

上海证券交易所转融通证券出借交易业务会员及其他交易参与者指南

2013. 2. 22

目 录

第一章	转融通证券出借交易业务概述	3
第二章	交易权限申请、开通与客户证券账户报送	3
	一、会员及其他交易参与人交易权限申请.....	3
	二、证券出借交易业务会员客户证券账户报备.....	4
第三章	交易流程	5
	一、委托与申报.....	5
	二、交易前端控制.....	6
	三、成交.....	7
	四、出借证券的归还、权益补偿和借券费用支付.....	7
第四章	标的证券、期限与费率	7
	一、标的证券与期限.....	7
	二、费率.....	8
第五章	交易信息披露	9
第六章	会员内部控制	9
	一、会员业务管理制度.....	10
	二、会员对标的证券的管理.....	11
	三、会员对证券出借交易的管理.....	11
	四、会员信息报送日常报告制度.....	12
	五、会员相关技术系统的运行管理.....	12
第七章	其他事项	13
	一、权益类信息披露及相关事务.....	13
附件：	转融通证券出借交易业务会员客户证券账户信息	14

为促进转融通业务的顺利开展，保障证券出借人与证券借入人通过上海证券交易所（以下简称“本所”）的转融通证券出借交易有序进行，根据中国证监会《转融通业务监督管理试行办法》和《上海证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》（以下简称“《实施办法》”）和相关规定，制定本指南。

第一章 转融通证券出借交易业务概述

本指南所称转融通证券出借交易业务（以下简称“证券出借交易”），是指证券出借人（以下简称“出借人”）以一定的费率通过本所综合业务平台向证券借入人（以下简称“借入人”）出借本所上市证券，借入人到期归还所借证券及其相应权益补偿并支付费用的业务。中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）是证券出借交易的借入人。

会员及其客户，持有、租用本所交易单元的交易参与者（以下简称“其他交易参与者”）办理与本所相关的证券出借交易业务，适用本指南。

证券出借交易的清算、交收、权益补偿、归还等业务，适用中国证券登记结算有限责任公司和证券金融公司的相关规定。

第二章 交易权限申请、开通与客户证券账户报送

一、会员及其他交易参与者交易权限申请

会员为其客户提供证券出借交易代理服务的，应当向本所

申请交易权限，需向本所会员部提交以下材料：

（一）书面申请报告；

（二）证券出借内部管理制度；

（三）负责证券出借的高级管理人员与业务人员名单及其联系方式；

（四）本所要求提交的其他材料。

其他交易参与者如要向本所申请交易权限的，除上述材料外，还应当提交已知晓并理解相关证券出借交易风险的承诺函。

上述申请材料应以电子文件报送本所，其中，申请材料（一）及承诺函应加盖申请人公章。

会员及其他交易参与者向本所申请交易权限前，应先与证券金融公司实现技术系统连接，并按证券金融公司要求报备相关信息。

本所经审核，认为会员及其他交易参与者申请符合规定的，将向其发出确认其转融通出借交易权限的书面通知。

本所可根据需要，对会员及其他交易参与者转融通出借业务相关的内部控制制度、业务操作规范、风险管理措施、交易技术系统的安全运行状况等进行检查，作为转融通出借交易权限审核依据之一。

二、证券出借交易业务会员客户证券账户报备

会员与客户签订委托代理协议前，应当向客户充分揭示证券出借交易风险，并与客户签署风险揭示书。会员应当将与其签订

委托代理协议的客户证券账户报本所备案。T日报备的证券账户，T+1日可参与证券出借交易。

报送路径：本所网站--会员公司专区--业务办理--转融通证券出借交易业务办理--会员客户证券账户报备。

权限：共用融资融券的EKEY权限。

报送时间：每个交易日9:00-16:00。

说明：数据以增量方式报送，数据传送方向为单向上传，本所无应答文件反馈。

具体文件内容及格式详见附件（《转融通证券出借交易业务会员客户证券账户信息》）。

第三章 交易流程

一、委托与申报

会员可以接受客户普通证券账户的证券出借交易委托。其他交易参与人可以直接通过其交易单元进行证券出借交易申报。借入人直接通过其交易单元进行证券借入申报。

证券出借交易委托与申报分为非约定申报和约定申报两种类型。会员接受客户证券出借交易委托，应当按照本所规定的格式申报。其他交易参与人和借入人应当按照本所规定的格式申报。

