

深证会 2016 291 号

(2001年11月30日实施；2006年5月15日第一次修订；2011年11月17日第二次修订；2012年11月30日第三次修订；2013年7月29日第四次修订；根据2013年11月30日《关于修改〈深圳证券交易所交易规则〉(2013年修订)》第3.1.4条的决定》修订；根据2015年1月9日《关于修改〈深圳证券交易所交易规则〉第3.1.4条的通知》修订；根据2015年12月4日《关于修订〈深圳证券交易所交易规则〉新增第3.1.4条》修订；根据2016年4月28日《关于修改〈深圳证券交易所交易规则〉第3.1.4条》修订；根据2016年9月30日《关于修改〈深圳证券交易所交易规则〉涉及交易参与者若干条款的通知》修订)

目 录

第一章 总则.....	4
第二章 交易市场.....	4
第一节 交易场所.....	4
第二节 交易参与者.....	4
第三节 交易品种与方式.....	5
第四节 .....	5
第三章 证券买卖.....	6

第一节	证券回购交易	6
第二节	委托	7
第三节	申报	8
第四节	竞价	12
第五节	成交	13
第六节	大宗交易	15
第七节	融资融券交易	18
第八节	债券回购交易	19
	其他交易事项	20
第一节	转托管	20
第二节	开盘价与收盘价	21
第三节	挂牌、摘牌、停牌与复牌	21
第四节	除息与除权	22
第五节		23
第六节	指数熔断	24
第五章	交易信息	25
第一节	证券回购交易	25
第二节	即时行情	25
第三节	证券指数	26
第四节	证券交易公开信息	27
第六章	证券交易监督	28
第七章	交易异常情况处理	31
	交易纠纷	32
	交易费用	33
第十章	附则	33





易

规定。

2.2.2 交易单元，是指交易参与者向本所申请设立的、参与本所证券交易与接受本所监管及服务的基本业务单位。

2.2.3 交易单元和交易权限的具体规定，由本所另行制定。

### 第三节 交易品种与方式

2.3.1 在本所市场上市交易的品种包括：

(一) 股票；

(二) 基金；

(三) 债券；

(四) 权证；

2.3.2 证券交易的方式包括：

(一) 现券交易；

(二) 回购交易；

(三) 融资融券交易；

(四) 经证监会批准的其他交易方式。

### 第四节 交易时间

2.4.1 本所交易日为每周一至周五。

国家法定节假日除外。

2.4.2 证券竞价交易的时间为每个交易日 9:15 至 9:25

9:30 至 11:30、13:00 至 14:57 为连续竞价时间，14:57 至 15:00 为收盘集合竞价时间。

经证监会批准，本所可以调整交易时间。

2.4.3 交易时间内因故停市，交易时间不作顺延。

### 第一节 一般规定

3.1.1 会员接受投资者的买卖委托后，应当确认投资者具备相应资金，并按照接受的内容和条件执行，承担相应的交易责任，交收责任。

会员接受投资者买卖委托达成交易的，投资者应当向会员交付其委托会员卖出的证券或其委托会员买入证券的款项，会员应当向投资者交付卖出证券所得款项或买入的证券。

3.1.2 交易参与人通过报盘系统向本所交易主机发送买卖申报，交易参与人。

3.1.3 交易参与人应当按有关规定妥善保管委托和申报记录。

3.1.4 易的除外。

当在证券的回购或融券，是指投资者买入的证券，经确认成交交收完成前全部或部分卖出。

基金、货币市场基金、跨境交易型开放式基金、跨境上市开放式基金竞价交易实行当日回转交易，B股实行次交易日起回转交易。

前款所述的跨境交易型开放式基金和跨境上市开放式基金仅限于所跟踪指数成份证券或投资标的实施当日回转交易的开放式基金。

方式。

3.1.5 本所不办理委托电话委托、实时行情委托、竞价委托、

## 第二节 委托

3.2.1 投资者买卖证券，应当以实名方式开立证券账户和资金账户，并与会员签订证券交易委托协议。协议生效后，投资者为该会员经纪业务的客户。

3.2.2 投资者可以通过书面或电话、自助终端、互联网等自助委托方式委托会员买卖证券。

投资者通过自助委托方式买卖证券的，会员应当与其签订自助委托协议。

3.2.3 投资者通过自助委托方式进行自助委托的，应当按相关规定操作。

会员应当记录投资者委托的电话号码、网卡地址、IP 地址等信息。

3.2.4 自助委托应当记录下列信息：

- (一) 证券账户号码；
- (二) 证券代码；
- (三) 买卖方向；
- (四) 委托数量；
- (五) 委托价格；
- (六) 本所及会员要求的其他内容。

