

证券交易常识：集合竞价确定成交价的原则 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/40/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E4_BA_A4_E6_c33_40014.htm 集合竞价确定成交价的原则是：首先，在有效价格范围内选取能使所有有效委托产生最大成交量的价位。如有两个以上这样的价位，则依以下规则选取成交价位：高于选取价格的所有买方有效委托和低于选取价格的所有卖方有效委托能够全部成交；与选取价格相同的委托有一方必须全部成交，如满足以上条件的价位仍有多个，则选取离上日收市价最近的价位。其次，进行撮合处理。所有买方有效委托限价由高到低的顺序排列。限价相同者按照进入撮合主机的时间先后排列。所有卖方有效委托按照委托限价由低到高的顺序排列。限价相同者按照进入撮合的时间先后排列。依序逐笔将排在前面的买方委托与卖方委托配对成交，即按照价格优先、同等价格下时间优先的成交顺序依次成交，直至成交条件不满足为止，即所有买入委托的限价均低于卖出委托的限价。所有成交都以同一成交价成交。集合竞价中未能成交的委托，自动进入连续竞价。100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com