非约定申报指令，应当包括证券账号、证券代码、期限、出借或借入、费率、证券数量、交易单元代码等内容。方向为F的，

表示借入申报；方向为 G 的，表示借出申报。

约定申报指令，应当包括证券账号、证券代码、期限、出借或借入、费率、证券数量、本方交易单元代码、对手方交易单元代码、约定号等内容。约定号由借入人统一分发。方向为 F 的，表示借入申报；方向为 G 的，表示借出申报。

二、交易前端控制

会员和其他交易参与者应当建立由总部集中管理的证券出借交易业务技术系统，对证券出借交易业务的主要流程进行自动化管理，并在现有普通交易前端检查的基础上，增加对包括但不限于下列有关事项进行前端检查：

（一）对已申报出借的证券，在其撤销申报指令前限制其卖出或者另作他用；

（二）出借申报的数量应当为 100 股（份）或其整数倍，最低单笔申报数量不得低于 1 万股（份），最大单笔申报数量不得超过 100 万股（份）。

借入人应当建立相关技术系统，并制定相应的安全运行管理制度和应急处理预案。对证券借入交易业务的主要流程进行自动化管理，并对包括但不限于下列有关事项进行前端检查：

（一）借入申报的数量应当为 100 股（份）或其整数倍，最低单笔申报数量不得低于 1 万股（份），最大单笔申报数量不得超过 1 亿股（份）。

（二）转融券专用证券账户不得借入除本所公布的融券卖出

标的证券范围以外的证券。

本所对客户证券账户报备进行事后检查，会员应做好相关前端控制，确保只有报备过的证券账户才能进行证券出借交易。

本所对证券出借交易权限不实行技术前端控制，会员和其他交易参与者应做好相关前端控制，确保在完成与证券金融公司的技术连接和完成本所交易权限申请之后才进行证券出借交易。

三、成交

对于证券出借业务，撮合成交后返回的成交回报为客户普通证券账户的成交记录。

本所发送的闭市过户文件将体现订单的业务类型。

相关技术细节详见《上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口》和《上海证券交易所证金公司系统接口规格说明书》。

四、出借证券的归还、权益补偿和借券费用支付

出借证券的归还、权益补偿和借券费用支付，由本所指定的登记结算机构根据证券金融公司的指令进行相关证券划转和资金划转。

第四章 标的证券、期限与费率

一、标的证券与期限

证券出借交易标的证券（以下简称“标的证券”）的范围与

本所公布的可融券卖出标的证券范围一致。

证券被调整出标的证券范围的，在调整前未了结的证券出借合约仍然有效。

证券出借交易实行固定期限，分为 3 天、7 天、14 天、28 天和 182 天共 5 个档次。本所可以根据市场情况，调整证券出借交易的期限。

证券出借交易期限自成交之日起按自然日计算，归还日为到期日的下一日。归还日为非交易日的，顺延至下一个交易日。归还日标的证券停牌的，顺延至该证券的复牌日。

二、费率

每一交易日开市前，借入人应当通过本所行情系统和网站向市场公布其当日有借入意向的标的证券对应的各期限的证券借入费率（以下简称“费率”）。当日公布的费率当日不得变更。

出借人接受该费率的，可以申报出借。申报指令中的费率应当与借入人当日向市场公布的费率一致。

借券费用自证券出借交易成交之日起计算，归还日支付，归还日不计费用。

证券出借交易期限顺延未超过 30 个自然日的，借入人按原费率和顺延自然日天数向出借人支付借券费用；顺延超过 30 个自然日的，借入人自第 31 个自然日起不再向出借人支付借券费用。

