

关于结算银行开展港股通跨境资金结算业务有关事项的通知

各港股通跨境资金结算银行：

根据《沪港股票市场交易互联互通机制试点登记、存管、结算业务实施细则》（以下简称“《实施细则》”）、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“本公司”）及其上海分公司相关业务规则，现就港股通换汇、资金划拨等跨境资金结算业务有关事项通知如下：

一、港股通跨境资金结算业务分为两类：一是交易、非交易类资金及相关税费的换汇与资金划付业务；二是与香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）进行的交易及风控等业务的资金交收。

二、结算银行须经本公司批准获得港股通跨境资金结算业务资格（以下简称“港股通结算银行”）后，方能开展相关业务。其中，资金划拨业务通过港股通结算银行上海及香港分支机构办理，换汇业务通过港股通结算银行香港分支机构办理，与香港结算进行的资金交收等业务通过本公司指定的港股通结算银行香港分支机构办理。

三、为确保港股通换汇业务平稳开展，本公司对港股通换汇业务实施试运行，期限为三个月。试运行期间，本公司在港股通结算银行内均分每日换汇份额，相关银行须按本公司有关

换汇要求提供换汇服务。

本公司将对港股通结算银行汇率报价进行事后监督，并可根据需要公布各港股通结算银行汇率报价。本公司保留对报价明显偏离市场价格的银行采取下调份额等措施的权利。

本公司对港股通结算银行换汇、资金划拨等跨境结算的业务要求见本通知附件。

三个月试运行期后，本公司将对换汇情况进行评估，制订相关业务指引。

四、本公司授权本公司上海分公司进行港股通跨境资金结算业务日常管理。港股通结算银行上海、香港分支机构须与本公司上海分公司就港股通换汇、资金划拨等跨境资金结算业务签订相关业务备忘。

特此通知。

附件：中国证券登记结算有限责任公司港股通跨境资金结算业务管理要求

中国证券登记结算有限责任公司

二〇一四年十一月十日

附件：

中国证券登记结算有限责任公司 港股通跨境资金结算业务管理要求

根据《沪港股票市场交易互联互通机制试点登记、存管、结算业务实施细则》（以下简称“《实施细则》”）、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“本公司”）及上海分公司相关业务规则，就港股通跨境资金结算业务安排制定本要求。

本公司授权上海分公司进行港股通跨境资金结算业务的日常管理。

一、交易类资金换汇安排

自港股通业务开展起的三个月内，本公司对港股通交易类资金换汇业务实施试运行管理。试运行期间，各港股通换汇银行（含指定开户银行）平均分配每个港股通工作日¹（以下简称“T日”）包含交易清算净额与相关税费的交易类资金全部换汇份额。换汇银行于T-1日向本公司提供参考汇率²，T日日终提供日终结算汇率报价，T+2日按T日报价与相应份额完成交易类资金换汇及划付。

本公司将对港股通结算银行日终结算汇率报价进行事后监督，并可根据需要向市场公布银行报价信息。对于报价明显偏离市场水平的银行，本公司保留对其采取下调份额等措施的权利。

（一）换汇份额确认

¹ 港股通工作日指港股通交易日或港股通交收日。

² 汇率报价精确到小数点第四位，最小报价单位为一个基点，即0.0001。

本公司在业务正式开展前通过指定电子邮箱等方式向各银行提供换汇安排确认表（具体格式附后）。收到确认表后，换汇银行及时确认结果，签字盖章后邮件反馈，相关确认文本递交本公司。

（二）参考汇率的确定

T-1 日 17:45 前，本公司通过指定电子邮箱等方式向换汇银行提供 T 日双边参考汇率。换汇银行确认后，于 18:00 前通过指定电子邮箱等方式反馈港股通参考汇率确认表（具体格式附后）。其中，双边参考汇率为 17:30 离岸市场港币对人民币汇率中间价³±3%。该参考汇率通过上海证券交易所（以下简称“上交所”）对市场公布，作为 T 日全市场投资者的换汇参考价。

如遇离岸人民币市场在 17:30 后发生巨幅波动，换汇银行应及时通知本公司，由本公司协调，修改参考汇率，并通过上交所对市场公布最新参考汇率。

（三）日终结算汇率报价的确定

1. T 日日间，在收到上交所发送的相关交易数据后，本公司将通过指定电子邮箱等方式提供各换汇银行不少于 3 次的当日港股通累计买入成交金额（港币）和累计卖出成交金额（港币）数据。换汇银行可据此作为换汇参考。

换汇银行须建立相关保密机制，确保上述数据仅用作换汇参考。

2. T 日收到上交所发送的截至 16:15 的相关交易数据后，本公司通过指定电子邮箱等方式向各换汇银行提供当日累计买入成交金额

³ 本要求中，离岸市场港币对人民币中间价为报价时点路透资讯系统显示的买入价与卖出价的平均值。买入价、卖出价均为银行角度，即银行买入、卖出港币的汇率报价。

(港币)、当日累计卖出成交金额(港币)、当日交易净额(港币)及根据交易净额匡算的税费⁴。

3. 换汇银行须通过指定电子邮箱等方式于收到本公司发送的交易信息数据后 5 分钟内向本公司提供日终单边结算汇率报价。报价须合理,不偏离市场情况,并在当日参考汇率范围内。如因 T 日日间离岸市场大幅波动导致日终结算汇率报价超过参考汇率范围的,双方可协商后确定。

