

全国社会保障基金投资涉及的 证券登记结算业务指南

第一条 为保证全国社会保障基金（以下简称社保基金）参与证券市场的正常投资活动，保障其资产的安全，保护其合法权益，根据国家法律法规和《全国社会保障基金投资管理暂行办法》，按照中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）的有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称本公司）有关业务规则，制定本指南。

第二条 本指南适用于社保基金投资涉及的证券账户管理及相关的证券登记、托管、结算等业务。

第三条 全国社会保障基金理事会（以下简称社保理事会）可根据《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》（以下简称《账户管理规则》）的有关规定，直接到本公司上海、深圳分公司（以下统称本公司）分别办理 A 股账户和基金账户的开户事宜。

第四条 本公司按照《账户管理规则》和其他业务规则对社保理事会开立的证券账户进行管理。

第五条 社保基金托管人（以下简称托管人）应当直接向本公司申请为社保基金投资管理人（以下简称管理人）管理的每个投资组合，以“社保基金”的名义分别开立证券账户。

第六条 托管人开立社保基金证券账户须提供以下材料：

- （一） 《证券账户注册申请表》；
- （二） 社保理事会 对托管人的授权委托书；
- （三） 托管人法定代表人授权委托书；
- （四） 加盖托管人公章的托管人营业执照复印件；
- （五） 社保理事会确定管理人及相应投资组合的确认函；

- （六） 加盖管理人公章的管理人营业执照复印件；
- （七） 经办人有效身份证明文件原件及复印件。

第七条 托管人在填写《证券账户注册申请表》时，“持有人名称”一项应为“全国社保基金+投资组合名称”；“身份证明文件号码”一项应为“全国社保基金+投资组合号码”。投资组合名称和号码根据本指南第六条第 5 款填写。

第八条 本公司审核本指南第六条规定的材料无误后予以开户，并留存除经办人有效身份证明文件原件外的所有材料。

第九条 托管人申请证券账户注册资料查询与变更、账户卡挂失补办、账户注销等业务，参照《账户管理规则》的相关规定办理。变更“持有人名称”或“身份证明文件号码”、注销账户时还须提供社保理事会的相关证明文件。

第十条 托管人申请办理相关账户业务时，应当按照

本公司对机构账户的有关收费标准交纳相应费用。

第十一条 本公司对社保基金每个投资组合对应的托管人和管理人进行备案，记录其全称和营业执照号码。社保理事会更换投资组合对应的托管人，应当及时由社保理事会确定的新托管人到本公司办理重新备案手续，并提供相关证明文件；社保理事会更换投资组合对应的管理人，应当及时由托管人到本公司办理重新备案手续，并提供相关证明文件。

第十二条 托管人受社保理事会委托，向本公司申请将社保理事会证券账户内的证券过户到管理人使用的社保基金证券账户时，须提供以下材料：

- （一） 《过户登记申请表》；
- （二） 社保理事会和社保基金的证券账户卡原件或加盖公章的复印件；
- （三） 社保理事会授权委托书；
- （四） 托管人法定代表人授权委托书；
- （五） 经办人有效身份证明文件原件及复印件。

第十三条 本公司收到前条材料三个工作日内，审核无误后予以办理过户手续，并出具《过户登记确认书》。

第十四条 申请过户的双方应当按照国家有关规定缴纳印花税。本公司按照过户股份面值的 1‰单向收取过户费，债券、基金暂不收取过户费。本公司报经主管部门批准后，

可以调整对有关证券的收费标准。

第十五条 社保理事会、托管人可根据业务需要按照本公司的相关规定申请查询社保基金证券账户持股余额和持股变更情况，并交纳相应费用。社保理事会在办理上述查询时，可不提供证券账户卡，但经办人须提供社保理事会授权委托书。

第十六条 社保理事会可根据业务需要直接或授权托管人向本公司申请将社保基金证券账户持有的证券在一定期限内予以锁定。

第十七条 社保理事会申请锁定证券须提供以下材料：

- （一） 《证券锁定申请表》（附件 1）；
- （二） 社保理事会授权委托书；
- （三） 经办人有效身份证明文件原件及复印件。

托管人申请锁定证券须提供以下材料：

- （一） 《证券锁定申请表》；
- （二） 证券账户卡原件或加盖公章的复印件；
- （三） 社保理事会授权委托书；
- （四） 托管人法定代表人授权委托书；
- （五） 经办人有效身份证明文件原件及复印件。

