**附件：**

**上海证券交易所沪港通业务指南第1号——港股通业务交易权限开通**

为指导上海证券交易所（以下简称“本所”）会员和基金管理公司、保险机构等租用本所参与者交易业务单元（以下简称交易单元）的机构开展沪港通下的港股通（以下简称港股通）业务，根据《上海证券交易所沪港通业务实施办法》等相关规定，制定本指南。

1. **概述**

本指南所称的港股通，是指投资者委托本所会员，通过本所证券交易服务公司，向香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）进行申报，买卖港股通标的证券。

会员和基金管理公司、保险机构等租用本所交易单元的机构（以下简称申请机构）开展港股通业务，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）相关部门规章和本所相关业务规则及规定，切实执行港股通业务内部管理制度，接受中国证监会和本所的监督管理。

会员申请开展港股通业务，应向本所提出申请。基金管理公司、保险机构等申请通过租用的本所交易单元开展港股通业务，应以自身名义向本所提出申请。

申请机构开展港股通业务，适用本指南。

港股通业务的登记结算，适用中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）的相关规定。

1. **港股通业务开通申请**

一、申请条件

（一）申请机构申请开通港股通业务前，除应满足本所及中国结算的相关要求外，还应符合以下条件：

1.制定港股通业务方案和实施计划；

2.参与港股通技术测试，确保技术准备就绪（技术支持电话：4009003600。）；

3.在中国结算上海分公司完成港股通业务资金结算账户开立；

4.结合公司实际完成港股通业务准备情况自我评估（评估要点详见附件）；

5.采取托管人模式结算的申请机构，还应当会同托管人制订港股通交易相关结算方案、业务制度和操作流程，并督促托管人前往中国结算上海分公司完成港股通业务资金结算账户开立。

（二）申请机构申请开通港股通业务前，应当与本所证券交易服务公司（中国投资信息有限公司）签订《上海证券交易所港股通服务协议》。申请机构可与本所会员管理部联系，领取与本所证券交易服务公司签署的《上海证券交易所港股通服务协议》文本，并于签署完毕后将1份原件寄往本所会员管理部转交本所证券交易服务公司存档。

二、申请材料

申请机构申请开通港股通业务，应当通过本所业务管理系统平台-会员管理业务模块向本所会员管理部提交以下材料：

（一）业务申请书；

（二）与本所证券交易服务公司签署的《上海证券交易所港股通服务协议》；

（三）港股通业务实施方案；

（四）港股通业务投资者适当性管理制度（仅会员适用）；

（五）由本所技术部门提供的技术测试通过反馈文件；

（六）港股通业务准备情况自我评估表（加盖公章）

业务申请书应当为申请机构的正式发文，并加盖公司公章。租用本所交易单元的申请机构应当在申请书中承诺，就将相关交易单元用于港股通交易已获得交易单元持有人的同意。申请机构的法定代表人或其授权代表应当在申请书上签章，并做出如下承诺：申请材料的内容真实、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。上述申请材料的文件上传路径为“本所业务管理系统平台-会员管理业务模块-\*\*交易单元操作岗-业务办理-港股通业务办理-港股通业务权限申请 ”。其中，业务申请书必须为PDF格式的彩色扫描件；其他申请材料可以是黑白扫描件，单个文件大小限制在20M内。

三、办理流程

本所将在中国结算上海分公司为申请机构或其指定托管人开通相应港股通结算业务后，为符合规定的申请机构开通其交易单元的港股通交易权限，并向申请机构发出确认开通其交易单元的港股通交易权限的书面通知。

申请机构在中国结算上海分公司的结算业务涉及多个托管人的，应当确保其用于港股通交易的交易单元对应的托管人已开通港股通结算业务，否则不得通过该交易单元进行港股通交易。申请机构违反上述要求的，应当承担由此产生的一切责任。

