

## 中央結算系統運作程序規則

### 定義

(a) 為便利讀者，規則內的定義茲重複載列如下。

“午市”

指 根據聯交所規則規定可於聯交所進行交易的下午時段；

“自動對盤系統”

指 由聯交所安裝和操作用作證券買賣的自動對盤及成交系統；

“自動買賣盤配對”

與聯交所規則中所指的含義相同；

“抵押品”

指 參與者根據規則第 602、806、3501 或 3602 條，及交易通中央結算系統參與者額外根據規則第 12A14 條，按結算公司不時規定的方式向結算公司提供的抵押品；

“解除標記”

指 對交易通標記股份不再受標記後的形容；或為有關股份除去標記的行動；

“標記”

指 對經外匯兌換服務支援而購買的交易通股份的形容；或為有關股份加上標記的行動；

“交易通標記股份”

指 除非規則或結算公司另有規定，經外匯兌換服務支援購買，而必須存放在交易通戶口內以作標記的交易通股份；

“外匯兌換”

指 外匯兌換；

“外匯兌換服務”

指 結算公司根據規則第 12A 章可能提供的外匯兌換服務；

“港元 或 “\$”

指 港元，香港之法定貨幣；

## “早市”

指 根據聯交所規則規定可於聯交所進行交易的上午時段；

## “開市前時段”

與聯交所規則中所指的含義相同；

## “人民幣”

指 在香港交收的中華人民共和國法定貨幣；

## “人民幣買入最終匯率”

與規則第 12A10(iii)條所指的含義相同；

## “人民幣買入參考匯率”

與規則第 12A10(i)條所指的含義相同；

## “人民幣賣出最終匯率”

與規則第 12A10(iv)條所指的含義相同；

## “人民幣賣出參考匯率”

與規則第 12A10(ii)條所指的含義相同；

## “STI 轉移”

指 中央結算系統內因為(i)輸入(若有需要，則以及批核)股份獨立戶口轉移指示(毋須確認)；或(ii)輸入(若有需要，則以及批核)由有關股份獨立戶口結單收件人確認的股份獨立戶口轉移指示(須確認)，而在結算參與者或託管商參與者的附寄結單服務的股份獨立戶口與任何其他股份戶口(包括其他附寄結單服務的股份獨立戶口，但不包括抵押股份統制戶口及交易通戶口)之間進行的轉移；

## “股份戶口”

指 如規則第 601 條所述，(i) 編配予各結算參與者並由其管理的每個股份結算戶口、股份獨立戶口、股份貸出戶口和抵押股份統制戶口，(ii) 編配予各投資者戶口持有人並由其管理的每個股份結算戶口，(iii) 編配予各非結算參與者及投資者戶口持有人的參與者並由其管理的每個股份結算戶口、股份獨立戶口和股份貸出戶口，合資格證券將於該等股份戶口記存或記除，及如規則第 12A08 條所述，每個額外由結算公司編配予各交易通中央結算系統參與者的交易通戶口；

## “股份轉出外匯交易”

指 規則第 12A12 條所述，因交易通中央結算系統參與者提出股份轉出要求而產

生，或引致該參與者向作為交易通營運者的結算公司賣出人民幣的外匯交易；

## “股份轉出要求”

指 規則第 12A12 條所述，交易通中央結算系統參與者向結算公司提出為交易通標記股份解除標記的要求；

## “股份獨立戶口 或 SSA”

指 如規則第 601 條所述，(i) 各結算參與者於中央結算系統內除其股份結算戶口、股份貸出戶口和抵押股份統制戶口以外開立的股份戶口，(ii) 以及各非結算參與者及投資者戶口持有人的參與者於中央結算系統內除其股份結算戶口及股份貸出戶口以外開立的股份戶口，包括（但不限於）參與者的附寄結單服務的股份獨立戶口，及就交易通中央結算系統參與者而言，交易通戶口將不會被視為股份獨立戶口；

## “股份獨立戶口轉移指示或 STI”

指 如規則第 601 條所述，結算參與者或託管商參與者按結算公司不時指定的有效方式所發出的指示，用以在其設於中央結算系統內的附寄結單服務的股份獨立戶口與名下於中央結算系統的其他股份戶口(包括其他附寄結單服務的股份獨立戶口，但不包括抵押股份統制戶口及如結算參與者或託管商參與者為交易通中央結算系統參與者，其交易通戶口也不包括在內)之間就合資格證券進行賬面轉移；

## “交易日”

指 可在聯交所進行交易的日子；

## “交易通”

指 結算公司為便利買賣交易通股份而可能提供的外匯兌換服務支援設施。結算公司是以交易通營運者而非以聯交所交易的中央結算對手方身份提供該項外匯兌換服務；除文意另有所指外，規則第 12A 章內對結算公司的提述須據此詮釋；

## “交易通戶口”

指 交易通主要戶口或交易通獨立戶口，視乎文意而定；

## “交易通買入聯交所買賣”

指 與交易通聯交所參與者透過自動對盤系統買入交易通股份相關、並符合以下條件的聯交所買賣：(i) 該項聯交所買賣透過自動對盤系統成交之前得到交易通買入外匯盤的支援，及(ii)該項聯交所買賣在透過自動對盤系統成交後得到交易通買入外匯交易的支援；

## “交易通買入外匯盤”

指 由交易通聯交所參與者向作為交易通營運者的結算公司發出以港幣兌換人民幣的指令，用以支援該參與者透過自動對盤系統輸入交易通股份買盤，該買盤在配對成功後，會生成交易通買入聯交所買賣；

## “交易通買入外匯交易”

指 作為交易通營運者的結算公司與交易通聯交所參與者之間，通過交易通買入外匯盤，以結算交易通買入聯交所買賣而產生的外匯交易；

## “交易通中央結算系統參與者”

指 交易通結算參與者或交易通託管商參與者，視乎文意而定；

## “交易通結算參與者”

指 已被結算公司接納登記，並維持有效登記為交易通中央結算系統參與者的直接結算參與者或全面結算參與者；

## “交易通託管商參與者”

指 已被結算公司接納登記，並維持有效登記為交易通中央結算系統參與者的託管商參與者；

## “交易通交易所參與者”

指 就買賣交易通股份而言，已被聯交所接納登記，並維持有效登記為交易通交易所參與者的聯交所參與者；

## “交易通聯交所買賣”

指 交易通買入聯交所買賣或交易通賣出聯交所買賣，視乎文意而定；

## “交易通外匯盤”

指 交易通買入外匯盤或交易通賣出外匯盤，視乎文意而定；

## “交易通外匯交易”

指 交易通買入外匯交易或交易通賣出外匯交易，視乎文意而定；

## “交易通參與者”

指 交易通聯交所參與者及 / 或交易通中央結算系統參與者，視乎文意而定；

## “交易通參與者登記準則”

指 結算公司不時訂定的合資格準則，以便參與者按此被接納登記、並維持有效登記為交易通結算參與者，致使其可以就交易通聯交所買賣提供結算和交收服務及 / 或就交易通標記股份提供託管服務；

## “交易通夥伴銀行”

指 與結算公司簽訂協議或安排，為作為交易通營運者的結算公司提供人民幣兌港元或港元兌人民幣的兌換服務及 / 或提供流動資金的金融機構；

## “交易通主要戶口”

指 由結算公司以交易通中央結算系統參與者名義開立的股份戶口，該戶口設立的主要目的是支援結算公司替該參與者記存及記除交易通股份，以作標記或解除標記之用；

## “交易通獨立戶口”

指 由結算公司以交易通中央結算系統參與者名義開立的股份戶口，該戶口設立的唯一目的是用作持有交易通標記股份，該等交易通股份可以是參與者自身持有或以代理人身份為客戶持有；

## “交易通賣出聯交所買賣”

指 與交易通聯交所參與者透過自動對盤系統賣出交易通股份相關、並符合以下條件的聯交所買賣：(i) 該項聯交所買賣在透過自動對盤系統成交之前得到交易通賣出外匯盤的支援，及 (ii) 該項聯交所買賣在透過自動對盤系統成交之後得到交易通賣出外匯交易的支援；

## “交易通賣出外匯盤”

指 由交易通聯交所參與者向作為交易通營運者的結算公司發出以人民幣兌換港幣的指令，用以支援該參與者透過自動對盤系統輸入交易通股份的沽盤，該沽盤在配對成功後，會生成交易通賣出聯交所買賣；

## “交易通賣出外匯交易”

指 作為交易通營運者的結算公司與交易通聯交所參與者之間通過交易通賣出外匯盤，以結算交易通聯交所賣出買賣而產生的外匯交易；

## “交易通股份”

指 結算公司不時根據規則第 12A04 條而納入交易通股份名單的合資格證券；

(b) 除非內文另有所指，否則下列詞語運用於本運作程序規則時具有下列含義：

## “下午外匯交收時間”

指 第12A.3.1(ii)節及第12A.3.5節所述，交易通結算參與者交收交易通最終外匯數額的最後期限，即不遲於T+2日下午三時；

## “預先繳付現金預設指示”

指 結算參與者按結算公司不時指定的指示詳情透過其中央結算系統終端機或參與者網間連接器「預先繳付現金 / 交易通付款預設指示」修訂功能向結算公司發出的指示，以授權結算公司代表結算參與者發出預先繳付現金指示；

## “相應的在持續淨額交收制度下的款項數額”

指 關於交易通外匯交易的交收，按第12A.3.4(ii)(c)節所述，就同一交易通股份，與該股份的交易通外匯數額相對應的持續淨額交收款項數額 (如有)；

## “黃昏外匯交收時間”

指 第12A.3.1(ii)節及第12A.3.5節所述，交易通結算參與者交收交易通最終外匯數額的最後期限，即最後多批交收處理程序在T+2日完成的時間；

## “交易日”

——指 可在聯交所進行交易的日子；

## “交易通確認報告”

指 第12A.2.3節所述，由結算公司向交易通中央結算系統參與者提供的報告，該報告列明了有關交易通聯交所買賣、交易通外匯交易、股份轉出外匯交易及其他相關資料；

## “交易通最終外匯數額”

指 關於交易通外匯交易的交收，根據第12A.3.5節所規定，交易通結算參與者和結算公司就交易通股份作出交收之最終款項數額；

## “交易通外匯數額”

指 關於交易通外匯交易的交收，根據第12A.3.2節所規定，交易通結算參與者和結算公司就一隻交易通股份作出交收之款項數額；

## “交易通外匯交易 / 股份轉出活動 / 狀況報告”

指 第16.6節所述，由結算公司向交易通中央結算系統參與者提供的每日報告，該報告載有該參與者 (i)有關股份轉出要求的修訂活動，及 (ii)該辦公日之交易通外匯交易和股份轉出外匯交易的交收狀況 (詳情請參閱《參與者適用的中央結算系統終端機使用者指引》)；

## “交易通付款指示”

指 結算公司因應第12A.4.1節所述的交易通最終外匯數額，或第12A.6.3節所述的就股份轉出外匯交易而產生的款項數額所發出的付款指示；

## “交易通付款預設指示”

指 第12A.4.1(i)節所述，交易通結算參與者為透過票據交換所自動轉賬系統付款指示(CPIs)支付交易通付款指示而設立的預設指示；

## “交易通股份解除標記程序”

指 規則第12A09條及運作程序規則第12A.5.6節所述，結算公司在交易通賣出聯交所買賣交收時，為交易通股份解除標記所採用的程序；

## “交易通股份標記程序”

指 規則第 12A09 條及運作程序規則第 12A.5.4 節所述，結算公司在交易通買入聯交所買賣交收後，為交易通股份加上標記所採用的程序；

## “交易通股份數額”

指 第12A.5.3節所述，交易通股份的淨長倉或淨短倉；

## 第一節

### 引言

#### 1.4 附加服務

結算公司也會提供有關境外證券的交收及結算服務，而該等交收及結算服務不一定透過中央結算系統提供。

作為交易通的營運者，結算公司也可能會向交易通中央結算系統參與者提供外匯兌換服務，這是為了支援以下的交收〈i〉產生自交易通聯交所買賣的交易通外匯交易及〈ii〉產生自股份轉出要求的股份轉出外匯交易。

## 第二節

### 參與者

#### 2.3 股份戶口及CCMS 抵押品戶口

##### 2.3.1 股份戶口的類別

中央結算系統共有四五種股份戶口，計有：

- (i) 股份結算戶口；
- (ii) 股份獨立戶口；
- (iii) 抵押股份統制戶口；及
- (iv) 股份貸出戶口；及
- (v) 交易通戶口。

## 2.3.2 股份戶口的數量

每位非投資者戶口持有人的參與者將擁有一個股份結算戶口，惟如獲結算公司批准，可擁有一個股份貸出戶口及不時由結算公司行使絕對酌情權而訂定其數量的股份獨立戶口。除上述戶口外，每位結算參與者會獲配一個抵押股份統制戶口。當參與者同時也是交易通中央結算系統參與者時，除上述戶口外，該參與者將獲配一個交易通主要戶口，及一個交易通獨立戶口。每位投資者戶口持有人會獲配一個股份結算戶口。

## 2.3.3 獲派的戶口編號

為便於識別起見，參與者的每個股份戶口均會獲配一個編號。

股份結算戶口獲分配或重新分配的編號為1號。

參與者的股份獨立戶口將獲分配或重新分配一個2號及以後的編號〈17至20號除外〉。倘為附寄結單服務的股份獨立戶口，則此等戶口將獲分配21號及以後的編號。

結算參與者的抵押股份統制戶口獲配的編號為20號。

參與者的股份貸出戶口獲配的編號為19號。

交易通中央結算系統參與者的交易通戶口獲配的編號為17號〈交易通獨立戶口〉及18號〈交易通主要戶口〉。

## 2.3.4 合資格證券的賬面交收紀錄

參與者在中央結算系統內的合資格證券將記錄於其股份戶口內。

存入合資格證券時，參與者〈投資者戶口持有人除外〉可指定將該等合資格證券記存於一個或多個股份戶口內（不包括抵押股份統制戶口，及倘若該參與者同時也是交易通中央結算系統參與者，則其交易通戶口亦不包括在內）。

