

附件

# 深圳证券交易所 中国证券金融股份有限 公司 中国证券登记结算有限责任公司 创业板转融通证券出借和转融券 业务特别规定

## 第一章 总则

**第一条** 为促进创业板转融通证券出借和转融券业务的顺利开展，防范业务风险，根据《转融通业务监督管理试行办法》《创业板首次公开发行股票注册管理办法（试行）》《深圳证券交易所转融通证券出借交易实施办法（试行）》（以下简称《证券出借实施办法》）、《中国证券金融股份有限公司转融通业务规则（试行）》（以下简称《转融通业务规则》）、《中国证券登记结算有限责任公司证券出借及转融通登记结算业务规则（试行）》（以下简称《证券出借及转融通登记结算业务规则》）等有关规定，制定本规定。

**第二条** 创业板上市交易的股票和存托凭证（以下统称股票），其证券出借、转融券以及相关登记结算业务适用本规定。本规定未作规定的，适用《证券出借实施办法》《转融通业务规则》《证券出借及转融通登记结算业务规则》等其他有关规定。

**第三条** 证券出借人（以下简称出借人）和转融券借入人

(以下简称借入人)可以按本规定通过约定申报和非约定申报方式参与证券出借以及转融券业务。

通过约定申报方式参与的,由出借人、借入人按本规定及其他有关业务规则协商确定数量、期限、费率等要素。

**第四条** 中国证券金融股份有限公司(以下简称中国证券金融公司)分别与出借人、借入人进行证券出借、转融券业务,并提供信息交互平台,出借人、借入人可以通过信息交互平台发布出借意愿、借入意愿等信息。

## 第二章 证券出借

**第五条** 符合条件的公募基金、社保基金、保险资金等机构投资者,以及参与创业板发行人首次公开发行的战略投资者(以下简称战略投资者),可以作为出借人参与证券出借。

**第六条** 证券出借的标的证券范围,与可融券卖出的标的证券范围一致。

**第七条** 可通过约定申报和非约定申报方式参与证券出借的证券类型包括:

- (一) 无限售流通股;
- (二) 战略投资者配售获得的在承诺的持有期限内的股票;
- (三) 符合规定的其他证券。

**第八条** 出借人的股票已被质押或被有权机关冻结的,不得用于出借。出借人、提供证券出借交易代理服务的证券公司,在申报证券出借指令前应当进行前端检查和控制。

**第九条** 战略投资者与证券公司存在关联关系的，在承诺持有期限内，可以通过约定申报方式出借获配股票，仅供该证券公司开展融资融券业务，不得与证券公司等关联方或其他主体合谋，锁定配售股票收益、实施利益输送或谋取其他不当利益。

战略投资者及其关联方，在战略投资者承诺持有期限内，不得融券卖出该上市公司股票。

战略投资者违反本条规定的，深圳证券交易所（以下简称深交所）可以视情节轻重，对其单独或合并采取口头或书面警示、约见谈话等自律监管措施和通报批评、公开谴责等纪律处分，并通报中国证券业协会。

**第十条** 对于发行人首次公开发行股票向战略投资者配售的，深交所于每个交易日公布该股票可出借和已出借且尚未归还的战略配售股票数量，以及限售流通股和无限售流通股数量。

**第十一条** 通过约定申报方式参与证券出借的，证券出借期限可在 1 天至 182 天的区间内协商确定。

**第十二条** 深交所接受约定申报方式下出借人的出借申报时间为每个交易日的 9:15 至 11:30、13:00 至 15:00。

约定申报当日有效。未成交的申报，15:00 前可以撤销。

**第十三条** 标的证券在当日开市后停牌的，停牌期间深交所不接受其出借或借入申报，已申报但未成交的可以撤销。

**第十四条** 约定申报方式的申报数量应当符合以下规定：

（一）单笔申报数量应当为 100 股（份）的整数倍；

(二) 最低单笔申报数量不得低于 1000 股 (份), 最大单笔申报数量不得超过 1000 万股 (份)。

非约定申报方式的申报数量应当符合以下规定:

(一) 单笔申报数量应当为 100 股 (份) 的整数倍;

(二) 出借人最低单笔申报数量不得低于 1000 股 (份), 最大单笔申报数量不得超过 1000 万股 (份);

(三) 中国证券金融公司最低单笔申报数量不得低于 1000 股 (份), 最大单笔申报数量不得超过 1 亿股 (份)。

深交所可以根据市场情况, 对证券出借申报数量进行调整。

**第十五条** 深交所对证券出借约定申报进行实时撮合成交, 生成成交数据, 并对中国证券金融公司和出借人的账户可交易余额进行实时调整。

**第十六条** 当日交易结束后, 中国证券登记结算有限责任公司 (以下简称中国结算) 根据深交所的成交数据, 对通过约定申报方式达成的证券出借以多边净额结算方式进行清算交收。

**第十七条** 深交所可以根据市场状况, 暂停单只或全部创业板股票参与证券出借。

出借人在开展证券出借过程中发生重大风险事件的, 深交所可暂停或终止为其提供证券出借服务。

### **第三章 转融券业务**

**第十八条** 符合以下条件的证券公司, 可以作为借入人

通过约定申报和非约定申报方式参与转融券业务：

- （一）具有融资融券业务资格并已开通转融通业务权限；
- （二）业务管理制度和风险控制制度健全，具有切实可行的业务实施方案；
- （三）技术系统准备就绪；
- （四）中国证券金融公司规定的其他条件。

