

关于《上市公司现金选择权业务指南》新增附终止条件的现金选择权业务的通知

深市各上市公司、结算参与人：

关于对深市上市公司派发现金选择权的登记结算服务及对 B 股公司该类服务的特别要点，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“本公司”）分别在 2011 年发布的《上市公司现金选择权业务指南》和 2012 年发布的《关于 B 股现金选择权的补充通知》中阐明。为满足近期上市公司派发附终止条件的现金选择权的需求，本公司新增“附终止条件的现金选择权”登记结算服务，有关事项通知如下：

一、附终止条件现金选择权的特点

“附终止条件的现金选择权”是一类特殊的现金选择权，上市公司或第三方在拟实施的现金选择权方案附加终止条件。如投资者行权申报量达到终止条件，则公司行为终止，所有行权申报不交收；如行权申报量未达到终止条件，公司行为继续实施，所有行权申报在上市公司指定日期清算交收。

该类现金选择权在派发登记、行权申报、注销和收费同普通现金选择权，详见《上市公司现金选择权业务指南》和《关于 B 股现金选择权的补充通知》，只在行权的清算交收环节和上市公司缴纳的初始行权履约保证金的计算标准这两个方面不同。

二、附终止条件现金选择权的行权清算交收

（一）通过交易所系统申报行权的清算交收

通过交易所系统申报的行权指令，清算交收按申报期和清算交

收期两阶段进行：

1、申报期

投资者可在行权申报期内任一交易日(以下简称“T日”)通过证券公司向交易所系统申报行权,投资者需确保其账户内有足额可用的现金选择权和标的证券。

本公司在T日日终对当日所有行权申报进行有效性检查,内容包括账户的有效性、账户内可用的现金选择权和标的证券是否足额等。通过有效性检查的,对应账户内可用于行权申报的现金选择权和标的证券的余额将被记减。本公司在行权申报期不作行权的清算交收处理,也不作行权标的证券的交收锁定。

在申报期结束后,上市公司根据累计有效的行权申报数量和事先预定的终止条件,判断是否终止公司行为,并公告。如终止,申报期所有的行权申报都不做交收处理。如要继续实施的,则进入“清算交收期”。

2、清算交收期

在上市公司公告的行权清算日,本公司对申报期的有效行权指令进行清算,并将清算结果通知上市公司和结算参与人。上市公司需在次一交易日16:00前向其行权专用资金交收账户汇入足额资金,以完成上述行权申报的交收。

本公司在清算日的次一交易日16:00点,根据清算结果,按行权申报的时间顺序,进行逐笔全额非担保交收。

对于B股的附终止条件现金选择权,行权清算时使用的汇率中间价为清算当日中国人民银行发布的汇率中间价,同普通B股现金选择权,详见《关于B股现金选择权的补充通知》。

（二）通过手工方式申报行权的清算交收

通过手工方式申报的行权指令，待上市公司确认继续实施后，上市公司将向本公司申请划拨相关行权标的证券，行权资金交收由上市公司和投资者在场外办理。

三、附终止条件现金选择权的初始行权履约保证金计算标准

上市公司在刊登附终止条件现金选择权实施公告之前，必须向本公司提交初始行权履约保证金。

初始行权履约保证金计算标准原则上同普通现金选择权，详见《上市公司现金选择权业务指南》，但如果初始行权履约保证金超过附终止条件的现金选择权行权所需最大资金，则以行权所需最大资金为初始行权履约保证金。

为确保该业务的顺利开展，请各证券公司及相关单位于 2013 年 4 月 29 日之前完成“附终止条件现金选择权”业务相关技术系统的上线工作。

特此通知

二 一三年四月二十二日