《指南》中关于深市跨市场股票 ETF 场内申赎模式的规定,具体而言,新增以深市组合证券及沪市全额现金替代申赎的相关内容,同时删除全额现金申赎的相关内容。

三、调整《指南》中关于 ETF 申赎业务所涉及非担保结算的相关规定。对于以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF、跨境 ETF 三个品种的份额赎回注销时点,从现行的 T+1 日日终统一调整为 T 日日终。对于以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF 的申购业务及黄金 ETF 的现金

申购业务，其结算模式则统一调整为 T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非担保交收。

四、为配合商品期货 ETF 品种的推出，在《指南》中增加商品期货 ETF 登记结算相关内容。

五、根据货币 ETF 产品发展需要，在《指南》中增加货币 ETF 需要使用退补款时，相关结算安排的内容。

六、为精简 ETF 初始登记申请材料，《指南》中免除了申请办理初始登记时关于验资报告、基金合同和基金募集说明书的报送要求。

七、对《指南》中部分文字描述、业务表格、收费标准、数据接口与联系方式进行了更新。

修改后的《指南》自 2019 年 10 月 21 日起实施，原《指南》同时废止。

在 2019 年 10 月 21 日形成的 ETF 相关业务按新结算模式进行清算交收，2019 年 10 月 18 日（正式实施前一交易日）形成的 ETF 相关业务仍按原结算模式进行清算交收。请各市场参与机构按照前述安排，切实做好深市 ETF 新旧结算模式切换工作。

特此通知。

附件：

1、具体修订内容及对应章节情况说明表

2、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南（2019年修订）

二〇一九年十月十一日

## 附件 1

### 具体修订内容及对应章节情况说明表

章节	修订内容
释义	增加：“商品期货 ETF”的定义
一、市场参与者参与 ETF 业务 1.1 投资者参与 ETF 业务	修订：调整关于封闭式基金账户业务使用范围的表述
二、基金份额认购 2.1 基金认购方式	增加：商品期货 ETF 的认购方式
二、基金份额认购 2.2 网上现金认购	修订：将认购前准备期间需要提交《基金网上发售认购资金划款申请》的品种从货币 ETF 扩大至所有 ETF 品种 增加：网上现金认购进行末日比例确认时，超比例资金返还的概括描述
三、登记托管 3.1 初始登记	删除：基金管理人提交验资报告、基金合同及基金募集说明书的要求 修订：根据最新操作实践，调整 ETF 网下沪深组合证券认购过户及初步登记相关业务办理流程中相关时点、表格材料的表述
三、登记托管 3.2 变更登记 3.5 其他托管业务	修订：明确非交易过户、司法协助、份额持有记录查询业务参照相关业务规则办理
三、登记托管 3.3 分红派息与收益支付	增加：查收退款及接收手续费发票相关内容
四、清算交收 4.1.2 申赎的结算原则	修订：将跨市场股票 ETF 原场内全额现金替代申赎相关内容删除，相应替换为深市组合证券及沪市全额现金替代申赎相关内容 修订：调整以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF 的申购业务，以及黄金 ETF 现金申购业务的结算原则内容，增加 RTGS 相关表述 修订：调整货币 ETF 结算原则，增加退补款结算表述 增加：商品期货 ETF 结算原则
四、清算交收 4.2 结算时间安排	修订：参照 A 股交收时间安排，调整所有 ETF 品种交易及单市场股票 ETF、以组合证券申赎的单市场债券 ETF 及货币 ETF 三个品种的时间安排 修订：调整以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF、跨境 ETF 三个品种的份额赎回注销时点 修订：调整以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF 的申购业务，以及黄金 ETF 现金申购业务的申购时间安排，增加 RTGS 内容

	<p>修订：货币 ETF 增加退补款的结算时间安排 增加：商品期货 ETF 结算时间安排</p>
<p>四、清算交收 4.4 申赎的清算交收</p>	<p>修订：参照 A 股结算实践，调整 ETF 交易业务及单市场股票 ETF 品种申赎业务的清算交收内容，同时出于相同内容合并的考虑，删除以组合证券申赎的单市场债券 ETF 申赎业务清算交收内容，直接转引单市场股票 ETF 申赎业务清算交收内容 修订：调整以全额现金申赎的单市场债券 ETF 申赎业务的清算交收内容，申购方面增加 RTGS 表述，赎回方面将份额注销时点调整为 T 日终，同时出于相同内容合并的考虑，删除跨市场债券 ETF、跨境 ETF 两个品种申赎业务以及黄金 ETF 现金申赎业务的清算交收内容，直接转引以全额现金申赎的单市场债券 ETF 申赎业务清算交收内容 修订：参照 A 股结算实践，调整货币 ETF 申赎业务清算交收内容，同时增加退补款清算交收内容 增加：商品期货 ETF 申赎业务清算交收转引规定，直接转引以全额现金申赎的单市场债券 ETF 申赎业务清算交收内容 修订：删除代收代付业务范围的列举内容，调整退补款业务项的使用范围</p>
<p>五、风险管理 5.3 资金交收违约处理 5.4 证券交收违约处理</p>	<p>修订：参照 A 股结算实践，调整交收违约处理相关内容</p>
<p>六、附则 6.1 本公司收费标准</p>	<p>修订：对分红派息手续费收费标准的表述进行细化</p>
<p>六、附则 6.3 业务咨询电话</p>	<p>修订：因应办公地址变化及业务人员更替情况进行更新</p>
<p>附件</p>	<p>修订：根据系统最新情况，更新了附件五《沪市证券冻结电子申报数据接口》、附件九《沪市股份冻结结果数据接口》 删除：附件十一《金钱权益转移申请表》、附件十五《ETF 现金红利分派申请表》，改为通过网站 <a href="http://www.chinaclear.cn">www.chinaclear.cn</a> →“服务支持”→“业务资料”→“业务表格”→中国结算深圳分公司发行人业务申请单处提供</p>
<p>全文</p>	<p>修订：对文中提及的数据接口说明文字进行删除，仅保留接口名称。</p>

## 附件 2

### 中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

#### 交易型开放式基金登记结算业务指南

(2019 年修订)

##### 版本修订说明

修订日期	主要修订内容
2019-10	<ol style="list-style-type: none"><li>1、根据 ETF 结算模式调整项目整体要求，将 T+1DVP 担保结算模式相关内容调整为 A 股结算模式，相应调整了相关业务运作及风险控制机制的描述</li><li>2、增加了跨市场股票 ETF 深市组合证券及沪市全额现金替代申赎模式的相关内容，同时删除了跨市场股票 ETF 全额现金申赎的相关规定</li><li>3、调整统一深市 ETF 申购赎回业务非担保结算模式的规定，其中对于以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF、跨境 ETF，非担保赎回时份额注销时点从 T+1 日日终调整为 T 日日终，对于以全额现金申赎的单市场债券 ETF、跨市场债券 ETF 的全部申购及黄金 ETF 的现金申购，结算模式调整为 T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非担保交收</li><li>4、增加了商品期货 ETF 登记结算相关内容</li><li>5、新增货币 ETF 退补款的相关表述</li><li>6、精简了 ETF 登记申请材料，删除了基金管理人提交验资报告、基金合同及基金募集说明书的要求</li></ol>

	7、调整了部分业务表格、收费标准、数据接口相关内容
2018-9	<p>1、修订扩大了网下沪深组合证券认购的适用范围；</p> <p>2、修订了黄金 ETF 账户比对的相关表述；</p> <p>3、根据深交所《证券投资基金交易和申购赎回实施细则》的修订情况，调整了各类 ETF 品种的定义与债券 ETF 内容的编排；</p> <p>4、根据《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券资金结算业务指南》的修订情况，调整了 ETF 资金结算账户开立的相关表述；</p> <p>5、根据分公司发行人业务指南编撰及内容调整的统一安排，增加关于 ETF 权益分派具体操作的相关内容；</p> <p>6、增加 ETF 发售前的业务技术准备与风险防范工作相关内容；</p> <p>7、修订代收代付业务相关内容，规定因补收款项而办理代收代付的情况下基金管理人的注意事项及相应责任；</p> <p>8、调整了部分业务流程、业务表格、收费标准、数据接口与联系方式的相关内容。</p>
2015-4	<p>1、调整了跨市场股票 ETF 和跨境 ETF 申赎制度的相关内容，增加规定了跨市场股票 ETF 全额现金申赎方式，同时，将跨市场股票 ETF 与跨境 ETF 全额现金申购结算方式调整规定为：日间实时逐笔全额非担保交收（即 RTGS 交收），日间未交收成功则统一并入当日日终批次的逐笔全额非担保交收；</p> <p>2、根据系统优化项目具体实施情况，修改了对结算账户开立流程的相关表述，同时对部分清算交收数据文件的表述进行了相应调整；</p> <p>3、根据深交所最新颁布的《证券投资基金交易和申购赎回实施</p>

	细则》修改了部分 ETF 的定义与描述。
2014-10	增加了货币 ETF 品种登记结算相关内容。
2013-11	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、增加了黄金 ETF 登记结算相关内容；</li> <li>2、增加了债券 ETF 和跨市场 ETF 登记结算相关内容；</li> <li>3、删除了 ETF 申赎履约保证金相关内容。</li> </ol>
2012-7	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、增加了跨境 ETF 登记结算相关内容；</li> <li>2、ETF 申购赎回现金差额由净额结算调整为代收代付模式；</li> <li>3、对 ETF 申购赎回中采用代收代付模式的业务处理顺序作了调整；</li> <li>4、调整了 ETF 申购赎回履约保证金缴纳公式。</li> </ol>

# 目 录

一、	市场参与人参与 ETF 业务.....	2
1.1	投资者参与 ETF 业务 .....	2
1.2	特定投资者参与跨市场股票 ETF 场外深沪组合证券申赎业务 .....	3
1.3	基金管理人参与 ETF 登记结算业务 .....	3
1.3.1	基金管理人的 ETF 发售前准备.....	3
1.3.2	货币 ETF 的产品准入 .....	5
1.3.3	ETF 发售前的业务技术准备与风险防范工作.....	5
1.4	基金托管人参与 ETF 登记结算业务 .....	5
1.5	结算参与人参与 ETF 登记结算业务 .....	6
1.5.1	参与 ETF 认购结算业务 .....	6
1.5.2	参与 ETF 交易结算业务 .....	7
1.5.3	参与 ETF 申赎结算业务 .....	7
二、	基金份额认购 .....	7
2.1	基金认购方式 .....	7
2.2	网上现金认购 .....	9
2.2.1	认购期前准备 .....	9
2.2.2	认购期业务流程.....	9
2.2.3	认购截止后业务流程 .....	10
2.3	网下现金认购 .....	10
2.4	网下组合证券认购 .....	10
2.5	网下黄金合约认购 .....	11
2.6	ETF 募集失败的协助工作.....	11
三、	登记托管 .....	11
3.1	初始登记 .....	11
3.1.1	L 日业务事项.....	12
3.1.2	L+1 日业务事项.....	12
3.1.3	L+2 日业务事项.....	14

3.1.4	L+3 日前业务事项.....	15
3.1.5	L+3 日业务事项.....	15
3.1.6	L+4 日业务事项.....	18
3.1.7	L+4 日及以后业务事项.....	19
3.2	变更登记.....	19
3.3	分红派息与收益支付.....	20
3.4	份额持有明细服务.....	21
3.5	其他托管业务.....	21
<b>四、</b>	<b>清算交收.....</b>	<b>22</b>
4.1	基本原则.....	22
4.1.1	交易的结算原则.....	22
4.1.2	申赎的结算原则.....	22
4.1.3	交收账户.....	24
4.2	结算时间安排.....	25
4.2.1	单市场股票 ETF.....	25
4.2.2	单市场债券 ETF.....	25
(1)	以组合证券申赎的.....	25
(2)	以全额现金申赎的.....	26
4.2.3	跨市场股票 ETF.....	26
(1)	场外组合证券申赎的.....	26
(2)	场内申赎的.....	27
4.2.4	跨市场债券 ETF.....	27
4.2.5	跨境 ETF.....	28
4.2.6	黄金 ETF.....	28
4.2.7	货币 ETF.....	29
4.2.8	商品期货 ETF.....	29
4.3	交易的清算交收.....	30
4.3.1	交易的清算.....	30
4.3.2	交易的交收.....	31
4.4	申赎的清算交收.....	31
4.4.1	单市场股票 ETF.....	31
4.4.2	单市场债券 ETF.....	33
4.4.3	跨市场股票 ETF 申赎的清算交收.....	35
4.4.4	跨市场债券 ETF 申赎的清算交收.....	42
4.4.5	跨境 ETF 申赎的清算交收.....	42
4.4.6	黄金 ETF 申赎的清算交收.....	42

