



深圳证券交易所向二级市场投资者定价配售新股实施办法

2004-5-24

根据证监发行字〔2000〕5号《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的通知》、证监发行字〔2002〕54号《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》及相关规定，制定本办法。本办法适用于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）采用市值配售方式向二级市场投资者定价发行新股，现说明如下：

一、配售发行

1. 市值计算

投资者持有上市流通股票的市值，是指按发行公告确定的交易日登记在投资者证券账户内的各已上市流通人民币普通股（即A股）的数量乘以该日各股票收盘价的总和，包括可流通但暂时锁定的股份的市值。如该日无收盘价，则依上一交易日的收盘价计算。

每持有1万元上市流通股票市值可申购1000股新股，不足1万元的部分不计入可申购市值。

深市投资者同一证券账户在不同营业部托管的上市流通股票市值合并计算。

中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）深圳分公司计算投资者持有的深圳市场（以下简称“深市”）上市流通股票的可申购市值，并于T-2日（T日为发行申购日）收市后向会员营业部发送。中国结算上海分公司、上海证券交易所（以下简称“上证所”）计算投资者持有的上海市场（以下简称“沪市”）上市流通股票的可申购数量，并于T-2日收市后向会员营业部发送。

2. 申购

两市投资者都可参加在深交所发行的新股的配售。配售时，分别使用其所持的深、沪两市的股票市值。投资者可依据其所持深市的股票市值，用深圳证券账户向深交所申购；并可同时依据其所持沪市的股票市值，用上海证券账户向上证所申购。

同一只新股的配售申购，两个交易所分别使用各自的申购代码。深交所配售代码为“002nnn”；上证所的配售代码为“739nnn”，后三位代码相同。

申购新股的数量最低为1000股，超过1000股的，应为1000股的整数倍。

除证券投资基金（包括开放式基金）持有的证券账户外，每个证券账户只能申购一次。超额申购和重复申购部分将被发行系统自动剔除。

基金可以以其持有的上市流通股票市值参与配售，基金持有的证券账户在深市按其所持市值上限一次性申购，在沪市可重复申购，但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。

投资者申购新股时，无需预先缴纳申购款。申购一经确认，不得撤消。

3. 配号

有效申购总量，即两所有效申购量之和经确认后，按以下办法配售新股：

- （1）当有效申购总量等于拟向二级市场投资者配售的总量时，按投资者的实际申购量配售；
- （2）当有效申购总量小于拟向二级市场投资者配售的总量时，按投资者实际申购量配售后，余额按照招股说明（意向）书所确定的方式处理；
- （3）当有效申购总量大于拟向二级市场投资者配售的总量时，中国结算深圳分公司、上证所按每1000股有效申购量配一个号的规则，对有效申购进行统一连续配号。

4. 摇号抽签

保荐机构（主承销商）于T+1日，根据总配号量组织统一摇号抽签。投资者每中签一个号配售新股1000股。会员营业部应于T+2日在营业场所的显著位置公布摇号中签结果。

5. 中签缴款

配售新股中签后，投资者应确保资金账户中有足够的新股认购资金。若中签投资者因资金不足无法足额认购中签股票时，深市会员营业部应于T+3日15:00前，将其放弃认购部分向深交所申报；沪市会员应于T+3日15:00前通过PROP向中国结算上海分公司申报。因资金不足而放弃认购的新股，由保荐机构（主承销商）包销。

投资者在中签后若想部分或全部放弃所中签的股票，必须就中签后放弃认购部分进行申报（深市投资者申报的证券代码为“002nnn”，委托价格为0，沪市投资者由沪市会员通过PROP向中国结算上海分公司申报，证券代码为“739nnn”），放弃认购的数量为实际放弃的数量（可以不是1000股的整数倍）。不作放弃认购申报，视同全部缴款认购。

6. 资金交收

中国结算于T+4日进行资金交收。两市投资者缴纳的新股认购资金，由中国结算深圳、上海分公司收取。新股认购资金扣除相关费用后集中由中国结算深圳分公司划付给保荐机构（主承销商）。

7. 其他事项

配售发行一般在正常交易时间内进行。

开户资料中缺少持有人姓名（名称）或者身份证号码（营业执照注册号码）的证券账户，不允许参加配售。

二、上市交易

1. 投资者以上海证券账户获得配售的新股只能委托上证所卖出，不能在上证所买入。需要卖出时，与卖出沪市其他证券一样，可委托会员营业部向上证所进行卖出申报，上证所接到卖出指令后向深交所进行转报，成交回报由深交所反馈给上证所，再发送至会员营业部。

2. 配售新股在深交所挂牌交易时，股票代码仍为“002nnn”。为便于沪市投资者卖出配售中签的股票，新股上市交易后，在上证所也挂出对应的代理股票代码，沪市的股票代码为“609nnn”，两市股票代码的后三位一致。

