

上海证券交易所
证券交易业务指南
第 2 号——股票质押式回购交易业务
(2020 年 12 月修订)

目 录

- 第一章 股票质押回购概述
- 第二章 交易权限申请与开通
 - 一、交易权限申请
 - 二、交易权限开通
 - 三、业务规模申请与变更
 - 四、股票质押回购交易业务专用 EKEY 申请
 - 五、股票质押回购合格投资者账户报送
- 第三章 交易管理
 - 一、标的证券
 - 二、融入方
 - 三、最低初始交易金额
 - 四、质押率
 - 五、交易前端控制
 - 六、业务协议签署
 - 七、委托、申报与成交确认
 - 八、标的证券权益处理
- 第四章 违约处置
- 第五章 会员内部控制
 - 一、会员业务管理制度
 - 二、会员对标的证券的管理
 - 三、会员对融资投向的管理
 - 四、会员对股票质押回购的风险管理
 - 五、会员信息报送和日常报告制度
- 附件 1：技术接口文件
- 附件 2：会员报告格式

为方便本所会员进行股票质押式回购交易（以下简称“股票质押回购”），推动股票质押回购业务顺利开展，根据上海证券交易所（以下简称“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，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、规范性文件和本所、中国结算相关业务规则及规定，切实执行股票质押回购交易内部管理制度，认真履行与融入方、融出方之间的《股票质押回购交易业务协议》（以下简称“《业务协议》”），自觉接受中国证监会和本所、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，适用中国结算的相关规定。

第二章 交易权限申请与开通

一、交易权限申请

会员在本所从事股票质押回购业务，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。会员申请股票质押回购交易权限，需向本所会员部提交以下材料：

- （一）交易权限申请书；
- （二）证券经纪、证券自营业务资格证明文件；
- （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）《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）拟负责业务的高级管理人员与业务联络人的姓名及其联系方式；
- （七）本所要求的其他材料。

交易权限申请书应加盖申请会员公章，会员的法定代表人和经营管理的主要负责人应当在股票质押回购交易权限申请书上签字，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。

上述申请材料应以电子文件报送本所，其中，申请材料（一）、（二）应提供加盖公章文本的电子扫描版。

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证券监管机构意见。

二、交易权限开通

会员申请符合规定的，本所将向其发出确认其股票质押回购

交易权限的书面通知。

本所可根据需要，对会员股票质押回购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。

三、业务规模申请与变更

会员应当建立健全的股票质押回购风险控制机制，业务规模应当符合相关规定，并与自身业务风险控制能力和风险承受能力相适应。会员应在申请交易权限时，在交易权限申请书中列明股票质押回购业务规模。会员需要调整股票质押回购业务规模的，应当事先向本所会员部提交加盖会员公章的业务规模变更申请书。

四、股票质押回购交易业务专用 EKEY 申请

会员可使用已有 EKEY 或新申请 EKEY 办理股票质押回购业务。使用 EKEY 前，应向本所会员部提交《“会员公司专区”用户 EKEY 及权限申请表》，申请开通相应 EKEY 办理股票质押回购交易业务的权限。申请表通过“SSE 网站——会员/证券机构专区——会员业务及非会员机构业务网上办理”栏目下载。

新申请 EKEY 及权限添加需要 5 个工作日，为已有 EKEY 添加权限需要 1 个工作日。信息公司开通相关权限后，将以邮件或电话方式通知会员。

五、股票质押回购合格投资者账户报送

根据《业务办法》，融入方和融出方经会员报备上交所后，方可参加股票质押回购。具体报送路径为：SSE 网站——会员/证券机构专区——业务办理——股票质押式回购交易业务办

理——融入方合格投资者账户报备；SSE 网站——会员/证券机构专区——业务办理——股票质押式回购交易业务办理——融出方合格投资者账户报备。与会员的数据接口文档为《会员综合业务会员信息文件接口》（详见“SSE 网站——会员/证券机构专区——业务办理——股票质押式回购交易业务办理——融出/入方合格投资者账户报备——《会员综合业务会员信息文件接口》”）。网站接收账户数据报送的时间段为：9:00-16:00，会员报送数据文件后网站将对应产生反馈文件，且网站将在每个交易日 17:00 以后反馈会员所属全量有效账户数据，并提供查询下载。