參與者可透過輸入「戶口轉移指示」（「ATI」）或上載「ATI整批檔案」，將合資格證券在其名下的股份戶口（抵押股份統制戶口及附寄結單服務的股份獨立戶口除外）之間轉移，或可輸入「大批戶口轉移指示」，將合資格證券由其股份結算戶口轉往另一個股份獨立戶口（附寄結單服務的股份獨立戶口除外）。



結算參與者或託管商參與者可透過輸入「股份獨立戶口轉移指示」(「STI」)或上載「STI整批檔案」，將合資格證券自其名下一個股份戶口(不包括抵押股份統制戶口，及倘若該結算參與者或託管商參與者同時也是交易通中央結算系統參與者，則其任何一個交易通戶口亦不包括在內)轉往其附寄結單服務的股份獨立戶口，反之亦然。此外亦可透過輸入「大批股份獨立戶口轉移指示」，將合資格證券從其股份結算戶口轉往附寄結單服務的股份獨立戶口。

在一般規則的規限下，結算參與者或託管商參與者可就其每個附寄結單服務的股份獨立戶口，授權其附寄結單服務的股份獨立戶口所指定及/或持續指定的股份獨立戶口結單收件人，在結算公司接納前，確認經由參與者輸入(若有需要，則以及批核)的STI。所有由結算參與者或託管商參與者就附寄結單服務的股份獨立戶口輸入(若有需要，則以及批核)及須有關的股份獨立戶口結單收件人確認的STI，均屬股份獨立戶口轉移指示(須確認)，否則就屬於股份獨立戶口轉移指示(毋須確認)。

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。

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)。

### 2.3.5 股份結算戶口

各參與者的股份結算戶口將為其於中央結算系統內作交收用途(即交付或收取合資格證券)的主要股份戶口。

除在一個例外情況下，參與者的股份結算戶口通常將用作向其他參與者交付或收取合資格證券之用。

舉例而言，結算公司於每個交收日進行的多批交收處理程序，在有合資格證券可供運用的情形下，將自付方參與者的股份結算戶口記除合資格證券，並將其記存於取方參與者的股份結算戶口。

只有在非投資者戶口持有人的參與者以「交付指示」或簡稱「DI」的方式主動將中央結算系統內的合資格證券交付予另一參與者的情形下，才可不須指定使用參與者的股份結算戶口。如屬上述情況，付方參與者可選擇運用其名下的任何股份戶口(包括其股份獨立戶口，但不包括抵押股份統制戶口，及倘若該付方參與者同時也是交易通中央結算系統參與者，則其交易通戶口亦不包括在內)內的合資格證券。

### 2.3.13 交易通戶口

交易通戶口是在中央結算系統內，以交易通中央結算系統參與者的名義建立的股份戶口，該等戶口只能用作持有交易通標記股份。

交易通主要戶口是作為通過其轉入或轉出交易通股份，而使交易通股份被加上標記或解除標記的主要股份戶口。結算公司會通過交易通主要戶口，記存完成結算和交收交易通買入聯交所買賣的交易通股份，及記除交易通標記股份以作交易通賣出聯交所買賣的交收。

交易通獨立戶口只能用作持有交易通標記股份。此戶口可供交易通中央結算系統參與者，用作獨立客戶戶口，為其客戶持有交易通標記股份，或供其自營業務使用而持有交易通標記股份。

交易通中央結算系統參與者可透過輸入戶口轉移指示，或上載「戶口轉移指示整批檔案」，在其交易通主要戶口及交易通獨立戶口之間轉移交易通標記股份。

交易通中央結算系統參與者可透過輸入交收指示，或上載「交收指示整批檔案」，將交易通標記股份從其交易通戶口，轉移到另一交易通中央結算系統參與者的交易通戶口。

交易通中央結算系統參與者不可直接從其交易通戶口中提取交易通標記股份。該等參與者可透過輸入及確認「股份轉出要求」（請參閱第 12A.6.1 節），再由其交易通戶口轉出交易通股份，到其中央結算系統的其他股份戶口（抵押股份統制戶口及附寄結單服務的股份獨立戶口除外），然後才提取有關股份。

## 2.5 獲授權簽署人士

2.5.1 在規則第2.5.2條規限下，每一參與者（非投資者戶口持有人）須向結算公司提供獲其授權為獲授權簽署人士的名單，該等人士可代表該參與者就任何有關參與者參與中央結算系統及在中央結算系統內日常運作的事宜向結算公司發出書面指示，以及執行下列任何或全部的職務：

- (a) 授權在參與者的中央結算系統股份戶口內（抵押股份統制戶口，或倘若該參與者同時也是交易通中央結算系統參與者其交易通戶口皆除外）存入和提取證券，以及簽署有關表格並交回結算公司（就「股份存入表格」而言，「簽署」包括加蓋或蓋上簽署式樣的印章）；

## 第六節

### 運作及服務時間表

## 6.2 每日處理及服務時間表

以下的中央結算系統每日辦公及服務時間表僅載有中央結算系統部分事項的時間。有關中央結算系統提供的服務時間及系統功能詳情，請參閱《參與者適用的中央結算系統終端機使用者指引》。

時間	中央結算系統事項
上午八時	<p><u>透過中央結算系統終端機及參與者網間連接器</u>開始提供以下服務及設施：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(i) <u>透過中央結算系統終端機及參與者網間連接器</u>提供的結算服務（交收指示／投資者交收指示的修訂活動及整批傳送功能）；</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；</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／<u>交易通付款</u>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；</li> <li>(v) 認購、權益選擇、投票指示、電子認購新股指示（該日為申請首日除外）、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；及</li> <li><u>(vi) 透過中央結算系統終端機及參與者網間連接器</u>提供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>
上午九時三十分	<p><u>透過中央結算系統終端機及參與者網間連接器</u>開始提供以下服務及設施</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><u>(i) 交收服務（輸入交付指示、輸入索還及歸還證券要求，如適用者）</u>；</li> <li><u>(ii) 股份轉出要求修訂服務（為交易通中央結算系統參與者而設）</u>；</li> <li><u>(iii) 存管服務（參與者存入及提取合資格證券）</u>；</li> <li><u>(iv) 轉移指示輸入服務</u>；以及</li> <li><u>(v) 共同抵押品管理系統服務</u></li> </ul>

<a href="#"><u>上午十時十五分</u></a>	<a href="#"><u>第一次交易通股份解除標記程序</u></a>
<a href="#"><u>上午十一時四十五分</u></a>	<a href="#"><u>第二次交易通股份解除標記程序</u></a>
<a href="#"><u>下午一時四十五分</u></a>	<a href="#"><u>第三次交易通股份解除標記程序</u></a>
下午三時三十分	第四次 STI 整批處理程序 <a href="#"><u>第四次交易通股份解除標記程序</u></a> 如欲於該日傍晚開始收取代理人款項，輸入代理人款項（傍晚）預設指示的最後時限（唯該代理人款項（傍晚）預設指示須獲結算公司接納）
<a href="#"><u>下午四時</u></a>	<a href="#"><u>停止股份轉出要求修訂服務（為中央結算系統參與者而設）</u></a>
下午四時十五分	停止基金單位的新增 / 贖回指示修訂功能服務 輸入投票指示及公司代表 / 委託人指示的最後時限（若該日為結算公司規定輸入該等指示的最後時限） 第六批股份權益分派 <a href="#"><u>第一次交易通股份標記程序</u></a> <a href="#"><u>第五次交易通股份解除標記程序</u></a>

下午七時

停止交收指示 / 投資者交收指示修訂及整批傳送、預先繳付現金 / 交易通付款 預設指示修訂、即日付款預設指示修訂、代理人款項（傍晚）預設指示修訂、戶口轉移指示 / 股份獨立戶口轉移指示輸入及整批傳送、大批戶口轉移指示 / 大批股份獨立戶口轉移指示修訂、共同抵押品管理系統之現金轉移指示及股份轉移指示修訂服務、投標指示、認購、權益選擇、投票以及公司代表 / 委託人指示修訂功能服務

停止所有透過中央結算系統終端機及參與者網間連接器的查詢服務（共同抵押品管理系統查詢服務及查詢螢光屏廣播訊息服務除外）

輸入認購指示的最後時限（若有關發行人規定的最後認購時限為下一個辦公日中午十二時或之前）

開始重估抵押證券的價值及日終差額繳款抵押程序

第九批股份權益分派

結算公司發出於下一個辦公日交收的直接記存指示、直接記存指示及電子收付款指示

下午八時三十分

第二次交易通股份標記程序

電子認購新股指示的修訂活動、共同抵押品管理系統查詢服務、報告檢索及查詢螢光屏廣播訊息服務停止。

附註：

(iv) 於每個交收日，最後一次多批交收處理程序包括以下幾個過程：

- 最後一次多批交收處理程序 — 第一部分
- 強制借入證券程序
- 第一次自動歸還證券程序 — 為已發出索還證券通知的強制借入證券活動而設
- 最後一次多批交收處理程序 — 第二部分
- 第二次自動歸還證券程序 — 為所有其他強制借入證券活動而設
- 交收於傍晚外匯交收時間進行交收的交易通最終外匯數額

最後一次多批交收處理程序第一部分可確定所有在持續淨額交收制度下到期 / 逾期未交收的待收取股份數額。強制借入證券程序可就每隻合資格證券確定在持續淨額交收

制度下到期／逾期未交收的待收取股份和貸出人已發出索還證券通知要求歸還的合資格證券的總額（化為整數，以每手為單位），並會根據第10.7節為每隻合資格證券發出強制借入證券要求，從而與記存在股份貸出戶口的合資格證券進行配對。

被借用的證券會存入結算公司的股份戶口，並會依次用於下列幾方面：

- (a) 透過第一次自動歸還證券程序，交收貸出人已發出索還證券通知的未結清強制借入證券交易；
- (b) 透過最後一次多批交收處理程序第二部分，交收在持續淨額交收制度下未交收的待收取股份數額；及
- (c) 透過第二次自動歸還證券程序，交收貸出人尚未發出索還證券通知的未結清強制借入證券交易，但結算公司已根據強制證券借貸規例選擇行使其權利，終止該等交易。

於傍晚外匯交收時間進行交收的交易通最終外匯數額，會根據第12A.4.4節規定的程序進行交收。

## 6.3 適用於指定銀行的每日服務時間表

適用於指定銀行的中央結算系統每日服務時間表的概要如下。有關中央結算系統提供的服務時間及系統功能詳情，請參閱《指定銀行適用的中央結算系統終端機使用者指引》。

時間	中央結算系統事項
上午九時三十分 (以後)	提供「已拒付的直接記除指示／直接記存指示／電子收付款指示報告」（有關上一日發出並於當日交收的直接記除指示／直接記存指示／電子收付款指示的付款確認）  <u>提供「電子票據交換所自動轉帳系統付款指示報告</u>

## 第七節

### 存管及有關服務

#### 7.2 運作原則

##### 7.2.5 票據的存入和提取

在下列規定的限制下，參與者可於任何時間把記名合資格證券存入其股戶口（抵押股份統制戶口，及倘若參與者同時也是交易通中央結算系統參與者其交易通戶口皆

除外)。投資者戶口持有人只可存入記名合資格證券，該等證券須以有關的投資者戶口持有人的名義或代理人的名義登記。以其他名義登記的合資格證券不會獲結算公司接納。

參與者不可把任何屬合資格證券的不記名債務證券存入中央結算系統，結算公司只會於首次發行的過程中，直接接納由發行人或發行人的代理或代表記存於參與者股份戶口內（抵押股份統制戶口除外）的不記名債務證券。參與者自中央結算系統提取記存在參與者股份戶口（抵押股份統制戶口除外）的不記名債務證券的股票後，便不可於其後的任何時間再次把該等債務證券的股票存入中央結算系統。

參與者須按結算公司不時訂定的條件和限制，可於任何時間提取記存在其中央結算系統股份戶口內（抵押股份統制戶口，及倘若參與者同時也是交易通中央結算系統參與者其交易通戶口皆除外）的合資格證券。除非結算公司另有決定或一般規則另有規定，參與者不能從中央結算系統，或透過結算公司從獲委任存管處，實物提取以無股票證書或以綜合票據形式發行的合資格證券。

為避免疑慮，沒有合資格證券可以直接存入或提取於任何抵押股份統制戶口及任何交易通戶口。

## 7.2.8 可替換性

結算公司將視在中央結算系統內持有的所有同類合資格證券為可互相替換的。結算公司一般不會對某一參與者或涉及某項交易的合資格證券加上標記指示或標籤。

## 第八節

### 代理人服務

## 8.2 一般原則

### 8.2.7 參與者發出指示等的時間限制

一旦參與者向結算公司作出指示，參與者須負責確保其股份戶口內（抵押股份統制戶口，及倘若參與者同時也是交易通中央結算系統參與者其交易通戶口皆除外）存有有關數額的合資格證券（已發出指示者）（抵押股份統制戶口除外），以及（視乎情況而定）於適當日期向結算公司提供有關款項，以便執行有關的指示。如未能履行上述責任，結算公司將不會實行上述指示或採取其他適當行動（包括紀律處分）以填補該數額之不足。

### 8.2.3 計算時的小數點位數

在大多數情況下，以大部份貨幣為單位的合資格證券應計的現金股息，將計至小數後的兩位，詳情如下表所示：

幣制 小數位

元 (中國) (CNY 2  
人民幣)

