

非自動對盤交易的合規提示

根據《交易所規則》第五章，交易所參與者應遵守相關規則的一般原則，建立有效監控或程序，確保非自動對盤交易得以適時準確地向交易所申報。

在 2017 年合規評核及現場視察之年度計劃中，我們發現部分交易所參與者有以下缺失： -

1. 申報非自動對盤交易

- 因運作及系統監控失靈或失當而未能在規定的時限內申報非自動對盤交易。交易所注意到，部分交易所參與者在申報系統內預設將收市競價交易時段內完成的非自動對盤交易於下一個交易日申報（上午九時四十五分前）。

根據《交易所規則》第 501E(2)、501F、520(1)及 526(1)條的規定，交易所參與者須在規定的時限內申報非自動對盤交易：

- 在交易完成後十五分鐘內輸入交易資料；及
- 如屬 ATS 交易的兩邊客交易，在該交易完成後立即及在任何情況下須於一分鐘內輸入，

並在任何情況下不遲於相關規則中所訂明的時限。

因此，收市競價交易時段內完成的有關收市競價交易時段證券的交易，不可遲於收市競價交易時段結束時輸入。

2. 就已申報的非自動對盤交易進行交易後審視

- 沒有足夠的政策及程序就已申報的非自動對盤交易進行交易後審視及處理錯盤交易。

根據《交易所規則》第 528(1)條，交易所參與者須在每段交易時間結束時覆核買賣記賬，並在下個交易日早市開始後十五分鐘內向聯交所報告任何差異、錯誤的交易或投訴。

3. 員工培訓

- *員工培訓不足*。部分交易所參與者並無向參與重點範疇業務活動的員工提供強制及個別產品培訓，僅依賴資深員工分享經驗及指導作為在職培訓。

為了加強交易所參與者的合規文化，交易所提醒交易所參與者應在開初及持續地向所有員工提供足夠且適當的培訓。