

中央結算系統一般規則

甲部：一般適用的規則

第一章
釋義

101. 定義

在本文件內，除非文義另有所指，下列詞語具有下列意義：

「聯交所交易系統」	指	由聯交所安裝和操作用作證券買賣的自動對盤及成交系統；
「交易通買入聯交所買賣」	指	與交易通聯交所參與者透過聯交所交易系統買入交易通股份相關、並符合以下條件的聯交所買賣：(i) 該項聯交所買賣透過聯交所交易系統成交之前得到交易通買入外匯盤的支援，及(ii)該項聯交所買賣在透過聯交所交易系統成交後得到交易通買入外匯交易的支援；
「交易通買入外匯盤」	指	由交易通聯交所參與者向作為交易通營運者的結算公司發出以港幣兌換人民幣的指令，用以支援該參與者透過聯交所交易系統輸入交易通股份買盤，該買盤在配對成功後，會生成交易通買入聯交所買賣；
「交易通賣出聯交所買賣」	指	與交易通聯交所參與者透過聯交所交易系統賣出交易通股份相關、並符合以下條件的聯交所買賣：(i) 該項聯交所買賣在透過聯交所交易系統成交之前得到交易通賣出外匯盤的支援，及(ii)該項聯交所買賣在透過聯交所交易系統成交之後得到交易通賣出外匯交易的支援；
「交易通賣出外匯盤」	指	由交易通聯交所參與者向作為交易通營運者的結算公司發出以人民幣兌換港幣的指令，用以支援該參與者透過聯交所交易系統輸入交易通股份的沽盤，該沽盤在配對成功後，會生成交易通賣出聯交所買賣；

第九章 結算服務

901. 聯交所買賣的結算 (ia) 取代程序

如聯交所買賣中的一方為非結算參與者，該非結算參與者所指定代為結算其聯交所買賣的全面結算參與者，將取代該非結算參與者以當事人身份成為該宗聯交所買賣的一方，並就該宗聯交所買賣享有完全相同的權利及責任。

如聯交所買賣中的一方為特別參與者，為該特別參與者結算聯交所買賣的相關結算機構參與者將取代該特別參與者以當事人身份成為該宗聯交所買賣的一方，並就該宗聯交所買賣享有完全相同的權利及責任。

就交易通交易所參與者的交易通聯交所買賣，由該交易通交易所參與者指定，代其結算其交易通聯交所買賣與相應的交易通外匯交易的交易通結算參與者，將在有關的交易通聯交所買賣在聯交所交易系統中生效時，取代該交易通交易所參與者，以當事人身份成為該宗交易通聯交所買賣及其相應的交易通外匯交易的其中一方，並就該等買賣及外匯交易享有與該交易通交易所參與者完全相同的權利及負上相同的責任。

第十二 A 章 外匯兌換服務

12A01. 交易通

結算公司可以交易通營運者的身份，並基於下列原則向交易通參與者提供外匯兌換服務，藉此支援在聯交所交易的交易通股份買賣：

- (ii) 當交易通交易所參與者發出交易通買入外匯盤時，即代表該交易通交易所參與者同意，由結算公司按外匯兌換服務而可能向其提供的人民幣資金，只限於用作購買相關的交易通股份，因此該筆資金只可在相應的交易通買入聯交所買賣於聯交所交易系統中生效時作交收之用；

12A06. 交易通支援的買賣

交易通只適用於以下的買賣：

- (i) 交易通交易所參與者指定使用外匯兌換服務的買賣，而該買賣已根據聯交所規則通過聯交所交易系統生效；及
- (ii) 結算公司按照一般規則規定而接納在持續淨額交收制度下交收的聯交所買賣。

12A10. 人民幣外匯匯率

無論是否因為聯交所的交易時間改變或其他原因，結算公司可酌情決定在其認為合適的其他時間按此規則的規定公佈兌換匯率。

為免發生誤解，當交易通交易所參與者在早市時輸入聯交所交易系統的任何交易通股份買盤或賣盤未能在該時段成交，並被轉移到同一交易日的午市繼續執行時：

- (a) 相應的交易通外匯盤應使用結算公司為午市公佈的人民幣買入參考匯率或人民幣賣出參考匯率；及
- (b) 當上述買賣盤在午市經聯交所交易系統生效，相應的交易通外匯交易應使用結算公司公佈適用於午市的人民幣買入最終匯率或人民幣賣出最終匯率。

