

关于修订并发布《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划登记结算业务运作指引》的通知

中国结算发字〔2020〕195号

中国结算开放式基金登记结算系统各参与者：

为进一步规范中国证券登记结算有限责任公司（以下简称我公司）开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划登记结算业务运作，我公司对《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划登记结算业务运作指引》进行了修订，现予发布并自2020年9月28日起实施。我公司于2011年8月3日发布的《开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划登记结算业务运作指引》（中国结算发字〔2011〕222号）同时废止。

特此通知。

附件：中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划登记结算业务运作指引

中国证券登记结算有限责任公司

2020年9月28日

附件：

中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划 登记结算业务运作指引

第一章 总则

第一条 为了规范开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划（以下统称“基金”）登记结算业务运作，明确管理人、基金销售机构等参与主体的业务职责，根据《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》及相关业务规定制定本业务运作指引。

第二条 管理人、基金销售机构通过中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“本公司”）电子化基金登记结算系统（以下简称“基金系统”）办理相关基金登记结算业务时应遵照本业务运作指引的相关规定。

第三条 本业务运作指引中的业务用语含义除特别说明外，与《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》中的含义一致。

第四条 本公司将根据基金系统最新发展不时更新本业务运作指引，并及时通过本公司网站（www.chinaclear.cn）

对基金业务参与人进行发布。

第二章 基金系统工作时间安排

第五条 本公司基金系统工作日（以下简称“工作日”）为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。

第六条 在工作日，本公司接收基金销售机构申报的基金账户类及交易类业务申请等数据，向基金销售机构发送基金行情、基金交易预汇总、基金回报与资金清算、基金份额对账等数据。

基金销售机构应将在非工作日期间（如周六、日或节假日）受理的基金账户类及交易类业务申请归入下一个工作日的基金账户类及交易类业务申请数据中一并发送给本公司。

第七条 在工作日，本公司接收管理人发送的基金行情、基金交易确认等数据，向管理人发送基金交易预汇总、基金交易待确认、基金回报与资金清算、基金份额对账等数据。

第八条 在工作日，本公司通过资金交收系统为基金业务参与人办理相关基金资金结算业务。

第三章 基金行情数据转发

第九条 管理人应于每个工作日日终规定时点前（具体时点要求见附件《数据传输安排》，下同），将所管理的全部基金当日的基金净值及下一工作日的基金交易状态等基金

行情数据发送给本公司。

对于 QDII 基金、场外 ETF 基金，管理人应于每个工作日向本公司发送申购净值、赎回净值及普通（揭示）净值。

第十条 如果管理人未能在本公司规定时点前将当日基金行情数据文件送达本公司，或基金行情数据文件遗漏部分基金行情数据，本公司有权按与上一工作日基金行情数据相同的基金净值及下一工作日基金交易状态对相关基金进行当日业务处理。

第十一条 本公司收到管理人发送的当日基金行情数据后，于下一工作日规定时点前将基金行情数据、结算席位数据与参数类汇总数据转发给相关基金销售机构。

第四章 基金账户类及交易类业务申请报送

第十二条 基金销售机构受理投资者基金账户开立、资料变更、账户注销、非居民涉税信息报送、反洗钱信息报送等账户类业务申请，以及认购、申购、赎回、基金转换、转托管、分红方式变更等交易类业务申请，于每个工作日日终规定时点前将前述基金账户类及交易类业务申请数据发送给本公司。

在当日没有基金账户类或交易类业务申请发生的，基金销售机构也应于日终规定时点前向本公司发送空文件。

第十三条 如果基金销售机构未能在本公司规定时点前

将当日基金账户类或交易类业务申请数据送达本公司，本公司有权按当日无相关业务申请的方式（空文件）处理该基金销售机构当日的基金账户类或交易类业务申请。

第十四条 基金销售机构应按照本公司最新发布的《中央数据交换平台开放式基金业务数据交换协议》，向本公司报送基金账户类及交易类业务申请数据。对于数据交换协议中规定的必填字段信息项，基金销售机构在报送的业务申请数据中必须填写内容，不能为空，否则本公司将该业务申请作无效申报处理。

