

开放式基金结算保证金管理暂行办法

第一条 为防范和化解开放式证券投资基金(以下简称“基金”)结算风险,保障基金登记结算系统安全运行,妥善管理和使用开放式基金结算保证金(以下简称“保证金”),根据国家有关法律、法规、行政规章以及《中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算业务指南》,制订本办法。

第二条 本办法所称保证金是指基金管理人和基金销售代理人缴纳给本公司、用于结算备付金不足情况下担保交收的资金。

第三条 中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“本公司”)上海、深圳分公司分别负责保证金的日常管理。

第四条 基金管理人须以法人名义为其名下的每只基金在本公司上海、深圳分公司分别开立“开放式基金保证金账户”,基金销售代理人须以法人名义选择本公司上海、深圳分公司之一开立“开放式基金保证金账户”(以下统称“保证金账户”)。

第五条 本公司参照中国人民银行的有关规定,向基金管理人和基金销售代理人计付保证金利息。

第六条 保证金的收取与调整

(一) 初始保证金

基金管理人和基金销售代理人参与本公司基金登记结算系统时,应缴纳初始保证金。基金管理人每个保证金账户的初始保证金不得低于 15 万元;基金销售代理人保证金账户的初始保证金不得低于 30 万元。

(二) 保证金调整

1、每季度前 5 个工作日内,本公司根据基金管理人在本公司上海、深圳分公司结算的上季度日均交易金额的 10%,与初始保证金孰大者分别确定其本季度在本公司上海、深圳分公司的保证金缴存金额;根据基金销售代理人上季度日均交易金额的 10%,与初始保证金孰大者确定其本季度保证金缴存金额。具体计算公式为:

$$\text{本季度保证金缴存金额} = \text{Max}\left(\frac{\text{上季度总交易金额}}{\text{交易天数}} \times 10\%, \text{初始保证金}\right)$$

其中,总交易金额包括申购金额和赎回金额。

2、保证金调整将通过基金管理人和基金销售代理人的结算备付金账户划转完成。

第七条 根据市场风险状况,本公司认为必要时可调整初始保证金标准和缴存比例。

第八条 因基金管理人、基金销售代理人未按期履行资金交收义务等原因导致重大交收风险时,本公司有权动用所有基金管理人和基金销售代理人缴存的保证金来弥补风险。

第九条 动用保证金后,本公司将向违约基金管理人、基金销售代理人追偿所动用的保证金及利息,用于偿还保证金。

第十条 基金管理人或基金销售代理人如需注销保证金账户,应先结清其与本公司的债权债务,剩余保证金及相应利息由本公司划入其指定收款账户。

第十一条 本公司有权对本办法修改补充。

第十二条 本办法由本公司负责解释。

第十三条 本办法自发布之日起施行。