



在科创板股票交易中, 维持涨(跌)幅限制价格的异常交易行为是指什么?

维持涨(跌)幅限制价格是指投资者通过大笔申报、连续申报、密集申报, 维持科创板股票交易价格处于涨(跌)幅限制状态的异常交易行为。



上交所对哪些科创板股票交易中的维持涨(跌)幅限制价格行为予以重点监控?

(1)【盘中维持涨(跌)幅限制价格】在连续竞价交易阶段同时存在下列情形:

- 一是股票交易价格处于涨(跌)幅限制状态;
- 二是单笔以涨(跌)幅限制价格申报后, 在该价格剩余有效申报数量或者金额巨大, 占市场该价格剩余有效申报总量的比例较高, 且持续10分钟以上。

(2)【收盘维持涨(跌)幅限制价格】在收盘集合竞价阶段同时存在下列情形:

- 一是连续竞价结束时股票交易价格处于涨(跌)幅限制状态;
- 二是连续竞价结束时和收盘集合竞价结束时, 市场涨(跌)幅限制价格剩余有效申报数量或者金额巨大;
- 三是收盘集合竞价结束时, 收盘集合竞价阶段新增涨(跌)幅限制价格申报的剩余有效申报数量或者金额较大;
- 四是收盘集合竞价结束时, 涨(跌)幅限制价格剩余有效申报数量占市场该价格剩余有效申报总量的比例较高。



在科创板股票交易中, 自买自卖和互为对手方的异常交易行为是指什么?

在科创板股票交易中, 自买自卖和互为对手方交易是指投资者在自己实际控制的账户之间或者关联账户之间大量进行股票交易, 影响股票交易价格或者交易量的异常交易行为。

(1)【自买自卖】股票交易同时存在下列情形:

- 一是在自己实际控制的账户之间频繁、大量交易;
- 二是成交数量占股票全天累计成交总量的10%以上或者收盘集合竞价阶段成交数量占期间市场成交总量的30%以上。

(2)【互为对手方交易】股票交易同时存在下列情形:

- 一是两个或者两个以上涉嫌关联的证券账户之间互为对手方进行频繁、大量交易;
- 二是成交数量占股票全天累计成交总量的10%以上或者收盘集合竞价阶段成交数量占期间市场成交总量的30%以上。