## 第九節

### 中央結算系統結算及交收運作概覽

#### 9.2 聯交所買賣

根據聯交所規則，所有聯交所買賣(聯交所不承認的買賣除外)均須在中央結算系統進行交收。

如聯交所買賣中至少有一方為非結算參與者，該非結算參與者所指定代為結算其聯交所買賣的全面結算參與者，將取代該非結算參與者以當事人身份成為該宗聯交所買賣的一方，並就該宗聯交所買賣享有完全相同的權利及責任。

就交易通交易所參與者的交易通聯交所買賣，由該交易通交易所參與者指定代其結算其交易通聯交所買賣與相應的交易通外匯交易的交易通結算參與者，將在有關的交易通聯交所買賣在自動對盤系統中生效時，取代該交易通交易所參與者，以當事人身份成為該宗交易通聯交所買賣及其相應的交易通外匯交易的其中一方，並就該等買賣及外匯交易享有與該交易通交易所參與者完全相同的權利及負上相同的責任。

聯交所買賣將以下列任何方式在中央結算系統進行交收：

- (i) 持續淨額交收制度（見第十節）：據此，結算公司會代替雙方參與者成為交收對手方，而結算參與者與結算公司之間的交收會以淨額方式進行；或
- (ii) 「已劃分的買賣」制度（見第十一節）：據此，有關買賣的雙方結算參與者將直接進行交收。

在持續淨額交收制度下進行的交收一般會以貨銀對付方式進行。

在「已劃分的買賣」制度下進行的交收，視乎付方結算參與者的選擇而定，可以貨銀對付或毋須付款的方式進行。



## 第十節

### 聯交所買賣 — 持續淨額交收制度

#### 10.12 風險管理：凍結證券

##### 10.12.4 結算參與者可預先繳付現金

結算參與者可於每個交收日透過輸入預先繳付現金指示或透過「預先繳付現金/交易通付款預設指示」修訂功能輸入預先繳付現金預設指示，授權結算公司代表結算參與者重複發出預先繳付現金指示，以向結算公司支付同日可運用的資金。根據預先繳付現金預設指示所發出的預先繳付現金金額將視乎該預先繳付現金預設指示的付款基礎而定，並將為以下兩者其中之一：(a)持續淨額交收的待收取股份的未交收款項責任總額；或(b)持續淨額收的待收取及待交收股份的未交收款項責任淨額，另加結算參與者按淨額若干百分比預設的數額。凡在最後更新日期後十個曆日內仍處於「有待完成狀態」的預先繳付現金預設指示，將自動從中央結算系統中剔除。

## 第十二節

### 非聯交所買賣 — 「交收指示的交易」、「結算機構的交易」、 「投資者交收指示的交易」及「轉移指示」

#### 12.1 「交收指示的交易」（參與者（非投資者戶口持有人）之間）

##### 12.1.2 輸入交收指示

###### (i) 交收指示的細節

就第(f)項而言，參與者可輸入交付或收取股份的戶口，以進行「交收指示的交易」的交收。倘若付方或取方參與者沒有在第(f)項內輸入資料，其股份結算戶口便會用以交付或收取合資格證券，以進行「交收指示的交易」的交收。倘若交易通中央結算系統參與者在第(f)項輸入了一個交易通戶口，儘管該交收指示可按照第 12.1.3 節的規定完成配對，但該項交收指示的交易，只會在交易對手方在相應的交收指示的第(f)項也輸入了一個交易通戶口時，方能生效。

## 第12A節

### 外匯兌換服務

#### 12A.1 交易通

##### 12A.1.1 目的

一般規則第12A章列明結算公司作為交易通營運者可能提供外匯兌換服務的條款及條件，及交易通中央結算系統參與者交收交易通外匯交易和股份轉出外匯交易的責任。本第12A節提供了交易通中央結算系統參與者與結算公司之間，關於交易通外匯交易和股份轉出外匯交易的款項數額詳情，及有關交收該等交易、提交股份轉出要求及為交易通股份加上及解除標記的程序。

#### 12A.2 交易通外匯交易

##### 12A.2.1 交易通外匯交易的交收日

交易通結算參與者須在交收相應的交易通聯交所買賣的同一日（即 T+2 日）交收交易通外匯交易。除非文意另有所指，否則在本第 12A 節提及的「交收日」或「T+2 日」應據此理解。

##### 12A.2.2 交易通外匯交易的交收責任

就交易通買入外匯交易，交易通結算參與者有責任向結算公司買入人民幣，買入數額應等於相應的交易通買入聯交所買賣的應付代價。據此，交易通結算參與者為交收交易通買入外匯交易而提供的港元數額應等於應付代價乘以適用的人民幣賣出最終匯率。根據一般規則第 12A 章及本第 12A 節的規定，結算公司提供用以交收交易通買入外匯交易的人民幣數額，應等於上文所述的應付代價的數額。

就交易通賣出外匯交易，交易通結算參與者有責任向結算公司賣出人民幣，賣出數額應等於相應的交易通賣出聯交所買賣的應收所得。根據一般規則第 12A 章及本第 12A 節的規定，結算公司提供用以交收交易通賣出外匯交易的港元數額，應等於應收所得乘以適用的人民幣買入最終匯率。

##### 12A.2.3 交易通確認報告

為協助交易通中央結算系統參與者就其交易通外匯交易和股份轉出外匯交易與其內部記錄進行每日對賬，在每個辦公日大約下午六時，該等交易的詳情和相關資料會記錄在提供予交易通中央結算系統參與者的交易通確認報告內。交易通確認報告只供交易通中央結算系統參與者作參考之用。交易通中央結算系統參與者可以透過中央結算系統終端機或參與者網間連接器取得交易通確認報告。

根據以上所述及結算公司的酌情權，提供予交易通結算參與者的交易通確認報告將會包括下列資料（如有）：

- (i) 在相關交易日產生的每項交易通外匯交易的資料、相應的交易通聯交所買賣的細節、關於每一相關交易通股份的交易通外匯數額及其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額及股份數額的資料、參與者的交易通最終外匯數額及會被加上標記或解除標記的交易通股份數量；
- (ii) 每一相關交易通股份在前一交易日所產生的交易通外匯數額及其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額及股份數額、參與者的交易通最終外匯數額及會被加上標記或解除標記的交易通股份數量；
- (iii) 在相關交易日產生的每項股份轉出外匯交易的資料、相應股份轉出要求的詳情、及參與者就股份轉出外匯交易的匯總款項數額；及
- (iv) 在前一交易日產生的每項股份轉出外匯交易的資料、及參與者就股份轉出外匯交易的匯總款項數額。

## **12A.3 交易通外匯交易的款項數額**

### **12A.3.1 目的**

交易通結算參與者可能須在 T +2 日，就一隻交易通股份，交收多項交易通外匯交易，並須在同一天，就交易通股份交收多項非交易通支援的聯交所買賣。為了減低交易通結算參與者的資金壓力，結算公司可全權酌情容許產生自不同交易通外匯交易的款項數額作對銷，及容許參與者以其在持續淨額交收制度下將收取的人民幣款項數額，抵消其部份或全部由交易通外匯交易產生的人民幣付款責任。

第 12A.3.2 節至第 12A.3.6 節簡要說明在容許款項數額對銷的情況下所採取的程序。該等程序可概括如下：

- (i) 確定每隻交易通股份的交易通外匯數額：有關程序載於第 12A.3.2 節，並在第 12A.3.3 節以例子說明。
- (ii) 確定每項交易通外匯數額的交收時間：根據此項程序，交易通結算參與者於 T+2 日到期交收的不同交易通股份的交易通外匯數額會被分成兩組：參與者須在不遲於下午三時（「下午外匯交收時間」）完成交收其中一組數額，及在最終多批交收處理程序完成時（「黃昏外匯交收時間」）完成交收另一組數額。有關程序載於第 12A.3.4 節，並在第 12A.3.6 節以例子說明。
- (iii) 確定交易通最終外匯數額；有關程序載於第 12A.3.5 節，並在第 12A.3.6 節以例子說明。

為免產生疑問，在本第 12A 節及運作程序規則的其他部份提及有關交易通結算參與者及結算公司的款項數額，除非文意另有所指，「交易通外匯數額」、「交易通最終外匯數額」或「外匯數額」均包括兩個款項數額：其中一個為交易通結算參與者作為外匯交易的買方或賣方（按照情況而定）的款項數額，以人民幣或港元表示；另一個為結算公司（作為交易通營運者）作為該項外匯交易的另一方的相應款項數額，以港元或人民幣表示。

### 12A.3.2 確定交易通外匯數額

交易通結算參與者於某交易日所產生有關某交易通股份的所有交易通買入外匯交易，將與同一交易通股份在同一交易日所產生的所有交易通賣出外匯交易、及根據第 12A.7.1 節的規定，為修改或調整同一交易通股份的交易通聯交所買賣而產生的所有外匯交易進行抵銷，因而就該交易通股份，產生一項待交易通結算參與者交收的款項數額，及一項待結算公司交收的相應款項數額。該等款項數額將被稱為「交易通外匯數額」。

如何生成交易通外匯數額的概念，可通過載於第 12A.3.3 節的例子說明。

交易通外匯數額通常涉及以下兩種情況：交易通結算參與者為購買人民幣而向結算公司支付港元（即結算公司向參與者支付人民幣以轉換港元）；或交易通結算參與者為出售人民幣而向結算公司支付人民幣（即結算公司向參與者支付港元以轉換人民幣所得）。但在某些情況下，交易通結算參與者可能就某交易通外匯數額同時有責任向結算公司支付人民幣和港元（或相反地，結算公司同時有責任向參與者支付人民幣和港元）。這些情況可能是因為交易通聯交所買賣適用的人民幣買入最終匯率與人民幣賣出最終匯率之間的差異所導致的。

由於每個交易通外匯數額只會涉及一隻交易通股份，所以當交易通結算參與者在 T+2 日，就多隻交易通股份的交易通外匯交易須履行交收責任時，不同的交易通股份將產生不同的交易通外匯數額。

### 12A.3.3 實例（確定每隻交易通股份的交易通外匯數額）

通過對銷生成交易通外匯數額的概念，可以下述例子說明：

（註：負號（-）表示由交易通結算參與者支付而  
正號（+）表示由結算公司支付。）

(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
交易通股份	交易通買入／賣出外匯交易	人民幣外匯數額	最終外匯匯率	港元外匯數額
X	買入	¥100 +	1.17	\$117 -

<u>X</u>	買入	<u>¥400 +</u>	<u>1.19</u>	<u>\$476 -</u>
<u>X</u>	賣出	<u>¥200 -</u>	<u>1.16</u>	<u>\$232 +</u>
	<b>交易通外匯數額：</b>	<b><u>¥300 +</u></b>		<b><u>\$361 -</u></b>
<b>交易通 股份</b>	<b>交易通買入／賣出 外匯交易</b>	<b>人民幣 外匯數額</b>	<b>最終 外匯匯率</b>	<b>港元 外匯數額</b>
<u>Y</u>	買入	<u>¥300 +</u>	<u>1.17</u>	<u>\$351 -</u>
<u>Y</u>	賣出	<u>¥800 -</u>	<u>1.16</u>	<u>\$928 +</u>
	<b>交易通外匯數額：</b>	<b><u>¥500 -</u></b>		<b><u>\$577 +</u></b>

此例子假設交易通結算參與者有責任交收以下交易：

- 關於股份 X 的兩項交易通買入外匯交易及一項交易通賣出外匯交易；及
- 關於股份 Y 在同一交收日的一項交易通買入外匯交易及一項交易通賣出外匯交易。

第一步是確定每項交易通外匯交易的人民幣和港元的支付數額。縱列（3）的人民幣數額是來自相應的交易通聯交所買賣，其為應付或應收數額取決於該交易涉及買入還是賣出股份 X 或 Y。縱列（5）港元數額是以縱列（4）即一般規則第 12A10 條所指的人民幣買入最終匯率或人民幣賣出最終匯率（取決於結算公司須兌換人民幣或兌換港元），乘以相應人民幣數額。

對於在縱列（2）的交易通買入外匯交易，交易通結算參與者須向結算公司支付港元以換取人民幣。對於交易通賣出外匯交易（亦是縱列（2）），參與者須以人民幣支付結算公司以換取港元。

交易通外匯數額為股份 X 和 Y 各自在縱列（3）的人民幣款項數額和縱列（5）的港元款項數額分別抵銷後的結果。生成的交易通外匯數額，包括交易通結算參與者在某貨幣的一個款項數額，及結算公司在另一貨幣的相應款項數額，即：

- 交易通結算參與者的交易通外匯數額為：就股份 X 向結算公司支付港元 361 元以換取人民幣 300 元，及就股份 Y 向結算公司支付人民幣 500 元以換取港元 577 元。
- 結算公司（作為交易通營運者）的交易通外匯數額為：就股份 X 為參與者轉換港元 361 元以向其提供人民幣 300 元，及就股份 Y 為參與者轉換人民幣 500 元以向其提供港元 577 元。