4.4.7	货币 ETF	43
4.4.8	商品期货 ETF	44
4.4.9	代收代付业务的清算交收	44
<b>五、</b>	<b>风险管理</b>	<b>46</b>
5.1	结算参与人管理	46
5.2	货币 ETF 申赎的额度管理	47
5.3	资金交收违约处理	47
5.4	证券交收违约处理	48
5.5	待处分证券处置	48
<b>六、</b>	<b>附则</b>	<b>49</b>
6.1	本公司收费标准	49
6.2	深交所及其他机构收费	51
6.3	业务咨询电话	51
6.4	查询网站	51
6.5	数据接口下载	51



为规范交易型开放式基金(以下简称“ETF”)的登记结算业务运作,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”)根据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》,制定本指南。

本指南所称 ETF,包括单市场股票 ETF、单市场债券 ETF、跨市场股票 ETF、跨市场债券 ETF、跨境 ETF、黄金 ETF、货币 ETF、商品期货 ETF,具体释义如下:

单市场股票 ETF,指所跟踪股票指数成份证券仅为深圳证券交易所(以下简称“深交所”)上市股票的 ETF;

单市场债券 ETF,指所跟踪债券指数成份证券仅为深交所上市债券的 ETF;

跨市场股票 ETF,指所跟踪股票指数成份证券仅为深交所和上海证券交易所(以下简称“上交所”)上市股票的 ETF;

跨市场债券 ETF,指所跟踪债券指数成份证券包括非深交所上市债券的 ETF;

跨境 ETF,指所跟踪指数成份证券包括境外证券的 ETF;

黄金 ETF,指以上海黄金交易所(以下简称“金交所”)现货合约为投资标的、跟踪现货合约价格的 ETF。

货币 ETF,指仅投资于货币市场工具的 ETF。

商品期货 ETF,指以中国证监会依法批准设立的商品期货交易所挂牌交易的商品期货合约为主要投资标的、跟踪商品期货价格或价格指数的 ETF。

本指南适用于 ETF 网上现金认购的资金结算，组合证券认购的证券过户，ETF 份额初始登记、基金份额标准化转换、ETF 交易、申购及赎回的登记结算业务。投资者、结算参与人、基金管理人、基金托管人可参照本指南办理相关业务。

## 一、 市场参与人参与 ETF 业务

### 1.1 投资者参与 ETF 业务

投资者可使用深圳 A 股账户和深圳封闭式基金账户（以下简称“基金账户”）进行 ETF 相关业务，其中使用基金账户的，目前能办理的业务范围为：所有 ETF 的现金认购及交易、货币 ETF 的现金申购赎回、黄金 ETF 的网下实物认购和实物申购赎回业务。

对于允许以深沪组合证券认购、通过公司总部系统使用深沪组合证券申赎（以下简称“场外组合证券申赎”）的跨市场股票 ETF，及允许以深沪组合证券认购的跨境 ETF，投资者参与上述 ETF 组合证券认购及申赎的，须同时拥有深圳 A 股账户和上海 A 股账户。

对于黄金 ETF，投资者在进行黄金合约认购或黄金合约申赎之前，须先通过金交所会员进行身份验证，以确保投资者金交所账户与深圳 A 股账户或基金账户身份一致。投资者进行身份验证时，需提交包括深圳 A 股账户或基金账户的号码及名称、拟申购黄金 ETF 的基金代码等。

投资者身份验证由基金管理人负责。我司在服务时间内向基金管理人提供深圳 A 股账户或基金账户相关信息，仅供基金管理人身份验证时参考。基金管理人需要向本公司总部申请开通相应权限，以接收上述深圳账户相关信息。

下文将深圳 A 股账户与基金账户统称证券账户。

## 1.2 特定投资者参与跨市场股票 ETF 场外深沪组合证券申赎业务

特定投资者是指不通过代办证券公司经纪交易单元，而通过基金管理人直销申报跨市场股票 ETF 场外组合证券申购赎回申请的保险产品、全国社保基金、证券投资基金、证券集合资产管理计划等特殊机构及产品投资者。

在办理跨市场股票 ETF 场外组合证券申赎业务前，特定投资者须将其与基金管理人签订的跨市场股票 ETF 场外组合证券申购赎回业务协议及其沪、深证券账户信息向本公司总部报备，提交如下材料：

- 1、特定投资者开通直销 ETF 场外组合证券申购赎回业务报备表(附件一)；
- 2、与基金管理人签订的跨市场股票 ETF 场外组合证券申购赎回业务协议(特定投资者为该跨市场股票 ETF 管理人所管理的产品的，提交《跨市场 ETF 直销场外组合证券申购赎回承诺函》)；
- 3、法人营业执照复印件(加盖公司公章)；
- 4、法定代表人授权委托书；
- 5、经办人有效身份证明文件复印件；
- 6、本公司总部要求的其他材料。

在本公司总部备案通过后，特定投资者方可通过基金管理人直销办理跨市场股票 ETF 基金场外组合证券申赎业务。

## 1.3 基金管理人参与 ETF 登记结算业务

### 1.3.1 基金管理人的 ETF 发售前准备

基金管理人须在 ETF 发售前做好如下准备工作：

- 1、向本公司结算业务部申请维护深圳证券综合结算平台(D-COM

系统)相关参数信息。

基金管理人未开通 D-COM 系统的,须在 ETF 发售前提交基金募集批文及《深圳证券综合结算平台(D-COM)申请表》,以开通 D-COM 系统,并申请维护 D-COM 相关参数信息。

基金管理人已开通 D-COM 系统的,也须在 ETF 发售前提交基金募集批文及《深圳证券综合结算平台(D-COM)申请表》,以申请维护 D-COM 相关参数信息。

此处及下文提及的资金结算业务类表格均可通过本公司网站如下栏目获取:www.chinaclear.cn→“服务支持”→“业务表格”→“深圳市场”→“中国结算深圳分公司证券资金结算业务表格”。

2、根据《基金管理人登记结算数据接口规范》,进行系统开发及维护。

该数据接口规范可通过本公司网站如下栏目获取:www.chinaclear.cn→“服务支持”→“接口规范”→“深圳市场”。

3、督促基金托管人开立 ETF 证券账户与 ETF 资金结算账户(详见本指南 1.4 内容)。

4、对于允许场外组合证券申赎的跨市场股票 ETF,基金管理人还须向本公司总部申请开通申赎业务,报送代办证券公司名单。

基金管理人首只跨市场股票 ETF 申请开通场外组合证券申赎业务,应提前向深圳证券通信公司申请办理通信开通手续,并于开放申赎前三个工作日前,向本公司总部提交如下材料:

(1) 开通跨市场股票 ETF 基金场外组合证券申购及赎回业务申请表;

- (2) 跨市场股票 ETF 基金场外组合证券申购及赎回业务测试报告；
- (3) 交易型开放式基金开放场外组合证券申赎参数通知单；
- (4) 基金成立日期确认函；
- (5) 本公司总部要求的其他材料。

基金管理人非首只跨市场股票 ETF 申请开通场外组合证券申赎业务，应于开放申赎前三个工作日前向本公司总部提交上述材料第(3)(4)(5)项。

### 1.3.2 货币 ETF 的产品准入

本公司针对货币 ETF 实施产品准入管理。

拟发售货币 ETF 的基金管理人须先向本公司提出申请，本公司对其申报的货币 ETF 方案进行审核，相关审核程序和审核标准详见附件二。

### 1.3.3 ETF 发售前的业务技术准备与风险防范工作

ETF 基金管理人在 ETF 产品发售前，应做好相关各项准备和风险防范工作，包括但不限于开立结算账户、制订业务流程、风险应急预案、技术系统测试方案等。因未做好上述相关准备工作导致重大业务技术风险事故的，由基金管理人自行承担相关责任。

## 1.4 基金托管人参与 ETF 登记结算业务

受 ETF 基金管理人委托，基金托管人须于 ETF 上市前向本公司投资者业务部申请开立 ETF 证券账户，及向本公司结算业务部申请开立资金结算账户：结算备付金账户（B001+结算账号）和结算保证金账户（B002+结算账号）。

## 1、开立证券账户

对于投资标的中涉及境内组合证券的相关 ETF 品种,需要先行开立 ETF 证券账户。仅涉及深市组合证券的,开立深市 ETF 证券账户,如涉及沪深两市组合证券的,还需开立沪市 ETF 证券账户。

ETF 基金托管人须于 L+3 日 ( L 日为发售截止日 ) 之前,按照《中国证券登记结算有限责任公司特殊机构及产品证券账户业务指南》申请开立相关市场 ETF 证券账户。

该指南详见 [www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn) →“法律规则”→“账户管理”。

## 2、资金结算账户相关事宜

托管银行作为基金托管人开展 ETF 申购赎回资金结算业务,以每个 ETF 名义单独开立资金结算账户,需要按照《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券资金结算业务指南》中 ETF 结算账户开立的相应流程办理。

该指南详见 [www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn) →“法律规则”→“清算与交收” →“深圳市场”。

## 1.5 结算参与者参与 ETF 登记结算业务

### 1.5.1 参与 ETF 认购结算业务

具有深交所基金销售业务资格的结算参与者,均可使用其现有的结算备付金账户参与 ETF 网上现金认购的结算业务。

结算参与者参与 ETF 网下组合证券认购和网下现金认购的结算业务,见基金管理人公告的《基金招募说明书》相关规定及本指南 2.3-2.5 内容。

## 1.5.2 参与 ETF 交易结算业务

结算参与者使用其现有的结算备付金账户和证券交收账户参与 ETF 交易结算业务。还未开立结算备付金账户或证券交收账户的结算参与者，须先向本公司结算业务部申请开立。

## 1.5.3 参与 ETF 申赎结算业务

代办证券公司等结算参与者首次代办跨市场股票 ETF 场外组合证券申赎，应提前向深圳证券通信公司申请办理通信开通手续，并于代办申赎前三个工作日前向本公司总部提交如下材料：

- (1) 开通跨市场股票 ETF 基金场外组合证券申购及赎回业务申请表；
- (2) 跨市场股票 ETF 基金场外组合证券申购及赎回业务测试报告；
- (3) 本公司总部要求的其他材料。

基金管理人在代办证券公司等结算参与者提交上述材料后，于其代办申赎前三个工作日前向本公司总部提交跨市场股票 ETF 新增代办券商的函。

代办证券公司等结算参与者非首次代办跨市场股票 ETF 场外组合证券申赎，基金管理人于其代办申赎前三个工作日前向本公司总部提交跨市场股票 ETF 新增代办券商的函。

## 二、 基金份额认购

### 2.1 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、网下组合证券

认购及网下黄金合约认购等方式。各种认购方式释义如下：

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经深交所交易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或指定的发售代理机构以现金进行的认购；

网下组合证券认购，是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以在沪深证券交易所交易的组合证券进行的认购；

网下黄金合约认购，是指投资者以黄金现货合约进行黄金 ETF 份额的认购。

各类 ETF 的一般认购方式可见下表：

ETF 类型 \ 认购方式	网上现金 认购	网下现金 认购	网下组合证券 认购	网下黄金合 约认购
单市场股票 ETF	√	√	√	
单市场债券 ETF	√	√	√	
跨市场股票 ETF	√	√	√	
跨市场债券 ETF	√	√		
跨境 ETF	√	√	√	
黄金 ETF	√	√		√
货币 ETF	√	√		
商品期货 ETF	√	√		

