

附件：

深圳证券交易所股票期权试点 交易取消审核委员会工作细则

第一章 总则

第一条 为了规范股票期权取消交易的实施，根据《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司股票期权试点风险控制管理办法》及其他相关规定，制定本细则。

第二条 深圳证券交易所（以下简称本所）设立交易取消审核委员会（以下简称委员会），负责股票期权取消交易事宜。委员会的设立及运作，适用本规定。

第三条 股票期权交易出现下列情形之一且尚未进入清算程序的，本所可以决定取消相关期权合约或者合约品种当日已经成交的交易：

（一）期权合约存续期间，合约类型、合约单位、行权价格等合约条款发生错误；

（二）加挂的期权合约数量、到期日或者行权价格等出现错误，不符合期权合约加挂相关规则；

(三) 期权合约到期后未及时摘牌，仍进行交易；

(四) 合约标的除权、除息错误导致合约标的的交易价格出现重大误差；

(五) 合约标的当日全部或者部分交易被本所采取取消交易措施；

(六) 合约标的为交易型开放式基金的，该交易型开放式基金出现申赎清单错误，导致其在当日连续竞价交易时段的交易价格波幅与其对应指数波幅之差按时间加权平均后的绝对值超过 2%；

(七) 合约标的为交易型开放式基金的，因基金管理人出现技术故障或者重大差错等原因（申赎清单错误除外），导致该基金持有的各成分股权重与其对应指数相应成分股权重之差的绝对值合计超过 35%；

(八) 因本所交易系统发生重大故障、被非法侵入或遭受其他人为破坏等原因，导致期权交易未能按照本所业务规则的规定进行成交或在规定的交易时段以外进行交易，或者出现其他重大异常情形；

(九) 因合约标的市场或者股票期权市场发生不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错，导致股票期权交易结果出现重大异常，按此交易结果进行结算将对股票期权交易正常秩序和市场公平造成重大影响的其他情形。

第二章 委员会

第四条 委员会委员共十五名，由本所业务部门的专业人员担任。本所可以根据需要，对委员会的委员人数和名单进行调整。

第五条 委员会委员应当具备下列条件：

（一）熟悉证券、股票期权相关的法律、行政法规、部门规章和本所业务规则；

（二）熟悉证券、股票期权市场情况；

（三）坚持原则、公正廉洁、严格守法；

（四）本所要求的其他条件。

第六条 委员会委员履行职责时，应当遵守下列规定：

（一）勤勉尽责，以审慎的态度，全面审阅相关申请材料；

（二）按要求出席审核会议，独立发表意见，行使表决权；

（三）不得接受与审核事项有关的单位或人员的馈赠，不得私下与前述单位或人员接触；

（四）不得透露在履行职责时接触的相关未公开信息和会议情况，不得利用未公开信息为本人或他人谋取利益；

（五）本所规定的其他要求。

第七条 委员会委员出现下列情形之一的，不再担任委员会委员：

（一）两次以上无故缺席审核的；

（二）严重违反委员会工作纪律的；

（三）申请辞去委员职务的；

（四）不适合担任委员的其他情形。

第八条 委员会设召集人一名，负责召集会议或指定其他委员召集会议。

第三章 工作程序

第九条 股票期权交易出现第三条所述情形的，由本所相关业务部门及时向委员会提出取消交易审核事项，并递交相关异常情况说明文件、拟取消交易的相关交易统计数据等材料。

第十条 委员会通过召开审核会议的形式审议取消交易事项。审核会议可以采用现场会议、通讯表决或其他方式进行。

第十一条 每次审核会议由五名委员参加。

委员会委员与取消交易审核事项存在利害关系，可能影响其公正履行职责的，应当及时提出回避，不得参会审议。

第十二条 审核会议采取记名投票方式进行表决，参会委员每人享有一票表决权，只能表决同意或者反对，不得弃权。

投票表决时同意票数达到三票及以上时，形成同意取消交易的审核意见，否则形成不予取消交易的审核意见。

第十三条 本所根据审核意见作出取消交易决定或者不予取消交易的决定。

第四章 附则

第十四条 本规定由本所负责解释。

第十五条 本规定自发布之日起施行。