

证监会公告[2012]35号

中国证券监督管理委员会公告

[2012] 35号

现公布《关于修改〈关于证券公司证券自营业务投资范围及有关事项的规定〉的决定》，自公布之日起施行。

中国证监会

2012年11月16日

关于修改《关于证券公司证券自营业务 投资范围及有关事项的规定》的决定

一、第二条第一款修改为：“证券公司从事证券自营业务，可以买卖本规定附件《证券公司证券自营投资品种清单》所列证券。”

二、删除第二条第二款。

三、第四条第二款修改为：“设立前款规定子公司的证券公司，应当具备证券自营业务资格，并按照《证券公司监督管理条例》第十三条关于变更公司章程重要条款的规定，事先报经公司住所地证监会派出机构批准。”

四、增加一条，作为第五条：“具备证券自营业务资格的证券公司可以从事金融衍生产品交易。

“不具备证券自营业务资格的证券公司只能以对冲风险为目的，从事金融衍生产品交易。”

五、第五条改为第六条，修改为：“证券公司与本规定有关事项的净资本和风险资本准备计算，应当符合证监会的规定。”

六、附件《证券公司证券自营投资品种清单》修改为：“一、已经和依法可以在境内证券交易所上市交易和转让的证券。二、已经在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券。三、已经和依法可以在符合规定的区域性股权交易市场挂牌转让的私募债券，已经在符合规定的区域性股权交易市场挂牌转让的股票。四、

已经和依法可以在境内银行间市场交易的证券。五、经国家金融监管部门或者其授权机构依法批准或备案发行并在境内金融机构柜台交易的证券。”

本决定自公布之日起施行。

《关于证券公司证券自营业务投资范围及有关事项的规定》根据本决定作相应修改并对条款顺序作相应调整，重新公布。

关于证券公司证券自营业务投资范围及有关事项的规定

(2011年4月29日中国证券监督管理委员会公布, 根据2012年11月16日中国证券监督管理委员会《关于修改〈关于证券公司证券自营业务投资范围及有关事项的规定〉的决定》修订)

第一条 为了明确证券公司证券自营业务的投资范围及有关事项, 根据《证券公司监督管理条例》, 制定本规定。

第二条 证券公司从事证券自营业务, 可以买卖本规定附件《证券公司证券自营投资品种清单》所列证券。

第三条 证券公司可以委托具备证券资产管理业务资格、特定客户资产管理业务资格或者合格境内机构投资者资格的其他证券公司或者基金管理公司进行证券投资管理。

证券公司将自有资金投资于依法公开发行的国债、投资级公司债、货币市场基金、央行票据等中国证券监督管理委员会(以下简称证监会)认可的风险较低、流动性较强的证券, 或者委托其他证券公司或者基金管理公司进行证券投资管理, 且投资规模合计不超过其净资本80%的, 无须取得证券自营业务资格。

第四条 证券公司可以设立子公司, 从事《证券公司证券自营投资品种清单》所列品种以外的金融产品等投资。

设立前款规定子公司的证券公司，应当具备证券自营业务资格，并按照《证券公司监督管理条例》第十三条关于变更公司章程重要条款的规定，事先报经公司住所地证监会派出机构批准。

证券公司不得为本条第一款规定的子公司提供融资或者担保。

第五条 具备证券自营业务资格的证券公司可以从事金融衍生产品交易。

不具备证券自营业务资格的证券公司只能以对冲风险为目的，从事金融衍生产品交易。

第六条 证券公司与本规定有关事项的净资本和风险资本准备计算，应当符合证监会的规定。

第七条 本规定自 2011 年 6 月 1 日起施行。证监会此前公布的有关规定与本规定不一致的，以本规定为准。

附件：证券公司证券自营投资品种清单

附件：

证券公司证券自营投资品种清单

一、已经和依法可以在境内证券交易所上市交易和转让的证券。

二、已经在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券。

三、已经和依法可以在符合规定的区域性股权交易市场挂牌转让的私募债券，已经在符合规定的区域性股权交易市场挂牌转让的股票。

四、已经和依法可以在境内银行间市场交易的证券。

五、经国家金融监管部门或者其授权机构依法批准或备案发行并在境内金融机构柜台交易的证券。