第五章 基金交易预汇总处理

第十五条 本公司于每个工作日日终收到基金销售机构发送的基金账户类及交易类业务申请数据后，进行基金交易预汇总处理，并将基金交易预汇总处理结果数据发送给基金销售机构及相关管理人。

第十六条 基金销售机构及管理人应及时接收和查看本公司发送的基金交易预汇总处理结果数据，如发现数据差错、遗漏或其他异常，应及时联系本公司。

第六章 基金交易待确认处理

第十七条 本公司收到基金销售机构发送的当日基金账户类业务申请数据后，进行基金账户类业务数据处理。本公

司收到管理人发送的当日基金净值数据、基金销售机构发送的当日基金交易类业务申请数据后，进行基金交易类业务申请数据处理。

管理人所有基金的全部基金销售机构的当日基金账户类及交易类业务申请数据处理完成后，本公司生成基金账户通知、非居民涉税信息、反洗钱信息等账户类业务数据，以及基金交易待确认数据，发送给该管理人。

对于 QDII 基金，管理人可以在申请日之后向本公司发送申请日基金净值数据，本公司于收到管理人发送的申请日基金净值数据之日，对相应申请日的基金交易类业务申请数据进行处理，生成基金交易待确认数据发送给该管理人。

对于场外 ETF 基金，本公司于当日对基金销售机构发送的基金账户类及交易类业务申请数据进行一次交易待确认处理，生成 ETF 一次交易待确认数据发送给相关管理人；管理人可以在申请日之后向本公司发送申请日基金净值数据，本公司于收到管理人发送的申请日基金净值数据之日，进行二次交易待确认处理，生成 ETF 二次交易待确认数据发送给该管理人。

第十八条 本公司在基金交易待确认处理阶段对基金交易申请数据进行合法性检查，对于未能通过合法性检查的交易申请，本公司将其作无效申报处理。

第十九条 管理人应及时接收并处理本公司发送的基金

交易待确认数据。

第七章 基金批量份额调整处理

第二十条 管理人向本公司发送基金交易确认数据前，可向本公司发送批量份额调整申请数据，发起基金份额强增、强减、锁定、解锁等业务。本公司接收管理人批量份额调整申请数据后，即时进行处理并于处理完成后向该管理人发送批量份额调整确认数据。管理人应在接收到批量份额调整确认数据后，再向本公司发送基金交易确认数据。

第二十一条 如果当日无需进行基金批量份额调整，管理人可不向本公司发送批量份额调整申请数据。

第八章 基金交易确认处理

第二十二条 管理人收到本公司发送的基金交易待确认数据后，应及时进行有关基金交易确认处理。管理人应在每个工作日规定时点前将基金交易确认数据送达本公司。

管理人发送给本公司的基金交易确认数据可以是包含针对部分或全部基金交易申请的明细确认文件，也可以是空文件。

对于管理人进行明细确认的基金交易申请，本公司以管理人的明细确认为准进行确认处理；对于管理人未进行明细确认的基金交易申请，本公司按默认批确认方式处理，默认

批确认比例为 100%。管理人可提前向本公司书面申请修改默认批确认比例。

第二十三条 如果管理人未能在本公司规定时点前将当日基金交易确认数据送达本公司，本公司有权按 100%默认确认方式处理该管理人当日的基金交易确认。

第二十四条 管理人可向本公司书面申请开通基金交易确认数据提前处理功能。

第二十五条 管理人进行基金交易确认处理时，应遵循以下业务原则：

（一）对于基金交易待确认数据中已被本公司确认无效的交易申请数据，管理人不得确认成功；

（二）管理人进行基金认购最终确认时，如进行了明细确认，则必须在基金认购最终确认数据中填写相关认购计息结果字段信息；

（三）基金认购期间不计费，管理人只能在认购最终确认数据中对认购手续费进行明细确认处理；

（四）如拟于 N+1 日（N 日为发行截止日）进行基金认购份额登记过户处理，管理人应于 N+1 日同时进行 N 日认购确认和认购最终确认处理；

（五）如基金发行失败，管理人应在认购最终确认中将全部认购数据做失败处理；

（六）对于赎回交收周期不确定的基金，或触发巨额赎

回处理后比例确认部分交收周期不确定的基金，管理人应对基金赎回支付（095 业务）待确认数据进行逐笔确认，本公司于收到管理人发送的基金赎回支付确认后组织基金赎回款交收；

