

# 中国证券金融股份有限公司融资融券业务 统计与监控规则（试行）

## 第一章 总则

**第一条** 为规范证券公司融资融券业务数据报送与统计，加强融资融券业务风险监测监控，根据中国证券监督管理委员会（以下简称证监会）《转融通业务监督管理试行办法》、《证券公司融资融券业务管理办法》和《证券公司风险控制指标管理办法》等相关规定，制定本规则。

**第二条** 中国证券金融股份有限公司（以下简称本公司）按照证监会的授权，依法履行融资融券业务统计和风险监测监控职责，建立融资融券统计监测系统，汇集、统计、比对融资融券业务数据，监控证券公司融资融券业务运行情况，监测分析全市场融资融券交易情况，防范融资融券业务风险。

**第三条** 开展融资融券业务的证券公司（以下简称证券公司）应当按照本规则的规定报送融资融券业务数据，及时报告融资融券业务风险控制情况，落实本公司为防范融资融券业务风险采取的各项措施。

## 第二章 数据报送与统计

**第四条** 本公司制定融资融券统计监测系统数据报送接

口规范。证券公司应当按照该接口规范和有关要求，向本公司报送证券公司及其融资融券客户的基本资料、融资融券相关账户的持仓、交易及合约等数据。

本公司为履行融资融券业务统计监控职责，可要求证券公司定期或者不定期报送融资融券业务情况和相关信息。

**第五条** 证券公司应当建立融资融券业务数据和信息报送制度，及时、准确、真实、完整地向本公司报送融资融券业务相关数据和信息。

证券公司不能在规定时间内报送业务数据和信息，或者报送数据和信息有误的，应当及时按照应急处理要求补充报送或者进行更正。

**第六条** 证券公司连续多次出现业务数据和信息报送不及时，或者所报送的数据和信息出现重大遗漏或者错误的，本公司可对证券公司进行现场调查，视情况采取口头提醒、书面提示等措施，并记入诚信档案。

证券公司出现虚报、瞒报、伪造、篡改融资融券业务数据和信息的，本公司除可对该证券公司采取上述措施外，还将及时提请证监会采取监管措施。

**第七条** 本公司建立融资融券业务统计制度，规范统计指标，健全统计报表体系，编制定期报告和专项报告，报送证监会。

### **第三章 风险监测与监控**

**第八条** 本公司对证券公司融资融券业务风险进行监测监控，通过指标预警、压力测试和情景分析等方式，重点关注融资融券标的证券和担保证券集中度、客户负债和合约违约情况、证券公司融资融券业务运行、财务状况和相关监管指标合规情况等。

本公司可根据市场情况和融资融券业务发展需要，确定和调整融资融券业务监控重点。

**第九条** 本公司对证券公司每日融资融券交易数据进行统计分析，监测全市场融资融券交易的系统性风险，分析单只融资融券标的证券的市场风险程度和融资融券业务集中度可能带来的业务风险，重点关注标的证券的以下情形：

（一）价格短期大幅波动，估值明显偏离行业平均水平，市场风险较高的；

（二）标的证券长期停牌、上市公司发生并购重组等重大事项或出现其他突发情况的；

（三）交易型开放式指数基金融券规模短期内迅速放大的；

（四）短期内应偿还的融券数量占该证券流通股本比例较大的；

（五）融资融券交易量占该证券交易量比例较高的；

（六）融资融券余额占该证券流通市值或者全部标的证券融资融券余额比例较高的；

(七) 本公司认为需要重点关注的其他情形。

**第十条** 本公司对证券公司融资融券担保证券进行统计分析，监测全市场和单一证券公司融资融券业务风险状况，分析单只融资融券担保证券的市场风险程度和集中度可能带来的信用风险，重点关注担保证券的以下情形：

(一) 客户信用证券账户内担保证券的市场风险较高的；

(二) 担保证券长期停牌、上市公司发生并购重组等重大事项或出现其它突发情况的；

(三) 单一及全体证券公司单只担保证券集中度较高的；

(四) 单一客户信用证券账户单只担保证券集中度较高的；

(五) 本公司认为需要重点关注的其他情形。

**第十一条** 本公司对证券公司融资融券客户维持担保比例与违约情况进行统计分析，了解证券公司融资融券客户诚信情况，监测证券公司的授信管理和风险控制状况，重点关注以下情形：

(一) 融资融券整体维持担保比例较低的；

(二) 融资融券维持担保比例较低的客户数量较多的；

(三) 融资融券客户违约次数较多或者违约规模较大的；

(四) 融资融券客户未补仓规模较大的;