会员在报送成功后，当日即可允许相应融入方、融出方参加股票质押回购。

第三章 交易管理

会员应按照股票质押回购业务规则和技术实施指引（见附件 1）要求，建立相关交易技术系统，与本所交易及相关系统接口部分的建设、运行、维护，必须严格遵照本所发布的最新接口规格说明书（见附件 1），并制定相应的安全运行管理制度。

会员应当定期检查股票质押回购及相关系统的安全性、稳定性，并根据本所提供的应急通道（参见“SSE 网站——交易技术支持专区——软件下载——上海证券交易所_应急通道工具_STEPBCP”），制定应急预案。技术咨询，请联系技术服务热线：4009003600。

一、标的证券

股票质押回购初始交易标的证券为本所 A 股股票、优先股、其他经本所和中国结算认可的证券。补充质押标的证券为本所 A 股股票、优先股、本所竞价交易系统上市的债券、本所竞价交易系统上市的基金、其他经本所和中国结算认可的证券。

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、股权激励限制性股票暂不纳入初始交易和补充质押标的证券范围。

二、融入方

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。符合一定政策支持创业投资基金及满足一定条件的通过委托定向资产管理作为融入方的除外。

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。

通过委托定向资产管理作为融入方的，定向资产管理客户应满足前述股票质押回购融入方的准入要求。

三、最低初始交易金额

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（人民币，下同）。无论首笔初始交易是否已了结，此后通过同一会员进行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等情形的除外，但会员应当在交易发生之日起五个交易日内通过“SSE 网站——会员/证券机构专区——会员监管——函件往来——工作函件”栏目，以“(证券公司简称)(证券代码)(证券简称)(融

入方名称) (年月日) 最低初始交易金额特殊适用情形报告”为公文标题提交书面报告 (格式见附件 2, 特殊适用情形报告)。

四、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。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的计算方法。

以有限售条件股份作为标的证券的, 质押率的确定应根据该上市公司的各项风险因素全面认定并原则上低于同等条件下无限售条件股份的质押率。

五、交易前端控制

会员应当建立由总部集中管理的股票质押回购业务管理和技术系统, 对股票质押回购的主要流程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) 融入方、融出方参与股票质押回购的证券账户应为会员已报备提交本所的账户。

(二) 交易的标的证券符合会员按照《业务办法》、本指南及其他相关规则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。

(三) 会员业务规模应当符合相关规定, 并与自身业务风险控制能力和风险承受能力相适应。本所以对业务规模按以下规则进行前端控制:

最新一笔初始交易申报金额 \leq 该会员后台配置的股票质押

回购会员额度- $[\Sigma(\text{会员回购未到期明细数据中的所有未到期初始交易金额})+\Sigma(\text{T日已有效申报的初始交易成交金额})]$ 。

(四) 会员应当查验初始交易金额符合《业务办法》及本指南规定。

(五) 会员应当查验进行初始交易的融入方标的证券余额、可用额度、会员总体业务额度使用情况等风控指标；查验质押率、融出方接受单只 A 股股票质押的数量占该股票 A 股股本比例、市场整体质押比例等指标符合《业务办法》及本指南规定。

同一笔初始交易申报提交质押登记证券的证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。

初始交易金额必须大于 0。

(六) 会员应当查验补充质押申报的融入方标的证券可用余额、标的证券集中度等风控指标。

补充质押申报的初始交易成交编号、初始交易日、证券账户等要素应与相应初始交易一致。

同一笔补充质押申报的标的证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。

(七) 会员应当查验部分解除质押申报相应的初始交易或补充质押可解除质押证券或其孳息余额。

部分解除质押申报的初始交易成交编号或补充质押成交编号、初始交易日或补充质押日、证券账户等要素应与相应初始交易或补充质押一致。

同一笔部分解除质押申报的标的证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。

若部分解除质押后，相应初始交易或补充质押已经没有任何对应的证券或孳息仍然处于质押状态的，则中国结算上海分公司将确认该笔部分解除质押申报失败。

（八）购回交易申报的初始交易成交编号或补充质押成交编号、初始交易日或补充质押日、证券账户等要素应与相应初始交易或补充质押一致。

购回交易金额必须大于等于 0。

（九）同一笔违约处置申报的标的证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。

（十）会员应确保融入方、融出方在股票质押回购业务未全部了结前，不能改变其证券账户的指定交易关系，且不改变融入方、融出方的股票质押回购账户权限。

六、业务协议签署

融出方为证券公司、证券公司管理的集合资产管理计划或定向资产管理客户的，证券公司应当与融入方签署《业务协议》。

融出方为证券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的，证券公司应当与融入方、资产管理子公司签署三方《业务协议》。

