

# 关于调整沪市债券质押式回购现金担保品业务的通知

各结算参与者：

为方便结算参与者管理债券质押式回购业务风险，进一步提高业务办理效率，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下简称“本公司”）将于 2020 年 9 月 14 日起调整沪市债券质押式回购现金担保品（以下简称“现金担保品”）业务，现就有关事项通知如下：

一、结算参与者可通过 PROP 综合业务终端（风险管理→债券质押式回购→现金担保品指令申报）或 PROP 通用接口软件向本公司申报提交或返还指定证券账户的现金担保品。现金担保品指令申报时间为每个交易日 8:30-15:30。

二、结算参与者申报提交、返还现金担保品时，应填报指定的证券账户和对应的担保结算备付金账户。系统校验 PROP 用户、指定证券账户、指定结算备付金账户的对应关系，校验通过则生成指令，否则不生成指令，并实时反馈错误信息。

三、本公司实时处理 PROP 现金担保品提交申报指令。可提交的现金担保品最大数量为指定担保结算备付金账户的当前可用余额。可用余额足额的，本公司实时划拨资金；可用余额不足额的，申报失败，该笔指令失效，系统不进行后续处理或重复处理，结算参与者可根据结算备付金账户当前可用余额，

重新申报提交现金担保品。

四、本公司日终处理 PROP 现金担保品返还申报指令。在日终质押券第二次出库后、当日兑付清算债券的出库前，本公司以 PROP 申报顺序逐笔处理当日申报的现金担保品返还指令。可返还的现金担保品最大数量= $\text{Max}[\text{指定证券账户的当前现金担保品余额} + \text{Min}(\text{该证券账户的当前标准券余额}, 0), 0]$ ，即现金担保品返还不会导致该证券账户欠库。对每一笔返还申报，实际返还的现金担保品数量= $\text{Min}(\text{申报返还数量}, \text{可返还的现金担保品最大数量})$ 。

五、结算参与人可通过 PROP 综合业务终端（风险管理→债券质押式回购→现金担保品指令查询）或 PROP 通用接口软件，查询当日通过 PROP 申报的符合要求的现金担保品指令及指令处理结果。现金担保品指令查询时间为每个交易日 8:30-17:00。

六、每个交易日日终，本公司通过业务回报文件（ywhb），向结算参与人发送当日申报的符合要求的现金担保品指令处理结果。

七、具体调整情况详见《中国证券登记结算有限责任公司上海分公司结算账户管理及资金结算业务指南》（[www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn)→法律规则→业务规则→清算与交收→上海市场）。

八、请各结算参与人于 9 月 14 日调整生效后及时进行以

下 PROP 服务类型的赋权工作:

| 业务说明      | 业务域名   | 业务名称 | 业务代码 |
|-----------|--------|------|------|
| 现金担保品指令申报 | SSCCRC | CGXT | 58   |
| 现金担保品指令查询 | SSCCRC | CGXT | 59   |

联系人: 021-50923505 (业务); 021-68872966 (技术)。

请各结算参与者做好业务和技术准备。

特此通知。

二〇二〇年九月十一日