本所可根据需要，对申请机构港股通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现场检查。

四、注意事项

参与港股通业务的会员可以复用或新设A股市场的交易单元。

参与港股通交易，选择托管人结算模式的，应当确保托管人已在中国结算上海分公司完成港股通业务资金结算账户开立，方可接受相应产品的港股通交易委托。

本指南自发布之日起施行。

附件：港股通业务准备情况评估要点

港股通业务准备情况评估要点

**第一部分港股通业务就绪情况**

一、基本要求

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **检查项目** | **编号** | **检查内容** |
|
| **组织架构** | **1** | 建立完善的港股通业务授权体系 |
| **2** | 应当确定港股通业务的牵头部门，明确各相关部门的职责与分工 |
| **3** | 明确港股通业务各相关岗位的岗位名称、所属部门、岗位职责 |
| **制度与****规则** | **4** | 港股通经纪业务管理办法 |
| **5** | 港股通合规与风险管理相关制度 |
| **6** | 港股通业务客户适当性管理相关制度 |
| **7** | 港股通客户管理相关制度（包括但不限于客户投诉、客户回访 、投资者教育等方面） |
| **8** | 港股通客户协议风险揭示书 |
|  | **9** | 港股通业务登记结算管理办法 |
| **流程** | **10** | 客户业务受理流程（投资者教育、客户身份审核、客户资质审核、风险揭示、业务权限开通、港股通交易、客户资料档案管理）、交易业务规程） |
| **11** | 资金业务规程（明确以港市报价、以人民币交收） |
| **12** | 交易业务规程（明确交易费用收取标准和费用调整审批流程） |
| **13** | 业务差错处理流程 |
| **14** | 港股通客户回访流程 |
| **15** | 港股通客户投诉流程 |

二、功能要求

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **检查项目** | **编号** | **检查内容** |
|
| **账户及适当性管理业务** | **16** | 投资者准入管理 |
| **17** | 新客户开立账户过程中包含实名制校验、投资者教育、风险揭示等环节 |
| **交易终端** | **18** | 支持港股至少一档行情显示周边系统可让客户查询到港股通行情 |
| **19** | 支持客户对交易费用的查询 |
| **20** | 支持客户通过依次选择品种、交易类型、股数等进行交易委托 |
| **21** | 支持买卖指令，包括买入、卖出、撤单 |
| **22** | 不允许卖空 |
| **23** | 支持对客户增加或取消港股通交易权限 |
| **24** | 日间参考汇率的揭示 |
| **25** | 市场额度的揭示 |
| **港股通交易业务** | **26** | 支持“竞价限价盘” |
| **27** | 支持“增强限价盘” |
| **28** | 支持回转交易 |
| **29** | 资金前端控制 |
| **30** | 不允许客户进行港股卖空操作 |
| **31** | 支持港股通交易日12:30-13:00撤单 |
| **32** | 支持港股通标的证券最小报价单位限制 |
| **33** | 支持港股通标的证券交易单位的控制 |
| **34** | 不允许客户买入零股、支持零股卖出 |
| **35** | 未完成交收、当日有委托或有成交时，禁止撤销指定 |
| **36** | 支持通过自动导入和维护调整，开盘前完成处理上交所转发的当日参考汇率数据 |
| **37** | 佣金税费设置应包括印花税、交易征费、交易费、交易系统使用费、证券组合费、佣金等费用的设置，支持按分笔计算、支持最低、最高费用设置 |
| **38** | 支持客户查询、打印交割单、对账单 |
| **39** | 支持港股通交易日历、交收日历维护 |
| **40** | 对港股通证券不设置涨跌幅限制 |

**第二部分 港股通业务登记结算就绪情况**

一、基本要求

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **检查****项目** | **编号** | **检查内容** |
|
| **制度****与****规则** | **1** | 港股通业务账户管理相关规定 |
| **2** | 港股通业务交易结算相关规定 |
| **3** | 港股通业务资金划付相关规定 |
| **4** | 港股通业务公司行为处理相关规定 |
| **5** | 港股通业务结算风险管理相关规定 |
| **6** | 港股通业务投资者资金交收违约处置流程相关规定 |
| **7** | 异常情况处理流程相关规定 |

二、功能要求

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **检查项目** | **编号** | **检查内容** |
|
| **账户管理业务** | **8** | 支持投资者开通/关闭港股通交易权限 |
| **结算日常业务** | **9** | 支持港股通业务清算：包括日常交易、风控资金、公司行为、证券组合费、非交易过户费用、其他特殊情形等 |
| **10** | 支持清算结果（资金和股份）数据核对 |
| **11** | 支持不同交收批次资金划付功能（包括风控资金划付安排） |
| **12** | 支持公司行为处理（包括客户意愿的征集和发送） |
| **结算风险控制** | **13** | 支持延迟交收处理 |
| **14** | 支持汇率风险管理 |
| **15** | 支持客户资金透支的管理 |
| **16** | 支持港股通卖出证券资金的可用控制 |
| **17** | 汇率波动导致客户交收资金违约处理 |
| **18** | 港股延迟交收导致客户交收资金违约处理 |
| **19** | 证券组合费收取导致客户交收资金违约处理 |
| **结算技术系统** | **20** | 支持柜台系统或网上交易系统与中国结算CCNET系统实时对接，能够实现公司行为业务的实时申报及实时查询功能。 |
| **21** | 系统能够根据文件发送结束标志接收中国结算信箱相关文件；系统能够对日终文件自动、准确的进行清算交收处理。 |
| **22** | 清算系统存在冗余灾备系统，能够在发生宕机、掉电或其他不可抗力时及时恢复 |
| **23** | 系统对中国结算的日终文件留有备份；并应支持在系统出错或意外中断等情况下根据备份日终文件重新进行清算。 |

