UF20新股市值申购业务指引

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **版本编号** | **变更说明(变更内容、变更位置、变更原因和变更范围)** | **变更日期** | **变更人** | **审核人** |
| **1** | **1.0** | **创建，全页** | **2013-12-31** | **方文燕** | **陈辉苗** |
| **2** | **1.0** | **修订UF20版本** | **2014-02-14** | **王权英** | **张勋** |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

目录

[UF20新股市值申购业务指引 1](#_Toc380412487)

[一. 业务概述 2](#_Toc380412488)

[二. 业务规则 2](#_Toc380412489)

[三. 业务开展前的准备工作 3](#_Toc380412490)

[3.1 证券模板和代码信息 3](#_Toc380412491)

[3.2 系统配置参数 4](#_Toc380412492)

[3.3 日终清算文件 5](#_Toc380412493)

[四. 日间业务流程 5](#_Toc380412494)

[五. 日终流程 6](#_Toc380412495)

[4.1 可申购额度返回（T-1日） 6](#_Toc380412496)

[4.2 申购（T日） 6](#_Toc380412497)

[4.3 配号（T+1日） 7](#_Toc380412498)

[4.4 中签（T+2日） 8](#_Toc380412499)

[4.5 新股入账（T+N日） 8](#_Toc380412500)

# 业务概述

新股申购是指首次公开发行股票(英文翻译成Initial Public Offerings，简称[IPO](http://baike.baidu.com/view/7497.htm" \t "_blank))，是指[企业](http://baike.baidu.com/view/38340.htm" \t "_blank)通过[证券交易所](http://baike.baidu.com/view/10107.htm" \t "_blank)首次公开向投资者发行股票，以期募集用于企业发展[资金](http://baike.baidu.com/view/92610.htm" \t "_blank)的过程。

# 业务规则

新股申购一般分为上网定价和上网竞价两种申购模式，目前上海和深圳基本上采用上网定价发行模式。

* 传统的上网定价发行

上网定价发行是指主承销商利用证券交易所的交易系统，由主承销商作为股票的唯一“卖方”，投资者在指定的时间内，按现行委托买入股票的方式进行股票申购。主承销商在上网定价发行前应在证券交易所设立股票发行专户和申购资金专户。申购结束后，根据实际到位资金，由证券交易所主机确认有效申购。

投资者应在申购委托前把申购款全额存入与办理该次发行的证券交易所联网的证券营业部指定的帐户。上网申购期内，投资者按委托买入股票的方式，以发行价格，填写委托单。一经申报，不得撤单。

各证券营业部在申购日不得接受投资者的现金申购委托。

上海每一帐户申购委托不少于1000股。超过1000股的必须是1000股的整数倍。

深圳每一帐户申购委托不少于500股。超过500股的必须是500股的整数倍。

每一股票帐户申购股票数量上限为发行公告为准公布。

* 新的上网定价发行

本次IPO重启后，投资者参与上网定价发行时，账户上必须有参与申购的市值额度。投资者可参与申购的市值额度由登记公司计算，通过结算文件发给券商，由券商系统清算到系统。新股市值申购的具体规则如下：

1、登记公司计算投资者市值时是以投资者为单位进行计算的，即投资者如果有多个证券帐号的，是把多个证券帐号的市值合并计算。

2、登记公司计算投资者市值时沪深两个市场分开计算。

3、投资者相关证券账户市值为其T-2 日日终持有的A股市值。T-1日通过结算文件返回。

4、上海纳入计算的市值是投资者持有的上海市场非限售A股股份市值包括融资融券客户信用证券账户的市值和证券公司转融通担保证券明细账户的市值，投资者持有的ETF、封闭式基金、B股股份、债券以及将来持有的优先股的市值，不计入该投资者用于申购沪市新股的持有市值中。

5、深圳纳入计算的市值是投资者持有的深圳市场（包括主板、中小板和创业板）非限售A股股份市值，包括融资融券客户信用证券账户的市值和证券公司转融通担保证券明细账户的市值，不包括B股股份、基金、债券或其他限售A股股份的市值。

6、不合格证券帐号不计算证券市值。

7、上海市场计算可申购额度是以10000元市值为一个单位，每一个申购单位为1000；深圳市场计算可申购额度是以5000元市值为一个单位，每一个申购单位为500。

8、投资者参与网上市值申购时，只能使用一个证券帐号，同一投资者使用多个证券账户参与同一只新股申购的，以及投资者使用同一证券账户多次参与同一只新股申购的，以该投资者的第一笔申购为有效申购，其余申购均为无效申购。