#### 12A.3.4 確定交易通外匯數額的交收時間

- (i) 交易通結算參與者一般必須在不遲於 T+2 日的下午外匯交收時間，交收其所有交易通外匯數額。但結算公司可因應載於第 12A.3.4 (ii) 節的多種因素，容許交易通結算參與者在黃昏外匯交收時間，或在結算公司根據第 12A.3.4 (iv) 節及第 12A.4.5 節所批准的較後時間，交收其部份或全部交易通外匯數額。在任何情況下，在結算公司未確認從交易通結算參與者收妥相關交收數額前，結算公司沒有責任在 T+2 日交收交易通外匯數額的任何款項數額。
- (ii) 結算公司在考慮下列及其他因素後，可容許交易通結算參與者的某些交易通外匯數額在黃昏外匯交收時間進行交收，而其他的交易通外匯數額則必須如常在下午外匯交收時間進行交收：
  - (a) 參與者是否必須就交易通外匯數額對結算公司作港元付款；
  - (b) 參與者是否必須就交易通外匯數額對結算公司作人民幣付款；及
  - (c) 對於同一交易通股份，參與者是否兼有交易通外匯數額及在持續淨額交收制度下的款項數額（「相應的在持續淨額交收制度下的款項數額」），若是，兩者相關的人民幣數額。
- (iii) 當交易通結算參與者就其交易通外匯數額，須向結算公司交付港元以換取人民幣，該交易通外匯數額將被指定最遲須於下午外匯交收時間進行交收。
- (iv) 當交易通結算參與者就其交易通外匯數額，須在 T+2 日向結算公司交付人民幣以換取港元，結算公司在指定其交易通外匯數額的交收時間時，會考慮參與者會否在 T+2 日，就其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額，從結算公司收取人民幣。在通常情況下，結算公司將採用以下原則：
  - (a) 倘若結算公司的記錄顯示，交易通結算參與者就其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額，將不會從結算公司收取任何人民幣，則該交易通外匯數額將會被指定最遲須於下午外匯交收時間進行交收。
  - (b) 倘若結算公司的記錄顯示，交易通結算參與者就其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額，將會從結算公司收取人民幣，而將會收取的人民幣數額不會少於該參與者因應交易通外匯數額而要支付予結算公司的數額，則該交易通外匯數額將會被指定最遲須於黃昏外匯交收時間進行交收。

(c) 倘若結算公司的記錄顯示，交易通結算參與者就其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額，將會從結算公司收取人民幣，而將會收取的相應的在持續淨額交收制度下的人民幣數額是少於該參與者因應交易通外匯數額而需支付予結算公司的數額，則該交易通外匯數額將會被分成兩個外匯數額（各自包括人民幣款項數額和相應的港元款項數額）。交易通結算參與者須在 T+2 日的兩個不同時間，就這兩個外匯數額進行以下交收：

(1) 交易通外匯數額的人民幣付款數額中，相等於相應的在持續淨額交收制度下的人民幣款項數額的部份，會被指定最遲須於黃昏外匯交收時間進行交收；及

(2) 交易通外匯數額的人民幣付款數額中，超過相應的在持續淨額交收制度下的人民幣款項數額的部份，會被指定最遲須於下午外匯交收時間進行交收。

為免產生疑問，第 12A.3.4 (iv) (c) 節所指從交易通外匯數額分割出來的部份，應據「交易通外匯數額」的定義相應地詮釋；而「相應港元款項數額」所指的意思，就某交易通外匯數額被分割為兩個外匯數額而言，為以上第 (1) 及第 (2) 段提及的人民幣款項數額相應的港元款項數額，正如在第 12A.3.6 節陳述的例子所說明，其為按比例方式而產生的。

上述關於確定交易通外匯數額交收時間的方法，可通過第 12A.3.6 節的例子說明。

### **12A.3.5 確定交易通最終外匯數額**

(i) 當完成第 12A.3.4 節的程序後，交易通結算參與者最遲在 T+2 日下午外匯交收時間須交收的一個或多個交易通外匯數額，及最遲在黃昏外匯交收時間須交收的一個或多個交易通外匯數額將會產生。

(ii) 所有（根據第 12A.3.4 (iii)、12A.3.4 (iv) (a) 及 12A.3.4 (iv) (c) (2) 節所指）被指定最遲於下午外匯交收時間進行交收的交易通外匯數額，將相互抵銷而產生一個淨款項數額。交易通結算參與者通常須向結算公司支付港元以換取人民幣，或向結算公司支付人民幣以換取港元。但在某些情況下，參與者可能就某交易通最終外匯數額有責任向結算公司同時支付人民幣和港元（或反過來，結算公司有責任向參與者同時支付人民幣和港元）。這些情況可能是因為交易通聯交所買賣適用的人民幣買入最終匯率與人民幣賣出最終匯率之間的差異所導致的。該港元及／或人民幣數額（視情況而定）代表參與者就有關交易通外匯交易，在 T+2 日的下午外

匯交收時間或之前須交收的最終款項數額（「交易通最終外匯數額」），並須在不遲於該時間進行交收。

- (iii) 所有（根據第 12A.3.4 (iv) (b) 及 12A.3.4 (iv) (c) (1) 節）被指定最遲於黃昏外匯交收時間進行交收的交易通外匯數額，將被匯總而產生一個合併的款項數額。交易通結算參與者須向結算公司支付人民幣以換取結算公司支付相應的港元數額。該人民幣數額代表參與者就有關交易通外匯交易，最遲在 T+2 日的黃昏外匯交收時間須交收的最終款項數額（「交易通最終外匯數額」）。除非結算公司根據第 12A.4.5 節所述的規定，允許一個較後的交收時間，否則該數額須在不遲於該時間進行交收。

在第 12A.3.5 節所述的對銷程序，將在第 12A.3.6 節中以例子說明。

交易通結算參與者的交易通最終外匯數額的詳情，將載於交易通確認報告內。

### 12A.3.6 實例 (確定交易通外匯數額的交收時間及交易通最終外匯數額)

在第 12A.3.4 節描述確定交易通外匯數額交收時間的方法，及在第 12A.3.5 節描述確定交易通最終外匯數額的方法，可以下述例子說明：

（註：負號（-）表示由交易通結算參與者支付而  
正號（+）表示由結算公司支付。）

交易通 股份	在持續淨 額交收制 度下的人 民幣款項 數額	交易通外匯數額		參與者須在不同時間支付 的交易通外匯數額			
		人民幣 數額	港元 數額	在下午外匯 交收時間		在黃昏外匯 交收時間	
		人民幣 數額	港元 數額	人民幣 數額	港元 數額	人民幣 數額	港元 數額
<u>交易通外匯數額 (參與者須支付港元):</u>							
U	¥200 -	¥100 +	\$117 -	¥100 +	\$117 -	0	0
V	¥100 -	¥200 +	\$234 -	¥200 +	\$234 -	0	0
W	¥100 +	¥300 +	\$351 -	¥300 +	\$351 -	0	0
<u>交易通外匯數額 (參與者須支付人民幣):</u>							
X	¥100 -	¥400 -	\$464 +	¥400 -	\$464 +	0	0
Y	¥200 +	¥500 -	\$580 +	¥300 -	\$348 +	¥200 -	\$232 +
Z	¥700 +	¥600 -	\$696 +	0	0	¥600 -	\$696 +
				<u>¥100-</u>	<u>\$110 +</u>	<u>¥800-</u>	<u>\$928 +</u>
		<u>交易通最終外匯數額:</u>					



在這個例子中，假設交易通結算參與者在同一天內，須交收 U 至 Z 各隻股份的交易通外匯數額和相應的在持續淨額交收制度下的款項數額。

參與者就股份 U、V 和 W 的交易通外匯數額，須向結算公司支付港元以換取人民幣。這些交易通外匯數額將被指定在下午外匯交收時間進行交收。(第 12A.3.4 (iii) 節)

參與者就股份 X、Y 和 Z 的交易通外匯數額，須向結算公司支付人民幣換取港元。正如第 12A.3.1 節所述，結算公司在指定該等交易通外匯數額的交收時間之前，將酌情考慮參與者是否會在 T+2 日就其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額，從結算公司收取人民幣(第 12A.3.4 (iv) 節)。

就股份 X 而言，參與者必須為其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額，向結算公司支付人民幣(人民幣 100 元)。由於參與者不能使用任何來自其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額產生的人民幣，以交收人民幣 400 元的交易通外匯數額，股份 X 的全數交易通外匯數額(人民幣 400 元)會被指定最遲須於下午外匯交收時間進行交收。(第 12A.3.4 (iv) (a) 節)

就股份 Y 和 Z 而言，據記錄顯示，參與者將從結算公司就其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額收取人民幣(股份 Y 為人民幣 200 元及股份 Z 為人民幣 700 元)。

有關股份 Y，應收的人民幣數額(人民幣 200 元)是少於在交易通外匯數額的應付人民幣數額(人民幣 500 元)。因此，股份 Y 的交易通外匯數額將被分成兩個外匯數額，由參與者在不同的時間內進行交收：

- 其中一個款項數額將最遲於黃昏外匯交收時間進行交收：這部份最多等於相應的在持續淨額交收制度下的款項數額的人民幣數額的部份(人民幣 200 元)(第 12A.3.4 (iv) (c) (1) 節)；
- 另一個款項數額將最遲於下午外匯交收時間進行交收：這部分是指超過相應的在持續淨額交收制度下的款項數額的人民幣付款數額的部份(人民幣 300 元)(第 12A.3.4 (iv) (c) (2) 節)；及
- 股份 Y 原來的交易通外匯數額的相應港元付款數額(港元 580 元)，將按其人民幣付款數額的比例，分為兩個新的交易通外匯數額(分別是港元 232 元兌換人民幣 200 元，及港元 348 元兌換人民幣 300 元)。(第 12A.3.4 (iv) (c) 節)

至於股份 Z，參與者按其相應的在持續淨額交收制度下的款項數額從結算公司收取的人民幣數額(人民幣 700 元)將會多於其交易通外匯數額的人民幣應付數額(人民幣 600 元)。因此，該交易通外匯數額將會被指定最遲於黃昏外匯交收時間進行交收。(第 12A.3.4 (iv) (b) 節)

在將多項交易通外匯數額分為在下午外匯交收時間及黃昏外匯交收時間進行交收的兩組後，被指定最遲於下午外匯交收時間進行交收的交易通外匯數額，將會互相抵銷以得出淨款項數額；而被指定最遲於黃昏外匯交收時間進行交收的交易通外匯數額，將被滙總以得出總款項數額；在各情況下，都得出參與者在 T+2 日須交收的交易通最終外匯數額。（第 12A.3.5 (i) 至 (iii) 節）

在這個例子中，最遲於下午外匯交收時間進行交收的交易通最終外匯數額，參與者須向結算公司支付人民幣 100 元（人民幣 100 元 + 人民幣 200 元 + 人民幣 300 元 - 人民幣 400 元 - 人民幣 300 元），以換取港元 110 元（- 港元 117 元 - 港元 234 元 - 港元 351 元 + 港元 464 元 + 港元 348 元）；而最遲於黃昏外匯交收時間進行交收的交易通最終外匯數額，參與者須向結算公司支付人民幣 800 元（- 人民幣 200 元 - 人民幣 600 元）以換取港元 928 元（港元 232 元 + 港元 696 元）。

## 12A.4 交易通最終外匯數額的交收

### 12A.4.1 交易通結算參與者可使用的付款方式

交易通結算參與者於 T+2 日的黃昏外匯交收時間，交收其交易通最終外匯數額時可使用的交收方法，已詳述於第 12A.4.4 節。交易通結算參與者最遲於 T+2 日的下午外匯交收時間，交收其交易通最終外匯數額時可使用的交收方法則載列如下。

根據第 12A.3.5 (ii) 節，交易通結算參與者有責任在 T+2 日的下午外匯交收時間或之前，向結算公司支付港元或人民幣，以交收其交易通最終外匯數額，有關該港元或人民幣付款責任的付款指示會在 T+2 日大約上午八時產生（「交易通付款指示」）。

交易通付款指示可通過票據交換所自動轉賬系統付款指示，或其他方法進行交收。下面描述按照參與者選擇採取的方法而適用的程序。

- (i) 交易通結算參與者可選擇透過票據交換所自動轉賬系統付款指示，交收交易通付款指示。若參與者選擇此方法，下列程序將適用：
  - (a) 參與者應進行一次設定，在任何辦公日上午八時至下午七時，或在其他結算公司不時訂立的時間內，透過中央結算系統終端機或參與者網間連接器，向結算公司輸入並授權以「票據交換所自動轉賬系統」作為付款方式的指示（「交易通付款預設指示」）。凡在最後更新日期後十個曆日內仍處於「等待狀態」的交易通付款預設指示，將自動從中央結算系統中剔除。

- (b) 當結算公司發出交易通付款指示時，票據交換所自動轉賬系統付款指示資料將會記錄在「電子票據交換所自動轉賬系統付款指示報告」(CSEPI03)，讓交易通結算參與者的指定銀行採取行動。
- (c) 交易通結算參與者必須授權其指定銀行代表其發出票據交換所自動轉賬系統付款指示予銀行公會票據交換所。
- (d) 交易通結算參與者必須確保在其港元及／或人民幣指定銀行戶口內有足夠相關貨幣的資金，而其指定銀行在不遲於產生票據交換所自動轉賬系統付款指示當天的下午外匯交收時間，或在結算公司不時規定的其他時間，完成票據交換所自動轉賬系統的付款。
- (e) 倘若結算公司在下午外匯交收時間後，才收到票據交換所自動轉賬系統的付款，結算公司有權不交收有關的交易通最終外匯數額。該等透過票據交換所自動轉賬系統付款而收到的相關款項（不包括利息），將會記存到參與者的款項記賬戶口，退還給參與者。
- (ii) 交易通結算參與者可選擇透過其他結算公司不時指定接受的方式（例如透過銀行轉賬或票據交換所自動轉賬系統付款），交收交易通付款指示。在該等情況下，下列程序將適用：

  - (a) 交易通結算參與者必須確保同日可用的資金，會於不遲於交收交易通付款指示產生當天的下午外匯交收時間，或結算公司不時指定的時間，轉往結算公司指定的銀行戶口內。
  - (b) 倘若結算公司在下午外匯交收時間後才收到付款，結算公司有權不交收有關的交易通最終外匯數額。該等已繳付的現金金額（不包括利息），將會記存到交易通結算參與者的款項記賬戶口，全數退還給參與者。
  - (c) 倘若結算參與者並非根據交易通付款指示匯入現金款項予結算公司，結算公司有權不在當日退款給交易通結算參與者。結算公司一般可在下一個辦公日，酌情將該等金額（不包括利息），記存到參與者的款項記賬戶口，退還給參與者。

