**关于调整信用账户科创板、创业板股票交易风控措施的公告**

为了有效防范和控制科创板、创业板股票融资融券业务风险，保护投资者的合法利益，根据交易所相关规定，结合融资融券业务规则及科创板、创业板股票交易特性，公司决定针对信用账户科创板、创业板股票交易制定如下风险控制措施：

**一、单一客户科创板、创业板股票融资总额控制**

单一客户科创板股票融资总额不超过500万元；

单一客户创业板股票融资总额不超过2000万元。

**二、科创板、注册制创业板股票融资保证金比例设置**

1.科创板、注册制创业板股票上市后的5个交易日内，融资保证金比例为200%；

2.科创板、注册制创业板股票上市5个交易日后，融资保证金比例＝max(1+0.5-担保证券折算率，1)。

**三、投资者信用账户科创板、创业板股票集中度控制**

公司将注册制创业板与科创板股票合并为一类，设置板块集中度控制方案；为核准制创业板股票单独设置板块集中度控制方案。

1.注册制创业板与科创板股票集中度方案

|  |
| --- |
| 上市5个交易日内集中度控制 |
| 维持担保比例（R） | 科创板单票集中度 | 注册制创业板单票集中度 | 科创板+注册制创业板板块集中度 |
| R＜300% | ≤5% | ≤5% | ≤10% |
| R≥300%或无负债 | ≤5% | ≤5% | ≤15% |

|  |
| --- |
| 上市5个交易日后集中度控制 |
| 维持担保比例（R） | 科创板单票集中度 | 注册制创业板单票集中度 | 科创板+注册制创业板板块集中度 |
| R＜180% | ≤10% | ≤5% | ≤20% |
| 180%≤R＜240% | ≤20% | ≤10% | ≤30% |
| 240%≤R＜300% | ≤30% | ≤15% | ≤40% |
| R≥300%或无负债 | ≤40% | ≤20% | ≤50% |

2.核准制创业板股票集中度方案

公司对核准制创业板股票的板块集中度采取如下控制措施：

|  |  |
| --- | --- |
| 维持担保比例（R） | 核准制创业板板块集中度 |
|  R＜180% | ≤30% |
| 180%≤R＜240% | ≤60% |
| R≥240%或无负债 | ≤100% |

**四、创业板股票融资融券合约展期管理**

公司在原有的融资融券合约展期条件的基础上，增加科创板+注册制创业板板块集中度不得高于30%、核准制创业板板块集中度不得高于60%的条件限制。

**五、交易权限管理**

为控制创业板融资融券业务风险，针对核准制创业板股票涨跌幅的变化，公司限制未开通注册制创业板交易权限的客户新增核准制创业板的融资融券合约。

该公告以创业板注册制首批企业上市交易之日起实施，原“[关于增加信用账户科创板股票交易风控措施指标的公告](http://www.cczq.com/home/a/buscenter/sfc/notice/20190715/10035.html%22%20%5Ct%20%22http%3A//www.cczq.com/home/buscenter/sfc/notice/_blank)”同日废止。公司将根据监管要求、市场环境、风险情况、业务发展需要等因素动态调整以上风险控制指标，并在公司官网证券金融栏目公告，敬请投资者持续关注。

特此公告！

川财证券有限责任公司

2020年8月20日