



深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则

2008-12-18

2008年12月18日 深证会〔2008〕177号

各会员单位及相关机构：

为提高大宗交易市场效率，丰富交易服务手段，本所决定自2009年1月12日起，启用综合协议交易平台，取代现有大宗交易系统，现发布《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》（见附件）并将有关事项通知如下：

1. 自2009年1月12日起，会员和合格投资者可以通过综合协议交易平台办理证券大宗交易业务和专项资产管理计划协议交易业务，原大宗交易系统不再办理相关业务；
2. 综合协议交易平台业务遵照《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》及本所其他相关规定执行；
3. 原大宗交易系统用户自动成为综合协议交易平台用户，无需再次申请用户资格及相关电子证书；拥有或租用本所交易单元的会员和合格投资者可以申请成为综合协议交易平台用户，新增用户申请通过会员业务专区“协议平台用户新增”栏目办理；交易用户交易权限由绑定的交易单元确定；
4. 为了鼓励投资者利用综合协议交易平台进行债券大宗交易，本所决定自2009年1月12日起一年内暂免征收债券大宗交易经手费（不含监管规费）；
5. 综合协议交易平台相关技术注意事项请参见本所网站“技术专栏”之“相关文档”栏目下《深圳证券交易所综合协议交易平台相关技术系统注意事项》；
6. 自2008年12月18日起，本所将在综合协议交易平台独立测试系统为原大宗交易系统用户提供测试服务，具体事项参见本所网站“技术专栏”之“相关文档”栏目下《深圳证券交易所综合协议交易平台独立测试系统启用通知》；
7. 原大宗交易和专项资产管理计划协议交易人工办理方式不变，没有开通综合协议交易平台用户资格的会员和合格投资者仍可通过人工办理方式进行大宗交易和专项资产管理计划协议交易。

特此通知

附件：《深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则》

二〇〇八年十二月十八日

附件：

深圳证券交易所综合协议交易平台业务实施细则

第一章 总 则

第一条 为规范在深圳证券交易所（以下简称“本所”）综合协议交易平台（以下简称“协议平台”）上进行的大宗交易和协议交易，根据《深圳证券交易所交易规则》（以下简称“《交易规则》”）等相关业务规则，制定本细则。

第二条 本细则所称协议平台，是指本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。

第三条 符合法律法规和《交易规则》规定的证券大宗交易以及专项资产管理计划收益权份额等证券的协议交易，可以通过协议平台进行。

第四条 会员和合格投资者在协议平台的交易行为应当遵守法律、行政法规、部门规章以及本所相关业务规则。

第五条 下列交易可以通过协议平台进行：

- （一）权益类证券大宗交易，包括A股、B股、基金等；
- （二）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；
- （三）专项资产管理计划收益权份额协议交易（以下简称“专项资产管理计划协议交易”）；
- （四）本所规定的其他交易。

第二章 用户申请

第六条 本所会员可以申请成为协议平台交易用户（以下简称“交易用户”）。

第七条 符合条件的合格投资者，经本所批准，可以申请成为交易用户。

合格投资者申请成为交易用户的资格条件和申请程序，由本所另行规定。

第八条 经本所批准，会员和合格投资者可以变更或撤销交易用户资格。

第三章 申 报

第九条 协议平台接受交易用户申报的时间为每个交易日9:15至11:30、13:00至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申报。

第十条 协议平台接受交易用户下列类型的申报：

- （一）意向申报；
- （二）定价申报；
- （三）双边报价；
- （四）成交申报；
- （五）其他申报。

第十一条 意向申报指令应当包括证券账号、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。

第十二条 定价申报指令应当包括证券账号、证券代码、买卖方向、交易价格、交易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申请按指定的价格与定价申报全部或部分成交，交易主机按时间优先顺序配对成交。

定价申报的未成交部分可以撤销。定价申报每笔成交的交易数量或交易金额，应当满足协议平台不同业务模块适用的最低标准。

第十三条 双边报价分为双边意向申报和双边定价申报。双边意向申报等同于两条买卖方向相反的意向申报；双边定价申报等同于两条买卖方向相反的定价申报。

第十四条 成交申报指令包括证券账号、证券代码、买卖方向、交易价格、交易数量和对对手方交易单元代码等内容。

成交申报要求明确指定价格和数量。成交申报指令在协议平台确认成交前可以撤销。

第十五条 根据债券市场发展的需要，本所将债券大宗交易的最低限额调整为：

- （一）债券单笔现货交易数量不低于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；
- （二）债券单笔质押式回购交易数量不低于5000张（以人民币100元面额为1张）。

