

## 关于融资融券业务集中度控制的公告

本公司决定自 2023 年 9 月 4 日起调整信用账户集中度控制指标，具体内容如下：

### 一、持仓集中度控制

持仓集中度是指投资者信用账户内持有某一只或某一类证券的总市值占其信用账户总资产的比例。投资者通过信用账户普通买入或者融资买入证券委托成交后，根据委托成交后的维持担保比例，信用账户内某一只或某一类证券的持仓集中度，不得超过本公司规定的上限。

持仓集中度从信用账户维持担保比例和证券分组两个维度进行控制，包括单一证券持仓集中度和 E 组证券合计持仓集中度两个控制指标。上述两个集中度控制指标同时生效，根据取小原则确定最终的持仓集中度上限。

持仓集中度的具体控制指标如表 1、表 2 所示：

表 1：单一证券的持仓集中度上限

维持担保比例 \ 证券分组	A	B	C	D	E
低于 170%	60%	60%	40%	20%	5%
不低于 170%，且低于 240%	100%	80%	60%	40%	10%
不低于 240%，且低于 400%	100%	100%	80%	60%	20%
不低于 400%	100%	100%	100%	100%	100%

表 2：E 组证券合计的持仓集中度上限

维持担保比例	E 组证券合计
低于 170%	20%
不低于 170%，且低于 240%	40%
不低于 240%，且低于 400%	60%
不低于 400%	100%

注：上述证券分组仅适用于本公司集中度控制，不构成任何投资建议或意见。本公司对上述证券分组的准确性和完整性不作任何保证，亦不对投资者因参照该分组内容而引致的任何损失承担任何责任，投资者应谨慎判断并自行承担证券投资引发的全部风险。

## 二、融券集中度控制

融券集中度是指投资者信用账户内融券卖出且尚未偿还的某一只或某一类证券的总市值占其信用账户总资产的比例。投资者通过信用账户融券卖出证券委托成交后，根据委托成交后的维持担保比例，信用账户内某一只或某一类证券的融券集中度，不得超过本公司规定的上限。

融券集中度从信用账户维持担保比例和证券分组两个维度进行控制，包括单一证券融券集中度和 E 组证券合计融券集中度两个控制指标。上述两个集中度控制指标同时生效，根据取小原则确定最终的融券集中度上限。

融券集中度的具体控制指标如表 3、表 4 所示：

表 3：单一证券的融券集中度上限

证券分组 维持担保比例	A	B	C	D	E
低于 170%	60%	60%	40%	20%	5%
不低于 170%，且低于 240%	100%	80%	60%	40%	10%
不低于 240%，且低于 400%	100%	100%	80%	60%	20%
不低于 400%	100%	100%	100%	100%	100%

表 4：E 组证券合计的融券集中度上限

维持担保比例	E 组证券合计
低于 170%	20%
不低于 170%，且低于 240%	40%
不低于 240%，且低于 400%	60%
不低于 400%	100%

注：上述证券分组仅适用于本公司集中度控制，不构成任何投资建议或意见。本公司对上述证券分组的准确性和完整性不作任何保证，亦不对投资者因参照该分组内容而引致的任何损失承担任何责任，投资者应谨慎判断并自行承担证券投资引发的全部风险。

## 三、集中度控制结果

集中度控制的最终结果以委托下单界面中可委托成交数量为准。

#### 四、查询方式

登录东方赢家 APP，可查看集中度控制说明。具体路径为：东方赢家 APP—交易—两融—投资分析—集中度查询（如有不同，以实际界面为准）。

#### 五、其他说明

上述调整自 2023 年 9 月 4 日起生效。

本公司历史公告中的相关内容与本公告内容不一致的，以本公告为准。

东方证券股份有限公司

2023 年 9 月 1 日