

## 2006 年版《交易规则》新旧对照表

新《交易规则》（2006 年发布）	旧《交易规则》
<b>第一章 总则</b>	<b>第一章 总则</b>
1.1 为规范证券市场交易行为，维护证券市场秩序，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券法》等法律、行政法规、部门规章以及《上海证券交易所章程》，制定本规则。	第一条 为规范证券市场交易行为，维护证券市场秩序，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券法》、《证券交易所管理办法》及其他法律、法规和规章的规定，制定本规则。
1.2 在上海证券交易所（以下简称“本所”）上市的证券及其衍生品种（以下统称“证券”）的交易，适用本规则。 本规则未作规定的，适用本所其他有关规定。	第二条 上海证券交易所和深圳证券交易所（以下统称“交易所”）上市证券的交易，适用本规则。 本规则未作规定的，适用交易所其他有关规定。
1.3 证券交易遵循公开、公平、公正的原则。	第三条 证券交易遵循公开、公平、公正的原则。
1.4 证券交易应当遵守法律、行政法规和部门规章及本所相关业务规则，遵循自愿、有偿、诚实信用原则。	
1.5 证券交易采用无纸化的集中交易或经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）批准的其他方式。	第四条 证券交易采用无纸化的电脑集中竞价等交易方式。
<b>第二章 交易市场</b>	<b>第二章 交易市场</b>
<b>第一节 交易场所</b>	<b>第一节 交易场所</b>
2.1.1 本所为证券交易提供交易场所及设施。交易场所及设施由交易主机、交易大厅、参与者交易业务单元、报盘系统及相关的通信	第五条 交易所设置交易场所。交易场所由交易主机、交易大厅、交易席位、报盘系统及相关的通信系统等组成。

系统等组成。	
	第六条 交易主机通过报盘系统接受申报指令，撮合成交，并将交易结果发送给交易所会员。
<p>2.1.2 本所设置交易大厅。本所会员（以下简称“会员”）可以通过其派驻交易大厅的交易员进行申报。</p> <p>除经本所特许外，进入交易大厅的，仅限下列人员：</p> <p>（一）登记在册交易员；</p> <p>（二）场内监管人员。</p>	<p>第七条 申报指令由会员以有形席位报盘或无形席位报盘方式进入交易主机。有形席位报盘申报指令由会员通过设在交易大厅内的交易席位输入交易主机；无形席位报盘申报指令由会员经其柜台系统处理后，通过无形席位报盘系统自动输送至交易主机。</p> <p>设置交易大厅的，会员通过其派驻在交易大厅内的交易员进行有形席位报盘。</p> <p>进入交易大厅的，限于下列人员：</p> <p>（一）登记注册的会员交易员；</p> <p>（二）场内监管人员；</p> <p>（三）特许入场的人员。</p>
<b>第二节 交易参与人与交易权</b>	<b>第二节 交易会员</b>
	第八条 具有中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）认可的证券经营资格的机构，经交易所审核批准后可成为会员。
	第九条 根据证监会批准的业务许可，交易所核定会员的交易业务范围。
<p>2.2.1 会员及本所认可的机构进入本所市场进行证券交易的，须向本所申请取得相应席位和交易权，成为本所交易参与者。</p> <p>交易参与者应当通过在本所申请开设的参与者交易业务单元进行证券交易。</p>	第十条 会员在交易所办理席位开通手续后，才能进行证券交易。
	第十一条 投资者参与证券买卖，应当委托会员进行。会员接受投资者委托并申报后，必须承担由此产生的交易、交收责任。
	<b>第三节 交易席位</b>
2.2.2 参与者交易业务单元，是指交易参与者据此可以参与本所	第十二条 会员应当在交易所开设一个或一个以上的交易席位（以下

证券交易，享有及行使相关交易权利，并接受本所相关交易业务管理的基本单位。	简称“席位”）。
2.2.3 参与者交易业务单元和交易权限等管理细则由本所另行规定，报证监会批准后生效。	第十三条 席位的交易权限由交易所规定。交易所可以根据市场需要设置专用席位。专用席位持有人应当承担会员的相关义务。
	第十四条 交易所可以限制和调整席位数量。
	第十五条 会员应当保证每个席位具备至少一种通信备份手段。
	第十六条 经交易所同意，席位可以在会员之间转让。未经交易所许可，会员不得将席位以出租或承包等形式交由他人使用。
<b>第三节 交易品种</b>	<b>第四节 交易品种</b>
2.3.1 下列证券可以在本所市场挂牌交易： （一）股票； （二）基金； （三）债券； （四）债券回购； （五）权证； （六）经证监会批准的其他交易品种。	第十七条 下列证券可以在交易所市场挂牌交易： （一）普通股股票（A股和B股）； （二）基金； （三）债券（含企业债券、公司债券、可转换公司债券、金融债券及政府债券等）； （四）债券回购； （五）经证监会批准的其他交易品种。
<b>第四节 交易时间</b>	<b>第五节 交易时间</b>
2.4.1 本所交易日为每周一至周五。 国家法定假日和本所公告的休市日，本所市场休市。	第十八条 交易日为每周一至周五。每个交易日 9:15 至 9:25 为集合竞价时间，9:30 至 11:30、13:00 至 15:00 为连续竞价时间。 国家法定假日和交易所公告的休市日，交易所市场休市。 交易所认为必要时，经证监会批准，可以变更交易时间。
2.4.2 采用竞价交易方式的，每个交易日的 9:15 至 9:25 为开盘集合竞价时间，9:30 至 11:30、13:00 至 15:00 为连续竞价时间，开市期间停牌并复牌的证券除外。 根据市场发展需要，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。	第十九条 交易时间内因故停市，交易时间不作顺延。

