

交易所規則

第十四章

中華通服務

透過中華通服務輸入買賣盤及執行交易

1418. 在不限規則第1417條的情況下，中華通交易所參與者輸入的中華通買賣盤必須符合相關中華通市場由中華通市場營運者不時為其設定適用的價位、每手買賣單位限制、價格限制、買賣盤大小及其他報價規定或限制（包括但不限於持股量限制、及回轉交易安排的限制及任何形式的熔斷機制）。不同的中華通市場及不同的中華通證券或會應用不同的報價規定或限制。本交易所將透過制定規則或於香港交易所網站作出公布或按其認為適合的其他方式載列其獲相關中華通市場營運者通知的此等規定或限制。本交易所所有權拒絕不符合相關規定及限制的中華通買賣盤。此外，本交易所可全權酌情根據規則第1430條訂定額外的報價規定或限制。
1422. 在符合相關中華通市場營運者適用於聯交所子公司的規則下（包括但不限於任何形式的熔斷機制），中華通交易所參與者輸入的中華通買賣盤可透過中華通交易所參與者經中華通開放式網間連接器向CSC輸入取消指示的要求而被取消，前提是該中華通買賣盤尚未在相關中華通市場系統被配對或及執行。除非相關中華通市場系統發出取消確認，任何中華通買賣盤概不應視為已取消。不論任何理由，若中華通交易所參與者要求取消的中華通買賣盤並無被取消，本交易所及聯交所子公司概毋須承擔任何責任。

使用中華通服務的條件及限制

1430. 本交易所可全權酌情不時對接入或使用中華通服務實施或更改條件或限制，以確保買賣中華通證券不會違反適用法規或本交易所認為適當的任何其他理由。為遵守中國內地的適用法規及相關中華通市場營運者的規定，有關的條件或限制可包括遵守若干持股量限制的規定及持股量披露責任、任何形式的熔斷機制、進行孖展買賣、股票借貸及賣空活動的條件、進行場外交易的限制、提醒投資者有關投資風險及其有責任遵守適用法規，以及向投資者提供監管警示或調查的資訊。不同的中華通證券及不同的中華通市場可規定不同條件或限制。本交易所將透過制定規則或於香港交易所網站作出公布或按其認為適合的其他方式訂明或更改有關條件或限制。中華通交易所參與者須遵守該等條件及限制。

本交易所及聯交所子公司的責任

1443. 本交易所、香港交易所及聯交所子公司以及其各自的董事、僱員及代理人概不就中華通交易所參與者、其客戶或任何第三方因中華通服務或CSC而直接或間接產生或與中華通服務或CSC有關的虧損或損失承擔責任或作出賠償，包括但不限於以下各項：
- (4) 在中華通市場的任何中華通證券的交易暫停不論是否因實施任何熔斷機制或因任何其他原因暫停、延誤、中斷或停止；

- (9) 有關根據本規則輸入或取消中華通買賣盤、買賣中華通證券或使用中華通服務方面實施、引入或更改任何額度或額度限制或任何條件、限制或規定；

第十四A章 中華通服務——上海

釋義

- 14A02. (2) 在本章中，除文意另有所指外：

「熔斷機制條文」 指 上交所規則中，可據而實施上交所熔斷機制、以（其中包括）減低或避免在上交所市場買賣的證券價格大幅上漲或下跌的相關條文（包括應用及撤銷上交所熔斷機制的的所有相關條文）；

「上交所熔斷機制」 指 上交所根據熔斷機制條文在上交所市場實施或啟用的任何措施；

上交所的中華通服務運作時間

- 14A03. (2A) 在不影響規則第 14A03(2)條的情況下，中華通證券的交易執行須遵守上交所規則的規定（包括熔斷機制條文）。任何上交所交易日若實施上交所熔斷機制，透過上交所市場系統執行交易的活動即告暫停，暫停時間長短按熔斷機制條文所載規定。此外，在任何上交所交易日的連續競價時段撤銷上交所熔斷機制或會令交易透過集合競價執行。

