

## 一、滬股通股票種類：

在各類滬股中，初始階段僅有 A 股獲納入滬港通。其他產品類別如 B 股、交易所買賣基金、債券以及其他證券將不包括在內。

在初始階段，您可買賣上交所市場上市的若干股票（滬股通股票），包括不時的上證 180 指數的成份股、上證 380 指數的成份股，以及不在上述指數成份股內但有 H 股同時在聯交所上市及買賣的上交所上市 A 股，但不包括下列股票：

- (a)所有以人民幣以外貨幣報價的滬股；及
- (b)所有被實施風險警示的滬股。

任何滬股因被納入風險警示板而在滬港通初期推出時暫不納入為滬股通股票，該等滬股如日後從風險警示板剔除，但仍屬於有關指數成份股或其相應的 H 股仍在聯交所掛牌買賣（如適合）將被接納為滬股通股票。

滬股通股票將在以下幾種情況下被暫停買入（但允許賣出）：

- (a)該等滬股不再屬於有關指數成份股；及/或
- (b)該等滬股被實施風險警示；及/或
- (c)該等滬股相應的 H 股不再在聯交所掛牌買賣；相應適用情況。

## 二、滬股通盤種介紹

### 限價盤：

滬股通股票全日只接受限價訂單（上交所限價訂單可於指定價格或更優價格配對）。

### 「限價盤」例子(僅供說明之用)

假設您設定一個以每股 RMB3.00 沽出某股票 20,000 股的限價訂單種類。本行將會以您設定的落盤價 RMB3.00，與市場最佳價格的輪候隊伍配對。

市場輪候隊伍：

買入價 (RMB)	股數	成交股數(沽出)
3.02	1,000	1,000 股@RMB3.02
3.01	0	6,000 股@RMB3.00
3	6,000	
2.99	3,000	
2.98	0	
		未成交股數(沽出)
		13,000 股

交易結果：該「限價盤」以您的落盤價及市場上最佳價格的輪候隊伍配對共 7,000 股，餘下未能成交的 13,000 股將按您指定的落盤價 RMB3.00 繼續輪候。

## 三、如何設定「限價盤」

1. 點選[一般交易]選項，然後選擇上海市場
2. 選擇買賣方向
3. 輸入股票編號
4. 輸入您想買入/沽出的股數
5. 輸入落盤價

一般交易	競價交易	預放盤
落盤指示		市場: 上海
指示種類: 限價盤		
買賣方向: <input type="radio"/> 買入 <input type="radio"/> 沽出		
股票編號: <input type="text"/>		
股票名稱: -		
股數: <input type="text"/>		
落盤價: <input type="text"/>		
交易金額(參考):		<input type="button" value="查詢"/>

[結算戶資料](#)

\*\* [滬股注意事項](#)

\*\* [滬股注意事項](#)

#### 四、落盤規則

所有滬股通股票買盤每手均為 100 股(必須以整手落買盤)。僅賣盤可接納碎股。因此，完整買賣單位的買盤訂單與碎股賣盤相對形成碎股交易的情況亦屬常見。與香港市場不同，上交所收到的完整買賣單位的訂單與碎股訂單是在同一交易平台配對，並在同一價位競價。滬股最大買賣盤為 100 萬股，最低上落價位劃一為人民幣 0.01 元。

#### 五、價格限制

就滬股通股票而言，上交所目前實行的價格限制一般為不超過前一日收市價的 $\pm 10\%$ (被納入風險警示板的滬股(即 ST 股票及 \*ST 股票)的價格限制為 $\pm 5\%$ )。

所有滬股通股票訂單的價格必須在價格限制範圍之內，否則訂單會被上交所拒絕。價格限制的上下限在一天之內不會變動。

除此之外，為了更有效地使用滬股通交易額度及確保滬股通的運作能順利進行，香港交易所就滬股通股票交易買入盤訂單設定一個價格下限，當滬股通股票買入盤訂單價格低於當前買入價(如沒有當前買入價時，最新價格適用，如沒有，則前收盤價格適用) 3% (此百分比可按市況不時調整) 時，該買入盤訂單便會被 CSC 系統拒絕。該價格限制並不適用於上交所的開市集合競價時段。

## 六、回轉交易

上海 A 股市場不允許回轉交易。因此，您於 T 日買入滬股通股票後僅可於 T+1 日或之後賣出。