**第十九条** 转融券业务的标的证券名单，由中国证券金融公司根据市场状况确定，并在每一交易日开市前公布。

**第二十条** 战略投资者在承诺的持有期限内，可以按本规定向中国证券金融公司借出配售获得的股票，该部分股票出借后，按照无限售流通股管理。中国证券金融公司可以根据市场需求，将借入的战略投资者配售股票出借给证券公司，供其办理融券业务。

借出期限届满后，中国证券金融公司应当将借入的股票返还给战略投资者。该部分股票归还后，继续按战略投资者配售获得的在承诺持有期限内的股份管理。

**第二十一条** 借入人以约定申报方式和非约定申报方式提交的转融券申报指令应当符合以下规定：

- （一）单笔申报数量应当为 100 股（份）的整数倍；
- （二）最低单笔申报数量不得低于 1000 股（份），最大单笔申报数量不得超过 1000 万股（份）。

**第二十二条** 中国证券金融公司接受借入人转融券约定申报指令的时间为每个交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:00。

转融券约定申报指令未成交的，借入人可在 15:00 前撤

销。

**第二十三条** 通过约定申报方式参与转融券业务的，转融券期限可在 1 天至 182 天的区间内协商确定。

**第二十四条** 通过约定申报方式参与转融券业务的，转融券费率应符合以下规定：

（一）借入人申报的费率=出借人申报的费率+转融券费率差；

（二）借入人申报的费率不得低于或等于转融券费率差。

转融券费率差按中国证券金融公司公布的标准执行。中国证券金融公司可以根据市场供求等因素调整转融券费率差。

**第二十五条** 中国证券金融公司可以根据借入人资信情况和转融通担保证券、资金明细账户的资产情况，按照一定的综合比例，确定对借入人开展转融券业务应收取的保证金。

前款应收取的保证金比例可低于 20%，其中货币资金占应收取保证金的比例不得低于 15%。

**第二十六条** 证券公司向中国证券金融公司借入证券用于融资融券业务的，应当使用证券公司融券专用证券账户。

**第二十七条** 中国证券金融公司按照一一对应原则，对转融券约定申报实时撮合成交，生成转融券约定申报成交数据，并实时发送深交所。

深交所接受转融券约定申报成交数据的时间为每个交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。转融券约定申报成交数据当日有效。

**第二十八条** 标的证券全天停牌的，深交所不接受有关的转融券约定申报成交数据。

标的证券在当日开市后停牌的，停牌期间深交所正常接受转融券约定申报成交数据。

**第二十九条** 对转融券非约定申报，仍按照现有规定执行，采用盘中申报、盘后一次性按比例撮合成交，中国结算日终根据中国证券金融公司直接发送的成交数据进行证券划转。

**第三十条** 深交所接受中国证券金融公司发送的转融券约定申报成交数据后，对中国证券金融公司和借入人的账户可交易余额进行实时调整确认，并向中国证券金融公司发送调整结果。

转融券约定申报成交数据要素包括：中国证券金融公司证券账户、中国证券金融公司托管单元代码、借入人证券账户、借入人托管单元代码、证券代码、划转数量等。

中国证券金融公司接受前款调整结果后，实时向借入人发送转融券约定申报成交结果和账户可交易余额调整结果。

**第三十一条** 深交所根据本规定第三十条对中国证券金融公司和借入人的账户可交易余额完成调整的，深交所将中国证券金融公司该部分转融券约定申报成交数据发送中国结算，当日交易结束后，中国结算据此对转融券约定申报的成交以多边净额结算方式进行清算交收。

**第三十二条** 因特殊原因，导致中国证券金融公司和借入人账户可交易余额未做实时调整的，当日交易结束后，中

国证券金融公司就该部分转融券约定申报成交数据，向中国结算发送证券划转指令。

中国结算在日终对符合要求的证券划转指令进行划转处理，且只对已完成证券交收或净应付证券交收锁定之后的证券进行划出处理。如果委托划出的证券数量大于该证券账户中可划出的该种证券的数量，则对该笔证券划转指令不做划转处理。

**第三十三条** 借入人和出借人协商一致，可申请转融券约定申报的展期、提前了结，经中国证券金融公司同意后可以展期或提前了结。

借入人和出借人应在原合约到期日前的同一交易日向中国证券金融公司提交展期指令；在商定的归还日前的同一交易日提交提前了结指令。

提交展期或提前了结指令的时间为每个交易日 9:30 至 11:30、13:00 至 15:00。展期或提前了结指令当日有效，在 15:00 前可撤销。

**第三十四条** 转融券展期的，展期数量、期限、费率由借入人和出借人按照本规定协商确定。

借入人和出借人协商提前了结的，应一次性全部提前了结该笔转融券业务。提前了结时，双方可以协商调整原费率。

**第三十五条** 转融券业务提前了结的，相关权益补偿一并提前了结。权益补偿日需重新计算，其中原转融券归还日为出借人和借入人商定的归还日。

转融券展期的，相关权益补偿不进行展期。



**第三十六条** 通过约定申报进行转融券业务，以及相关展期、提前了结等过程中，借入人和出借人应当合理确定费率、期限、实际出借天数等要素，不得违反中国证券金融公司相关规定，禁止任何形式的利益输送。

**第三十七条** 证券公司向中国证券金融公司归还所借证券的，证券公司通过中国结算从证券公司融券专用证券账户将归还证券划付至中国证券金融公司转融通专用证券账户。

**第三十八条** 中国证券金融公司可以根据市场状况，暂停单只或全部创业板证券参与转融券业务。

借入人在开展转融券业务过程中发生重大风险事件的，中国证券金融公司可暂停或终止为其提供转融券服务。

#### **第四章 附则**

**第三十九条** 经中国证监会批准，中国证券金融公司可将自有或依法筹集的证券出借给证券公司，供其用于做市与风险对冲，相关事项另行规定。

**第四十条** 本规定由深交所、中国证券金融公司、中国结算负责解释。

**第四十一条** 本规定的制定和修改，报中国证监会批准。