當交易通付款指示在某一辦公日中產生，但結算公司在該辦公日的辦公時間結束時還沒有收到有關的款項，該交易通付款指示將在當天結束時從中央結算系統中剔除。

**12A.4.2 交易通最終外匯數額—當交易通結算參與者最遲須在下午外匯交收時間支付港元**

本節陳述交易通結算參與者最遲於下午外匯交收時間，向結算公司支付港元，以交收交易通最終外匯數額的交收程序。

根據第 12A.3.5 (ii) 節，交易通結算參與者或會被要求最遲於 T+2 日的下午外匯交收時間，向結算公司支付港元，以交收交易通最終外匯數額。參與者以港元及結算公司以人民幣交收該等交易通最終外匯數額的程序如下：

- (i) 當結算公司透過第 12A.4.1 節所指的票據交換所自動轉賬系統付款指示或其他方式，收到參與者就交易通最終外匯數額的有關港元款項後，會將收到的港元記存到參與者款項記賬的雜項戶口內，以記錄該筆款項。
- (ii) 結算公司通常會在 T+2 日的黃昏外匯交收時間，支付人民幣以交收交易通最終外匯數額。但是，結算公司可能考慮提早付款，以便參與者交收其在持續淨額交收制度下的款項數額（如有）。因此，在確定何時支付人民幣以交收交易通最終外匯數額時，結算公司會考慮參與者持有交易通外匯數額的交易通股份所相應的在持續淨額交收制度下的款項數額（如有），和這些相應的在持續淨額交收制度下的款項數額的淨額（在本 12A.4.2 (ii) 節，稱為「持續淨額交收制度款項數額的淨額」）。下列為採用的程序：
  - (a) 結算公司會考慮交易通結算參與者在 T+2 日，就其持續淨額交收制度款項數額的淨額，會否從結算公司收取人民幣，或參與者在 T+2 日，就其持續淨額交收制度款項數額的淨額，是否有責任向結算公司支付人民幣。
  - (b) 倘若根據結算公司的記錄，參與者將會在 T+2 日，就其持續淨額交收制度款項數額的淨額，從結算公司收取人民幣，結算公司可在黃昏外匯交收時間以人民幣交收其交易通最終外匯數額。此乃透過按照上述第 12A.4.2 (i) 節，從交易通參與者收到相關港元後，將款項從參與者的款項記賬的雜項戶口中記除，再將相關的人民幣款項記存在同一戶口，以完成參與者就交易通最終外匯數額的交收。
  - (c) 倘若根據結算公司的記錄，參與者將會在 T+2 日，須就其持續淨額交收制度款項數額的淨額，向結算公司作人民幣付款，結算公司可分批及在不同時間以人民幣交收其交易通最終外匯數額。有關操作如下：
    - (1) 當結算公司按照上述第 12A.4.2 (i) 節，從交易通結算參與者收到相關港元，並從其雜項賬中記除相關港元後，結算公司可立即在交易通結算參與者的款項記賬的交收戶口中，記存其預計須向參與者就交易通最終外匯數額支付的人民幣款額，所記存的人民

幣以持續淨額交收制度款項數額的淨額為限，但該數額在任何情況下都不能大於持續淨額交收制度款項數額的淨額，或相應交易通最終外匯數額的人民幣付款數額，以較低者為準；及

- (2) 結算公司可在黃昏外匯交收時間，交收超過持續淨額交收制度款項數額的淨額的剩餘部份（如有）。相關的港元將從交易通結算參與者款項記賬的雜項戶口中記除，而相關的人民幣將在同一戶口中記存。

上述交收程序會在第 12A.4.3 節以例子說明。

**12A.4.3 實例（確定交收交易通最終外匯數額的人民幣數額的付款時間—當交易通結算參與者須在下午外匯交收時間支付港元）**

這個例子是用於說明：當交易通結算參與者根據第 12A.4.2 (ii) (c) 節，須就其持續淨額交收制度款項數額的淨額，向結算公司作人民幣付款時，結算公司將會就參與者的交易通最終外匯數額，分別在該參與者向其交付港元後立即交收人民幣付款數額，及在黃昏外匯交收時間之前交收人民幣付款數額。

此例子假設交易通結算參與者須就其交易通股份 Y 和 Z 的交易通聯交所買賣，及在持續淨額交收制度下的款項數額，在 T+2 日進行交收：

（註：負號（-）表示由交易通結算參與者支付而正號（+）表示由結算公司支付。）

股份	相應的在持續淨額交收制度下的款項數額的人民幣數額	參與者須在下午外匯交收時間交收的交易通外匯數額	
		人民幣數額	港元數額
<u>交易通外匯數額（參與者須支付人民幣）</u>			
Y	¥200 +	¥400 -	\$468 +
<u>交易通外匯數額（參與者須支付港元）</u>			
Z	¥300 -	¥800 +	\$928 -
	<u>¥100 -</u>	<u>¥400 +</u>	<u>\$460 -</u>

經過如上述圖表所說明的對銷後，該交易通結算參與者就其須在下午外匯交收時間或之前交收的交易通最終外匯數額，為港元款項數額（港元 460 元）。

假設該參與者在下午外匯交收時間之前，已交收其港元款項數額（港元 460 元），結算公司將立即把收到的港元 460 元記存到參與者款項記賬的雜項戶口，以記錄該款項。

隨後，結算公司會立即記存人民幣 100 元到參與者款項記賬的交收戶口；該數額為以下兩者的較低者：(i) 參與者持有交易通外匯數額的交易通股份所相應的在持續淨額交收制度下的款項數額的淨額（人民幣 100 元），及 (ii) 結算公司就相應交易通最終外匯數額的人民幣付款數額（人民幣 400 元）。結算公司會從參與者的雜項戶口記除相關港元數額的港元 115 元（港元 460 元 \* 人民幣 100 元 / 人民幣 400 元）後，才作出上述的記存。（第 12A.4.2 (ii) (c) (1)）

就參與者超過相應的在持續淨額交收制度下的款項數額的淨額（人民幣 400 元 - 人民幣 100 元）的人民幣數額的剩餘部份（人民幣 300 元），結算公司將在參與者的雜項戶口中記除相關港元數額的港元 345 元（港元 460 元 - 港元 115 元）後，在黃昏外匯交收時間將該款項記存到相同的戶口。（第 12A.4.2 (ii) (c) (2) 節）

#### **12A.4.4 交易通最終外匯數額—當交易通結算參與者須最遲在下午外匯交收時間支付人民幣**

本節列明當交易通結算參與者須最遲在下午外匯交收時間，向結算公司支付人民幣，以交收交易通最終外匯數額的程序。

根據第 12A.3.5 (ii) 節，交易通結算參與者可能被要求最遲在 T+2 日的下午外匯交收時間，向結算公司支付人民幣，以交收其交易通最終外匯數額。參與者以人民幣及結算公司以港元交收該等交易通最終外匯數額的程序如下：

- (i) 當結算公司透過第 12A.4.1 節所指的票據交換所自動轉賬系統付款指示或其他方式，收到參與者就交易通最終外匯數額的有關人民幣款項後，會將收到的人民幣記存到參與者的款項記賬的雜項戶口內，以記錄該筆款項。
- (ii) 結算公司將會在黃昏外匯交收時間，透過在參與者款項記賬的雜項戶口中記除相關數額的人民幣，並記存相關數額的港元，以完成交收交易通最終外匯數額。

#### **12A.4.5 交易通最終外匯數額—當交易通結算參與者須最遲在黃昏外匯交收時間支付人民幣**

本節列明當交易通結算參與者須最遲在黃昏外匯交收時間，向結算公司支付人民幣，以交收交易通最終外匯數額的程序。

根據第 12A.3.5 (iii) 節，交易通結算參與者可能被要求最遲在 T+2 日的黃昏外匯交收時間，向結算公司支付人民幣，以交收其交易通最終外匯數額。參與者以人民幣，及結算公司以港元，交收該等交易通最終外匯數額的程序如下：

- (i) 在 T+2 日的最後多批交收處理程序完成時，結算公司會按以下方式向交易通結算參與者收取相關的人民幣數額，以交收交易通最終外匯數額：

- (a) 首先，接受或收取就持續淨額交收制度款項數額的淨額而支付予參與者的任何人民幣數額，包括根據第 12A.4.2 (ii) (c) (1) 節而支付的任何人民幣數額。該數額會從參與者款項記賬的雜項戶口中記除；及
- (b) 然後，接受及收取在 T+2 日下午外匯交收時間按照第 12A.4.2 (ii) (b) 及 12A.4.2 (ii) (c) (2) 節，支付到參與者款項記賬的雜項戶口以交收其交易通最終外匯數額的任何人民幣數額。該數額會從參與者的款項記賬的雜項戶口中記除。

在上述段落 (a) 及 (b) 收取到的人人民幣款項，在本 12A.4.5 節中被統稱為「人民幣可用數額」。

- (ii) 就參與者被指定最遲在黃昏外匯交收時間進行交收的交易通最終外匯數額而言，當人民幣可用數額足夠交收有關的人民幣款項數額，結算公司可認為該交易通結算參與者已全數交收該款項數額。當根據第 12A.4.5 (i) (a) 及 (b) 節由有關的戶口中記除人民幣可用數額，結算公司會立即將相關的港元數額記存到參與者的雜項戶口中。
- (iii) 就參與者被指定最遲在黃昏外匯交收時間進行交收的交易通最終外匯數額而言，當人民幣可用數額不足夠交收其全數人民幣款項數額（即在此情況下，當須要交收的交易通最終外匯數額的人民幣款項數額，大於人民幣可用數額），結算公司可酌情考慮，允許參與者分階段在不同的時間，採用以下程序交收該人民幣款項數額：
  - (a) 首先，當根據第 12A.4.5 (i) (a) 及 (b) 節由有關戶口中記除人民幣可用數額時，結算公司會立即將相應的港元數額記存到參與者的雜項戶口中。該記除的數額可被視為參與者用作部份交收其在 T+2 日的黃昏外匯交收時間須交收的人民幣款項數額。
  - (b) 然後，通過在參與者款項記賬的雜項戶口中錄入一項記除賬，以收取在 T+2 日的黃昏外匯交收時間到期但尚未交收的人民幣款項數額。該記除賬將按照第 14.4 節所述的款項交收程序進行交收。在按照第 14.4 節所述交收該記除賬，及當結算公司已確認收妥付款後，參與者於 T+2 日的黃昏外匯交收時間到期交收的全數人民幣款項數額，可被視為已完成交收。
  - (c) 最後，當結算公司已根據以上 (a) 及 (b) 段的程序確認收妥全數人民幣交收數額後（通常在 T+2 日大約下午八時三十分發生），結算公司會將以上第 12A.4.5 (iii) (b) 節所指的人民幣尚欠數額所相應

的港元數額，透過記存到交易通結算參與者款項記賬的雜項戶口中，以完成交易通最終外匯數額的交收。

(iv) 倘若根據以上第 12A.4.5 (i) (a) 及 (b) 節，沒有人民幣可用數額可供結算公司收取時，結算公司會在交易通結算參與者款項記賬的雜項戶口中錄入一項記除賬，以向該參與者收取人民幣。該記除賬會按照第 14.4 節所述的款項交收程序進行交收。在按照第 14.4 節所述交收該記除賬，及結算公司已確認收妥相關的人民幣付款後（通常在 T+2 日大約下午八時三十分發生），結算公司將會透過在交易通結算參與者的款項記賬的雜項戶口記存有相關港元數額，以完成交易通最終外匯數額的交收。

(v) 就以上第 12A.4.5 (i) (a) 及 (b) 節所述，透過接受或收取人民幣可用數額交收的人民幣款項數額的該部份，交易通結算參與者通常會在 T+2 日收到相應的港元付款。

(vi) 就以上第 12A.4.5 (i) (a) 及 (b) 節所述，未能透過接受或收取人民幣可用數額交收的人民幣款項數額的該部份，交易通結算參與者通常會在 T+3 日早上收到以 T+2 日計價的相應港元付款。

上述交收程序會在第 12A.4.6 節以例子說明。

#### 12A.4.6 實例（確定將會在 T+2 日日終或 T+3 日上午，從結算公司收到的港元付款的數額）

此例子說明根據第 12A.4.5 節，當參與者在交易通最終外匯數額的人民幣款項數額，在黃昏外匯交收時間不被結算公司視作已交收或只被視作部份交收時，就被指定在黃昏外匯交收時間交收的交易通最終外匯數額，交易通參與者將會在 T+2 日日終或 T+3 日上午，從結算公司收到的港元付款的數額。

此例子假設交易通結算參與者須就其股份 N（為非交易通股份）及股份 Y 和 Z（為交易通股份）的交易通聯交所買賣，及在持續淨額交收制度下的款項數額，在 T+2 日進行交收：

（註：負號（-）表示由交易通結算參與者支付而正號（+）表示由結算公司所支付。）



股份	在持續淨額交收制度下的人民幣款項數額	交易通外匯數額		參與者在不同時間須支付的交易通外匯數額			
		人民幣數額	港元數額	在下午外匯交收時間		在黃昏外匯交收時間	
				人民幣數額	港元數額	人民幣數額	港元數額
<u>非交易通股份的在持續淨額交收制度下的款項數額：</u>							
N	¥300 -						
<u>交易通外匯數額(參與者須支付人民幣)：</u>							
Y	¥200 -	¥200 -	\$232 +	¥200 -	\$232 +	0	0
Z	¥300 +	¥900 -	\$1,044 +	¥600 -	\$696 +	¥300 -	\$348 +
	<u>¥200 -</u>			<u>¥800 -</u>	<u>\$928 +</u>	<u>¥300 -</u>	<u>\$348 +</u>
				<u>交易通最終外匯數額</u>			

