

关于统一结算参与人资金 交收透支处罚的通知

各结算参与人：

为规范对结算参与人资金交收透支风险管理，统一对结算参与人资金交收透支处罚措施，对于在交收日规定的资金交收时点不能足额履行资金交收义务的结算参与人，中国证券登记结算有限责任公司（以下称“本公司”）按以下处罚标准进行处理：

一、出现资金交收透支的结算参与人，除按结算备付金适用的存款利率向本公司计付透支资金利息外，还应按第二条的规定向本公司缴纳交收违约金。本公司收缴的交收违约金按证监会、财政部有关规定记入证券交易结算风险基金。

二、交收违约金按结算参与人透支金额的 1%，自透支之日起，按日（包括节假日）计收。

交收违约金=结算参与人当日结算备付金账户透支金额×1%

其中，结算参与人当日结算备付金账户透支金额，按其累计交收所需资金与其结算备付金账户内可用于交收的资金的差额确认，即

$T+1$ 日结算备付金账户透支金额=累计交收所需资金-（结算参与人备付金账户资金-冻结资金）

三、本通知自二 00 四年一月一日起执行，沪、深分公司原资

金交收透支罚息相关规定同时废止。

二〇〇三年十二月二十二日