

上海证券交易所沪港通试点办法

关于发布《上海证券交易所沪港通试点办法》和《上海证券交易所港股通投资者适当性管理指引》的通知

各市场参与者:

为规范沪港通试点活动,根据中国证监会《沪港股票市场交易互联互通机制试点若干规定》、《上海证券交易所交易规则》及其他相关规定,上海证券交易所制定了《上海证券交易所沪港通试点办法》和《上海证券交易所港股通投资者适当性管理指引》。现予发布,并自发布之日起施行。

特此通知。

附件:1.上海证券交易所沪港通试点办法

2.上海证券交易所港股通投资者适当性管理指引

上海证券交易所
二〇一四年九月二十六日

第一章 总则

第一条 为规范沪港通试点相关活动,防范风险,保护投资者合法权益,根据中国证监会《沪港股票市场交易互联互通机制试点若干规定》、《上海证券交易所交易规则》及上海证券交易所有关规定的其他相关业务规则,制定本办法。

第二条 投资者、本所会员、香港联合交易所有限公司(以下简称“联交所”)设立的证券交易服务公司(以下简称“联交所证券交易服务公司”)、本所设立的证券交易服务公司(以下简称“本所证券交易服务公司”)及其他市场主体参与沪港通交易及相关活动,应当遵守本办法。

沪股通交易事项(投资者证券买卖委托事项除外)和港股通交易的委托、本所会员客户管理等事项,本办法未规定的,适用《上海证券交易所交易规则》(以下简称“《交易规则》”)和本所其他相关业务规则。

第三条 本所对沪港通交易及相关活动实施自律管理。

第二章 沪股通交易

第一节 联交所证券交易服务公司参与沪股通业务

第四条 联交所证券交易服务公司参与沪股通业务,应当申请成为本所交易参与人并取得参与者交易业务单元,遵守本所对交易参与人的相关规定。

联交所证券交易服务公司不是本所会员,不享有法律、行政法规、部门规章、规范性文件和《上海证券交易所章程》、《上海证券交易所会员管理规则》等规定的本所会员权利。

第五条 联交所证券交易服务公司申请成为本所交易参与人,应当提交下列文件:

(一)申请书、承诺书;

(二)中国证监会、香港证券及期货事务监察委员会相关批准文件;

(三)企业法人营业执照;

(四)公司章程;

(五)沪股通业务管理制度、技术安排,以及委托联交所承担沪股通业务相关职责的安排;

(六)董事、监事、高级管理人员的个人资料;

(七)联交所参与者参与沪股通业务的承诺书文本、技术标准及其他要求;

(八)联交所证券交易服务公司与香港中央结算有限公司(以下简称“香港结算”的)沪股通结算协议;

(九)拟开展沪股通业务的联交所参与者名单,以及上述联交所参与者符合技术标准及其他要求的情况说明;

(十)与沪股通有关的费用收取方式和标准;

(十一)本所要求的其他文件。

第六条 联交所证券交易服务公司将联交所参与者根据投资者委托进行沪股通交易的订单向本所申报,并承担相应的交易责任。

沪股通交易申报在本所达成交易后,联交所证券交易服务公司应当承认交易结果,接受成交回报并发送给相关联交所参与者和香港中央结算有限公司。

联交所证券交易服务公司应当对联交所参与者的沪股通交易行为进行管理,并根据本所要求对沪股通违规交易行为采取必要的措施。

第七条 联交所证券交易服务公司可以委托联交所代为履行本办法规定的相关职责,但仍应承担相关职责未充分、适当履行的责任。

第八条 联交所证券交易服务公司应当建立沪股通业务风险控制措施,加强内部控制,防范业务风险。

第九条 联交所证券交易服务公司应当制定联交所参与者与沪股通业务的技术标准及其他要求,并对拟开展沪股通业务的联交所参与者的系统技术进行测试评估。

第十条 联交所证券交易服务公司应当要求符合条件的联交所参与者签署沪股通业务承诺书,承诺书应当包括但不限于以下内容:遵守内地和香港相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和业务规则;认可并执行联交所证券交易服务公司基于前述规定和双方约定对其提出的相关要求,以及通过合同或者其他安排要求其客户认可并执行相关要求;认可并通过合同或者其他安排要求其客户认可本办法及本所其他业务规则关于本所责任豁免的相关规定。

第十一条 联交所证券交易服务公司应当为沪股通投资者、联交所参与者了解相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和业务规则,业务流程、费用收取方式及标准等信息,提供必要的便利和指引。

第十二条 联交所证券交易服务公司应当遵守内地相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和业务规则。

第十三条 联交所证券交易服务公司按照本办法第五条向本所提交的材料内容发生变化的,应当在变更发生后3个交易日内向本所提交更新材料。

联交所证券交易服务公司应当按照本所要求提供沪股通业务运行相关情况的报告。

第十四条 联交所证券交易服务公司发生影响或者可能影响其业务运行的重大事件时,应当立即向本所报告,说明

事件的起因、目前的状态、可能产生的后果和应对措施。

第十五条 联交所证券交易服务公司应当妥善保存履行本办法规定职责形成的各类文件、资料,并采取适当方式要求联交所参与者妥善保存沪股通客户资料及其委托和申报记录等资料,保存期限不少于20年。

