

中国国际金融股份有限公司关于港股通交易风险提示公告

尊敬的投资者：

2023年3月3日，上海证券交易所、深圳证券交易所分别联合中国证券登记结算有限公司发布了《关于发布〈上海证券交易所港股通交易风险揭示书必备条款（2023年修订）〉的通知》（上证发〔2023〕54号）、《关于发布〈深圳证券交易所港股通交易风险揭示书必备条款〉（2023年修订）的通知》（深证会〔2023〕64号），就港股通交易风险揭示书必备条款进行了修订。我公司据此更新了《上海证券交易所港股通交易风险揭示书》《深圳证券交易所港股通交易风险揭示书》，对于此前已经开通港股通交易权限的投资者，就主要修订内容进行提示说明如下：

- 1、 **调整“证券价格波动较大产生的风险”相关表述。**其中，《上海证券交易所港股通交易风险揭示书》新增部分表述为：“港股通股票在上市第一年里，除受市场、资金、企业盈利等方面影响，还可能因投资者对新股情绪变化、限售解禁等因素，出现股价较大波动的情形；港股通股票可能因为上市公司注册地或主营业务经营所在地的政策法律变化、境外市场联动以及其他原因而出现股价较大波动的情形。”《深圳证券交易所港股通交易风险揭示书》调整相关表述为：“香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）市场股票及ETF交易不设置涨跌幅限制，港股通股票可能出现因公司基本面变化、第三方研究分析报告的观点、异常交易情形、做

空机制等原因，引起股价较大波动尤其是上市初期股价大幅波动的情形；港股通股票可能因为上市公司注册地或者主营业务经营所在地的政策法律变化、境外市场联动以及其他原因而引起股价较大波动。”

- 2、 **新增“部分港股通上市公司实际经营状况难以获取或理解的风险”**。新增的表述为：“提示投资者注意，部分港股通股票可能因为上市公司注册地、主营业务经营所在地法律法规、语言或文化习惯等与内地存在差异，导致投资者较难获取或理解公司实际经营状况相关资讯，投资者应当关注可能产生的风险。”
- 3、 **调整“港股通股票退市后，中国结算名义持有人服务受限产生的风险”相关表述**。调整后的表述为：“提示投资者注意，港股通股票退市后，因香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）可能无法比照退市前标准提供名义持有人服务，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）通过香港结算继续为投资者提供的退市股票名义持有人服务可能会受限，投资者应当关注可能产生的风险。”
- 4、 **调整“港股通交易日与香港市场不一致产生的风险”相关表述**。调整后的表述为：“沪港通/深港通交易日历优化正式实施后，只有沪港/深港两地均为交易日的日期才为港股通交易日，具体以上海/深圳证券交易所证券交易服务公司在其指定网站公布的日期为准。”

- 5、 **调整“日间交易依据汇率与最终结算汇率不一致产生的风险”相关表述。**调整后的表述为：“提示投资者注意，投资者在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国结算上海分公司/深圳分公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。”
- 6、 **新增“在非对称节假日港股通标的暂停接受交易申报的风险”。**新增的表述为：“提示投资者注意，沪港通/深港通交易日历优化正式实施后，在港股通股票、港股通 ETF 分拆合并业务中，有并行买卖的首个代码转换日（即原代码最后交易日对应的港股交收日）或者无并行买卖的转换日（转换生效日前一港股交易日）为非对称节假日（内地节假日且为香港地区非节假日）或者非对称节假日后第一个港股通交易日的，在前述非对称节假日前的新增港股通交易日暂停接受该股票或者 ETF 的港股通交易申报；上述业务在非对称节假日期间，港股通股票、港股通 ETF 取消分拆合并的，非对称节假日后第一个港股通交易日继续暂停接受该股票或者 ETF 的港股通交易申报，投资者应当关注因此可能产生的风险。”
- 7、 **调整“两地市场订单申报价格与数量限制等差异产生的风险”相关表述。**调整后的表述为：“提示投资者注意，与内地证券市场相比，联交所在订单申报的最小交易价差、每手证券数量、申报最大限制等方面存在一定的差异，投资者应当关注因此可能产生的风险。”

