

上海证券交易所交易规则 (2013年修订)

(上接 A13 版)

第四章 其他交易事项

第一节 开盘价与收盘价

4.1.1 证券的开盘价为当日该证券的第一笔成交价格。

4.1.2 证券的开盘价通过集合竞价方式产生,不能产生开盘价的,以连续竞价方式产生。

4.1.3 证券的收盘价为当日该证券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价(含最后一笔交易)。当日无成交的,以前收盘价为当日收盘价。

第二节 挂牌、摘牌、停牌与复牌

4.2.1 本所对上市证券实行挂牌交易。

4.2.2 证券上市期届满或依法不再具备上市条件的,本所终止其上市交易,并予以摘牌。

4.2.3 本所可以对涉嫌违法违规交易的证券实施特别停牌并予以公告,相关当事人应按照本所的要求提交书面报告。

特别停牌及复牌的时间和方式由本所决定。

4.2.4 证券停牌时,本所发布行情中包括该证券的信息;证券摘牌后,行情中无该证券的信息。

4.2.5 证券开市期间停牌的,停牌前的申报参加当日该证券复牌后的交易;停牌期间,可以继续申报,也可以撤销申报;复牌时对已接受的申报实行集合竞价,集合竞价期间不揭示虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量、虚拟未匹配量。

4.2.6 证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的其他规定,按照本所上市规则或其他有关规定执行。

第三节 除权与除息

4.3.1 上市证券发生权益分派、公积金转增股本、配股等情况,本所在权益登记日 B 股为最后交易日 A 交易日的对该证券作除权除息处理,本所另有规定的除外。

4.3.2 除权(息)参考价格的计算公式为:

除权(息)参考价格=(前收盘价-现金红利)÷(配(新)股价格×流通股数+流通股数×除权(息)参考价格)

4.3.3 除权(息)日证券买卖,按除权(息)参考价格作为计算涨跌幅度的基准,本所另有规定的除外。

第四节 债券分期偿还

4.4.1 债券分期偿还采取减少面值的方式办理。

4.4.2 采取减少面值方式的,按照以下规定办理:

(一)债券持仓数量保持不变,债券面值根据已偿还比例相应减少。面值计算公式为:减少后的面值=发行面值×未偿还比例。

(二)债券计价单位为减少后的面值所对应债券的价格,债券质押式回购为“每百元资金到期年收益”,债券买断式回购为减少后的面值所对应债券的到期回购价格。”

(三)债券交易单位为手,申报数

量为1手或其整数倍。1手债券对应的面值计算公式为:1手债券面值=1000元×未偿还比例。

(四)本所在权益登记日次日交易日作除权处理。除权参考价格的计算公式为:除权参考价格=前收盘价格-100元×本次偿还比例。

4.4.3 采取减少持仓方式的,债券面值保持不变,债券持仓数量根据已偿还比例相应减少。由此产生的不足1手债券,应当予以全部偿还。

4.4.4 以其他方式办理债券分期偿还的,具体事项由本所另行规定。

4.4.5 本节未做规定的交易事项按照本规则其他规定办理。

第五章 交易信息

第一节 一般规定

5.1.1 本所每个交易日发布证券交易即时行情、证券指数、证券交易公开信息等交易信息。

5.1.2 本所及时编制反映市场成交情况的各类日报表、周报表、月报表和年报表,并予以发布。

5.1.3 本所市场产生的交易信息归本所所有。未经本所许可,任何机构和个人不得使用和传播。

个人本所许可使用交易信息的机构和个人,未经本所同意,不得将本所交易信息提供给其他机构和个人使用或予以传播。

5.1.4 证券交易信息的管理办法由本所另行规定。

第二节 即时行情

5.2.1 每个交易日 9:15 至 9:25 开盘集合竞价期间,即时行情内容包括:证券代码、证券简称、前收盘价、虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量和虚拟未匹配量。

5.2.2 连续竞价期间,即时行情内容包括:证券代码、证券简称、前收盘价格、最新成交价格、当日最高成交价格、当日最低成交价格、当日累计成交量、当日累计成交金额、实时最高五个买入申报价格和数量、实时最低五个卖出申报价格和数量。

