

# 关于发布《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[2011]222号

各基金业务参与人：

为了规范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（以下统称“基金”）登记结算业务的日常业务运作及基金业务数据传输，进一步明确基金登记结算业务相关办理规定，明确基金业务参与人的业务职责，保护投资者的合法权益，我公司制定了《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》（见附件），请在办理我公司相关基金业务时遵照执行。

特此通知。

附件：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

二〇一一年八月三日

中国证券登记结算有限责任公司

附件：

# 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（以下简称“本公司”）《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须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《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](http://www.chinaclear.cn)）对基金业务参与者进行发布。

## 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为境内证券交易所交易日。

**第六条** 在基金系统工作日，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，及向基金销售机构发送基金交易回报、基金份额对账等数据。

基金销售机构在非基金系统工作日期间（如周六、日或节假日）受理的基金账户类及交易类业务申请，应将其归入下一个基金系统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** 在基金系统工作日，本公司接收管理人发送的基金动态信息文件、基金交易确认数据，及向管理人发送基金交易待确认、交易回报、基金份额对账等数据。

**第八条** 在基金系统工作日，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 基金动态信息等交易资讯发布**

**第九条** 管理人可自行确定其所管理基金每个工作日的申购、赎回、基金转换、转托管等交易状态，并通过基金动态信息文件通知本公司。

**第十条** 管理人应于每个基金系统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），将当日的基金净值及下一工作日的基金动态信息等交易资讯发

送给本公司，其中基金净值资讯包括基金份额净值、累计净值、货币基金万份收益等信息，基金动态信息资讯包括基金规模、基金交易状态等信息。

对于 QDII 基金、ETF 基金，管理人还应于每个基金系统工作日向本公司发送申购净值、赎回净值及揭示净值。其中，本公司仅将揭示净值转发给相关基金销售机构。

管理人可以选择以单批次或多批次方式向本公司发送当日的基金净值及下一工作日的基金动态信息等交易资讯，如果选择以多批次方式发送，则管理人须以单只基金为单位发送，即一个基金为一个批次文件。

**第十一条** 本公司收到管理人发送的当日的基金净值及下一工作日的基金动态信息等交易资讯后，于下一系统工作日日初将前述交易资讯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上报**

**第十二条** 基金销售机构在规定的交易时间内受理投资者提出的基金账户开立、登记、资料变更及账户注销等账户类业务申请，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，并于每个基金系统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。

如基金销售机构在当日没有基金账户类及交易类业务申

请发生的，也应于日终规定时点前向本公司发送一个空文件。

**第十三条** 基金销售机构应严格按照证监会最新发布的《开放式基金业务数据交换协议》要求向本公司上报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，基金销售机构在上报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

**第十四条** 本公司于每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。

**第十五条** 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，应及时通知本公司。

## 第六章 基金交易待确认处理

**第十六条** 本公司收到管理人发送的当日基金净值数据后，据此对当日的基金账户类及交易类业务申请数据进行相关系统处理，生成基金账户通知数据及基金交易待确认数据

发送给管理人。

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，据此对相应申请日的基金交易类业务申请数据进行相关系统处理，生成基金交易待确认数据发送给管理人。

对于 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，据此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管理人。

**第十七条** 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。

**第十八条** 在管理人选择单批次处理模式下，本公司待管理人所有基金的全部基金销售机构的基金交易申请文件都到齐后，一批次生成当日基金交易待确认数据发送给管理人。

在管理人选择多批次处理模式下，本公司以基金销售机构为单位多批次向管理人发送基金交易待确认数据，即一个基金销售机构为一个批次文件。

**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。

**第二十条** 对于管理人选择由本公司在基金交易待确认处理阶段进行计费处理的，本公司发送的基金交易待确认数据包含相关基金交易计费结果，对于该计费结果管理人可以在基金交易确认处理阶段进行修改。

对于管理人选择由本公司在基金交易待确认处理阶段不进行计费处理的，本公司发送的基金交易待确认数据不包含相关基金交易计费结果，管理人可以在基金交易确认处理阶段自行进行相关交易计费处理。如管理人在基金交易确认处理阶段未做相关交易计费处理，则本公司在基金交易回报处理阶段对相关基金交易进行计费处理，对于该计费结果管理人不能修改。

## **第七章 基金交易确认处理**

**第二十一条** 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，并在规定时点前将基金交易确认数据发送给本公司。

**第二十二条** 管理人可对部分或全部基金交易授权本公司进行默认确认处理，由本公司基金系统按照默认规则进行有关基金交易确认处理。

管理人授权本公司进行基金交易默认确认处理时，可不

向本公司发送基金交易确认数据（但管理人必须每日向本公司发送一个空文件）。

**第二十三条** 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。

对于包含针对部分或全部基金交易申请的明细确认文件，本公司以管理人的明细确认为准；对于空文件，本公司按默认批确认方式处理，默认批确认比例是 100%。如管理人要求的批确认比例不是 100%，则需要通知本公司修改批确认比例（对于采用 TXT 数据接口的，管理人须书面通知本公司或者由管理人通过全部明细确认方式通知本公司；对于采用 DBF 数据接口的，管理人须通过数据接口通知本公司）。

