

中国证监会指定披露上市公司信息报纸
中国保监会指定披露保险信息报纸
中国银监会指定披露信托公司信息报纸

2015年1月27日 星期二

B1

■ 特别提示 | Trading Tips |

深市 新股上市日 利民股份 复牌日	丰原药业 三花股份 佰利联 中银产债	万方发展 青岛金王 金龙机电	当代东方 多氟多 蓝盾股份	停牌 申科股份 江特电机 泰胜风能	华控赛格 海隆软件	ST生化 人人乐	沪市 新股上市日 晨光文具 债券上市日	14长兴债
-----------------------------------	-----------------------------	----------------------	---------------------	-----------------------------------	--------------	-------------	-------------------------------------	-------

■ 今日公告导读 | Bulletin Board |

深市主板			深市中小板			沪市主板			沪市B股			创业板			基金		
000005 世纪星源	B57		000892 星美联合	B19		600251 冠农股份	B55		600847 万里股份	B69		600854 春兰股份	B30		600877 万润股份	B59	
000008 宝利来	B65		000908 天一科技	B39		600256 广汇能源	B69		600854 春兰股份	B30		600866 星湖科技	B32		600881 亚泰集团	B54	
000010 深华新	B87		000910 大业科技	B40		600257 大湖股份	B19		600866 星湖科技	B32		600887 伊泰集团	B54		600887 伊泰集团	B54	
000023 深天地A	B60		000912 沪天化	B70		600260 凯乐科技	B24		600881 亚泰集团	B54		600893 华联控股	B24		600903 云天化	B54	
000042 中洲控股	B60		000955 欣龙控股	B31		600267 海正药业	B9		600893 华联控股	B24		600901 株冶集团	B54		600903 云天化	B54	
000061 农产品	B60		000958 东方能源	B26		600269 赣粤高速	B40		600901 株冶集团	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000068 华控赛格	B57		000958 东方能源	B62		600280 中央商场	B19		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000153 丰原药业	B63		000973 佛塑科技	B65		600282 *ST南钢	B53		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000166 申万宏源	B19					600290 华仪电气	B58		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000403 ST生化	B39					600291 西水股份	B16		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000407 胜利股份	B70					600292 中电远达	B69		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000411 美都集团	B23					600306 *ST尚钢	B25		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000415 渤海租赁	B70					600340 华夏幸福	B72		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000426 兴业矿业	B56					600346 大橡塑	B64		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000498 山东路桥	B56					600346 大橡塑	B80		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000504 *ST传化	B72					600355 精伦电子	B16		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000506 中润资源	B39					600356 恒丰纸业	B59		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000516 国际医学	B20					600369 西南证券	B56		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000528 精工	B70					600376 首开股份	B40		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000534 万泽股份	B72					600382 广弘济世	B55		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000540 中天城投	B72					600393 东华实业	B18		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000544 中原环保	B16					600398 海澜之家	B21		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000547 闽福悦A	B31					600401 海润光伏	B80		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000564 西安民生	B18					600415 小商品城	A8		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000571 新大洲A	B32					600416 兴业银行	B18		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000584 友利控股	B31					600421 仰光控股	B21		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000589 鹏轮股份	B16					600426 华鲁恒升	B20		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000592 平潭发展	B32					600483 福能股份	B64		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000594 *ST国恒	B38					600509 天富能源	B61		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000605 渤海股份	B60					600518 康美药业	B30		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000608 阳光电源	B60					600518 康美药业	B22		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000610 西安高新	B68					600535 天士力	B61		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000615 顺鑫农业	B63					600537 亿晶光电	B18		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000616 亿帆医药	B80					600538 国农股份	B16		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000622 恒立实业	B59					600565 通江股份	B27		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000638 万方发展	B8					600566 鼎城股份	B32		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000661 长春高新	B65					600575 汇川技术	B80		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000662 美泰特	B54					600588 用友软件	B16		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000665 闽北电力	B27					600588 用友软件	B64		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000676 思达高科	B64					600614 鼎立股份	B29		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000680 山推股份	B36					600644 重庆路桥	B68		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000686 东北证券	B65					600645 中鼎股份	B14		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000703 国盛科技	B31					600645 中鼎股份	B14		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000711 京蓝科技	B56					600646 海油工程	B72		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000719 大地传媒	B28					600629 西部矿业	B21		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000721 西安饮食	B69					600639 西部矿业	B59		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000728 国元证券	B24					600641 兴农集团	B56		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000732 泰禾集团	B57					600646 海油工程	B72		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000733 泰禾集团	B57					600651 航天机电	B69		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000753 神州投资	B26					600663 福建海峡	B34		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000761 江淮动力	B28					600665 西子特钢	B57		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000818 万化化工	B19					600629 西部矿业	B21		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000828 东密控股	B57					600639 西部矿业	B59		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000836 鑫茂科技	B55					600641 兴农集团	B56		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000839 中信国安	B28					600646 海油工程	B72		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000850 华茂股份	B60					600651 航天机电	B69		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000875 吉电股份	B26					600663 福建海峡	B34		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	
000883 湖北能源	B35					600665 西子特钢	B57		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54		600903 云天化	B54	