12A11. 交易通聯交所買賣及交易通外匯交易

在結算公司根據規則第 12A10 在有關交易日公佈外匯匯率的情況下，當交易通聯交所買賣在聯交所交易系統中生效後，有關該交易通外匯盤相應的交易通外匯交易會自動產生〔但可根據聯交所規則容許的買賣的修訂而被更改〕，以交收該項交易通聯交所買賣。

交易通參與者對於交易通外匯交易的責任，為無條件及不可撤回地承諾，以相關的人民幣賣出最終匯率或人民幣買入最終匯率，向結算公司買入或賣出人民幣。除非一般規則和運作程序規則另有規定，交易通結算參與者須在交收交易通聯交所買賣的同一交收日，交收交易通外匯交易。對於交易通賣出外匯交易，參與者須向結算公司交付人民幣，並以適用的人民幣買入最終匯率計算港元金額；對於交易通買入外匯交易，參與者須以適用的人民幣賣出最終匯率計算港元金額，並向結算公司交付港元。交易通外匯交易的交收程序及相關規定已詳載於運作程序規則。

12A16. 結算公司的責任

結算公司提供外匯兌換服務及其對交收交易通交易或股份轉出外匯交易的責任，無論何時都是有條件的，及取決於相關交易通夥伴銀行在相關交收日能向結算公司提供人民幣或港元。因此，如果交易通夥伴銀行不能在相關交收日向結算公司提供資金或足夠相關貨幣的資金，結算公司有權不完成以下交易：

- (i) 交收交易通外匯交易；儘管在交易通聯交所交易根據聯交所規則在聯交所交易系統中生效時，該項交易通外匯交易及相關的交易通聯交所交易會被視作對交易通參與者具有約束力；或

12A18. 暫停交易通

結算公司如決定暫停全部或部份外匯兌換服務，便會在香港交易所網站及／或以結算公司認為適當的其他方式公佈，並列明外匯兌換服務的那些部份將暫停、交易通聯交所買賣、交易通外匯交易、或股份轉出外匯交易會否受影響、暫停服務的生效日期與時間，和任何其他結算公司認為適當的資料。

除非結算公司另有決定或說明：

- (a) 暫停部份的外匯兌換服務不會影響其他部份的外匯兌換服務。具體來說，暫停交易通買入外匯盤的外匯兌換服務並不影響交易通賣出外匯盤的外匯兌換服務；而暫停交易通買入外匯交易的外匯兌換服務並不影響交易通賣出外匯交易或股份轉出外匯交易的外匯兌換服務，反之亦然；
- (b) 當為交易通買入外匯盤而設的外匯兌換服務暫停時，結算公司將不會處理或交收所有在暫停日期或時間生效後，於聯交所交易系統輸入的交易通買入外匯盤，及該日期或時間生效後產生的交易通買入外匯交易；及
- (c) 當為交易通賣出外匯盤而設的外匯兌換服務暫停時，結算公司將不會處理或交收所有在暫停日期或時間生效後，於聯交所交易系統輸入的交易通賣出外匯盤，及該日期或時間生效後產生的交易通賣出外匯交易和股份轉出外匯交易。

除非結算公司另有決定，如果分段（b）所描述的情況發生，交易通中央結算系統參與者有責任籌措相關的人民幣資金，以交收任何交易通買入聯交所買賣，而支援該等交易通買入聯交所買賣的相關交易通買入外匯交易乃在外匯兌換服務暫停日期或時間生效後產生。除非結算公司另有決定，如果分段（c）所描述的情況發生，交易通中央系統結算參與者會被視為同意以人民幣接受任何交易通賣出聯交所買賣所得的賣出款項收益，而支援該等交易通賣出聯交所買賣的相關交易通賣出外匯交易乃在外匯兌換服務暫停日期或時間生效後產生的。此外，所有在相關的外匯兌換服務暫停日期或時間生效後提交的股份轉出要求，和結算公司在該日期或時間生效後接受的股份轉出外匯交易均屬無效。