

关于发布《深圳证券交易所创业板交易特别规定》的通知

深证上〔2020〕515号

各市场参与人：

为积极稳妥推进创业板改革并试点注册制，保障市场平稳运行，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》等法律法规及《深圳证券交易所交易规则》等业务规则，本所制定了《深圳证券交易所创业板交易特别规定》（以下简称《交易特别规定》），经中国证监会批准，现予以发布，并将有关事项通知如下：

一、《交易特别规定》自按照《创业板首次公开发行股票注册管理办法（试行）》发行上市的首只股票上市首日起施行。

二、自本通知发布之日起，创业板股票被实施风险警示的，本所自该股票被实施风险警示当日起将其调整出融资融券标的证券范围。

三、深股通投资者参与创业板股票盘后定价交易相关规定暂不实施，具体实施时间及业务安排由本所另行通知。

特此通知

附件：深圳证券交易所创业板交易特别规定

深圳证券交易所

2020年6月12日

深圳证券交易所创业板交易特别规定

第一章 总 则

1.1 为规范深圳证券交易所（以下简称“本所”）创业板市场交易行为，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》等法律法规及《深圳证券交易所交易规则》（以下简称《交易规则》）等业务规则，制定本规定。

1.2 在本所创业板上市的股票和存托凭证，以及相关基金的交易，适用本规定。本规定未作规定的，适用《交易规则》及本所其他有关规定。

第二章 竞价交易

2.1 本所以对创业板股票竞价交易实行价格涨跌幅限制，涨跌幅限制比例为 20%。超过涨跌幅限制的申报为无效申报。

创业板首次公开发行上市的股票，上市后的前五个交易日不设价格涨跌幅限制。本所可以通过适当方式作出相应标识。

2.2 买卖创业板股票，连续竞价阶段限价申报的有效

竞价范围，应当符合下列要求：

（一）买入申报价格不得高于买入基准价格的 102%；

（二）卖出申报价格不得低于卖出基准价格的 98%。

前款所称买入（卖出）基准价格，为即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格；无即时揭示的最低卖出（最高买入）申报价格的，为即时揭示的最高买入（最低卖出）申报价格；无即时揭示的最高买入（最低卖出）申报价格的，为最近成交价；当日无成交的，为前收盘价。

开市期间临时停牌阶段的限价申报，不适用前两款规定。

2.3 有效竞价范围的计算结果按照四舍五入原则取至价格最小变动单位。

有效竞价范围上限或下限与基准价格之差的绝对值低于价格最小变动单位的，以基准价格增减一个价格最小变动单位为有效竞价范围。

2.4 超过有效竞价范围的限价申报不能即时参加竞价，暂存于交易主机；当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。

2.5 创业板股票竞价交易出现下列情形之一的，属于盘中异常波动，本所实施盘中临时停牌：

（一）无价格涨跌幅限制的股票盘中交易价格较当日开盘价格首次上涨或下跌达到或超过 30%的；

（二）无价格涨跌幅限制的股票盘中交易价格较当日开

盘价格首次上涨或下跌达到或超过 60%的；

（三）中国证监会或者本所认定属于盘中异常波动的其他情形。

2.6 根据前条规定实施盘中临时停牌的，按照下列规定执行：

（一）单次盘中临时停牌的持续时间为 10 分钟；

（二）停牌时间跨越 14：57 的，于当日 14：57 复牌，并对已接受的申报进行复牌集合竞价，再进行收盘集合竞价；

（三）盘中临时停牌期间，可以申报，也可以撤销申报，复牌时对已接受的申报实行盘中集合竞价。

盘中临时停牌具体时间以本所公告为准。

2.7 本所可以对创业板股票的有效竞价范围和盘中临时停牌情形等另行作出规定，并根据市场情况进行调整。

2.8 创业板股票限价申报的单笔买卖申报数量不得超过 30 万股，市价申报的单笔买卖申报数量不得超过 15 万股。

2.9 本所对下列基金竞价交易实行的涨跌幅限制比例为 20%：

（一）跟踪指数成份股仅为创业板股票或其他实行 20%涨跌幅限制股票的指数型 ETF、LOF 或分级基金 B 类份额；

（二）基金合同约定投资于创业板股票或其他实行 20%涨跌幅限制股票的资产占非现金基金资产比例不低于 80%的 LOF。

本所向市场公布涨跌幅限制比例为 20% 的基金名单。

第三章 盘后定价交易

3.1 盘后定价交易，是指在创业板股票交易收盘后按照时间优先的原则，以当日收盘价对盘后定价买卖申报逐笔连续撮合的交易方式。

3.2 每个交易日的 15:05 至 15:30 为盘后定价交易时间。盘后定价交易申报的时间为每个交易日 9:15 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。当日 15:00 仍处于停牌状态的，不进行盘后定价交易。

