
光大证券股份有限公司

科创板股票融资融券交易风险提示函

尊敬的投资者：

科创板股票因特殊发行定价、特殊交易规则及退市机制可能引致特别风险。为了使您充分了解您在信用账户内参与上海证券交易所科创板股票交易的相关风险，请您认真阅读本特别提示函（以下简称《特别提示函》），充分认识在信用账户内参与科创板股票交易（包括融资买入、融券卖出、以自有资金买入及划转担保物）的特别提示。

一、科创板新股发行全部采用询价定价方式，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。同时，因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，发行定价难度较大，科创板股票上市后可能存在较大的股价波动风险。

二、科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%，因此，科创板股票交易面临更大的股份波动风险。

三、科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。

四、因科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制且退市制度较其它A股股票更严格，在同等杠杆倍数下，投资者以科创板股票进行融资融券交易的潜在损失风险可能高于以其它A股股票为标的证券的融资融券交易。

五、投资者融资买入、融券卖出科创板股票的单笔申报数量、最小价格变动单位、有效申报价格范围等与其它A股股票的融资融券交易存在差异，投资者应避免因前述差异而产生无效融资融券交易申报。

六、为防范价格波动等风险，本公司有权对科创板股票设置较严格的可充抵保证金证券和标的证券准入条件、较低的折扣比率、信用账户单一证券持仓集中

度、信用账户单一板块持仓集中度，较高的融资融券保证金比例、预警线、平仓线、追保线，可能因此无法完全满足投资者的融资融券交易需求，对投资者的交易决策可能产生一定影响，可能造成的损失由您自行承担。

七、本公司可能根据投资者的信用账户维持担保比例的变化情况等因素调整单一板块持仓集中度要求。您的信用账户单一板块持仓集中度达到外部监管或本公司规定的上限时，本公司有权暂停接受您信用账户的融资买入、以自有资金买入、融券卖出该板块证券，将该板块证券从普通证券账户转入信用证券账户，调减或取消您的授信额度等措施，可能造成的损失由您自行承担。

本《特别提示函》的提示事项仅为您在信用账户内开展科创板股票交易的特有风险，未能详尽列明科创板股票交易的所有风险，您在参与交易前，应当认真阅读有关法律法规和交易所业务规则等相关规定，对其他可能存在的风险因素也应当有所了解和掌握，并确信自己已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与科创板股票交易遭受难以承受的损失。

本人/本机构承诺：已充分了解科创板股票交易业务规则及全部风险，知晓在信用账户内开展科创板股票交易，尤其是进行融资买入或融券卖出交易将面临更大的风险。在本《特别提示函》上签字，即表明本人/本机构已经理解并愿意自行承担在本人信用账户内参与科创板股票交易的风险和损失。

证件类型：
证件号码：
投资者签名：

（当投资者为个人时，由本人签署。当投资者为机构时，由法定代表人/执行事务合伙人或其授权代理人签署，并加盖公司公章，法定代表人/执行事务合伙人签章。当投资者为金融产品时，由管理人的法定代表人/执行事务合伙人或其授权代理人签署，并加盖管理人公司公章，法定代表人/执行事务合伙人签章。）

签署日期： 年 月 日