

附件

深圳证券交易所
证券交易业务指南
第 3 号——股票质押式回购交易

目 录

第一章 股票质押回购概述	3
第二章 交易权限管理	4
一、业务资格.....	4
二、质押特别交易单元申请.....	4
三、交易权限开通.....	4
四、交易权限暂停和终止.....	6
五、业务规模变更.....	7
六、新增或变更资产管理子公司全称.....	8
第三章 适当性管理	8
一、融入方适当性标准.....	8
二、合格融入方、融出方信息报备.....	8
三、客户资信管理.....	8
四、诚信档案.....	9
第四章 交易	9
一、标的证券.....	9
二、质押率.....	10
三、回购期限.....	10
四、最低交易金额.....	11
五、申报与成交.....	11
第五章 业务数据报送	15
第六章 违约处置	16
一、通过交易系统，在质押特别交易单元上进行违约处置的流程.....	16
二、通过协议转让进行违约处置的流程.....	18
三、通过仲裁、诉讼、申请执行强制执行公证或变价被标记的质押股票进行违约处置的流程.....	19
四、违约处置结果报告.....	20
五、违约处置撤销报告.....	20
第七章 会员业务管理和风险控制	20
一、交易及相关系统的前端控制.....	20
二、合并管理.....	21
三、融出方利益冲突管理.....	21
四、融入方信息披露.....	21
五、资金用途管理.....	22
六、特殊标的证券管理.....	23
七、交易信息查询.....	25
八、司法冻结（含对质押股票进行的标记）及司法强制执行监控.....	26
第八章 其他	26

特别说明：本指南仅为方便会员开展股票质押式回购交易（以下简称“股票质押回购”）之用，并非深圳证券交易所（以下简称“本所”）业务规则或对规则的解释。本所将根据股票质押回购的发展情况，对本指南作出修订，并保留对本指南的最终解释权。

为指导股票质押回购顺利开展，根据本所、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）发布的《股票质押式回购交易及登记结算业务办法》（以下简称“《业务办法》”）和相关规定，制定本指南。

第一章 股票质押回购概述

本指南所称股票质押回购是指符合条件的资金融入方（以下简称“融入方”）以所持有的股票或其他证券质押，向符合条件的资金融出方（以下简称“融出方”）融入资金，并约定在未来返还资金、解除质押的交易。

会员开展股票质押回购，须向本所申请股票质押回购交易权限。

会员开展股票质押回购，应当严格遵守相关法律、法规、中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）部门规章、规范性文件和本所、中国结算相关业务规则及规定，切实执行会员股票质押回购内部管理制度，认真履行与融入方、融出方签署的协议，自觉接受中国证监会、本所和中国结算的监

督管理。

会员办理与本所相关的股票质押回购业务，适用本指南。

股票质押回购的登记结算，适用中国结算深圳分公司的相关规定。

第二章 交易权限管理

一、业务资格

会员在本所从事股票质押式回购业务，应当具备证券经纪、证券自营业务资格，并符合《业务办法》关于申请股票质押回购交易权限的其他条件。

本所通过指定或配置专用交易单元，对会员股票质押回购交易权限进行管理。

二、质押特别交易单元申请

会员应当在开通股票质押回购交易权限前，通过本所会员业务专区申请开通质押特别交易单元，该交易单元用于股票质押回购质押标的证券的保管和处置。

会员可以通过新增或变更现有交易单元类别的方式开通质押特别交易单元。交易单元名称为“（会员简称）质押特别交易单元”，交易单元类别为“股票质押专用交易单元”，申请材料按照自营交易单元执行。

三、交易权限开通

会员通过本所、中国结算深圳分公司组织的股票质押回购技术系统仿真测试，完成业务和技术准备后，可以通过“会员

业务专区” - “业务办理” - “交易单元业务” - “股票质押式回购交易权限维护” - “新增”，按照以下步骤在线申请开通股票质押回购交易权限：

1. 指定自营交易单元用于股票质押回购交易指令申报；
2. 选择开通的质押特别交易单元；
3. 上传以下材料：

（一）交易权限申请书；

（二）经营证券业务许可证（副本）；

（三）业务实施方案及管理制度、客户适当性制度和客户投诉处理制度等相关文件；

（四）《股票质押式回购交易业务协议》（以下简称“《业务协议》”）和《股票质押式回购交易风险揭示书》（以下简称“《风险揭示书》”）样本；

（五）业务和技术系统准备情况说明；

（六）拟负责股票质押回购的高级管理人员与业务联络人的姓名及其联系方式（格式见附件 1），并通过“会员业务专区” - “业务办理” - “会籍业务” - “会员资料变更”栏目在线填写股票质押回购业务联络人资料；

