

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
上海证券交易所大宗交易系统专场业务结算指南
(试行)

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

根据《上海证券交易所大宗交易系统解除限售存量股份转让业务操作指引》、《上海证券交易所大宗交易系统专场业务办理指南（试行）》及本公司相关业务规则，制定本指南。参与上海证券交易所（简称“上交所”）大宗交易系统专场业务（简称“大宗专场业务”）的相关各方，依据本指南办理大宗专场业务结算。

第一章 结算业务概述

大宗专场业务结算是指根据上交所发送的通过其大宗交易系统确定成交的大宗专场业务成交数据，按照货银对付原则，以逐笔全额非担保方式，组织进行的证券与资金结算。

1.1 交收方式、交收期和交收顺序

本公司对大宗专场业务实行逐笔全额非担保交收。本公司组织交易双方的结算参与者（或合格投资者）根据相关规则及本指南办理交收。交收资金（证券）是否足额的认定以单笔交易为单位，资金（证券）足额，则该笔交易交收；不足则该笔交易不交收，无部分交收。

大宗专场业务的交收期可为 $T+1$ 至 $T+N$ ($N \leq 5$)。交收日日终，在权证行权交收处理完毕后，办理大宗专场业务的交收。

1.2 结算路径

上交所会员参与的大宗专场业务通过现有路径结算。

合格投资者可以指定本公司的结算参与人代理结算，也可以以自己名义结算。

第二章 结算账户的开立、变更和注销

2.1 结算账户的开立

结算参与人参照本公司“结算账户管理及资金结算业务指南”(<http://www.chinaclear.cn>下“业务规则-上海市场-清算与交收”)申请开立非担保资金交收账户和证券交收账户。已经开立的，无需另行开立。

以自己名义结算的合格投资者，应在参与大宗专场业务前，向本公司申请安装 PROP 并签署《PROP 联网及使用合同书》，并申请开立资金交收账户，其证券交收账户为参与大宗专场业务的证券账户。合格投资者申请开立资金交收账户，需向本公司出具上交所认可合格投资者资格的文件，并提交下述材料：

- (1) 合格投资者资金交收账户开立申请（见附件）；
- (2) 营业执照等身份证明文件；
- (3) 《PROP 联网及使用合同书》；
- (4) 本公司认为必要的其他材料。

2.2 结算账户的变更和注销

结算账户的变更和注销参照本公司“结算账户管理及资金结算业务指南”办理。

第三章 清算

1、大宗专场业务发生的当日（T日）交易结束后，本公司结算系统接收上交所大宗专场业务当日成交数据后办理清算。

2、对每笔大宗专场业务成交，本公司逐笔计算买卖双方结算参与人（或合格投资者）应收应付金额。

应收付资金=清算金额-印花税-过户费-证券结算风险基金-经手费-证管费+/-佣金

其中，清算金额=成交价格×成交数量，卖方为正数（+），买方为负数（-）；发起方“佣金”为“+”，响应方“佣金”为“-”；响应方应付中介机构的佣金数据，由上交所提供本公司。

3、本公司在T日日终，将清算结果作为交收通知发送相关结算参与人（或合格投资者），当结算参与人（或合格投资者）与投资者证券托管人（指托管其证券的证券公司或托管银行）不一致时，清算结果同时发送证券托管人。

第四章 交收

1、根据 T 日清算结果，本公司于交收日日终对大宗专场业务采用逐笔全额非担保交收方式组织买卖双方结算参与人（或合格投资者）进行交收。应付资金一方资金足额且应付证券一方证券足额的，交收成功；否则交收失败。

2、结算参与人（或合格投资者）可向本公司申报不交收。

证券托管人可向本公司申报不同意交付相应证券，申报不同意交付的，该笔交易交收失败。未申报不同意交付的，视为同意交付。

不交收、不同意交付指令的申报时间为交收日 9:00-15:00。指令与清算数据不匹配的，视为无效指令。

3、应付资金的，结算参与人（或合格投资者）须于交收日 16:00 前将应付资金足额划至其相应的资金交收账户。

资金划拨具体可参照本公司“结算账户管理及资金结算业务指南”办理。

4、交收处理完毕后，本公司在交收日日终，将交收结果发送结算参与人（或合格投资者）、证券托管人。

5、如发生交收违约，本公司将按有关规定对违约方进行处理。

第五章 其他

1、本指南从发布之日起试行。

2、本指南由本公司根据市场发展适时修订。

附件

上海证券交易所大宗交易系统专场业务
合格投资者资金交收账户开立申请

中国证券登记结算有限责任公司上海分公司：

本申请人已成为上海证券交易所大宗交易系统专场业务的合格投资者，现向贵公司申请开立资金交收账户并承诺：

- 1、 本申请人承担全部结算责任；
- 2、 本申请人严格遵守贵公司制定的《中国证券登记结算有限责任公司上海分公司上海证券交易所大宗交易系统专场业务结算指南（试行）》及贵公司的相关业务规定；
- 3、 本申请人通过贵公司结算的资金系本申请人享有合法所有权且没有任何瑕疵的资金。

特此申请。

附：开户信息登记表

申请人盖章

年 月 日

开户信息登记表

申请人名称			
联系人		联系电话	
手机		传真电话	
通讯地址 (邮政编码)			电子邮件
证券账户号			

申请人盖章

年 月 日