借券费用的计算公式为：借券费用=出借日证券收盘价×出

借数量×出借日费率×实际出借天数/360

第五章 交易信息披露

一、每个交易日证券出借交易期间，本所通过行情系统发布出借人非约定申报的即时行情。

二、每一交易日开市前，借入人应当向市场公布其当日有借入意向的标的证券对应的各期限的费率。当日公布的费率当日不得变更。借入人可以通过本所行情系统和网站向市场公布费率。

路径：本所网站--业务推介--融资融券业务--交易信息--可出借转融通标的的证券信息；展示字段：证券代码、期限（天）、费率（%）。

三、每个交易日开市前，本所通过网站发布前一交易日每只标的证券各期限档次的成交数量信息。

路径：本所网站--业务推介--融资融券业务--交易信息--交易概况--转融通成交数量信息 / 本所网站--市场数据--成交概况--转融通；展示字段：证券代码、期限（天）、费率（%）、申报类型（转融通非指定对手方申报、转融通指定对手方申报）、成交总量。

第六章 会员内部控制

会员开展转融通证券出借交易代理业务（以下简称“出借交易代理业务”），应当按照《证券公司内部控制指引》和《上海证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》（以下简称《实

施办法》)的规定,建立健全内部控制机制。

一、会员业务管理制度

会员应当根据《内部控制指引》以及《实施办法》的要求,建立健全出借交易代理业务内部控制机制,防范出借交易代理业务各类风险。除《实施办法》要求建立的各项内部控制制度、操作流程和风险识别以及评估与控制体系以外,会员还应当针对包括但不限于下列有关事项建立相应的业务管理制度:

(一)会员应对参与转融通证券出借交易的客户进行适当性管理,制定相应的出借人准入条件;

(二)客户申请出借人资格的,会员应先向申请人进行投资者教育,包括讲解证券出借交易业务规则、合同条款及风险揭示等;

(三)会员应与出借人签署《转融通证券出借交易委托代理协议及风险揭示书》并根据本所相关要求报备出借人证券账户。

(四)会员应对出借人进行持续跟踪管理,包括出借人资格的暂停、终止及恢复。

(五)会员应与出借人约定,出借人拟向证券金融公司出借的证券,应当为其合法持有、有权处分且依法可流通的证券,未设定担保或者其他任何第三方权利,且未被国家有权机关采取财产保全等限制性措施。

(六)对于证券金融公司同意展期的转融通合约,会员应联系出借人协商展期事项;若出借人同意展期的,会员代理出借人

申报展期指令。

(七) 会员应为出借人提供证券出借交易的清算与交收服务。

二、会员对标的证券的管理

会员应当与出借人在相关合同中具体约定标的证券长期停牌、终止上市或以终止上市为目的被收购的处置办法。

三、会员对证券出借交易的管理

(一) 会员应对出借人的申报指令进行如下前端检查：

1. 检查客户是否在合格出借人名单范围内。
2. 检查出借证券是否在标的证券范围内。
3. 检查出借人证券账户内是否拥有与申报数量相对应的证券。
4. 检查交收路径是否完整、准确。
5. 检查出借证券是否全天停牌或是否在临时停牌期间。

(二) 会员为出借人申报证券出借指令之前，应在自身交易系统对相关证券进行冻结，限制该证券的卖出或划转。检查未通过的，会员应拒绝为出借人进行申报。

(三) 出借人提交的证券出借申报指令，包括非约定申报和约定申报两种类型。

(四) 出借人出借证券的申报数量应当符合交易所的相关规则，会员转融通业务系统应对出借人出借证券申报做好前端控

制。本所调整申报相关标准的，公司应即时调整系统相关业务参数。

四、会员信息报送日常报告制度

会员应当建立证券出借交易代理业务的信息报送和日常报告制度。

会员应当指定专人根据本所要求进行证券出借交易相关信息数据报送，负责有关数据、信息的统计与复核，保证向本所报送的数据、信息真实、准确、完整。

五、会员相关技术系统的运行管理

会员应当定期检查证券出借交易代理业务相关技术系统的安全性、稳定性，制定应急预案，并根据本所的要求，进行定期或者临时应急演练。会员对相关技术系统的检查内容包括但不限于以下方面：

