关于完善首次公开发行股票上市首日交易机制有关事项的通知

深证会〔2014〕54 号

各会员单位：

为切实防范首次公开发行股票（以下简称“股票”）上市首日交易风险，维护证券市场秩序，保护投资者的合法权益，根据《中国证监会关于进一步推进新股发行体制改革的意见》和《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，经中国证监会批准，现就完善股票上市首日交易机制的有关事项通知如下：

一、股票上市首日全日投资者的有效申报价格不得高于发行价的 144%且不得低于发行价的 64%，超过有效申报价格范围的申报为无效申报。

有效申报价格范围的计算结果按照四舍五入的原则取至 0.01 元。

二、股票上市首日开盘集合竞价阶段有效竞价范围为发行价的上下 20%。

超过开盘有效竞价范围，但未超过有效申报价格范围的申报不能参加开盘集合竞价，暂存于交易主机，当连续竞价成交价波动使其进入有效竞价范围时，交易主机自动取出申报，参加连续竞价。

集合竞价阶段未产生开盘价的，以当日第一笔成交价作为开盘价。

三、股票上市首日连续竞价阶段出现盘中成交价较当日开盘价首次上涨或下跌达到或超过 10%的，本所对其实施盘中临时停牌，临时停牌时间为 30 分钟。

临时停牌期间，投资者可以申报，也可以撤销申报。复牌时，对已接受的申报进行复牌集合竞价。

盘中临时停牌具体时间以本所公告为准，临时停牌时间跨越 14：57 的，于 14：57 复牌并对已接受的申报进行复牌集合竞价。

四、股票上市首日 14：57 至 15：00 采用收盘集合竞价，收盘价通过集合竞价的方式产生。

收盘集合竞价阶段不允许撤销申报。

五、股票上市首日连续竞价、盘中临时停牌复牌集合竞价、收盘集合竞价的有效竞价范围为最近成交价的上下 10%，但不得超过全日有效申报价格范围。

六、股票上市首日不接受市价申报。

七、本通知自发布之日起施行。本所 2013 年 12 月 13 日发布的《关于首次公开发行股票上市首日盘中临时停牌制度等事项的通知》（深证会〔2013〕142 号）同时废止。本通知未做规定的，适用本所《交易规则》及其他相关规定。

特此通知

深圳证券交易所

2014 年 6 月 13 日