

中央結算系統運作程序規則

第二節

參與者

2.3 股份戶口及 CCMS 抵押品戶口

2.3.4 合資格證券的賬面交收紀錄

結算參與者或託管商參與者輸入STI時，須於STI內訂明該STI轉移是以貨銀對付方式還是毋須付款方式進行。以貨銀對付方式進行的STI轉移僅適用於合資格證券從附寄結單服務的股份獨立戶口記除的STI轉移。如以貨銀對付方式於中央結算系統內進行STI轉移，在合資格證券完成轉移後，結算公司將如常向有關結算或託管商參與者的指定銀行發出EPI，以進行付款及使有關款項存入股份獨立戶口結單收件人的銀行戶口內。

若交付股份的股份戶口在輸入STI指示或進行STI整批處理程序時已有足夠的合資格證券，則在輸入(若有需要，批核及確認) STI後，結算公司將以線上交付方式交付合資格證券（涉及特別獨立戶口者除外）。

若STI轉移的有關合資格股份交付涉及特別獨立戶口，而該等STI指示(i)在上午八時十五分至最後一次持續淨額交收多批交收處理程序期間輸入及批核，~~或(ii)在上午八時十五分前輸入及批核而付方戶口是特別獨立戶口~~，則有關股份將處於「等待轉移」狀態。若根據第6.2.2節進行STI整批處理程序時須交付的股份戶口已有足夠的合資格證券，結算公司將執行有關STI。

如將中央結算系統內的合資格證券由一位參與者交付予另一位參與者，可自付方參與者的股份戶口（抵押股份統制戶口除外）記除，並將相應數量的股份記存於取方參與者的股份戶口內（抵押股份統制戶口除外）。

## 第六節

### 運作及服務時間表

#### 6.2 有關非投資者戶口持有人的參與者的每日處理及服務時間表

##### 6.2.1 有關非中華通證券的合資格證券的每日處理及服務時間表

時間	中央結算系統事項
上午七時十五分	<p>透過中央結算系統終端機及（如適用）參與者網間連接器開始提供以下服務及設施：</p> <ul style="list-style-type: none"><li>(i) 結算服務（交收指示及戶口轉移指示/股份獨立戶口轉移指示整批傳送功能）；及</li><li>(ii) 結算及交收的查詢服務、查詢螢光屏廣播訊息及報告檢索等功能</li></ul> <p>前一日的所有報告均可供檢索</p>
上午八時	<p>透過中央結算系統終端機及（如適用）參與者網間連接器開始提供以下服務及設施：</p> <ul style="list-style-type: none"><li>(i) 結算服務（交收指示／投資者交收指示的修訂活動及投資者交收指示整批傳送功能）；</li><li>(ii) 戶口轉移指示/股份獨立戶口轉移指示的修訂活動及整批傳送功能及大批戶口轉移指示／股份獨立戶口轉移指示修訂功能；</li><li>(iii) 股份獨立戶口的修訂活動及整批傳送功能；</li><li>(iv) 預先繳付現金指示、預先繳付現金／交易通付款預設指示、即日付款預設指示及代理人款項（傍晚）預設指示的修訂功能；及</li></ul>

- (v) 認購、權益選擇、投票指示、電子認購新股指示（該日為申請或確認首日除外）、投標指示（該日為投標或申請首日除外）及公司代表/委託人指示的修訂功能

## 6.2.2 有關中華通證券的每日處理及服務時間表

時間	中央結算系統事項
上午七時十五分	<p>透過中央結算系統終端機及（如適用）參與者網間連接器開始提供以下服務及設施：</p> <ul style="list-style-type: none"><li>(i) 結算服務（戶口轉移指示/股份獨立戶口轉移指示的修訂活動以及交收指示的修訂活動及整批傳送功能）；及</li><li>(ii) 結算及交收的查詢服務、查詢螢光屏廣播訊息及報告檢索等功能</li></ul> <p>前一日的所有報告均可供檢索</p>
上午八時	<p>透過中央結算系統終端機及（如適用）參與者網間連接器開始提供以下服務及設施：</p> <ul style="list-style-type: none"><li>(i) <del>戶口轉移指示/股份獨立戶口轉移指示的整批傳送功能及大批戶口轉移指示/股份獨立戶口轉移指示修訂功能</del>；</li><li>(ii) 即日付款預設指示（僅適用於代理人款項）及代理人款項（傍晚）預設指示的修訂功能；及</li><li>(iii) 認購（接受上市證券收購建議者除外）、權益選擇、投票指示、持股類別披露及委託人指示的修訂功能</li></ul> <p>結算公司發出於同日交收的票據交換所自動轉賬系統指示（有關於上一個內地辦公日交收的持續淨額交收股份數額所產生的款項責任）</p> <p><u>首次 STI 整批處理程序</u></p>
上午九時十五分	<p><u>第二</u>首次 STI 整批處理程序（不包括特別獨立戶口）</p>

