

关于北交所融资融券业务指标实施的公告

尊敬的投资者：

为有效防范北京证券交易所（以下简称“北交所”）融资融券业务风险，切实保障投资者利益，根据我司《融资融券业务合同-北交所融资融券业务补充协议》、《北交所融资融券业务风险揭示书》以及相关规定，现对我公司北交所融资融券业务的相关业务指标进行如下公示：

一、 北交所融资融券业务可充抵保证金证券担保证券范围及折算率

我公司将在北交所公布的可充抵保证金证券范围内筛选可充抵保证金证券清单范围，并确定该等证券的折算率。具体以我公司网站公布的相关信息为准。

二、 北交所融资融券业务标的证券范围及保证金比例

北交所股票自上市首日起可作为融资融券标的，我公司将在北交所公布的标的范围内筛选融资融券标的证券范围，并确定相应保证金比例。具体以我公司网站公布的相关信息为准。

三、 维持担保比例要求

任一交易日（T日）16:00 双创板及北交所股票类别净持仓集中度	平仓线	警戒线	提取线
不高于 30%	130%	140%	300%
高于 30%，且不高于 50%	140%	150%	300%
高于 50%，且不高于 80%	150%	160%	300%
高于 80%	160%	170%	300%

说明：

- “双创板及北交所股票类别净持仓集中度”指客户信用账户内，属于创业板、科创板、北交所股票类别的各单一证券的个券净持仓集中度之和；
- “个券净持仓集中度”指客户信用账户内，已融券卖出任一证券的市值减去该证券持仓市值的差额的绝对值占信用账户总资产的比例。其中，在计算该证券在 T 日 16:00 的市值时，若我公司为该证券设定了公允价格的，使用该公允价格，否则使用该证券在 T 日 16:00 的最新收盘价。

• 关于北交所股票净持仓集中度的特别要求：当您信用账户内的北交所股票净持仓集中度超过 10%（我公司有权调整该集中度指标，具体以我公司公告或通知为准）且维持担保比例低于您信用账户对应的平仓线时，我公司有权限制您信用账户融资买入、普通买入、融券卖出交易权限，并通知您追加担保物，要求所追加的担保物于我公司发出通知后的第一个交易日 12:45 前到达您的信用资金账户或信用证券账户，或由您直接进行还款或还券，使其维持担保比例尽快恢复到大于等于警戒线的水平。如您未能于中金公司发出追加担保物通知后的第一个交易日 12:45 前补足担保物或由客户直接进行还款或还券使其维持担保比例大于等于警戒线的，视为已满足强制平仓的条件，我公司有权强制平仓。

四、 北交所股票类别持仓集中度要求

在现有个券持仓集中度要求及对 E 组证券类别持仓集中度要求的基础上，新增北交所股票类别持仓集中度要求如下：

维持担保比例	北交所股票类别持仓集中度要求
不高于 180%	≤20%
高于 180%，且不高于 240%	≤30%
高于 240%，且不高于 400%	≤40%
高于 400%	≤60%

说明：

“北交所股票类别持仓集中度”指信用账户中属于北交所股票类别的全部证券的“个券持仓集中度”之和。

五、 规模监控要求

当客户信用交易担保证券账户或单一客户的信用账户中发生以下情形时，我公司有权对客户采取合同中约定的风险控制措施：

- 1、 全体客户单一北交所股票持仓市值超过该标的总市值的 5%；；
- 2、 全体客户单一北交所股票融资规模超过该标的流通市值的 5%
- 3、 单一客户单一北交所股票持仓市值超过该标的总市值的 4%；
- 4、 单一客户单一北交所股票融资规模超过 Min（该证券 1 倍 20 日日均成交额、该证券 1%流通股本市值、2 亿元人民币）。

5、单一客户单一北交所股票融券负债超过 Min (该证券 1 倍 20 日日均成交额、该证券 1%流通股本市值、2 亿元人民币)。

- 我公司有权结合市场情况、风控及合规要求，对以上规模监控阈值进行调整。
- 特别提示，如您在普通证券账户与信用证券账户合并持有的单一北交所股票市值超过该标的总市值的 5%，我公司有权在盘中采取限制措施，禁止您对该标的进行融资买入。

六、北交所股票转板的特殊处理

- 1、自上市公司发布公告启动转板之日起，我公司将根据北交所要求将该拟转板的标的证券调整出融资融券标的范围 (T 日)，客户需不晚于 T+1 日了结相关融券合约。
- 2、在您了结存续合约后，您应在符合原合同约定的资产取出线要求的前提下，及时向我公司申请将标的证券划转至您的普通证券账户；如您未申请的，我公司有权在保障您信用账户维持担保比例不低于原合同约定的平仓线的前提下，于有关标的证券终止上市前将其从您的信用账户划转到您的普通证券账户中。
- 3、我公司有权自上市公司发布公告启动转板之日起将该标的证券调整出可充抵保证金证券范围，调出后该标的证券市值按零计算。若您信用账户的维持担保比例低于平仓线，则您应按照协议约定追加担保物；若您未按时追加担保物或直接进行还款或还券使其维持担保比例大于等于警戒线的，我公司有权进行强制平仓。

如有任何问题，您可以联系您的专属投资经理问询。

特此公告。

附件：

- 1、《融资融券业务合同-北交所融资融券业务补充协议》
- 2、《北交所融资融券业务风险揭示书》

中国国际金融股份有限公司

2023年02月10日