<b>第三章 证券买卖</b>	<b>第三章 证券经纪业务与自营业务</b>
<b>第一节 一般规定</b>	
<p>3.1.1 会员接受投资者的买卖委托后，应当按照委托的内容向本所申报，并承担相应的交易、交收责任。</p> <p>会员接受投资者买卖委托达成交易的，投资者应当向会员交付其委托会员卖出的证券或其委托会员买入证券的款项，会员应当向投资者交付卖出证券所得款项或买入的证券。</p>	<p>第十一条 投资者参与证券买卖，应当委托会员进行。会员接受投资者委托并申报后，必须承担由此产生的交易、交收责任。</p>
<p>3.1.2 会员通过其拥有的参与者交易业务单元和相关的报送渠道向本所交易主机发送买卖申报指令，并按本规则达成交易，交易结果及其他交易记录由本所发送至会员。</p>	<p>第六条 交易主机通过报盘系统接受申报指令，撮合成交，并将交易结果发送给交易所会员。</p>
<p>3.1.3 会员应当按照有关规定妥善保管委托和申报记录。</p>	<p>第三十五条 会员应当按有关规定妥善保管委托、申报记录。</p>
<p>3.1.4 投资者买入的证券，在交收前不得卖出，但实行回转交易的除外。</p> <p>证券的回转交易是指投资者买入的证券，经确认成交后，在交收前全部或部分卖出。</p>	<p>第四十二条 会员接受客户委托，当日买入的证券，不得在当日再行卖出。债券交易除外。</p>
<p>3.1.5 债券和权证实行当日回转交易，B股实行次交易日起回转交易。</p>	
<p>3.1.6 根据市场需要，本所可以实行一级交易商制度，具体办法由本所另行规定，报证监会批准后生效。</p>	
<b>第二节 指定交易</b>	<b>第五章 第一节 指定交易与转托管</b>
<p>3.2.1 本所市场证券交易实行全面指定交易制度，境外投资者从事B股交易除外。</p>	<p>第七十八条 上交所实行全面指定交易制度。从事B股交易的境外投资者除外。</p>
<p>3.2.2 全面指定交易是指参与本所市场证券买卖的投资者必须事先指定一家会员作为其买卖证券的受托人，通过该会员参与本所市场证券买卖。</p>	<p>第七十九条 全面指定交易指投资者在上交所买卖证券，必须通过事先指定的一家会员进行委托申报，并由该会员履行清算交收义务。</p>

<p>3.2.3 投资者应当与指定交易的会员签订指定交易协议,明确双方的权利、义务和责任。指定交易协议一经签订,会员即可根据投资者的申请向本所交易主机申报办理指定交易手续。</p>	<p>第八十条 投资者应当与指定的会员签订《指定交易协议书》。会员根据投资者申请向交易主机申报办理指定交易手续。</p>
<p>3.2.4 本所在开市期间接受指定交易申报指令,该指令被交易主机接受后即刻生效。</p>	<p>第八十一条 上交所在开市期间接受指定交易申报指令,该指令被交易主机接受后即刻生效。</p>
<p>3.2.5 投资者变更指定交易的,应当向已指定的会员提出撤销申请,由该会员申报撤销指令。对于符合撤销指定条件的,会员不得限制、阻挠或拖延其办理撤销指定手续。</p>	<p>第八十二条 投资者可以变更指定交易。</p>
<p>3.2.6 指定交易撤销后即可重新申办指定交易。</p>	<p>第八十三条 投资者变更指定交易时,应当向会员提出撤销申请,由该会员申报撤销指令。指定交易撤销后即可重新申办指定交易。</p>
<p>3.2.7 指定交易的其他事项按照本所的有关规定执行。</p>	
<p><b>第三节 委托</b></p>	<p><b>第一节 证券经纪业务</b></p>
<p>3.3.1 投资者买卖证券,应当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,投资者即成为该会员经纪业务的客户(以下简称客户)。 投资者开立证券账户,按本所指定登记结算机构的规定办理。</p>	<p>第三十条 投资者买卖证券,应当按交易所指定的登记结算机构的规定,以实名方式在会员处开立证券帐户和资金帐户,并与会员签订证券委托买卖协议。协议一经签订,投资者即成为该会员经纪业务的客户。</p>
	<p>第三十一条 证券委托买卖协议应当包括但不限于下列内容: (一)会员与客户遵守本规则及其他有关业务规则的承诺; (二)会员已向客户揭示证券买卖的各类风险,包括不同委托方式的风险; (三)客户表明会员已向其说明证券买卖的各类风险; (四)会员受托业务范围和权限; (五)指定交易或转托管有关事项; (六)客户开户所需证件及其有效性的确认方式和程序;</p>

	<p>(七) 委托、交割的方式、时间、内容和要求；</p> <p>(八) 交易结算资金及证券管理的有关事项；</p> <p>(九) 交易费用及其他收费说明；</p> <p>(十) 会员对客户委托事项的保密责任；</p> <p>(十一) 客户应当履行的交收责任；</p> <p>(十二) 违约责任及免责条款；</p> <p>(十三) 争议解决办法。</p>
<p>3.3.2 客户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。电话、自助终端、互联网等自助委托应当按相关规定操作。</p>	<p>第三十二条 会员可通过柜台委托或电话、自助终端、互联网等自助委托方式受理并执行客户的委托买卖指令。柜台委托应当填写委托单。电话、自助终端、互联网等自助委托应当按交易所及会员规定的程序操作。</p>
<p>3.3.3 客户通过自助委托方式参与证券买卖的，会员应当与其签订自助委托协议。</p>	
<p>3.3.4 除本所另有规定外，客户的委托指令应当包括下列内容：</p> <p>(一) 证券账户号码；</p> <p>(二) 证券代码；</p> <p>(三) 买卖方向；</p> <p>(四) 委托数量；</p> <p>(五) 委托价格；</p> <p>(六) 本所及会员要求的其他内容。</p>	<p>第三十三条 客户的委托指令应当包括下列内容：</p> <p>(一) 证券帐户号码；</p> <p>(二) 证券代码；</p> <p>(三) 买卖方向；</p> <p>(四) 委托数量；</p> <p>(五) 委托价格；</p> <p>(六) 交易所及会员要求说明的其他内容。</p> <p>在经纪业务中，会员不得接受全权委托。</p>
	<p>第三十四条 会员提供自助委托的，应当与客户签订自助委托协议。</p>
	<p>第三十五条 会员应当按有关规定妥善保管委托、申报记录。</p>
<p>3.3.5 客户可以采用限价委托或市价委托的方式委托会员买卖证券。</p> <p>限价委托是指客户委托会员按其限定的价格买卖证券，会员必须</p>	<p>第三十六条 会员可以接受客户的限价委托或市价委托。</p> <p>限价委托指客户要求按其限定的价格买卖证券，会员必须按限价或低于限价买入证券；按限价或高于限价卖出证券。</p>

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。 市价委托是指客户委托会员按市场价格买卖证券。	市价委托指客户要求会员按市场价格买卖证券。
	第三十七条 委托当日有效,会员与客户另有约定的除外。
3.3.6 客户可以撤销委托的未成交部分。	第三十八条 客户可以撤销委托的未成交部分。
3.3.7 被撤销和失效的委托,会员应当在确认后及时向客户返还相应的资金或证券。	第三十九条 被撤销和失效的委托,会员应当在确认后及时向客户返还相应的资金或证券。
	第四十条 会员接受委托卖出证券必须是客户证券帐户上实有的证券,不得为客户融券交易。
3.3.8 会员向客户买卖证券提供融资融券服务的,应当按照有关规定办理。	第四十一条 会员接受委托买入证券必须以客户资金帐户上实有的资金支付,不得为客户融资交易。
	第四十三条 会员不得私自或者假借客户名义买卖客户帐户上的证券,或者为牟取佣金收入诱使客户进行不必要的证券买卖。
	第四十四条 会员对客户的资金和证券应有详实的记录和凭证,按户分帐管理,不得挪用。
	<b>第二节 证券自营业务</b>
	第四十五条 取得自营业务资格的会员,可以在交易所市场从事证券自营业务。
	第四十六条 会员必须以自己的名义在交易所指定的登记结算机构开立自营证券帐户,并只能通过该帐户从事自营业务。
	第四十七条 会员应当开设独立的自营资金帐户,并与客户的资金帐户分帐管理。
	第四十八条 会员不得将自营帐户借给他人使用。
	第四十九条 会员应当设专门管理人员和专用交易终端从事自营业务,不得因自营业务影响经纪业务。
	<b>第四章 证券买卖</b>