9、申购委托申报以后，不允许撤单。

10、上海的信用账号不能进行新股申购，深圳的信用账号可以进行新股申购。

11、同一个交易日，如果有多个新股代码，市值额度可以重复使用。

# 业务开展前的准备工作

新股市值申购业务开展前柜台系统必须升级到2013SP0pack3patch1补丁29及以上版本。

在业务正式开展前请进行如下参数检查：

### 3.1 证券模板和代码信息

通过【系统】-【证券代码参数】-【证券模板设置】和【证券代码设置】菜单检查模板参数代码信息，其中上海和深圳的新股申购代码信息如下：

申购代码 回款代码 配号代码 中签代码 上市代码

上海 730\*\*\* 740\*\*\* 741\*\*\* 730\*\*\* 600\*\*\*

上海 780\*\*\* 790\*\*\* 791\*\*\* 780\*\*\* 601\*\*\*

上海 732\*\*\* 732\*\*\* 734\*\*\* 736\*\*\* 603\*\*\*

深圳 000\*\*\* 000\*\*\* 000\*\*\* 000\*\*\* 000\*\*\*

深圳 002\*\*\* 002\*\*\* 002\*\*\* 002\*\*\* 002\*\*\*

深圳 300\*\*\* 300\*\*\* 300\*\*\* 300\*\*\* 300\*\*\*

1）、深圳在整个新股申购期间到上市后代码均不变，通过申购期（普通申购）和上市后（股票）的股票类别不同进行区分。

2）、行情服务器根据股票模板转入上海的780\*\*\*/ 730\*\*\*/732\*\*\*代码类别为‘普通申购’，790\*\*\*/740\*\*\*/734\*\*\*为‘申购回款’，791\*\*\*/741\*\*\*/736\*\*\*为‘申购配号’；深圳根据sjsxx中的xxjyzt为‘F’或‘I’－证券上网定价转入002\*\*\*/ 000\*\*\*/300\*\*\*代码的类别为‘4－普通申购’。

3）、新股申购委托时，不允许超过主承销商公布的申购上限，深圳的新股申购代码根据sjsxx库中对应的XXMBXL自动转入到系统证券代码的交易最高数量中，如信息库中没有限制，则可手工进行设置或由交易所系统进行控制。

上海通过对应证券类别的上限99999000转入，根据具体申购代码公布的申购上限手工修改【系统】-【证券代码参数】-【证券代码设置】菜单中的交易最高数量或由交易所进行控制。

4）、因上海启用新股市值申购以后，可能还会存在老模式的新股申购模式，证券代码表中通过“证券子类”是否为“4市值申购”来控制该代码是否进行市值申购，申购日行情转入时证券子类默认转为“4市值申购”。

### 3.2 系统配置参数

1118－普通申购柜台允许重复申购，0 - 不允许（默认）；1 - 允许。特别注意国债分销I、LOF申购K、ETF认购M、ETF申购N等业务不受此开关控制，因为这些申购业务规则允许同日多次申购。

### 3.3 日终清算文件

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **市场** | **文件** | **包含内容** | **文件类型** | **文件子类** |
| **上海** | Zqy | 市值额度 | 结算 | 6上海ZQY |
| Gh | 申购、中签、返款数据 | 结算 | 1上海GH |
| Zqbd | 新股上市余额 | 结算 | 100 上海ZQBD |
| **深圳** | Sjsks | 市值额度 | 结算 | 140 深圳SJSKS |
| Sjsfx | 申购、中签、返款数据 | 结算 | 30 深圳SJSFX |
| Sjsgf | 新股上市余额 | 结算 | 1. 深圳SJSGF |

# 日间业务流程

新股市值申购日投资者通过周边的普通委托或者柜台的普通委托菜单进行下单，委托要素如下：

委托代码：上海市场为730\*\*\*/780\*\*\*；深圳市场为002\*\*\*/300\*\*\*；

委托数量：上海市场为1000的整倍数；深圳市场为500的整倍数；

委托下单时系统根据证券代码表中“证券子类”是否为“4市值申购”判断该代码是否进行市值申购，如为“4市值申购”，系统自动校验投资者账户上的市值可申购额度和可用资金。委托确认后写入entrust表，通过普通报盘机写入接口库。

委托时可申购额度不进行冻结，即申购当日如有多个申购代码，可申购额度可以多次使用，申购的额度都是相同的。

注：

1. 周边301接口中返回的可买数量是可申购额度和按照客户资金计算出来的可买数量两者的小值。
2. 周边300接口中，当输入参数中的传入资产帐号、交易类别，且委托属性为3申购，后台会返回该客户的市值可申购额度。
3. 系统目前支持代理申购功能，当投资者证券帐号上有K代理申购权限时，可以通过【证券】-【代理委托】-【代理申购】菜单进行批量下单。
4. 当投资者账户上的可申购额度、按照可用资金计算出的可买数量都高于该申购代码的申购上限时，如果证券代码设置中的交易最高数量未进行申购上限控制，投资者的申购委托可以申报到交易所，但是超过申购上限部分是无效的。