《业务协议》应当载明必备条款所要求的内容。

融出方是证券公司的，《业务协议》应当约定质权人登记为证券公司；融出方是集合资产管理计划的，《业务协议》应当约定质权人登记为管理人；融出方是定向资产管理客户的，《业务协议》应当约定质权人登记为定向资产管理客户或管理人。

七、委托、申报与成交确认

融入方、融出方应当在签订《业务协议》时或根据《业务协议》的约定在申报交易委托前，协商确定标的证券及数量、初始交易日及交易金额、购回交易日及交易金额等要素。会员根据《业务协议书》委托提交双方的交易申报，由本所交易系统进行确认成交，并发送成交回报。

股票质押回购的申报类型包括初始交易申报、补充质押申报、部分解除质押申报、购回交易申报、终止购回申报、违约处置申报。本所综合业务平台在交易时间支持对上述申报的撤单处理。会员系统必须严格按照本所发布的接口规格说明书进行填写。

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。同一笔初始交易提交质押登记的标的证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。

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。同一笔补充质押的标的证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。

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。初始交易日或补充质押日、初始交易成交编号或补充质押成交编号、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份不一致的标的证券或其孳息应分笔申报部分解除质押。

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。购回交易时，应对初始交易、补充质押分笔申报购回交易。

违约处置申报是指发生约定情形需处置质押标的证券的，会员应当按照《业务协议》的约定向上交所提交违约处置申报，该笔交易进入违约处置程序。同一笔违约处置申报相应的初始交易日或补充质押日、初始交易成交编号或补充质押成交编号、证券代码、证券类别、流通类型、权益类别、挂牌年份应一致。对于同一笔初始交易或补充质押，会员可就部分标的证券或其孳息提交违约处置申报，或分为多笔提交违约处置申报。

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。融入方、融出方按《业务协议》约定进行违约处置或场外了结债权债务后，应当通过提交终止购回申报，若相应交易对应质押标的证券及孳息仍有剩余，解除质押。初始交易日或补充质押日、初始交易成交编号或补充质押成交编号不一致的标的证券及其孳息应分笔申报终止购回。

标的证券停牌的，不影响股票质押回购交易。

会员系统应向融入方、融出方提供交易查询、待购回交易明细等查询服务。

八、标的证券权益处理

待购回期间，标的证券产生的无需支付对价的股东权益，如送股、转增股份、现金红利等，一并予以质押。但是发行人不通过中国结算上海分公司派发的股东权益，以及采用场外现金分红或收益结转份额分红方式的，相应的股东权益不随标的证券一并质押。

待购回期间，标的证券产生的需支付对价的股东权益，如老

股东配售方式的增发、配股等，由融入方自行行使，所取得的证券不随标的证券一并质押。

待购回期间，融入方基于股东身份享有出席股东大会、提案、表决等权利。

第四章 违约处置

融入方违约，根据《业务协议》的约定无须处置标的证券的，会员按约定处理。根据《业务协议》的约定须处置质押标的证券的，对于无限售条件股份，交易各方可以通过交易、协议转让等方式进行处置；对于仍处于限售期的有限售条件股份，会员应当按照《业务协议》的约定处理，包括但不限于：标的证券限售期届满解除限售再行处置，通过司法途径予以拍卖、变卖等。会员应当及时将具体处置方式及进展情况书面报告本所。

会员应核查违约处置是否符合中国证监会部门规章、规范性文件及上交所业务规则等关于股份减持的相关规定。

一、以交易方式进行违约处置

根据《业务协议》的约定须处置质押标的证券的，对于无限售条件股份且未被司法冻结，通过本所交易系统进行处置的，会员按以下程序处理：

（一）会员应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，或处置单一标的证券所对应初始交易金额超过 1,000 万元等情形，会员应书面报告本所，并电话通知本所股票