第四节 申报	第一节 申报
<p>3.4.1 本所接受会员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。</p> <p>每个交易日 9:20 至 9:25 的开盘集合竞价阶段,本所交易主机不接受撤单申报;其他接受交易申报的时间内,未成交申报可以撤销。撤销指令经本所交易主机确认方为有效。</p> <p>本所认为必要时,可以调整接受申报时间。</p>	
<p>3.4.2 会员应当按照客户委托的时间先后顺序及时向本所申报。</p>	<p>第五十一条 会员应当按照接受客户委托的先后顺序向交易主机申报。</p>
<p>3.4.3 本所接受会员的限价申报和市价申报。</p>	<p>第五十条 交易所只接受会员的限价申报。</p>
<p>3.4.4 根据市场需要,本所可以接受下列方式的市价申报:</p> <p>(一)最优五档即时成交剩余撤销申报,即该申报在对手方实时最优五个价位内以对手方价格为成交价逐次成交,剩余未成交部分自动撤销。</p> <p>(二)最优五档即时成交剩余转限价申报,即该申报在对手方实时五个最优价位内以对手方价格为成交价逐次成交,剩余未成交部分按本方申报最新成交价转为限价申报;如该申报无成交的,按本方最优报价转为限价申报;如无本方申报的,该申报撤销。</p> <p>(三)本所规定的其他方式。</p>	
<p>3.4.5 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,本所另有规定的除外。</p>	
<p>3.4.6 限价申报指令应当包括证券账号、营业部代码、证券代码、买卖方向、数量、价格等内容。</p> <p>市价申报指令应当包括申报类型、证券账号、营业部代码、证券代码、买卖方向、数量等内容。</p>	<p>第五十二条 申报指令应当包括证券帐号、证券代码、买卖方向、数量、价格等内容,并按交易所规定的格式传送。</p> <p>交易所认为必要时可以调整申报内容及方式。</p>

<p>申报指令按本所规定的格式传送。本所认为必要时，可以调整申报的内容及方式。</p>	
<p>3.4.7 通过竞价交易买入股票、基金、权证的，申报数量应当为 100 股(份)或其整数倍。 卖出股票、基金、权证时，余额不足 100 股(份)的部分，应当一次性申报卖出。</p>	<p>第五十三条 买入股票或基金，申报数量应当为 100 股(份)或其整数倍。</p>
<p>3.4.8 竞价交易中，债券交易的申报数量应当为 1 手或其整数倍，债券质押式回购交易的申报数量应当为 100 手或其整数倍，债券买断式回购交易的申报数量应当为 1000 手或其整数倍。 债券交易和债券买断式回购交易以人民币 1000 元面值债券为 1 手，债券质押式回购交易以人民币 1000 元标准券为 1 手。</p>	<p>第五十四条 债券以人民币 1000 元面额为 1 手。债券回购以 1000 元标准券或综合券为 1 手。债券和债券回购以 1 手或其整数倍进行申报，其中，上交所债券回购以 100 手或其整数倍进行申报。</p>
<p>3.4.9 股票、基金、权证交易单笔申报最大数量应当不超过 100 万股(份)，债券交易和债券质押式回购交易单笔申报最大数量应当不超过 1 万手，债券买断式回购交易单笔申报最大数量应当不超过 5 万手。 根据市场需要，本所可以调整证券的单笔申报最大数量。</p>	<p>第五十五条 股票(基金)单笔申报最大数量应当低于 100 万股(份)，债券单笔申报最大数量应当低于 1 万手(含 1 万手)。交易所可以根据需要调整不同种类或流通量的单笔申报最大数量。</p>
<p>3.4.10 不同证券的交易采用不同的计价单位。股票为“每股价格”，基金为“每份基金价格”，权证为“每份权证价格”，债券为“每百元面值债券的价格”，债券质押式回购为“每百元资金到期年收益”，债券买断式回购为“每百元面值债券的到期回购价格”。</p>	<p>第五十六条 不同的证券交易采用不同的计价单位。股票为“每股价格”，基金为“每份基金价格”，债券为“每百元面值的价格”，债券回购为“每百元资金到期年收益”。</p>
<p>3.4.11 A 股、债券交易和债券买断式回购交易的申报价格最小变动单位为 0.01 元人民币，基金、权证交易为 0.001 元人民币，B 股交易为 0.001 美元，债券质押式回购交易为 0.005 元。</p>	<p>第五十七条 A 股、基金和债券的申报价格最小变动单位为 0.01 元人民币；B 股上交所为 0.001 美元、深交所为 0.01 港元；债券回购上交所为 0.005、深交所为 0.01。交易所认为必要时，可以对前款规定进行调整。</p>
<p>3.4.12 根据市场需要，本所可以调整各类证券单笔买卖申报数量和申报价格的最小变动单位。</p>	<p>第五十八条 交易所可以规定并调整各类证券每笔买卖申报数量和申报价格的最小可变动单位。</p>