- （一）是否存在缺陷和漏洞；
- （二）通过反例测试等方式，确认相关系统是否符合证监会、交易所和登记公司相关监管要求；
- （三）对技术系统的开发和升级是否有规范的管理流程；
- （四）技术系统升级后是否进行必要的测试，包括但不限于前端控制有效性测试、业务功能合规性测试等；
- （五）对相关系统日常参数维护，是否有规范的业务流程和复核机制。

第七章 其他事项

一、权益类信息披露及相关事务

证券出借与归还比照证券卖出和买入，遵守现有信息披露的相关规定。

出借人、借入人持有一家上市公司股票及其权益的数量或者其增减变动达到法定的比例时，应当依法履行相应的信息报告和披露义务。

借入人通过转融通担保证券账户持有的证券不计入其自有证券，无须因该账户内证券数量的变动而履行信息报告、披露或者要约收购义务。

出借人仅因收回出借股票使其持股比例超过 30% 的，无须履行要约收购义务。

附件：

转融通证券出借交易业务会员客户 证券账户信息

1) 上传路径与权限

- 会员公司使用具有融资融券 EKEY 权限进入 SSE 网站会员专区相关栏目进行数据上传；
- 路径：SSE 网站——会员公司专区——业务办理——转融通证券出借交易业务办理——会员客户证券账户报备

2) 数据格式

所有数据均为电子格式，采用 GBK 编码。上传的文件建议不超过 5MB。

3) 数据传输时间

- 报备时间段：交易日 9:00~16:00。

4) 命名规则

zrtzqzh*****YYYYMMDD.txt (文件名大小写敏感)

zrtzqzh*****YYYYMMDD.flg (文件名大小写敏感)

其中：

- zrtzqzh 为转融通客户证券账户的简称
- *****为 5 位会员代码(同会员公司专区用户名中的 5 位数字)
- YYYYMMDD 表示申报日期
- 文件中不允许出现相同帐号，否则视为非法数据
- 每次上传视为当日全量数据，以最后一次申报为准
- 文件名样例: zrtzqzh0001520120829.txt

5) 文件内容与格式

数据文件名： zrtzqzh*****YYYYMMDD.txt

采用标准文本文件格式：

编号	字段名	描述	字段类型
1	股东卡号	10 位字母或数字	C 10
2	所属营业部唯一码	营业部唯一码如为 01234, 则该字段请填写 1234	C 5
3	股东账户名称		C 80
4	报备、注销		C 11
5	联系人姓名	个人客户为股东账户名称, 机构客户为经办人姓名	C 80
6	手机		C 50
7	Email 地址		C 80
8	备用		C 80

说明：数据文件以 GBK 格式编码，每行以十六进制“0xA”字符结束，字段间以”|”为分隔符，最后一个字段不跟分隔符。所有字段均为必填字段，如发生数据内容低于字段长度时，均需以右补空格形式填充。以上所有字段内容开始和中间均不可包含空格，例如：“上交所”、“上交 所”均视为非法数据。

6) 标志文件接口

标志文件名：zrtzqzh*****YYYYMMDD.flg

采用标准标志文件格式：

编号	字段名	描述	字段类型	必选项
1	File Name	被标志的文件名	C 60	是
2	File Size	文件大小，以字节为单位	C 16	是
3	Creation Date	该文件的生成日期，YYYYMMDD 格式	C 8	是
4	Creation Time	文件生成时间，HHMMSS 格式	C 6	
5	Record Number	文件记录数，对二进制文件无效	C 12	
6	Check Sum	MD5 校验码，大写	C 64	是
7	Reserved Field	预留字段，填空格	C 64	

本文文件为单行文件，字段间以”|”为分隔符，末尾除外。数据不足或为空时，该字段右补空格。