3.2.5 投资者可以采用限价委托或市价委托的方式委托会员

买卖证券。

~~限价委托 是指投资者委托会员按其限定的价格买卖证券。会员~~  
必须按限定的价格或低于限定的价格申报买入证券；按限定的价格或高于限定的价格申报卖出证券。

市价委托，是指投资者委托会员按市场价格买卖证券。

3.2.6 投资者可以撤销委托的未成交部分。

3.2.7 被撤销或失效的委托，会员应当在确认后及时向投资者  
~~说明原因并退还保证金。~~

### 第三节 申报

3.3.1 本所接受 ~~交易参与人~~ ~~竞价交易申报的时间为每个交易~~  
日 9:15 至 9:25、9:30 至 11:30、13:00 至 15:00。

每个交易日 9:20 至 9:25、14:57 至 15:00 ~~本所交易主机不接~~  
受参与竞价交易的撤销申报；在其他接受申报的时间内，未成交申  
报可以撤销。

本所可以调整接受申报的时间。

3.3.2 会员应当按照接受投资者委托的时间先后顺序及时向  
本所申报。

~~申报申报撤销申报经本所交易主机确认后应当无效。~~

3.3.3 ~~本所接受交易参与人的限价申报和市价~~  
申报。

3.3.4 ~~本所可以根据市场需要，接受下列类型的市价申报。~~

- (一) 对手方最优价格申报；
- (二) 本方最优价格申报；
- (三) 最优五档即时成交剩余撤销申报；

(四) 即时成交剩余撤销申报;

(五) 大额订单成交撮合申报;

(六) 本所规定的其他类型。

对手方最优价格申报,以申报进入交易主机时集中申报簿中对手方队列的最优价格为其中报价格。

本方最优价格申报,以申报进入交易主机时集中申报簿中本方队列的最优价格为其中报价格。

最优五档即时成交剩余撤销申报,以对手方价格为成交价,与对手方最优五档申报队列依次成交,未成交部分自动撤销。

即时成交全额申报,以对手方价格为成交价,与申报进入交易主机时集中申报簿中对手方所有申报队列依次成交,未成交部分自动撤销。

全额成交或撤销申报,以对手方价格为成交价,如与申报进入交易主机时集中申报簿中对手方所有申报队列依次成交能够使其完全成交的,则依次成交,否则申报全部自动撤销。

3.3.5 市价申报只适用于无价格涨跌幅限制证券连续竞价期间的交易,其他交易时间,交易主机不接受市价申报。

3.3.6 本方最优价格申报进入交易主机时,集中申报簿中本方无申报的,申报自动撤销。

其他市价申报当申报进入交易主机时,集中申报簿中对手方无申报的,申报自动撤销。

3.3.7 限价申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、交易

申报指令应当包括申报类型、证券账户号码、证券代码、申报日期、交易单元代码、证券营业部识别码、买卖方向、数量等内容。

申报指令应当按本所规定的格式传送。

本所可以根据市场需要，调整申报的内容。

3.3.8 通过竞价交易买入股票或基金的，申报数量应当为 100 股（份）或其整数倍。

卖出股票或基金时，余额不足 100 股（份）部分，应当一次性申报卖出。

3.3.9 通过竞价交易买入债券以 10 张或其整数倍进行申报。买入、卖出债券质押式回购以 10 张或其整数倍进行申报。

卖出债券质押式回购 10 张部分，应当一次性申报卖出。

债券以人民币 100 元面额为 1 张，债券质押式回购以 100 元标准券为 1 张。

3.3.10 股票（基金）竞价交易单笔申报最大数量不得超过 100 万股（份），债券（债券质押式回购）申报最大数量不得超过 100 万张。

3.3.11 债券质押式回购的计价单位按照《证券交易所公司债券质押式回购业务实施细则》的规定，股票交易的计价单位为“每份基金价格”，债券交易的计价单位为“每百元面值的债券”，债券质押式回购交易的计价单位为“每百元面值的债券”。

