

## 附件 2

# 深圳证券交易所交易规则修订

## 《深圳证券交易所交易规则》第四章第六节“指数熔断”

(征求意见稿)

4.6.1【指数熔断触发条件】沪深 300 指数出现下列情形的，本所可以于当日暂停相关证券品种的竞价交易（以下简称“指数熔断”）：

（一）沪深 300 指数较前一交易日收盘首次上涨或下跌达到或超过 5%的，指数熔断时间为 30 分钟。指数熔断时间跨越 11:30 的，于 13:00 起继续计算。熔断时间跨越 14:57 的，于 14:57 恢复交易并进行收盘集合竞价，但 14:30 及之后触发的，指数熔断至 15:00，当日不恢复交易。

（二）沪深 300 指数较前一交易日收盘上涨或下跌达到或超过 7%的，指数熔断至 15:00，当日不恢复交易。

开盘集合竞价出现上述情形的，于 9:30 开始实施指数熔断。指数熔断的具体实施时间和证券品种以本所公告为准。

4.6.2【股指期货交割日特殊安排】本所交易日为股指期货合约交割日的，当日指数熔断时间跨越 11:30 的，于 13:00 起恢复交易；当日 13:00 至 15:00 期间，本所不实施指数熔断。

本条所称股指期货合约交割日，是指中国金融期货交易所上市交易的上证 50 指数期货、沪深 300 指数期货、中证 500 指数

期货以及本所规定的其他股指期货合约的交割日。

4.6.3 **【熔断品种】** 本所实施指数熔断的证券品种包括：

- （一）股票；
- （二）基金；
- （三）可转换公司债券和可交换公司债券；
- （四）本所认定的其他证券。

4.6.4 **【熔断期间的申报和熔断结束后恢复交易】** 指数熔断期间，投资者可以申报，也可以撤销申报。

恢复交易时，本所对已接受的申报进行集合竞价，再继续当日交易。

4.6.5 **【复牌时间遇熔断延续】** 指数熔断期间，相关证券复牌的，延至指数熔断结束后实施。

4.6.6 **【收盘价确定】** 指数熔断至 15:00 的，相关证券以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）为收盘价。

4.6.7 **【大宗交易】** 指数熔断至 15:00 的，相关证券当日不再进行大宗交易。