

2010证券从业资格考试《证券交易》笔记：第4章 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/647/2021_2022_2010_E8_AF_81_E5_88_B8_c33_647497.htm 2010年证券从业资格全科套餐

，七折优惠，并赠送100元模考卡！第四章 特别交易事项及其监管 考情分析 此章是新增的一章，但其内容属于旧教材第二章5、6小节。在“大宗交易”知识点中，新增了“深圳证券交易所综合协议交易平台业务”。第一节 特别交易规定与交易事项 【主要考点】 上海证券交易所大宗交易和深圳证券交易所综合协议交易平台业务的有关规定。回转交易制度。熟悉股票交易特别处理的规定。熟悉中小企业板股票暂停上市、终止上市特别规定。掌握开盘价、收盘价的产生方式。熟悉证券交易所上市证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的规则。掌握证券除权(息)的处理办法和除权(息)价的计算方法。熟悉证券交易异常情况的处理规定。熟悉固定收益证券综合电子平台的交易规定。

一、大宗交易 大宗交易的定义：大宗交易是指单笔数额较大的证券买卖。我国现行有关交易制度规定，如果证券单笔买卖申报达到一定数额的，证券交易所可以采用大宗交易方式进行交易。按照规定，证券交易所可以根据市场情况调整大宗交易的最低限额。

(一)上海证券交易所大宗交易 1.进行大宗交易的条件(重点掌握) 根据《上海证券交易所交易规则》的规定，在上海证券交易所进行的证券买卖符合以下条件的，可以采用大宗交易方式：(1)A股单笔买卖申报数量应当不低于50万股，或者交易金额不低于300万元人民币。(2)B股单笔买卖申报数量应当不低于50万股，或者交易金额不低于30万美元。(3)基金大宗交易的单笔买卖申报数

量应当不低于 300 万份，或者交易金额不低于 300 万元人民币。

(4) 国债及债券回购大宗交易的单笔买卖申报数量应当不低于 1 万手，或者交易金额不低于 1000 万元。

(5) 其他债券单笔买卖申报数量应当不低于 1000 手，或者交易金额不低于 100 万元人民币。

2. 大宗交易时间 上海证券交易所接受大宗交易的时间为每个交易日 9:30 ~ 11:30、13:00 ~ 15:30，但如果在交易日 15:00 前处于停牌状态的证券，上海证券交易所不受理其大宗交易的申报。每个交易日 15:00 ~ 15:30，证券交易所交易主机对买卖双方的成交申报进行成交确认。

3. 大宗交易的申报 大宗交易的申报包括意向申报和成交申报。

4. 有涨跌幅限制证券的大宗交易成交价格，由买卖双方在当日涨跌幅价格限制范围内确定。无涨跌幅限制证券的大宗交易成交价格，由买卖双方在前收盘价的上下 30% 或当日已成交的最高、最低价之间自行协商确定。成交申报分别通过各自委托会员的席位进行。成交申报须经证券交易所确认。交易所确认后，买方和卖方不得撤销或变更成交申报，并必须承认交易结果、履行相关的清算交收义务。大宗交易不纳入证券交易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。每个交易日大宗交易结束后，属于股票和基金大宗交易的，上海证券交易所公告证券名称、成交价、成交量及买卖双方所在会员营业部的名称等信息。属于债券和债券回购大宗交易的，上海证券交易所公告证券名称、成交价和成交量等信息。

(二) 深圳证券交易所综合协议交易平台业务 自 2009 年 1 月 12 日起，深交所启用综合协议交易平台，取代原有大宗交易系统。协议平台是指交易所为会员和合格投资者进行各类证券大宗交易或协议交易提供的交易系统。

1. 下列交

易可以通过协议平台进行：(重点掌握) (1)权益类证券大宗交易，包括A股、B股、基金等。(2)债券大宗交易，包括国债、企业债券、公司债券、分离交易的可转换公司债券、可转换公司债券和债券质押式回购等。(3)专项资产管理计划收益权份额协议交易。(4)交易所规定的其他交易。

2.根据《深圳证券交易所交易规则》的规定，在深圳证券交易所进行的证券买卖符合以下条件的，可以采用大宗交易方式：(重点掌握) (1)A股单笔交易数量不低于50万股，或者交易金额不低于300万元人民币。(2)B股单笔交易数量不低于5万股，或者交易金额不低于30万港币。(3)基金单笔交易数量不低于300万份，或者交易金额不低于300万元人民币。(4)债券单笔交易数量不低于5000张(以人民币100元面额为1张)，或者交易金额不低于50万元人民币。(5)债券质押式回购单笔交易数量不低于5000张(以人民币100元面额为1张)，或者交易金额不低于50万元人民币。(6)多只A股合计单向买入或卖出的交易金额不低于500万元人民币，且其中单只A股的交易数量不低于20万股。(7)多只基金合计单向买入或卖出的交易金额不低于500万元人民币，且其中单只基金的交易数量不低于100万份。(8)多只债券合计单向买入或卖出的交易金额不低于500万元人民币，且其中单只债券的交易数量不低于1.5万张。

协议平台接受用户申报的时间为每个交易日 9:15 ~ 11:30、13:00 ~ 15:30。申报当日有效。当天全天停牌的证券，协议平台不接受其有关的申报。协议平台接受交易用户申报的类型包括意向申报、定价申报、双边报价、成交申报和其他申报。

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