4. T 日清算完成后,本公司通过指定电子邮箱等方式向换汇银行提供港股通日终结算汇率报价表(包含交易清算净额与交易税费在内的换汇金额等数据,具体格式附后)。换汇银行签字确认后反馈本公司。

5. 特殊情况的处理

(1) 如因香港联合交易所有限公司(以下简称“联交所”)或香港中央结算有限公司(以下简称“香港结算”)数据调整导致 T 日港股通换汇金额发生调整,且调整幅度不超过 T 日提供的换汇金额的 1%,本公司按调整后数据向换汇银行发送港股通日终结算汇率报价表。各换汇银行确认后,按其换汇份额,以 T 日日终结算汇率于 T+2 日完成调整后换汇金额的换汇。

若调整金额超过换汇金额的 1%,本公司与各换汇银行就适用汇率另行协商。

(2) 如无法在 17:30 分前完成 T 日港股通交易清算并计算换汇

⁴ 仅作参考,换汇金额以日终清算结果为准。

金额，本公司将通过 16:15 从上交所获得的交易数据，匡算相关税费，告知各换汇银行进行换汇安排。当晚港股通清算完成后，本公司及时将最新港股通换汇金额告知各换汇银行。

（四）资金交割

T+2 日，换汇银行应按 T 日与本公司确定的日终结算汇率和换汇金额进行换汇资金交割。

二、交易类资金划付

（一）T 日交易资金清算净额为本公司应付香港结算

1. T+2 日 10:30，本公司完成港股通业务相关资金交收后，向换汇银行上海分支机构发送资金划拨指令，将相关人民币资金汇划至本公司开立在其香港分支机构的账户。

2. 换汇银行上海及香港分支机构须互相协调确保相关人民币资金自本公司指令发出后及时到账，并通知本公司。

3. 换汇银行香港分支机构须于 17:00 前按 T 日确定的结算汇率和换汇金额完成 T 日换汇交易的资金交割，并根据本公司的资金划拨指令将港币资金汇划至本公司开立在指定开户银行香港分支机构的相关账户，与指定开户银行香港分支机构协调确认资金到账。指定开户银行香港分支机构须及时检查各换汇银行所有港币资金是否全额到账。若发现问题，应立即协调相关换汇银行解决问题，并告知本公司。

4. 18:00，指定开户银行香港分支机构完成资金交收。

5. 若因个别换汇银行资金划付等问题导致指定开户银行香港分支机构未于 18:00 前全额收妥本公司应付香港结算款项，指定开户银

行香港分支机构应暂不向香港结算发送拒付指令，及时通知本公司并启动授信安排。相关问题由本公司协调解决。

（二）T 日交易资金清算净额为本公司应收香港结算

1. T+2 日，换汇银行根据本公司于日间向其香港分支机构发送的人民币资金划付指令，于 17:00 前在其授信额度范围内将人民币资金划入本公司上海分公司在其上海分支机构开立的账户。

2. 换汇银行上海分支机构应在 17:30 前检查资金是否到账。若发现问题，应及时协调解决，并告知本公司。

3. 18:00 至 18:30 间，指定开户银行香港分支机构根据本公司的资金划拨指令，通过香港银行间的港币 RTGS 清算系统完成资金划拨，并与各换汇银行香港分支机构做好资金划拨指令的协调，确保当日按其换汇额度获取港币实头寸。

三、 非交易类资金换汇及资金划付

非交易类资金指公司行为类业务资金、非交易过户等业务产生的印花税等资金。相关资金换汇汇率通过港股通非交易类资金换汇报价表（具体格式附后）进行确定。

（一）现金红利、公司收购款及非交易过户印花税的换汇及资金划付

对于现金红利、公司收购款的换汇，本公司于换汇当日 10:30 提交换汇需求，并与指定开户银行香港分支机构协商确认 T+0 交割的换汇汇率。完成换汇后，指定开户银行应根据本公司的资金划拨指令，及时将换汇所得人民币资金划入本公司上海分公司开立在其上海分

支机构的账户。相关资金须于当日 15:00 前到账。

对于非交易过户等业务产生的印花税，本公司在确认境内人民币账户收妥相关税款后，于 10:30 提交换汇需求，与指定开户银行香港分支机构协商确认 T+0 交割的换汇汇率。同时，指定开户银行上海分支机构根据本公司的资金划拨指令，将相关资金划拨至其香港分支机构。相关资金须于当日 15:00 前到账。