对于 ETF 的具体认购方式，一般采用上表方式，但基金公司另有约定的除外。

## 2.2 网上现金认购

### 2.2.1 认购期前准备

基金认购开始日的前两个工作日，ETF 的基金管理人和基金托管人需先行向本公司结算业务部提交《基金网上发售认购资金划款申请》。

### 2.2.2 认购期业务流程

基金发售期内的任一认购日（以下简称 N 日），均按下述业务流程滚动进行：

1、N 日，本公司根据深交所发送的认购数据进行资金清算，并于当日晚向结算参与人发送初步有效申购结果数据及资金清算数据（详见 SJSFX.DBF 及 SJSQS.DBF）。

2、N+1 日，结算参与人应当确保在最终交收时点，其结算备付金账户有足额资金用于认购资金的交收。如结算参与人结算备付金账户余额不足，本公司根据认购时间优先原则，对不足部分的认购申报做资金无效处理。当日晚本公司向结算参与人发送资金变动情况（详见 SJSZJ.DBF）。

3、N+2 日，本公司向结算参与人发送因认购资金不到位或比例认购引起的不确认记录、认购结果记录和全部有效认购记录（详见 SJSFX.DBF），并向结算参与人发送资金清算结果（详见 SJSQS.DBF）。

4、基金发售期内，本公司向基金管理人发送网上现金认购相关数据（详见 GLRYW.DBF）。

### 2.2.3 认购截止后业务流程

1、L+3日(L日为截止认购日),本公司根据基金管理人和基金托管人的申请,将网上全部有效认购资金划入基金托管人的结算备付金账户。

2、对于有效认购资金冻结期间的利息,本公司按分段计息的原则,根据人民银行规定的活期存款利率和实际冻结天数(N+1日~L+3日前一自然日)计算,在季度结息日的下一自然日划入该基金托管人的结算备付金账户。若基金募集期跨越季度结息日,则相应利息分两次计付,第一次利息于L+3日划付,第二次利息于季度结息日次一自然日划付。

3、基金管理人申请对认购期末日的网上现金认购进行比例确认的,本公司于L+3日将超比例资金返还至相关结算参与人的结算备付金账户。

## 2.3 网下现金认购

网下现金认购的资金结算由基金管理人组织完成,不通过本公司办理。

## 2.4 网下组合证券认购

代办证券公司将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,确认各组合证券的认购数量,向本公司申请办理组合证券认购的ETF份额登记及组合证券过户,详细流程见本指南3.1内容。

说明:1、代办证券公司不得接收投资者使用有限售条件或因其高管身份而处于锁定状态的组合证券认购ETF;2、在本公司划转组合证

券前，代办证券公司应冻结投资者提交的组合证券，如果投资者在组合证券划转之前因申报卖出等导致组合证券数量不足，则组合证券认购失败。

## **2.5 网下黄金合约认购**

黄金 ETF 的网下黄金合约认购由基金管理人自行组织完成，不通过本公司办理。

## **2.6 ETF 募集失败的协助工作**

基金份额募集不能满足基金设立条件的，基金管理人承担返还认购资金、组合证券、黄金合约及孳息的责任，本公司可协助基金管理人完成相关资金和组合证券的退还工作。

# **三、 登记托管**

## **3.1 初始登记**

根据本指南 2.1 的规定涉及组合证券认购的 ETF 品种，其份额初始登记一般包括网上现金发售份额（含利息折份额）、网下现金发售份额（包括网下利息折份额）、网下组合证券认购份额的初始登记以及组合证券的登记过户等。

根据本指南 2.1 的规定不涉及组合证券认购的 ETF 品种，其份额初始登记一般包括网上现金发售份额（含利息折份额）及网下现金发售份额（含利息折份额）的初始登记，基金公司另有约定的除外。

黄金 ETF 的份额初始登记一般包括网上现金发售份额（含利息折份

额)、网下现金发售份额(包括网下利息折份额)、网下黄金合约认购份额的初始登记等。

基金管理人可按如下顺序向本公司发行人业务部申请办理 ETF 份额的初始登记及组合证券过户事宜(仅针对涉及组合证券认购的 ETF 品种),跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF,相关组合证券的认购过户直接向本公司总部申请办理。

下文跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的登记业务表格和登记数据模板见附件,其他 ETF 涉及的深市登记业务表格和登记数据模板可通过本公司网站获取: [www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn) →“服务支持”→“业务资料”→“业务表格”→中国结算深圳分公司发行人业务申请表单。

### 3.1.1 L 日业务事项

L 日下午,本公司总部根据跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 基金管理人的申请,分配沪市组合证券申请书号。

L 日晚,跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的基金管理人应向本公司总部申请账户同一性检查。

基金管理人向本公司总部申请对网下组合证券认购的投资者的沪、深证券账户进行同一性检查,本公司总部将检查结果反馈相关基金管理人,相关数据接口规范见附件三。

### 3.1.2 L+1 日业务事项

1、单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 基金

管理人向本公司申请将组合证券划入 ETF 认购专户

本公司使用 ETF 认购专户 ,用于保管投资者认购 ETF 份额提交的组合证券。

单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 基金管理人向本公司申请办理组合证券划入 ETF 认购专户(注:基金管理人提交的单市场股票 ETF 的网下组合证券认购数据需先经深交所审核通过),需提交如下资料:

(1)《组合证券划入 ETF 认购专户申请表》;

(2)ETF 认购组合证券第一次过户数据(数据模板联系本公司发行人业务部索取)。

组合证券自认购日至划入 ETF 认购专户前产生的孳息归认购投资者本人所有,本公司不将其做认购处理,不划入 ETF 认购专户。

2、跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的基金管理人向本公司总部申请组合证券调账/冻结业务

基金管理人需向本公司总部申请办理上海市场网下认购组合证券的冻结,及将深圳市场网下认购组合证券划转至本公司为其开立的证券认购专户(注:基金管理人提交的深圳市场网下组合证券认购数据需先经深交所审核通过),申请材料如下:

(1)沪市认购 ETF 组合证券冻结申请表(附件四)、证券冻结申请清单及证券冻结电子申报数据(格式见附件五);

(2)深市组合证券调入 ETF 认购专户申请表(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)(附件六),证券调账申请清单及批量调账电子申报数据(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)(格式见附件七);

(3)中国证监会核准基金募集的批复复印件;

- (4) 基金管理人法人营业执照副本复印件；
- (5) 法定代表人证明书；
- (6) 指定联络人授权委托书(附件八)；
- (7) 指定联络人身份证原件及复印件；
- (8) 指定印鉴授权委托书；
- (9) 公司总部要求的其他材料。

本公司总部根据基金管理人电子申报数据，打印沪市证券冻结清单和深市证券调账清单交由基金管理人加盖被授权的指定印鉴确认。其他书面材料均须加盖基金管理人公章。L+1 日日间(下午 14:00 前)，本公司总部对上述资料审核后，将沪市投资者组合证券冻结数据发送给中国结算上海分公司(以下简称“上海分公司”)，上海分公司据此对投资者账户内相应的组合证券进行冻结。

L+1 日日间(下午 13:30 前)，本公司总部将深市组合证券调入证券认购专户申请表传真给本公司，并将深市投资者组合证券批量调账数据发送给本公司，本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。

如果个人投资者使用应纳税的已解除限售的组合证券认购 ETF，应按个人转让上市公司限售股所得征收个人所得税有关规定缴纳个人所得税。

### 3.1.3 L+2 日业务事项

1、跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的基金管理人确认调账结果

本公司总部根据本公司批量调账结果，打印组合证券批量调账清单交由基金管理人加盖被授权的指定印鉴确认。

## 2、基金管理人领取组合证券过户/冻结明细

单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 组合证券划转完成后，由本公司提供 ETF 认购专户的持股情况。

跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF，在组合证券划转完成后，本公司总部根据上海分公司认购冻结结果向基金管理人出具沪市股份冻结证明及股份冻结结果数据（格式见附件九），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及批量调账结果数据（格式见附件十）。

## 3、所有 ETF 基金管理人均需提交以下申请资料：

（1）《网上发售末日确认比例通知书》；

（2）《网上认购资金利息折份额登记申请》（当基金合同约定投资者的认购资金利息折合为基金份额时需要提供，如果基金合同约定投资者认购利息不折合为基金份额则无需提供）。

### 3.1.4 L+3 日前业务事项

L+3 日前，基金管理人需向本公司提交如下资料：

（1）中国证监会核准基金发售的批复复印件；

（2）已签署的登记结算服务协议（一式四份）（协议范本联系发行人业务部领取）；

（3）基金管理人有效营业执照复印件、法定代表人证明书及身份证复印件、《指定联络人授权委托书》、指定联络人身份证复印件；

（4）本公司要求的其他材料。

上述书面材料均须加盖基金管理人公章。

### 3.1.5 L+3 日业务事项

1、向本公司领取《基金利息转份额持有人名册清单》及《网上认购情况统计报表》

基金管理人应认真核对《基金利息转份额持有人名册清单》，确认名册清单无误后，出具《关于<利息转份额持有人名册清单>的确认书》。

2、单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 及跨市场股票 ETF 基金管理人申报 ETF 证券账户及组合证券托管单元信息

单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 及跨市场股票 ETF 基金管理人应在 L+3 日报送《ETF 证券账户及托管单元（主交易单元）信息申报表》。组合证券托管单元须为基金管理人申请 ETF 多个交易单元合并清算时使用的证券合并清算主交易单元。

3、单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 基金管理人向本公司申请将组合证券划入 ETF 证券账户，提交以下资料：

（1）《组合证券划入 ETF 证券账户申请表》；

（2）ETF 认购组合证券第二次过户数据（数据模板联系本公司发行人业务部索取）。

组合证券在 ETF 认购专户保管期间发生权益分派业务的，红股红利归基金资产，本公司将权益分派对应的孳息划归 ETF 基金。红股部分，管理人应将其与组合证券合并，在 L+3 日申请自认购专户划入 ETF 证券账户；现金红利部分，基金管理人须于 L+4 日前向本公司提交《组合证券的现金红利转移申请表》，本公司审核通过后将认购专户中红利转移至基金托管人的结算备付金账户。

4、跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的基金管理人向本公司总部申请办理网下认购组合证券过户

跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的基金管理人向本公司总部申请办理网下认购组合证券过户，需提交如下申请材料：

(1) 认购 ETF 组合证券过户申请表 (附件十一)、认购 ETF 组合证券股份过户清单及组合证券过户电子申报数据 (分沪、深市场分别制作数据文件，格式见附件十二)；

(2) 本公司总部要求的其他材料。

本公司总部根据基金管理人组合证券过户电子申报数据，打印沪市、深市组合证券股份过户清单交由基金管理人加盖被授权的指定印鉴确认。

L+3 日日间 (下午 14:00 前)，本公司总部对上述资料审核后，将沪市投资者组合证券过户数据发送给上海分公司，上海分公司据此解除认购组合证券的冻结，并将其过户至 ETF 证券账户，未被基金管理人确认为有效认购的股票冻结将被解冻。

如果个人投资者使用应纳税的已解除限售的组合证券认购 ETF，应按个人转让上市公司限售股所得征收个人所得税有关规定扣缴个人所得税。

L+3 日日间 (下午 13:30 前)，本公司总部将认购 ETF 组合证券过户申请表传真给本公司，并将深市投资者组合证券过户数据发送给本公司，本公司据此将组合证券过户至 ETF 证券账户。

沪市组合证券认购冻结期间的股票权益，按照权益与所有权一致的原则，在认购的股票过户前，股票的权益仍属于认购人，因此，上海分公司不冻结组合证券在认购冻结期间产生的权益，即股票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。红股部分,应将其与组合证券合并,在 L+3 日申请自认购专户划入 ETF 证券账户;现金红利部分,基金管理人须于 L+4 日前向本公司总部提交《权益转移申请表(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)》(附件十三),本公司总部通知本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。

### 3.1.6 L+4 日业务事项

1、跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境 ETF 的基金管理人确认过户结果

本公司总部根据本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。

2、所有 ETF 基金管理人均需申请办理网下发售(网下现金认购及利息、网下组合证券认购、网下黄金合约认购)的份额登记(无网下发售安排的除外),提交基金网下发售份额登记数据(数据模板联系本公司发行人业务部索取)。