- (3) 中華通服務的交易日及運作時間載列如下，但可根據規則第 1415 條更改。

- (b) 除本交易所另有決定或公布外，於 CSC 交易日，中華通交易所參與者可於下列時間輸入中華通買賣盤以傳遞至 CSC：

- (i) 就上交所上午開市集合競價時段：9 時 10 分起；
- (ii) 就上交所上午連續競價時段：9 時 25 分起；及
- (iii) 就上交所下午連續競價時段：12 時 55 分起。

這表示 CSC 一般於每節上交所交易時段開始前五分鐘接收中華通買賣盤。上交所市場系統通常於每個上交所交易時段（見規則第 14A03(2)條）開始時開始處理中華通買賣盤。

- (4) 假如香港在 CSC 交易日發出 8 號或以上颱風訊號或黑色暴雨警告，運作時間將調整如下。

- (c) 解除 8 號颱風訊號或取消黑色暴雨警告

解除／取消時間	開始或恢復服務時間
07:00或之前	09:10

解除／取消時間	開始或恢復服務時間
07:00後至07:30	09:25
07:30後至08:00	10:00
08:00後至08:30	10:30
08:30後至09:00	11:00
09:00後至11:00	12:55
11:00後至11:30	13:30
11:30後至12:00	14:00
12:00後	停止服務

為免生疑問，8 號颱風訊號解除或黑色暴雨警告取消後開始或恢復服務時，交易狀況將依據規則第 14A03(2) 及 14A03(2A) 條所述的上交所交易時段，即表示若是在 9 時 25 分或之後開始或恢復服務，當日將不會有開市集合競價交易。

交易安排

在上交所熔斷機制生效期間輸入及取消中華通買賣盤

- 14A06. (10A) (a) 除本交易所另有決定外，在熔斷機制條文允許於熔斷機制生效期間從上交所市場系統接收或向上交所市場系統傳送有關中華通證券的買賣盤的情況下，中華通交易所參與者在此期間可如常透過中華通服務輸入中華通買賣盤。儘管如此，中華通交易所參與者接受在任何上交所交易日實施上交所熔斷機制將導致規則第 14A03(2A) 條所述的暫停透過上交所市場系統執行交易。
- (b) 除本交易所另有決定外，在熔斷機制條文允許於熔斷機制生效期間取消有關中華通證券的買賣盤的情況下，中華通交易所參與者在此期間可如常透過中華通服務輸入取消中華通買賣盤的要求。儘管如此，一如規則第 1422 條規定，除非相關上交所市場系統發出取消確認，任何中華通買賣盤概不應視為已取消。不論任何理由，若中華通交易所參與者要求取消的中華通買賣盤並無被取消，本交易所及聯交所子公司概毋須承擔任何責任。

納入為中華通證券的上交所上市證券的額度

14A07.(13) 除本交易所另有決定外：

- (a) 於每個 CSC 交易日，在上交所的開市集合競價時段及該時段開始前五分鐘內，規則第 14A07(12) 條所指的參考價為(i)相關中華通證券的現行買盤價；及(ii)倘無現行買盤價，則取該中華通證券的前收市價；~~及~~
- (b) 於每個 CSC 交易日，在上交所的連續競價時段（上午及下午）及該時段開始前五分鐘內，規則第 14A07(12) 條所指的參考價為(i)相關中華通證券的現行最佳買盤價；及(ii)倘無現行最佳買盤價，則取相關中華通證券的最新成交價；及(iii)倘無最新成交價，則取相關中華通證券的前收市價~~；及~~
- (c) 若已實施上交所熔斷機制，規則第 14A07(12) 條所指的參考價為(i)相關中華通證券的現行買盤價；(ii) 倘無現行買盤價，則取相關中華通證券的最新成交價；及(iii)倘無最新成交價，則取相關中華通證券的前收市價。