（二）涉及供股/公开配售的换汇及资金划付

对于供股/公开配售产生的换汇需求，本公司在换汇日 10:30 提交换汇需求，与指定开户银行香港分支机构协商确定 T+1 交割的换汇汇率。

换汇日下一港股通工作日 11:00 前，本公司将相应人民币款项通过指定开户银行上海分支机构汇划至本公司开立在其香港分支机构的账户。16:00 前，指定开户银行香港分支机构完成换汇，并于香港结算规定时点完成相应资金交收。

（三）其他单笔换汇

因特殊原因导致的换汇需求，本公司协商指定开户银行香港分支机构进行换汇处理。

四、 风控资金划拨

风控资金划拨包括本公司净应付香港结算与净应收香港结算两类，具体如下：

（一）本公司净应付香港结算

1. 风控资金交收日 10:30，本公司完成港股通第一批次资金交

收后，向指定开户银行上海分支机构发送资金划拨指令，将相关人民币资金汇划至本公司开立在其香港分支机构的账户。

2. 指定开户银行香港分支机构应在 15:00 前检查资金是否到账。若发现问题，应及时协调解决，并告知本公司。

3. 指定开户银行香港分支机构根据香港结算指令，完成风控应付资金的交收。

（二）本公司净应收香港结算

1. 风控资金交收日，指定开户银行香港分支机构根据本公司于日间发送的资金划付指令，于 17:00 前在双方约定的授信额度范围内将人民币资金汇划至本公司上海分公司开立在指定开户银行上海分支机构的账户。

2. 指定开户银行香港分支机构根据香港结算指令，完成风控应收资金的交收。

五、其他

（一）如遇 8 号风球或黑色暴雨天气，换汇银行香港及上海分支机构仍须根据要求按时向本公司提供参考汇率，并根据本公司指令及时办理相关资金划付。

（二）如本公司与港股通结算银行上海及香港分支机构间发生通讯故障，港股通结算银行应及时查明原因并妥善解决，确保本公司相关账户查询、资金划付的正常进行。

（三）对于与本公司进行港股通跨境资金结算业务过程中接触到的任何非公开信息，包括但不限于资金结算账户、结算资金、换汇安排

等方面的信息，除依法向有权机关披露外，港股通结算银行均应严守秘密，保证其及其相关业务人员不以任何方式向任何无关的第三人披露。

（四） 本通知未明确事项，按照《港股通资金结算业务备忘录》及本公司其他相关规则办理。

文档一：港股通业务换汇安排确认表

港股通业务换汇安排确认表

换 汇 安 排	
银行名称	
适用时间	
换汇货币	换汇份额占比
	百分之_____（大写）
备注： 公司签章 _____年____月____日	
银 行 信 息 确 认	
经确认，贵公司换汇工作安排信息无误。我行承诺在_____年____月____日至_____年____月____日承担每个港股通交易日交易及相关税费全部换汇份额的百分之_____（大写）。	
备注： 银行签章 _____年____月____日	

文档二：港股通参考汇率确认表

港股通参考汇率确认表

报价时间	_____年____月____日____时____分		
银行名称		适用日期	_____年____月____日
换汇货币		市场中间价	
银行买入价		银行卖出价	
备注： 银行签章 _____年____月____日			
填表说明： 本表汇率指港币对人民币汇率，最小报价单位为一个基点。			

文档三：港股通日终结算汇率报价表

港股通日终结算汇率报价表

银行名称			
换汇日期	____年__月__日	交割日期	____年__月__日
交易方向	交易净额应____	中国结算 换汇方向	卖出____买入____
换汇金额			
币种	港币	币种	人民币
金额（小写）		金额（小写）	
金额（大写）		金额（大写）	
银行换汇方向	卖出____买入____	日终结算汇率报价	
银行签章 ____年__月__日			
填表说明： 1、本表汇率指港币对人民币汇率，最小报价单位为一个基点； 2、本表中报价均站在银行角度，即银行买入、卖出港币的汇率报价； 3、换汇方向栏填写币种，如人民币、港币。			

文档四：港股通非交易类资金换汇报价表

港股通非交易类资金换汇报价表

中国结算换汇需求			
换汇时间	_____年____月____日____时____分		
交割日期	_____年____月____日	中国结算 换汇方向	卖出____买入____
换汇金额 (港币小写)		换汇金额 (港币大写)	
备注			
银行换汇报价			
银行名称			
报价时间	_____年____月____日____时____分		
银行换汇方向	卖出____买入____	汇率报价	
换汇金额			
币种	港币	币种	人民币
金额（小写）		金额（小写）	
金额（大写）		金额（大写）	
备注			
银行签章 _____年____月____日			
填表说明： 1、本表汇率指港币对人民币汇率，最小报价单位为一个基点； 2、本表中报价均站在银行角度，即银行买入、卖出港币的汇率报价； 3、换汇方向栏填写币种，如人民币、港币。			