登记电子数据经检查通过后,本公司向基金管理人提供《证券登记申报明细清单》。基金管理人须认真核对明细清单中的证券账户号码、股东名称、证件号码、持股数量、托管单元等信息。如核对有误,基金管理人重新提交登记电子数据;如核对无误,基金管理人签字盖章后将明细清单交回本公司。

3、基金管理人领取 ETF 证券账户持股余额文件

对于单市场股票 ETF、以组合证券申购赎回的单市场债券 ETF 基金,由本公司出具 ETF 证券账户持股余额文件;

对于跨市场股票 ETF 及组合证券中含有境内沪深上市证券的跨境

ETF，本公司总部根据上海分公司和本公司发送的 ETF 证券账户的持股余额数据，打印 ETF 证券账户的沪、深持股余额清单。持股余额清单包含 ETF 沪、深证券账户号、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）。本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。

### 3.1.7 L+4 日及以后业务事项

#### 1、提交《证券投资基金份额登记申请表（ETF）》

本公司发行人业务部收取基金管理人的上述登记申请后，对基金管理人提交的所有 ETF 份额登记材料进行审核并完成 ETF 份额登记。

#### 2、领取 ETF 份额登记结果

基金管理人可于份额登记完成后的次一工作日向本公司申请领取 ETF 份额登记结果文件，包括登记证明、全体持有人名册前十名等。

## 3.2 变更登记

#### 1、ETF 份额标准化数据转换

基金管理人须于 ETF 份额标准化转换基准日次一工作日上午 9：30 前向本公司发行人业务部提交《基金份额标准化登记申请》。

本公司完成基金份额标准化转换后，向基金管理人出具份额标准化后的证券登记结果文件。

#### 2、ETF 交易、申购、赎回的变更登记

本公司根据结算参与人 ETF 交易、申购、赎回的交收结果，办理 ETF 份额和相应组合证券的变更登记。

#### 3、其他情况的变更登记

非交易过户、司法协助等业务参照《中国结算深圳分公司证券非交易过户业务指南》《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司协助执法业务指南》等规范性文件办理。

### 3.3 分红派息与收益支付

#### 3.3.1 办理流程

##### 3.3.1.1 申请办理现金红利分派

基金管理人申请办理场内份额现金红利分派业务,在 R-3 日(R 日为权益登记日)前在发行人 E 通道填报申请,或通过邮寄、传真等方式将以下申请材料送达本公司:

- 1、ETF 场内份额现金红利分派申请表;
- 2、分派现金红利公告。

##### 3.3.1.2 联系公告事宜

现金红利分派申请经本公司确认后,基金管理人须及时联系深交所办理公告事宜。

##### 3.3.1.3 接收付款通知

基金管理人接收到本公司出具的付款通知后,应及时确认。

##### 3.3.1.4 付款

基金管理人应确保权益分派预付款在 R+2 日 11:00 前足额汇至本公司指定的银行账户。本公司确认现金红利款和手续费足额到账后,实施现金红利分派。

通过本公司分派 ETF 的现金红利,由本公司在 R+2 日日终向结算参与者发送现金红利清算数据,并于下一交易日向结算参与者划付现金

红利资金。

#### 3.3.1.5 查收退款

基金管理人可在 R+3 日接收本公司出具的权益分派退款通知,并在 R+4 日后在其业务资金专户中查收并提取退款。

#### 3.3.1.6 接收手续费发票

基金管理人应及时登陆统一用户管理系统维护和更新发票信息,以便本公司准确开立和邮寄相关发票。本公司将在本次权益分派完成后寄送手续费发票。

### 3.3.2 注意事项

1、遇 ETF 基金场内份额分派现金红利,本公司将在 R-2 日至 R 日期间,暂停该基金的跨市场转托管。

2、填写申请时,每 10 份基金份额分派的现金红利金额(单位为“元”),小数点后最多为 6 位。例如:每 10 份送 0.123456 元。

3、货币 ETF 的收益,由基金管理人负责计算并记录,本公司根据基金管理人提交的业务申请及资金支付数据,按本指南 4.4.9 代收代付的规定支付投资者收益。

## 3.4 份额持有明细服务

基金管理人可通过 D-COM 系统接受每日的 ETF 份额持有明细数据(详见 GLRMX.DBF)。

## 3.5 其他托管业务

ETF 份额的持有记录查询参照《中国证券登记结算有限责任公司投

投资者证券查询业务指南》等相关规范性文件办理。

## 四、 清算交收

### 4.1 基本原则

#### 4.1.1 交易的结算原则

本公司作为共同对手方，参照 A 股做法，对 ETF 交易的份额和资金提供多边净额结算服务。

#### 4.1.2 申赎的结算原则

各类 ETF 的申赎采用不同的交收方式，具体结算原则如下：

##### 1、单市场股票 ETF 的结算原则

根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申赎对应的份额、组合证券和现金替代，实行多边净额结算；对 ETF 申赎的现金差额、现金替代退补款，实行资金代收代付。

##### 2、单市场债券 ETF 的结算原则

可以使用组合证券或全额现金两种方式进行申购赎回。

(1) 以组合证券申赎的，根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申赎对应的份额、组合证券和现金替代，实行多边净额结算；对 ETF 申赎的现金差额、现金替代退补款，实行资金代收代付。

(2) 以全额现金申赎的，根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申购对应的份额和现金替代，日间实行 RTGS 交收，上述份额和现金替代日间未完成交收的，日终统一进行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回份额实行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回的现金替代、申赎的现金差额及现金替代退补款，实行资金代收代付。

### 3、跨市场股票 ETF 申赎的结算原则

可以采用两种申购赎回方式，分别为场外组合证券申赎，以及通过深交所深市组合证券及沪市全额现金替代申赎（以下简称“场内申赎”）。

（1）采用场外组合证券申赎的，根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申赎对应的份额和组合证券，实行逐笔全额非担保交收，并由沪深分公司相应扣收 ETF 申赎过程中的组合证券过户费；对 ETF 申赎的现金替代、现金差额及现金替代退补款，实行资金代收代付。

（2）采用场内申赎的，根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申赎对应的份额、组合证券和现金替代，均实行多边净额结算；对 ETF 申赎的现金差额及现金替代退补款，实行资金代收代付。

### 4、跨市场债券 ETF 申赎的结算原则

与采用全额现金申赎的单市场债券 ETF 相一致。即根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申购对应的份额和现金替代，日间实行 RTGS 交收，上述份额和现金替代日间未完成交收的，日终统一进行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回份额实行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回的现金替代、申赎的现金差额及现金替代退补款，实行资金代收代付。

### 5、跨境 ETF 申赎的结算原则

与采用全额现金申赎的单市场债券 ETF 相一致。即根据基金管理人的委托，本公司对 ETF 申购对应的份额和现金替代，日间实行 RTGS 交收，上述份额和现金替代日间未完成交收的，日终统一进行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回份额实行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回的现金替代、申赎的现金差额及现金替代退补款，实行资金代收代付。

### 6、黄金 ETF 申赎的结算原则

对于黄金 ETF 实物申赎,本公司根据深交所数据直接进行投资者证券账户黄金 ETF 份额的变更登记。

对于黄金 ETF 现金申赎,与采用全额现金申赎的单市场债券 ETF 相一致。即本公司根据基金管理人委托,对 ETF 申购对应的份额和现金替代,日间实行 RTGS 交收,上述份额和现金替代日间未完成交收的,日终统一进行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回份额实行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回的现金替代、申赎的现金差额和现金替代退补款,实行资金代收代付。

#### 7、货币 ETF 申赎的结算原则

根据基金管理人的委托,本公司对货币 ETF 申赎对应的份额和现金,实行多边净额结算。如申赎涉及退补款的,则实行资金代收代付。

#### 8、商品期货 ETF 申赎的结算原则

与采用全额现金申赎的单市场债券 ETF 相一致。即根据基金管理人的委托,本公司对 ETF 申购对应的份额和现金替代,日间实行 RTGS 交收,上述份额和现金替代日间未完成交收的,日终统一进行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回份额实行逐笔全额非担保交收。对 ETF 赎回的现金替代、申赎的现金差额及现金替代退补款,实行资金代收代付。

说明:上述各类 ETF 如以组合证券进行申赎,则:1、组合证券不得有限售条件或因持有人高管身份而处于锁定状态;2、个人投资者使用应纳税的已解除限售的组合证券申购 ETF,应按个人转让上市公司限售股所得征收个人所得税有关规定扣缴个人所得税,本公司在划拨组合证券时,通知结算参与者按照有关规定扣收相关税款。

### 4.1.3 交收账户

结算参与者通过其在本公司开立的结算备付金账户进行 ETF 交易、

申赎的资金交收 ;基金管理人通过 ETF 基金结算备付金账户完成该 ETF 基金申赎涉及的资金交收。

本公司在组织多边净额交收活动中 ,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。

本公司使用专用清偿账户 ,存放结算参与人交收违约时暂未交付的证券和资金。

## 4.2 结算时间安排

### 4.2.1 单市场股票 ETF

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的份额	T 日	T 日	多边净额结算
申赎的组合证券	T 日	T 日	多边净额结算
申赎的现金替代	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

### 4.2.2 单市场债券 ETF

#### (1) 以组合证券申赎的 (结算时间安排同单市场股票 ETF)

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的份额	T 日	T 日	多边净额结算
申赎的组合证券	T 日	T 日	多边净额结算

申赎的现金替代	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

## (2) 以全额现金申赎的

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申购的份额和现金替代	T 日 ( RTGS 部分 T 日 日间实 时 )	T 日 ( RTGS 部分 T 日日间实 时 )	日间 RTGS 交收+日 终逐笔全额非担保交 收
赎回份额	T 日	T 日	逐笔全额非担保交收
赎回的现金替代 ( 含赎回现金替代退补款 )	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申购的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

## 4.2.3 跨市场股票 ETF

### (1) 场外组合证券申赎的

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算

申赎的份额	T 日	T+1 日	逐笔全额非担保交收
申赎的组合证券	T 日	T+1 日	逐笔全额非担保交收
申赎的现金替代	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

## (2) 场内申赎的

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的份额	T 日	T 日	多边净额结算
申赎的深市组合证券	T 日	T 日	多边净额结算
申赎的深市组合证券对应的现金替代	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的沪市全额现金替代	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

### 4.2.4 跨市场债券 ETF(结算时间安排同以全额现金申赎的单市场债券 ETF)

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申购的份额和现金替代	T 日 ( RTGS	T 日 ( RTGS 部分	日间 RTGS 交收+日 终逐笔全额非担保交

	部分 T 日 日间实 时 )	T 日日间实 时 )	收
赎回份额	T 日	T 日	逐笔全额非担保交收
赎回的现金替代 ( 含赎回现金替代退补款 )	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申购的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

#### 4.2.5 跨境 ETF ( 结算时间安排同以全额现金申赎的单市场债券 ETF )

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申购的份额和现金替代	T 日 ( RTGS 部分 T 日日间 实时 )	T 日 ( RTGS 部 分 T 日日间 实时 )	日间 RTGS 交收+日终 逐笔全额非担保交收
赎回份额	T 日	T 日	逐笔全额非担保交收
赎回的现金替代 ( 含赎回现金替代退补款 )	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申购的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

#### 4.2.6 黄金 ETF

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
实物申赎的份额	—	T 日	变更登记
现金申购的份额和现金替代	T 日 ( RTGS 部分 T 日 日间实 时 )	T 日 ( RTGS 部分 T 日日间实 时 )	日间 RTGS 交收+日 终逐笔全额非担保交 收
现金赎回份额	T 日	T 日	逐笔全额非担保交收
现金赎回的现金替代 ( 含赎回现金替代退补款 )	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
现金申赎的现金差额	T+N	T+N+1 日	代收代付
现金申赎的现金替代退补款	T+N	T+N+1 日	代收代付

#### 4.2.7 货币 ETF

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎的份额	T 日	T 日	多边净额结算
申赎的现金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申赎退补款 ( 如有 )	T+N	T+N+1 日	代收代付