<p>3.4.13 本所对股票、基金交易实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，其中 ST 股票和*ST 股票价格涨跌幅比例为 5%。</p> <p>股票、基金涨跌幅价格的计算公式为：涨跌幅价格=前收盘价×(1±涨跌幅比例)。</p> <p>计算结果按照四舍五入原则取至价格最小变动单位。</p> <p>属于下列情形之一的，首个交易日无价格涨跌幅限制：</p> <p>(一)首次公开发行上市的股票和封闭式基金；</p> <p>(二)增发上市的股票；</p> <p>(三)暂停上市后恢复上市的股票；</p> <p>(四)本所认定的其他情形。</p> <p>经证监会批准，本所可以调整证券的涨跌幅比例。</p>	<p>第六十二条 交易所对股票、基金交易实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，其中 ST 股票价格涨跌幅比例为 5%。</p> <p>涨跌幅价格的计算公式为：涨跌幅价格=前收盘价×(1±涨跌幅比例)。</p> <p>计算结果四舍五入至价格最小变动单位。</p> <p>股票、基金上市首日不受涨跌幅限制。交易所认为必要时，经证监会批准，可以调整涨跌幅比例和适用范围。</p>
<p>3.4.14 买卖有价格涨跌幅限制的证券，在价格涨跌幅限制以内的申报为有效申报，超过价格涨跌幅限制的申报为无效申报。</p>	<p>第五十九条 买卖有价格涨跌幅限制的证券，在价格涨跌幅限制以内的申报为有效申报。超过涨跌幅限制的申报为无效申报。</p>
<p>3.4.15 买卖无价格涨跌幅限制的证券，集合竞价阶段的有效申报价格应符合下列规定：</p> <p>(一)股票交易申报价格不高于前收盘价格的 200%，并且不低于前收盘价格的 50%；</p> <p>(二)基金、债券交易申报价格最高不高于前收盘价格的 150%，并且不低于前收盘价格的 70%。</p> <p>集合竞价阶段的债券回购交易申报无价格限制。</p>	<p>第六十条 买卖上交所无价格涨跌幅限制的证券，集合竞价时，申报价格无限制；连续竞价时，符合下列条件的申报为有效申报：</p> <p>(一)买入(卖出)申报价格不高(低)于即时揭示的最低(高)卖出(买入)申报价格的规定幅度；</p> <p>(二)无卖出(买入)申报的，买入(卖出)申报价格不高(低)于即时揭示的最高(低)买入(卖出)价格的规定幅度；</p> <p>(三)既无卖出又无买入的，买入(卖出)申报价格不高于最新成交价格的规定幅度；当日无最新成交价格的，按前收盘价计算申报限价幅度。上交所认为必要时，可以对上述幅度进行调整并予以公告。</p>
<p>3.4.16 买卖无价格涨跌幅限制的证券，连续竞价阶段的有效申报价格应符合下列规定：</p>	

<p>(一) 申报价格不高于即时揭示的最低卖出价格的 110%且不高于即时揭示的最高买入价格的 90%; 同时不高于上述最高申报价与最低申报价平均数的 130%且不高于该平均数的 70%;</p> <p>(二) 即时揭示中无买入申报价格的, 即时揭示的最低卖出价格、最新成交价格中较低者视为前项最高买入价格;</p> <p>(三) 即时揭示中无卖出申报价格的, 即时揭示的最高买入价格、最新成交价格中较高者视为前项最低卖出价格。</p> <p>当日无交易的, 前收盘价格视为最新成交价格。</p> <p>根据市场需要, 本所可以调整申报价格限制的规定。</p>	
	<p>第六十一条 买卖深交所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; 当成交价格波动使其进入有效竞价范围时, 交易主机自动取出申报, 参加竞价。</p>
<p>3.4.17 申报当日有效。每笔参与竞价交易的申报不能一次全部成交时, 未成交的部分继续参加当日竞价, 本规则另有规定的除外。</p>	<p>第六十三条 申报当日有效。每笔申报不能一次全部成交时, 未成交部分继续参加当日竞价, 也可以撤销。</p>
<p><b>第五节 竞价</b></p>	<p><b>第二节 竞价与成交</b></p>
<p>3.5.1 证券竞价交易采用集合竞价和连续竞价两种方式。</p> <p>集合竞价是指在规定时间内接受的买卖申报一次性集中撮合的竞价方式。</p> <p>连续竞价是指对买卖申报逐笔连续撮合的竞价方式。</p>	<p>第六十四条 证券交易一般采用电脑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。</p> <p>连续竞价是指对买卖申报逐笔连续撮合的竞价方式。</p> <p>交易所认为必要时, 经证监会批准, 可以采用其他交易方式。</p>
<p>3.5.2 集合竞价期间未成交的买卖申报, 自动进入连续竞价。</p>	<p>第六十八条 集合竞价未成交的买卖申报, 自动进入连续竞价。</p>
	<p>第六十九条 深交所有涨跌幅限制的证券有效竞价范围与涨跌幅申报范围一致。</p>
	<p>第七十条 深交所无涨跌幅限制证券的交易按下列方法确定有效竞价范围:</p> <p>(一) 上市首日集合竞价的有效竞价范围为发行价的上下 150 元, 连</p>

	<p>续竞价的有效竞价范围为最近成交价的上下 15 元；</p> <p>(二) 非上市首日集合竞价的有效竞价范围为前收盘价的上下 5 元，连续竞价的有效竞价范围为最近成交价的上下 5 元。深交所认为必要时，可以调整有效竞价范围并公告。</p>
	<p>第七十一条 深交所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，按下列方式调整有效竞价范围：</p> <p>(一) 有效竞价范围内的最高买入申报价高于发行价的，以最高买入申报价为基准调整有效竞价范围；</p> <p>(二) 有效竞价范围内的最低卖出申报价低于发行价的，以最低卖出申报价为基准调整有效竞价范围。</p>
<b>第六节 成交</b>	
<p>3.6.1 证券竞价交易按价格优先、时间优先的原则撮合成交。</p> <p>成交时价格优先的原则为：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。</p> <p>成交时时间优先的原则为：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。</p>	<p>第六十五条 证券交易按价格优先、时间优先的原则竞价撮合成交。</p> <p>成交时价格优先的原则为：较高价格买进申报优先于较低价格买进申报，较低价格卖出申报优先于较高价格卖出申报。</p> <p>成交时时间优先的原则为：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。</p>

<p>3.6.2 集合竞价时，成交价格确定原则为：</p> <p>（一）可实现最大成交量的价格；</p> <p>（二）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价格；</p> <p>（三）与该价格相同的买方或卖方至少有一方全部成交的价格。</p> <p>两个以上申报价格符合上述条件的，使未成交量最小的申报价格为成交价格；仍有两个以上使未成交量最小的申报价格符合上述条件的，其中间价为成交价格。</p> <p>集合竞价的所有交易以同一价格成交。</p>	<p>第六十六条 集合竞价时，成交价格确定原则为：</p> <p>（一）成交量最大的价位；</p> <p>（二）高于成交价格的买进申报与低于成交价格的卖出申报全部成交；</p> <p>（三）与成交价格相同的买方或卖方至少有一方全部成交。</p> <p>两个以上价位符合上述条件的，上交所取其中间价为成交价，深交所取距前收盘价最近的价位为成交价。</p> <p>集合竞价的所有交易以同一价格成交。</p>
<p>3.6.3 连续竞价时，成交价格确定原则为：</p> <p>（一）最高买入申报价格与最低卖出申报价格相同，以该价格为成交价格；</p> <p>（二）买入申报价格高于即时揭示的最低卖出申报价格的，以即时揭示的最低卖出申报价格为成交价格；</p> <p>（三）卖出申报价格低于即时揭示的最高买入申报价格的，以即时揭示的最高买入申报价格为成交价格。</p>	<p>第六十七条 连续竞价时，成交价格确定原则为：</p> <p>（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；</p> <p>（二）买入申报价格高于即时揭示的最低卖出申报价格时，以即时揭示的最低卖出申报价格为成交价；</p> <p>（三）卖出申报价格低于即时揭示的最高买入申报价格时，以即时揭示的最高买入申报价格为成交价。</p>
<p>3.6.4 按成交原则达成的价格不在最小价格变动单位范围内的，按照四舍五入原则取至相应的最小价格变动单位。</p>	