1.问:跨境ETF、跨境LOF交易规则改变的通知在哪里发布?
答:跨境ETF、跨境LOF交易规则改变的通知发布在深交所网站“法律/规则”“交易类”“一般规定”下,名为《关于修改〈深圳证券交易所交易规则〉第3.1.4条的通知》。

2.问:跨境ETF、跨境LOF实施T+0交易后会有标识吗?
答:跨境ETF、跨境LOF实施T+0交易后代码、简称中不会有特别标识,截至2015年1月19日的深交所跨境ETF、跨境LOF名单如下:

股票期权交易100问(六)

编者按:行权,是股票期权业务不同于现货的重要特点之一。投资者持有的期权到期时,如果是实值期权,需要及时行权或平仓,才能真正获得收益。本期内容主要为投资者介绍什么是行权,如何行权,以及在行权过程中投资者需要注意哪些问题。

4.行权
73. 什么是行权?
行权是指期权的买方行使期权合约赋予的权利。期权的买方可以在合同约定的时间以约定的行权价格买入或者卖出相应数量的合约标的。对于到期没有行权的合约,将会丧失全部价值。

74. 期权合约买方决定行权,那么买方有哪些权利?
期权合约的买方决定行权,可以在合同约定的时间以约定的行权价格买入或者卖出相应数量的合约标的。如果行权方持有的是认购期权,则享有以约定的行权价格买入相应数量的合约标的的权利;如果行权方持有的是认沽期权,则享有以约定的行权价格卖出相应数量的合约标的的权利。

75. 期权卖方应当承担哪些义务?
期权卖方有义务以合同约定的行权价卖出或者买入相应数量的合约标的。如果被行权方持有认购期权义务仓,则应当准备好相应数量的合约标的;如果被行权方持有认沽期权义务仓,则应当准备好相

证券代码	基金简称
159920	恒生ETF
160125	南方中国
160416	华安石油
160717	恒生H股
160719	嘉实黄金
161116	易基黄金
161210	国投新兴
161714	招商金砖
161815	银华通胀
162411	华宝油气
164701	添富贵金
164815	工银资源
165510	信诚四国

应的资金。

76. 什么是行权价格?
行权价格,是指期权合约规定的、在期权买方行权时买入、卖出合约标的的交易价格。

77. 什么是行权价格间距?
行权价格间距,是指基于同一合约标的的期权合约相邻行权价格的差值。上交所股票期权行权价格间距按下表设置:

行权价格(元)	间距(元)	行权价格(元)	间距(元)
30元以下	0.05	20至50(含)	1
3至5(含)	0.1	50至100(含)	2.5
5至10(含)	0.25	100以上	5
10至20(含)	0.5		

78. 什么是到期月份?
到期月份,是指期权合约期限届满的月份,包括当月、下月以及随后两个连续季月。

79. 期权合约买方如何进行行权申报?
期权合约的买方行权的,应在期权行权日的9:15至9:25、9:30至11:30、13:00至15:30委托期权经营机构进行行权申报,或者通过期权经营机构为客户提供协议行权服务,根据协议规定的行权触发条件、行权数量等事项进行自动行权申报。

80. 期权合约买方申报行权时应注意哪些事项?
期权合约买方申报行权,应当确保其相应账户在规定时间内有足额合约、

165513 信诚商品

3.问:跨境ETF、跨境LOF T+0交易有次数限制?
答:跨境ETF、跨境LOF T+0交易没有次数限制。

4.问:限售股东如持有实物股票或证券登记证书是否可以办理解除限售?
答:原则上不可以。根据《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司限售股份登记存管业务指南(2011年修订)》的规定,上市公司须核查股东是否持有实物股票(含证券登记证书);如有,须收回并提交中国证券深圳分公司,同时提起《上市公司注销实物股票申

请》;如实物股票已遗失,股东还须在中国证监会指定披露报刊刊登实物股票遗失作废声明;因实物股票冻结等原因导致实物股票无法注销的,只可申请对实物股票对应的股份一次性全部解除限售,并申报托管在虚拟托管单元“XXXXXX”上。

5.问:已解除限售的深市上市公司限售股份,尚未托管到证券公司的交易单元,应如何办理手续才能进行交易?
答:股东如未指定有效托管单元,需委托上市公司向中国结算深圳分公司申请股份指定托管单元业务。所需材料如下:股东提交书面申请及身份证明材料;

交易日的次一交易日进行除权、除息的,期权合约最后交易日顺延至合约标的除权、除息日,期权合约于当日到期并进行行权。

(3)因合约标的被暂停上市、终止上市,该合约品种所有未平仓合约提前至合约标的被实施暂停或者终止上市前的最后交易日的前一交易日到期并进行行权。

(4)期权合约最后交易日,上交所对该合约采取暂时停止交易或者临时停牌措施,且当日未恢复交易的,期权合约最后交易日顺延至期权合约恢复交易首日,期权合约于当日到期并进行行权。