## 4.2.8 商品期货 ETF（结算时间安排同以全额现金申赎的单市场债券 ETF）

结算内容	清算日	交收日	结算模式
交易的份额	T 日	T 日	多边净额结算
交易的资金	T 日	T+1 日	多边净额结算
申购的份额和现金替代	T 日 ( RTGS 部分 T 日日间实时 )	T 日 ( RTGS 部分 T 日日间实时 )	日间 RTGS 交收+日终逐笔全额非担保交收
赎回份额	T 日	T 日	逐笔全额非担保交收
赎回的现金替代 ( 含赎回现金替代退补款 )	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申赎的现金差额	T+N 日	T+N+1 日	代收代付
申购的现金替代退补款	T+N 日	T+N+1 日	代收代付

说明：上述 ETF 中涉及代收代付业务的清算由基金管理人负责，本公司仅负责转发清算数据，因此，其时间安排供参考，具体以基金招募说明书为准；不同代收代付业务的清算日（T+N 日）可能不同。

## 4.3 交易的清算交收

### 4.3.1 交易的清算

T 日收市后，本公司根据深交所实时传送的 T 日 ETF 交易成交数据，计算出 T 日 ETF 应收付明细及 T+1 日结算参与者应收付资金净额数据

( 详见 SJSQS.DBF 及 SJSTJ.DBF ), 发送相关结算参与人。

对于 T 日 ETF 交易资金清算净额及相关费用, 本公司于 T+1 日最终交收时点记增、记减结算参与人的结算备付金。结算参与人必须保证在最终交收时点, 其结算备付金账户有足额资金用于完成 ETF 交易资金的交收。

#### 4.3.2 交易的交收

本公司 T 日日终办理 ETF 交易份额的担保交收, T+1 日 16:00 后办理 ETF 交易资金的担保交收, 具体如下:

1. T 日日终, 本公司根据 T 日 ETF 交易的证券清算数据, 将 ETF 份额从净应付投资者证券账户划出, 通过相关证券交收账户, 最终划入净应收投资者证券账户。若投资者证券账户 ETF 份额不足, 导致证券交收违约的, 本公司按本指南 5.4 内容进行处理。

2. T+1 日 16:00 后, 根据 T 日 ETF 交易的资金清算数据, 对应记增、记减各结算参与人的结算备付金, 完成 T 日 ETF 交易资金的交收, 并向结算参与人发送资金记账数据 ( 详见 SJSZJ.DBF )。

3. 若结算参与人未能足额完成上述资金的交收, 本公司按相关规定确定待处分证券 ( 详见本指南 5.3 部分 ), 并将其划入本公司专用清偿账户。

## 4.4 申赎的清算交收

### 4.4.1 单市场股票 ETF

#### 4.4.1.1 申赎所涉组合证券、ETF 份额和现金替代的清算

T 日收市后,本公司根据深交所传送的 T 日 ETF 申赎数据,计算出 T 日 ETF 应收付的组合证券、ETF 份额明细和 T+1 日结算参与人应收付的现金替代数据(详见 SJSQS.DBF 及 SJSMX1.DBF),发送相关结算参与人。

#### 4.4.1.2 组合证券与 ETF 份额的交收

T 日收市后,本公司根据当日成交数据,在处理 A 股等基础产品证券交收的同时,办理 ETF 申赎对应组合证券的过户与 ETF 份额的交收。

##### 1、组合证券的交收过程

本公司根据 T 日 ETF 申赎的证券清算数据,将申购 ETF 所用的组合证券从投资者证券账户代为划出,通过相关证券交收账户,最终划入 ETF 证券账户;将赎回 ETF 所得的组合证券从 ETF 证券账户代为划出,通过相关证券交收账户,最终划入投资者证券账户。

##### 2、ETF 份额的交收过程

本公司根据 T 日 ETF 申赎的证券清算数据,将 ETF 份额从净应付投资者证券账户划至对应结算参与人证券交收账户,再划入本公司证券集中交收账户。

如果全市场出现 ETF 总的净申购,直接在证券集中交收账户中记增全市场净申购份额;如果 T 日全市场出现 ETF 总的净赎回,直接在本公司证券集中交收账户中记减全市场净赎回的份额。

此后,将相应 ETF 份额从本公司证券集中交收账户划至相关结算参与人证券交收账户,并代为划入净应收投资者证券账户。

### 3、交收结果数据

T 日日终，本公司向结算参与者发送投资者每个证券账户持有组合证券与 ETF 份额的明细数据（详见 SJSZJ.DBF）。

#### 4.4.1.3 申赎现金替代的交收

T+1 日 16:00，本公司进行 ETF 申赎现金替代的担保交收。

##### 1、交收过程

（1）本公司根据 T 日 ETF 申赎的资金清算数据，对应记增、记减各结算参与人的结算备付金，完成 T 日 ETF 申赎现金替代的担保交收。

（2）若结算参与者未能足额完成上述资金的交收，本公司按相关规定确定待处分证券（详见本指南 5.3 部分），并将其划入本公司专用清偿账户。

##### 2、交收结果数据

交收完成后，本公司向结算参与者发送现金替代等资金交收结果数据（详见 SJSZJ.DBF）。

#### 4.4.1.4 现金差额、现金替代退补款的清算交收

单市场股票 ETF 的申赎现金差额、现金替代退补款的清算交收，参照本指南 4.4.9 规定办理。

### 4.4.2 单市场债券 ETF

#### 4.4.2.1 以组合证券申赎的单市场债券 ETF

以组合证券申赎的单市场债券 ETF 在组合证券、申赎份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款的清算交收安排，与单市场股票 ETF 相同，具体内容参见本指南 4.4.1 部分。

## 4.4.2.2 以全额现金申赎的单市场债券 ETF

### 4.4.2.2.1 申赎份额和申购现金替代的清算

#### 1、申购份额和现金替代的清算

T日日间，本公司根据深交所传送ETF申赎数据的先后顺序，实时逐笔计算各投资者、各结算参与人的应收ETF份额及应付资金，通过D-COM系统实时发送结算参与人。

#### 2、赎回份额的清算

本公司分别计算投资者每一笔赎回应付份额及结算参与人T日应付份额总额。结算参与人应付份额总额为投资者T日赎回份额的汇总。

#### 3、清算数据的发送

除了采用RTGS交收的申购份额与现金替代清算数据实时逐笔通过D-COM系统下发外，T日日间，本公司分四批（11:30、14:30、15:00和15:30）将ETF现金申赎份额、现金申购现金替代相关明细清算数据发送结算参与人和基金管理人。其中，本公司在15:00和15:30发送的现金申赎清算数据相同，均为T日申赎最终清算数据。

### 4.4.2.2.2 申购份额和现金替代的交收

#### 1、日间RTGS交收

T日日间，申购方的结算参与人可通过D-COM系统进行勾单确认。本公司根据勾单先后顺序，按照货银对付的原则，实时进行券资的逐笔非担保交收。未勾单确认的，日间不作交收处理。

日间实时交收处理时，申购方资金不足的，交收指令将进行暂存。本公司每隔特定时段对T日所有未完成交收的指令重新进行交收处理。T

日日终时点仍未完成交收的暂存指令，将与未勾单确认指令一起，并入日终非担保交收批次进行逐笔全额非担保交收。

## 2、日终逐笔全额非担保交收

T日最终交收时点，本公司根据当日清算结果，按委托顺序逐笔办理ETF申购的证券和资金的交收，并将交收结果发送结算参与人。

本公司逐笔检查结算参与人用于交收的资金是否足额。资金足额的，本公司将投资者用于申购的资金从结算参与人结算备付金账户划拨至基金托管人以每个ETF名义单独开立的结算备付金账户；同时在基金托管人证券交收账户记增基金份额，再将基金份额划拨至结算参与人的证券交收账户，并最终划拨至投资者的证券账户。申购资金不足额的，视为交收失败，本公司不办理相关份额和资金的交收。

### 4.4.2.2.3 赎回份额的交收

T日最终交收时点，本公司根据T日清算结果，按委托顺序逐笔办理投资者ETF赎回所涉份额的交收，并将交收结果发送结算参与人。

本公司逐笔检查投资者证券账户中用于赎回的基金份额是否足额。份额足额的，将投资者用于赎回的基金份额从投资者证券账户代为划拨到结算参与人证券交收账户，再划拨到基金托管人证券交收账户后直接记减基金份额。份额不足额的，视为交收失败，本公司不办理相关份额的交收。

### 4.4.2.2.4 交收结果

上述三项业务交收完成后，本公司将向结算参与人发送证券资金的交收结果数据。

#### 4.4.2.2.5 现金差额、现金替代退补款、赎回现金替代的清算交收

以全额现金申赎的单市场债券 ETF 申赎的现金差额、现金替代退补款、赎回现金替代的清算交收，参照本指南 4.4.9 规定办理。

#### 4.4.3 跨市场股票 ETF 申赎的清算交收

##### 4.4.3.1 跨市场股票 ETF 场外组合证券申赎

###### 4.4.3.1.1 申赎流程

1. 申购赎回日（以下简称 T 日）7:30 点前，基金管理人将 T 日的申购赎回清单（以下简称“PCF 清单”）发送深交所及本公司总部。

2. T 日 8:30，本公司总部基金业务系统将该清单通过深证通 FDEP 文件传输系统发送至直销机构及其指定的代办证券公司。

3. T 日 9:30 至 15:00，投资者通过代办证券公司营业部提出 ETF 基金申购、赎回申请，代办证券公司营业部实时进行如下检查：

（1）投资者深市 A 股账户及沪市 A 股账户是否具有相同的证件号、名称及资金账号；

（2）该营业部所属交易单元必须同时为投资者深市 A 股的托管单元及沪市 A 股指定交易的交易单元；

（3）如为 ETF 基金申购申请，则检查沪市 A 股组合证券、深市 A 股组合证券及现金替代、预估现金差额是否足额；

（4）如为 ETF 基金赎回申请，则检查深市 ETF 基金份额及预估现金差额是否足额。

如上述条件均满足，则冻结相关组合证券、ETF 基金份额及相应资金；如上述任一条件不满足的，则作失败处理。

4. T 日 9:30 至 15:00，特定投资者通过基金管理人直销提出 ETF

申购、赎回申请，申请时应注意如下事项：

(1) 特定投资者应申报深市组合证券的托管单元数据及沪市组合证券的托管单元数据；

(2) 确保特定投资者深市 A 股账户及沪市 A 股账户具有相同的证件号及名称；

(3) 确保特定投资者在深市的托管银行同时为其在沪市的托管银行；

(4) 确保特定投资者沪深证券账户已通过本公司总部备案。

5. T 日 9:30 至 15:00，证券公司及基金管理人通过深证通 FDEP 消息传输系统实时向公司总部基金业务系统报送 ETF 基金份额申购赎回申请。本公司总部基金业务系统接收到数据后，进行如下检查：

(1) 数据格式：根据相关数据接口规范对各字段进行合法性检查；

(2) 代办权限：检查代办证券公司或基金管理人是否有资格办理该类业务；

(3) 基金状态（是否允许申购赎回）及特殊类业务控制状态；

(4) 根据沪深分公司提供的 T-1 日数据，检查投资者深市托管的托管单元与沪市指定交易的交易单元是否为同一代办证券公司法人所有。对于特定投资者，则检查其沪、深证券账户是否已经向本公司总部报备；

(5) 根据统一账户平台提供的 T-1 日数据，检查投资者沪深证券账户的证件号及名称是否属于同一投资者所有；

(6) 投资者的申购申请是否符合 PCF 清单；

(7) 其他检查。

对于收到的每一条申请，无论是否通过检查，本公司总部基金业务

系统都将向相关代办证券公司及基金管理人实时反馈合法性检查结果，返回代码“0000”表示通过合法性检查，否则表示失败。

6. T日 9:30 至 15:00，对于通过检查的当日 ETF 基金申购、赎回申请数据，本公司总部基金业务系统根据申请数据中的沪、深标志字段，对申购、赎回数据进行拆分，生成需要交收锁定的组合证券及 ETF 基金份额数据，并下发沪深分公司。

7. T日 15:00 至 18:00，沪深分公司在完成 T 日的所有担保交收、非担保交收及司法等引起的非交易过户后，进行如下处理：

(1) 对于申购申请，沪深分公司根据公司总部发送的指令，对相关组合证券进行交收锁定；

(2) 对于赎回申请，上海分公司对 ETF 基金管理人证券账户下的沪市组合证券进行交收锁定；本公司除对 ETF 基金管理人证券账户下的深市组合证券进行交收锁定外，还对投资者证券账户下的 ETF 基金份额进行交收锁定；