5.2.3 首次上市证券上市首日,其即时行情显示的前收盘价格为其发行价,本所另有规定的除外。

5.2.4 即时行情通过通信系统传输至各会员,会员应在本所许可的范围内使用。

5.2.5 根据市场发展需要,本所可以调整即时行情发布的方式和内容。

第三节 证券指数

5.3.1 本所编制综合指数、成份指数、分类指数等证券指数,以反映证券交易总体价格或某类证券价格的变动和走势,随即时行情发布。

5.3.2 证券指数的编制遵循公开透明的原则。

5.3.3 证券指数设置和编制的具体方法由本所另行规定。

第四节 证券交易公开信息

5.4.1 有价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金竞价交易出现下列情形之一的,本所公布当日买入、卖出金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额:

(一)收盘价格涨跌幅偏离值达到±7%的前三只股票(基金);

收盘价格涨跌幅偏离值的计算公式为:收盘价格涨跌幅偏离值=单只股票(基金)涨跌幅÷对应分类指数涨跌幅。

(二)日价格振幅达到15%的前三只股票(基金);

价格振幅的计算公式为:价格振幅=(当日最高价格-当日最低价格)÷

当日最低价格×100%。

(三)日换手率达到20%的前三只股票(基金);

换手率的计算公式为:换手率=成交股数(份额)÷流通股数(份额)×100%。

收盘价格涨跌幅偏离值、价格振幅或换手率相同的,依次按成交金额和成交量选取。

对应分类指数包括本所编制的上证 A 股指数、上证 B 股指数和上证基金指数等。

对第 3.4.13 条规定的无价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金,本所公布当日买入、卖出金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额。

5.4.2 股票、封闭式基金竞价交易出现下列情形之一的,属于异常波动,本所分别公告该股票、封闭式基金交易异常波动期间累计买入、卖出金额最大五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额:

(一)连续三个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到±20%的;

(二)连续三个交易日内日均换手率与前五个交易日的日均换手率的比值达到 30 倍,并且该股票、封闭式基金连续三个交易日内的累计换手率达到 20%的;

(三)本所或证监会认定属于异常波动的其他情形。

异常波动指标自公告之日起重新计算。

对第 3.4.13 条规定的无价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金不纳入异常波动指标的计算。

经证监会批准,本所可以调整涨跌幅偏离值的累计比例。

5.4.3 本所根据第 4.2.3 条对证券实施特别停牌的,根据需要可以公布以下信息:

(一)成交金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出数量和买入、卖出金额;

(二)股份统计信息;

(三)本所认为应披露的其他信息。

5.4.4 证券交易公开信息涉及机构的,公布名称为“机构专用”。

5.4.5 根据市场发展需要,本所可以调整证券交易公开信息的内容。

第六章 交易行为监督

6.1 本所对下列可能影响证券交易价格或者证券交易量的异常交易行为予以重点监控:

(一)可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前,大量买入或者卖出相关证券;

(二)以同一身份证明文件、营业执照或其他有效证明文件开立的证券账户之间,大量或者频繁进行互为对手方的交易;

(三)委托、授权给同一机构或者同一个人代为从事交易的证券账户之间,大量或者频繁进行互为对手方的交易;

(四)两个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户之间,大量或者频繁进行互为对手方的交易;

(五)大量申报、连续申报或者密集申报,以影响证券交易价格;

(六)频繁申报或频繁撤销申报,以影响证券交易价格或其他投资者的投资决定;

(七)巨额申报,且申报价格明显偏离申报时的证券市场成交价格;

(八)一段时期内进行大量且连续的交易;

(九)在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易;

(十)大量或者频繁进行高买低卖交易;

(十一)进行与自身公开发布的投资

分析、预测或建议相背离的证券交易;

(十二)在大宗交易中进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报;

(十三)本所认为需要重点监控的其他异常交易。

6.2 会员及其营业部发现投资者的证券交易出现第 6.1 条所列异常交易行为之一,且可能严重影响证券市场秩序,应当予以提醒,并及时向本所报告。

6.3 出现第 6.1 条所列异常交易行为之一,且对证券交易价格或者交易量产生重大影响的,本所可采取非现场调查和现场调查措施,要求相关会员及其营业部提供投资者开户资料、授权委托书、资金存取凭证、资金账户情况、相关交易情况等资料;如异常交易涉及投资者的,本所可以直接要求其提供有关材料。

6.4 会员及其营业部、投资者应当配合本所进行相关调查,及时、真实、准确、完整地提供有关文件和资料。

6.5 对情节严重的异常交易行为,本所可以对视情况采取下列措施:

(一)口头或书面警示;

(二)约见谈话;

(三)要求相关投资者提交书面承诺;

(四)限制相关证券账户交易;

