

关于政府债券基金产品开展 质押式回购有关事项的通知

(中国结算发字〔2020〕111号)

各市场参与机构:

为进一步规范政府债券基金产品开展净额结算质押式回购(以下简称“回购”)业务管理,支持交易所市场政府债券基金产品发展,根据中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“本公司”)《质押式回购资格准入标准及标准券折扣系数取值业务指引》、《标准券折算率(值)管理办法》等业务规则规定,现将政府债券基金产品开展回购有关事项通知如下:

一、本通知所称政府债券基金产品,是指证券交易所市场上市交易的且投资标的为证券交易所上市交易国债、地方政府债的基金产品。

二、政府债券基金产品申请作为回购质押品开展回购,应当符合以下条件:

(一)投资标的为证券交易所上市交易的国债、地方政府债;

(二)在基金投资运作中,不以基金组合持有的债券开展回购融资交易;

(三)基金资产净值不低于5亿元人民币;

(四) 本公司认定的其他条件。

三、符合第二条规定的政府债券基金产品在证券交易所上市后，基金管理人可向本公司申请将基金产品作为回购质押品。申请材料包括：

(一) 申请书（文本见附件 1）；

(二) 承诺书（文本见附件 2）；

(三) 基金招募说明书、基金合同、基金合同生效公告及基金上市公告；

(四) 基金管理人企业法人营业执照复印件（加盖公章）；

(五) 法定代表人授权委托书（文本见附件 3）；

(六) 经办人有效身份证明文件复印件；

(七) 本公司要求的其他材料。

四、经评估开展回购风险可测可控的，本公司书面通知基金管理人同意政府债券基金产品作为回购质押品及适用的初始折扣系数取值。基金管理人应就政府债券基金产品开展回购相关事项向市场进行公告。

本公司每日计算政府债券基金产品适用标准券折算率（值），并通过结算业务系统与本网站发布。

五、政府债券基金产品或其管理人发生以下情形的，本公司根据具体风险情况对政府债券基金产品折扣系数取值进行下调或取消其回购资格：

（一）基金管理人或基金经理被监管机构或自律组织通报发生风险或违规行为；

（二）政府债券基金产品发生运营风险；

（三）政府债券基金产品连续 3 个自然月日均资产净值低于 1 亿元人民币；

（四）政府债券基金份额交易价格异常波动，偏离基金净值幅度超过 5%；

（五）本公司认为有必要调整的其他情形。

六、基金管理人应当于政府债券基金产品每季度定期报告公告后的 20 个交易日内，向本公司提交季度情况报告（文本见附件 4）。

发生不符合本通知第二条第（一）（二）项规定，或发生本通知第五条所列相关风险情形的，基金管理人应当及时向本公司进行书面报告。

七、基金管理人在基金投资运作中，未遵守承诺书约定，不符合本通知第二条第（一）（二）项规定，或未按本通知第六条要求履行定期、不定期报告义务的，本公司取消相关政府债券基金的回购资格，并于取消相关政府债券基金回购资格之日起，2 年内不受理该基金管理人新提出的政府债券基金产品开展回购申请。

八、本通知发布前已具备回购质押品资格的政府债券基金产品，无需补充提交相关申请材料，开展回购期间应适用

本通知相关规定。

九、证券交易所市场上市交易的，且投资标的为证券交易所上市交易政策性金融债的基金产品，参照适用本通知相关规定执行。

十、本通知自发布之日起实施。

特此通知。

附件：

- 1.申请书文本
- 2.承诺书文本
- 3.法定代表人授权委托书文本
- 4.季度情况报告文本

中国证券登记结算有限责任公司

2020年4月24日

附件 1:

关于将 XXXX 基金作为质押式回购质押品的 申请

中国证券登记结算有限责任公司:

XXXXXX（基金公司全称）旗下 XXXX 基金已于 X 年 X 月 X 日于 XX 证券交易所上市。根据《质押式回购资格准入标准及标准券折扣系数取值业务指引》（以下简称《指引》）、《关于政府债券基金产品开展质押式回购有关事项的通知》（以下简称《通知》）等有关规定，现申请将 XXXX 基金作为质押式回购质押品：

