

关于扩大融资融券标的股票范围相关事项的通知

2016-12-02

🔍 | A⁺ | A⁻

上证发〔2016〕76号

各会员单位及其他市场参与者：

为满足融资融券业务发展需要，经中国证监会批准，根据《上海证券交易所融资融券交易实施细则》（以下简称《实施细则》）的相关规定，上海证券交易所（以下简称本所）决定扩大融资融券标的股票（以下简称标的股票）范围。现将有关事项通知如下：

一、本次扩大标的股票范围的选取标准是：对符合《实施细则》第二十四条规定条件的本所上市股票，按照加权评价指标从大到小排序，并综合考虑市盈率等情况，选取40只股票作为新增标的股票（具体名单见附件）。

加权评价指标的计算方式为：加权评价指标=2×（一定期间内该股票平均流通市值/一定期间内沪市A股平均流通市值）+（一定期间内该股票平均成交金额/一定期间内沪市A股平均成交金额）。

二、现有485只作为融资融券标的的证券的股票及16只作为融资融券标的的证券的交易型开放式指数基金范围维持不变。

三、各会员单位应高度重视，认真做好此次扩大标的股票范围的相关业务和技术准备工作，保障此项工作顺利开展和安全运行。

四、各会员单位应进一步优化自身风险监控指标，根据上市公司财务指标、合规运营情况及市场交易情形等相关信息，加强对标的证券的风险识别及差异化管理，并采取相应的监控措施，严控融资融券业务风险，切实保护投资者利益。

五、本通知自2016年12月12日起施行。本所2014年9月12日发布的《关于扩大融资融券标的股票范围相关事项的通知》（上证发〔2014〕51号）同时废止。本所其他规定与本通知不一致的，以本通知为准。

特此通知。

附件：融资融券标的证券名单 (/lawandrules/sserules/trading/universal/a/20161202/6bcc2348c2402a45817150d7366f7c1f.docx)

上海证券交易所

二〇一六年十二月二日



上交所移动App 随时随地掌握第一手资讯

立即打开 (<http://mb.sseinfo.com/ComInfoServer/ssegwapppdownload.jsp>)