

# 中国证券金融股份有限公司股票质押式回购交易统计监测规则

## 第一章 总则

第一条 为规范证券公司参与股票质押式回购交易（以下简称“股票质押回购”）数据报送与统计，加强风险统计监测，根据中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）有关规定和授权，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”）建立股票质押回购统计监测系统，汇集、统计、比对相关数据，统计分析证券公司参与股票质押回购情况，监测相关风险。

第三条 证券公司参与股票质押回购，应当按照本规则的规定报送股票质押回购数据，及时报告相关风险控制情况。

## 第二章 数据报送与统计

第四条 本公司制定股票质押回购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股票质押回购资金融入方与资金融出方的基本资料，股票质押回购相关账户的持仓、交易及合约等数据。

本公司为履行股票质押回购信息统计与风险监测职责，可要求证券公司定期或者不定期报送股票质押回购情况和相关信息。

第五条 证券公司应当建立股票质押回购数据和信息报送制度，及时、准确、真实、完整地向本公司报送股票质押回购相关数据和信息。

证券公司不能在规定时间内报送数据和信息，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，并向本公司提供书面说明。

第六条 证券公司连续多次出现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，本公司可视情况采取口头提醒、书面提示等措施。

证券公司出现虚报、瞒报、伪造、篡改股票质押回购数据和信息的，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 本公司建立股票质押回购统计制度，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**

第八条 本公司对证券公司股票质押回购风险进行监测，通过指标预警、压力测试和情景分析等方式，重点关注标的证券质押集中度、流动性，融入方负债和履约保障比例，

资金用途，证券公司股票质押回购运行、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股票质押回购发展需要，确定和调整监控重点。

第九条 本公司对股票质押回购数据进行统计分析，监测全市场股票质押回购的系统性风险，重点关注以下情形：

（一）初始交易较活跃的；

（二）待购回初始交易金额及其占 A 股总市值、占证券公司净资本的比例较高或增加较快的；

（三）全市场平均履约保障比例较低或下降幅度较大的；

（四）履约保障比例降至《股票质押回购交易业务协议》（以下简称《业务协议》）约定预警线或平仓线以下的待购回初始交易金额及其占比较大的；

（五）全市场违约处置规模较大或增加较快的；

（六）本公司认为需要重点关注的其他情形。

第十条 本公司对股票质押回购标的证券交易金额、待购回证券市值等进行统计，分析单只标的证券质押的市场风险程度和集中度可能带来的风险，重点关注标的证券的以下情形：

（一）标的证券待购回初始交易金额较高或增加较快的；

（二）待购回证券数量占该证券 A 股总股本的比例较高的；

（三）待购回无限售条件股票数量占该证券 A 股流通股本的比例较高的；

（四）回购到期日在一个月内存待购回证券数量占该证券 A 股总股本的比例较高的；

（五）标的证券平均履约保障比例较低或下降幅度较大的；

（六）履约保障比例降至《业务协议》约定预警线或平仓线以下的标的证券待购回初始交易金额较大的；

（七）单只 A 股股票市场整体质押比例较高的；

（八）标的证券价格短期大幅波动，估值明显偏离行业平均水平，市场风险较高的；

（九）标的证券所属上市公司上一年度亏损且本年度仍无法确定能否扭亏的；

（十）标的证券长期停牌、对应上市公司发生并购重组等重大事项或存在退市风险的；

（十一）标的证券对应的上市公司及其高管、实际控制人正在被有关部门立案调查的；

（十二）标的证券进入违约处置规模较大的；

（十三）本公司认为需要重点关注的其他情形。

第十一条 本公司对证券公司股票质押回购融入方履

约保障比例与违约情况进行统计分析，了解证券公司股票质押回购融入方诚信情况，监测证券公司的融入方适当性管理、授信管理和风险控制状况，重点关注以下情形：

（一）融入方待购回初始交易金额及其占证券公司净资本的比例较高的；

（二）融入方履约保障比例降至《业务协议》约定预警线或平仓线以下的；

（三）融入方待购回风险证券市值较大的；

（四）融入方为上市公司董事、监事、高级管理人员、持有上市公司股份百分之五以上的股东及其一致行动人，将其持有的标的证券累计质押比例较高的；

（五）融入方发生延期购回且金额较大的；

（六）融入方违约次数较多或者违约处置金额较大的；

（七）融入方通过违约处置不足以支付本息，应当继续承担偿付责任的规模较大的；

（八）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股票质押回购规模及财务状况统计数据，定期监测证券公司股票质押回购运行的风险情况，重点关注以下情形：

（一）证券公司待购回初始交易金额与其净资本比例较高的；

（二）回购到期日在一个月内的待购回初始交易金额

及其占比较大的；

（三）证券公司单一融入方或者单只标的证券待购回初始交易金额与其净资本比例较高的；

（四）证券公司单只标的证券待购回数量占该证券 A 股总股本比例较高的；

（五）证券公司履约保障比例降至《业务协议》约定预警线或平仓线以下的融入方待购回金额较大及其占比较高的；

（六）证券公司财务状况急剧恶化或者恶化幅度较大的；

（七）本公司认为需要重点关注的其他情形。

第十三条 本公司依据证券公司报送的股票质押回购融出资金来源等统计数据，定期监测证券公司自有资金出资的风险情况，重点关注以下情形：

（一）自有资金出资规模占该公司净资本比例较高的；

（二）自有资金出资对应合约平均履约保障比例较低的；

（三）自有资金出资对应单只标的证券待购回数量占该证券 A 股总股本比例较高的；

（四）自有资金出资对应高风险标的证券待购回市值占比较高的；

（五）本公司认为需要重点关注的其他情形。

第十四条 本公司定期监测证券公司集合资产管理计划或定向资产管理客户参与股票质押回购的风险情况，重点关注以下情形：

（一）单一集合资产管理计划或定向资产管理客户接受单只 A 股股票的质押比例较高的；

（二）证券公司以自有资金参与集合资产管理计划，持有份额规模较大的；

（三）本公司认为需要重点关注的其他情形。

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股票质押回购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 本公司发现证券公司股票质押回购存在较高风险，出现异常情况较为严重，或者存在违规行为的，及时报告证监会。

#### **第四章 统计数据的管理与使用**

第十七条 本公司负责维护统计监测系统，制定股票质押回购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。

第十八条 本公司建立健全信息安全隔离机制，通过统计监测系统界面使用数据的行为实行账户权限控制，且全程

留痕。

第十九条 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股票质押回购敏感数据承担保密义务，不得泄露或者谋取不正当利益。

第二十条 本公司及其工作人员对股票质押回购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。

## 第五章 附则

第二十一条 本规则所称“以上”“以下”含本数。

第二十二条 本规则已经证监会备案，自2018年1月15日起实施。