

深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司关于做好LOF场内限量发行比例配售及场内申购比例确认的系统改造通知 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/306/2021_2022__E6_B7_B1_E5_9C_B3_E8_AF_81_E5_c80_306088.htm 深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司关于做好LOF场内限量发行比例配售及场内申购比例确认的系统改造通知各场内基金代销机构、结算参与者：根据中国证监会要求，为了确保基金的平稳发展，同时切实保护中小投资者对基金的投资需求，上市开放式基金（LOF）业务将做以下调整：1．每只拟发行的基金须设定规模上限，发行期间如有效认购量超过限额必须实行比例配售。2．当基金开放申购赎回净申购规模达到基金限额时，基金公司将对当日申购进行比例确认。根据要求，深圳证券交易所和中国结算深圳分公司及相关基金公司共同协商拟定了基金发行实行发行期末日比例配售方案。末日比例配售的方案仍采用现行LOF基金多日发行、滚动交收的数据接口（详见《深圳证券交易所数据接口规范》

中SJS GF.DBF的“LOF/ETF连续认购方式”一节），但L+2日（L日为最后发行认购日）中国结算下传数据的内容反映比例配售的结果。中国结算深圳分公司的LOF基金发行流程如下：
：L日：根据认购数据做清算处理，并发送清算数据。L+1日：冻结认购资金，检查认购资金是否足额。L+2日：先对资金不足部分做拉单处理后，根据基金公司提供的认购比例做有效认购确认，并发送清算数据。清算数据中包括以下信息：A1：认购不确认记录，包括资金不到位及超比例认购的不确认记录（对于同时发生资金不到位和超比例认购的委托

，只发送一笔A1回报），证券公司可据此解冻相应的投资者超比例认购资金。A3：认购结果记录。A6：全部有效认购申报记录。L+3日：将超额认购资金返还至结算参与人备付金账户。L+4日：将认购资金划入相关基金托管人结算备付金账户。LOF基金场内发行手续费采用的是前端收费，费用计算采用外扣法计算，由代销证券公司根据与基金公司及投资者的约定自行计算并收取认购手续费。因此LOF基金发行末日按比例配售后，证券公司根据结算公司确认的认购申报不确认记录退回认购款的同时要自行计算并退回投资者认购手续费。为了配合LOF基金业务的顺利进行，请各具有深圳证券交易所场内LOF基金代销资格的证券公司做好以下业务及系统的准备工作：一、关于LOF基金限量发行比例配售的业务，证券公司应根据中国结算深圳分公司于L+2日发送的股份清算数据，向投资者退回不确认认购资金。另外在退回不确认认购资金的同时计算并退回相关认购手续费。100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com