

关于发布《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司信用保护合约结算业务指南》的通知

中国结算深业字【2020】7号

各市场参与主体：

为进一步明确深市信用保护合约相关结算业务事项，本公司根据《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司信用保护工具业务管理试点办法》制定了《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司信用保护合约结算业务指南》，现予以发布实施。

其中，第三章“保护费支付”，系统上线时间另行通知；第六章“收费”，试点期间暂免收取相关费用。

特此通知。

附件：《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司信用保护合约结算业务指南》

二〇二〇年四月三十日

附件：

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
信用保护合约结算业务指南

目录

第一章 总则.....	3
第二章 账户.....	3
第三章 保护费支付.....	3
第四章 提前终止结算.....	4
第五章 信用事件结算.....	5
第一节 现金结算.....	5
第二节 实物结算.....	6
第六章 收费.....	6
第七章 附则.....	7

第一章 总则

第一条 为配合信用保护工具业务的开展,明确信用保护合约(以下简称“合约”)结算业务流程,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《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司信用保护工具业务管理试点办法》及中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定,制定本指南。

第二条 本指南适用于在深圳证券交易所(以下简称“深交所”)开展的合约相关结算业务。

第二章 账户

第三条 合约买方和卖方(以下简称“交易双方”)使用深市 A 股证券账户参与信用保护合约业务。

第四条 本公司通过交易双方结算参与人的结算备付金账户办理资金交收业务。

第三章 保护费支付

第五条 交易双方选择通过本公司支付保护费的,需在 T 日日间(T 日指“交易日”,T 日日间指“交易日 8:30 至 15:50”,下同)通过收款方结算参与人或付款方结算参与人向本公司提交资金代收代付指令。

第六条 本公司根据结算参与人提交的资金代收代付指令,提供资金代收代付服务,将保护费资金从付款方结算参与人结算备付金账户划至收款方结算参与人结算备付金账户。

第七条 T 日日间,本公司收到代收代付指令后,对合约双方相

关信息（包括合约编号及相应证券账户等）进行有效性检查。检查通过的，根据相关税费的规定及结算参与者提交的金额计算应收付金额，并实时转发至交易双方结算参与者。结算参与者可通过 D-COM 终端实时查询代收代付数据。

第八条 付款方结算参与人在收到代收代付数据后，可于 T 日 15:50 前通过 D-COM 终端进行勾单确认交收，收款方结算参与者无需勾单确认。代收代付指令经勾单确认后，立即进入交收环节。

第九条 本公司在收到付款方结算参与者提交的勾单指令后，按照勾单确认顺序逐笔检查资金是否足额，资金足额的，本公司办理交收。

若付款方结算参与者最后时点 15:50 资金仍不足额，或未勾单确认，该笔指令交收失败。

第十条 T 日交收失败的，交易双方可于 T+1 日起另行提交代收代付指令。

第四章 提前终止结算

第十一条 合约提前终止的，交易双方应向深交所提交提前终止申报指令，并在申报时明确通过本公司或者自行协商的其他方式支付提前终止的相关金额。

第十二条 交易双方选择通过本公司支付提前终止相关金额的，本公司根据深交所发送的成交确认数据提供实时逐笔全额结算服务，将资金从付款方结算参与者结算备付金账户划至收款方结算参与者结算备付金账户。

第十三条 本公司根据相关税费的规定及深交所发送的成交确认数据对每笔交易实时清算，并将清算结果实时发送给交易双方结算参与人，结算参与人可通过 D-COM 终端实时查询清算结果。

第十四条 付款方结算参与人收到实时逐笔清算数据后，通过 D-COM终端在当日15:50前进行勾单确认交收，收款方结算参与人无需勾单确认。交易经勾单确认后，立即进入交收环节。

第十五条 本公司在收到付款方结算参与人提交的勾单指令后，按照勾单确认顺序逐笔检查资金是否足额。资金足额的，本公司办理交收。

对于 T 日日间未完成实时交收的，转为日终逐笔全额非担保交收。日终交收时仍不满足交收条件的，交收失败。

第十六条 T 日交收失败的，交易双方可于 T+1 日起另行向深交所申报合约提前终止指令。

第五章 信用事件结算

第一节 现金结算

第十七条 合约信用事件发生后采用现金结算的，交易双方应向深交所申报合约现金结算指令，并在申报时明确通过本公司或者自行协商的其他方式支付的相关金额。

第十八条 交易双方选择通过本公司支付相关金额的，本公司根据相关税费的规定及深交所发送的成交确认数据提供实时逐笔全额结算服务，将结算资金从付款方结算参与人结算备付金账户划至收款方结算参与人结算备付金账户。

第十九条 信用事件现金结算实时逐笔全额清算交收方式和业务办理流程同第四章。

第二节 实物结算

第二十条 合约采用实物结算的，交易双方应向深交所申报合约实物结算指令。

第二十一条 本公司根据相关税费的规定及深交所发送的成交确认数据提供日终逐笔全额结算，合约买方结算参与者应付可交付债务（包括资产支持证券）数量及合约卖方结算参与者应付资金均足额的，对相应可交付债务和资金进行交收。

第二十二条 合约买方应当向合约卖方提交符合深交所规定范围的可交付债务。

对于提交不符合深交所规定范围的可交付债务，或已退出本公司登记结算系统的可交付债务，本公司做交收失败处理。

第二十三条 涉及司法冻结等有权利瑕疵的可交付债务不可申报为可交付债务。

第二十四条 一笔交易指令可以申报一只可交付债务，也可以申报多只可交付债务。

一笔交易指令申报多只可交付债务的，须所有可交付债务均足额时该笔交收成功，否则做失败处理。

第六章 收费

第二十五条 信用事件发生后的现金结算或实物结算的结算费按合约名义本金的百万分之一向合约买方收取。

第二十六条 合约信用事件现金结算或实物结算的结算费，T 日日终清算，T+1 日日终交收。

第二十七条 同一个合约，合约现金结算或实物结算分多笔申报的，只对第一笔交收成功的申报收取结算费。

第二十八条 合约保护费、合约提前终止的资金划付，相关结算费按本公司资金代收代付业务收费标准执行。

第七章 附则

第二十九条 本公司不受理合约登记、质押、司法冻结及查询业务。

第三十条 本指南由本公司负责解释。

第三十一条 本指南自发布之日起实施。