第十八条 本公司收到前条材料一个工作日内，审核无误后对有关证券予以锁定并出具《证券锁定确认书》（附件 2）。锁定期届满，被锁定证券自动解除锁定。

第十九条 锁定期限内，社保理事会、托管人申请解除锁定时须提供《解除锁定申请表》（附件3）及本指南第十七条规定的相应材料，并交回《证券锁定确认书》。

第二十条 本公司审核前条材料无误后，对有关证券解除锁定。

第二十一条 托管人作为本公司的结算参与者，直接与公司办理结算业务，承担相应的交收责任。托管人与所托管社保基金的结算业务由托管人自行负责办理。

第二十二条 托管人在办理结算业务前，应当与公司签订结算协议，明确各方的权利和义务。

第二十三条 托管人应当以自身名义在公司开立结算备付金账户，用于办理相关的资金结算业务。申请开户时应向公司提交以下材料：

（一） 中国证监会、中国人民银行关于核准托管人资格的批复的复印件（加盖公章）；

（二） 托管人营业执照复印件（加盖公章）；

（三） 托管人出具的授权委托书；

（四） 开立结算备付金账户申请表和预留印鉴卡；

（五） 指定收款账户授权书；

（六） 经办人有效身份证明文件原件及复印件；

（七） 公司要求提供的其他材料。

同时，托管人还应出具社保理事会对托管人的确认函。

第二十四条 托管人应当在本公司预留指定收款账户。托管人通过该账户接收其从结算备付金账户汇划的资金。指定收款账户的名称应与托管人名称一致。

第二十五条 托管人名称、指定收款账户相关信息发生变更时，托管人应当及时向本公司提供相应资料，办理结算账户变更手续。

第二十六条 社保理事会变更托管人后，新托管人应当按本指南第二十三条的规定在本公司开立结算备付金账户，已开立结算备付金账户的托管人，应当向本公司提交社保理事会对托管人的确认函。

第二十七条 托管人结算备付金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。

第二十八条 托管人不再作为本公司结算参与者时，在与本公司结清证券登记结算相关的其他债权债务后，可向本公司申请划付结算备付金余额。

第二十九条 每个交易日（T 日）闭市后，本公司根据管理人 T 日在证券交易所的成交数据及其他数据(包括派息、送股、新股认购款、新股申购款、应扣税费等)，计算托管人的资金应收或应付净额，以及管理人买卖相关证券的应收、应付数量，产生证券、资金清算数据，确定托管人的交收责任。

第三十条 T 日清算完成后，本公司将当日的证券、资金清算数据存放于本公司结算系统，作为对托管人的证券、资金交收依据与交收指令，托管人应当及时从本公司结算系统获取。

除因本公司结算系统原因托管人无法获取相关数据外，本公司视同已将交收指令通知托管人。

第三十一条 托管人应当按照本公司的证券、资金交收指令，按时履行交收责任。托管人对本公司提供的清算数据存有异议的，应当及时反馈本公司。经本公司核实，确属清算差错的，本公司将予以更正，但托管人不得因此拒绝履行或延迟履行当日交收义务。

第三十二条 本公司依据 T 日清算数据，于 T 日当晚，对社保基金的证券账户余额进行记增或记减处理，完成证券不可撤销的最终交收；T+1 日 17:00，同托管人完成资金的最终交收。

