附件：

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 1 17 日第二次修订；2012 年 11 30 日第三次修订；2013 年 7 月 29 日第四次修订；根据 2013 年 11 30 日《关于修改〈深圳证券交易所 2013 年修订）〉第 3.1.4 条的决定》修订；根据 2015 年 1 月 9 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 》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〉 》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〉涉及交易参与人若干条款的通知》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 交易参与人 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 [illegible] 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 [illegible] 22
第五节 23
第六节 指数熔断 24
第五章 交易信息 25
第一节 [illegible] 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，是指交易参与人向本所申请设立的、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。

2.4.2 [illegible] 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 [illegible]

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[illegible]交收责任。

[illegible]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[illegible]

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[illegible]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 [illegible]易的除外。

[illegible]交收完成前全部或部分卖出。

[illegible]交易的货币市场基金、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 本所不放弃投资者通过其他证券公司交易系统与本所交易系统

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 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

（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

第三节　申报

3.3.1　本所接受[illegible]交易参与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。

[illegible]

3.3.3　[illegible]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）全额成交或撤销申报；

（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申报价格。

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申报价格。

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。

即时成交剩余撤销申报，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 市价申报只适用于有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。

其他市价申报类型进入交易主机时，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

[illegible]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。

[illegible]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[illegible]得超过100万张。

3.3.11 [illegible]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[illegible]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。

[illegible]

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　[illegible]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。

[illegible]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　[illegible]幅限制：

[illegible]

（二）[illegible]

（三）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[illegible]3.3.4 [illegible]（五）项市价申报类型除外。

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　买卖有价格涨跌幅限制的证券，有效竞价范围为涨跌幅限制范围。超过有价格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）首日上市开盘集合竞价的有效竞价范围为发行价的上下30%，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%；债券上市后的交易日，开盘集合竞价有效竞价范围为前收盘价的上下10%，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。

无价格涨跌幅限制证券有效竞价范围上限为买卖申报最近成交

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，交易主机自动将此申报参加竞价。

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，继续交易时，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准调整有效竞价范围；

（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准调整有效竞价范围。

3.4.6

第五节 集成交

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）可实现最大成交量的价格；

高于该价格的买入申报与低于该价格的卖出申报全部成交的

交；

（三）与该价格相同的买方或卖方至少有一方全部成交。

交价；买卖申报累计数量之差仍存在相等情况的，开盘集合竞价时

合竞价时取最接近最近成交价的价格为成交价。

3.5.3 连续竞价时，成交价的确定原则为：

（一）最高买入申报与最低卖出申报价格相同，以该价格为成交价；

（二）

（三）

3.5.4

结果，履行清算交收义务。

后果的交易。本所可以采取适当措施或认定无效。

违反本规则，严重破坏证券市场正常运行的交易，本所有权宣

3.5.5

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[illegible]

（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）基金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；

[illegible] 5 千张，或者交易金额不低于 50 万元人民币。

[illegible]

3.6.2　交易大宗商品采取协议大宗交易和盘后定价大宗交易方式。

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 [illegible]该证券当日涨跌幅限制价格范围内确定。

[illegible]价的上下30%之间确定。

3.6.5 [illegible]

[illegible]向申报；

（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。[illegible]

[illegible]向、价格、数量等各项要素均匹配的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

日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。

3.6.8

价格类型等内容

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

3.6.9

（二）

（二）盘后定价大宗交易的交易信息，内容包括：证券代码、

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信息：

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、卖出金额最大五家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；

（三）单只证券大宗交易的累计成交量、累计成交金额、买入金额最大五家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

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；

（三）证券账户及资金账户的开立和使用要求；

（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给资金融入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

交易参与人为“融资方”，其对手方为“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债

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[illegible]

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[illegible]

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 [illegible]

布。

3.8.5 债券质押式回购交易应行[illegible]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购回价，购回价是指每百元资金的本金和利息之和。

购回价的具体计算方法，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[illegible]

第二节　收盘价与收盘价

4.2.1　证券的开盘价为当日该证券的第一笔成交价格。

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，本所可以视情况对相关证券实施停牌，发布公告，并根据需要公布相关交易、股份和基金份额统计信息。有披露义务的当事人应当按规定及时披露相关信息。

本所根据需要对证券实施停牌和复牌的时间另行发布公告。

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%的，临时停牌至当日的14:57；

50%[illegible]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开始对前接受的申报进行复牌集合竞价，再复牌进行收盘集合竞价。

盘中风险控制措施。

4.3.5 [illegible]

券新值上市或临时停牌后的前适证券的交易。

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之后临时停牌的，当日复牌时对已接受的申报实行集合竞价，复牌后继续当日交易。[illegible]

停牌期间[illegible]可以申报，也可以撤销申报

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）次一交易日对该证券作除权、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公式的，应当向本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，不在主板、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可转换公司债券、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%。

[illegible]本规则另有规定外，退市整理期间股票交易不设涨跌幅限制比例。

4.5.3 [illegible]退市整理期间，[illegible]金额。

4.5.4 [illegible]股票退市整理期间交易[illegible]本规则第[illegible]规定的

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 恢复交易并进行收盘集合竞价，但 14:45 后指数熔断至 15:00 的，当日不恢复交易。

（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 开始实施指数熔断；14:57 至 15:00 期间不实施指数熔断。

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，当日指数熔断时间跨越 11:30

交易。

指数熔断期间和恢复交易时的集合竞价不揭示虚拟参考价、匹[illegible]

4.6.5 指数熔断期间，相关证券复牌的，延至指数熔断结束后实施。

4.6.6 指数熔断至15:00[illegible]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，以前收盘价为当日收盘价。

4.6.7 指数熔断至15:00的，相关证券当日不再进行大宗交易。

第一节 一般规定

5.1.1 本所每个交易日发布证券交易即时行情、证券指数、证券交易公开信息等交易信息。

5.1.2 本所及时编制反映市场成交情况的各类日报表、周报表、月报表和年报表，并通过本所网站或其他媒体予以公布。

5.1.3 [illegible]不得使用和传播。

经本所许可使用交易信息的机构和个人，未经同意，不得将交易信息提供给其他机构和个人使用或予以传播。

证券交易信息的管理办法，由本所另行制定。

第二节 即时行情

5.2.1 开盘、收盘集合竞价期间，即时行情内容包括：证券代码、证券简称、集合竞价参考价、匹配量和未匹配量等。

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、当日证券状态、前收盘价、最近成交价、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；

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 即时行情通过本所交易参与人综合业务系统供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 [illegible]

异常波动，本所公开披露交易异常波动期间累计买入、卖出金额最大的五家会员证券营业部或交易单元名称及其对应买入、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；

（四）证券交易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 本规定所称涨跌幅限制股票不作为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 本所对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；

为；

（四）证券交易价格或证券交易量明显异常波动；

（五）上所认为需要重点监控的其他事项。

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

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

（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。

[illegible]

7.4 本所对暂缓进入交收、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相应措施造成损失的，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，相关

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　证券交易的收费项目、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》等相关规定进行纪律处分。

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；

（三）本所认定的其他人员。

10.4　经证监会批准上市交易和回转交易的证券，其协议大宗交易平台进行协议交易，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）委托一批机构或者自己进行具体操作买卖证券的行为。

的行为。

（五）对手方（本方）队列最优价格：指集中申报簿中买方的

按照集合竞价规则形成的虚拟集合竞价成交价。

（十）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。

（十一）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虚拟成交的买方或卖方申报剩余量。

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[illegible]起施行。