(五)报请证监会冻结相关证券账户或资金账户;

(六)上报证监会查处。

如对第(四)项措施有异议的,可以向本所提出复核申请。复核期间不停止相关措施的执行。

第七章 交易异常情况处理

7.1 发生下列交易异常情况之一,导致部分或全部交易不能进行的,本所可以决定技术性停牌或临时停牌:

(一)不可抗力;

(二)意外事件;

(三)技术故障;

(四)本所认定的其他异常情况。

7.2 出现行情传输中断或无法申报的会员营业部数量超过营业部总数 10%以上的交易异常情况,本所可以实行临时停牌。

7.3 本所认为可能发生第 7.1 条、第 7.2 条规定的交易异常情况,并会严重影

响交易正常进行的,可以决定技术性停牌或临时停牌。

7.4 本所对技术性停牌或临时停牌决定予以公告。

7.5 技术性停牌或临时停牌原因消除后,本所可以决定恢复交易。

7.6 除本所认定的特殊情况外,技术性停牌或临时停牌后当日恢复交易的,应当予以提醒,并及时向本所报告。

7.7 因交易异常情况及本所采取的相应措施造成的损失,本所不承担责任。

第八章 交易纠纷

8.1 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷,相关会员应当记录有关情况,以备本所查阅。交易纠纷影响正常交易的,会员应当及时向本所报告。

8.2 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷,本所可以按有关规定提供必要的交易数据。

8.3 客户对交易有疑义的,会员应当协调处理。

第九章 交易费用

9.1 投资者买卖证券成交的,应当按规定向代其进行证券买卖的会员交纳佣金。

9.2 会员应当按规定向本所交纳会员费、交易经手费及其他费用。

9.3 证券交易的收费项目、收费标准和管理办法按照有关规定执行。

第十章 纪律处分

10.1 会员违反本规则的,本所责令其改正,并视情节轻重单处或并处:

(一)在会员范围内通报批评;

(二)在证监会指定的媒体上公开谴责;

(三)暂停或者限制交易;

(四)取消交易资格;

(五)取消会员资格。

10.2 会员对前条(二)、(三)、(四)、(五)项处分有异议的,可以自接到处分

暂缓实施的条款

序号	条款内容	备注
3.7.2	本所接受下列大宗交易申报: (一)意向申报; (二)成交申报; (三)固定价格申报; (四)本所认可的其他大宗交易申报。	(1)第(三)项的实施时间另行通知。 (2)其余项在 2013 年 12 月 9 日实施。
3.7.3	本所每个交易日接受大宗交易申报的时间分别为: (一)9:30 至 11:30、13:00 至 15:30 接受意向申报; (二)9:30 至 11:30、13:00 至 15:30、16:00 至 17:00 接受成交申报; (三)15:00 至 15:30 接受固定价格申报。	(1)第(二)项 9:30 至 11:30、13:00 至 15:00、16:00 至 17:00 接受成交申报”以及第(三)项的实施时间另行通知。 (2)其余项在 2013 年 12 月 9 日实施。
3.7.4	每个交易日 9:30 至 15:30 时段确认的成交,于当日进行清算交收。每个交易日 16:00 至 17:00 时段确认的成交,于次日交易日进行清算交收。	(1)第二款的实施时间另行通知。 (2)其他内容在 2013 年 12 月 9 日实施。
3.7.9	提出固定价格申报的,买卖双方可按当日竞价交易市场收盘价格或者当日全天成交量加权平均价格进行申报。	本条实施时间另行通知。
3.7.10	有价格涨跌幅限制的证券的成交申报价格,由买卖双方在前收盘价格的上下 30%或当日已成交的最高、最低价格之间自行协商确定。	(1)第三款的实施时间另行通知。 (2)其他内容在 2013 年 12 月 9 日实施。
3.7.14	本所在每个交易日接受后通过本交易所网站公布以下交易信息: (一)股票和基金的成交申报大宗交易,内容包括:证券代码、证券简称、成交量、成交价格以及买卖双方所在会员证券营业部的名称; (二)债券和债券回购的成交申报大宗交易,内容包括:证券名称、成交价和成交量; (三)单只证券的固定价格申报的成交量、成交金额,及该证券当日买入、卖出金额最大五家会员证券营业部的名称和各自的买入、卖出金额。	(1)第(三)项的实施时间另行通知。 (2)其他内容在 2013 年 12 月 9 日实施。