（七）当管理人认定基金发生巨额赎回且不能 100%进行赎回确认时，应于基金交易确认前书面通知本公司发生基金巨额赎回及具体的基金赎回确认比例；

（八）对于 T+1 日交收的申购赎回业务，如果管理人未开通基金交易确认数据提前处理功能，或管理人已开通基金交易确认数据提前处理功能但未能在当日提前确认处理开始时点前将基金交易确认数据送达本公司，本公司有权按 100%默认确认方式处理该管理人当日 T+1 交收的申购赎回业务确认；

（九）对于本公司基金系统按照既定规则发起的账户类业务以及强制赎回、转托管、定期定额协议类业务、分红方式变更、货币基金升降级、货币基金收益分配、货币基金收益结转、非交易过户、冻结解冻、权益分派等交易类业务，本公司将相关业务处理结果直接通知管理人，对于该部分业务管理人无需进行确认；

（十）对于由管理人发起的强制赎回、基金权益分派及基金份额强制调整等管理人发起类业务，本公司不向管理人发送基金交易待确认数据，由管理人直接生成相关基金交易

确认数据发送给本公司。

第九章 基金回报与资金清算处理

第二十六条 本公司根据基金账户类业务数据处理结果，生成账户回报、非居民涉税信息回报、反洗钱信息回报等账户类业务回报发送基金销售机构。

第二十七条 本公司根据基金交易确认数据进行相关基金交易确认处理，生成基金交易回报、分红回报数据发送管理人及相关基金销售机构。

第二十八条 对于本公司组织资金交收的基金，本公司根据基金交易回报、分红回报进行资金清算，生成资金清算数据发送管理人及相关基金销售机构。

第二十九条 管理人及基金销售机构应及时接收并处理有关基金交易回报、分红回报、资金清算数据，对交易回报、分红回报、资金清算数据有疑义的，应及时查明原因并联系本公司。

第三十条 基金销售机构可向本公司书面申请开通 T+1 交收申购赎回业务提前回报与资金清算数据功能。本公司于每个工作日提前确认处理完成后向开通此功能的基金销售机构提前发送 T+1 交收申购赎回业务回报与资金清算数据。

第十章 基金份额对账处理

第三十一条 本公司每个工作日向管理人、基金销售机构发送基金份额对账数据，管理人、基金销售机构可以选择以全量或者增量方式对账，也可以选择有明细或者无明细对账（对于货币基金，管理人基金份额对账固定为全量、无明细，管理人基金交易回报固定为无明细，基金销售机构基金份额对账固定为无明细）。

对于选择全量方式对账的管理人或基金销售机构，本公司每个工作日向其发送全部基金账户下的相关基金份额余额数据；对于选择增量方式对账的管理人或基金销售机构，本公司每个工作日向其发送当日发生份额变动的基金账户下的相关基金份额余额数据。

对于选择有明细对账的管理人，本公司每个工作日向其发送相关基金账户下登记的相关份额持有明细数据及基金交易回报明细数据；对于选择有明细对账的基金销售机构，本公司每个工作日向其发送相关基金账户下登记的相关份额持有明细数据；对于选择无明细对账的管理人或基金销售机构，本公司每个工作日向其发送相关基金账户下登记的按基金代码、交易账户等要素汇总的相关份额持有数据。