# 日终流程

### 4.1 可申购额度返回（T-1日）

* **交易所数据**

上海zqy文件

深圳sjsks文件，ksywlb为A9

* **上海**

处理zqy文件，匹配股东账号表，当zqy文件返回记录的股东账号在后台存在，结算转入时转入到unpreclear表中，在结算入账的时候会把该条记录由unpreclear插入到后台的额度表hs\_secu.secusubequity以及hs\_crdt.crdtsubequity中，否则前台会自动过滤该条记录。

* **深圳**

处理sjsks文件，匹配股东账号表，当sjsks文件返回记录的股东帐号在后台存在，结算转入时转入到unpreclear表中，在结算入账时会把该条记录由unpreclear插入到后台的额度表hs\_secu.secusubequity以及hs\_crdt.crdtsubequity中，否则前台会自动过滤该条记录。

### 4.2 申购（T日）

* **交易所数据**

上海gh文件

深圳sjsfx文件，fxywlb为A0的申购扣款记录，A1为无效申购记录

* **上海**

处理gh文件，与entrust表配对，清算后扣减投资者上的资金，增加申购代码持仓（740\*\*\*/790\*\*\*），产生资金变动流水、证券变动流水和交割流水，业务标志为4034‘新股申购’。同时记录在途表settunfinished，unfinished\_type = ‘7’。

* **深圳**

处理sjsfx文件（fxywlb为A0），与entrust表配对，清算后扣减投资者上的资金，增加申购代码持仓（002\*\*\*/300\*\*\*），产生资金变动流水、证券变动流水和交割流水，业务标志为4034‘新股申购’。同时记录在途表settunfinished，unfinished\_type = ‘7’。

对于无效申购记录，清算处理后，生成业务标志为4021‘申购返款’的资金证券变动流水。

### 4.3 配号（T+1日）

* **交易所数据**

上海gh文件

深圳sjsfx文件，fxywlb为A2的申购配号记录（FXWTGS=起始配号，FXQRGS=连续配号个数），A1为无效申购记录

* **上海**

处理gh文件的配号记录，匹配settunfinished表unfinished\_type为7申购的记录，清算后产生交割流水（配号不产生fundjour与stockjour，只记deliver），业务标志为4020‘申购配号’（流水中的证券代码为741\*\*\*/791\*\*\*），其中交割表中备注记录起始配号和配号数量。

对于无效申购记录，清算处理后，生成业务标志为4021‘申购返款’的资金证券变动流水。

* **深圳**

处理sjsfx文件（fxywlb为A2），匹配settunfinished表unfinished\_type为7申购的记录，清算后产生交割流水，业务标志为4020‘申购配号’（流水中的证券代码为002\*\*\*/300\*\*\*），其中交割表中备注记录起始配号和配号个数。

对于无效申购记录（sjsfx文件（fxywlb为A1）），清算处理后，生成业务标志为4021‘申购返款’的资金证券变动流水。

### 4.4 中签（T+2日）

* **交易所数据**

上海gh文件

深圳sjsfx文件，fxywlb为A3的申购中签记录，A6为申购返款记录

* **上海**

处理gh文件的中签返款记录，匹配settunfinished表unfinished\_type为7申购的记录，清算后产生资金变动、证券变动和交割流水，业务标志为4021‘申购返款’，对于中签客户，会同时产生业务标志为4022‘申购中签’的资金变动、证券变动和交割流水，并增加中签持仓（证券代码为730\*\*\*/780\*\*\*）。同时记录在途settunfinished表，unfinished\_type为‘3’。

* **深圳**

处理sjsfx文件（fxywlb为A3和A6），匹配settunfinished表unfinished\_type为7申购的记录，清算后产生资金变动、证券变动和交割流水，业务标志为4021‘申购返款’，对于中签客户，会同时产生业务标志为4022‘申购中签’的资金变动、证券变动和交割流水，并增加中签持仓（证券代码为002\*\*\*/300\*\*\*）。同时记录在途settunfinished表，unfinished\_type为‘3’。

### 4.5 新股入账（T+N日）

* **交易所数据**

上海zqbd文件，bdlx为00G

深圳sjsgf文件，gfywlb为01

* **上海**

处理zqbd文件，匹配settunfinished表中unfinished\_type为‘3’的记录，结算处理时删除中签代码持仓，结算入账时增加上市代码持仓，产生证券变动和交割流水，业务标志为4016‘新股入账’。

* **深圳**

处理sjsgf文件，匹配settunfinished表表中unfinished\_type为‘3’的记录，结算处理时删除中签代码持仓，结算入账时增加上市代码持仓，产生证券变动和交割流水，业务标志为4016‘新股入账’。