

财经·视界

“光”想套利 “大”错离奇

16日,光大证券策略投资部开展ETF套利交易时发生乌龙事件;19日再闹乌龙事件

□据 新华社 网易财经

错了一次:大乌龙凸显A股投机市痼疾

A股8月16日的乌龙事件虽然已经被证监会定义成“极端个别事件”,但在业内人士看来,除了光大证券本身的行为值得质疑,这起事件还凸显了A股交易系统的监管漏洞以及投机市的痼疾。

“此次事件是新中国资本市场建立以来的首例,是一起极端个别事件,但暴露出的问题足以引起整个证券行业的高度警觉。”8月18日,中国证监会新闻发言人通报了8月16日光大证券交易异常的应急处置和初步核查情况。

经初步核查,光大证券自营的策略交易系统包含订单生成系统和订单执行系统两个部分,存在程序调用错误、额度控制失效等设

计缺陷,并被连锁触发,导致生成巨量市价委托订单,直接发送至上交所,累计申报买入234亿元,实际成交72.7亿元。同日,光大证券将18.5亿元股票转化为ETF卖出,并卖出7130手股指期货合约。

证监会发言人表示,在核查中尚未发现人为操作差错,但光大证券该项业务内部控制存在明显缺陷,信息系统管理问题较多。上海证监局已决定先行采取行政监管措施,暂停相关业务,责成公司整改,进行内部责任追究。同时,证监会决定对光大证券正式立案调查,根据调查结果依法严肃处理,及时向社会公布。

再错一次:超低价卖出国债,正协商处理

19日,光大证券在银行间市场再闹乌龙事件。光大证券在官方网站证实,19日上午,光大证券金融市场总部在银行间本币交易系统进行现场买卖点击成交报价时,误将“12附息国债15”债券卖价收益率报为4.20%(高于前一日中债估值约25个基点),债券总面值为1000万元,后被交易对手点击成交。

资料显示,12附息国债15(120015)为银行间市场交易品种,在当日早间9:25:37由

光大证券报价93.9764卖出1000万元该债券,收益率4.20%。该价格仍是截至目前的最低价位。

资料显示,“12附息国债15”为2012年记账式附息(十五期)国债,期限为10年,于2012年8月23日发行,发行额为300亿元,发行价为100元,票面利率3.39%。

光大证券称,目前光大证券正在与对手方沟通并协商处理。

光大证券 上海淮海中路营业部 中国十佳证券营业部 (31层) www.ebscn.com 021-64727070 955

十九日,行人从上海一处光大证券宣传板前走过 (新华社发)

专家有话说:

凸显证券市场的重大缺陷和漏洞

□据 新华社

接受记者采访的专家普遍认为,抛开光大证券来说,这起乌龙事件,凸显了证券市场相关业务上的监管漏洞与A股的重大缺陷。

中山大学兼职研究员陈培雄在新浪财经专栏中表示,光大证券与交易所之间进行的是信用交易。光大证券在没有72亿元情况下可以购买72亿元的股票,光大证券所需做的工作仅仅是第二个交易日之前将头寸补齐即可。

业内人士认为,这种行为使得普通股民与机构在交易上处于完全不对等的地位,这是证券市场的重大缺陷和漏洞。另一名业内人士则表示,现在监管部门对券商自营账户信用保证金杠杆比率没有明确规定,交易时可任其下单,只要收盘后把资金凑齐就行。这意味着整个券商自营投资都存在风险被无限放大的监控盲区。

《洛阳晚报》分类广告 诚聘 商务资讯 激光切割加工 二手超市 会计服务 亮化照明 机械工程 房产资讯 车辆资讯 等等

友情提示:本栏目仅为信息提供和使用的双方搭桥,信息内容的真实性、准确性以及由此产生的后果,由信息提供者负责。您使用这些信息时,请注意查验各种相关文件和手续。