第三十二条 对于短期理财、固定份额明细封闭期产品等基金，本公司每个工作日向相关基金销售机构增加发送理财产品份额明细数据。

第三十三条 选择增量方式对账的，管理人、基金销售机

构应定期向本公司申请接收全量基金份额对账数据，保障管理人、基金销售机构处正确展示投资者份额持有与分红方式选择等信息。

相关基金销售机构应定期向本公司申请接收全量理财产品份额明细数据，保障基金销售机构处正确展示投资者份额明细可赎回日期。

第三十四条 管理人、基金销售机构对本公司发送的基金份额对账数据有疑义的，应及时查明原因并联系本公司。

第十一章 T日过户业务处理

第三十五条 管理人、基金销售机构可向本公司书面申请开通T日过户业务，以支持券商柜台份额转让、现金产品T+0资金可取等业务办理。

第三十六条 相关基金销售机构应按照本公司最新发布的《中央数据交换平台开放式基金业务数据交换协议》，于每个工作日规定时点前将T日过户申请数据发送给本公司。

如果当日无T日过户申请，基金销售机构可不向本公司发送T日过户申请数据。

如果基金销售机构未能在本公司规定时点前将T日过户申请数据送达本公司，本公司有权按当日无相关业务申请的方式（空文件）处理该基金销售机构当日的T日过户业务申请。

第三十七条 本公司根据 T 日过户申请数据进行 T 日过户处理，生成 T 日过户回报、T 日过户对账数据发送相关管理人及基金销售机构。

第十二章 基金业务参数管理

第三十八条 管理人、基金销售机构加入本公司基金系统，发行基金，开通基金申购、赎回、基金转换，设定基金交易费率及开办其他基金业务前，应于本公司规定的时点前将有关基金业务参数通过 TA 参数管理平台提交或书面通知本公司。

第三十九条 本公司向管理人、基金销售机构提供格式化业务参数通知单，管理人、基金销售机构在申请办理基金业务时应按规定填写业务参数通知单。

第四十条 本公司、管理人及基金销售机构应妥善保管日常业务往来的各项业务参数通知单，以备日后查阅。

第四十一条 对于非常规业务，管理人、基金销售机构应与本公司协商一致后按本公司要求办理。

第十三章 附则

第四十二条 本业务运作指引未尽事宜，参照本公司其他相关业务规则办理。

第四十三条 本业务运作指引由本公司负责修订和解释。

第四十四条 本业务运作指引自 2020 年 9 月 28 日起施行。本公司于 2011 年 8 月 3 日发布的《开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划登记结算业务运作指引》同时废止。

附件

数据传输安排

(管理人适用)

一、数据传输基本安排

(一) 本公司与管理人双方应严格按照本安排要求, 保证安全、及时、完整、准确地完成有关基金业务数据传输。

(二) 数据传输中的数据收发时间以本公司系统记录时间为准。

(三) 数据传输应通过加密方式进行。

(四) 传输的数据文件内容及格式遵照《中国结算开放式基金登记结算系统管理人数据接口规范》的规定。

(五) 对于数据传输中出现的差错、延误等, 本公司与管理人双方应在相关系统条件允许的情况下, 本着将相关市场影响降到最低水平的原则尽快配合解决。本公司与管理人双方需指定数据传输固定联系人, 保证联系畅通。

二、数据传输通讯方式

采用深圳证券通信公司通讯方式, 管理人办理基金业务前, 应向深圳证券通信公司申请开通通讯通道。

三、数据传输时间安排

时间	管理人	本公司
T 日 19:00 前 ①	相关管理人及时接收 T 日过户 回报、T 日过户对账数据	向相关管理人发送 T 日过户回 报、T 日过户对账数据
T 日 20:00 前 ②	向本公司发送当日基金行情数 据	及时接收当日基金行情数据
T 日 20:00— 24:00③	及时接收 T 日基金交易预汇总 数据	向管理人发送 T 日基金交易预 汇总数据
T 日 20:00— 24:00③	及时接收 T 日基金账户通知等 账户类业务数据和基金交易待 确认数据	向管理人发送 T 日基金账户通 知等账户类业务数据和基金交 易待确认数据
T+1 日管理人 确认前	可向本公司发送批量份额调整 申请数据，等待并及时接收批 量份额调整确认数据	及时接收批量份额调整申请数 据，处理完成后，向管理人发 送批量份额调整确认数据
T+1 日 11:00 前④	向本公司发送基金交易确认数 据	及时接收基金交易确认数据
T+1 日 15:00 前	及时接收基金交易回报、分红 回报、资金清算数据及基金份 额对账数据	向管理人发送基金交易回报、 分红回报、资金清算数据及基 金份额对账数据