（七）本所要求的其他材料。

交易权限申请书应当使用正式函件，分别列明交易权限开通时股票质押回购自营、资产管理产品作为融出方的业务规模，加盖申请会员公章，会员法定代表人应当在交易权限申请书上

签字，并严格按照如下文字做出承诺：“保证申请材料内容真实、准确、完整，如申请材料存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。”

以上材料应当逐项标明序号，压缩为一个电子文件上传。其中第（一）、（二）项应当经彩色扫描，第（六）项应当为可编辑文档。

会员成立了资产管理子公司的，还应当准确填写资产管理子公司全称、资产管理子公司营业执照号码等信息。

会员申请材料完备的，本所就其是否符合《业务办法》第七条关于公司治理和内部控制、合法合规经营、财务和风险控制指标等条件征求中国证监会证券基金机构监管部意见。中国证监会证券基金机构监管部无异议的，本所在收到意见起五个工作日内为会员开通指定交易单元的股票质押回购交易权限，并发出确认股票质押回购交易权限的书面通知。

四、交易权限暂停和终止

会员可以通过“会员业务专区”-“业务办理”-“交易单元业务”-“股票质押式回购交易权限维护”-“注销”，向本所提出终止股票质押回购交易权限的申请。提交申请时，应当不存在未了结的股票质押回购。

本所可以根据《业务办法》的相关规定暂停或终止会员股票质押回购交易权限。

会员股票质押回购交易权限被暂停的，本所交易系统不接

受该会员初始交易申报，但不影响购回交易、部分购回、补充质押、部分解除质押、违约处置和违约处置撤销申报。会员可以在引起被暂停股票质押回购交易权限的情形消除后，向本所申请恢复股票质押回购交易权限。

会员股票质押回购交易权限被终止的，本所交易系统不接受该会员各类股票质押回购申报，且本所自权限终止次日起一年内不接受该会员股票质押回购交易权限申请。

五、业务规模变更

业务开展期间，会员股票质押回购相应业务规模发生变更的，应当在业务规模调整前的2个交易日，通过“会员业务专区”-“业务办理”-“交易单元业务”-“股票质押式回购交易权限维护”-“变更”栏目在线填写变更后的自营业务规模、资产管理产品业务规模，上传加盖会员公章并经彩色扫描的业务规模变更说明，向本所报备。

变更说明内容应包含：

1. 会员变更前后报备的深市自营业务规模、资产管理产品业务规模；
2. 会员上一月月末实际深市及全市场自营业务规模、资产管理产品业务规模；
3. 会员上一月月末净资本规模；
4. 会员最近一次分类评价结果。

六、新增或变更资产管理子公司全称

会员新设资产管理子公司，或变更资产管理子公司全称的，应当通过“会员业务专区”-“业务办理”-“交易单元业务”-“股票质押式回购交易权限维护”-“变更”，填写资产管理子公司全称、资产管理子公司营业执照号码等信息，并上传经彩色扫描的资产管理子公司经营证券业务许可证（副本）。

第三章 适当性管理

一、融入方适当性标准

会员应当建立健全融入方资质审查制度，对融入方进行尽职调查。融入方不得为金融机构或者从事贷款、私募证券投资或私募股权投资、个人借贷等业务的其他机构，或者前述机构发行的产品。符合首发企业中创业投资基金股东认定标准的创业投资基金可以作为融入方参与股票质押回购。

二、合格融入方、融出方信息报备

会员应当在 T+1 日 9:00 之前通过“会员业务专区”向本所报送 T 日股票质押回购的合格融入方、融出方报告。

合格融入方报告填写融入方客户身份、风险揭示书签署、参与业务权限等情况。合格融出方报告填写融出方以自有资金出资或募集的资产管理产品出资，以及资产管理产品管理人等情况。

三、客户资信管理

会员可以对约定购回式证券交易、股票质押回购等业务在

客户资质调查及评级、交易额度授予等方面制订统一制度进行管理，根据客户已参与上述业务的履约情况对资信评级、交易额度授予进行调整。

四、诚信档案

会员应当积极配合并提交因违约而导致质押标的证券被处置的融入方信息，本所将其用于证券市场诚信档案建设工作。

第四章 交易

一、标的证券

（一）标的证券范围

股票质押回购初始交易标的证券为本所上市的 A 股股票；补充质押标的证券为本所上市的 A 股股票、基金、债券，以及本所挂牌的资产支持证券、优先股等证券。

B 股股票、暂停上市的 A 股股票、进入退市整理期的 A 股股票、没有完成股改的非流通股股票、股权激励限售股、非公开发行债券暂不纳入初始交易及补充质押标的证券范围。