(3) 对于交收锁定业务，上海分公司采用逐笔处理原则，本公司采用分组处理的原则。

分组处理的原则是指在交收锁定的处理过程中，本公司对从本公司总部接收的交收锁定数据以组为处理单位，一笔申购或赎回对应的 ETF 份额与深市所有涉及的组合证券为一组，必须是对组内记录要同时交收锁定成功才认为成功，如有任意一条记录交收锁定失败，该组记录都做失败处理。

上述交收锁定处理完成后，沪深分公司将交收锁定结果（其中 QFII 的交收锁定结果包括 QFII 在托管银行的指定或托管单元）在 18:00 前发送本公司总部，并发各结算参与者。

8. T 日 20:00 前，本公司总部基金业务系统将接收到的沪深分公司交收锁定结果进行申赎的处理，并通过本公司总部基金业务系统，将处理结果发送给基金管理人。

9. T+1 日 11:00 之前，基金管理人将申赎的确认结果，通过基金业务系统，反馈给本公司总部基金业务系统。

10. T+1 日 15:00 前，本公司总部基金业务系统将经基金管理人确认的申赎确认结果，根据确认数据中的沪、深标志，对申赎确认数据进行拆分，生成需要解除锁定、变更登记的组合证券及 ETF 基金份额数据(其中 QFII 解除锁定及变更登记所涉证券指定交易单元或托管单元的信息为 T 日沪深分公司交收锁定时发送本公司总部的信息)，下发沪深分公司。

11. T+1 日 15:00 至 18:00，沪深分公司在完成当日的的所有担保交收及非担保交收后，根据本公司总部发送的基金管理人确认后的申赎确认结果，进行股份和基金份额的变更登记。

(1) 对于变更登记业务，上海分公司采用逐笔处理原则，本公司采用分组处理的原则。

分组处理的原则是指本公司对从本公司总部接收的数据以组为处理单位，即一笔申购或赎回对应的 ETF 份额与深市所有涉及的组合证券为一组，必须是对组内记录要同时增减份额都要成功才认为成功，如有任意一条记录过户失败，该组记录都做失败处理。

(2) 变更登记在分红派息之前处理。这种情形下，如 T 日(申赎日)同时为某只证券的股权登记日，则由于组合证券发生除权引起的 ETF 申赎对价物不足可通过现金差额方式调整；如 T+1 日为某只证券的股权登记日，则组合证券的分红派息处理不会影响到申赎的对价物。

12.上述变更登记完成后，沪深分公司将变更登记结果在 20:00 前发送本公司总部，同时发送代办证券公司、基金管理人及交易所。

T+1 日 20:00 以后，本公司总部基金业务系统汇总沪深分公司的变更登记结果，生成对各个证券公司 T 日申购赎回申请的回报数据，并通过深证通 FDEP 文件传输系统发送给各证券公司及基金管理人。

13.T+2 日，投资者申购得到的 ETF 基金份额、赎回得到的组合证券可用。

#### **4.4.3.1.2 申赎现金替代、现金差额、现金替代退补款的清算交收**

以组合证券申赎的跨市场股票 ETF，申赎的现金替代、现金差额和现金替代退补款的清算交收，参照本指南 4.4.9 规定办理。

#### **4.4.3.2 跨市场股票 ETF 场内申赎**

##### **4.4.3.2.1 申赎所涉组合证券、ETF 份额和现金替代的清算**

T 日收市后，本公司参照 A 股做法，根据深交所传送的 T 日 ETF 申赎数据，计算出 T 日 ETF 应收付深市组合证券、ETF 份额的明细数据和 T+1 日结算参与者应收付的沪市全额现金替代、深市组合证券对应现金替代数据，发送相关结算参与者。

##### **4.4.3.2.2 深市组合证券与 ETF 份额的交收**

T 日收市后，本公司根据当日成交数据，在处理 A 股等基础产品证券交收的同时，办理 ETF 申赎对应深市组合证券的过户与 ETF 份额的担保交收。

###### **1、深市组合证券的交收过程**

本公司根据 T 日 ETF 申赎的证券清算数据，将申购 ETF 所用的深市组合证券从投资者证券账户代为划出，通过相关证券交收账户，最终划入

ETF证券账户；将赎回ETF所得的深市组合证券从ETF证券账户代为划出，通过相关证券交收账户，最终划入投资者证券账户。

## 2、ETF 份额的交收过程

本公司根据 T 日 ETF 申赎的证券清算数据，将 ETF 份额从净应付投资者证券账户划至对应结算参与者证券交收账户，再划入本公司证券集中交收账户。

如果全市场出现 ETF 总的净申购，直接在证券集中交收账户中记增全市场净申购份额；如果 T 日全市场出现 ETF 总的净赎回，直接在本公司证券集中交收账户中记减全市场净赎回的份额。

此后，将相应 ETF 份额从本公司证券集中交收账户划至相关结算参与者证券交收账户，并代为划入净应收投资者证券账户。

## 3、交收结果数据

T 日日终，本公司向结算参与者发送投资者每个证券账户持有组合证券与 ETF 份额的明细数据。

### 4.4.3.2.3 申赎现金替代的交收

T+1 日 16:00，本公司参照 A 股做法，对 ETF 申赎所涉的沪市全额现金替代、深市组合证券对应的相关现金替代进行担保交收。

#### 1、交收过程

(1) 本公司根据 T 日 ETF 申赎的资金清算数据，对应记增、记减各结算参与人的结算备付金，完成 T 日 ETF 申赎现金替代的交收。

(2) 若结算参与者未能足额完成上述资金的交收，本公司按相关规定确定待处分证券(详见本指南 5.3 部分)，并将其划入本公司专用清偿账户。

#### 2、交收结果数据

交收完成后，本公司向结算参与人发送交易应收付资金净额、交易费用和现金替代等资金交收结果数据。

#### **4.4.3.2.4 现金差额、现金替代退补款的清算交收**

单市场股票 ETF 的申赎现金差额、现金替代退补款的清算交收，参照本指南 4.4.9 规定办理。

#### **4.4.4 跨市场债券 ETF 申赎的清算交收**

跨市场债券 ETF 在申赎份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款的清算交收安排与以全额现金申赎的单市场债券 ETF 相同，具体内容参见本指南 4.4.2.2 部分。

#### **4.4.5 跨境 ETF 申赎的清算交收**

跨境 ETF 在申赎份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款的清算交收安排，与以全额现金申赎的单市场债券 ETF 相同，具体内容参见本指南 4.4.2.2 部分。

#### **4.4.6 黄金 ETF 申赎的清算交收**

##### **4.4.6.1 实物申赎的清算交收**

对于黄金 ETF 实物申赎，本公司不负责清算，日终直接根据深交所成交数据进行份额交收，具体处理如下：

1. 对于投资者实物申购黄金 ETF 的，本公司根据深交所数据，在 T 日日终直接记增投资者证券账户黄金 ETF 份额；
2. 对于投资者实物赎回黄金 ETF 的，本公司根据深交所数据，在 T

日日终直接记减投资者证券账户 ETF 份额。

本公司日间将深交所发送的实物申赎成交数据直接转换成实物申赎清算数据，分四批（11:30、14:30、15:00 和 15:30）发送，其中，本公司在 15:00 和 15:30 发送的实物申赎清算数据相同，均为 T 日申赎最终清算数据，日终则发送 ETF 份额变更登记结果（详见 SJSJG.DBF）。

#### 4.4.6.2 现金申赎的清算交收

黄金 ETF 的现金申赎，在申赎份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款的清算交收安排，与以全额现金申赎的单市场债券 ETF 相同，具体内容参见本指南 4.4.2.2 部分。

#### 4.4.7 货币 ETF

##### 4.4.7.1 申赎份额和现金的清算

T 日收市后，本公司根据深交所传送的 T 日 ETF 申赎数据计算出 T 日应收付的 ETF 份额明细数据及 T+1 日结算参与者应收付的现金数据（详见 SJSQS.DBF 及 SJSMX1.DBF），发送相关结算参与者。

##### 4.4.7.2 申赎份额和现金的交收

本公司 T 日日终办理 ETF 申赎份额的担保交收，T+1 日 16:00 后办理申赎现金的担保交收。

###### 1、申赎份额的交收

(1) T 日日终，本公司根据 T 日 ETF 申赎的证券清算数据，将 ETF 份额从净应付投资者证券账户划至对应结算参与者证券交收账户，再划入本公司证券集中交收账户。

如果全市场出现 ETF 总的净申购，直接在证券集中交收账户中记增

全市场净申购份额；如果 T 日全市场出现 ETF 总的净赎回，直接在本公司证券集中交收账户中记减全市场净赎回的份额。

此后，将相应 ETF 份额从本公司证券集中交收账户划至该结算参与人证券交收账户，并代为划入净应收投资者证券账户。

(2) T 日日终，本公司向结算参与人发送投资者每个证券账户持有 ETF 份额的明细数据。

## 2、申赎现金的交收

(1) T+1 日 16:00，本公司根据 T 日 ETF 申赎的资金清算数据，对应记增、记减各结算参与人的结算备付金，完成 T 日 ETF 申赎现金的交收。

(2) 交收完成后，本公司向结算参与人发送资金交收结果数据(详见 SJSZJ.DBF、SJSJG.DBF 及 SJSDZ.DBF)。

### 4.4.7.3 退补款（如有）的清算交收

货币 ETF 如存在退补款项，该退补款的清算交收，参照本指南 4.4.9 规定办理。

### 4.4.8 商品期货 ETF

商品期货 ETF 在申赎份额、现金替代、现金差额、现金替代退补款的清算交收安排，与以全额现金申赎的单市场债券 ETF 相同，具体内容参见本指南 4.4.2.2 部分。

## 4.4.9 代收代付业务的清算交收

### 4.4.9.1 代收代付业务的清算

对于代收代付业务,基金管理人需于 T+N 日 13 :30 前通过 D-COM 向本公司发送资金清算数据( 详见 GLRQS.DBF )。本公司收到清算数据后, 随即向基金管理人反馈资金清算数据的检查结果( 详见 GLRFK.DBF )。

T+N 日日终,本公司向结算参与者发送代收代付业务相关清算数据( 详见 SJSQS.DBF 及 SJSMX2.DBF )。

### 4.4.9.2 代收代付业务的交收

在办理代收代付业务的交收时,本公司按如下原则办理:

1、T+N+1 日,本公司在完成所有净额担保交收和逐笔全额非担保交收后,根据 T+N 日收到的基金管理人发送的清算数据进行资金代收代付。具体 N 的取值详见《基金招募说明书》的规定( 对于跨市场股票 ETF 申赎现金差额清算数据的 N 取值为 1 )。

2、若同一天基金管理人兼有向结算参与者退还款项和补收款项的业务,本公司先办理基金管理人补收款业务,后办理退还款业务。

#### 3、补收款处理方式

① 本公司首先办理申购现金替代的资金代收付,再办理现金差额、退补款的资金代收付。

#### ② 申购现金替代的资金代收代付

本公司合并当日结算参与者所有 ETF 现金替代的应付资金总和,若结算参与者结算备付金余额可以全额满足所有 ETF 现金替代汇总资金的划付,本公司方予以办理;若结算参与者结算备付金余额未能全额满足所有 ETF 现金替代汇总资金的划付,本公司不予办理,基金管理人可

