

香港聯合交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

THE STOCK EXCHANGE OF HONG KONG LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

## 通告 CIRCULAR

---

事項： 交易所規則之修訂

查詢： 參與者一般查詢熱線<sup>1</sup> (電話：2840 3626 電子郵箱：[trd@hkex.com.hk](mailto:trd@hkex.com.hk))

請各位聯交所交易權持有人及交易所參與者注意，證券及期貨事務監察委員會已批准交易所規則之修訂，以規定屬於ATS（自動化交易服務）營辦商的交易所參與者完成ATS兩邊客交易後須按個別交易基準逐一匯報。

載於附件之修訂由 2020年4月20日(星期一)起生效。

有關規則的標明修訂本可在香港交易所網站之“規則修訂 - 交易所規則”中下載。

法律部主管

梁志珩 謹啟

---

<sup>1</sup> 所有參與者一般查詢熱線之通話可能會被錄音。請[按此](#)參閱香港交易所的私隱政策聲明。

交易所規則

第五章

交易

交易運作規則

延續交易證券

- 501F. (1) 進行延續交易證券兩邊客交易的交易所參與者有責任於開市前時段，根據規則第 501(1)條所規定，延續早市及收市競價交易時段之交易期間，於以下時限(或其他交易所不時規定的時限)內，將該等交易資料輸入系統中：
- (i) 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於一分鐘內按個別交易基準逐一輸入；及
  - (ii) 如屬所有其他兩邊客交易，在該交易完成後十五分鐘內輸入。

及須於當天延續交易證券買賣結束前，將該等交易資料輸入系統中。對於以自動對盤配對完成之交易，此責任則不存在。任何未能按上述規定於延續交易證券買賣結束前記錄在系統中的延續交易證券交易，需於下一個交易日開市前時段的輸入買賣盤時段及對盤前時段或持續交易時段開始後的首十五分鐘內向本交易所申報，並將該交易視作為申報時交易日的交易。假如下一個交易日無論由於任何原因導致沒有持續交易時段，上述未能向本交易所申報的有關交易必須在不遲於下一個持續交易時段的首個交易時段開始後的首十五分鐘向本交易所申報，並將有關交易視作為申報交易時段的交易。

兩邊客交易

526. (1) (a) 進行兩邊客交易的各交易所參與者有責任在開市前時段、規則第 501(1)條所指定之交易時間及收市競價交易時段內於以下時限(或其他交易所不時規定的時限)內，將該等交易資料輸入系統中：
- (i) 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按個別交易基準逐一輸入；及
  - (ii) 如屬所有其他兩邊客交易，在交易完成後十五分鐘內輸入，

惟：

- (i) 開市前時段內完成的交易不可遲於早市開始後十五分鐘輸入；
- (ii) 早市內完成的交易不可遲於早市完結時輸入及(若早市後立即進入收市競價交易時段)早市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結束時輸入；
- (iii) 午市內完成的交易則不可遲於午市完結時輸入及(若午市後立即進入收市競價交易時段)午市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結束時輸入；及
- (iv) 在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，則不可遲於收市競價交易時段結束時輸入。

對於以自動對盤配對完成之交易此責任則不存在。