<p>3.6.5 买卖申报经交易主机撮合成交后，交易即告成立。符合本规则各项规定达成的交易于成立时生效，买卖双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。</p> <p>因不可抗力、意外事件、交易系统被非法侵入等原因造成严重后果的交易，本所可以采取适当措施或认定无效。</p> <p>对显失公平的交易，经本所认定并经理事会同意，可以采取适当措施，并向证监会报告。</p> <p>违反本规则，严重破坏证券市场正常运行的交易，本所有权宣布取消，由此造成的损失由违规交易者承担。</p>	<p>第七十二条 买卖申报经交易主机撮合成交后，交易即告成立。符合本规则各项规定达成的交易于成立时生效，买卖双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。</p> <p>因不可抗力、非法侵入交易系统等原因造成严重后果的交易，交易所可以认定无效。</p> <p>违反本规则，严重破坏证券市场正常运行的交易，交易所所有权宣布取消交易。由此造成的损失由违规交易者承担。</p>
<p>3.6.6 依照本规则达成的交易，其成交结果以本所交易主机记录的成交数据为准。</p>	<p>第七十三条 依照本规则达成的交易，其成交结果以交易所指定的登记结算机构发送的结算数据为准。</p>
	<p>第七十四条 会员应当在成交后的第一个交易日(T+1)开市前为客户完成清算交收手续，并在营业时间内为客户提供查询服务。B股的交收期由结算规则另行规定。</p>
	<p>第七十五条 会员不得以投资者违约为由，不履行清算交收义务。</p>
<p>3.6.7 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。</p>	<p>第七十六条 会员间的清算交收业务由交易所指定的登记结算机构负责办理。</p>
	<p>第七十七条 清算交收的具体规则，依照登记结算机构的规定执行。</p>
<p><b>第七节 大宗交易</b></p>	<p><b>第五节 大宗交易</b></p>
<p>3.7.1 在本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：</p> <p>（一）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；</p> <p>（二）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30万元美元；</p>	<p>第九十八条 证券单笔买卖申报达到一定数额的，交易所可以采用大宗交易方式进行交易。</p> <p>交易所可以根据市场情况调整大宗交易的最低限额。</p>

<p>(三) 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;</p> <p>(四) 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;</p> <p>(五) 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。</p> <p>本所可以根据市场情况调整大宗交易的最低限额。</p>	
<p>3.7.2 本所接受大宗交易申报的时间为每个交易日 9:30 至 11:30、13:00 至 15:30。</p>	
<p>3.7.3 大宗交易的申报包括意向申报和成交申报。</p> <p>意向申报指令应包括证券账号、证券代码、买卖方向等。</p> <p>成交申报指令应包括证券代码、证券账号、买卖方向、成交价格、成交数量等。</p>	
<p>3.7.4 意向申报应当真实有效。申报方价格不明确的, 视为至少愿以规定的最低价格买入或最高价格卖出; 数量不明确的, 视为至少愿以大宗交易单笔买卖最低申报数量成交。</p>	
<p>3.7.5 当意向申报被会员接受(包括其他会员报出比意向申报更优的价格)时, 申报方应当至少与一个接受意向申报的会员进行成交申报。</p>	
<p>3.7.6 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。</p> <p>无涨跌幅限制证券的大宗交易成交价格, 由买卖双方在收盘价的上下 30%或当日已成交的最高、最低价之间自行协商确定。</p>	<p>第九十九条 大宗交易的成交价格, 由买卖双方在当日已成交的最高和最低成交价格之间确定。该证券当日无成交的, 以前收盘价为成交价。</p>
<p>3.7.7 买卖双方达成协议后, 向本所交易系统提出成交申报, 申报的交易价格和数量必须一致。</p> <p>成交申报一经本所确认, 不得变更或撤销, 买卖双方必须承认交易结果。</p>	<p>第一百条 大宗交易由买卖双方达成一致, 并由交易所确认后方可成交。</p>

3.7.8 会员应保证大宗交易参与者实际拥有与意向申报和成交申报相对应的证券或资金。	
3.7.9 本所债券大宗交易实行一级交易商制度。 经本所认可的会员，可以担任一级交易商，通过本所大宗交易系统 进行债券双边报价业务。	
3.7.10 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该证券成交总量。	
3.7.11 每个交易日大宗交易结束后，属于股票和基金大宗交易 的，本所公告证券名称、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，本所公告证券名称、 成交价和成交量等信息。	第一百零一条 大宗交易不纳入指数计算，成交量则在收盘后计入该 证券成交总量。该证券每笔大宗交易的成交量、成交价及买卖双方于 收盘后单独公布。
	<b>第六章 债券交易的特别规定</b>
	<b>第一节 回转交易</b>
	第一百零二条 债券可以进行回转交易。
	第一百零三条 投资者买入的债券经交易主机确认成交后，可以在当 日全部或部分卖出。
<b>第八节 债券回购交易</b>	<b>第二节 回购交易</b>
3.8.1 债券回购交易包括债券买断式回购交易和债券质押式回购 交易等。	
3.8.2 债券买断式回购交易是指债券持有人将债券卖给购买方 的同时，交易双方约定在未来某一日期，卖方再以约定价格从买方购 回相等数量同种债券的交易。 债券质押式回购交易是指债券持有人在将债券质押的同时，将相 应债券以标准券折算比率计算出的标准券数量为融资额度而进行的 质押融资，交易双方约定在回购期满后返还资金和解除质押的交易。	第一百零四条 债券回购交易，指债券持有人在卖出一笔债券的同 时，与买方约定，经过一定期限后，以一定价格再行买回该笔债券的 交易。