第四章 成交确认

第十六条 协议平台按不同业务类型分别确认成交，具体确认成交的时间规定如下：

对权益类证券大宗交易、债券大宗交易（除公司债券外），协议平台的成交确认时间为每个交易日15:00至15:30；

对公司债券的大宗交易、专项资产管理计划协议交易，协议平台的成交确认时间为每个交易日9:15至11:30、13:00至15:30。

第十七条 协议平台对申报价格和数量一致的成交申报和定价申报进行成交确认。用户对各交易品种申报的价格应当符合下列规定，交易方可成立：

（一）权益类证券大宗交易中，该证券有价格涨跌幅限制的，由买卖双方在其当日涨跌幅价格限制范围内确定；该证券无价格涨跌幅限制的，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。

（二）债券大宗交易价格，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。

（三）专项资产管理计划协议交易价格，由买卖双方自行协议确定。

第十八条 符合《交易规则》并由协议平台确认的成交，买卖双方必须承认交易结果。协议平台用户应当保证自身或投资者实际拥有与申报时相对应的足额资金或证券数量。因资金或证券数量不足造成成交失败的，协议平台用户应按照中国证券登记结算有限公司深圳分公司的规定承担由此引起的相关责任。

第五章 回转交易与跨系统交易安排

第十九条 债券大宗交易以及专项资产管理计划协议交易实行当日回转交易。

第二十条 协议平台、竞价系统双边交易的公司债券，协议平台T日买入的，T+2日在竞价系统可用；竞价系统T日买入的，T日在协议平台可用。

第二十一条 协议平台、竞价系统双边交易的权益类证券、债券（除公司债券外），协议平台T日买入的，T+1日在竞价系统可用；竞价系统T日买入的权益类证券，T+1日在协议平台可用；竞价系统T日买入的债券（除公司债券外），T日在协议平台可用。

第六章 交易信息披露

第二十二条 本所每个交易日通过协议平台、交易所网站等方式对外发布协议平台交易信息。

第二十三条 对于权益类证券大宗交易以及债券大宗交易（除公司债券外），本所在每个交易日结束后，通过交易所网站公布每笔大宗交易的成交信息。

交易所网站发布的成交信息包括：证券代码、证券名称、成交量、成交价以及买卖双方所在会员营业部或交易单元的名称。

协议平台上进行的权益类证券大宗交易和双边交易债券的大宗交易，暂不纳入本所即时行情和指数的计算，成交量在协议平台交易结束后计入当日该证券成交总量。

第二十四条 对于公司债券大宗交易，本所在协议平台交易时间内通过协议平台和交易所网站即时公布每笔协议交易的报价信息和成交信息。

通过协议平台和交易所网站发布的报价信息包括：证券代码、证券名称、申报类型、买卖方向、买卖数量、买卖价格以及报价联系人和联系方式等。

通过协议平台和交易所网站发布的成交信息包括：证券代码、证券名称、成交量、成交价以及买卖双方所在会员营业部或交易单元的名称。

第二十五条 仅在协议平台交易的公司债券大宗交易信息纳入本所即时行情发布。

即时行情发布的内容包括：证券代码、证券简称、前收盘价、当日最高价、当日最低价、当日累计成交数量、当日累计成交金额以及实时最优五个买入或卖出价位定价申报的申报价格和数量等。

前收盘价的计算方法为前交易日该证券所有大宗交易的成交量加权平均价。当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

第二十六条 对于专项资产管理计划协议交易，本所在协议平台交易时间内通过协议平台和交易所网站即时公布每笔协议交易的报价信息和成交信息。

通过协议平台和交易所网站发布的报价信息包括：证券代码、证券名称、申报类型、买卖方向、买卖数量、买卖价格以及报价联系人和联系方式等；

通过协议平台和交易所网站发布的成交信息包括：证券代码、证券名称、成交量、成交价以及买卖双方所在会员营业部或交易单元的名称。

第二十七条 专项资产管理计划协议交易信息，纳入本所即时行情发布。

即时行情发布内容包括：证券代码、证券简称、前收盘价、当日最高价、当日最低价、当日累计成交数量、当日累计成交金额以及实时最优五个买入或卖出价位定价申报的申报价格和数量等。

前收盘价的计算方法为前交易日该证券所有协议交易的成交量加权平均价。当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

第二十八条 本所可以根据市场需要，调整协议平台交易信息发布的方式和内容。

第七章 监督管理

第二十九条 交易用户应当遵守本所《交易规则》及相关规定，依法及时履行有关信息披露义务。

第三十条 本所对协议平台交易进行监督，对利用协议平台进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报等异常交易行为予以重点监控，并视情况采取监管措施。

第八章 附 则

第三十一条 协议平台相关清算交收业务按照中国证券登记结算有限公司深圳分公司有关规定办理。

第三十二条 本细则未作规定的事宜，参照本所交易规则及其它相关规则执行。

第三十三条 本细则由本所负责解释。

第三十四条 本细则自2009年1月12日起施行。



打印本页



填入收藏夹



关闭窗口

深圳证券交易所 版权所有 Copyright ©2008 Shenzhen Stock Exchange. All Rights Reserved