说明：

① “相关管理人”指已向本公司书面申请开通 T 日过户业务的管理人。

②在特殊情况下，管理人可提前半小时向本公司申请适当推迟发送当日基金净值数据及基金状态信息，但最迟不得超过 T 日 24:00。

③在特殊情况下，本公司可推迟发送基金交易预汇总数据、基金账户通知等账户类业务数据和基金交易待确认数据，但最迟不超过 T+1 日 6:00。

④在特殊情况下，管理人可提前半小时向本公司申请适当推迟发送交易确认数据，但最迟不得超过 12:30。

管理人开通基金交易确认数据提前处理功能的，基金交易确认数据提前确认处理开始时点为 T+1 日 6:00，如果管理人未能在 T+1 日 6:00 前将基金交易确认数据送达本公司，本公司有权按 100%默认确认方式处理该管理人当日的 T+1 交收申购赎回业务确认。

⑤在特殊情况下，本公司可推迟发送相关数据，并及时通知管理人。

数据传输安排

(基金销售机构适用)

一、数据传输基本安排

(一) 本公司与基金销售机构双方应严格按照本安排要求, 保证安全、及时、完整、准确地完成有关基金业务数据传输。

(二) 数据传输中的数据收发时间以本公司系统记录时间为准。

(三) 数据传输应通过加密方式进行。

(四) 传输的数据文件内容及格式遵照本公司《中央数据交换平台开放式基金业务数据交换协议》的规定。

(五) 对于数据传输中出现的差错、延误等, 本公司与基金销售机构双方应在相关系统条件允许的情况下, 本着将相关市场影响降到最低水平的原则尽快配合解决。本公司与基金销售机构双方需指定数据传输固定联系人, 保证联系畅通。

二、数据传输通讯方式

采用深圳证券通信公司通讯方式, 基金销售机构办理基金业务前, 应向深圳证券通信公司申请开通通讯通道。

三、数据传输时间安排

时间	基金销售机构	本公司
T 日 8:00 前	及时接收 T 日基金行情及结算席位数据、参数类汇总数据	向基金销售机构发送 T 日基金行情及结算席位数据、参数类汇总数据
T 日 16:00 前 ①	相关基金销售机构向本公司发送 T 日过户申请数据	及时接收 T 日过户申请数据
T 日 19:00 前 ①	相关基金销售机构及时接收 T 日过户回报、T 日过户对账数据	向相关基金销售机构发送 T 日过户回报、T 日过户对账数据
T 日 19:30 前 ②	向本公司发送 T 日基金账户类及交易类业务申请数据	及时接收 T 日基金账户类及交易类业务申请数据
T 日 24:00 前	及时接收 T 日基金交易预汇总数据	向基金销售机构发送 T 日基金交易预汇总数据
T+1 日 15:00 前 ③	及时接收 T 日基金账户类及交易类业务回报、分红回报、基金份额对账、资金清算数据，相关基金销售机构及时接收理财产品份额明细数据	向基金销售机构发送 T 日基金账户类及交易类业务回报、分红回报、基金份额对账、资金清算数据，向相关基金销售机构发送理财产品份额明细数据

说明：

① 此处“相关基金销售机构”指已向本公司书面申请开通 T 日过户业务的基金销售机构。

② 在特殊情况下，基金销售机构可向本公司申请适当推

迟发送 T 日基金账户类及交易类业务申请数据，但最迟不得超过 T 日 24:00，否则本公司有权视为基金销售机构当日无基金业务申请数据。

③ T 日基金账户类及交易类业务回报、分红回报包含未经基金销售机构发送业务申请，由本公司或管理人直接发起的基金业务回报，包括但不限于强制赎回、份额强制调整、非交易过户、冻结解冻、权益分派以及认购最终确认结果等业务回报数据。

此处“相关基金销售机构”指代销短期理财、固定份额明细封闭期产品等基金的基金销售机构。

基金销售机构开通 T+1 交收申购赎回业务提前回报与资金清算数据功能的，本公司于 T+1 日 9:00 前向该基金销售机构发送 T+1 交收申购赎回业务回报与资金清算数据。T+1 日 15:00 前，本公司向该基金销售机构发送基金交易回报、资金清算数据，内容包括 T+1 交收申购赎回业务提前回报与资金清算数据。

④ 在特殊情况下，本公司可推迟发送相关数据，并及时通知基金销售机构。