

## 关于明确信用账户科创板股票集中度实时控制指标的通知

尊敬的投资者：

为了有效防范科创板股票融资融券交易风险，保护投资者的合法权益，根据市场情况和风险管理要求，公司对信用账户持有科创板股票或融券卖出科创板股票形成负债的集中度进行实时控制，具体控制指标如下：

### 1、信用账户科创板股票市值持仓集中度及单一科创板股票市值持仓集中度控制

持仓集中度=买入或者融资买入相关股票委托成交后信用账户内相关股票市值/信用账户总资产

(1) 信用账户维持担保比例不高于 200% 的客户，科创板股票市值持仓集中度为 0；

(2) 信用账户维持担保比例高于 200% 但不高于 240% 的客户，科创板股票市值持仓集中度不得高于 20%，单一科创板股票市值持仓集中度不得高于 10%；

(3) 信用账户维持担保比例高于 240% 但不高于 300% 的客户，科创板股票市值持仓集中度不得高于 30%，单一科创板股票市值持仓集中度不得高于 15%；

(4) 信用账户维持担保比例高于 300% 的客户，科创板股票市值持仓集中度不得高于 40%，单一科创板股票市值持仓集中度不得高于 20%。

同时，上市时间不超过 5 个交易日的科创板股票，在上述科创板

股票总体持仓集中度控制范围内，增加如下持仓集中度控制：

（1）信用账户维持担保比例不高于 200% 的客户，上市不超过 5 个交易日的科创板股票市值持仓集中度为 0；

（2）信用账户维持担保比例高于 200% 但不高于 400% 的客户，上市不超过 5 个交易日的科创板股票市值持仓集中度不得高于 10%，单一科创板股票市值持仓集中度不得高于 5%；

（3）信用账户维持担保比例高于 400% 的客户，上市不超过 5 个交易日的科创板股票市值持仓集中度不得高于 20%，单一科创板股票市值持仓集中度不得高于 10%。

## 2、信用账户科创板融券负债集中度管理

融券负债集中度=信用账户融券卖出科创板股票净空头市值/总资产

（1）信用账户维持担保比例不高于 200% 的客户，融券负债集中度为 0；

（2）信用账户维持担保比例高于 200% 但不高于 240% 的客户，融券负债集中度不得高于 15%；

（3）信用账户维持担保比例高于 240% 但不高于 300% 的客户，融券负债集中度不得高于 20%；

（4）信用账户维持担保比例高于 300% 的客户，融券负债集中度不得高于 25%。

同时，上市时间不超过 5 个交易日的科创板股票，在上述持仓集中度控制范围内，增加如下集中度控制：

(1) 信用账户维持担保比例不高于 200%的客户，上市不超过 5 个交易日的科创板融券负债集中度为 0；

(2) 信用账户维持担保比例高于 200%但不高于 400%的客户，上市不超过 5 个交易日的科创板融券负债集中度不得高于 10%；

(3) 信用账户维持担保比例高于 400%的客户，上市不超过 5 个交易日的科创板融券负债集中度不得高于 15%。

3、投资者提取信用账户担保物，除满足维持担保比例提取前后高于 300%的条件外，还需满足信用账户提取前后科创板股票集中度要求。

4、申请融资融券合约展期的客户，除满足一般的展期要求之外，还需满足信用账户科创板股票市值持仓集中度要求。

大通证券股份有限公司

2019 年 7 月 19 日