

# 关于融资融券标的证券 2023 年第三季度定期调整 有关事项的通知

上证发〔2023〕156 号

各会员单位及其他市场参与人：

为促进融资融券业务健康长远发展，优化标的证券结构，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》）的相关规定及融资融券标的证券（以下简称标的证券）定期评估调整机制，上海证券交易所（以下简称本所）于每季度末对标的证券进行评估并视情况实施调整。现将 2023 年第三季度定期调整的有关事项通知如下：

一、本次融资融券标的股票（以下简称标的股票）范围的调整以优先保留现有标的股票为基本原则，对符合《实施细则》第二十五条规定的本所上市 A 股，按照加权评价指标从大到小排序选取新增标的股票，调整后本所标的股票数量为 1000 只（具体名单详见附件）。

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、本次融资融券标的的交易型开放式指数基金范围的调整依据《实施细则》第二十六条规定，并综合考虑基金类型等因素，调整后本所融资融券标的的交易型开放式指数基金的数量为 185 只（具体名单详见附件）。

三、各会员单位应高度重视，认真做好此次标的证券范围调整的相关业务和技术准备工作，保障此项工作顺利开展和安运行。

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、注册制下首次公开发行的股票及存托凭证不适用本通知规定。

六、本通知自 2023 年 10 月 16 日起施行。本所于 2023 年 7 月 7 日发布的《关于融资融券标的证券 2023 年第二季度定期调整有关事项的通知》（上证发〔2023〕109 号）同时废止。

特此通知。

上海证券交易所

2023 年 10 月 13 日