

期交所規則、規例及程序

第一章

規則的釋義、執行及修訂

定義及釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外，以下詞句具下列涵義：—

「自行成交防範」或“SMP” 指 在 T 時段及 T+1 時段防止已標註同一 SMP 識別碼的買賣盤在 HKATS 電子交易系統內自行對盤成交，有關買賣盤將按指定的 SMP 指示自動取消；

「SMP 識別碼」或“SMP ID” 指 一個代碼、號碼或識別符，用以按本交易所不時規定的方式，就自行成交防範目的而標識為同一名交易所參與者、客戶或其他人士的賬戶輸入 HKATS 電子交易系統的買賣盤；

「SMP 指示」 指 在有新買賣盤和現有買賣盤分別排在不同買賣盤輪候隊伍但兩者有同一個 SMP 識別碼（否則有可能對盤成交時），相關交易所參與者就該 SMP 識別碼給予的以下其中一項指示：—

- (a) 「取消較新盤」，即 HKATS 電子交易系統將會取消新輸入的買賣盤，或如新輸入的買賣盤在任何註有同一 SMP 識別碼的現有買賣盤排在買賣盤輪候隊伍首位之前已經自行配對成交了一部分，則 HKATS 電子交易系統將取消該新輸入買賣盤其餘尚未配對的部分；或

- (b) 「取消較舊盤」，即 HKATS 電子交易系統將會取消現有買賣盤，或如現有買賣盤在該註有同一 SMP 識別碼的新輸入買賣盤排在買賣盤輪候隊伍首位之前已經自行配對成交了一部分，則 HKATS 電子交易系統將取消該現有買賣盤其餘尚未配對的部分；

## 第八章

### 交易安排—慣例及系統

#### 自行成交防範

- 825A. 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，為自己、客戶或其他人士申請自行成交防範服務。本交易所將編配一個 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。此 SMP 識別碼只可根據本交易所不時規定的要求，標註於交易所參與者、客戶或本交易所批准的其他人士（視屬何情況而定）的買賣盤。
- 825B. 交易所參與者確認，註有 SMP 識別碼的買賣盤在輸入 HKATS 電子交易系統後有可能因 SMP 而被取消。本交易所對 SMP 運作上的任何故障、停用、錯誤或缺陷概不負責。
- 825C. 不同交易所參與者可共用一個 SMP 識別碼。交易所參與者在使用 SMP 及每個 SMP 識別碼前，必須先獲得本交易所的批准。若擬徵求批准，交易所參與者須向本交易所提出書面申請，並（在申請時及其後持續）證明及令本交易所信納其已實施適當及有效措施並採取合理步驟，確保 SMP 及每個 SMP 識別碼的使用情況符合本交易所不時規定的要求。交易所參與者須為使用每個 SMP 識別碼負責，如發現任何違反、抵觸或不遵守本規則或本交易所不時規定的要求的情況，或發現其自己、客戶或其他人的實際或潛在市場不當行為，須立即通知本交易所。

- 825D. 如行政總裁認為交易所參與者或其任何客戶或根據其 SMP 申請獲批准的其他人士沒有適當遵守與 SMP 相關的任何要求，包括其使用 SMP 上的任何不當行為或做法，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 SMP，或施加其認為適當的附加使用規定。
- 825E. 不論本規則有任何其他條文規定，若有多於一名交易所參與者為同一人士向本交易所申請 SMP 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，均可能會被本交易所按其認為適當的情況而向另一名或其他的交易所參與者披露。