再次向本公司发送相关清算数据，由本公司组织进行再次资金划付。

③ 现金差额、退补款的划付原则同现金替代资金的划付。

④ 基金管理人申请办理含有补收款项的代收代付业务前，应自行先与相应作为销售代理的结算参与者协商，确保结算参与者及相关持有人层面的资金充足。因资金不足导致代收代付失败或产生扣收错误，造成任何损失或引发法律风险的，由基金管理人与相关方自行协商解决后续事宜，本公司不承担相关法律责任。

#### 4、退款处理方式

① 本公司按照基金收益、赎回现金替代、现金差额、退补款的顺序办理资金代收付。

② 赎回现金替代的代收付。本公司合并计算基金管理人所有 ETF 赎回现金替代的应付资金总和，若 ETF 结算备付金账户余额不小于基金管理人所有 ETF 赎回现金替代的应付资金总和，则我司根据清算数据将应付资金从 ETF 结算备付金账户划至结算参与者结算备付金账户；否则，本公司不予办理，基金管理人可再次向本公司发送相关清算数据，由本公司组织进行再次资金划付。

③ 基金收益、现金差额、退补款的划付原则同赎回现金替代的划付。

#### 5、交收结果数据

交收完成后，本公司向结算参与者发送代收代付资金交收结果（详见 SJSZJ.DBF 及 SJSJG.DBF）。

## 五、 风险管理

### 5.1 结算参与人管理

1、参与纳入净额结算服务的 ETF 申购及赎回的代办证券公司必须通过本公司总部的资格审核。

2、本公司将对结算参与人的 ETF 交易、纳入净额结算的 ETF 申购及赎回进行实时监控，一旦发现结算参与人可能发生违约交收风险，本公司将立即警示该结算参与人，在必要时提请深交所采取相应的限制措施，并上报证监会备案。

3、本公司有权对结算风险较大的结算参与人调整最低结算备付金缴存比例、要求其提供结算信用担保或结算抵押品，或暂停该结算参与人 ETF 交易、申购及赎回结算资等风险管理措施。

### 5.2 货币 ETF 申赎的额度管理

对于货币 ETF，基金管理人应对其申购、赎回分别实施额度控制。

货币 ETF 管理人应以当日货币 ETF 的现金类资产（银行存款及银行承兑汇票）规模与货币 ETF 自身获得的银行授信（简称直接授信）之和为上限，设置次一交易日该 ETF 的申购、赎回额度。

本公司根据净额结算风险控制需要，结合托管人报送的该货币 ETF 现金类资产数据，对其次一交易日适用的申购额度、赎回额度进行审核确认。

本公司可根据市场状况等因素对上述限额进行调整，并提请深交所于下一交易日对货币 ETF 的申购赎回规模进行控制。

### 5.3 资金交收违约处理

最终交收时点，结算参与者未完成资金交收义务，出现结算备付金账户透支的，本公司将有权采取以下措施：

1、按照违约结算参与者向本公司提交的《待处分证券申报表》(见附件十四)，扣划违约结算参与者指定的相应证券作为待处分证券进入本公司专用清偿账户。

2、对违约交收金额按千分之一以自然日逐日计收违约金，并根据违约交收金额按本公司的结息利率以自然日逐日收取垫付利息。

3、限制质押券出库及限制转托管等措施，并采取其他处置措施。

4、按照中国结算自律管理相关规则的规定实施相应的自律管理措施，并报告中国证监会。

5、视结算参与人的违约程度，提高其结算备付金最低限额标准、结算保证金收取标准。

6、其他风险管理措施。

### 5.4 证券交收违约处理

结算参与人在最终交收时点，未能足额履行纳入净额结算的 ETF 份额交收义务的，本公司将其卖空资金作为待处分资金划入专用清偿账户，并有权采取以下措施：

1、要求该结算参与者及时补购未交付的 ETF 份额；

2、动用待处分资金代该结算参与者补购相应 ETF 份额，并弥补权益、违约金；

3、待处分资金不足的，本公司将动用其结算保证金等，仍不足的，本公司将继续追偿；

- 4、没收该结算参与人的卖空所得；
- 5、按证券交收违约金额的千分之一以自然日逐日计收交收违约金；
- 6、按照中国结算自律管理相关规则的规定实施相应的自律管理措施，并报告中国证监会。

## 5.5 待处分证券处置

本公司扣划相关待处分证券后，有权按以下规定进行处置：

- 1、处置待处分证券，处置所得用于弥补结算参与人的违约交收金额；
- 2、若处置所得不足以弥补违约交收金额，本公司将继续追偿，包括扣划该结算参与人 T 日 ETF 份额赎回所得的相关组合证券。

## 六、 附则

### 6.1 本公司收费标准

#### 1、向基金管理人收取的费用

收 费 项 目	标 准
申购/赎回登记结算费(货币 ETF 除外)	每年 30 万元。按实际月份数收取,即初始登记当年的年费自基金份额登记当月起(含当月)按实际存续月份折算收取,退出登记当年的年费自退出登记次月起不再收取

货币 ETF 登记结算服务费	每年 15 万元。 按实际月份数收取,即初始登记当年的年费自基金份额登记当月起(含当月)按实际存续月份折算收取,退出登记当年的年费自退出登记次月起不再收取。
分红派息手续费	现金总额的 1‰,手续费金额超过 300 万元以上的部分免收

## 2、向投资者收取的费用：

收 费 项 目	标 准	备 注
组合证券过户费	面值 0.5‰	对于用股票篮子换取 ETF 基金,或用 ETF 基金换取股票篮子,引起的投资者与基金管理公司之间的股票过户,仅向投资者单向收取过户费。
非交易过户费	100 元/笔	向转让双方收取。

备注：①根据《关于交易型开放式指数基金（ETF）相关费用减免的通知》，对于投资者在跨市场股票 ETF 申购赎回过程中涉及深市组合证券的过户费，目前减半收取。上海市场的组合证券过户费，在 ETF 成立后三年内按正常标准减半收取；②对于跨市场股票 ETF 申购赎回业务，按照上述标准执行时，向基金管理人收取的费用，由负责办理 ETF 份额登记业务的分公司收取；向投资者收取的费用，由办理业务的分公司收取。③对于债券类 ETF，免收组合证券过户费。

## 3、其他费用

本公司按 ETF 成交金额的 0.03‰向结算参与者收取结算风险基金。

对于货币 ETF，本公司将按照申购或赎回所涉基金份额面值的

0.001%向结算参与人收取结算费，但现阶段暂免收取，以后可视市场状况调整。

本公司对上述各项收费项目及标准进行变更的，以最新公布的收费项目及标准为准。

## 6.2 深交所及其他机构收费

ETF 交易的税费标准比照深交所封闭式基金交易的税费标准；ETF 申购及赎回的税费根据深交所公布的标准办理。

## 6.3 业务咨询电话

单位	业务部门	主要负责业务	联系电话	传真电话
中国 结算 深圳 分公 司	投资者业务部	证券账户管理、 基金非交易过户 协助执法	0755—21899150 0755—21899121	
	发行人业务部	证券登记、转托管、权益分派、 调账、证券清算与交收	0755—21899329 0755—21899321	0755-25987132 0755-25987133
	结算业务部	资金清算与交收	0755—21899208	0755-25987433 0755-25987422
	技术开发部	结算系统运作及技术支持	0755—25946080	
	系统运行部		0755—25987818	
	业务发展部	综合业务咨询与协调	0755—21899269	
	中国 结算 公司 总部	基金业务部业 务人员	组合证券认购、申购与赎回	010-50938782 010-50938697
基金业务部技 术人员		组合证券认购、申购与赎回技 术支持	010-50938605	010-50938907

## 6.4 查询网站

中国结算公司业务查询网站：<http://www.chinaclear.cn/>

## 6.5 数据接口下载

本指南业务所涉数据接口文件的详细说明请参见《深圳证券交易所数据接口规范》、《中国结算深圳分公司结算参与人数据接口规范》和《基金管理人登记结算数据接口规范》，可在本公司网站（[www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn)）和深交所网站技术专栏（[www.szse.cn](http://www.szse.cn)）下载。

附件一：

## 特定投资者开通直销 ETF 场外组合证券申购赎回业务报备表

中国证券登记结算有限责任公司：

我方拟通过 XX 基金管理公司直销办理 XX 跨市场股票 ETF 的申购赎回业务，我方已与 XX 基金管理公司签订了 ETF 申购赎回直销业务协议，委托 XX 基金管理公司直销代理我方向贵公司申报 ETF 申购赎回业务申请。我方认可贵公司将从 XX 基金管理公司直销收到的我方 ETF 申购赎回业务申请视为我方的真实意愿表示，并按时足额履行相关证券和资金交收义务，因申购赎回申报方面引发的业务纠纷与贵公司无关。为了开通直销 ETF 申购赎回业务，我方现将有关信息报备如下：

投资者名称			
投资者证件号码			
托管人			
上海证券账户		深圳证券账户	
沪市托管单元		深市托管单元	
特定投资者盖章确认：  经办人： 联系电话：  报备方：（加盖公章） 年 月 日	托管人盖章确认： 我方对上述报备事项无异议。 经办人： 联系电话：  托管人：（加盖托管业务章） 年 月 日		

附件二：

## 深圳分公司关于纳入净额结算货币 ETF 产品方案的审核程序和标准

为支持基金市场发展，配合市场创新，防范结算风险，根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）相关规则，中国结算深圳分公司制定了纳入净额结算货币 ETF 产品业务方案的审核程序和审核标准。

### 一、基本原则

（一）透明公正。根据审核程序和审核标准，对提交的货币 ETF 产品方案进行透明、公正及合理的评审。

（二）择优选择。审核主要针对与货币 ETF 登记结算相关的内容，选择业务及技术准备工作充分、产品方案可行、风险措施完善的基金公司开展货币 ETF 业务。

### 二、审核程序

对纳入净额结算货币 ETF 产品方案的评审分为两个阶段，初审和复审。

#### （一）初审

##### 1、接受申请材料

基金公司申请开发货币 ETF 产品，应当向深圳分公司业务发展部提交书面申请。书面申请材料，应包括但不限于以下内容：

（1）货币 ETF 产品业务运作和技术实现方案；

- ( 2 ) 产品可行性分析 ;
- ( 3 ) 风险 ( 特别是流动性风险 ) 与防范措施 ;
- ( 4 ) 投资者保护和风险提示 ;
- ( 5 ) 货币 ETF 管理应急预案 ;
- ( 6 ) 基金公司与托管银行签订证券资金结算协议的情况说明 ;
- ( 7 ) 货币 ETF 的银行授信情况说明 ( 如有 ) ;
- ( 8 ) 基金公司开展货币 ETF 管理运作经验的说明 ;
- ( 9 ) 技术准备情况及内部业务流程安排 ;
- ( 10 ) 货币 ETF 招募说明书 ;
- ( 11 ) 货币 ETF 基金合同 ;
- ( 12 ) 业务及技术联络人信息表 ;
- ( 13 ) 中国结算深圳分公司要求的其他资料。

## 2、初审标准

初审由深圳分公司业务发展部负责。审核内容主要包括申请资料是否完备及是否满足标准 ( 详见附件 1 )。

## 3、初审意见反馈

初审完成后，由业务发展部向基金公司反馈初审意见。

### ( 二 ) 复审

进入复审阶段后，由分公司组织专家小组，对产品方案进行专业评价和审议。

#### 1、专家小组

专家小组由 5-10 人构成，其中组长由分公司相关领导担任，成员

由分公司内结算业务部、技术开发部、法律部、发行人业务部、系统运行部、业务发展部等以及公司总部、深交所基金管理部等专家组成。

## 2、复审流程

i 基金管理公司从产品可行性、法律关系、风险防范措施及技术准备情况等几个方面介绍产品方案，并回答专家小组的提问；

ii 专家小组按照评分标准，对基金管理公司的汇报及回答进行评审（复审标准见附件 2）；

iii 业务研发部在专人监督下对专家评审结算进行统计。

对单个专家的评审结果，评审得分 80 分以上的，确定为同意该方案，否则为不同意该方案。当“同意该方案”的专家人数达到总专家人数的三分之二以上的，确定为评审通过，否则为评审未通过。