(五) 融资融券业务坏账规模较大的;

(六) 本公司认为需要重点关注的其他情形。

**第十二条** 本公司依据证券公司报送的融资融券业务规模及财务状况统计数据, 定期监测证券公司融资融券业务规模的适当性, 重点关注以下情形:

(一) 证券公司融资融券业务总体规模与其净资本比例较高的;

(二) 证券公司单一客户或者单只证券融资融券业务规模与其净资本比例较高的;

(三) 证券公司财务状况急剧恶化或者恶化幅度较大的;

(四) 本公司认为需要重点关注的其他情形。

**第十三条** 本公司监测到融资融券标的证券存在风险或者出现异常情况, 可以向证券公司进行口头提醒或者书面提示; 监测到标的证券风险较高或者异常情况较为严重的, 可视情况采取以下措施, 并及时报告证监会:

(一) 提示证券公司暂停将该证券作为融资买入或者融券卖出的标的证券;

(二) 提示证券公司将该证券调出融资融券标的证券范围;

(三) 本公司认为需要采取的其他措施。

**第十四条** 本公司监测到融资融券担保证券存在风险或者出现异常情况，可以向证券公司进行口头提醒或者书面提示；监测到担保证券风险较高或者异常情况较为严重的，可视情况采取以下措施，并及时报告证监会：

（一）提示证券公司调整该融资融券担保证券折算率；

（二）提示证券公司暂停接受该证券为融资融券担保证券；

（三）本公司认为需要采取的其他措施。

**第十五条** 证券公司出现技术系统故障、法律诉讼、客户群体事件等可能影响融资融券业务正常运行的突发性事件或者重大事项，应当立即向本公司报告，并说明事项的起因、可能引起的后果和应对措施等。

**第十六条** 本公司可根据需要，对证券公司与融资融券业务相关的内部控制制度、业务操作规范、风险管理措施、交易技术系统安全运行状况及对本公司相关业务规则的执行情况等进行现场调查。

本公司发现证券公司融资融券业务运行存在违规行为的，及时报告证监会。

**第十七条** 证券公司融资融券业务存在较高风险或者出现异常情况较为严重的，本公司可以就相关事项对证券公司进行问讯，视情况采取口头提醒、书面提示以及约谈证券公司相关负责人等措施，并及时报告证监会。

## 第四章 统计数据的管理与使用

**第十八条** 本公司负责维护统计监测系统，制定融资融券统计数据和信息的采集、存储、使用、查询等管理制度，确保有关数据和信息的安全。

**第十九条** 本公司建立健全信息安全隔离机制，登录和使用统计监测系统实行严格的权限控制，对操作统计监测系统的所有行为进行强制留痕。

**第二十条** 本公司建立数据和信息管理制度，工作人员对履行职责获得的融资融券敏感数据承担保密义务，不得泄露或者谋取不正当利益。

**第二十一条** 本公司及其工作人员对融资融券统计数据进行客观整理、比对和保存，不得篡改、毁损或者非法使用，不得对外提供虚假统计数据和信息。

**第二十二条** 本公司履行信息发布义务，定期向市场发布以下融资融券相关数据和信息：

- （一）融资融券交易额和余额；
- （二）信用证券账户数量和客户数量；
- （三）融资融券担保证券数量和市值；
- （四）本公司认为需要向市场公布的其他信息。

**第二十三条** 本公司可根据需要向证券公司发布以下相关数据和信息：

- （一）全体证券公司接受的融资融券担保证券市值达到

该证券总市值 30%以上的担保证券名单;

(二) 融资和融券交易规模占标的证券总交易规模的比例;

(三) 融资和融券交易规模占总交易规模的比例;

(四) 本公司认为需要向证券公司发布的其他信息。

## **第五章 附则**

**第二十四条** 本规则所称“以上”、“达到”含本数。

**第二十五条** 本规则已经证监会批准,自 2012 年 8 月 27 日起实施。