經過如上述圖表所說明的對銷後，該交易通結算參與者就其須在下午外匯交收時間交收的交易通最終外匯數額，為一項人民幣款項數額（人民幣 800 元），而在黃昏外匯交收時間交收的交易通最終外匯數額，為另一項人民幣款項數額（人民幣 300 元）。

就交易通結算參與者被指定於下午外匯交收時間交收的交易通最終外匯數額，假設參與者已準時交收其人民幣款項數額（人民幣 800 元），結算公司將會在黃昏外匯交收時間之前完成該外匯交收。該交易通結算參與者在 T+2 日日終時，將會收到交易通最終外匯數額的相應港元款項數額（港元 928 元）。

就交易通結算參與者被指定於黃昏外匯交收時間交收的人民幣款項數額（人民幣 300 元），雖然參與者會從結算公司就股份 Z 的在持續淨額交收制度下的款項數額收到人民幣 300 元，但是，參與者須就其所有股份持續淨額交收制度款項數額的淨額，向結算公司作人民幣付款，以支付人民幣 200 元。因此，參與者在持續淨額交收制度下的款項數額並無任何可用的人民幣數額供提取，而參與者須通過中央結算系統的日終款項交收程序，支付其交易通最終外匯數額的尚欠人民幣款項數額（人民幣 300 元）。當收到交易通結算參與者的人民幣付款數額（人民幣 300 元）後，結算公司將完成該交易通最終外匯數額的交收，而參與者將只會於 T+3 日早上（以 T+2 日計價）從結算公司收到相應的港元付款數額（港元 348 元）。

#### 12A.4.7 未能交收的交易通最終外匯數額或其他外匯款項數額

當交易通結算參與者未能交收關於交易通外匯交易的任何交易通最終外匯數額、交易通外匯數額或款項數額時，將按照12A.8節執行。

#### 12A.5 為交易通股份加上及解除標記

##### 12A.5.1 加上及解除標記的準則

根據一般規則第 12A01 (v) 條及第 12A09 條的規定，在交易通支援下購入的交易通股份會因而加上標記、存放在交易通戶口、及在轉移到其他股份戶口及從中央結算系統中提取實物股票時受到限制。除非結算公司接受其股份轉出要求、或由於其他原因而根據一般規則批准，否則交易通參與者如打算出售交易通標記股份，必須通過使用交易通，並接受以港元作為出售該交易通股份之所得。交易通標記股份經交易通出售，有關標記會因此被解除。

##### 12A.5.2 交易通戶口

每個交易通中央結算系統參與者會獲編配一個交易通主要戶口及一個交易通獨立戶口，以作持有交易通標記股份之用。

##### 12A.5.3 確定應被加上或解除標記的交易通股份數量

對交易通結算參與者而言，就交易通結算參與者須於T+2日交收的交易通聯交所買賣，每隻交易通股份應被加上或解除標記的股份數量，將根據以下程序確定：

- (i) 匯總有關交易日生效的所有交易通買入聯交所買賣的股份數量；
- (ii) 匯總於同一交易日生效的所有交易通賣出聯交所買賣的股份數量；及
- (iii) 抵銷上述 (i) 及 (ii) 段所得到的股份數量，以得出一個淨收取股份數額，或一個淨交付股份數額（「交易通股份數額」）。

關於交易通結算參與者須於T+2日交收的每隻交易通股份，根據上述程序得出的淨收取股份數額的股份數量將被加上標記，及根據上述程序得出的淨交付股份數額的股份數量將被解除標記。

##### 12A.5.4 為交易通股份加上標記

- (i) 須受標記限制的股份，必須在有關的交易通聯交所買賣於 T+2 日交收後被加上標記。因此，在每個交收日，交易通結算參與者必須在最後多批交收

處理程序完成前，按照第 12A.5.3 節的計算，使有關數量的股份被加上標記或為其進行標記。否則，標記將由結算公司按照第 12A.5.4 (iii) 節執行。

- (ii) 交易通結算參與者須使用戶口轉移指示，將有關數量的股份，從他們的其他股份戶口（抵押股份統制戶口除外）轉移到交易通戶口，從而為有關股份加上標記。交易通結算參與者不應將任何無須加上標記的合資格證券轉移到其交易通戶口。
- (iii) 倘若在交收日的最後多批交收處理程序完成後，交易通結算參與者尚未按照第 12A.5.4 (i) 節的規定進行標記，或為有關數量的股份加上標記，結算公司會在無須預先通知或無須取得參與者的預先同意下，自行進行標記；結算公司會從參與者的股份結算戶口中記除有關數量的股份（記除的數量或代表須標記但仍未標記的股份數量餘額），及記存相同數量的股份到參與者的交易通主要戶口中。各交易通中央結算系統參與者須確認及承認，結算公司已獲授權，按本節規定從參與者的股份結算戶口及交易通主要戶口之間轉入及轉出股份，以進行標記。倘若結算公司有必要根據本節所述進行標記，結算公司通常會在以下時間進行：
  - (a) 在 T+2 日的最後多批交收處理程序完成後，即通常在大約下午四時十五分；及
  - (b) 隨著按照第 14.4.3 節指定銀行的第二輪輸入直接記除指示付款確認的時段結束，而被凍結證券的限制得以解除後，也就是通常在晚上大約八時三十分。
- (iv) 當第 12A.5.4 (iii) 節適用及結算公司須要為交易通結算參與者加上標記時，參與者有責任確保在為股份加上標記的特定進行時間前，在其股份結算戶口有足夠數量的有關交易通股份，以便結算公司完成為有關數量的股份加上標記。倘若根據第 12A.5.4 (iii) 節，為交易通結算參與者加上標記時，結算公司發現交易通結算參與者的股份結算戶口中並沒有足夠的股份數量（「**股份不足之數**」），而導致為相關數量的交易通股份加上標記的行動未能全數完成，則下列規定將適用。

倘若參與者就同一交易通股份，有未交收的待收在持續淨額交收制度下的股份數額，而未交收股份數量不少於股份不足之數，則結算公司將在交收有關的待收在持續淨額交收制度下的股份數額後，才由交易通結算參與者的股份結算戶口，轉移相等於股份不足之數的股份數量到交易通主要戶口；否則，交易通結算參與者須於 T+3 日結束前，轉移相等於股份不足之數的股份數量，到其交易通主要戶口或交易通獨立戶口。倘若參與者在 T+3 日結束前並未轉移股份到其交易通戶口，或轉移股份的數量不足的話，結算公司有權在其認為合適時收取特別手續費，及與參與者就相關交

易通外匯數額的股份不足之數，進行一項相反方向的外匯兌換交易，或採取其他行動，並在此情況下，參與者須負責支付、償還及賠償因其失誤而導致結算公司產生的所有成本、費用、開支、損失及賠償金。

- (v) 交易通確認報告將提供：須被加上標記限制的股份數量和相應的在持續淨額交收制度下的款項及股份數額的資料，以供交易通中央結算系統參與者作參考之用。

#### **12A.5.5 為股份權益加上標記**

根據第8.8節所述，從交易通標記股份產生的股份權益（如紅股及以股代息）將被記存到交易通中央結算系統參與者的股份權益戶口。交易通中央結算系統參與者若打算維持該權益在其交易通戶口，可以提交按照規定格式的書面指示予結算公司，要求結算公司將有關股份從股份權益戶口轉移到交易通戶口。為免產生疑問，產生自交易通標記股份的股份權益一旦被轉移到交易通戶口，該等股份將會被加上標記及受到載於一般規則第12A09條及第12A.5.1節的同樣限制。

#### **12A.5.6 交易通標記股份的解除標記**

經交易通出售交易通標記股份，將導致其標記被解除。此外，交易通中央結算系統參與者亦可透過提交股份轉出要求，以解除交易通標記股份的標記。本12A.5.6節列明經出售交易通標記股份而解除標記所涉及的程序；第12A.6.1節則列明經提交股份轉出要求以解除交易通標記股份的標記所涉及的程序。

出售交易通標記股份而導致的解除標記行動會由結算公司執行。各交易通中央結算系統參與者須確認及承認，結算公司已獲授權按本節所述，從其交易通主要戶口中轉出股份到其股份結算戶口，以解除標記。

交易通結算參與者有責任確保在最後多批交收處理程序前的最少十五分鐘，有足夠數量的相關交易通股份在其交易通主要戶口，以便結算公司能完成解除標記。

倘若，當結算公司根據第12A.5.6節執行解除標記行動時，發現交易通結算參與者的交易通主要戶口中沒有足夠的相關股份數量，因而解除標記行動未能全數完成，此將導致參與者無法根據第12A.3.5(iii)節以人民幣交收其交易通最終外匯數額，在這情況下，將按照第12A.8.1節執行。

解除標記程序的簡要說明如下：

- (i) 在 T+2 日每次執行多批交收處理程序之前的十五分鐘，及最後多批交收處理程序完成後（即通常在大約下午四時十五分），結算公司將根據第12A.5.3節規定所計算的交易通結算參與者的淨交付交易通股份數額，並在受以下第12A.5.6節所規限的情況下，從交易通結算參與者的交易通主要戶

口，轉出相關數量的股份到參與者的股份結算戶口，以便為應被解除標記的相關股份數量解除標記。

(ii) 在進行解除標記時，結算公司可考慮交易通結算參與者，被指定在 T+2 日下午外匯交收時間或之前交收的交易通最終外匯數額的款項數額，以決定在不同時間應被解除標記的股份數量：

(a) 倘若參與者根據第 12A.3.5 (ii) 節的規定被指定在 T+2 日的下午外匯交收時間或之前交收的款項數額，沒有任何尚欠款項數額，而參與者的交易通主要戶口中有足夠數量的股份能作解除標記之用，結算公司將由參與者的交易通主要戶口，轉移全數應被解除標記的相關股份，到參與者的股份結算戶口。

(b) 倘若參與者根據第 12A.3.5 (ii) 節的規定被指定在 T+2 日的下午外匯交收時間或之前交收的款項數額，仍有尚欠款項數額：

(1) 而參與者的交易通主要戶口有足夠相關數量的股份可供轉移作解除標記之用，結算公司將由參與者的交易通主要戶口，轉移等同於相應的在持續淨額交收制度下的應付股份數額（如有）的相關數量的股份，到參與者的股份結算戶口；及

(2) 還未被解除標記的股份，如其股份數額多於相應的在持續淨額交收制度下的應付股份數額（如有），結算公司將只會在收到參與者全數在 T+2 日交收的人民幣款項數額後，才把多出的有關股份數量，從交易通結算參與者的交易通主要戶口，轉移到參與者的股份結算戶口。

## **12A.6 股份轉出要求及股份轉出外匯交易**

### **12A.6.1 提交股份轉出要求及為交易通標記股份解除標記**

根據一般規則第12A12條的規定，倘若交易通中央結算系統參與者打算在不出售交易通標記股份的情況下，解除其標記或其受到一般規則第12A09條和第12A.5.1節所訂下的限制，該參與者可在任何辦公日，透過中央結算系統終端機輸入及授權「股份轉出要求」，或以任何其他結算公司不時規定的方法，從其交易通戶口進行賬面轉移，把相關數量的交易通標記股份，轉移到任何其他股份戶口（抵押股份統制戶口及附寄結單服務的股份獨立戶口除外）。

除非結算公司另有決定，結算公司將在核實股份轉出要求後，透過中央結算系統通知參與者，其股份轉出要求已被接受。除非結算公司相信交易通中央結算系統參與者的指定交易通戶口內，已有足夠數量的相關股份供解除股份標記之用，否

則將不會接受其股份轉出要求。

交易通中央結算系統參與者的股份轉出要求活動，及股份轉出外匯交易的詳細情況，將會透過交易通外匯交易／股份轉出活動／狀況報告，及交易通確認報告提供予參與者。參與者可通過中央結算系統終端機和／或參與者網間連接器取得該等報告。

結算公司會就已接受的股份轉出要求而解除股份標記。在結算公司接受股份轉出要求後，結算公司將透過從交易通中央結算系統參與者的指定交易通戶口，轉移相關數量的股份，到參與者的其他指定股份戶口，而使股份轉出要求中所指定數量的股份得以解除標記。各交易通中央結算系統參與者須確認及承認，結算公司已獲授權如在本節中所敘述，由參與者的指定交易通戶口，轉出股份到參與者的其他指定股份戶口，以解除標記。

交易通中央結算系統參與者在辦公日提交的任何股份轉出要求，若在該辦公日停止辦公時仍維持在「等待狀態」，則該要求在同日終結時會被自動從中央結算系統中剔除。

#### **12A.6.2 股份轉出外匯交易**

當結算公司接受股份轉出要求後，中央結算系統將會自動產生股份轉出外匯交易。

根據一般規則第12A12條的規定，交易通中央結算系統參與者就股份轉出外匯交易，會被視為已同意在股份轉出要求被接受後的第二個交收日，向結算公司支付相等於交易通標記股份（為相應股份轉出要求的主體）總市值的人民幣，而其計算是根據提交股份轉出要求的前一個交易日，聯交所記錄上該交易通股份的收市價而定。

受制於相關的交易通夥伴銀行能否提供有關的港元資金，及假設交易通沒有被暫停或停止運作而可提供外匯兌換服務，在參與者支付人民幣數額後，結算公司會在同一交收日將相當於該人民幣數額的港元數額記存到參與者相關的指定銀行戶口，以交收股份轉出外匯交易。其參考的兌換率如下：

