

滴灌通（澳門）金融資產交易所

清算結算規則

發佈日期：2023年8月3日

滴灌通（澳門）金融資產交易所

清算結算規則

第一章 總則

第一條 為規範本所交易產品的清算結算業務，維護發行人、會員等市場參與主體的合法權益，維護市場清算結算秩序，防範相關風險，滴灌通（澳門）金融資產交易所（以下簡稱“滴灌通澳交所”或“本交易所”）根據有關法律法規、相關規定及《滴灌通（澳門）金融資產交易所總規則》（以下簡稱“《總規則》”），制定本規則。

第二條 依據中華人民共和國澳門特別行政區（以下簡稱“澳門”）法律法規及監管規定，在本交易所發行交易產品相關的清算及結算業務，適用本規則。本規則未作規定的，適用本交易所其他有關規則。與產品清算結算相關的更為細緻的規則將在對應產品的細則中進行明確規定。

澳門法律法規及澳門金融管理局對本規則所涉事項另有規定的，從其規定。

第三條 除文意另有所指或《總規則》另有規定外，本規則下列用語具有如下含義：

- (一) 清算：指本交易所按照確定的規則計算產品和資金應收應付數額的行為。
- (二) 結算：指本交易所根據確定的清算結果，通過產品和資金的最終交付履行資金資產交收的行為。
- (三) 交易賬戶：指本交易所為會員開立並登記在其名下的，用於記載其所持有的產品種類、數量、登記託管情況及其變動情況的簿記賬戶。
- (四) 資金賬戶：指本交易所為會員開立並登記在其名下的，用於支持交易和結算并記載

會員資金變動情況的簿記賬戶。

第四條 本交易所遵循公平、安全、高效的原則開展產品清算結算活動。

第二章 交易清算結算

第五條 本交易所根據產品類型、交易方式、風險狀況等因素，通過本交易所允許的清算結算方式為會員提供與產品的交易清算結算服務。

第六條 除本交易所相關規則另有規定外，每個交易日（T日），本交易所將依據當日產品交易的成交結果及費用等相關數據，計算會員交易賬戶下相關產品應收或者應付的產品份額、資金賬戶應收或應付的金額，以及掛牌申請人應收或應付的金額，形成當日的交易清算結果。

為免疑義，T日的交易清算結果將於下一交易日的營業時間開始前完成計算，會員及掛牌申請人可以通過本交易所提供的途徑查看交易清算結果。

第七條 根據交易清算結果，本交易所將安排會員的應付產品或者應收產品從相應交易賬戶劃出或劃入，以及應付資金或者應收資金從相應資金賬戶劃出或劃入，並向持有該產品的會員提供途徑查閱該產品相應的產品憑證（如適用）。

第八條 本交易所將按照貨銀對付原則安排交收。貨銀對付原則，是指本交易所會員在交收過程中，產品和資金的交收互為條件，當且僅當會員履行資金交收義務的，相應產品完成交收，會員履行產品交收義務的，相應資金完成交收。

第九條 為確保交易清算結算正常進行，會員進行交易申報時，針對其申報的產品買賣，應當保證其相關交易賬戶中有該相應的足額應付產品或保證其相關資金賬戶中有該相應的足額應付資金（含相關交易費用）。

第十條 除本交易所相關規則另有規定外，會員提交交易申報過後，根據其申報內容，該

會員交易賬戶中對應的產品份額或資金賬戶中對應的交易資金（含相關交易費用）將被凍結。

如出現交易撮合失敗、超額申購或者其他情況導致會員被凍結資金金額或產品份額多於其最終應付資金金額或應付產品份額的，該部分會於本交易所完成清算結算後解凍。

第十一條 清算交收程序開始前，本交易所按照相關法律法規或本交易所相關規則取消交易的，本交易所將不把相關交易納入清算交收範圍。

本交易所已經開始的產品和資金的清算交收程序不得被中斷、撤銷或改變，除本交易所相關規則另有規定外，交收完成後不可撤銷。

第十二條 本交易所于每週一至週五（澳門法律規定的法定公休日和節假日除外）進行交易清算結算安排。如本交易所公告其他休市或停市安排，相關清算結算安排以本交易所發佈的通知為準。

第十三條 本交易所同時提供其他交易清算結算服務，具體情形由本交易所另行制定相關規則予以規定。

第三章 產品收入清算結算

第十四條 本交易所為會員提供產品收入的清算結算服務。

第十五條 會員所享有的產品經濟權益，包括經濟權益的範圍、收入分配方式、分配頻率以及分配日期等安排將列於本交易所相關規則及產品發行文件中。

第十六條 本交易所將依據本交易所相關規則及產品發行文件的規定，計算會員持有產品所對應的收入以及相關稅費以形成產品收入清算結果，並根據產品收入清算結果相應進行資金結算。

第十七條 本交易所將依據產品收入的清算結算情況，為會員提供途徑定期查閱相關清算

結算結果。

第十八條 會員可隨時選擇將其資金賬戶中的累計金額作提現安排。

本交易所將在收到會員提出提現安排要求的10個工作日之內將對應金額劃轉至會員于本交易所登記的銀行賬戶，但本交易所相關規則另有規定的情形除外。本條的工作日指中國大陸及澳門金融機構的對公業務正常營業日(不包括中國大陸及澳門法律規定的法定公休日和節假日)。

第四章 風險規範

第十九條 本交易所可以根據市場風險狀況、會員風險情況等因素，採取相應的風險管控措施。

第二十條 本交易所應當依據法律法規、相關規定制定相應的風險防範制度和內部控制制度。

會員應當根據法律法規、相關規定和業務需要，建立相應的結算風險控制制度。

第二十一條 對於違反法律法規、相關規定或本交易所相關規則的，本交易所視具體情況有權對相關人員採取以下管理措施：

- (一) 口頭警示；
- (二) 書面警示；
- (三) 將其交易賬戶列為重點監控賬戶；
- (四) 暫停其於本交易所的相關業務資格；
- (五) 終止其於本交易所的相關業務資格；或
- (九) 本交易所規定的其他管理措施。

如對該措施有異議的，可以向本交易所提出複核申請，本交易所所有權在審核後決定是否接受複核申請。

第二十二條 因不可抗力、技術系統故障、設備故障、通信故障、停電等不受本交易所控制的突發事件對清算結算產生影響的，本交易所可以採取延遲發送數據、延遲清算結算等緊急措施。因上述原因導致清算結算結果有誤的，本交易所將對清算結算結果予以糾正，但在法律法規允許的範圍內不承擔任何其他責任。

第五章 附則

第二十三條 本交易所可以對本規則規定的內容另行制定相關規則予以規定，如本規則與另行制定的規則存在衝突的，以另行制定的規則為準。

第二十四條 本規則由滴灌通澳交所負責修訂並擁有最終解釋權，如無其他規定，本規則的任何修改會在滴灌通澳交所平台公佈之日起正式生效，不作另行通知。

第二十五條 本規則自滴灌通澳交所批准後，於滴灌通澳交所官方網站發佈之日起正式生效並實施。