证券代码:000776 证券简称:广发证券 公告编号:2013-102

广发证券股份有限公司第七届监事会第十七次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

广发证券股份有限公司第七届监事会第十七次会议于 2013 年 10 月 18 日以通讯方式召开。本届监事会监事 5 人,参与表决 5 人。会议的召开符合《公司法》等有关法规和《公司章程》的有关规定。

会议审议通过了以下议案:

一、审议《关于使用部分闲置募集资金补充流动资金的议案》

以上议案同意票 5 票,反对票 0 票,弃权票 0 票。

反对票弃权的原因:无。

内容详见公司与本公告同时披露在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网站(www.cninfo.com.cn)的《关于使用部分闲置募集资金补充流动资金的公告》。

广发证券股份有限公司监事会
二〇一三年十月十九日

证券代码:000776 证券简称:广发证券 公告编号:2013-103

广发证券股份有限公司第七届董事会第四十一次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

广发证券股份有限公司(以下简称“公司”)第七届董事会第四十一次会议于 2013 年 10 月 18 日以通讯方式召开。公司董事会 9 名,参与表决董事 9 名。会议的召开符合《公司法》等有关法规和《公司章程》的有关规定。

会议审议通过了以下议案:

一、审议《关于使用部分闲置募集资金补充流动资金的议案》

以上议案同意票 9 票,反对票 0 票,弃权票 0 票。

反对票弃权的原因:无。

内容详见公司与本公告同时披露在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网站(www.cninfo.com.cn)的《关于使用部分闲置募集资金补充流动资金的公告》。

二、审议《关于提高公司融资融券业务总规模的议案》

根据该议案,同意公司开展融资融券业务的总规模由“不超过 200 亿元人民币”提高至“不超过 300 亿元人民币”,授权公

司管理层在不违反上述规模的范围内,根据公司资产状况和使用收益等实际情况科学决策,在相关指标符合外部监管规定的前提下确定融资融券业务的具体规模。

以上议案同意票 9 票,反对票 0 票,弃权票 0 票。

反对票弃权的原因:无。

三、审议《关于确定融资融券业务规模的事项》

经董事会审议融资融券业务规模不超过 160 亿元;其中通过自有资金开展融资融券业务规模不超过 40 亿元。通过公司《客户资产专项资产管理计划》开展融资融券业务规模不超过 100 亿元。授权公司经营管理层在上述确定的规模内,根据公司资产状况和使用收益等实际情况科学决策,在相关指标符合外部监管规定的前提下确定资金使用的具体规模。

以上议案同意票 9 票,反对票 0 票,弃权票 0 票。

反对票弃权的原因:无。

特此公告。

广发证券股份有限公司董事会
二〇一三年十月十九日

证券代码:000776 证券简称:广发证券 公告编号:2013-104

广发证券股份有限公司关于使用部分闲置募集资金补充流动资金的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《上市公司监管指引第 2 号—上市公司募集资金管理和使用的监管要求》等相关规定,为提高募集资金的使用效率,公司使用部分闲置募集资金合计 1,199,000,000 元用于补充流动资金,使用期限自第七届董事会第四十一次会议审议通过“本次董事会”决议批准之日起六个月。公司对前述暂时闲置募集资金补充流动资金的使用将严格遵守相关法律法规的规定。

一、本次募集资金的基本情况

公司于 2011 年 8 月 16 日以非公开发行股票的方式向 10 名特定投资者发行了 45,260 万股人民币普通股(A 股)人民币普通股 9 票,反对票 0 票,弃权票 0 票。

根据德勤华永会计师事务所有限公司于 2011 年 8 月 17 日出具的《验资报告》(德勤华永证验字[2011]第 0066 号),本次发行募集资金总额为 12,179,466,000.00 元,扣除发行费用 179,519,556.22 元后,募集资金净额为 11,999,946,443.78 元。

根据《上市公司公开发行证券类方募集公司债券募集资金管理办法》,本次募集资金主要用于以下方面:

1. 扩大承销业务规模,增强投行承销业务能力;

2. 增加融资融券业务规模,全面开展融资融券业务;

3. 优化经纪业务网点布局,拓展业务规模,促进服务产品销售;

4. 提高证券投资业务规模;

5. 加大对子公司投入,扩大直接投资、股权投资、股指期货等业务规模;

7. 加大信息系统建设投入;

8. 其他合理用途。

截至 2013 年 10 月 14 日,公司累计收到募集资金存款利息收入 79,092,357.54 元,累计使用募集资金 10,766,873,973.53 元,支付银行手续费 3,400.38 元,公司募集资金专户现有余额 1,312,161,337.41 元,实际余额人民币 1,312,161,337.43 元。