- (i) 當股份轉出要求在交易日正午十二時或之前被結算公司接受，適用的兌換率應是結算公司在同一交易日大約下午十二時四十五分公佈的人民幣買入最終匯率；及
- (ii) 當股份轉出要求在交易日正午十二時後被結算公司接受，適用的兌換率應是結算公司在同一交易日大約下午四時四十五分公佈的人民幣買入最終匯率。

### 12A.6.3 股份轉出外匯交易的交收

本節列出股份轉出外匯交易的交收程序，及可使用的交收方法。在本節中提及的「交收日期」是指結算公司已接受有關的股份轉出要求後的第二個交收日。

- (i) 在交收日的大約上午八時，結算公司將匯總 (a) 就交易通中央結算參與者而言，其交易通股份的所有股份轉出外匯交易所產生的人民幣款項數額，及 (b) 就結算公司而言，其相同的股份轉出外匯交易所產生的相應款項數額。按第 12A.6.2 節的規定，該等數額於當天到期交收。結算公司將同時為參與者發出單一合併的人民幣款項數額及相關付款指示（「交易通付款指示」）及為結算公司產生單一合併的港元款項數額；
- (ii) 倘若參與者已按照第 12A.4.1 (i) (a) 節的規定，設定交易通付款預設指示，並以「票據交換所自動轉賬系統」為付款方法，在發出如上文 (i) 段所指的交易通付款指示後，結算公司將發出票據交換所自動轉賬系統付款指示至參與者的指定銀行，並要求其為參與者付款；
- (iii) 交易通結算參與者必須在結算日不遲於下午三時，或結算公司不時規定的其他時間內，自行或確保其指定銀行，透過繳款或把同日可用的人民幣資金，轉賬到結算公司指定的銀行，以交收交易通付款指示；
- (iv) 在交收日，當結算公司全數收到交易通中央結算系統參與者相應的應付人民幣款項後，將在同一交收日透過記存相應的港元付款數額到參與者的款項記賬，以交收如上文 (i) 段所指的合併的港元款項數額。

### 12A.6.4 未能交收股份轉出外匯交易

當交易通中央結算系統參與者未能根據上述第 12A.6.3 (i) 節的規定，在交收日下午三時或之前交收其合併的人民幣款項數額時，結算公司有權與交易通夥伴銀行訂立一項或多項相反方向的外匯交易，以降低或儘量減少其對交易通夥伴銀行的背對背外匯風險，或採取其他行動。倘若結算公司訂立該等外匯交易，及一般而言交易通中央結算系統參與者未能按本節交收其人民幣款項數額，參與者須負責支付、償還及賠償因其失誤而導致結算公司產生的所有成本、費用、開支、損失及賠償金。此外，交易通中央結算系統參與者也可能須要繳付特別手續費（如適用）。

## 12A.7 交易通聯交所買賣的修訂及交易通外匯交易的調整

### 12A.7.1 買賣的修訂及調整

當買賣的修訂根據聯交所規則第 528 條獲得批准，或當交易通聯交所買賣被結算公司根據一般規則第 901 (ii) 條劃分，結算公司有權採取其認為必要的行動，

以調整、修改或逆轉受影響的交易通聯交所買賣的相應交易通外匯交易（「原交易通外匯交易」）。這些行動可能包括結算公司與參與者，就需要調整的相應人民幣或港元數額訂立任何外匯交易（「修訂外匯交易」），及就每個個案與交易通夥伴銀行，以結算公司認為合適的匯率，訂立一項背對背外匯交易；為免產生疑問，儘管訂立了修訂外匯交易，但原交易通外匯交易將繼續被結算公司視為有效和生效的。

倘若訂立了修訂外匯交易，交易通結算參與者須在應交收原交易通外匯交易的交收日同日，交收該交易。有關任何修訂外匯交易，或任何其他交易通外匯交易的修訂或調整的詳情，將會透過獨立報告提供予參與者。

### **12A.7.2 結算公司的權力**

當結算公司根據第 12A.7.1 節的規定行使其權力時，交易通中央結算參與者須負責支付和償還因此而導致結算公司承擔的所有成本、費用及開支；並賠償結算公司所有（無論直接或間接）因為訂立任何修訂外匯交易或背對背外匯交易、或結算公司採取任何行動，而對結算公司產生的這些成本、費用、開支及對結算公司造成的損失。

### **12A.8 未能交收款項數額**

#### **12A.8.1 結算公司的權力**

倘若交易通結算參與者未能於 T+2 日交收交易通外匯數額、交易通最終外匯數額、或與任何交易通外匯交易有關的任何其他款項數額，在結算公司的任何權力不受影響或限制、及不影響規則的任何其他規定的情況下（包括失責條款），結算公司有權採取任何或所有下列的行動：

- (i) 視乎情況而定，結算公司有權不交收任何港元或人民幣的相應款項數額。在這種情況下並視乎是否合適，有關參與者有責任取得所需相應貨幣的資金，以交收相關的交易通聯交所買賣；
- (ii) 結算公司可採取其認為必須的行動，以調整、修訂或逆轉（全部或部份）任何有關該參與者未能交收的交易通外匯交易。這些行動可能包括結算公司與參與者訂立任何外匯交易（「修訂外匯交易」），及就每個個案與交易通夥伴銀行，以結算公司認為合適的匯率，訂立一項背對背外匯交易；  
及
- (iii) 當結算公司可在其認為合適時，向參與者收取特別手續費；

此外，結算公司有權在下列特別情況下採取額外行動：



- (a) 當交易通結算參與者未能按照第 12A.5.6 節的規定，提供足夠股份以作解除標記之用，因而導致參與者未能在有關交收日的指定交收時間，全數交收相應的持續淨額交收股份數額及相應的款項數額；而所涉及的款項數額為參與者按照第 12A.3.4 (iv) (b) 節或第 12A.3.4 (iv) (c) (1) 節所規定的人民幣付款。結算公司有權不接受全部或只收取部分第 12A.4.4 節所指的人民幣可用數額，及把相應的款項數額視作為尚欠及未交收的；及
- (b) 當交易通結算參與者未能全數交收任何交易通最終外匯數額，儘管發生此失誤，結算公司仍有權當作該交易通最終外匯數額已全數交收一樣，根據第 12A.5.4 節的規定為按照第 12A.5.3 節計算的相應數量的股份，透過股份轉移進行或繼續進行加上標記的行動。在這情況下，交易通參與者將被視為已授權和接受該等轉移。

當結算公司根據第 12A.8 節的規定採取任何行動，該參與者須負責支付和償還，因參與者失誤或結算公司因採取任何上述行動而（無論直接或間接）承擔的成本、費用、開支，並賠償結算公司所有這些成本、費用、開支及對結算公司造成的損失。

#### **12A.9 風險管理：抵押品**

作為交易通的營運者，結算公司可以收取現金形式的抵押品，以用作保證參與者履行其在交易通外匯交易或股份轉出外匯交易的責任和負債，或用作履行該等責任和負債。結算公司將不時決定所須要提供的抵押品的數量。

結算公司將以書面形式通知交易通中央結算系統參與者，其須要提供的抵押品數量，而該參與者必須在指定的時間內提供該抵押品。

結算公司將在其認為合適的時間，歸還交易通中央結算系統參與者提供的抵押品。

結算公司可全權酌情，以其不時決定的利率計算，對交易通中央結算系統參與者提供的抵押品派發利息。結算公司保留從派發的利息中扣除行政費用的權力。

### **第十三節**

#### **證券交收**

##### **13.1 緒言**

##### **13.1.2 用作交收的股份戶口**

倘若非投資者戶口持有人的參與者透過輸入交付指示進行交收，其股份結算戶口便不能用以在中央結算系統進行交收。在此情況下，參與者可指定其任何股份戶口（不包括抵押股份統制戶口，及倘若該參與者同時也是交易通中央結算系統參與

者，其交易通戶口亦不包括在內）作為記除合資格證券的股份戶口。參與者也可就某宗「交收指示的交易」指定記除或記存合資格證券的股份戶口（抵押股份統制戶口除外）。

## 第十四節

### 款項交收

#### 14.1 款項交收服務的範圍

##### 14.1.2 結算公司的角色

就中央結算系統的款項交收而言，結算公司擔當兩個不同的角色：

- (i) 就(a)結算公司及參與者間的應收或應付款項（例如：在持續淨額交收制度下或有關代理人或投標服務等）及(b)結算公司（以交易通營運者的身份）及交易通中央結算參與者間的應收或應付款項（例如：有關交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的交收）而言，結算公司作為對手方；
- (ii) 就參與者以貨銀對付或即時貨銀對付的方式在逐項交收中進行交收所應付或應收的款項而言，結算公司為促成者；
- (iii) 就參與者及發行人之間所支付和退還有關電子認購新股指示或投標指示的認購款項或投標款項而言，結算公司為促成者；及
- (iv) 結算參與者或託管商參與者按貨銀對付方式根據STI轉移向其股份獨立戶口結單收件人付款而言，結算公司為促成者。

#### 14.3 結算公司向指定銀行發出的指示

##### 14.3.7 外匯兌換服務產生的款項

在第12A.4節和第12A.6節已解釋就交易通外匯交易及股份轉出外匯交易，須要在交易通中央結算系統參與者的指定銀行賬戶中記除及記存的港元或人民幣款項。簡而言之，

- (i) 就交易通外匯交易，結算公司會向交易通結算參與者的指定銀行，發出直接記除指示、直接記存指示及／或票據交換所自動轉帳系統付款指示，以交收結算公司根據第12A.3.5節所定出參與者在每一交收日的交易通最終外匯數額；及
- (ii) 就股份轉出外匯交易，結算公司會向交易通中央結算系統參與者的指定銀行，發出直接記存指示及票據交換所自動轉帳系統付款指示，以交收結算公司根據第12A.6.3(i)節所定出參與者應付或應收的總數額。

## 14.4 直接記除指示及直接記存指示

### 14.4.1 用途

直接記除指示／直接記存指示乃用於進行結算公司和參與者之間因下列各項導致的款項交收：(i)與結算參與者交收由聯交所買賣及「結算機構的交易」所產生的持續淨額交收股份數額；(ii)結算參與者就持續淨額交收股份數額所提供的差額繳款及抵押品；(iii)結算參與者的保證基金供款；(iv)依據第14.3.4節結算公司提供代理人服務的款項交易；(v)依據第14.3.7節結算公司作為交易通營者而提供外匯兌換服務有關的款項交易；(vi)投資者戶口持有人應付的中央結算系統服務費用及開支（見第14.3.5節）；及(vii)結算公司可要求參與者付款或結算公司應付款予參與者的其他事項。

## 14.7 票據交換所自動轉賬系統付款指示

### 14.7.2 程序

下列為有關結算公司發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示的程序簡述：

- (iiia) 就已授權結算公司透過票據交換所自動轉賬系統付款指示收取付款的每名交易通中央結算系統參與者，結算公司（作為交易通營運者）在每個交收日，會就其交易通外匯交易及／或股份轉出外匯交易，向其指定的銀行發出票據交換所自動轉賬系統付款指示。該票據交換所自動轉賬系統付款指示將包括：交易通中央結算系統參與者的有關款項金額、銀行帳戶及其他資料；
- (iv) 結算公司所發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示，是透過中央結算系統終端機傳送至付款方參與者的指定銀行。付款方參與者的指定銀行可於每個辦公日內的五四個指定時間透過中央結算系統終端機或參與者網間連接器檢索「電子票據交換所自動轉賬系統付款指示報告」，並須盡力於當日就有關每項中央結算系統交易所定下的限期前完成其付款程序，必須根據票據交換所自動轉賬系統處理程序視窗關閉前（即下午三時三十分前）進行票據交換所自動轉賬系統的付款程序；
- (vii) 倘若有關合資格貨幣的銀行公會票據交換所未能於每個辦公日中央結算系統即時款項交收的指定時限（有關代理人服務的款項，一般為下午一時；有關交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的付款，一般為下午三時；有關交收指示／投資者交收指示交易及其他與中央結算的款項，一般為下午三時三十分）前確認已交收有關的款項，結算公司將 i) 不會執行或處理或交收有關的中央結算系統交易，ii) 就交易通外匯交易或股份轉出外匯交易，根據第12A.6節及第12A.8節，採取其認為必須的行動，以調整、修改或逆轉該等外匯交易，或iii) 就交收指示／投資者交收指示交易而言，解除對被扣存證券的限制，以便交付方參與者使用該等證券進行其他的交收用途（如適用者）；

- (viii) 若有關款項在每個辦公日中央結算規定對即時款項結算的時限後的任何時間，被中央結算確認及證實已交收有關的款項予結算公司之銀行戶口內(指除交收指示/投資者交收指示以外的中央結算系統交易)，結算公司將會安排在同一辦公日內經直接記存指示將有關款項退回予有關的參與者；及

### 14.7.3 未能或延誤履行付款責任

付方參與者有責任確保其指定銀行對有關就中央結算系統交易所發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示作出相應行動及在結算公司不時定下的期限前完成有關款項交收。

就未能履行或延誤有關即日差額繳款的款項交收責任時，結算公司有可能在認為適當並符合中央結算系統一般規則的情況下，向有關參與者就該等失責行為或其他行為採取行動。

就未能履行或延誤有關交易通中央結算系統參與者的交易通最終外匯數額，或股份轉出外匯交易的付款責任時，結算公司作為交易通營運者，有可能在認為適當並符合規則的情況下，向有關交易通中央結算系統參與者就該等失責行為或其他行為採取行動。

### 14.7.4 票據交換所自動轉賬系統付款指示的服務時間

票據交換所自動轉賬系統付款指示的設施會於每一辦公日上午九時三十分至下午三時三十分提供服務。結算公司會於下列時間透過中央結算系統終端機或參與者網間連接器向付款方參與者的指定銀行發出「電子票據交換所自動轉賬系統付款指示報告」：上午九時三十分（之後）、上午十時三十分（之後）、上午十一時（之後）、中午十二時（之後）及下午二時（之後）。