（二）质押数量及比例控制

会员接受单只 A 股股票质押的数量及市场整体质押比例应符合《业务办法》相关规定，因适用《关于股票质押式回购交易相关事项的通知》化解股票质押回购违约风险，导致会员接受单只 A 股股票质押的数量或单只 A 股股票市场整体质押比例超过《业务办法》规定上限的除外。会员应当加强标的证券的风险管理，在提交交易申报前，应通过中国结算指定渠道查询

相关股票最近一个交易日市场整体质押比例信息，做好交易前端检查控制。

（三）暂停或恢复单一标的证券

本所可以根据市场情况，暂停或恢复单一标的证券用于股票质押回购，并向市场公布。

单一标的证券被本所暂停用于股票质押回购的，本所不接受会员以该标的证券用于申报初始交易，但接受申报补充质押、部分解除质押、购回交易、部分购回、违约处置和违约处置撤销指令。

会员可以通过本所网站“关于本所”-“业务专栏”-“股票质押式回购交易”-“业务通知”栏目查询暂停、恢复单一标的证券用于股票质押回购的公告。

二、质押率

会员应当依据标的证券资质、融入方资信、回购期限、第三方担保等因素确定和调整标的证券的质押率上限，其中股票质押率上限不得超过《业务办法》相关规定，因适用《关于股票质押式回购交易相关事项的通知》化解股票质押回购违约风险，导致质押率超过《业务办法》规定上限的除外。质押率是指初始交易金额与质押标的证券市值的比率。

会员应当在其内部管理制度或相关文件中明确质押标的证券市值计算方法。

三、回购期限

股票质押回购的回购期限不超过3年，发生回购到期日遇

非交易日顺延等超出 3 年的情形，会员应当将其作为异常情况向本所报告。因适用《关于股票质押式回购交易相关事项的通知》化解股票质押回购违约风险，导致累计回购期限超过三年的，会员应当在合约延期起五个交易日内通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“回购期限延期超 3 年”栏目在线填写相关信息，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件 2）。

四、最低交易金额

会员应当根据业务实质、市场情况和公司资本实力，合理确定股票质押回购每笔最低初始交易金额。会员确定的融入方首笔初始交易金额不得低于 500 万元；无论首笔初始交易是否已了结，此后在同一会员开展的每笔初始交易金额不得低于 50 万元。通过初始交易进行跨市场补充质押，以及会员开展上市公司股权激励行权融资需要办理股票质押的，每笔最低初始交易金额不受前述规定限制。

五、申报与成交

（一）初始交易

初始交易申报是指融入方按约定将所持标的证券质押，向融出方融入资金的交易申报。

交易双方可在申报初始交易指令之后的当日，申报对应的购回交易、部分购回、补充质押或部分解除质押指令。

根据不同融出方与登记质权人的选择情况，初始交易指令应申报“质权人类型”要素，用于进行质权人信息登记，具体

请参见中国结算深圳分公司的相关规定。

因适用《关于股票质押式回购交易相关事项的通知》化解股票质押回购违约风险，新增初始交易用于偿还违约合约债务而不适用《业务办法》若干规定的，会员应当在交易发生之日起五个交易日内通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“特殊适用情形”栏目在线填写相关信息，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件3）。

会员通过初始交易进行跨市场补充质押，以及开展上市公司股权激励行权融资通过初始交易进行质押登记的，应当在交易发生之日起五个交易日内通过本所“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“最低交易金额豁免”栏目在线填写相关信息，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件4）。