质押回购业务联系人。会员应通过“SSE 网站——会员/证券机构专区——会员监管——函件往来——工作函件”栏目提交书面报告（格式见附件 2，违约处置报告）。书面报告应以“（证券公司简称）（证券代码）（证券简称）（融入方名称）（年月日）交易方式违约处置报告”命名；

（二）T 日会员根据《业务协议》约定，向本所交易系统提交违约处置申报；

（三）T 日违约处置申报处理成功后，T+1 日起会员即可根据《业务协议》的约定处置标的证券，卖出成交后，会员应当根据中国结算上海分公司的要求通过 PROP 系统申报证券卖出数据。处置所得优先偿付融出方。会员应当根据《业务协议》的约定将偿付资金划付到融出方对应的账户；

（四）违约处置后，会员应向本所提交终止购回申报。质押标的证券及相应孳息如有剩余的，中国结算上海分公司根据终止购回申报解除剩余标的证券及相应孳息的质押登记；

（五）违约处置完成后，会员应向本所、中国结算上海分公司和中国证券投资者保护基金有限责任公司提交违约处置结果报告。

二、以协议转让方式进行违约处置

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》（上证发〔2020〕28 号）条件的股票质押回购违约处置协议转让，可以根据《上海证券交易所股票质押式回购交易违约处置协议转让业务办理指南》向本所提交办理协

议转让的申请。拟协议转让股票数量对应的证券市值应当和融入方应付融资余额基本匹配。

不符合前述通知规定的条件，但符合《上市公司流通股协议转让业务办理暂行规则》、《上海证券交易所上市公司股份协议转让业务办理指引》的，可以按《上海证券交易所上市公司股份协议转让业务办理指南》向本所提交办理协议转让的申请。

三、以申请仲裁、执行强制执行公证或诉讼方式进行违约处置

采用申请仲裁、执行强制执行公证或诉讼等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，在案件受理或立案之日起五个交易日内提交书面报告（格式见附件 2，违约处置报告），并电话通知本所股票质押回购业务联系人。会员应当通过“SSE 网站——会员/证券机构专区——会员监管——函件往来——工作函件”栏目提交书面报告。书面报告应以“（证券公司简称）（证券代码）（证券简称）（融入方名称）（年月日）（违约处置方式）违约处置报告”命名。

（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，会员应当及时按照前述途径和格式向本所报告处置进展，并电话通知本所股票质押回购业务联系人。

四、信息披露

会员应当根据相关规定，核查违约处置是否需要进行信息披

露。根据规定需要进行信息披露的，会员应督促融入方要求上市公司做好相关信息披露工作，并对督促过程进行留痕。会员应当在违约处置报告（附件 2）信息披露情况栏目中，准确填写信息披露情况。如上市公司未配合进行信息披露，或信息披露不充分的，除违约处置报告外，会员还应当一并提交已履行督促义务的相关证明材料。违约处置报告及相关证明材料提交 3 个交易日后（不含提交当日），上市公司仍未进行信息披露的，会员可以根据协议约定进行违约处置。

五、违约处置结果报告

违约处置完成后五个交易日内，会员应提交书面报告（格式见附件 2，违约处置结果报告）。书面报告应通过“SSE 网站——会员/证券机构专区——会员监管——函件往来——工作函件”栏目提交，并以“(证券公司简称)(证券代码)(证券简称)(融入方名称)(年月日)(违约处置方式)违约处置结果报告”命名。

第五章 会员内部控制

会员开展股票质押回购，应当按照《证券公司内部控制指引》和《业务办法》的规定，建立健全内部控制机制。

一、会员业务管理制度

会员应当对股票质押回购实行集中统一管理，并建立完备的管理制度、操作流程和风险识别、评估与控制体系，确保风险可测、可控、可承受。会员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）会员应当健全业务隔离制度，确保股票质押回购与有

