

证券交易常识：深圳证券交易所中小企业板块交易特别规定  
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\\_40116.htm](https://www.100test.com/kao_ti2020/40/2021_2022__E8_AF_81_E5_88_B8_E4_BA_A4_E6_c33_40116.htm) 第一条 为规范中小企业板块交易行为,强化对中小企业板块股票交易的监管,制定本特别规定。第二条 深圳证券交易所(以下简称"本所")中小企业板块股票(以下简称"中小企业股票")的交易,适用本特别规定。本特别规定未作规定的,适用《深圳、上海证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所大宗交易实施细则》以及其他有关规定。第三条 每个交易日9 15至9 25为中小企业板块开盘集合竞价时间,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,15 00至15 30为大宗交易时间。第四条 开盘集合竞价期间,本所主机即时揭示中小企业股票的开盘参考价格、匹配量和未匹配量。开盘参考价格是指截至揭示时所有有效申报按照集合竞价规则形成的虚拟开盘价格;匹配量是指截至揭示时所有有效申报按照集合竞价规则形成的虚拟成交数量;未匹配量是指截至揭示时在开盘参考价位上的不能按照开盘参考价虚拟成交的买方或卖方委托剩余量。第五条 每个交易日9 20至9 25,本所主机不接受中小企业股票的撤销申报。第六条 中小企业股票的收盘价通过收盘前最后三分钟集合竞价的方式产生。收盘集合竞价不能产生收盘价的,以最后一笔成交价为当日收盘价。第七条 本所编制中小企业板块指数,以反映中小企业板块总体价格变动和走势。中小企业板块指数编制方法本所另行规定。第八条 中小企业股票交易出现下列情况之一的,本所公布成交金额最大五家会员营业部或席位的名称及其买入、卖出金

额:(一)日收盘价格涨跌幅偏离值达到 $\pm 7\%$ 的各前三只股票;收盘价格涨跌幅偏离值的计算公式为:收盘价格涨跌幅偏离值=单只股票涨跌幅-中小企业板块指数涨跌幅(二)日价格振幅达到15%的前三只股票;价格振幅的计算公式为:价格振幅=(当日最高价-当日最低价)/当日最低价 $\times 100\%$ (三)日换手率达到20%的前三只股票;换手率的计算公式为:换手率=当日成交股数/流通股数 $\times 100\%$ 收盘价格涨跌幅偏离值、价格振幅或换手率相同的,依次按成交金额和成交量选取。第九条 中小企业股票交易属于异常波动的,应当停牌,直至有披露义务的当事人作出公告的当日十点三十分复牌。本所公布该股票交易异常波动期间累计成交金额最大五家会员营业部或席位的名称及其买入、卖出金额。第十条 中小企业股票交易出现下列情况之一的,属于异常波动:(一)连续三个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到 $\pm 20\%$ 的;(二)ST和\*ST股票连续三个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到 $\pm 15\%$ 的;(三)连续三个交易日内日均换手率与前五个交易日的日均换手率的比值达到30倍,并且该股连续三个交易日内的累计换手率达到20%的。(四)本所或中国证监会认为属于异常波动的其他情况。异常波动指标的计算,自复牌之日起重新计算。上市首日股票(包括新股、增发、配股、恢复上市股票)不纳入异常波动指标的计算。第十一条 本所按第八条、第九条规定公布的中小企业股票交易公开信息包含机构专用席位的,只公布该席位所属会员名称及其买入、卖出金额。第十二条 会员应当在营业场所及时公布第八条、第九条规定的公开信息。第十三条 违反本特别规定的,本所按《交易规则》相关条款予以处分。第十四条 中小企业板块指数公布前,本特别规定第八条、第

十条的收盘价格涨跌幅偏离值的计算公式为:收盘价格涨跌幅  
偏离值=单只股票涨跌幅-深证A股指数涨跌幅第十五条 本特  
别规定由本所负责解释。第十六条 本特别规定自发布之日起  
施行。 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](http://www.100test.com)