

关于发布《交收担保品管理办法》的通知

各结算参与人：

为贯彻落实《证券法》、《证券登记结算管理办法》的相关规定，推动证券结算基础制度体系不断完善，规范交收担保品管理，我公司制定了《交收担保品管理办法》，现予以发布，请遵照执行。

特此通知。

二〇〇七年二月七日

中国证券登记结算有限责任公司 交收担保品管理办法

第一条 为规范对结算参与人交收担保品的管理，维护结算系统安全，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券法》、《证券登记结算管理办法》等相关法律、法规和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“本公司”）相关业务规则的规定，制定本办法。

第二条 本办法所称结算参与人，是指《中国证券登记结算有限责任公司结算参与人管理规则》中规定的结算参与人。

第三条 本办法所称交收担保品是指根据本办法、相关结算业务规则及本公司与结算参与人结算协议的规定，由结算参与人提交给本公司的，或本公司直接取得的用于担保结算参与人履行资金交收义务的证券等资产。

交收担保品为证券的，应是在证券交易所上市流通的、业绩优良、流通股本规模适度、流动性较好的证券。

债券回购质押债券及结算参与人提交的非证券类交收担保品的管理办法另行规定。

第四条 交收担保品的担保范围即结算参与人的违约金额，包括资金交收账户的透支本金、利息、违约金、因处置担保品所产生的相关税费及其他因处置事宜发生的合理

支出。

第五条 本公司依据保护结算系统安全、保护市场稳定和公开、公平、公正、效益的原则，采取市场化方式处置交收担保品。

第六条 最终交收时点前，结算参与人可能发生交收透支的，应该向本公司申报提交交收担保品。

第七条 结算参与人申报提交交收担保品须符合以下条件：

- （一）结算参与人对被提交的交收担保品有处分权；
- （二）被提交的担保品可供本公司依法处置；
- （三）本公司相关业务规则规定的其他条件。

第八条 结算参与人申报提交交收担保品，应当在申报材料中明确交收担保品的种类、数量、所在证券账户及席位（托管编码）。

对于登记于结算参与人名下的企业债券等交收担保品，无须明确证券账户。

第九条 结算参与人可以将自营证券申报提交为自营交收账户或客户交收账户的交收担保品。

第十条 结算参与人的申报不符合本办法或本公司其他相关业务规则规定的，视为申报无效。

第十一条 已经提交的交收担保品不足以弥补违约金额的，本公司有权直接扣取结算参与人的自营证券作为交收担

保品。

第十二条 本公司将结算参与者提交的与（或）本公司直接扣取的交收担保品记入该结算参与人在本公司设立的交收担保品账户。

根据本公司与结算参与人的结算协议及本办法，本公司对交收担保品享有质权。

第十三条 在担保期间，除弥补违约金额以外，本公司不因其他原因使用交收担保品。

第十四条 结算参与人在 T+1 日发生资金交收透支并且截至 T+2 日最终交收时点没有补足因透支发生的违约金额的，本公司自 T+3 日起有权处置该结算参与人的交收担保品。

第十五条 截至 T+2 日最终交收时点，结算参与者补足违约金额的，可以向本公司申请撤回已经提交的交收担保品。

结算参与者申请撤回交收担保品，应当在申请材料中明确相关交收担保品的种类、数量、所在证券账户及席位（托管编码）。交收担保品为登记于结算参与人名下的企业债券或其他证券的，无须明确证券账户。

第十六条 本公司认为结算参与者能够在合理期限内补足违约金额的，可以给予一定的处置宽限期，结算参与人在处置宽限期内补足违约金额的，可以申请撤回交收担保品。

第十七条 本公司给予的处置宽限期届满，结算参与人仍不能补足违约金额的，本公司有权根据交收担保品的持有总量及市场流动性等因素在结算参与人已申报提交的交收担保品中选择足额的可供处置的交收担保品。

第十八条 处置交收担保品后，本公司将处置结果通知相关结算参与人。

第十九条 本公司通过委托独立第三方处置的方式处置担保品。

第二十条 对于高比例集中持有交收担保品等特殊情
况，经报告中国证监会，本公司可以通过其他方式进行处置。

第二十一条 委托独立第三方处置的，本公司与独立
第三方签署书面委托协议，明确交收担保品的处置条件及处
置费用等内容。

第二十二条 交收担保品处置所得如不能弥补违约金
额，本公司有权继续追索。

处置所得超过违约金额的，违约事件处理完毕后，本公
司将超过部分返还违约结算参与人。

第二十三条 违约金额所涉及的利息和违约金的计算
方法依据本公司公布的相关业务规则确定；相关税费根据相
关法律、法规和本公司公布的业务规则确定。

第二十四条 交收担保品处置完毕后，本公司将相关
情况书面报告中国证监会。

第二十五条 在担保期间，交收担保品产生的孳息与交收担保品共同担保违约金额。

第二十六条 本办法由本公司负责修订和解释。

第二十七条 本办法自公布之日起实施。