3.3.12 债券交易可以采取净价交易或全价交易的方式。

净价交易，是指买卖债券时以不含有应计利息的价格申报并成交。

全价交易，是指买卖债券时以含有应计利息的价格申报并成交。

交。

3.3.13 A 股交易的申报价格最小变动单位为 0.01 元人民币；  
基金、债券、债券质押式回购交易的申报价格最小变动单位为 0.001  
元人民币；B 股的申报价格最小变动单位为 0.01 港元。

3.3.14 本所可以根据市场需要，调整证券单笔买卖申报数量  
和申报价格的最小变动单位。

3.3.15 涨跌幅限制：本所对股票、基金交易实行价格涨跌幅限制，涨  
跌幅限制比例为 10%，ST 和 \*ST 等被实施特别处理的股票价格涨跌幅  
限制比例为 5%。经证监会批准，本所可以调整证券的涨跌幅限制  
比例。

3.3.16 涨跌幅限制价格的计算公式为：涨跌幅限制价格=前收  
盘价×(1±涨跌幅限制比例)。

计算结果按照四舍五入原则取至价格最小变动单位。  
涨跌幅限制价格与前一交易日涨跌幅限制价格不同且涨跌幅限制  
单位的，以前收盘价增减一个价格最小变动单位为涨跌幅限制价  
格。

3.3.17 涨跌幅限制：本所对股票、基金交易实行价格涨跌幅限制：  
（一）上市首日；

（二）新股上市首日；

（三）复牌上市首日；

（四）证监会或本所认定的其他情形。

3.3.18 申报当日有效。每笔竞价交易的申报不能一次全部成

3.3.4 申报类型：本所实行市价申报、限价申报、大宗交易申报、

（五）市价申报类型除外。

## 第四节 竞价

### 3.4.1 证券竞价交易采用集合竞价和连续竞价两种方式。

集合竞价，是指对一段时间内接受的买卖申报，一次性集中撮合的竞价方式。

连续竞价，是指对买卖申报逐笔连续撮合的竞价方式。

3.4.2 买入有价格涨跌幅限制的证券，没有涨跌幅限制时，涨跌幅限制范围一致，在价格涨跌幅限制以外的申报为无效申报，超过涨跌幅限制的申报为无效申报。

3.4.3 买卖无价格涨跌幅限制的证券，按下列方法确定有效竞价范围：

(一)股票上市首日集合竞价的有效竞价范围为前收盘价的 900% 以内，连续竞价、盘中临时停牌复牌集合竞价、收盘集合竞价的有效竞价范围为最近成交价的上下 10%；

(二)债券上市首日开盘集合竞价的有效竞价范围为发行价格的上下 30%，连续竞价、收盘集合竞价的有效竞价范围为最近成交价的上下 10%；

(三)债券质押式回购非上市首日开盘集合竞价的有效竞价范围为前收盘价的上下 100%；

范围为最近成交价的上下 100%。债券质押式回购上市首日的有效竞价范围设置，由本所另行规定。

有效竞价范围计算结果按照四舍五入原则取至价格最小变动单位。

该证券的价格最小变动单位为有效竞价范围。

3.4.4 买卖无价格涨跌幅限制的证券，超过有效竞价范围的申报不能即时参加竞价，暂存于交易主机；当成交价波动使其进入有效竞价范围时，交易主机自动撤销申报，重新竞价。

3.4.5 无价格涨跌幅限制的证券在集合竞价期间没有产生成交的，继续六日以下，按下列方式调整有效竞价范围：

- (一)有效竞价范围内的最高买入申报价高于即时行情显示的前收盘价或最近成交价，以最高买入申报价为基础调整有效竞价范围；
- (二)有效竞价范围内的最低卖出申报价低于即时行情显示的前收盘价或最近成交价，以最低卖出申报价为基础调整有效竞价范围。

