

中国证券登记结算有限责任公司新增港股通交易日交易结算风险管理实施办法

第一条 为开通内地与香港市场全部共同交易日的港股通交易，防范新增港股通交易日交易的结算风险，保护投资者合法权益，根据《证券登记结算管理办法》《内地与香港股票市场交易互联互通机制若干规定》及2022年8月12日《中国证券监督管理委员会、香港证券及期货事务监察委员会联合公告》等相关规定，以及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，制定本办法。

第二条 本办法所称新增港股通交易日，是指交易当日至其对应的港股交收日（含）期间，至少有一日为内地节假日且为香港地区非节假日的内地与香港市场共同交易日。

第三条 上海证券交易所（以下简称“上交所”）和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）的会员以及其他使用交易单元的机构在新增港股通交易日参与港股通交易，结算参与人办理相应结算业务的，适用本办法；本办法未作规定的，按照本公司其他业务规则办理。

第四条 结算参与人参与新增港股通交易日经纪业务资金结算的，应当确保其结算备付金账户满足新增港股通交易日资金头寸管理要求。

结算参与人参与新增港股通交易日托管业务资金结算的，应当会同其托管业务客户联合建立交易与资金头寸信息

核验机制。

交易与资金头寸信息核验机制，是指结算参与人托管业务客户根据其当日交易情况自行计算并准备其应提前到账资金，将相关信息通知结算参与人；结算参与人核验后，足额准备当日应提前到账资金并及时划付至其结算备付金账户。

第五条 结算参与人应当于交易当日 17:00 前将应提前到账资金足额划付至其港股通结算备付金账户。

应提前到账资金=当日交易买卖轧差应付金额（含税费）×资金提前到账调整系数。资金提前到账调整系数由本公司另行发布。

第六条 经纪业务及自营业务结算参与人应当自行计算并足额准备新增港股通交易日应提前到账资金。

第七条 托管业务结算参与人应当会同其托管业务客户通过交易与资金头寸信息核验机制，足额准备新增港股通交易日应提前到账资金。

本公司可以对结算参与人与其托管业务客户之间建立的交易与资金头寸信息核验机制进行抽查。

第八条 在新增港股通交易日交易的交收完成前，本公司对结算参与人的应提前到账资金进行可提款额度限制。

第九条 港股通证券的香港市场股权登记日落在内地节假日或者内地节假日后第一个港股通交易日的，本公司将结合内地与香港地区节假日安排对内地股权登记日进行相应调整，并编制发布港股通股权登记日对应表。

第十条 在港股通证券分拆合并业务中，有并行买卖的首个代码转换日或者无并行买卖的转换日为内地节假日或者内地节假日后第一个港股通交易日的，本公司通知上交所证券交易服务公司或者深交所证券交易服务公司，在所述内地节假日之前的新增港股通交易日暂停接受该证券的港股通交易申报，并予以公告。

在暂停接受交易申报的最后一个新增港股通交易日前，港股通证券取消分拆合并的，本公司可以通知上交所证券交易服务公司或者深交所证券交易服务公司，恢复接受该证券的港股通交易申报，并予以公告。

在内地节假日期间，港股通证券取消分拆合并的，本公司会同上交所证券交易服务公司或者深交所证券交易服务公司在内地节假日后第一个港股通交易日继续暂停接受该证券的港股通交易申报，并予以公告。

第十一条 结算参与人在新增港股通交易日未完成资金提前到账的，本公司有权采取下列措施：

（一）计收违约金， $\text{违约金} = \text{未完成提前到账资金缺口} \times 1\% \times \text{违约天数}$ ；

（二）收取资金垫息， $\text{垫息} = \text{未完成提前到账资金缺口} \times \text{垫资利率} \times \text{违约天数} / 360$ ；

（三）动用境外商业银行授信的，相关授信成本向该结算参与者收取；

（四）计入中国结算结算参与者结算业务综合评价，进行相应业务扣分。

第十二条 结算参与人在新增港股通交易日未完成资金提前到账，且于下一港股通交易日日终前仍未补足的，本公司有权暂停其港股通全部或者部分结算业务资格，并通知上交所证券交易服务公司或者深交所证券交易服务公司，暂停接受相关证券账户的港股通买入申报。对于经纪业务或者自营业务，通知暂停接受相关交易所会员全部自营证券账户的港股通买入申报。对于托管业务，本公司根据结算参与人申报，通知暂停接受所申报证券账户的港股通买入申报。结算参与人应当对其申报内容的真实、准确、完整、及时负责并承担相关责任。

结算参与人及时补足应付资金、违约金和利息的，本公司可以恢复其结算业务资格，并通知上交所证券交易服务公司或者深交所证券交易服务公司恢复接受相关证券账户的港股通买入申报。

第十三条 本办法由本公司负责解释。

第十四条 本办法自 2023 年 4 月 24 日起实施。