	第一百零五条 债券持有人可卖出债券的数量,根据其在交易所指定的登记结算机构库存债券数量以交易所公布的标准券(综合券)折算率计算出的标准券(综合券)量为限。
	第一百零六条 交易所按季公布各债券品种的标准券(综合券)折算率,并按该比率计算各会员的标准券(综合券)库存。交易所可以根据市场情况调整标准券(综合券)折算率的公布时间。
3.8.3 债券回购交易的期限按日历时间计算。如到期日为非交易日,顺延至下一个交易日结算。	第一百零七条 债券回购交易的期限按日历时间计算。若到期日为非交易日,顺延至下一个交易日结算。
	第一百零八条 会员将债券用于回购业务的,必须在该债券托管的席位上进行申报。
	第一百零九条 卖出债券后一定期限再行买回该笔债券的交易方,其申报为“买入”,对应方申报为“卖出”。
<b>第四章 其他交易事项</b>	<b>第五章 其他交易事项</b>
	<b>第一节 指定交易与转托管</b>
	第八十四条 深交所投资者可以以同一证券帐户在多个证券营业部买入证券,但必须在原买入证券的营业部委托卖出该证券。投资者买入证券后可以向原买入证券的营业部发出转托管指令。转托管完成后,投资者才可以在转入营业部卖出其证券。
<b>第一节 开盘价与收盘价</b>	<b>第二节 开盘价与收盘价</b>
4.1.1 证券的开盘价为当日该证券的第一笔成交价格。	第八十五条 证券的开盘价为当日该证券的第一笔成交价。
4.1.2 证券的开盘价通过集合竞价方式产生,不能产生开盘价的,以连续竞价方式产生。	第八十七条 证券的开盘价通过集合竞价方式产生,不能产生开盘价的,以连续竞价方式产生。
4.1.3 证券的收盘价为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)。当日无成交的,以前	第八十六条 证券的收盘价为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)。当日无成交的,以

收盘价为当日收盘价。	前收盘价为当日收盘价。
	第八十九条 交易所对上市证券实施挂牌交易。上市首日证券行情显示的前收盘价为其发行价。
	第八十八条 按集合竞价产生开盘价后，未成交的买卖申报仍然有效，并按原申报顺序自动进入连续竞价。
<b>第二节 挂牌、摘牌、停牌与复牌</b>	<b>第三节 挂牌、摘牌、停牌与复牌</b>
4.2.1 本所以对上市证券实行挂牌交易。	第八十九条 交易所对上市证券实施挂牌交易。上市首日证券行情显示的前收盘价为其发行价。
4.2.2 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，并予以摘牌。	第九十条 证券上市期届满或依法不再具备上市条件的，交易所终止其上市交易，予以摘牌。
4.2.3 股票、封闭式基金交易出现异常波动的，本所可以决定停牌，直至相关当事人作出公告当日的上午 10:30 予以复牌。 根据市场发展需要，本所可以调整停牌证券的复牌时间。	
4.2.4 本所可以对涉嫌违法违规交易的证券实施特别停牌并予以公告，相关当事人应按照本所的要求提交书面报告。 特别停牌及复牌的时间和方式由本所决定。	
	第九十一条 对于连续三天以上（含三天）达到涨跌幅限制的证券，交易所对其实施停牌（暂停交易）半天，并予以公告。根据证监会和交易所业务规则的规定，交易所可以对其他上市证券实施停牌或复牌（恢复交易）。
4.2.5 证券停牌时，本所发布的行情中包括该证券的信息；证券摘牌后，行情中无该证券的信息。	第九十二条 证券停牌时，交易所发布的行情中包括该证券的信息；证券摘牌后，行情信息中无该证券的信息。
4.2.6 证券开市期间停牌的，停牌前的申报参加当日该证券复牌后的交易；停牌期间，可以继续申报，也可以撤销申报；复牌时对已接受的申报实行集合竞价，集合竞价期间不揭示虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量、虚拟未匹配量。	第九十三条 上交所开市期间停牌的，停牌前的申报参加当日该证券复牌后的交易；停牌期间，不接受申报，但停牌前的申报可以撤销。深交所开市期间停牌的，停牌前的申报参加当日该证券复牌后的交易；停牌期间，可以申报，申报也可以撤销；复牌时对已接受的申报

	实行集合竞价。
4.2.7 证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的，本所予以公告。	第九十四条 证券的挂牌、摘牌、停牌与复牌，交易所予以公告。
4.2.8 证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的其他规定，按照本所上市规则或其他有关规定执行。	
<b>第三节 除权与除息</b>	<b>第四节 除权与除息</b>
4.3.1 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股为最后交易日）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。	第九十五条 上市证券发生权益分派、公积金转增股本、配股等情况，交易所在股权（债权）登记日（B股为最后交易日）次一交易日对该证券作除权除息处理。
4.3.2 除权（息）参考价格的计算公式为： 除权（息）参考价格 = [（前收盘价格 - 现金红利） + 配（新）股价格 × 流通股份变动比例] ÷ （1 + 流通股份变动比例）。 证券发行人认为有必要调整上述计算公式的，可向本所提出调整申请并说明理由。本所可以根据申请决定调整除权（息）参考价格计算公式，并予以公布。 除权（息）日即时行情中显示的该证券的前收盘价为除权（息）参考价。	第九十六条 除权（息）价的计算公式为：除权（息）报价 = [(前收盘价 - 现金红利) + 配(新)股价格 × 流通股份变动比例] ÷ (1 + 流通股份变动比例) 证券发行人认为调整上述计算公式有利于保护投资者合法权益的，可向交易所提出调整申请并说明理由。交易所认为必要时，可调整除权（息）价计算公式，并予以公布。 除权（息）日该证券的前收盘价改为除权（息）日除权（息）价。
4.3.3 除权（息）日证券买卖，按除权（息）参考价格作为计算涨跌幅度的基准，本所另有规定的除外。	第九十七条 除权（息）日证券买卖，按除权（息）价作为计算涨跌幅度的基准，交易所另有规定的除外。
<b>第五章 交易信息</b>	<b>第一章 第六节 交易信息</b>
<b>第一节 一般规定</b>	
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。	第二十条 交易所每个交易日发布证券交易即时行情、股价指数等交易信息。
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，并予以发布。	第二十四条 交易所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，并及时向社会公布。
5.1.3 本所市场产生的交易信息归本所所有。未经本所许可，	第二十九条 交易所市场产生的证券交易信息归交易所所有。未经许

任何机构和个人不得使用 and 传播。 经本所许可使用交易信息的机构和个人，未经本所同意，不得将本所交易信息提供给其他机构和个人使用或予以传播。	可，任何机构和个人不得擅自使用和传播。
5.1.4 证券交易信息的管理办法由本所另行规定。	
<b>第二节 即时行情</b>	
5.2.1 每个交易日 9:15 至 9:25 开盘集合竞价期间，即时行情内容包括：证券代码、证券简称、前收盘价格、虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量和虚拟未匹配量。	
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、前收盘价格、最新成交价格、当日最高成交价格、当日最低成交价格、当日累计成交数量、当日累计成交金额、实时最高五个买入申报价格和数量、实时最低五个卖出申报价格和数量。	第二十一条 即时行情内容包括：证券代码、证券简称、前收盘价、最新成交价、当日最高价、当日最低价、当日累计成交数量、当日累计成交金额、实时最高三个价位买入申报价格和数量、实时最低三个价位卖出申报价格和数量等。
5.2.3 首次上市证券上市首日，其即时行情显示的前收盘价格为其发行价，本所另有规定的除外。	第八十九条 交易所对上市证券实施挂牌交易。上市首日证券行情显示的前收盘价为其发行价。
5.2.4 即时行情通过通信系统传输至各会员，会员应在本所许可的范围内使用。	第二十二条 即时行情通过通信系统传输至各会员，会员必须将其在营业场所予以公布。
5.2.5 根据市场发展需要，本所可以调整即时行情发布的方式和内容。	第二十三条 根据市场需要，经证监会批准，交易所可以调整即时行情发布的方法和内容。
	第二十四条 交易所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，并及时向社会公布。
<b>第三节 证券指数</b>	
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。	第二十五条 交易所编制综合指数、成份指数和分类指数等，以反映股市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 证券指数的编制遵循公开透明的原则。	第二十六条 指数采用派许加权综合价格指数公式计算。计算公式为：