### 3.4.6

## 第五章 成交

3.5.1 证券竞价交易按价格优先、时间优先的原则撮合成交。价格优先的原则为：较高价格买入申报优先于较低价格买入申报，较低价格卖出申报优先于较高价格卖出申报。

时间优先的原则为：买卖方向、价格相同的，先申报者优先于后申报者。先后顺序按交易主机接受申报的时间确定。

### 3.5.2 集合竞价时成交价的确定原则为：

- (一)可实现最大成交量；
- (二)未成交申报最低买入申报价格和最高卖出申报价格。



成交数据为准。

3.5.6 证券交易的清算交收业务，应当按照本所指定的登记结算机构的规定办理。

## 第六节 大宗交易

3.6.1 在本所进行的证券交易符合以下条件的，可以采用大宗交易方式：

(一) A 股单笔交易数量不低于 30 万股，或者交易金额不低于 200 万元人民币；

(二) B 股单笔交易数量不低于 3 万股，或者交易金额不低于 20 万元港币；

(三) 其他单笔交易数量不低于 200 万份，或者交易金额不低于 200 万元人民币；

科创板单笔交易数量不低于 5 千张，或者交易金额不低于 50 万元人民币。

3.6.2 交易双方协商一致采取大宗交易方式交易的，可以采用协议大宗交易方式。

协议大宗交易，是指大宗交易双方互为指定交易对手方，协商确定交易价格及数量的交易方式。

盘后定价大宗交易，是指证券交易收盘后按照时间优先的原则，以证券当日收盘价或证券当日成交量加权平均价格对大宗交易买卖申报逐笔连续撮合的交易方式。

3.6.3 采用协议大宗交易方式的，本所接受申报的时间为每个 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。

采用盘后定价大宗交易方式的，本所接受申报的时间为每个交易日的15:05至15:30。

当天全天停牌、处于临时停牌期间或停牌至收市的证券，本所不接受其协议大宗交易申报。

当天全天停牌或停牌至收市的证券，本所不接受其盘后定价大宗交易申报。

3.6.4 除盘中涨跌幅限制异常波动证券外，盘后定价大宗交易成交价格在该证券当日涨跌幅限制价格范围内确定。

盘中涨跌幅限制异常波动证券的盘后定价大宗交易成交价格在该证券当日涨跌幅限制价格范围的上下30%之间确定。

3.6.5 本所接受下列类型的大宗交易申报：

(一) 意向申报；

(二) 成交申报；

(三) 定价申报；

3.6.6 协议大宗交易意向申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向和大宗交易单元代码等内容。意向申报不承担成交义务，意向申报指令可以撤销。

协议大宗交易成交申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量、对手方交易单元代码、约定号等内容。

成交申报指令应当包含成交价格、数量、对手方交易单元代码、约定号等要素，且成交价格、数量等要素的匹配成交申报进行成交确认。

参与者可以提交成交申报，按指定的价格与定价申报全部或部分成以撤销。定价申报每笔成交的数量或交易金额，应当满足协议大宗交易最低限额的要求。

3.6.7 权益类证券协议大宗交易的成交确认时间为每个交易日 15:00 至 15:30、每个非交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。

3.6.8 盘后定价大宗交易的申报时间应当包括证券上市首日

从该日起次日

盘后定价大宗交易的价格类型包括：

(一) 证券当日收盘价；

撤销申报接受申报的时间为：未成交申报可以

3.6.9 本所在交易时间内通过交易系统或交易所网站即时公布交易信息，包括

(一) 债券协议大宗交易的报价信息，内容包括：证券代码、证券简称、申报数量、申报价格等；债券协议大宗交易的成交信息，内容包括：证券代码、证券简称、当日最新价、当日最高价、当日最低价、总成交数量、总成交金额、总成交笔数

(二) 盘后定价大宗交易的交易信息，内容包括：证券代码、证券简称、申报数量、申报价格、成交数量、成交金额以及实时买入或卖出的申报数量等。

3.6.10 本所在每个交易日结束后通过交易所网站公布以下交易单元的名称；

交易单元的名称；

(二) 单只证券盘后定价大宗交易的累计成交量、累计成交金额，及该证券当日平均成交价，卖出金额是十五字会员证券营业部或交易单元的名称和各自的买入、卖出金额；

(一) 单只证券大宗交易的买卖成交数量、买卖成交金额，及该证券当日平均成交价，卖出金额是十五字会员证券营业部或交易单元的名称和各自的买入、卖出金额。

3.6.11 大宗交易不纳入本所即时行情和指数的计算，成交量在大宗交易结束后计入当日该证券成交总量。

3.6.12  
对应的证券或资金。

### 第七节 融资融券交易

3.7.1 融资融券交易，是指投资者向会员提供担保物，借入资金买入证券或借入证券并卖出的行为。

3.7.2  
交易权限，并通过融资融券专用交易单元进行。

3.7.3 投资者进行融资融券交易，应当按照规定开立信用证券账户，并开立和注销，根据会员和本所指定登记结算机构的有关规定办理。

3.7.4 本所以对融资融券交易的下列事项作出规定：

(一) 交易业务流程；

(二) 可用于融资买入和融券卖出的证券

品种范围(三)