（二）购回交易

购回交易申报是指融入方按约定返还资金、解除标的证券及相应孳息质押登记的交易申报，包括到期购回申报、提前购回申报和延期购回申报。

交易双方将初始交易（包括合并管理的补充质押）的标的证券及相应孳息一并购回的，应当申报购回交易（到期购回、提前购回或延期购回）指令。

（三）部分购回

部分购回申报是指融入方按约定返还部分资金、解除部分标的证券或其孳息质押登记的交易申报。

交易双方应当约定部分购回的条件，以及上述情形下购回交易金额的调整方式。部分购回后的履约保障比例不得低于约定数值。

交易双方将初始交易或合并管理的补充质押的标的证券部分购回的，应当申报部分购回交易指令。

同一初始交易或合并管理的补充质押可多次申报部分购回交易指令。

同一初始交易及合并管理的补充质押标的证券已经通过部分购回交易指令全部购回的，会员应当申报终止购回交易指令。

融入方需要部分还款的，一般应通过部分购回交易指令完成；对于场外部分还款的，应当调减“股票质押回购盯市报告”报表中“融入方应付金额”数据。

（四）补充质押

补充质押申报是指融入方按约定补充提交标的证券进行质押登记的交易申报。

交易双方可以补充质押与初始交易相同或不同种类的标的证券。

本所暂不允许通过补充质押指令追加现金担保。

（五）部分解除质押

部分解除质押申报是指融出方解除部分标的证券或其孳息质押登记的交易申报。

融出方可以通过部分解除质押指令，解除任意数量的质押标的证券的质押登记。

融出方可以通过部分解除质押指令，解除质押标的证券的现金红利，具体要求请参见中国结算深圳分公司的相关规定。

（六）终止购回

终止购回申报是指不再进行购回交易时，融出方按约定解除标的证券及相应孳息质押登记的交易申报。

发生终止购回的，会员应当向本所提交购回交易金额为零、成交申报业务类别为“终止购回”的购回交易指令作为终止购回申报。

（七）违约处置

违约处置申报是指发生约定情形需处置质押标的证券的，会员按照《业务协议》的约定向本所提交的使该笔交易进入违约处置程序的交易申报。

会员拟通过交易系统进行处置的，申报违约处置指令，该笔交易进入违约处置状态。

（八）违约处置撤销

违约处置撤销申报是指违约处置指令成交确认后（含当日）、违约处置完成前，按照《业务协议》的约定或经交易各

方协商一致，因不再需要继续进行违约处置，会员向本所提交的撤销违约处置指令，使交易恢复正常状态的交易申报。违约处置撤销后，该笔交易进入正常状态，可以继续申报购回交易、部分购回、补充质押、部分解除质押、终止购回和违约处置指令。

第五章 业务数据报送

会员应当最迟于每一交易日 9:00 前通过“会员业务专区”-“公文及报表上传”-“创新业务报表报送”栏目，以 DBF 方式向本所报备前一交易日的“股票质押回购融入方报告”、“股票质押回购融出方报告”、“股票质押回购盯市报告”等数据。

会员应当通过“股票质押回购盯市报告”-“初始购回日期”字段准确填写每笔交易的最新购回日期，待购回期间发生提前或延期的应当及时更新购回日期。

会员应当通过“股票质押回购盯市报告”-“资金用途描述”字段准确填写每笔交易的资金用途，在“资金用途类型”字段准确填写资金用途类型。

会员应当通过“股票质押回购盯市报告”-“其他担保物描述”和“其他担保物价值”字段，准确填写不通过本所交易系统提交的其他担保物及价值数据。

会员应当确保向本所报送的“股票质押回购盯市报告”报表中“履约保障比例”数据与协议约定计算方式及柜台实际盯

市数据一致，将其他担保物价值、部分还款等情况纳入履约保障比例计算，并相应更新“保障级别”状态。

具体报送要求见《股票质押式回购交易业务之券商技术系统变更指南》“股票质押回购业务数据报送指南”。

第六章 违约处置

会员应当制定完善的违约处置方案，明确违约处置流程及会员内部各相关部门的职责，严格按照相关要求执行。

一、通过交易系统，在质押特别交易单元上进行违约处置的流程

对于无限售条件股份且不存在司法冻结（含依据《关于进一步规范人民法院冻结上市公司质押股票工作的意见》对质押股票进行的标记，以下简称对质押股票进行的标记），通过交易系统进行处置的，会员按以下程序处理：

（一）会员应当及时通知交易双方并报告本所，其中对于融入方为上市公司控股股东及其一致行动人，持有上市公司股份5%以上的股东及其一致行动人，上市公司董事、监事、高级管理人员或特定股东等情形（以下统称“须书面报告情形”），会员应当在提交违约处置电子指令前，通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“违约处置报告”-“交易系统处置”栏目在线填写违约处置报告，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件5）；

（二）会员 T 日向本所交易系统提交违约处置电子指令，

由交易系统即时确认成交，并发送成交回报；

（三）中国结算深圳分公司根据本所确认的违约处置电子指令数据，T日日终对初始交易合同序号下合并管理的全部标的证券进行可卖出处理操作，并将现金红利孳息全部划转至会员自营资金交收账户；

（四）会员可自T+1日起根据《业务协议》的约定，通过质押特别交易单元，使用竞价交易或大宗交易方式对质押标的证券进行处置，处置所得资金划入会员自营资金交收账户，卖出成交后，会员应当在当日根据中国结算深圳分公司的要求通过D-COM提交申报数据；

（五）处置所得资金与红利孳息由会员优先偿还融出方，如有剩余的返还融入方，如不足偿还的由融入方继续承担偿付责任；

（六）违约处置后，质押标的证券无剩余且需要了结合约的，或者质押标的证券有剩余且需要解除质押的，会员向本所交易系统申报终止购回指令。质押标的证券有剩余的，中国结算深圳分公司日终对初始交易合同序号下合并管理的剩余标的证券在质押特别交易单元上解除质押冻结，会员可以通过转托管指令将相应数量证券从质押特别交易单元转托管至融入方交易单元。