上午十時	第 <u>三三</u> 次 STI 整批處理程序（不包括特別獨立戶口）
中午十二時四十五分	第 <u>四三</u> 次 STI 整批處理程序（不包括特別獨立戶口）
下午三時三十分	第 <u>五四</u> 次 STI 整批處理程序（不包括特別獨立戶口）
下午五時	第 <u>六五</u> 次 STI 整批處理程序（不包括特別獨立戶口，另中華通證券僅可以毋須付款方式進行 STI 轉移）
下午五時三十分	第 <u>七六</u> 次 STI 整批處理程序（中華通證券僅可以毋須付款方式進行 STI 轉移，如 STI 轉移涉及特別獨立戶口，僅包括轉移至特別獨立戶口以外的股份戶口）
下午六時三十分（大約）	第 <u>八七</u> 次 STI 整批處理程序（僅供中華通證券以毋須付款方式由特別獨立戶口進行 STI 轉移至特別獨立戶口以外的股份戶口）
下午七時（大約）	<u>第九次 STI 整批處理程序（僅供中華通證券以毋須付款方式由特別獨立戶口進行 STI 轉移至特別獨立戶口以外的股份戶口）</u>
下午七時三十分	第 <u>十八</u> 次 STI 整批處理程序（中華通證券僅可以毋須付款方式進行 STI 轉移）
下午八時	最後一次 STI 整批處理程序（中華通證券僅可以毋須付款方式進行 STI 轉移）

## 第十節

### 聯交所買賣 — 持續淨額交收制度

#### 10.8 延誤交付：補購

##### 10.8.2 補購的時間

除非(i)結算公司根據第10.8.3節豁免參與者進行補購，或(ii)因風險管理委員會所確認的風險管理原因，或(iii)結算公司根據規則第3501(iv)條已補購參與者的待交付持續淨額交收股份數額，或(iv)符合在第17.2.13節詳述的豁免補購的情況，否則結算公司有權（但沒有責任必須）在其全權決定認為適當的情況下，代表待交付的參與者於T+3日（或在T+3日不可行時於隨後的時間進行）否則結算公司便可代待交付的參與者於T+3日（或在T+3日不可行時於隨後的時間進行）補購其在持續淨額交收制

度下的到期交收日尚未交付的待交付股份數額（即於T+2日交收程序結束後仍未完成交收）。

結算公司代表待交付的參與者在聯交所或其以外進行的補購買賣，通常須於 T+2 日的交收期在持續淨額交收制度下交收，並將進行取代程序(如適用)及正常的責務變更、每日淨額結算及跨日淨額結算的程序。

儘管上一段內容另有規定，結算公司可指定補購買賣（如在聯交所進行，將屬聯交所買賣）在「已劃分的買賣」制度下進行交收。縱使補購通常須於 T+2 日的交收期進行交收，結算公司亦可指定補購須於補購的當日交收或其全權決定認為合適的其他日期進行交收。

待交付的參與者有意根據規則第 3501(iv)條向結算公司提出不得撤回的補購要求時，必須填妥指定的補購要求表格（表格見《參與者適用的中央結算系統終端機使用者指引》），並把表格交回結算公司。結算公司保留權利按其認為適當全權決定接納或拒絕待交付參與者的補購要求。倘若結算公司於晚上八時一分至中午十二時之間收到並接納補購要求表格，便會於聯交所午市期間在聯交所或其以外發出落盤指示。倘若結算公司於下午十二時一分至晚上八時之間收到並接納補購要求表格，便會於下一個交易日在聯交所或其以外發出落盤指示。結算公司須在其認為最佳的市場價格及條件下進行補購（但需考慮到結算公司可能要迅速行事，而結算公司在忠誠辦事的情況下無須負上法律責任）。待交付的參與者須承擔有關結算公司因進行補購而招致的一切成本及開支，並須向結算公司、聯交所及身為結算公司控制人的認可交易所控制人償付該等費用。