(四) 融资融券的最长期限；

(五) 初始保证金比例及最低维持担保比例；

(六) 信息披露与报告制度；

(七) 市场风险控制措施；

(八) 其他事项。

3.7.5 会员向投资者融资、融券前，应当与其签订融资融券合同，向其讲解融资融券业务规则和合同内容，并要求其签署风险揭示书。

### 3.7.6

定的，本所认为必要时，可以暂停全部或部分证券的融资融券交易，并予以公告。

3.7.7 融资融券交易的具体规定，由本所另行制定，报证监会

## 第八节 债券回购交易

3.8.1 债券回购交易采取质押式回购交易等方式。

债券质押式回购交易是指债券持有人在将债券质押并将在该期限内按约定利率计算的该笔资金于回购期满前六日对手方进行质押融资的同时，交易双方约定在回购期满后返还资金和回购债券的行为。交易参与人为“融资方”，对手方为“融券方”。

3.8.2 会员应当与参与债券质押式回购交易的投资者签订倩

券回购委托协议，并设立标准券明细账。

标准券是指可用于回购质押的债券品种按标准券折算比率折算形成的，可用于融资的额度。标准券折算比率是指各债券现券与标准券的折算比率。

标准券及标准券折算比率的具体规定，由本所指定登记结算机构制定。

3.8.3 债券回购交易申报中，融资方按“买入”方向进行申报，融券方按“卖出”方向进行申报。

3.8.4 债券回购交易申报时，申报价格不得超过前收盘价的102%，且不得低于100%。

3.8.5 债券回购交易回购次日应行，次日... 回购交易达成后，初次结算的结算价格为100元，回购到期二次结算的结算价格为回购价。回购价是指每百元资金的本金和利息之和。回购价的具体计算方法，由本所另行制定。

## 第一节 转托管

4.1.1 投资者可以以同一证券账户在单个或多个会员的不同证券营业部买入证券。

4.1.2 投资者买入的证券可以通过原买入证券的交易单元委托卖出，也可以向原买入证券的交易单元发出转托管指令，转托管

## 第二节 收盘价与开盘价

4.2.1 证券的开盘价通过集合竞价方式产生，不能作为该证券当日该证券的第一笔成交价。

4.2.2 证券的开盘价通过集合竞价方式产生，不能通过集合竞价产生的，以连续竞价方式产生。

4.2.3 证券的收盘价通过集合竞价的方式产生。收盘集合竞价不能产生收盘价或未进行收盘集合竞价的，以当日该证券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易）为收盘价。

当日无成交的，以前收盘价为当日该证券的收盘价。

## 第三节 挂牌、摘牌、停牌与复牌

4.3.1 本所对上市证券实施挂牌交易。

4.3.2 证券上市期届满或依法不再具备上市条件的，本所终止其上市交易，予以摘牌。

4.3.3 证券交易出现第 6.1 条规定的异常交易行为或情形的，本所可以根据实际情况对相关证券实施停牌，并在公告中披露停牌公告，以及相关交易、股份和基金份额统计信息。有披露义务的当事人应当按

最佳价格及时复牌并披露复牌原因。

4.3.4 无价格涨跌幅限制股票交易出现下列情形的，本所可以对其实施盘中临时停牌措施：

（一）盘中成交价较当日开盘价首次上涨或下跌达到或超过 10% 的，临时停牌时间为 1 小时；

（二）盘中成交价较当日开盘价首次上涨或下跌达到或超过 20% 时，停牌至 14:57；

50%” “停牌时间” 1小时。

盘中临时停牌具体时间以本所公告为准。临时停牌时间跨越14:57的，于14:57前对已接受的申报进行复牌集合竞价，再行复牌进行收盘集合竞价。

盘中风险控制措施。

#### 4.3.5

盘中临时停牌或摘牌情形及停牌时间

4.3.6 证券在 9:25 前停牌的，当日复牌时对已接受的申报实

证券在 9:30 前停牌或摘牌的，当日复牌时对已接受的申报进行集合竞价；复牌后继续当日交易。实行挂

牌期间 可以申报 也可以撤单

停牌期间不揭示集合竞价参考价、匹配量和未匹配量。

4.3.7 证券的挂牌、摘牌、停牌与复牌，由本所或证券发行人予以公告。

4.3.8 证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的其他规定，按照本所上市规则及其他有关规定执行。