申报违约处置指令、该笔交易进入违约处置状态后，不可申报部分解除质押、部分购回指令；申报购回交易、终止购回

指令的，相应证券将在质押特别交易单元上解除质押冻结。会员应当在《业务协议》中约定，申报违约处置指令、该笔交易进入违约处置状态后，融入方能否申报补充质押、购回交易指令，并在内部管理制度和管理系统中明确规定相应业务和技术控制流程。

二、通过协议转让进行违约处置的流程

对于符合《关于通过协议转让方式进行股票质押式回购交易违约处置相关事项的通知》（以下简称《通知》）办理条件，交易各方通过协议转让进行违约处置的，股票转让价款应当与业务协议约定的融出方优先受偿金额基本匹配。涉及会员的事项，按以下程序处理：

（一）会员应当通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“违约处置报告”-“协议转让”栏目在线填写违约处置报告，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件6），此文件即会员根据《通知》第六条第（二）项要求出具的说明；

（二）其他事项依据《深圳证券交易所上市公司股份协议转让业务办理指引》及《通知》要求办理。

（三）协议转让违约处置过户完成后，质押标的证券无剩余且需要了结合约的，或者质押标的证券有剩余且需要解除质押的，会员向本所交易系统申报终止购回指令。质押标的证券有剩余的，中国结算深圳分公司日终对初始交易合同序号下合

并管理的剩余标的证券解除质押冻结。

三、通过仲裁、诉讼、申请执行强制执行公证或变价被标记的质押股票进行违约处置的流程

对于有限售条件股份、已被司法冻结（含对质押股票进行的标记）股份以及其他情形，采用仲裁、诉讼、申请执行强制执行公证或变价被标记的质押股票等司法途径处置质押标的证券的，会员按以下程序处理：

（一）会员应当及时通知交易双方并报告本所，其中对于符合须书面报告情形的，应当在案件受理或立案之日起五个交易日内通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“违约处置报告”-“通过司法途径主张质权（案件受理或立案后）”栏目在线填写违约处置相关信息，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件7）。

（二）案件受理或立案后，仲裁机构或司法机关出具生效法律文书后、人民法院采取强制执行措施前，会员应当通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“违约处置报告”-“通过司法途径主张质权（法院采取强制执行措施前）”栏目在线填写违约处置进展信息，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件7）。

（三）协助司法违约处置后，质押标的证券无剩余且需要了结合约的，或者质押标的证券有剩余且需要解除质押的，会员向本所交易系统申报终止购回指令。质押标的证券有剩余的，

中国结算深圳分公司日终对初始交易合同序号下合并管理的剩余标的证券解除质押冻结。

四、违约处置结果报告

违约处置完成后五个交易日内，会员通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“违约处置报告”-“违约处置结果”栏目在线填写违约处置结果信息(格式见附件8)。

五、违约处置撤销报告

对于符合须书面报告情形的，会员应当在申报违约处置撤销指令后五个交易日内通过“会员业务专区”-“业务办理”-“股票质押式回购”-“违约处置报告”-“违约处置撤销”栏目在线填写违约处置撤销相关信息，下载后加盖会员公章并经彩色扫描上传至“申请文件”处（格式见附件9）。

第七章 会员业务管理和风险控制

一、交易及相关系统的前端控制

会员应当建立股票质押回购管理系统，对股票质押回购实施统一管理，严格做好以下前端控制：

（一）融入方必须为符合会员所制定资质审查标准的客户，并已签署《风险揭示书》；

（二）融出方必须为符合《业务办法》要求的主体；

（三）标的证券必须符合会员按照《业务办法》确定和调整的证券范围，且未被本所暂停用于股票质押回购；

（四）初始交易金额必须符合《业务办法》要求；

（五）根据相关规定和自身风险承受能力确定和调整相应业务规模；

（六）单一客户、单一证券交易金额占净资本，单只 A 股股票质押数量及市场整体质押比例，质押率等风险控制指标；

（七）会员应当限制客户在交易未全部了结之前进行证券账户销户、证券账户号码变更等操作。

二、合并管理

会员应当建立以初始交易合同序号为核心的合并管理机制，对股票质押回购初始交易及相应的补充质押、部分解除质押、部分购回进行合并管理。

履约保障比例达到或低于约定数值的，会员可以按照《业务协议》的约定，要求融入方或其他主体提交经会员认可的其他担保物，与质押标的证券合并计算履约保障比例。

三、融出方利益冲突管理

会员应当制订相关制度，明确资产管理产品作为融出方与公司自有资金作为融出方的分配原则，尊重融入方意愿，保证不同融出方公平参与交易。

四、融入方信息披露

持有上市公司股份 5%以上的股东，将其持有的该上市公司股票进行股票质押回购的，会员应当书面提示融入方按照相关法律法规和本所业务规则的规定，履行相应的信息披露义务。