(5)期权合约最后交易日,上交所对该合约当日交易采取取消交易措施,期权合约最后交易日顺延至次一交易日,期权合约于当日到期并进行行权。

(6)上交所所认为应当顺延的其他情形。

依据上述规定,期权合约最后交易日、到期日、行权日顺延的,在实际行权日之前接受的行权申报按无效申报处理。

83. 期权合约的交收日是怎么规定的?
期权合约行权交收日为行权日的次一交易日。

84. 期权合约行权中,以现金结算方式进行行权交割的特殊情形有哪些?
期权合约行权中出现以下情形之一的,对相应合约按照上交所公布的行

理解除股份限售手续的,中国结算深圳分公司于该限售股份上市日的前一交易日收市后将已解除限售股份数据发送至各托管券商,投资者可于股份上市日起查询。

7.问:深市上市公司股东如何查询其限售股份的上市日期?
答:根据《股权分置改革工作备忘录第16号—解除限售》规定:上市公司董事会应在解除股份限售前三个交易日内刊登解除股份限售的提示性公告。投资者可通过深交所网站:www.szse.cn、巨潮资讯网:www.cninfo.com.cn等查询该上市公司公告。

上市公司提交指定托管单元申请表、企业营业执照副本复印件、法定代表人证明书、法定代表人身份证明文件、授权委托书及经办人身份证明文件。股份存在质押、冻结情况的,则不能办理。

6.问:持有深市上市公司限售股份的股东何时能在托管券商的交易账户上看到其解限的股份?
答:持有上市公司限售股份的股东应当关注限售股份的限售期,当限售期满时,相关股东应委托上市公司董事会向深交所及中国结算深圳分公司提出对其所持有的限售股份解除限售的申请。上市公司董事会为股东办

理解除股份限售手续的,中国结算深圳分公司于该限售股份上市日的前一交易日收市后将已解除限售股份数据发送至各托管券商,投资者可于股份上市日起查询。

7.问:深市上市公司股东如何查询其限售股份的上市日期?
答:根据《股权分置改革工作备忘录第16号—解除限售》规定:上市公司董事会应在解除股份限售前三个交易日内刊登解除股份限售的提示性公告。投资者可通过深交所网站:www.szse.cn、巨潮资讯网:www.cninfo.com.cn等查询该上市公司公告。

现金结算价格,以现金结算方式进行行权交割:

(1) 期权合约行权日遇合约标的全天停牌、临时停牌直至收盘,投资者对其持有的实值认沽期权提交行权申报的,中国结算对因合约标的不足未通过有效性检查的行权申报,按照上交所公布的行权现金结算价格,以现金结算方式进行行权交割。

(2) 期权合约交收日遇合约标的全天停牌、临时停牌直至收盘,对于行权交割中应交付的合约标的不足部分:

(3) 出现《交易规则》第八十条规定的异常情形,或者上交所认为有必要的。

除上述情形之外,对于行权交割中应交付的合约标的不足部分,按照中国结算公布的价格,以现金结算方式进行行权交割。

85. 股票期权行权的现金结算价格是怎么确定的?
期权合约标的为交易所交易基金的,行权现金结算价格的计算公式为:行权现金结算价格=交易所交易基金前一交易日的单位净值X(1+对应指数当日涨跌幅)。

前款规定的公式中,对应指数当日涨幅取正值,当日跌幅取负值。

86. 投资者的备兑开仓证券被提前用于行权交割的情形是怎样的?
投资者在行权交割中出现应交付的合约标的不足,其合约账户持有未到期备兑开仓的,相应备兑证券将被用于当日的行权交割。由此造成的备兑证券

不足部分,应于次一交易日规定时间内补足,否则将面临被强行平仓的风险。

期权经营机构应当及时通知客户补足相应备兑证券。

87. 投资者出现违约的,是否应支付违约金?
投资者出现行权资金交收违约、行权证券交割违约的,期权经营机构有权按照期权经纪合同约定的标准向其收取相应违约金。

88. 期权合约到期前,期权经营机构是否会提醒投资者?
期权经营机构应当在合约到期日前的3个交易日内,以网络、电话、短信或者与客户约定的其他方式,逐日提醒客户妥善处理期权交易持仓,并对提醒情况进行记录。

89. 关于期权经营机构协议行权服务是怎样规定的?
期权经营机构为客户提供协议行权服务的,应当在期权经纪合同中,详细约定协议行权的触发条件、行权数量等事项、各自权利义务以及风险提示内容,并对该项服务的实际操作流程进行记录。

免责声明:本栏目刊载的信息仅作为投资者了解股票期权业务的参考资料,关于股票期权业务的具体规定请以上交所官方网站(www.sse.com.cn)发布的相关业务规则为准。同时,上述内容仅为投资者教育之目的而发布,不构成任何投资建议,投资者不应以该等信息取代其独立判断或仅根据该等信息做出决策。