- 8、 **调整“交收期差异产生的风险”相关表述。**调整后的表述为：
“提示投资者注意，香港证券市场与内地证券市场在证券资金的交收期安排上存在差异，港股通交易的交收期为 T+2 日（只有沪港/深港两地均为交收日的日期才为港股通交收日）。若投资者卖出证券，在交收完成前仍享有该证券的权益。若投资者买入证券，在交收完成后才享有该证券的权益。同时，港股通交易的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交收。”
- 9、 **新增“股权登记日差异产生的风险”。**新增的表述为：“提示投资者注意，沪港通/深港通交易日历优化正式实施后，港股通股票、港股通 ETF 的香港市场股权登记日为非对称节假日（内地节假日且为香港地区非节假日）期间第一个港股交易日的，境内股权登记日为非对称节假日后第一个港股通交收日；香港市场股权登记日在非对称节假日期间第二个港股交易日至非对称节假日后第一个港股通交易日（含）之间的，境内股权登记日为非对称节假日后第二个港股通交收日。”
- 10、 **新增“截止日日终确定供股权有效申报的风险”。**新增的表述为：“提示投资者注意，对于在联交所上市公司的供股业务，中国结算将在境内申报截止日日终确定投资者账户供股权的有效申报数量，并记减有效申报的供股权。”
- 11、 **调整“现金红利发放较香港市场延后产生的风险”相关表述。**调整后的表述为：“提示投资者注意，中国结算在收到香港结算派发的联交所上市公司现金红利或联交所上市 ETF 收益分配后，需

要按规则对外币红利资金进行换汇、清算、代扣代缴税款、发放等业务处理，投资者通过港股通业务获得的现金红利将会较香港市场有所延后。部分港股通股票红利派发可能存在要求投资者申报相关信息的情形，请投资者及时关注上市公司官方公告或本公司提示，并通过本公司进行申报。”

12、 **调整“零碎证券处理规则产生的风险”相关表述。**调整后的表述为：“提示投资者注意，对于投资者账户中因联交所上市公司派发红股、供股权、公开配售权以及港股通标的证券分拆、合并业务产生的小于1单位的零碎证券，中国结算进行舍尾处理。当香港结算发放的红股、供股权、公开配售权总数或分拆、合并证券数额大于投资者账户舍尾取整后的总数的，中国结算按照精确算法分配差额部分。”

13、 **调整“两地市场税费标准差异产生的风险”相关表述。**新增的部分表述为：“部分港股通股票可能根据上市公司注册地或主营业务经营所在地要求，存在其他税收安排。”

14、 **调整“特别提示”相关表述。**调整后的表述为：“1、本《上海证券交易所港股通交易风险揭示书》/《深圳证券交易所港股通交易风险揭示书》的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明港股通交易的所有风险，且未来有关法律法规和业务规则修订时可能不会要求投资者重新签署相关《风险揭示书》，投资者在参与交易前，应当认真阅读有关法律法规和交易所业务规则等相关规定，并应当认真阅读相关信息披露公告、《客户开户合约》（包括《客户账

户开户协议》《证券交易委托风险揭示书》《证券交易委托代理协议》)等法律文件,对其他可能存在的风险因素也应当有所了解和掌握,并确信已做好足够的风险评估与财务安排,避免因参与港股通交易遭受难以承受的损失。2、港股通交易具有的各类风险,均可能致使投资者出现投资亏损,甚至存在所有本金损失的可能。3、投资者在本《风险揭示书》上签章,即表明投资者已经理解并愿意自行承担参与港股通交易的风险和损失。”

关于本次修订内容,如您有任何问题,请联系您的专属销售,或拨打股票业务部客服热线(4008209068),我们将一如既往竭诚为您服务!

特此公告。

中国国际金融股份有限公司

二零二三年三月十四日