可能形成冲突的业务在机构、人员、信息、账户等方面相互隔离；

（二）会员及其资产管理子公司应当健全利益冲突防范机制，以公平参与为原则，防范自营业务、客户资产管理业务在参与股票质押回购时可能发生的利益冲突；

（三）会员应对参与股票质押回购的融入方进行适当性管理，建立融入方资质审查制度，对融入方进行尽职调查，调查内容包括融入方的身份、财务状况、经营状况、信用状况、担保状况、融资投向、风险承受能力等，资质审查结果应当以书面或者电子形式记载、留存；

（四）会员应当向融入方全面介绍股票质押规则，充分揭示可能产生的风险，并要求融入方签署《风险揭示书》；若标的证券为优先股，会员还应当在相关风险揭示书或者风险揭示条款中向融入方充分揭示优先股作为股票质押回购标的证券的特定风险，并在《业务协议》中针对优先股特殊性明确约定相关处理方式。

（五）融出方为集合资产管理计划或定向资产管理客户的，会员应当核查确认相应资产管理合同及相关文件明确可参与股票质押回购，并明确约定参与股票质押回购的投资比例、单一融入方或者单一质押股票的投资比例、质押率上限等事项；若标的证券为优先股，会员还应当在相关风险揭示书或者风险揭示条款中向融出方充分揭示优先股作为股票质押回购标的证券的特定风险，并在《业务协议》中针对优先股特殊性明确约定相关处理方式。

（六）融出方为集合资产管理计划或定向资产管理客户的，

从事客户资产管理业务的会员或其资产管理子公司应在资产管理合同等相关文件中向客户充分揭示参与股票质押回购可能产生的风险；若标的证券为优先股，还应当在相关风险揭示书或者风险揭示条款中向客户充分揭示优先股作为股票质押回购标的证券的特定风险。

（七）集合资产管理计划为融出方的，集合资产管理合同应约定在股票质押回购中质权人登记为管理人，定向资产管理客户为融出方的，定向资产管理合同应约定在股票质押回购中质权人登记为定向资产管理客户或管理人；

（八）股票质押回购的回购期限不超过3年，延期后总的购回期限一般不超过3年，回购到期日遇非交易日顺延等情形除外；

（九）标的证券质押或处置需要获得国家相关主管部门的批准或备案的，会员应当核查确认融入方是否遵守相关法律法规的规定，事先办理相应手续；

（十）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，会员应当督促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。

二、会员对标的证券的管理

会员应当确定标的证券筛选标准，建立标的证券的管理制度，根据《业务办法》、本指南及其他相关规定确定和调整标的证券范围，合理确定用于质押的单一标的证券数量占其发行在外证券数量的最大比例，确保选择的标的证券合法合规、风险可控。

以有限售条件股份作为标的证券的，解除限售日应当早于回

购到期日；以债券作为标的证券的，实际购回日应不晚于债券兑付日；以封闭式基金作为标的证券的，实际购回日应不晚于封闭式基金的摘牌日。

证券被调整出标的证券范围的，在调整实施前未购回的《业务协议》仍然有效。会员应当在《业务协议》中具体约定有关流程和处置办法。

会员应当与交易各方在《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。

会员应当核查融入方所持有股票是否涉及业绩承诺股份补偿协议。会员应当通过融入方申报、上市公司公告、“SSE 网站——披露——监管信息公开——公司监管——承诺履行”栏目等渠道进行核查。

三、会员对融资投向的管理

（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，融入资金应存放在不同专用

账户。

会员应当要求融入方、指定商业银行及其他相关方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，并抄送会员或其指定机构；
4. 会员或其指定机构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、会员或其指定机构的权利和义务；
6. 融入方、商业银行、会员或其指定机构的违约责任。

（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。

四、会员对股票质押回购的风险管理

会员应当建立以净资本为核心的股票质押回购规模监控和调整机制，根据监管要求和自身财务状况，合理确定总体规模、

单一客户、单一证券交易金额占净资本的比例等风险控制指标。

会员应当建立以初始交易成交编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、部分解除质押进行合并管理。

会员应当对合并管理的交易，健全盯市机制，有效监控标的证券的市场风险。履约保障比例达到或低于约定数值的，会员应当按《业务协议》的约定要求融入方采取相应的措施。《业务协议》可以约定的措施包括：提前购回、补充质押标的证券、补充经会员认可的其他担保物等。补充其他担保物的，应与质押标的证券合并计算履约保障比例。

