

## 海通证券股份有限公司科创板融资融券交易风险揭示书

尊敬的客户：

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证券(含存托凭证,下同)交易的相关风险,请您认真阅读本风险揭示书,充分认识在信用账户内参与科创板证券交易的相关风险。

### 一、科创板特殊发行定价及交易机制引致的股价波动风险

科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向,可能采用直接定价或者询价定价的方式发行。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,科创板证券上市后可能存在较大的价格波动风险。

科创板证券竞价交易的价格涨跌幅限制比例为20%,首次公开发行上市后的前5个交易日、进入退市整理期的首日以及上交所认定的其他情形下不实行涨跌幅限制,因此,科创板交易面临更大的股价波动风险。

若您的信用账户持有科创板证券,上述科创板特殊发行、定价及交易机制引致的价格波动风险与融资融券交易的杠杆效应叠加后,容易导致您的信用账户维持担保比例降低至补仓或平仓维持担保比例以下,甚至可能在短时间内造成您信用账户资不抵债,您可能因此蒙受巨大的经济损失。

为防范科创板证券价格波动较大的风险,本公司有权针对科创板设置更加严格的融资融券标的证券范围、可充抵保证金证券范围及折算率、保证金比例、补仓/平仓/提取担保物维持担保比例及单一证券集中度等;有权综合或单独考虑科创板、创业板及交易机制类似的其它证券等设置担保证券板块集中度、融资/融券余额限额等风险阈值。本公司有权动态调整上述风险控制阈值。上述措施可能影响您担保品买入、转入及转出、可融资/可融券的品种、数量以及融资融券合约展期等,造成的损失由您自行承担。

特别提醒您注意,本公司还有权针对科创板执行差异化的公允价格估值标准,公允价格可以为零。对于设置公允价格的证券,计算维持担保比例及保证金可用余额时,该证券的担保证券市值按公允价格计算。当公允价格为零或远低于市价时,可能使您信用账户维持担保比例在短期内急剧下降,出现维持担保比例低于补仓维持担保比例、平仓维持担保比例、甚至资不抵债的情形,造成的损失由您自行承担。

### 二、科创板特殊退市机制引致的风险

科创板证券可能主动终止上市，也可能因触及退市情形被终止上市。您应当充分了解科创板退市相关规定及其政策变化，密切关注退市风险，及时从符合《中华人民共和国证券法》规定的信息披露平台获取相关信息。

本公司有权因您信用账户内担保证券所属科创板上市公司已经或可能终止上市而采取将该证券调出可充抵保证金证券范围、将其公允价值调整为零或要求您提前归还负债等措施，可能造成的损失由您自行承担。

### 三、科创板融券交易的特有风险

若您信用账户开通了科创板融券权限，请您详细了解以下风险：

1、若您为科创板上市公司的战略投资者或其关联方，在承诺持有期限内，本公司将禁止您融券卖出您作为战略投资者的科创板证券。并且请您知悉，在承诺持有期限内，您不得通过出借证券给其它方由其融券卖出的方式变相提前减持科创板证券。因此造成的法律后果由您自行承担。

2、请您知悉，您不得通过借入战略投资者持有的承诺持有期限内的证券并融券卖出的方式协助其提前减持科创板证券。因此造成的法律后果由您自行承担。

本风险揭示书的揭示事项仅为您在信用账户内开展科创板交易的特有风险，未能详尽列明融资融券交易及科创板交易的所有风险，您在信用账户内参与科创板交易前，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以及《海通证券股份有限公司融资融券交易风险揭示书》，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交易业务规则及全部风险，知晓在信用账户内开展科创板交易，尤其是进行融资买入或融券卖出交易将面临更大的风险。

本人/本机构承诺已经理解并愿意自行承担在本人/本机构信用账户内参与科创板交易的风险和损失。

信用资金台账：

信用证券账户：

投资者（或授权代理人）签字：

签署日期：