

上海证券交易所 监管措施决定书

[2024] 13 号

关于对宁波灵均投资管理合伙企业(有限合伙)相关证券账户实施暂停交易措施的决定

当事人:

宁波灵均投资管理合伙企业(有限合伙)

2024年2月19日9:30:00至9:31:00, 宁波灵均投资管理合伙企业(有限合伙)管理的多个产品账户大量卖出沪市股票, 合

计卖出 11.95 亿元，占期间市场成交额的比例较高，期间上证指数由 2886.59 点下跌至 2868.07 点，跌幅 0.65%。

上述账户通过计算机程序自动生成或者下达交易指令进行程序化交易，严重影响正常交易秩序，构成《上海证券交易所交易规则》（以下简称《交易规则》）第 7.2 条第（六）项规定的异常交易行为，违反了《交易规则》第 1.4 条的规定，情节严重。

鉴于上述违规事实和情节，根据《交易规则》第 7.8 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，上海证券交易所（以下简称本所）决定，从 2024 年 2 月 20 日起至 2024 年 2 月 22 日止对宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙）管理的相关产品连续实施暂停投资者账户交易的监管措施，即暂停相关产品账户在上述期间在本所上市交易的所有股票交易。

当事人从事证券交易活动，应当严格遵守法律法规、部门规章和本所业务规则，自觉维护证券市场秩序。

上海证券交易所

2024 年 2 月 20 日