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。

五、会员信息报送和日常报告制度

会员应当建立股票质押回购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股票质押回购相关信息数据报送，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。会员报送数据、信息有误的，应当就此承担全部责任。

会员应当于每个交易日（T日）向本所报送截至上一交易日（T-1日）的股票质押式回购交易的相关信息。会员应按照《上

海证券交易所市场参与者专项报送文件接口规格说明书》（见附件1）的相关要求，通过本所通用文件传输平台客户端——证通云盘或 EzTrans 进行文件上传，上传时间为每个交易日 15:30-16:30。当日文件上传后，若发现信息存在错漏，会员可在当日截止上传时间前重新上传文件；若发现 T-1 日之前报送信息存在错漏的，可将相应日期的正确文件与 T-1 日数据文件一起打包上传。

会员应当准确填报“股票质押回购盯市报告”报表中“融入方应付金额”字段，根据付息、部分还款等情况进行调整。

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“盯市履约保障比例”字段与《业务协议》约定计算方式一致，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，并准确填报“履约保障级别”字段。

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。（一）在日常股票质押回购中，会员应建立包括但不限于以下内容的报告管理制度：

1. 因融入方原因导致购回交易或资金划付无法完成的，会员应当于次一交易日报告本所会员部；

2. 因会员原因导致购回交易或证券解除质押、资金划付失败的，应当于次一交易日报告本所会员部；

3. 违约处置完成后，会员应向本所会员部、中国结算上海分公司以及中国证券投资者保护基金有限责任公司提交违约处置结果报告；

4. 发生《业务办法》规定的异常情况时，会员应及时向本所会员部报告，并持续报告进展情况；

5. 会员被暂停或终止股票质押回购交易权限的，应当及时向本所会员部提交业务处置报告。

（二）会员发生下列情况影响股票质押回购的，应当立即向本所会员部报告，并持续报告进展情况：

1. 重大业务风险；
2. 重大技术故障；
3. 不可抗力或者意外事件可能影响客户正常交易的；
4. 其他影响公司正常经营的重大事件。

会员未按照本所要求进行信息报送，或报送信息有误的，或未能及时、准确履行报告义务，本所将视情况采取监管措施或纪律处分。

附件 1：技术接口文件

1. 股票质押回购市场参与者技术实施指引

详见“SSE 网站——交易技术支持专区——技术指南——《股票质押回购市场参与者技术实施指引》”

2. 股票质押回购接口规格说明书

详见“SSE 网站——交易技术支持专区——数据接口——《上海证券交易所综合业务平台市场参与者接口规格说明书》”

3. 股票质押数据报送接口规格说明书

详见“SSE 网站——交易技术支持专区——数据接口——《上海证券交易所市场参与者专项报送文件接口规格说明书》”

附件 2：会员报告格式

违约处置报告

交易信息	初始交易成交编号			
	补充质押成交编号（如有）		初始交易日期	
	补充质押日期（如有）		到期购回日	
	回购期限		初始交易金额	
	融入方实际应付金额		质押标的证券代码	
	质押标的证券简称		质押标的证券股份性质	
	质押标的证券数量		质押标的证券数量占 A 股股本比例	
	质押标的证券数量占融入方持股数量比例		融出方证券账户号码	
	融出方名称		融出方属性	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融入方股东性质		融资投向	
	预警线		平仓线	
	会员编号		会员全称	
	质权人名称			
其他需要说明的内容				
违约情形				
信息披露情况	<p>是否需要信息披露 <input type="checkbox"/>是 <input type="checkbox"/>否 如果是，请继续填报下列选项： <input type="checkbox"/>已进行充分信息披露 <input type="checkbox"/>尚未进行充分信息披露 请说明具体情况，如是否督促融入方要求上市公司进行披露，历次督促的时间、方式及反馈情况等</p>			
处置安排	拟处置方式	<input type="checkbox"/> 竞价交易 <input type="checkbox"/> 大宗交易 <input type="checkbox"/> 仲裁 <input type="checkbox"/> 申请执行强制执行公证 <input type="checkbox"/> 诉讼 <input type="checkbox"/> 其他方式		
	拟处置金额			
	拟处置数量		拟处置数量占 A 股股本的比例	
	其他需要说明的处置安排	其他需要说明的情况包括但不限于：是否已被司法冻结以及司法冻结数量，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。		

司法等途径违约处置进展 (如需)	<p>(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填写)</p> <p><input type="checkbox"/> 司法拍卖 <input type="checkbox"/> 二级市场卖出 <input type="checkbox"/> 折价过户</p> <p>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>
<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:融出方属性填写“自有资金”、“集合资产管理计划”、“定向资产管理客户”、“专项资产管理计划”;融入方股东性质填列股东是否为控股股东及一致行动人、持股5%以上股东及一致行动人、特定股东或董事、监事、高级管理人员。融入方实际应付金额指考虑付息、部分还款等情形,融入方当前实际仍需偿付的金额。

违约处置结果报告

交易信息	初始交易成交编号			
	补充质押成交编号(如有)		初始交易日期	
	补充质押日期(如有)		到期购回日	
	回购期限		初始交易金额	
	融入方实际应付金额		质押标的证券代码	
	质押标的证券简称		质押标的证券股份性质	
	质押标的证券数量		质押标的证券数量占A股股本比例	
	质押标的证券数量占融入方持股数量比例		融出方证券账户号码	
	融出方名称		融出方属性	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融入方股东性质		融资投向	
	预警线		平仓线	
	会员编号		会员全称	
	质权人名称			
	其他需要说明的内容			
处置过程	违约处置申报日期			
	违约处置完成日期			
	违约处置方式	<input type="checkbox"/> 竞价交易 <input type="checkbox"/> 大宗交易 <input type="checkbox"/> 协议转让 <input type="checkbox"/> 仲裁 <input type="checkbox"/> 申请执行 <input type="checkbox"/> 强制执行公证 <input type="checkbox"/> 诉讼 <input type="checkbox"/> 其他方式		
	违约处置金额			
	违约处置股份数量		违约处置股份数量占A股股本比例	
	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>				
联系人：	联系电话：	证券公司：（公章）		
		年 月 日		

回购期限延期超过 3 年报告

交易信息	初始交易成交编号			
	补充质押成交编号（如有）		初始交易日期	
	补充质押日期（如有）		到期购回日	
	回购期限		初始交易金额	
	融入方实际应付金额		质押标的证券代码	
	质押标的证券简称		质押标的证券股份性质	
	质押标的证券数量		质押标的证券数量占 A 股股本比例	
	质押标的证券数量占融入方持股数量比例		融出方证券账户号码	
	融出方名称		融出方属性	
	融入方证券账户号码		融入方名称	
	融入方股东性质		融资投向	
	预警线		平仓线	
	会员编号		会员全称	
	质权人名称			
	其他需要说明的内容			
延期原因	回购期限是否已实际满 3 年	<input type="checkbox"/> 已实际满 3 年 <input type="checkbox"/> 3 个月内将满 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>				
联系人：		联系电话：		证券公司：（公章）
				年 月 日

特殊适用情形报告

新增交易信息	初始交易成交编号		
	初始交易日期		到期购回日
	回购期限		初始交易金额
	融入方实际应付金额		质押标的证券代码
	质押标的证券简称		质押标的证券股份性质
	质押标的证券数量		质押标的证券数量占 A 股股本比例
	质押标的证券数量占融入方持股数量比例		融出方证券账户号码
	融出方名称		融出方属性
	融入方证券账户号码		融入方名称
	融入方股东性质		融资投向
	预警线		平仓线
	证券公司全称		质权人名称
	其他需要说明的内容		
原交易信息	初始交易成交编号		
	补充质押成交编号（如有）		初始交易日期
	补充质押日期（如有）		到期购回日
	回购期限		初始交易金额
	融入方实际应付金额		质押标的证券代码
	质押标的证券简称		质押标的证券股份性质
	质押标的证券数量		质押标的证券数量占 A 股股本比例
	质押标的证券数量占融入方持股数量比例		融出方证券账户号码
	融出方名称		融出方属性
	融入方证券账户号码		融入方名称
	融入方股东性质		融资投向
	预警线		平仓线
	证券公司全称		质权人名称
其他需要说明的内容			
涉及的相关条款			
特殊情形说明			

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。

联系人： 联系电话：

证券公司：（公章）

年 月 日