融入方为持有上市公司股份 5%以上的股东、董事、监事或高级管理人员，根据《业务协议》的约定构成违约，会员通过

集中竞价交易处置质押标的证券的，会员应当书面提示融入方按照相关法律法规和本所业务规则的规定，履行相应的信息披露义务。

五、资金用途管理

（一）资金专用账户存放

《业务协议》应当明确约定融入方融入资金存放于其在会员指定商业银行开立的专用账户，专用账户用于存放股票质押回购融入或拟归还资金。初始交易完成后，会员应当及时确认融入资金已存放至该专用账户。

《业务协议》应当明确约定融入方违反融入资金专用账户存放要求的，会员可以要求融入方采取相应改正措施。

融入方通过同一会员进行多笔股票质押回购交易的，无论融出方是否相同，融入资金可以存放在同一专用账户。融入方通过不同会员进行股票质押回购交易的，融入资金应当存放在不同专用账户。

会员应当与指定商业银行、融入方、会员资产管理子公司（资产管理子公司管理的集合资产管理计划或定向资产管理客户作为融出方时）签订融入资金专户存放监管协议。该协议应当至少包括以下内容：

1. 融入资金专用账户号码；
2. 融入方应当将融入资金集中存放于融入资金专户；
3. 商业银行应当定期向融入方提供包含划出资金收款人信息的专户银行对账单，并抄送会员；

4. 会员可以定期或不定期通过商业银行查询专户资料；
5. 融入方、商业银行、会员的权利和义务；
6. 融入方、商业银行、会员的违约责任。

(二) 资金跟踪管理

会员应当要求融入方在融入资金划出专用账户后一定期间内提供资金使用证明材料。

(三) 违规或违约处理措施

会员发现融入方违反《业务办法》相关规定使用资金的，应当督促融入方按照协议约定采取改正措施，相关改正完成前不得继续向融入方融出资金；未按照协议约定采取改正措施的，会员应当要求融入方提前购回。

会员发现融入方违反《业务协议》约定但仍符合《业务办法》相关规定使用资金的，按照协议约定处理。

六、特殊标的证券管理

(一) 有限售条件股份解除限售

以有限售条件股份作为质押标的证券的，待购回期间解除限售条件满足时，会员应当向融入方提供融入方交易单元代码和冻结序号信息，督促融入方及时要求上市公司申请办理相应股票质押回购质押标的证券的解除限售手续。

交易各方应当在《业务协议》中约定，待购回期间，融入方对质押的无限售条件股份追加限售，或对质押的有限售条件股份延长限售期限的，应当获得质权人书面同意。

部分解除质押、部分购回的，会员应当根据中国结算深圳

分公司发送的数据文件，确保正确申报交易指令中的“股份性质”要素。

（二）董事、监事、高级管理人员所持有股份

会员拟接受上市公司董事、监事和高级管理人员持有的所任职上市公司股份作为质押标的证券的，应根据其可转让额度审慎评估确定质押率和回购期限，通过《业务协议》明确约定会员对可转让额度相关事项的管理措施，并在待购回期间对可转让额度进行监测。违约处置时，可转让额度内相关股份可通过二级市场卖出的方式进行处置，具体请参见中国结算深圳分公司相关规定。

（三）控股股东所持有股份

会员拟接受上市公司控股股东及其一致行动人持有股份作为质押标的证券的，应当对融入方持股情况、已质押情况、还款意愿、履约能力、追加担保能力等方面进行尽职调查，审慎评估违约处置发生和质权实现的风险。对于上市公司控股股东及其一致行动人累计质押股份占持有股份比例高、缺乏追加担保能力的，会员应当采取相应风险控制措施。

会员需要评估融入方已质押情况的，可以要求融入方委托会员，通过中国结算深圳分公司“投资人登记业务电子平台”-“证券查询”-“代理投资者查询”-“证券冻结查询”栏目，选择“书面证明”方式由中国结算深圳分公司邮寄反馈该融入方托管在多家会员的证券质押冻结情况。

（四）涉及业绩承诺股份补偿协议股份

会员应当通过融入方申报、上市公司公告、本所网站-“信息披露”-“监管信息公开”-“承诺事项及履行情况”-“承诺类别（业绩承诺及补偿安排）”栏目等渠道，核查确认融入方拟质押股票是否涉及业绩承诺股份补偿协议。

（五）个人持有的应纳税限售股份

个人以其持有的应纳税限售股份参与股票质押回购的，会员可以在相应《风险揭示书》中，对交易双方充分揭示纳税额度对交易可能产生的影响。

（六）基金、债券

以基金、债券作为补充质押标的证券的，会员应当在相应《风险揭示书》中，对融入方、融出方客户（融出方为集合资产管理计划或定向资产管理客户时）充分揭示基金、债券作为股票质押回购补充质押标的证券的特有风险。