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。

盘后定价申报当日有效。

3.3 投资者通过盘后定价交易买卖股票的，应当向会员提交盘后定价委托指令。盘后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。

3.4 会员等交易参与人的盘后定价申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、交易单元代码、证券营业部识别码、买卖方向、限价、数量等内容。

深股通盘后定价申报指令应当包括券商客户编码、证券代码、经纪商代码、买卖方向、限价、数量等内容。

3.5 买入限价低于收盘价或卖出限价高于收盘价的盘后定价申报无效。

3.6 盘后定价申报的单笔申报数量不得超过 100 万股。

3.7 盘后定价交易期间，本所以收盘价为成交价、按照时间优先原则对盘后定价申报进行逐笔连续撮合。

3.8 每个交易日 9:15 至 15:05，盘后定价申报不纳入即时行情；15:05 至 15:30，盘后定价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、盘后定价交易当日累计成交数量、盘后定价交易当日累计成交金额以及买入或卖出的实时未成交申报数量。

3.9 盘后定价交易成交量、成交金额在盘后定价交易结束后计入该股票当日总成交量、总成交金额。

3.10 通过盘后定价交易减持股份的，视同通过竞价交易减持股份。

3.11 盘后定价交易纳入深股通额度控制，当日额度在本所盘后定价交易阶段使用完毕的，联交所证券交易服务公司停止接受当日后续买入申报，但仍接受卖出申报。停止接受买入申报的，当日不再恢复，本所另有规定的除外。

第四章 交易公开信息

4.1 有价格涨跌幅限制的创业板股票竞价交易出现下

列情形之一的，本所分别公布相关股票当日买入、卖出金额最大的五家会员证券营业部或交易单元的名称及其各自买入、卖出金额：

（一）当日收盘价涨跌幅达到±15%的各前五只股票；

（二）当日价格振幅达到30%的前五只股票，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×100%；

（三）当日换手率达到30%的前五只股票，换手率的计算公式为：换手率=成交股数/无限售条件股份总数×100%。

收盘价涨跌幅、价格振幅或换手率相同的，依次按成交金额和成交量选取。

4.2 创业板股票竞价交易出现下列情形的，属于异常波动，本所分别公布其在交易异常波动期间累计买入、卖出金额最大五家会员证券营业部或交易单元的名称及其各自累计买入、卖出金额：

（一）连续三个交易日内日收盘价涨跌幅偏离值累计达到±30%的。收盘价涨跌幅偏离值的计算公式为：收盘价涨跌幅偏离值=单只股票涨跌幅-创业板综合指数涨跌幅；

（二）中国证监会或本所认为属于异常波动的其他情形。

4.3 创业板股票竞价交易出现下列情形之一的，属于严重异常波动，本所公布严重异常波动期间的投资者分类交

易统计等信息：

（一）连续 10 个交易日内 3 次出现第 4.2 条规定的同向异常波动情形；

（二）连续 10 个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到 100%（-50%）；

（三）连续 30 个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到+200%（-70%）；

（四）中国证监会或者本所认定属于严重异常波动的其他情形。

创业板股票交易出现严重异常波动的多种情形的，本所一并予以公布。

4.4 创业板股票交易出现严重异常波动情形的，本所可根据市场情况，加强异常交易监控，并要求会员采取有效措施向客户提示风险。

4.5 异常波动和严重异常波动指标自本所公布之日起重新计算。本所可以根据市场情况，调整异常波动和严重异常波动的认定标准。

无价格涨跌幅限制股票不纳入异常波动和严重异常波动指标的计算。

第五章 其他交易事项

5.1 本所可以通过适当方式，对上市时尚未盈利、具

有表决权差异安排、协议控制架构或者类似特殊安排的发行人的股票或者存托凭证作出相应标识。

5.2 按照《创业板首次公开发行股票注册管理办法（试行）》发行上市的股票，自上市首日起可以作为融资融券标的。被实施风险警示的，本所自该股票被实施风险警示当日起将其调整出标的证券范围。

5.3 创业板股票申报价格最小变动单位适用《交易规则》相关规定。本所可以依据股价高低，实施不同的申报价格最小变动单位，具体事宜由本所另行规定。

5.4 创业板存托凭证交易、融资融券等相关事宜，按照本规定中有关股票交易的规定、《交易规则》以及本所其他相关规定执行。

第六章 附则

6.1 本规定经本所理事会通过，报中国证监会批准。修改时亦同。

6.2 本规定由本所负责解释。