第三十三条 托管人应当配备熟悉电脑、财务、结算等方面的专业人员负责结算业务，制定内部结算管理办法，确保托管人和本公司之间的资金汇划渠道畅通。

第三十四条 托管人应当采取有效措施确保电子结算系统安全运行，制订结算数据备份制度和电脑病毒防范办法。

第三十五条 为防范结算风险，依据风险共担的原则，托管人应当按规定缴纳结算保证金。结算保证金的缴存、调

整、管理和使用按照本公司规定执行。

第三十六条 托管人作为结算参与者，应当按照《证券结算风险基金管理暂行办法》的规定，缴纳证券结算风险基金。

第三十七条 托管人如出现资金交收透支，本公司可以采取以下措施：

（一） 根据托管人发生的透支金额，按中国人民银行有关规定计收罚息。

（二） T+1 日交收时，暂扣托管人指定的证券账户内、相当于透支金额价值 120%的证券。托管人在两个交易日内补足透支款本息及罚息的，本公司向托管人交付暂扣的证券。否则，本公司将卖出暂扣证券，以卖出款弥补托管人的透支，卖出款不能全额弥补透支款本息及罚息的，差额仍向违约的托管人追索。

（三） 要求透支托管人提供书面情况说明和有关责任方盖章的资金交收透支责任确认书，将该透支事件在托管人业务不良记录中予以登记，作为评估风险程度、确定重点监控对象的依据。

（四） 通知透支托管人向本公司提供财务状况说明，提出弥补透支的具体措施，将该托管人列为重点监控对象，密切监测其财务状况。

（五） 提请证券交易所，限制或暂停透支托管人指

定的透支机构证券账户的证券买入，同时将有关情况报告中国证监会。

第三十八条 管理人所管理的证券账户发生证券卖空，本公司在 T+1 日交收时暂扣其卖空价款，并将卖空情况通知相应的托管人。相应的管理人在两个交易日内补足卖空证券的，本公司解除对卖空价款的暂扣。否则，本公司以暂扣的卖空价款买入与卖空等量的证券，卖空价款不足的，差额仍向相应的托管人追索。

管理人所管理的证券账户发生证券卖空，本公司以卖空价款为基数，按中国人民银行公布的透支罚息利率，向相应的托管人收取罚款。

第三十九条 本公司处理托管人交收违约事件而产生的费用和损失，由托管人承担。

第四十条 本公司有权对结算风险较大的托管人进行特别监控，必要时可以采取提高结算保证金缴纳额、调整最低结算备付金缴存比例与时间、要求其委托其他托管人代理结算业务等措施。

第四十一条 本指南未提及的社保基金结算业务，比照证券投资基金结算业务相关规则或规定执行。

第四十二条 本指南由本公司负责解释。

第四十三条 本指南自发布之日起执行。

附件 1:

证券锁定申请表

Application Form for Securities Lock

持有人名称 Holder's Name		证券账户 Securities A/c	
有效身份证明文件类别 Category of Holder's Identification Document			
有效身份证明文件号码 Holder's Identification Document No.		邮政编码 Post Code	
联系地址 Address		联系电话 Tel	
经办人/代办人 Applicant		有效身份证明文 件号码 Identification Document No.	
证 券 简 称 Securities' Name	证 券 代 码 Securities' Code	锁 定 股 数 Shares' Amount	
锁定期限: 自 _____ 年 _____ 月 _____ 日至 _____ 年 _____ 月 _____ 日止 Time Limit: From _____ (y) _____ (m) _____ (d) to _____ (y) _____ (m) _____ (d)			

说明: 填写内容必须真实、准确, 字迹要清楚、整洁。

Note: Please print or type. All the information must be authentic and accurate.

申请人签字:

日期:

Signature:

Date:

法人盖章:

Seal:

附件 3:

解除锁定申请表

Application Form for Securities Unlock

持有人名称 Holder's Name		证券账户 Securities A/c	
有效身份证明文件类别 Category of Holder's Identification Document			
有效身份证明文件号码 Holder's Identification Document No.		邮政编码 Post Code	
联系地址 Address		联系电话 Tel	
经办人/代办人 Applicant		有效身份证明文 件号码 Identification Document No.	
证 券 简 称 Securities' Name	证 券 代 码 Securities' Code	解 除 股 数 Shares' Amount	
解除日期: 年 月 日			
Unlocked Date:			

说明: 填写内容必须真实、准确, 字迹要清楚、整洁。

Note: Please print or type. All the information must be authentic and accurate.

申请人签字:

日期:

Signature:

Date:

法人盖章：
Seal: