

上海证券交易所科创板股票盘后固定价格交易指引

第一条 为了规范上海证券交易所（以下简称本所）科创板股票盘后固定价格交易行为，维护证券市场秩序，保护投资者合法权益，根据《上海证券交易所交易规则》（以下简称《交易规则》）《上海证券交易所科创板股票交易特别规定》（以下简称《交易特别规定》）等业务规则，制定本指引。

第二条 在本所科创板上市的股票和存托凭证（以下简称股票）的盘后固定价格交易，适用本指引。本指引未作规定的，适用《交易规则》《交易特别规定》及本所其他有关规定。

第三条 盘后固定价格交易，指在收盘集合竞价结束后，本所交易系统按照时间优先顺序对收盘定价申报进行撮合，并以当日收盘价成交的交易方式。

每个交易日的 15:05 至 15:30 为盘后固定价格交易时间，当日 15:00 仍处于停牌状态的股票不进行盘后固定价格交易。

第四条 本所接受交易参与者收盘定价申报的时间为每个交易日 9:30 至 11:30、13:00 至 15:30。

开市期间停牌的，停牌期间可以继续申报。停牌当日复牌的，已接受的申报参加当日该股票复牌后的盘后固定价格交易。当日 15:00 仍处于停牌状态的，本所交易主机后续不

再接受收盘定价申报，当日已接受的收盘定价申报无效。

接受申报的时间内，未成交的申报可以撤销。撤销指令经本所交易主机确认方为有效。

第五条 客户通过盘后固定价格交易买卖科创板股票的，应当向会员提交收盘定价委托指令。

收盘定价委托指令应当包括：证券账户号码、证券代码、买卖方向、限价、委托数量等内容。

第六条 本所盘后固定价格交易接受交易参与人的收盘定价申报。

收盘定价申报指令应当包括证券账号、证券代码、营业部代码、买卖方向、限价、数量等内容。

若收盘价高于收盘定价买入申报指令的限价，则该笔买入申报无效；若收盘价低于收盘定价卖出申报指令的限价，则该笔卖出申报无效。

第七条 通过收盘定价申报买卖科创板股票的，单笔申报数量应当不小于 200 股，且不超过 100 万股。

卖出时，余额不足 200 股的部分，应当一次性申报卖出。

第八条 收盘定价申报当日有效。

第九条 盘后固定价格交易阶段，本所以收盘价为成交价、按照时间优先原则对收盘定价申报进行逐笔连续撮合。

第十条 每个交易日 9:30 至 15:05，收盘定价申报不纳入即时行情；15:05 至 15:30，盘后固定价格交易阶段的申报

及成交纳入即时行情。

即时行情内容包括：证券代码、证券简称、收盘价、盘后固定价格交易当日累计成交数量、盘后固定价格交易当日累计成交金额以及买入或卖出的实时申报数量。

第十一条 盘后固定价格交易量、成交金额在盘后固定价格交易结束后计入该股票当日总成交量、总成交金额。

第十二条 通过盘后固定价格交易减持股份的，视同竞价交易执行股份减持的相关规定。

第十三条 本指引由本所负责解释。

第十四条 本指引自发布之日起施行。