### 第四节 除权与除息

4.4.1 上市证券发生权益分派、公积金转增股本、配股等情况，本所在权益登记日（B 为最后交易日）次日交易日起对该证券作除息除权除息处理，本所另有规定的除外。

4.4.2 除权（息）参考价计算公式为：

除权（息）参考价 = (前收盘价 - 现金红利) + 配股价格 × 股份

变动比例] ÷ (1+股份变动比例)

证券发行人认为有必要调整上述计算方法时，可以向交易所提出调整申请并说明理由。经本所同意的，证券发行人应当向市场公布

#### 4.4.3

涨跌幅度的基准。本所另有规定的除外。

### 第五节 退市整理期间交易事项

4.5.1 退市整理期间，上市公司股票进入退市整理板交易，不在三板、中小企业板或者创业板行情中揭示。

股票进入退市整理板交易的上市公司，其发行的公司债券、权证等衍生品种可以同时进入退市整理板交易，相关交易事项由本所

4.5.2 本所对股票退市整理期间交易实行价格涨跌幅限制，涨跌幅限制比例为 10%。

在退市整理期间，本所对股票退市整理期间涨跌幅限制的比例。

4.5.3 除金额类品种外，退市整理期间，本所对股票退市整理期间交易金额。

4.5.4 退市整理期间交易不纳入本所指数。

4.5.5 股票退市整理期间交易不纳入本所指数的计算。成交量

## 第六节

### 4.6.1 沪深 300

(一) 沪深 300 指数较前一交易日收盘首次上涨、下跌达到或超过 5% 但未达到 7% 的，指数熔断时间为 15 分钟。指数熔断时间跨越 11:30 的，于 13:00 起继续计算。熔断时间跨越 14:57 的，于 14:57 收市交易单进行收盘集合竞价，但 14:45 数熔断至 15:00。

(二) 沪深 300 指数较前一交易日收盘上涨、下跌达到或超过 7% 的，指数熔断至 15:00，当日不恢复交易。

9:30 前出现第 (一)、(二) 项情形的，于 9:30 开始实施指数

14:57 至 15:00 期间不再进行指数熔断。

指数熔断的具体实施时间以本所公告为准。

4.6.2 本所交易日为股指期货合约交割日的一天且指数熔断时间跨越 11:30



5.2.2 连续竞价期间，即时行情内容包括：证券代码、证券简称、当日开盘价、前收盘价、最大成交量、当日最高价、当日最低价、成交数量、当日累计成交金额、实时最高五个价位买入申报价和数量、实时最低五个价位卖出申报价和数量等。