募集资金使用情况及暂时闲置募集资金使用情况如下:

募集资金投资项目	募集资金承诺投资金额	已经投入的募集资金金额(截至 2013 年 10 月 14 日)	对应的暂时闲置募集资金
补充公司营运资金—增资广发期货有限公司	700,000,000.00	500,000,000.00	200,000,000.00
补充公司营运资金—增资广发创投(香港)有限公司	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	0
补充公司营运资金—增资广发德信投资管理有限公司	2,000,000,000.00	1,200,000,000.00	800,000,000.00
补充公司营运资金—加大信息系统建设投入	650,000,000.00	331,272,902.32	318,727,097.68
补充公司营运资金—加大信息系统建设投入	7,649,946,437.78	7,735,601,071.11	/
合计	11,999,946,437.78	10,766,873,973.53	1,318,227,097.68

注:1、注 2 包括包商银行使用募集资金专户利息冲减投入进行募集资金项目的投入。

根据募集资金投资项目资金使用计划,公司募集资金投资项目“增资广发期货有限公司”、“增资广发德信投资管理有限公司”及“加大信息系统建设投入”在除预计在将来 6 个月内可能使用的资金后分别对应的暂时闲置募集资金为 200,000,000 元、800,000,000 元、199,000,000 元,合计 1,199,000,000 元用于补充流动资金,使用期限自本次董事会审议通过之日起六个月。公司对前述暂时闲置募集资金补充流动资金的使用将严格遵守相关法律法规的规定。

在市公司监管指引第 2 号—上市公司募集资金管理和使用的监管要求的相关规定,同意使用募集资金投资项目“增资广发期货有限公司”、“增资广发德信投资管理有限公司”及“加大信息系统建设投入”在除预计在将来 6 个月内可能使用的资金后分别对应的暂时闲置募集资金 200,000,000 元、800,000,000 元、199,000,000 元,合计 1,199,000,000 元用于补充流动资金,使用期限自本次董事会审议通过之日起六个月。公司对前述暂时闲置募集资金补充流动资金的使用将严格遵守相关法律法规的规定。

二、董事会决议

董事会同意使用募集资金投资项目“增资广发期货有限公司”、“增资广发德信投资管理有限公司”及“加大信息系统建设投入”在除预计在将来 6 个月内可能使用的资金后分别对应的暂时闲置募集资金 200,000,000 元、800,000,000 元、199,000,000 元,合计 1,199,000,000 元用于补充流动资金,使用期限自本次董事会审议通过之日起六个月。公司对前述暂时闲置募集资金补充流动资金的使用将严格遵守相关法律法规的规定。

三、监事会决议

监事会同意使用募集资金投资项目“增资广发期货有限公司”、“增资广发德信投资管理有限公司”及“加大信息系统建设投入”在除预计在将来 6 个月内可能使用的资金后分别对应的暂时闲置募集资金 200,000,000 元、800,000,000 元、199,000,000 元,合计 1,199,000,000 元用于补充流动资金,使用期限自本次董事会审议通过之日起六个月。公司对前述暂时闲置募集资金补充流动资金的使用将严格遵守相关法律法规的规定。

四、保荐机构意见

关于广发证券本次运用部分闲置募集资金补充流动资金的事项,保荐机构核查后认为:广发证券本次运用部分闲置募集资金人民币 1,199,000,000 元暂时补充流动资金未改变募集资金用途,不会影响募集资金投资计划的正常进行,使用期限自本次董事会审议通过之日起六个月,且公司承诺对前述暂时闲置募集资金补充流动资金的使用将严格遵守《上市公司监管指引第 2 号—上市公司募集资金管理和使用的监管要求》等相关法规的规定,符合《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》的有关规定;该事项已经公司第七届董事会第四十一次会议审议通过,监事会和独立董事发表了同意意见。保荐机构对此事项无异议。

五、备查文件

1、“广发证券股份有限公司第七届董事会第四十一次会议决议”;

2、“广发证券股份有限公司独立董事关于使用部分闲置募集资金补充流动资金的独立意见”;

3、“广发证券股份有限公司第七届监事会第十七次会议决议”;

4、国信证券股份有限公司关于广发证券股份有限公司使用部分闲置募集资金补充流动资金的核查意见。

广发证券股份有限公司董事会
二〇一三年十月十九日