**第三部分 港股通信息系统技术就绪情况**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **检查****项目** | **序号** | **检查内容** |
|
| **建设****与****部署** | **1** | 是否完成系统建设方案的制定，建设方案应包括建设目标、原则；整体架构、功能、各系统间的逻辑关系；各相关系统（包含网上交易终端、清算系统、港股通交易系统、风控系统等）的技术架构、业务逻辑、数据流转；系统建设计划 |
| **2** | 各交付物所涉系统是否已覆盖港股通业务平台前、中、后台各业务系统（如网上交易终端、清算系统、港股通交易系统、风控系统等） |
| **3** | 是否有各系统部署图及网络拓扑图，包括硬件配置清单、软件配置清单、网络配置清单 |
| **4** | 是否有测试文档，至少有测试用例和测试报告 |
| **5** | 是否制定培训计划，系统上线前是否对系统管理人员、系统运维操作人员进行必要的培训，培训内容涵盖港股通业务知识、系统架构与功能、运维安全保障、应急备份措施等，并对培训内容、培训人员情况进行记录 |
| **6** | 是否交付系统安装配置说明、用户使用手册、运维操作手册、备份方案、故障处理与应急手册等 |
| **运维管理** | **7** | 为港股通业务已配备足够运维人员（包括灾难备份中心），关键事务岗位已配备多人共同管理，运维岗位应建立重要岗位的双人、双职、双责制，并加强对单人单岗的监控 |
| **8** | 定期对各个岗位的人员进行安全技能及安全认知的考核，考核应至少每年一次 |
| **9** | 有规范的系统上线、软件升级和变更、系统设置变更流程，并留存相应的升级或变更记录 |
| **10** | 有规范化的日常操作流程，关键操作应建立复核机制，建立详细的操作日志（包括重要的日常操作、运行维护记录、参数的设置和修改等内容），并及时备份参数文件 |
| **11** | 有规范化的故障处理流程，建立详细的故障日志（包括故障发生的时间、范围、现象、处理结果和处理人员等内容） |
| **12** | 已制定应急预案，并定期组织运维人员应急演练，留存演练记录 |
| **13** | 建立完善的运行监控系统，对港股通系统的运行环境、运行状况进行实时监控，并提供多种报警功能 |
| **14** | 已建立备份与恢复管理相关的管理制度，对备份信息的备份方式、备份频度、存储介质和保存期等进行规范 |
| **15** | 灾难备份系统需满足证监会发布核心关键系统的业务连续性要求，灾备系统具有满足业务需求的处理能力，有详细的切换演练记录 |

**第四部分 港股通投资者教育就绪情况**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **检查项目** | **编号** | **检查内容** |
|
| **投资者适当性管理制度、流程** | **1** | 建立港股通业务投资者适当性管理的操作指引和相关工作制度 |
| **2** | 建立港股通投资者适当性评估的实施办法和流程 |
| **3** | 建立评估投资者对港股投资规则熟悉程度的操作流程和方案 |
| **4** | 建立对投资者后续评估等持续管理制度 |
| **建立完整的港股通投资者教育工作机制** | **5** | 有一套港股通投资者教育工作的总体部署和工作计划 |
| **6** | 总部有港股通业务投资者教育联系人统筹投资者教育工作 |
| **7** | 有计划地制作、分发宣传折页、一本通等资料，通过有效手段宣传本所港股通投教专区及微信公众平台 |
| **8** | 在公司（包括总部、分支机构、营业部）持续开展面向讲师或投顾人员的港股通专题培训2场以上 |
| **加强对营业部一线员工的港股通知识培育** | **9** | 加强营业部的港股通业务人才队伍建设，明确营业部员工学习要求 |
| **10** | 拟开展港股通经纪业务的营业部应当至少有2名能够为投资者熟练解答港股通投资常见问题的工作人员 |
| **集中培育潜在合格投资者** | **11** | 持续开展面向港股通业务潜在合格投资者的培训和投资者教育 |