#### **10.8.4 T+3 豁免補購的申請方法**

有意根據第 10.8.3 節申請豁免的待交付參與者，必須於到期交收日（即 T+2 日）晚上八時或之前把填妥的豁免補購申請表格（表格見《參與者適用的中央結算系統終端機使用者指引》）交回結算公司。該申請表格必須以傳真方式或結算公司認為適當的其他方式交回，結算公司收到申請表格後才視為正式收到申請。此外，申請豁免的待交付參與者必須於 T+6 日或之前向結算公司提供下述的有效證明文件，除非結算公司另有通知。除非(i)結算公司根據第 10.8.3 節豁免參與者進行補購，或(ii)因風險管理委員會所確認的風險管理原因，或(iii)結算公司根據規則第 3501(iv)條已補購待交付參與者的待交付持續淨額交收股份數額，或(iv)符合在第 17.2.13 節詳述的豁免補購的情況，否則結算公司有權（但沒有責任必須）會在其全權決定認為適當的情況下，於 T+3 日透過其指定經紀代表待交付的參與者進行（或在 T+3 日不可行時於隨後的時間進行）補購。為釋疑起見，倘若符合在第 17.2.13 節詳述的豁免補購的情況，待交付的參與者並不須向結算公司申請豁免補購。

### 10.8.5 結算公司代表待交付的參與者進行補購的程序

下文詳細說明結算公司代表待交付的參與者進行補購的程序：

- (i) 就待交付的參與者於到期交收日（即 T+2 日）結束時仍未交付在持續淨額交收制度下待交付的股份數額而言，結算公司便會發出載有該等待交付股份數額資料的「補購通知書」；除非(a)結算公司根據第 10.8.3 節豁免參與者進行補購，或(b)因風險管理委員會所確認的風險管理原因，(c)結算公司根據規則第 3501(iv)條已補購待交付參與者的待交付持續淨額交收股份數額，或(d)符合在第 17.2.13 節詳述的豁免補購情況，否則結算公司有權（但沒有責任必須）會在其全權決定認為適當的情況下，於 T+3 日（或在 T+3 日不可行時於隨後的時間進行）補購在補購通知書上所載的待交付股份數額；

## 第十 A 節

### 中華通證券交易—持續淨額交收制度

#### 10A.6 延誤交付：補購

##### 10A.6.2 補購的時間

除非(i)結算公司根據第 10A.6.2A 節豁免參與者進行補購，或(ii)因風險管理委員會確認的風險管理原因正在影響結算公司，否則結算公司有權（但沒有責任必須）在其全權決定認為適當的情況下，代表待交付的中華通結算參與者於 T+1 日（或在 T+1 日不可行時於隨後的時間進行）或指定經紀可代待交付的中華通結算參與者於 T+1 日（或在 T+1 日不可行時於隨後的時間進行），補購其中華通證券中在持續淨額交收制度下的到期交收日尚未交收的待交付股份數額（即於 T 日中華通證券最後多批交收處理程序結束後仍未完成交收者），若所需補購數量並非完整買賣單位，則不足一手按一手計。

##### 10A.6.3 結算公司代表中華通結算參與者進行補購的程序

下文詳細說明任何可由結算公司代表待交付的中華通結算參與者進行的補購的程序：

- (i) 就待交付的中華通結算參與者的中華通證券於交收日在持續淨額交收制度下中華通證券的最後多批交收處理程序完結後仍為待交付的股份數額而言，結算公司會發出載有該等待交付股份數額資料的補購通知書。除非(i)結算公司根據第 10A.6.2A 節豁免參與者進行補購，或(ii)因風險管理委員會確認的風險管理原因正影響結算公司，結算公司有權（但沒有責任必須）在其全權決定認為適當的情況下，會於 T+1 日（或在 T+1 日不可行時於隨後的時間進行）為在補購通知書上所載的所有待交付股份數額進行補購，若補購數量並非完整買賣單位，則不足一手按一手計；

## 第十六節

### 報表及報告

#### 16.6 為參與者提供的報告及報表

##### 16.6.1 為非投資者戶口持有人的參與者提供的報告及報表

報告編號	報告名稱	發出頻次	提供時間
CSEBA01	戶口轉移指示整批輸入報告	每次整批核對後	於每次整批輸入核對程序約 <u>上午七時三十分、上午八時</u> 、上午九時十五分、上午十時、上午十一時三十分、下午十二時四十五分、下午三時十五分、下午五時、下午五時三十分及下午八時完成後（提供戶口轉移指示整批輸入的狀況）
CSEAT02	STI活動報告	每日六次	於每次STI整批轉移處理程序約上午九時十五分、上午十時、中午十二時四十五分、下午三時三十分、下午五時及下午八時完成後（非中華通證券的合資格證券截至報告產生時的累積STI活動）
		每日 <u>十一</u> 次	於每次STI整批轉移處理程序約 <u>上午八時</u> 、上午九時十五分、上午十時、中午十二時四十五分、下午三時三十分、下午五時、下午五時三十分、下午六時三十分、 <u>下午七時</u> 、下午七時三十分及下午八時完成後（中華通證券截至報告產生時的累積STI活動）
CSEAT01	STI整批輸入報告	每次整批核對後	於每次 STI 整批輸入核對程序約 <u>上午七時三十分、上午八時</u> 、上午九時十五分、上午十時、下午十二時四十五分、下午三時三十分、下午五時、下午五時三十分、下午七時三十分及下午八時完成後（提供 STI 整批輸入的狀況）