5.2.3 即时行情显示的前收盘价为该证券上一交易日的收盘价，但下列情形的除外：

行情显示的前收盘价为其发行价；

其暂停上市前最后交易日的收盘价或恢复上市前最近一次增发价；

因上市首日，其即时行情显示的前收盘价为其前一日交易日的收盘价。

0.001

(四) 证券除权(息)日，其即时行情显示的前收盘价为该证券除权(息)参考价；

(五) 本所规定的其他情形。

5.2.4 即时行情显示所允许的报价系统位价，交易参与人应在本所许可的范围内使用。

5.2.5 本所可以根据市场需要，调整即时行情发布的方式和内容。

### 第三节 证券指数

5.3.1 本所编制综合指数、成份指数、分类指数等证券指数，以反映证券交易总体价格或某类证券价格的变动和走势，随即时行情发布。

5.3.2 证券指数的设置和编制方法，由本所另行制定。

## 第四节 证券交易公开信息

### 5.4.1 前次募集资金使用情况的披露

日当日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到±20%的；

卖出金额：

(一) 连续三个交易日内日收盘价涨跌幅偏离值累计达到±20%的；

(二) ST 和\*ST 股票连续三个交易日内日收盘价涨跌幅偏离值累计达到±12%的；

手率的比值达到 30 倍，且该证券连续三个交易日内的累计换手率达到 20%的；

以中国证监会认定的属于异常波动的其他情形。

异常波动指标自相关信息披露义务人发布异常波动公告或复牌之日起重新计算。

3.3.17 各规定的不作价格涨跌幅限制股票不适用异常波动指标的计算。

5.4.4 证券交易公开信息涉及机构专用交易单元的，公布名称

6.1 交易所证券交易中的下列事项，予以重点监控：

(一) 涉嫌内幕交易、操纵市场等违法违规行为；

(二) 涉嫌异常交易、异常波动、异常停牌、异常停市、异常退市

为；

(四) 证券当日收盘价较前一日收盘价涨跌幅超过

(五) 上述以外其他证券上市地的其他市况

6.2 可能影响证券交易价格或者证券交易量的异常交易行为包括：

(一) 可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前，大量或持续买入或卖出相关证券；

(二) 单个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户，大量

申报、连续申报、

(三) 单个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户，大额申报、连续申报、密集申报或申报价格明显偏离该证券行情揭示的最新成交价；

(四) 单独或合谋，以涨幅或跌幅限制的价格大额申报或连续申报，致使该证券交易价格达到或维持涨幅或跌幅限制；

(五) 频繁申报和撤销申报，或大额申报后撤销申报，以影响





7.2 出现无法申报或行情传输中断情况的，会员单位应及时向本所报告。无法申报或行情传输中断的证券营业部数量超过本所全部会员证券营业部总数 10% 以上的，属于交易异常情况，本所可以实行临时停市。

7.3 本所认为可能发生第 7.1 条、第 7.2 条规定的交易异常情况，并严重影响交易正常进行的，可以决定技术性停牌或临时停市。

7.4 本所对暂缓进入交易、技术性停牌或临时停市决定予以公告。

技术性停牌或临时停市原因消除后，本所可以决定恢复交易，并予以公告。

7.5 因交易异常情况及本所采取的措施造成损失的，本所不承担赔偿责任。

## 7.6

8.1 交易参与人之间、会员与客户之间发生交易纠纷，如属

9.1 投资者买卖证券成交的，应当按规定向会员交纳佣金。

9.2 交易参与人应当按规定向本所交纳交易经手费及其他费用，会员还应当按规定向本所交纳会员管理费用。

9.3 证券交易的各项费用，收费标准和管理办法按照有关规定执行。

10.1 交易参与人违反本规则的，本所根据《深圳证券交易所会员管理规则》等相关规定进行自律管理。

10.2 通过本所交易系统进行证券发行、认购、申购、赎回、

定的，从其规定。

10.3 经本所同意，会员可以通过其派驻交易大厅的交易员进行申报。

进入交易大厅的，仅限于下列人员：

(一) 登记在册交易员；

(二) 场内监管人员；

经本所同意，经本所许可的其他人员。

10.4 经本所同意，会员可以在本所指定的交易平台上进行协议交易，具体规定由本所另行制定。

10.5 本规则中所述时间，以本所交易主机的时间为准。

10.6 本规则下列用语具有如下含义：

(一) 市场：指本所设立的证券交易市场。

(一) 委托 委托次由委托人进行具体委托可委托其他行出  
的行为。

市面以该价格作为成交价格

(五) 对手方(本方)队列最优价格:指集中申报簿中买方的  
最高价或卖方的最低价

按照集合竞价规则形成的虚拟集合竞价成交价。

(七) 匹配量:指截至揭示时集中申报簿中所有申报按照集合  
竞价规则形成的虚拟成交数量。

(八) 未匹配量:指截至揭示时集中申报簿中在集合竞价参考  
价位上的不能按照集合竞价参考价格虚拟成交的买方或卖方申报剩  
余量。

公允价值或票面价值折算成公允价值或公允价值  
格、结算价格、参考价值的特定期间,包括计算修正可转换债券转  
股价的特定时间,计算证券增发价的特定时间,计算证券单位净值

10.7 本规则未定义的用语的含义,依照法律、行政法规、部

10.8 本规则所称“超过”、“低于”、“不足”不含本数,“达  
到”、“以上”、“以下”含本数。

10.9 本规则经本所理事会通过,报证监会批准后生效。修改  
时亦同。

10.10 本规则由本所负责解释。

10.11 本规则自 2016 年 1 月 1 日起施行。