

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¹ (電話：2840 3626 電子郵箱：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，以在香港證券市場推出自行成交防範服務。

載於附件之修訂，將由 2024年4月2日(星期二)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

¹ 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

第一章

釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外：—

「自行成交防範」或「SMP」 指 在持續交易時段，防範已附加同一 SMP 識別碼的買賣盤在系統內進行配對，並按指定的 SMP 指示自動取消相關的買賣盤；

「SMP 識別碼」 指 一個代號、號碼或識別碼，用以按本交易所不時規定的方式，以自行成交防範為目的附加於為同一名交易所參與者、客戶或其他人士賬戶輸入系統的買賣盤；

「SMP 指示」 指 以下其中一項由相關交易所參與者就某一 SMP 識別碼指定的指示，此指示被附加於不同買賣盤輪候名單的新買賣盤和現有買賣盤，且無該指示則會引致買賣盤完成配對：—

(c) 「取消較新盤」，即系統將會取消新輸入的買賣盤，或如該新輸入的買賣盤在任何附加有同一 SMP 識別碼的現有買賣盤排在買賣盤輪候名單首位之前已經進行部分配對，系統則會取消該新輸入買賣盤未配對的餘額；或

(d) 「取消較舊盤」，即系統將會取消現有買賣盤，或如該現有買賣盤在附加有同一 SMP 識別碼的新輸入買賣盤排在買賣盤輪候名單首位之前已經進行部份配對，系統則會取消該現有買賣盤未配對的餘額；

第五章

交易

交易運作規則

自行成交防範

- 513D. 交易所參與者可向本交易所提交其不時規定的表格及證明文件，為其自身、客戶或其他人士申請自行成交防範服務。本交易所將編派一個 SMP 識別碼給交易所參與者，或每名客戶，或本交易所根據交易所參與者的申請而批准的其他人士。任何編派的 SMP 識別碼需根據本交易所不時規定的要求，只可附加在該交易所參與者、客戶或本交易所批准的其他人士（視情況而定）的買賣盤。
- 513E. 交易所參與者確認，附加 SMP 識別碼的買賣盤在輸入系統後有可能因自行成交防範而被取消。在任何情況下，本交易所對自行成交防範運作上的任何失靈、無法使用、出錯或損壞概不負責。
- 513F. 一個 SMP 識別碼可以由超過一個交易所參與者使用。交易所參與者在使用自行成交防範及每個 SMP 識別碼前，必須先獲得本交易所的批准。若要獲得使用自行成交防範和 SMP 識別碼的批准，交易所參與者申請人須向本交易所提出書面申請，並在申請及其後運作時持續地向本交易所提供可令本交易所信納的證據，證明其已制定適當且有效的措施並採取合理的步驟，以確保自行成交防範及每個 SMP 識別碼的使用是按照本交易所不時規定的要求。交易所參與者須為使用自行成交防範及每個 SMP 識別碼負上責任，如發現任何違反、觸犯或不遵守本規則或本交易所不時規定的要求，或發現其自身、客戶或其他人的行動或潛在市場失當行為，須即時通知本交易所。
- 513G. 如行政總裁認為交易所參與者，或其任何客戶，或就申請自行成交防範獲批准的其他人士沒有適當遵守任何與自行成交防範相關的任何要求，包括其使用自行成交防範上的任何失當行為或做法，行政總裁可向交易所參與者發出通知，透過暫停或停用相關 SMP 識別碼或其他方式，暫停或禁止交易所參與者或其任何客戶或其他人士使用自行成交防範，或施加其認為適當的附加使用規定。

- 513H. 不論本規則有任何其他條文規定，若超過一名交易所參與者為同一人士向本交易所申請自行成交防範服務，每名交易所參與者的身份及其獲准就該名人士使用 **SMP** 識別碼的情況，均可能會按本交易所認為適當的情況而向其他的交易所參與者披露。