## 3、复审意见反馈

分公司在组织专家评审后，确定评审结果，并根据评审结果在 10 个工作日内决定是否出具无异议函，同时将产品审核情况及时向公司总部报备。对于未通过评审的基金公司方案，以邮件或电话形式反馈评审结果和评审改进意见。

出具无异议函后，拟申请的创新产品方案出现涉及交易、登记、结算等重要事项发生变更的，基金公司应当及时报告分公司，并取得分公司认可，分公司在认为必要时，可要求专家评审委员会进行重新审定，并就相关事宜报备公司总部。

## 附件 1：初审标准

1、报送方案内容详实，包括且不限于运作流程与模式、产品可行性分析、风险（特别是流动性风险）与防范措施、投资者保护和风险提示、申购赎回权限终止的情形等；

2、具备技术开发实施条件；

3、具有三年以上的货币市场基金运作管理经验；

4、基金公司承诺在试点业务开展前，将与其托管银行签订证券资金结算协议，在协议中明确清算交收流程与各项风险管理措施，同时于试点业务开展前，将上述协议向分公司报备。

## 附件 2：复审标准

专家小组评审表

序号	项目	满分	评分	备注
1	业务可行性	20		◇ 业务可行性分析； ◇ 与托管人签订证券资金结算协议的情况； ◇ 业务方案与现有规则是否协调，是否有个性化需求。
2	法律关系	30		◇ 基金公司与结算公司之间权利义务描述是否妥当； ◇ 对投资者的权利义务有无描述，有无保护投资者权益的特别条款或措施； ◇ 发生交收违约情形下的法律责任是否清晰，有无限制申赎情形下结算公司的免责条款，或由其负责解决涉及结算公司纠纷的承诺。
3	风险防范	30		◇ 业务流程及稽核程序是否完备； ◇ 从银行获取的授信额度及投资

	措施			<p>组合的变现能力；</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>◇ 货币基金运作管理经验；</li> <li>◇ 是否制定风险应急预案；</li> <li>◇ 近五年托管人最低备付金情况、是否发生资金划拨预警、是否发生交收违约等；</li> <li>◇ 联系人信息是否有效并及时变更。</li> </ul>
4	技术准备情况	20		<ul style="list-style-type: none"> <li>◇ 系统接入是否准备就绪？包括交易所和结算公司系统。</li> <li>◇ 是否有个性化技术要求，是否需改造结算系统？</li> <li>◇ 是否通过仿真测试和全网测试？需提供测试报告。</li> <li>◇ 是否向交易所发送昨日净值？</li> </ul>
合计		100		

附件三：

## 投资者沪、深证券账户同一性检查数据接口规范 (以深沪组合证券认购或申购的ETF适用)

### 1、管理人向我公司申报账户检查的数据接口规范

文件名：gg\_深圳上海账户信息文件yyyymmdd.xls（注：其中gg为管理人代码，yyyymmdd为日期信息）

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1		账户名称	C	80	
2		证件号码	C	40	
3		深圳账户	C	10	
4		上海账户	C	10	

- (1) 该文件为EXCEL版文件；
- (2) 该文件由管理人于L日（L为认购结束日）发送给中国结算总部。

### 2、我公司向管理人反馈账户检查结果的数据接口规范

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1		深股东账户	C	10	
2		沪股东账户	C	10	
3		深股东名称	C	80	
4		沪股东名称	C	80	
5		深证件类型	C	1	
6		沪证件类型	C	1	
7		深证件代码	C	40	
8		沪证件代码	C	40	
9		是否一致	C		
10		不一致原因	C		

说明：中国结算总部在L日日终将该文件发送给管理人，管理人应核对检查结果中账户名称、证件类型、证件号码与投资者申报的一致

附件四：

**沪市认购 ETF 组合证券冻结申请表**  
**( 以深沪组合证券认购的 ETF 适用 )**

中国证券登记结算有限责任公司：

\_\_\_\_\_（以下简称本公司）\_\_\_\_\_基金（代  
码：\_\_\_\_\_）申请对认购人用于网下认购 ETF 份额的组合证券共计\_\_\_\_\_户  
股予以冻结。本公司保证所提供的证券冻结数据和有关资料（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  
冻结申请事宜，包括其对本公司提供的证券冻结数据打印书面清单进行确认。

附件：证券冻结清单

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：

附件五：

## 沪市证券冻结电子申报数据接口 (以深沪组合证券认购的ETF适用)

文件名: rgdj\*\*\*\*\*.dbf, 其中\*\*\*\*\*为基金代码

字段名称	字段类型	字段长度	字段描述
Pstxh	P 数值型	9	序号
Pstsqsh	A 英文字符型	9	申请书号, 格式为“四位申请书号+五位顺序编号”
Pstdjyy	A 英文字符型	1	冻结原因, 固定填写“6”
Pstsqdw	O 中文字符型	40	申请单位
Pstzqzh	A 英文字符型	10	股东代码
Psttgd	P 数值型	9	证券代码
Pstzqlb	A 英文字符型	2	证券类型, 固定填写“PT”或“GZ”
Pstltlx	A 英文字符型	1	流通类型, 固定填写“0”
Pstqylb	A 英文字符型	2	权益类别, 固定填写空
Pstgpnf	P 数值型	4	挂牌年份, 固定填写空
Pstdjsl	P 数值型	11	冻结数量
Pstdjdx	A 英文字符型	1	冻结对象, 固定填写“1”
Pstdjbz	A 英文字符型	1	冻结标志, 固定填写“0”
Pstsgbz	A 英文字符型	1	送股标志, 固定填写“0”
Psth1bz	A 英文字符型	1	红利标志, 固定填写“0”
Pstdxbz	A 英文字符型	1	兑息标志, 固定填写“0”
Pstfybz	A 英文字符型	1	费用标志, 固定填写“0”
Pstsfwx	A 英文字符型	5	收费结算单元, 固定填写空
Pstzdjdbz	A 英文字符型	1	自动解冻标志, 固定填写“1”
Pstzdjdrq	P 数值型	8	自动解冻日期
Pstslbh	A 英文字符型	9	受理编号, 固定填写空
Pstsbhy	A 英文字符型	8	申报会员, 固定填写空
Pstbybz1	A 英文字符型	1	备用标志一, 固定填写空
Pstbz	O 中文字符型	40	备用标志, 固定填写空
Pstah	O 中文字符型	40	案号, 固定填写空
Pstsqzxr	O 中文字符型	40	申请执行人, 固定填写空
Pstydjbh	A 英文字符型	9	原冻结编号, 固定填写空
Pstlhzx	A 英文字符型	1	轮候指向, 固定填写空
Pstdjms	A 英文字符型	1	冻结模式, 固定填写“1”

附件六：

**深市组合证券调入证券认购专户申请表**  
**(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)**

中国证券登记结算有限责任公司：

我公司\_\_\_\_\_基金（代码：\_\_\_\_\_）已于\_\_\_\_年\_\_月\_\_日发行结束，现申请将以下组合证券共计\_\_\_\_\_户\_\_\_\_\_股转移到证券认购专户，证券认购专户号码为\_\_\_\_\_；账户名称为\_\_\_\_\_。本公司保证所提供的证券调账数据完整、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调账申请事宜，包括其对本公司提供的组合证券批量调账书面清单进行确认。

附件：证券调账清单

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：

附件七：

## 深市批量调账电子申报数据接口

(以深沪组合证券认购的ETF适用)

ETF网下实物股票认购委托 (TZQDK.dbf)

字段名称	类型	长度	备注
TZWTCGD	C	20	申请认购股东的证券账户，必填字段
TZWTRGD	C	20	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	8	申请认购的成分股证券代号
TZWGFXZ	C	2	流通股“00”
TZWTLX	C	1	无特殊限制条件“0”
TZWTZGS	N	17,2	申请认购的成分股股数
TZWCLBZ	C	1	处理标志，填入空格

附件八：

## 指定联络人授权委托书

(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)

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

附件九：

## 沪市股份冻结结果数据接口

(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)

文件名：djjg\*\*\*\*\*.mdd，其中\*\*\*\*\*为基金代码

字段名	字段描述	类型	长度	备注
Djbh	冻结编号	C	9	
Zqzh	证券帐号	C	10	
Zqdm	证券代码	C	6	
Djzl	冻结数量	N	11	
Zzrq	终止日期	C	8	

附件十：

## 深市批量调账结果数据接口

(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)

深市 ETF 网下实物股票认购委托检查结果 (tzmx.dbf)

字段名	字段描述	类型	长度	备注
WTKYWBH	业务编号	A	16	结算公司内部使用的业务单号
WTKTCGD	调出股东	A	20	申请认购的股东的证券账户
WTKTRGD	调入股东	A	20	ETF 发行认购专户
WTKTCXW	转出席位	A	6	申请认购的股东的托管单元
WTKTRXW	转入席位	A	6	专用席位“XXXXXX”
WTKZQDH	证券代号	A	8	申请认购的成分股证券代号
WTKGFXZ	股份性质	A	2	流通股“00”
WTKLTLX	流通类型	A	1	无特殊限制条件“0”
WTKTZGS	调帐股数	P	17,2	申请认购的成分股股数
WTKCWDH	错误代号	A	4	空表示调账成功，非空表示调账失败的原因
WTKCLBZ	处理标志	A	1	Y=处理完成；E=处理错误；

附件十一：

## 认购 ETF 组合证券过户申请表

(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)

中国证券登记结算有限责任公司：

\_\_\_\_\_ (以下简称本公司) \_\_\_\_\_ 基金 (代码：\_\_\_\_\_) 已于 \_\_\_\_ 年 \_\_\_\_ 月 \_\_\_\_ 日发行结束，现申请将认购人已冻结用于网下认购 ETF 份额的沪市组合证券共计 \_\_\_\_\_ 户 \_\_\_\_\_ 股自认购人证券账户过户至沪市 ETF 证券账户 (账户名称：\_\_\_\_\_ 账户号码：\_\_\_\_\_ )。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：\_\_\_\_\_ 托管单元：\_\_\_\_\_ 托管单元名称：\_\_\_\_\_ )，

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：

附件十二：

## 组合证券过户电子申报数据接口

(以深沪组合证券认购的ETF适用)

### 1、沪市组合证券过户电子数据

文件名：gpgH\*\*\*\*\*.dbf，其中\*\*\*\*\*为基金代码

字段名称	字段类型	字段长度	字段描述
Intsqsh	A 英文字符型	9	申请书号，格式为“四位申请书号+五位顺序编号”
Intgrdm	A 英文字符型	10	基金在上海分公司开立的证券账户号
InttgdM	P 数值型	9	证券代码
Intzqlb	A 英文字符型	2	证券类型，固定填写“PT”或“GZ”
Intltlx	A 英文字符型	1	流通类型，固定填写“0”
Intqylb	A 英文字符型	2	权益类别，固定填写空
Intgpnf	P 数值型	4	挂牌年份，固定填写空
Intghsl	P 数值型	11	过户冻结数量
Intcjjg	P 数值型	7	成交价格，固定填写空
Intcgbz	A 英文字符型	1	成功标志，固定填写空
Intsbxx	0 中文字符型	40	失败信息，固定填写空
Intbz1	A 英文字符型	1	备用标志，固定填写空
Intbz	0 中文字符型	40	备注，固定填写空

### 2、深市组合证券过户委托 (TZQDK.dbf)

字段名称	类型	长度	备注
TZWTCGD	C	20	ETF 发行认购专户
TZWTRGD	C	20	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	8	成分股证券代号
TZWGFXZ	C	2	流通股“00”
TZWTLX	C	1	无特殊限制条件“0”
TZWTZGS	N	17,2	成分股股数
TZWCLBZ	C	1	处理标志，填入空格

附件十三：

**权益转移申请表**  
(以深沪组合证券认购的 ETF 适用)

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

附件十四：

### 待处分证券申报表

结算参与人名称：

结算备付金账号：

填表时间： 年 月 日

结算参与人填写	交易单元号码	证券账户号码	证券代码	证券数量(份)	买入日期
中国结算深圳分公司填写	经办人：		联系电话：		
	负责人：				
	日期：		预留印鉴		
中国结算深圳分公司填写	经办人：				
	负责人：				
	日期：		盖章：		