

深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司关于权证发行上市若干问题的通知 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

[https://www.100test.com/kao\\_ti2020/39/2021\\_2022\\_\\_E6\\_B7\\_B1\\_E5\\_9C\\_B3\\_E8\\_AF\\_81\\_E5\\_c33\\_39409.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/39/2021_2022__E6_B7_B1_E5_9C_B3_E8_AF_81_E5_c33_39409.htm) 为了做好权证的发行、上市和交易工作,根据《深圳证券交易所权证管理暂行办法》(以下简称"暂行办法")、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市权证登记结算业务实施细则》(以下简称"结算细则")有关规定,深圳证券交易所(以下简称"深交所")、中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")就权证上市、交易、结算和收费等相关事项通知如下:一、权证发行上市前的相关准备工作 权证发行人应在权证发行前向深交所申请权证代码与权证简称,经深交所确认后方可使用。深交所权证代码与简称编制规则如下:1、权证代码 认购权证代码区间为【030001--032999】;认沽权证代码区间为【038001--039999】;权证业务预留的代码区间为【033000--038000】。认购权证和认沽权证分别按发行先后顺序编码。深交所权证产品的发行、交易、行权等业务使用同一个证券代码。2、权证简称 一般情况下,权证简称应为"XYB b K s",其中:XY为标的证券的两个汉字简称;B b为两个拼音字母的发行人编码;K为权证类别,其中:C--认购权证,P--认沽权证;s为同一发行人对同一标的证券发行权证的发行批次,取值为[0,9],[A,Z],[a,z]。例如:攀枝花钢铁有限责任公司对新钢钒发行的认沽权证的代码为038001,简称为"钢钒PGP1"。权证发行人应在权证上市之前与深交所签订《权证上市协议书》(《权证上市协议书》格式见附件一),并严格

执行权证上市协议的规定。二、权证风险揭示及投资者教育工作 权证是高杠杆性和高风险性产品,为了帮助投资者正确认识并防范权证市场风险,会员单位应当认真履行职责,采取各种形式开展权证业务的投资者教育工作,使投资者知悉权证交易、行权的基本知识和主要风险,以有效防范和控制风险。在投资者首次参与权证交易前,会员单位必须要求其签署《权证风险揭示书》,并向其解释《权证风险揭示书》的内容,投资者在充分理解后签署。深交所《权证风险揭示书》范本详见附件二。

三、权证交易及结算资格管理 (一)深交所和中国结算对权证业务分别实施交易资格和结算资格管理。同时取得深交所权证交易资格和中国结算权证买入结算资格的会员公司和结算参与者,可从事权证自营或经纪业务。深交所或中国结算另有规定的除外。经深交所审核取得权证交易资格的会员公司名单见附件三。经中国结算审核取得权证买入结算资格的结算参与人名单详见中国结算外部网站。只取得权证交易资格但未取得权证买入结算资格的会员公司和结算参与者,只可以在自营或经纪业务中行权或卖出权证;已根据结算细则第三十九条的规定选择合资格结算参与者代理或担保其结算业务的,可以在自营或经纪业务中买入权证。(二)对违反结算细则规定,不能按时履行交收义务的结算参与者,中国结算从下一个交易日起暂停其权证买入结算资格。对于会员公司被暂停权证买入结算资格的,深交所根据中国结算的建议,在下一个交易日限制该会员在自营或经纪业务中买入权证;对于合格境外机构投资者指定的结算参与者被暂停权证买入交易结算资格的,深交所根据中国结算的建议,在下一个交易日限制该合格境外机构投资者买入权证。限制买入的有关措施,由中国结算

告知相关结算参与者。因不能按时履行交收义务被限制权证买入结算资格的结算参与人在补足交收透支款且权证交收履约保证金不低于最低限额的,中国结算认为其具备持续交收能力后,恢复其权证买入结算资格。根据中国结算的建议,深交所 在下一个交易日取消对相关会员或合格境外机构投资者的权证买入限制。取消限制买入的有关措施后,由中国结算告知相关结算参与者。(三)深交所对违反法律、法规、规章或相关业务规则的会员公司,可以暂停其权证交易资格。(四)会员公司和结算参与者被限制权证交易资格,或被暂停权证买入结算资格后,应及时向其客户说明原因,提示风险,并自行承担因交易资格和买入结算资格被暂停而引起的法律后果。 100Test 下载频道开通,各类考试题目直接下载。详细请访问 [www.100test.com](http://www.100test.com)