## 第十七節

### 暫停服務

#### 17.2 颱風

##### 17.2.13 非中華通證券的合資格證券的 T+3 補購

倘若八號或以上颱風訊號於 T+2 日懸掛，結算公司將會在下述情況給予結算參與者或結算機構參與者豁免補購，而不會代結算參與者或結算機構參與者於 T+3 日補購其在持續淨額交收制度下的到期交收日尚未交付的待交付股份數額(即於 T+2 日交收程序結束後仍未完成交收)：

- i) 八號或以上颱風訊號在上午九時至中午十二時期間懸掛，而在同日中午十二時仍未卸下；或
- ii) 八號或以上颱風訊號在中午十二時至第 6.2 節訂明非中華通證券的合資格證券的最後一次多批交收處理程序開始之前十五分鐘懸掛。

為釋疑起見，倘若八號或以上颱風訊號在 T+2 日以後仍然懸掛，並在該日中午十二時前仍未卸下，根據第 17.2.6 節按 T+2 交收制度以決定聯交所買賣的交收日期，該日不會視作交收日亦不視作 T+3 日。

獲豁免補購的結算參與者或結算機構參與者必須於 T+3 日結束前交付所有獲豁免補購的待交付股份數額。倘若該結算參與者或結算機構參與者於 T+3 日交收程序結束後未能交付該等股份，結算公司**有權（但沒有責任必須）在其全權決定認為適當的情況下，會**代表結算參與者或結算機構參與者於 T+4 日進行補購（或在 T+4 日不可行時於隨後的時間進行）。

##### 17.2.14 中華通證券的 T+1 補購

倘若八號或以上颱風訊號於中華通證券交收日懸掛，就中華通結算參與者在持續淨額交收制度下於到期日尚未交收的中華通證券待交付股份數額（即 T 日交收程序後尚未交收者），結算公司不會給予中華通結算參與者豁免補購。

為免產生疑問，倘若八號或以上颱風訊號在中華通證券交收日懸掛，每名中華通結算參與者須於同日就其中華通證券的待交付股份數額進行交收。除非(i)結算公司根據第 10A.6.2A 節豁免參與者進行補購，或(ii)因風險管理委員會確認的風險管理原因正影響結算公司，倘中華通結算參與者在持續淨額交收制度下於到期日有任何尚未

交收的中華通證券待交付股份數額，結算公司有權（但沒有責任必須）在其全權決定認為適當的情況下，將於 T+1 日代表待交付的中華通結算參與者補購其中華通證券中在持續淨額交收制度下的到期交收日尚未交收的待交付股份數額進行補購（或在 T+1 日不可行時於隨後的時間進行），以所需數量為限，若所需數量並非完整買賣單位，則不足一手按一手計。

## 17.3 暴雨

### 17.3.13 中華通證券的 T+1 補購

倘若黑色暴雨警告於中華通證券交收日發出，就中華通結算參與者在持續淨額交收制度下於到期日尚未交收的中華通證券待交付股份數額（即 T 日交收程序後尚未交收者），結算公司不會給予中華通結算參與者豁免補購。

為免產生疑問，倘若黑色暴雨警告在中華通證券交收日發出，每名中華通結算參與者須於同日就其中華通證券的待交付股份數額進行交收。除非(i)結算公司根據第 10A.6.2A 節豁免參與者進行補購，或(ii)因風險管理委員會確認的風險管理原因正影響結算公司，倘中華通結算參與者在持續淨額交收制度下於到期日有任何尚未交收的中華通證券待交付股份數額，結算公司有權（但沒有責任必須）在其全權決定認為適當的情況下，將於 T+1 日代表待交付的中華通結算參與者補購其中華通證券中在持續淨額交收制度下的到期交收日尚未交收的待交付股份數額進行補購（或在 T+1 日不可行時於隨後的時間進行），以所需數量為限，若所需數量並非完整買賣單位，則不足一手按一手計。