	$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本总市值(流通市值)}}{\text{基期样本总市值(流通市值)}} \times \text{基期指数}$
<p>5.3.3 证券指数设置和编制的具体方法由本所另行规定。</p>	<p>第二十七条 根据需要，交易所可以调整指数设置和编制方法。具体办法由交易所另行规定。</p>
<p><b>第四节 证券交易公开信息</b></p>	
<p>5.4.1 有价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金竞价交易出现下列情形之一的，本所公布当日买入、卖出金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额：</p> <p>（一）日收盘价格涨跌幅偏离值达到±7%的各前三只股票（基金）；</p> <p>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（基金）涨跌幅-对应分类指数涨跌幅。</p> <p>（二）日价格振幅达到15%的前三只股票（基金）；</p> <p>价格振幅的计算公式为：价格振幅=（当日最高价格-当日最低价格）/当日最低价格×100%。</p> <p>（三）日换手率达到20%的前三只股票（基金）；</p> <p>换手率的计算公式为：换手率=成交股数（份额）/流通股数（份额）×100%。</p> <p>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。</p> <p>对应分类指数包括本所编制的上证A股指数、上证B股指数和上证基金指数等。</p> <p>对 3.4.13 规定的无价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金，本所公布当日买入、卖出金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额。</p>	<p>第二十八条 交易所对A股和基金每日涨跌幅比例超过7%（含7%）的前5只证券，公布其成交金额最大的5家会员营业部或席位的名称及成交金额；涨幅或跌幅相同的，依次按成交金额和成交量选取证券。会员应当将前款规定的交易信息在营业场所予以公布。</p>

<p>5.4.2 股票、封闭式基金竞价交易出现下列情形之一的，属于异常波动，本所分别公告该股票、封闭式基金交易异常波动期间累计买入、卖出金额最大五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额：</p> <p>（一）连续三个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到±20%的；</p> <p>（二）ST 股票和*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±15%的；</p> <p>（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，并且该股票、封闭式基金连续三个交易日内的累计换手率达到 20%的；</p> <p>（四）本所或证监会认定属于异常波动的其他情形。</p> <p>异常波动指标自复牌之日起重新计算。</p> <p>对 3.4.13 规定的无价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金不纳入异常波动指标的计算。</p>	
<p>5.4.3 本所根据第 4.2.4 条对证券实施特别停牌的，根据需要可以公布以下信息：</p> <p>（一）成交金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出数量和买入、卖出金额；</p> <p>（二）股份统计信息；</p> <p>（三）本所认为应披露的其他信息。</p>	
<p>5.4.4 证券交易公开信息涉及机构的，公布名称为“机构专用”。</p>	
<p>5.4.5 根据市场发展需要，本所可以调整证券交易公开信息的内容。</p>	
	<p>第二十九条 交易所市场产生的证券交易信息归交易所所有。未经许可，任何机构和个人不得擅自使用和传播。</p>

<b>第六章 交易行为监督</b>	
<p>6.1 本所对下列可能影响证券交易价格或者证券交易量的异常交易行为，予以重点监控：</p> <p>（一）可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前，大量买入或者卖出相关证券；</p> <p>（二）以同一身份证明文件、营业执照或其他有效证明文件开立的证券账户之间，大量或者频繁进行互为对手方的交易；</p> <p>（三）委托、授权给同一机构或者同一个人代为从事交易的证券账户之间，大量或者频繁进行互为对手方的交易；</p> <p>（四）两个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户之间，大量或者频繁进行互为对手方的交易；</p> <p>（五）大笔申报、连续申报或者密集申报，以影响证券交易价格；</p> <p>（六）频繁申报或频繁撤销申报，以影响证券交易价格或其他投资者的投资决定；</p> <p>（七）巨额申报，且申报价格明显偏离申报时的证券市场成交价格；</p> <p>（八）一段时期内进行大量且连续的交易；</p> <p>（九）在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易；</p> <p>（十）大量或者频繁进行高买低卖交易；</p> <p>（十一）进行与自身公开发布的投资分析、预测或建议相背离的证券交易；</p> <p>（十二）在大宗交易中进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报；</p> <p>（十三）本所认为需要重点监控的其他异常交易。</p>	
<p>6.2 会员及其营业部发现投资者的证券交易出现 6.1 条所列异常交易行为之一，且可能严重影响证券交易秩序的，应当予以提醒，并及时向本所报告。</p>	
<p>6.3 出现 6.1 条所列异常交易行为之一，且对证券交易价格或者交易量产生重大影响的，本所可采取非现场调查和现场调查措施，要求相关会员及其营业部提供投资者开户资料、授权委托书、资金存取</p>	

<p>凭证、资金账户情况、相关交易情况等资料；如异常交易涉及投资者的，本所可以直接要求其提供有关材料。</p>	
<p>6.4 会员及其营业部、投资者应当配合本所进行相关调查，及时、真实、准确、完整地提供有关文件和资料。</p>	
<p>6.5 对情节严重的异常交易行为，本所可以视情况采取下列措施：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(一) 口头或书面警示；</li> <li>(二) 约见谈话；</li> <li>(三) 要求相关投资者提交书面承诺；</li> <li>(四) 限制相关证券账户交易；</li> <li>(五) 报请证监会冻结相关证券账户或资金账户；</li> <li>(六) 上报证监会查处。</li> </ul> <p>如对第(四)项措施有异议的，可以向本所提出复核申请。复核期间不停止相关措施的执行。</p>	
<b>第七章 交易异常情况处理</b>	<b>第七章 交易异常情况处理</b>
<p>7.1 发生下列交易异常情况之一，导致部分或全部交易不能进行的，本所可以决定技术性停牌或临时停市：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(一) 不可抗力；</li> <li>(二) 意外事件；</li> <li>(三) 技术故障；</li> <li>(四) 本所认定的其他异常情况。</li> </ul>	<p>第一百一十条 发生下列交易异常情况之一，导致部分或全部交易不能进行的，交易所可以决定临时停市或技术性停牌：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(一) 不可抗力；</li> <li>(二) 意外事故；</li> <li>(三) 技术故障；</li> <li>(四) 非交易所能够控制的其他异常情况。</li> </ul>
<p>7.2 出现行情传输中断或无法申报的会员营业部数量超过营业部总数 10%以上的交易异常情况，本所可以实行临时停市。</p>	<p>第一百一十一条 出现无法申报的交易席位数量超过交易所已开通席位总数的 10%以上的，或者行情传输中断的营业部数量超过营业部总数的 10%以上的交易异常情况，交易所实行临时停市。</p>