**第二十四条** 如果管理人在本公司规定的截止时点前仍未发送基金交易确认数据的，本公司有权按默认批确认方式处理。

**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，管理人须于 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，管理人须于认购最终确认处理前通知本公司；

(六) 对于 ETF 基金，管理人在 ETF 申购一次确认时可以对申购金额和各项费用进行修改，在 ETF 申购二次确认时不能做任何修改；

对于 ETF 基金，管理人在 ETF 赎回一次确认时可以修改赎回份额，在 ETF 赎回二次确认时可以修改赎回费用但不能再修改赎回份额；

(七) 对于赎回交收周期不确定的基金，管理人须对基金赎回支付 (058 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次一工作日进行基金赎回款交收；

(八) 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 (对于采用 TXT 数据接口的，管理人须书面通知本公司；对于采用 DBF 数据接口的，管理人须通过数据接口通知本公司)；

（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。

**第二十六条** 在管理人选择单批次处理模式下，管理人将其当日所有基金的交易确认数据一批次发送给本公司。

在管理人选择多批次处理模式下，管理人可以基金为单位多批次向本公司发送基金交易确认数据，即一个基金为一个批次文件。

## 第八章 基金交易回报处理

**第二十七条** 本公司收到管理人发送的基金交易确认数据后，据此进行相关基金交易回报处理（管理人未发送基金交易确认数据的，本公司按 100%默认比例确认处理），生成基金交易回报数据发送给管理人及相关基金销售机构。

**第二十八条** 管理人及基金销售机构应及时接收并处理

有关基金交易回报数据，对交易回报数据有疑义的，应及时查明原因并通知本公司。

**第二十九条** 在管理人选择单批次处理模式下，本公司将当日所有基金的交易回报数据一批次发送给管理人。

在管理人选择多批次处理模式下，本公司以基金为单位向管理人发送基金交易回报数据，即一个基金为一个批次文件。

对于基金销售机构，本公司仅一批次向其发送基金交易回报数据。

## 第九章 基金份额对账处理

**第三十条** 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（对于货币基金，只能选择全量方式对账）。对于选择全量方式对账的，本公司每个工作日将全部基金账户下的基金份额余额数据发送给管理人、基金销售机构；对于选择增量方式对账的，本公司每个工作日将当日发生份额变动的基金账户下的基金份额余额数据发送给管理人、基金销售机构。

**第三十一条** 选择增量方式对账的，管理人、基金销售机构可以不定期向本公司申请发送全量基金份额对账数据。

**第三十二条** 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，应及时查明原因并通知本公司。

## 第十章 基金业务参数管理

**第三十三条** 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书面通知本公司。

**第三十四条** 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。

**第三十五条** 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。

**第三十六条** 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。

## 第十一章 附则

**第三十七条** 本业务运作指引未尽事宜，参照本公司《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》及相关基金业务规定办理。

**第三十八条** 本业务运作指引由本公司负责修订和解释。

**第三十九条** 本业务运作指引自发布之日起施行。

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) 数据传输由深圳证券通信公司负责进行加密。

(四) 传输的数据文件内容及格式遵照本公司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, 保证及时联系畅通。

### 二、数据传输通讯方式

采用深圳证券通讯公司通讯方式, 管理人办理基金业务前, 应向深圳证券通讯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 19:30—— 24:00	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 前 ①	向本公司发送当日基金净值数据及基金状态信息	及时接收当日基金净值数据及基金状态信息
T 日 20:00—— 24:00②	及时接收 T 日账户资料变更数据和基金交易待确认数据	向管理人发送 T 日账户资料变更数据和基金交易待确认数据
T+1 日 11:00 前③	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④	及时接收基金交易回报数据及基金份额对账数据	向管理人发送基金交易回报数据及基金份额对账数据

说明:

①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。

②在特殊情况下,本公司可推迟发送账户资料变更数据和基金交易待确认数据,但最迟不超过 T+1 日 6:00。

③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。

④在特殊情况下,本公司可推迟发送基金交易回报数据及基金份额对账数据,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) 数据传输由深圳证券通信公司负责进行加密。

(四) 传输的数据文件内容及格式遵照证监会最新发布《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, 保证及时联系畅通。

### 二、数据传输通讯方式

采用深圳证券通讯公司通讯方式, 基金销售机构办理基金业务前, 应向深圳证券通讯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	开业前接收 T 日基金动态信息，并于当日在营业场所公告	向基金销售机构发送 T 日基金动态信息
T 日 19:30 前 ①	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+1 日 15:00 前	及时接收 T 日基金账户类及交易类业务回报及份额对账数据	向基金销售机构发送 T 日基金账户类及交易类业务回报及份额对账数据②

说明：

①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。

②T 日基金账户类及交易类业务回报包含未经基金销售机构发送业务申请，由本公司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。