一、基金管理人概况

包括成立时间、注册资本、企业性质等基本情况，以及对组织架构、业务范围、旗下基金、管理规模等情况的简要介绍。

二、基金产品情况

（一）基金产品基本要素表，内容包括成立日期、上市日期、基金代码、基金简称、运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等。（其中投资目标、投资范围、投资策略等不得出现与《通知》及承诺书不符的内容）

（二）基金成立时、成立以来每季度末及最新的份额与

净资产规模，并简要分析变动原因。

（三）截至最近一个季度末或是截至目前，基金投资组合构成，债券等各类资产规模及占基金净资产的比例；基金投资不同类别债券规模及占基金净资产的比例；投资规模前五名债券明细。（其中债券类别包括国债、地方政府债、政策性金融债等）

（四）截至最近一个季度末或是截至目前，持有基金份额投资者总数，不同类别投资者持有份额数量与占比，持有份额数量排名第一的投资者持有份额数量与占比，持有份额数量排名前五、前十的投资者持有份额数量与占比。

（五）基金成立以来每季度的二级市场成交金额，平均换手率（日均成交金额/日均基金净资产规模），平均折价率（取每日折价率的算术平均，每日折价率按照 $1 - \text{当日成交均价} / \text{当日基金份额净值}$ 计算），并对换手率与折价率情况进行简要分析。

综上，XXXX 基金符合《指引》《通知》关于相关规定，作为质押品开展回购风险较为可控。特此申请将 XXXX 基金作为质押式回购质押品。

指定联络人（2名）：

姓名：

部门：

座机:

手机:

电子邮箱:

通讯地址:

申请单位全称:

(加盖公章)

年 月 日

附件 2:

承诺书

中国证券登记结算有限责任公司:

现申请将本公司管理的 **XXXX** 基金作为回购质押品开展质押式回购业务。本公司承诺, **XXXX** 基金可开展回购期间遵守以下规定:

一、**XXXX** 基金所有投资标的证券均为国债、地方政府债、政策性金融债;

二、**XXXX** 基金不主动投资于不具备回购质押品资格的证券, 而且对被动持有的不具备回购质押品资格的证券于五个交易日内处置;

三、**XXXX** 基金不以产品资产组合持有的债券开展回购融资交易;

四、发生违反本承诺第一条、第二条、第三条规定, 或违反《关于政府债券基金产品开展质押式回购有关事项的通知》第五条第(一)(二)(三)(四)项规定的, 及时书面报告你公司。

五、**XXXX** 基金每季度定期报告公告后的 20 个交易日内, 向你公司提交基金季度情况报告。

申请单位全称:

(加盖公章)

年 月 日

附件 3:

法定代表人授权委托书

中国证券登记结算有限责任公司:

兹授权我单位 部门 同志办理申请将 XXXX 基金作为质押式回购质押品相关事宜。

本授权委托书有效期:自生效日起至 XXXX 基金回购质押品资格办理结束日。

被授权人姓名:

被授权人身份证明文件类别:

被授权人证件号码:

申请单位公章:

法定代表人签字或签章:

生效日期: 年 月 日

附件 4:

XXXX 年 X 季度 XXXX 基金情况报告

一、本季度末较本季度初，基金份额与净资产规模变动情况，并简要分析变动原因。

二、截至本季度末，基金投资组合构成，债券等各类资产规模及占基金净资产的比例；基金投资不同类别债券规模及占基金净资产的比例；投资规模前五名债券明细。（其中债券类别包括国债、地方政府债、政策性金融债等）

三、截至本季度末，持有基金份额投资者总数，不同类别投资者持有份额数量与占比，持有份额数量排名第一的投资者持有份额数量与占比，持有份额数量排名前五、前十的投资者持有份额数量与占比。

四、本季度基金二级市场成交金额，每日换手率（成交金额/基金净资产规模），每日折价率（ $1 - \text{当日成交均价} / \text{当日基金份额净值}$ 计算），并对换手率与折价率情况进行简要分析。

五、其他需要说明的事项。

落款（加盖公章）

日期