以债券作为补充质押标的证券的，交易各方应当在《业务协议》中约定，待购回期间发生债券兑付、赎回的，所得资金一并质押。

以分级基金作为补充质押标的证券的，交易各方应当在《业务协议》中约定，分级基金因份额折算业务增加的基金份额一并质押。

七、交易信息查询

会员应当向交易双方提供股票质押回购交易明细信息查询。

股票质押回购交易明细应当包括交易要素、冻结序号（初

始交易合同序号或补充质押合同序号) 等信息。发生合并管理的, 交易明细应当清晰列示交易流水及当前质押标的证券代码、数量等信息。

八、司法冻结(含对质押股票进行的标记) 及司法强制执行监控

会员应当根据中国结算深圳分公司发送的数据文件, 建立司法冻结(含对质押股票进行的标记) 及司法强制执行信息日常监控机制, 及时发现待购回期间质押证券司法冻结(含对质押股票进行的标记) 及司法强制执行情况。

第八章 其他

本所按照每笔初始交易质押标的证券面值 1%, 最高不超过 100 元人民币收取交易经手费, 对融入方在初始交易应收金额中扣收。

- 附件: 1. 股票质押式回购交易业务负责人及
 联络人信息表
2. 回购期限延期超过 3 年报告
3. 特殊适用情形报告
- 4-1. 最低交易金额豁免情形(跨市场补充质押)
 报告
- 4-2. 最低交易金额豁免情形(股权激励行权融资)
 报告

5. 违约处置（交易系统）报告
6. 违约处置（协议转让）报告
7. 通过司法途径主张质权报告
8. 违约处置结果报告
9. 违约处置撤销报告

附件 1

股票质押式回购交易业务负责人及联络人信息表

姓名	部门	职务	固定电话	移动电话	电子邮箱

注：前两行请分别填写指定业务、技术联络人的信息

附件 2

回购期限延期超过 3 年报告

交易信息	初始交易合同序号	(22 位或 24 位)		
	补充质押合同序号 (如有)	(22 位或 24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	履约保障比例		融资余额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融入方持股数量占总股本比例		融入方股东身份	
	延期原因	回购期限是否已届满 3 年	<input type="checkbox"/> 已届满 3 年 <input type="checkbox"/> 3 个月内将届满 3 年	
延期安排	延长期限			
	本次延期后到期购回日			
	本次为第几次提交本报告			
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整，如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司：（公章）</p> <p>联系人： 联系电话： _____ 年 ____ 月 ____ 日</p>				

注：“融入方股东身份”处填写融入方是否为上市公司控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东。“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 3

特殊适用情形报告

新增交易信息	初始交易合同序号	(24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方持股数量占总股本比例		融入方股东身份	
原交易信息	初始交易合同序号	(22 位或 24 位)		
	补充质押合同序号 (如有)	(22 位或 24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	履约保障比例		融资余额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方持股数量占总股本比例		融入方股东身份	
涉及的规则条款				
特殊适用情形说明				
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整，如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司：（公章）</p> <p>联系人： 联系电话：</p>				

____年__月__日

注：“融入方股东身份”处填写融入方是否为上市公司控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东。“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 4-1

最低交易金额豁免情形(跨市场补充质押)报告

交易信息	初始交易合同序号	(24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	质押标的证券数量		质押数量占总股本比例	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	股份性质			
原初始交易信息	初始交易合同序号			
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	质押标的证券数量		质押数量占总股本比例	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	股份性质		资金用途	
	融入方是否为控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东			
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整，如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司：（公章）</p> <p>联系人： 联系电话： _____年____月____日</p>				

注：“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 5

违约处置（交易系统）报告

交易信息	初始交易合同序号	(22 位或 24 位)		
	补充质押合同序号 (如有)	(22 位或 24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融入方是否为控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东			
处置原因				
处置安排	拟处置方式	<input type="checkbox"/> 竞价交易 <input type="checkbox"/> 大宗交易		
	拟处置金额			
	拟处置数量		拟处置数量占总股本比例	
	其他需要说明的处置安排			
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整，如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司：（公章）</p> <p>联系人： 联系电话： _____年__月__日</p>				

注：“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 6

违约处置（协议转让）报告

交易信息	初始交易合同序号		(22 位或 24 位)					
	补充质押合同序号 (如有)		(22 位或 24 位)					
	初始交易日期				初始交易金额			
	履约保障比例				融资余额			
	预警线				平仓线			
	回购期限				到期购回日			
	质押标的证券代码				质押标的证券简称			
	股份性质				质押标的证券数量			
	质押数量占总股本比例				资金用途			
	融出方证券账户号码				融出方名称			
	融出方类别		自有/集合/定向		质权人名称			
	融入方证券账户号码				融入方名称			
	融入方持股数量占公司总股本比例				融入方股东身份			
违约情形								
协议转让安排	冻结序号 (22 位或 24 位)	质押登记日期	受让人名称	拟转让数量 (万股)	拟转让数量占总股本比例(%)	拟转让价格与协议签署日前一交易日公司股份收盘价的比值 (%)	转让价款 (万元)	本次转让价款中优先偿还融出方金额 (万元)
	合计							
其他需要说明的协议转让安排，包括但不限于：本次协议转让税费计算情况；股票质押回购合约违约金计算情况；是否存在多个股东向同一受让人转让或一个股东向多个受让人								