## 第十五節

### 查詢服務

### 15.2 多種查詢功能的運用

下列為可提供使用的各種查詢功能以及使用這些功能的目的：

- (i) 為非投資者戶口持有人的參與者提供的查詢功能：
- (ah) 「查詢預先繳付現金/交易通付款預設指示」功能：查詢結算參與者所輸入的預先繳付現金預設指示及/或交易通付款預設指示預設指示的狀況和詳情；
- (ia) 為交易通中央結算系統參與者提供的查詢功能：
- (a) 「查詢股份轉出要求」功能：查詢關於當辦公日和前一辦公日的股份轉出要求的詳情（包括相應的股份轉出外匯交易的資料）；及

(b) 「查詢交易通付款指示」功能：查詢交易通中央結算系統參與者，根據第12A4.1節所指的交易通付款指示的詳情；

## 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
CSECP03	預先繳付現金／ <u>交易通付款</u> ／即日付款指示修訂稽核報告	每日	由報告檢索功能可供使用的時間起（上一日預先繳付現金、 <u>交易通付款</u> 及即日付款預設指示的修訂活動）
CFIBI01	補購通知書	每日	下午五時之後（由結算公司於下一個交易日進行的補購及上一個交易日已進行的補購）
<u>CSETF03</u>	<u>交易通外匯交易／股份轉出活動／狀況報告</u>	<u>每日</u>	<u>由報告檢索功能可供使用的時間起（上一交易日的(i)股份轉出要求修訂活動；及(ii)交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的交收狀況）</u>
<u>CSETF07</u>	<u>交易通確認報告</u>	<u>每日</u>	<u>約下午六時（(i)該交易日的交易通外匯交易及股份轉出要求；(ii)前一交易日的交易通外匯數額及股份轉出外匯交易；(iii)交易通中央結算系統參與者應被標記及解除標記的交易通股份數量摘要；及(iv)適用的外匯兌換匯率）</u>

#### 16.7 為指定銀行提供的報告及報表

報告編號	報告名稱	發出頻次	提供時間
CSEPI03	電子票據交換所自動轉賬系統付款指示報告	每日 <u>四</u> 次	<u>上午九時三十分之後（截至報告產生時已發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示）</u> 、上午十時三十分之後（首次多批交收處理程序完成後已發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示）、上午十一時之後（截至報告產生時已發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示）、中午十二時及下午二時之後（第二次及第三次多批交收處理程序完成後已發出的票據交換所自動轉賬系統付款指示）

## 第十七節

### 暫停服務

#### 17.2 颱風

##### 17.2.6a 交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的交收

有關交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的結算和交收，在颱風的情況下所採取的步驟，與聯交所買賣有關的步驟大致一致。倘若八號或以上颱風訊號於辦公日上午九時之前懸掛，至中午十二時仍未卸下，就決定交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的交收日期，則該日不得視作交收日。否則，該日仍得視作為交收日，儘管該日事實上有部分時間受颱風所影響。

如根據上文所述，某日不被視為交收日，有關根據第12A.4節交易通最終外匯數額的交收、根據第12A.5節為交易通股份加上或解除標記、根據第12A.6節股份轉出外匯交易的交收、及香港結算就失責而會採取的任何措施，或會相應推延。

##### 17.2.10 款項交收服務

對於預先繳付現金，倘若八號或以上颱風訊號於辦公日上午八時至上午九時期間懸掛，並在中午十二時仍未卸下，則結算公司不會處理結算參與者在該日上午八時至上午九時期間輸入的預先繳付現金指示或預先繳付現金預設指示，結算參與者須在「預先繳付現金指示」及「預先繳付現金／交易通付款預設指示」修訂功能恢復後重新輸入其預先繳付現金指示及預先繳付現金預設指示。倘若結算參與者並沒有重新輸入其預先繳付現金指示或預先繳付現金預設指示，結算公司在收到結算參與者附有付款證明的書面退款要求後，將退還該等已收到的預先繳付現金（不包括利息）予結算參與者。

對於即日付款預設指示，倘若八號或以上颱風訊號於辦公日上午八時至上午九時期間懸掛，並在中午十二時仍未卸下，則結算公司不會處理非投資者戶口持有人的參與者已在該日上午八時至上午九時期間輸入的即日付款預設指示，參與者須在「即日付款預設指示」修訂功能恢復後重新輸入其即日付款預設指示。倘若參與者並沒有重新輸入其即日付款預設指示，結算公司將(i)若中央結算系統內仍存有結算公司在上述的即日付款預設指示不獲處理輸入時間之前已接納的即日付款預設指示，將在其後的每個辦公日根據中央結算系統內該已為結算公司所接納的即日付款預設指示發出即日付款指示；或(ii)若中央結算系統內並無結算公司在上述的即日付款預設指示不獲處理輸入時間之前已接納的即日付款預設指示，則將在其後的每個辦公日不遲於該日結束時透過直接記存指示退回任何即日付款予參與者。

對於代理人款項（傍晚）預設指示，倘若八號或以上颱風訊號於辦公日上午八時至上午九時期間懸掛，並在中午十二時仍未卸下，則結算公司不會處理非投資者戶口持有人的參與者已在該日上午八時至上午九時期間輸入的代理人款項（傍晚）預設指示，參與者須在「代理人款項（傍晚）預設指示」修訂功能恢復後重新輸入其代理人款項（傍晚）預設指示。倘若參與者的代理人款項（傍晚）預設指示已根據前

述狀況不予以處理，及沒有重新輸入其代理人款項（傍晚）預設指示，結算公司將 (i) 若中央結算系統內仍存有結算公司在上述的代理人款項（傍晚）預設指示不獲處理輸入時間之前已接納的代理人款項（傍晚）預設指示，將在其後的每個辦公日不遲於當日結束時的傍晚，根據中央結算系統內已接納的代理人款項（傍晚）預設指示透過直接記存指示發放現金款項；或 (ii) 若中央結算系統內並無結算公司在上述的代理人款項（傍晚）預設指示不獲處理輸入時間之前已接納的代理人款項（傍晚）預設指示，則將在其後的每個辦公日完結時前透過直接記存指示發放現金款項。

對於交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的付款，倘若八號或以上颱風訊號在辦公日上午八時至上午九時期間懸掛，並在中午十二時仍未卸下，則結算公司不會處理交易通中央結算系統參與者在該日上午八時至上午九時期間輸入及／或授權的任何交易通付款預設指示，交易通中央結算系統參與者須在「預先繳付現金／交易通付款預設指示」修訂功能恢復後，重新輸入及授權其交易通付款預設指示。

為免產生疑問，倘若八號或以上颱風訊號於辦公日下午三時之前懸掛，而交易通中央結算系統參與者因此未能交付交易通外匯交易或股份轉出外匯交易的任何款項，該參與者將不會被視作第12A.6.4節及第12A.8節所指的未能交收任何款項數額的失誤。同樣地，倘若八號或以上颱風訊號於辦公日下午三時之前懸掛，而交易通中央結算系統參與者因此未能履行任何標記或解除標記的責任，該參與者將不會被視作第12A.5.4節所指的未能轉移足夠股份數量至有關交易通戶口的失誤。

## 17.3 暴雨

### 17.3.6a 交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的交收

有關交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的結算和交收，在暴雨時的情況下所採取的步驟，與聯交所買賣（包括交易通聯交所買賣）有關的步驟大致一致。倘若黑色暴雨警告於辦公日上午九時之前懸掛，至中午十二時仍未卸下，就決定交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的交收日期，則該日不得視作交收日。否則，該日仍得視作為交收日。

若某日按上文所述不被視為交收日，有關根據第12A.4節交易通最終外匯數額的交收、根據第12A.5節為交易通股份加上或解除標記、根據第12A.6節股份轉出外匯交易的交收、及香港結算就失責而會採取的任何措施，或會相應推延。

### 17.3.10 款項交收服務

就預先繳付現金而言，倘若黑色暴雨警告於辦公日上午八時至上午九時期間發出並延至中午十二時之後取消，則結算公司不會處理結算參與者已在該日上午八時至上午九時期間輸入的預先繳付現金指示或預先繳付現金預設指示，結算參與者須在「預先繳付現金指示」及「預先繳付現金／交易通付款預設指示」修訂功能恢復後重新輸入其預先繳付現金指示及預先繳付現金預設指示。倘若結算參與者並沒有重新輸入其預先繳付現金指示或預先繳付現金預設指示，結算公司在收到結算參與者

附有付款證明的書面退款要求後，將退還該等已收到的預先繳付現金（不包括利息）予結算參與者。

就即日付款預設指示而言，倘若黑色暴雨警告於辦公日上午八時至上午九時期間發出並延至中午十二時之後取消，則結算公司不會理會非投資者戶口持有人的參與者已在該日上午八時至上午九時期間輸入的即日付款預設指示，參與者須在「即日付款預設指示」修訂功能恢復後重新輸入其即日付款預設指示。倘若參與者並沒有重新輸入其即日付款預設指示，結算公司將 (i) 若中央結算系統內仍存有結算公司在上述的即日付款預設指示不獲理會輸入時間之前已接納的即日付款預設指示，將在其後的每個辦公日根據中央結算系統內已為結算公司已接納的即日付款預設指示發出即日付款指示；或(ii) 若中央結算系統內並無結算公司在上述的即日付款預設指示不獲理會輸入時間之前所接納的即日付款預設指示，則將在其後的每個辦公日不遲於該日結束時透過直接記存指示退回任何即日付款予參與者。

對於代理人款項（傍晚）預設指示，倘若黑色暴雨警告於辦公日上午八時至上午九時期間懸掛，並延至中午十二時之後取消，則結算公司不會處理非投資者戶口持有人的參與者已在該日上午八時至上午九時期間輸入的代理人款項（傍晚）預設指示，參與者須在「代理人款項（傍晚）預設指示」修訂功能恢復後重新輸入其代理人款項（傍晚）預設指示。倘若參與者的代理人款項（傍晚）預設指示已根據前述狀況不予以處理，及沒有重新輸入其代理人款項（傍晚）預設指示，結算公司將 (i) 若中央結算系統內仍存有結算公司在上述的代理人款項（傍晚）預設指示不獲處理輸入時間之前已接納的代理人款項（傍晚）預設指示，將在其後的每個辦公日不遲於當日結束時的傍晚，根據中央結算系統內已接納的代理人款項（傍晚）預設指示透過直接記存指示發放現金款項；或 (ii) 若中央結算系統內並無結算公司在上述的代理人款項（傍晚）預設指示不獲處理輸入時間之前已接納的代理人款項（傍晚）預設指示，則將在其後的每個辦公日完結時前透過直接記存指示發放現金款項。

就交易通外匯交易及股份轉出外匯交易的付款而言，倘若黑色暴雨警告於辦公日上午八時至上午九時期間發出，並延至中午十二時之後取消，則結算公司不會處理交易通中央結算系統參與者在該日上午八時至上午九時期間已輸入及授權的交易通付款預設指示，交易通中央結算系統參與者須在「預先繳付現金／交易通付款預設指示」修訂功能恢復後重新輸入及授權其交易通付款預設指示。

## 第二十節

### 紀律處分

#### 20.4 不當行為

##### 20.4.1 紀律處分的理由

結算公司可就參與者已作出或被合理地相信已作出的不當行為對該參與者採取紀律處分程序。不當行為包括：



- (j) 引致結算公司遭受任何紀律處分或引致結算公司違反獲委任存管處的規則的行為；及
- (k) 未能提供由與交易結算公司、結算公司或聯交所簽訂了資料共用安排或協議的交易所、結算所、監管權力或機構要求的資料（此不當行為不適用於投資者戶口持有人）；
- (l) 倘若參與者為共同參與者，對於任何其他認可結算所任何到期的應付款項失責，或在該等認可結算所規則下該參與者已發生失責事件；及
- (m) 倘若參與者為交易通中央結算系統參與者，而未能遵守交易通參與者登記準則、或未能符合維持其交易通中央結算系統參與者身份的條件或要求、或未能遵守一般規則第12A條、運作程序規則第12節和其他相關的運作程序規則的任合規定，或按其履行責任。

## 第二十一節

### 費用及開支

#### 21.19 交易通外匯交易的結算及交收

<u>— 交易通外匯結算費用</u>	<u>無</u>
<u>— 每位交易通結算參與者對每宗透過中央結算系統進行交收的交易通外匯交易的交易通外匯交收費用。</u>	<u>每宗交易通外匯交易收費 2 港元。</u>
<u>附註：</u>	
<u>費用於 T + 1 日記除</u>	

#### 21.20 為交易通外匯交易的交收，及為交易通股份加上標記的特別手續費

<u>於到期日未能交收交易通最終外匯數額或為交收股份轉出外匯交易而產生的交易通付款指示的特別手續費；</u>	<u>0.5% 乘以未交收數額，惟每項交收失誤的最高特別手續費為 100,000 港元。</u>
--	--

附註：

倘若未交收的數額為人民幣，該費用將按交易通最終外匯數額或股份轉出付款指示的相關的港元款項數額的港元數額計算。

費用將透過自動付款指示記除港元的方式收取。

結算公司將不時修訂此費用。

就未能按第 12A.5.4(iv) 節的規定，轉移所須數量的股份以進行交易通股份標記行動的特別手續費

附註：

費用將透過自動付款指示記除相關港元的方式收取。

結算公司將不時修訂此費用。

0.5% 乘以結算公司與失責交易通結算參與者（根據第 12A.5.4(iv)的規定）進行的外匯交易的港元款項數額，惟每項失誤的最高特別手續費為 100,000 港元。