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,并会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。	第一百一十二条 交易所认为可能发生第一百十条、第一百一十一条规定的交易异常情况,并严重影响交易正常进行的,可以决定临时停市或停牌。 技术性停牌和临时停市处理办法由交易所另行制定发布。
7.4 本所对技术性停牌或临时停市决定予以公告。	第一百一十三条 交易所对技术性停牌或临时停市决定予以公告,并报证监会备案。
7.5 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。	第一百一十四条 技术性停牌或临时停市原因消除后,交易所可以决定恢复交易。
7.6 除本所认定的特殊情况外,技术性停牌或临时停市后当日恢复交易的,技术性停牌或临时停市前交易主机已经接受的申报有效。交易主机在技术性停牌或临时停市期间继续接受申报,在恢复交易时对已接受的申报实行集合竞价交易。	第一百一十五条 除交易所认定的特殊情况之外,技术性停牌或临时停市前交易主机已经接受的申报有效。深交所技术性停牌或临时停市期间继续接受申报,在恢复交易时对已接受的申报实行集合竞价。
7.7 因交易异常情况及本所采取的相应措施造成的损失,本所不承担责任。	第一百一十六条 因交易异常情况及交易所采取的相应措施造成的损失,交易所不承担责任。
<b>第八章 交易纠纷</b>	<b>第八章 交易纠纷</b>
8.1 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷,相关会员应当记录有关情况,以备本所查阅。交易纠纷影响正常交易的,会员应当及时向本所报告。	第一百一十七条 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷,相关会员应当记录有关情况,以备交易所查阅。交易纠纷影响正常交易的,会员应当及时向交易所报告。
8.2 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷,本所可以按有关规定,提供必要的交易数据。	第一百一十八条 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷,交易所可以按有关规定,提供必要的交易数据。
8.3 客户对交易有疑义的,会员应当协调处理。	第一百一十九条 投资者对交易有疑义的,会员有义务协调处理。
<b>第九章 交易费用</b>	<b>第九章 交易费用</b>
	第一百二十条 会员受托买卖证券成交的,应当按规定向客户收取佣金。

9.1 投资者买卖证券成交的，应当按规定向代其进行证券买卖的会员交纳佣金。	第一百二十一条 投资者买卖证券成交的，应当按规定交纳佣金，买卖股票成交的，还应当依法纳税。
9.2 会员应当按规定向本所交纳会员费、交易经手费及其他费用。	第一百二十二条 会员应当按规定向交易所交纳席位费、会员费、交易经手费及其他费用。
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。	第一百二十三条 证券交易的收费项目、收费标准和管理办法由国务院有关管理部门统一规定。
<b>第十章 纪律处分</b>	<b>第十章 罚则</b>
10.1 会员违反本规则的，本所责令其改正，并视情节轻重单处或并处： （一）在会员范围内通报批评； （二）在证监会指定的媒体上公开谴责； （三）暂停或者限制交易； （四）取消交易资格； （五）取消会员资格。	第一百二十四条 会员违反本规则的，交易所责令其改正，并视情节轻重单处或并处： （一）罚款； （二）会员范围内通报批评； （三）在证监会指定报刊上公开批评； （四）警告； （五）限制交易； （六）暂停自营业务或经纪业务； （七）取消会籍。
10.2 会员对前条（二）、（三）、（四）、（五）项处分有异议的，可以自接到处分通知之日起15日内向本所理事会申请复核。复核期间不停止相关处分的执行。	第一百二十五条 会员对前条（四）、（五）、（六）、（七）项处罚有异议的，可以自接到处罚通知之日起15日内向交易所理事会申请复议，复议期间该处罚继续执行。
<b>第十一章 附则</b>	<b>第十一章 附则</b>
11.1 交易型开放式指数基金、债券、债券回购、权证等品种的其他交易事项，由本所另行规定。	

11.2 本规则中所述时间，以本所交易主机的时间为准。	
11.3 本所有关股票、基金交易异常波动的规定与本规则不一致的，按本规则执行。	
<p>11.4 本规则下列用语含义：</p> <p>（一）市场：指本所设立的证券交易市场。</p> <p>（二）上市交易：指证券在本所挂牌交易。</p> <p>（三）委托：指投资者向会员进行具体授权买卖证券的行为。</p> <p>（四）申报：指会员向本所交易主机发送证券买卖指令的行为。</p> <p>（五）标准券：指由不同债券品按相应折算率折算形成的，用以确定可利用质押式回购交易进行融资的额度。</p> <p>（六）最优价：指集中申报簿中买方的最高价或卖方的最低价。集中申报簿指交易主机中某一时点按买卖方向以及价格优先、时间优先顺序排列的所有未成交申报队列。</p> <p>（七）虚拟开盘参考价格：指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格。</p> <p>（八）虚拟匹配量：指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量。</p> <p>（九）虚拟未匹配量：指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方或卖方剩余申报数量。</p>	<p>第一百二十六条 本规则下列用语具有如下含义：</p> <p>（一）市场，指交易所设立的证券集中交易市场。</p> <p>（二）证券，指依据国家有关法律、法规发行，并在交易所上市的各种类证券。</p> <p>（三）上市，指证券在交易所挂牌交易。</p> <p>（四）委托，指投资者向会员进行具体授权买卖证券的行为。</p> <p>（五）申报，指会员向交易所交易主机发送证券买卖指令的行为。</p> <p>（六）标准券，指在上交所指定的登记结算机构托管而用于回购交易并按交易所规定的折算率计算出的回购抵押券。综合券，指深交所各类可用于回购交易的债券按一定的比率折算的用于回购交易的虚拟债券品种。</p> <p>（七）回转交易：指当日（T日）买入的证券，依照本规则的规定，在交收日之前卖出的交易。</p> <p>（八）交易所公告：指交易所以正式公告或其他形式在证监会指定的信息披露媒体上发布的，或通过交易所行情传输系统发布的可能影响市场交易的相关信息。</p>
11.5 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。	第一百二十七条 本规则经交易所理事会通过，报证监会批准后生效。修改时亦同。
11.6 本规则由本所负责解释。	第一百二十八条 本规则由交易所负责解释。
11.7 本规则自 2006 年 7 月 1 日起施行。	第一百二十九条 本规则自发布之日起三个月后施行。本规则施行前

实行的规定与本规则相抵触的，以本规则为准。