转让等。

我公司承诺已核查该协议转让符合《关于通过协议转让方式进行股票质押式回购交易违约处置相关事项的通知》的要求，协议转让申请及本报告内容真实、合法、合规。

证券公司：（公章）

联系人：

联系电话：

年 月 日

注：“融入方股东身份”处填写融入方是否为上市公司控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东。“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 7

通过司法途径主张质权报告

交易信息	初始交易合同序号	(22 位或 24 位)		
	补充质押合同序号 (如有)	(22 位或 24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融入方是否为控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东			
处置原因				
处置安排	处置方式	<input type="checkbox"/> 申请执行强制执行公证 <input type="checkbox"/> 仲裁 <input type="checkbox"/> 诉讼 <input type="checkbox"/> 申请变价被标记的质押股票 <input type="checkbox"/> 其他方式		
	拟处置金额			
	拟处置数量		拟处置数量占总股本比例	
	其他需要说明的情况，包括但不限于：是否已被司法冻结（含对质押股票进行的标记），是否拟采取财产保全措施；如通过诉讼途径处置，法院是否适用特别程序；如申请执行强制执行公证，是否涉及移送执行等。			
处置进展	（仲裁机构或司法机关出具生效法律文书后、人民法院采取强制执行措施前或变价被标记的质押股票前填写） <input type="checkbox"/> 司法拍卖 <input type="checkbox"/> 二级市场卖出 <input type="checkbox"/> 协议转让 <input type="checkbox"/> 折价过户 对于二级市场卖出的，应当说明拟处置方式、拟处置金额、拟处置数量。			
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整，如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司：（公章）</p> <p>联系人： 联系电话： _____ 年 ____ 月 ____ 日</p>				

注：“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 8

违约处置结果报告

交易信息	初始交易合同序号	(22 位或 24 位)		
	补充质押合同序号 (如有)	(22 位或 24 位)		
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方是否为控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东			
处置过程	违约处置申报日期			
	处置卖出日期			
	处置卖出方式	<input type="checkbox"/> 竞价交易 <input type="checkbox"/> 大宗交易 <input type="checkbox"/> 协议转让 <input type="checkbox"/> 强制执行公证 <input type="checkbox"/> 仲裁 <input type="checkbox"/> 诉讼 <input type="checkbox"/> 变价被标记的质押股票 <input type="checkbox"/> 其他方式		
	处置卖出成交金额			
	处置卖出数量			
	其他需要说明的处置安排			
处置结果	融出方是否足额受偿			
	融出方优先受偿金额 (其中融入方违约金金额)			
	返还融入方资金金额及方式 (如有)			
	处置剩余解除质押证券代码及数量			
	其他需要说明的处置结果			
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整,如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏,将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司:</p> <p>联系人: 联系电话:</p> <p style="text-align: right;">_____年___月___日</p>				

注:“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。

附件 9

违约处置撤销报告

交易信息	初始交易合同序号			
	补充质押合同序号(如有)			
	初始交易日期		初始交易金额	
	回购期限		到期购回日	
	质押标的证券代码		质押标的证券简称	
	股份性质		质押标的证券数量	
	质押数量占总股本比例		资金用途	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融出方证券账户号码		融出方名称	
	融入方是否为控股股东及其一致行动人、持股 5%以上股东及其一致行动人、董事、监事、高级管理人员或特定股东			
违约处置情况	违约处置申报日期			
	处置卖出日期			
	处置卖出方式	<input type="checkbox"/> 竞价交易 <input type="checkbox"/> 大宗交易 <input type="checkbox"/> 协议转让 <input type="checkbox"/> 强制执行公证 <input type="checkbox"/> 仲裁 <input type="checkbox"/> 诉讼 <input type="checkbox"/> 变价被标记的质押股票 <input type="checkbox"/> 其他方式		
	处置卖出成交金额			
	处置卖出数量			
	融出方是否足额受偿			
	截至目前融资余额			
撤销原因及后续处理安排				
<p>我公司承诺报告内容真实、准确、完整，如报告内容存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担全部法律责任。</p> <p style="text-align: right;">证券公司：（公章）</p> <p>联系人： 联系电话：</p> <p style="text-align: right;">年 月 日</p>				

注：“特定股东”定义参考《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》相关规定。