第二节 沪股通股票

第十六条 沪股通股票包括以下范围内的股票:

(一)上证180指数成份股;

(二)上证380指数成份股;

(三)A+H股上市公司的本所上市A股。

在本所上市公司股票风险警示板交易的股票(即ST、*ST股票和退市整理股票),以外币报价交易的股票(即B股)和具有本所认定的其他特殊情形的股票,不纳入沪股通股票。经监管机构批准,本所可以调整沪股通股票的范围。

第十七条 沪股通股票之外的本所上市股票因相关指数成份股调整等原因,导致属于本办法第六十条第一款规定范围且不属于第十六条第二款规定范围的,调入沪股通股票。

第十八条 因沪股通股票当日额度余额的计算公式为:

当日额度余额=每日额度-买入申报金额+卖出成交金额+被撤销和被本所拒绝接受的买入申报金额+买入成交价低于申报价的差额。

当日额度在本所连续竞价阶段使用完毕的,联交所证券交易服务公司暂停接受该时段后续的买入申报,但仍然接受卖出申报。此后在本所连续竞价阶段开始前,因买入申报被撤销,或被本所拒绝接受或者卖出申报成交等情形,导致当日额度余额大于零的,联交所证券交易服务公司恢复接受之后的买入申报。

当日额度在本所连续竞价阶段使用完毕的,联交所证券交易服务公司停止接受当日后续的买入申报,但仍然接受卖出申报。在上述时段停止接受买入申报的,当日不再恢复,本所另有规定的除外。

第十九条 联交所证券交易服务公司通过其指定网站公布沪股通股票名单,相关股票调入或者调出沪股通股票的生效时间以联交所证券交易服务公司公布的时间为准。

第三节 交易特别事项

第二十条 沪股通股票以人民币报价和交易。

第二十一条 沪股通交易日和交易时间由联交所证券交易服务公司在其指定网站公布。

第二十二条 沪股通交易采用竞价交易方式,本所另有规定的除外。

第二十三条 沪股通交易申报采用限价申报,本所另有规定的除外。

沪股通限价申报指令应当包括证券账号、经纪商代码、证券代码、买卖方向、数量、价格等内容。

本所根据监管需要,可以要求联交所证券交易服务公司提供其交易申报涉及的投资者信息。

第二十四条 根据本办法第八条被调出沪股通股票且仍属于本所上市股票的,不得通过沪股通买入,但可以卖出。

第二十五条 沪股通股票保证金交易和担保卖空的标的股票,应当属于本所市场融资融券交易的标的证券范围。

第二十六条 联交所证券交易服务公司应当对属于沪股通股票担保卖空的交易申报予以特别标识。

担保卖空的申报价格不得低于该股票的最新成交价;当天没有成交的,申报价格不得低于其前收盘价。

联交所证券交易服务公司应当促使联交所参与者要求其客户,在未归还为担保卖空而借入的股票前卖出相同股票的委托价格应当符合前款要求,但超出现归还股票数量的部

分除外。

第二十七条 单个沪股通交易日的单只沪股通股票担保卖空比例不得超过1%,连续10个沪股通交易日的单只沪股通股票担保卖空比例累计不得超过5%。联交所证券交易服务公司应当根据前述比例要求进行前端控制。

第二十八条 联交所证券交易服务公司应当对于每一个沪股通交易日最终通过其指定网站披露沪股通股票担保卖空比例。

本所可以根据市场情况,调整本条第一款规定的担保卖空比例限制,或者暂停接受沪股通股票担保卖空申报。

第二十九条 除下列情形外,不得进行沪股通股票非交易过户:

(一)为担保卖空而进行的期限不超过一个月的沪股通股票借贷;

(二)在自身持券范围内为满足持券检查要求而进行的为期一日不得展期的沪股通股票借贷;

(三)为处理错误交易而在联交所参与者与其交易客户之间进行的沪股通股票过户;

(四)基金管理人通过统一账户买入沪股通股票后,分配至其管理的各基金账户;

(五)本所和中国证监会登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)规定的其他情形。

第三十条 联交所证券交易服务公司应当采取适当方式,要求联交所参与者接受客户沪股通卖出委托时须确保客户账户内有足额的证券,不得接受客户无足额证券而直接在市场上卖出证券的委托。

第三十一条 通过沪股通买入的股票,在交收前不得卖

出。

第三十二条 联交所证券交易服务公司和联交所参与者不得自行撮合投资者买卖沪股通股票的订单,不得以其他任何形式在本所以外的场所提供沪股通股票转让服务,中国证监会另有规定的除外。

第三十三条 通过联交所证券交易服务公司进行的沪股通交易,证券交易公开信息中公布的名称为“沪股通专用”。

第三十四条 联交所证券交易服务公司未经本所同意,不得将本所许可其使用的交易信息提供给联交所参与者及其交易客户之外的其他机构和个人使用或者予以传播,也不得用于开发指数或者其他产品。

联交所证券交易服务公司应当采取适当方式,要求联交所参与者要求其客户遵守前款规定。

第三十五条 联交所证券交易服务公司应当按照本市场收费标准交纳沪股通交易经手费等相关费用。

联交所证券交易服务公司应当与香港结算就港股通交易进行清算交收、交纳交易经手费及其他相关费用。

<p