3. 配售发行的股票，不办理跨市场转托管。

4. 配售发行的股票，停牌遵照深交所相关规定。

5. 持上海证券账户的投资者对市值配售股票的卖出委托，经上证所系统转报，在深交所主机收到后方为有效。

6. 对按市值配售的股票，两市投资者在交易时，分别按照各自市场的收费标准缴纳相关交易、结算等费用。

三、登记结算

1. 中国结算深圳、上海分公司分别负责两市投资者在市值配售股票时获配新股的股份登记，并按照两市规则办理登记结算业务。

2. 两市同一市值配售股票的权益分派的股权登记日应保持一致。其他具体运作分别按两市规则执行。

3. 市值配售新股的持有人名册由中国结算深圳分公司统一提供。

附件：1. 深圳证券交易所向二级市场投资者定价配售新股操作程序

2. 深圳证券交易所向二级市场投资者定价配售新股操作实例

附件1： 深圳证券交易所向二级市场投资者定价配售新股操作程序

一、T-2日或之前刊登招股说明（意向）书

发行人披露新股发行价格、发行方式和拟上市证券交易所。

中国结算、证券交易所根据发行公告确定的交易日的收盘价，统计并发送各投资者分别持有的两市上市流通股票的市值。

二、T-1日或之前刊登发行公告

发行人及其保荐机构（主承销商）根据市场情况确定发行价格并公告。

三、T日投资者申购、配号

投资者按照其可申购新股的数量，自愿委托申购新股。

中国结算、交易所确认有效申购，剔除无效申购，并按有效申购量连续配号后，将配号结果传输给各证券营业部。

四、T+1日摇号抽签

证券营业部在营业场所的显著位置向投资者公布配号结果。

保荐机构（主承销商）在中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）指定报纸上公布中签率，并在公证机关的监督下组织摇号抽签。

证券交易所将中签号码分别传送中国结算深圳分公司和证券营业部。

五、T+2日公布中签结果

证券营业部在营业场所的显著位置公布抽签结果。

保荐机构（主承销商）在中国证监会指定报纸上公布抽签结果。

六、T+3日投资者缴款、放弃认购

证券营业部向中签投资者收取新股认购款，将股款集中划入中国结算的指定账户。中签投资者如放弃认购，需就放弃认购部分进行申报，不作放弃认购申报则视同全部缴款认购。若中签投资者认购资金不足，各证券营业部将只对其资金能够认购的部分进行配售，余者视同放弃认购并进行申报。

七、T+4日资金交收

中国结算根据中签结果及放弃认购情况扣收认购资金，新股认购资金扣除相关费用后集中由中国结算深圳分公司划至保荐机构（主承销商）指定的账户。

八、T+5日划款

保荐机构（主承销商）将募集资金划入发行人指定账户。

附件2： 深圳证券交易所向二级市场投资者定价配售新股操作实例

假设XX股份有限公司定于2004年某月15日（本例中的日期不考虑节假日），在深交所按市值配售方式上网定价发行A股，发行量为5000万股，申购上限5万股，发行价格为6.55元/股，该股上市后的交易代码为002999，简称为“XX股份”。投资者张三所持深圳证券账户号码为0087654321，所持上海证券账户号码为A123456789。

一、市值计算

2004年某月12日（T-3日）收市后，中国结算深圳、上海分公司分别计算投资者拥有A股的市值。经统计，投资者张三持深市可申购市值为68000元，持沪市可申购市值为86000元。根据市值计算办法，张三最多可向深交所申购6000股新股，向上证所申购8000股新股。

二、申购

2004年某月15日（T日），张三在正常交易时间内以深圳证券账户0087654321向深交所申购8000股新股（注意：已超过了6000股），申购代码为002999，申购价格为6.55元/股；同日的正常交易时间内，张三又以上海证券账户A123456789向上证所申购8000股新股，申购代码为739999，申购价格同为6.55元/股。

三、配号

2004年某月15日（T日）收市后，中国结算深圳分公司、上证所根据2004年某月12日收市后计算的投资者拥有的股票市值，按每1万元上市流通证券市值可申购1000股XX股份，不足1万元的部分不计入可申购市值的原则，对有效申购进行统一连续配号。

张三因同时向两个交易所申购，可获得深交所6个配号（注意：并非是8个号，剔除了2个），上证所8个配号。

四、中签缴款

配售新股中签后，投资者应确保资金账户中有足够的新股认购资金。若中签投资者因资金不足无法足额认购中签股票时，深市会员营业部应于T+3日15:00前，将其放弃认购部分向深交所申报；沪市会员应于T+3日15:00前通过PROP向中国结算上海分公司申报。因资金不足而放弃认购的新股，由保荐机构（主承销商）包销。

深交所要求投资者在中签后就放弃认购部分进行申报，申报的证券代码仍为“002999”，委托价格为0，放弃认购的数量为实际放弃的数量（可以不是1000的整数倍）。如不申报视同全部缴款认购。

假定张三在深、沪两市各中了1000股，且在会员营业部有足够的资金，因而共获配售2000股“XX股份”新股，分别登记托管在中国结算深圳、上海分公司。

五、上市交易

2004年某月30日，XX股份公司在深交所挂牌上市，其在深交所和上证所的挂牌代码分别为“002999”、“609999”，开盘参考价均为6.55元/股，上市首日简称统一以“N”开头，证券简称统一为“XX股份”。

张三可以通过自己的上海证券账户A123456789向上证所报单，卖出“609999”，也能对自己的卖出委托进行撤单，但不能买入“609999”。

上证所交易系统发布的行情数据中，“609999”“XX股份”的行情数据将实时转发深交所的“002999”的行情数据，为准确起见，沪市投资者应根据“002999”的实时行情数据确定“609999”的卖出委托价格。

张三在深交所中签股份的交易办法与深交所挂牌的其他股票一致。



打印本页



填入收藏夹



关闭窗口