# Data 3

3.5.1 在本所进行的证券交易符合以下条件的，可以采用大宗交易方式：（一）A 股单笔交易数量不低于 30 万股，或者交易金额不低于 200 万元人民币；（二）B 股单笔交易数量不低于 3 万股，或者交易金额不低于 20 万元港币；（三）基金单笔交易数量不低于 200 万份，或者交易金额不低于 200 万元人民币。本所可以根据市场需要，调整大宗交易的最低限额。

if 交易市场 is "深圳证券交易所"

and 证券类型 is "A股"

and (单笔交易数量 ≥300,000股

or 交易金额 ≥200万元人民币)

then 交易方式允许设置为 "大宗交易"

if 交易市场 is "深圳证券交易所"

and 证券类型 is "B股"

and (单笔交易数量 ≥30,000股

or 交易金额 ≥20万元港币)

then 交易方式允许设置为 "大宗交易"

if 交易市场 is "深圳证券交易所"

and 证券类型 is "基金"

and (单笔交易数量 ≥2,000,000份

or 交易金额 ≥200万元人民币)

then 交易方式允许设置为 "大宗交易"

条件：21/15

具体化：0

结果：3/0

3.5.3 采用协议大宗交易方式的，本所接受申报的时间为每个交易日 9:15 至 11:30、13:00 至 15:30。采用盘后定价大宗交易方式的，本所接受申报的时间为每个交易日 15:05 至 15:30。当天全天停牌、处于临时停牌期间或停牌至收市的证券，本所不接受其协议大宗交易申报。当天全天停牌或停牌至收市的证券，本所不接受其盘后定价大宗交易申报。

if 交易方式 is "协议大宗交易"

and 当前时间 not in [9:15-11:30,13:00-15:30]

and 证券状态 = "非停牌"

then 申报结果 is "失败（时段不符）"

if 证券状态 in ["全天停牌","临时停牌","停牌至收市"]

and 交易方式 is "协议大宗交易"

then 申报结果 is "失败（停牌限制）"

if 交易方式 is "盘后定价大宗交易"

and 当前时间 not in [15:05-15:30]

and 证券状态 = "非停牌"

then 申报结果 is "失败（时段不符）"

if 证券状态 in ["全天停牌","停牌至收市"]

and 交易方式 is "盘后定价大宗交易"

then 申报结果 is "失败（停牌限制）"

条件：24/17

具体化：0

结果：4/4

3.5.4 有价格涨跌幅限制证券的协议大宗交易的申报价格在该证券当日涨跌幅限制价格范围内确定。无价格涨跌幅限制证券协议大宗交易的申报价格，不得高于该证券当日竞价交易实时成交均价的 120%和已成交最高价的孰低值，且不得低于该证券当日竞价交易实时成交均价的 80%和已成交最低价的孰高值。均价的计算公式为：均价=已成交金额/已成交股数。计算结果按照四舍五入的原则取至申报价格最小变动单位。

if 证券类型 in ["A股","基金"]

and 价格涨跌幅限制存在

and 申报价格 < 当日最低限价

or 申报价格 > 当日最高限价

then 申报结果 is "失败（价格超限）"

if 证券类型 = "无涨跌幅限制证券"

and (申报价格 > min(当日实时均价×120%, 已成交最高价)

or 申报价格 < max(当日实时均价×80%, 已成交最低价))

and 实时均价 = 已成交金额 ÷ 已成交数量（四舍五入至最小变动单位）

then 申报结果 is "失败（价格校验失败）"

条件：18/10

具体化：2/0

结果：3/3

3.5.6 协议大宗交易意向申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向和本方交易单元代码等内容。意向申报不承担成交义务，意向申报指令可以撤销。协议大宗交易成交申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量、本方及对手方交易单元代码、约定号等内容。成交申报要求明确指定价格和数量。本所对约定号、证券代码、买卖方向、价格、数量等各项要素均匹配的成交申报进行成交确认。协议大宗交易定价申报指令应当包括证券账户号码、证券代码、买卖方向、价格、数量和本方交易单元代码等内容。市场所有参与者可以提交成交申报，按指定的价格与定价申报全部或部分成交，本所按时间优先顺序进行成交确认。定价申报的未成交部分可以撤销。定价申报每笔成交的数量或交易金额，应当满足协议大宗交易最低限额的要求。

if 申报类型 = "成交申报"

and (未包含以下全部字段：

证券账户号、证券代码、买卖方向、价格、数量、

本方交易单元代码、对手方交易单元代码、约定号)

then 申报结果 is "失败（字段缺失）"

if 申报类型 = "成交申报"

and 未找到匹配的对手方申报

and (约定号、证券代码、买卖方向、价格、数量不匹配)

then 申报结果 is "失败（无匹配对手盘）"

if 申报类型 = "定价申报"

and 成交金额 < 规则3.5.1中的该证券类型最低限额

then 剩余未成交部分自动撤销

条件：10/8

具体化：2/2

结果：2/2

3.5.7 证券协议大宗交易的成交确认时间为每个交易日 15:00 至 15:30。

if 协议大宗交易成交确认时间 not in [15:00-15:30]

and 已接收成交申报

then 延迟处理至下一有效时段

条件：6/3

具体化：0

结果：1/0

总：

条件：79/53

具体化：4/2

结果：13/9