

中央結算系統運作程序規則

定義

(a) 為便利讀者，規則內的定義茲重覆載列如下：

| | | |
|-------------------------|---|---|
| <u>「SPSA 集中管理賬號持有人」</u> | 指 | <u>獲編配 SPSA 集中管理賬號的實體，可使用已配對至 SPSA 集中管理賬號的特別獨立戶口的服務；</u> |
| <u>「SPSA 集中管理賬號」</u> | 指 | <u>根據規管配對至 SPSA 集中管理賬號的特別獨立戶口的服務使用的條款及條件（經證監會不時批准）而編配予 SPSA 集中管理賬號持有人的 6 位數投資者識別編號；</u> |
| <u>「特別獨立戶口賬號」</u> | 指 | <u>編配予特別獨立戶口的 6 位數投資者識別編號；</u> |

第二節 參與者

2.3 股份戶口及CCMS 抵押品戶口

2.3.15 特別獨立戶口

為方便結算公司進行前端監控，以確定託管商參與者或非交易所參與者的全面結算參與者的客戶在任何一個交易日可沽出的中華通證券的上限，託管商參與者或非交易所參與者的全面結算參與者須在客戶要求下，為客戶於中央結算系統設定具投資者識別編號特別獨立戶口賬號的特別獨立戶口，管理客戶的中華通證券持倉。託管商參與者或全面結算參與者須就以下事項給予結算公司不少於五個辦公日的書面通知：(i) 為客戶設定特別獨立戶口；(ii) 中央結算系統編配予該特別獨立戶口的特別獨立戶口賬號投資者識別編號；(iii) 客戶授權可代其透過相關中華交易通執行中華通證券賣盤的中華通交易所參與者詳細資料；及(iv) 任何曾通知結算公司有關特別獨立戶口的資料的變動。每名客戶可就每個特別獨立戶口授權不超過 20 名中華通交易所參與者代其執行賣盤，而託管商參與者或全面結算參與者及獲授權的中華通交易所參與者必須以結算公司不時指定的方式就每項此等授權向結算公司發出書面通知。若 SPSA 集中管理賬號持有人提出要求，可將一個或以上的特別獨立戶口配對至同一個 SPSA 集中管理賬號。在此情況下，香港結算將會無視託管商參與者或全面結算參與者提供有關任何該等特別獨立戶口的資料，而依賴由 SPSA 集中管理賬號持有人提供的資料（包括認可中華通交易所參與者的詳情）。

若在為客戶（不論是否 SPSA 集中管理賬號持有人）執行有關其特別獨立戶口中任何中華通證券的賣盤後發生特別獨立戶口未能交付，負責結算及交收該中華通證券交易的中華通結算參與者須就前端監控的緣故向結算公司提出要求調整以下各項：(i)（如適用）其可沽出餘額，(ii) 該客戶相關特別獨立戶口的可沽出餘額，及(iii)（如適用）任何其他客戶之特別獨立戶口的可沽出餘額、即客戶買入的同一中華通證券由中華通結算參與者在同一交易日負責為其結算及交收、但因特別獨立戶口未能交付而影響到向該客戶特別獨立戶口交付相關數量中華通證券。

提出此要求的情況以及提出要求的規定及程序，概以結算公司不時訂明並通知中央結算系統參與者為準。如確認已發生指稱的特別獨立戶口未能交付，而所牽涉之特別獨立戶口中的相關中華通證券數量足夠作出相關調整，結算公司將會：(i) 從特別獨立戶口未能交付所牽涉的特別獨立戶口的可沽出餘額扣除未能交付數量，(ii) 在任何其他受影響客戶的特別獨立戶口的可沽出餘額加入相關股份數量，以反映其在同一交易日買入的同一中華通

證券數額；及(iii)從特別獨立戶口未能交付的數量扣除上文(ii)所指數量後如有差額，將之加入中華通結算參與者相關股份戶口的可沽出餘額。如特別獨立戶口未能交付所牽涉的特別獨立戶口內的相關中華通證券不論任何原因已全部或部分轉出，令戶口內可供轉移的數量不足以作出相關調整，結算公司將按該特別獨立戶口所具有的數量以上述方式作調整，並可就前端監控目的，將其他獲轉移全部或部分中華通證券未能交付數量的中華通結算參與者或特別獨立戶口的可沽出餘額作出調整。

結算公司所作任何調整只就前端監控之目的對調整可沽出餘額產生影響，並只適用於下一個交易日。中華通結算參與者各個股票戶口的實際持倉或特別獨立戶口的持倉概不會被調整。

2.3.16 特別獨立戶口配對至 SPSA 集中管理賬號

若特別獨立戶口由 SPSA 集中管理賬號持有人配對至 SPSA 集中管理賬號，香港結算會將 SPSA 集中管理賬號持有人提供的有關配對資料及其任何變動通知相關託管商參與者或相關非交易所參與者的全面結算參與者。每個 SPSA 集中管理賬號每個交易日可經其出售的中華通證券上限，乃按所有配對至該 SPSA 集中管理賬號的特別獨立戶口合計（而非個別特別獨立戶口）的中華通證券可沽出餘額總數計算。每個特別獨立戶口只可配對至一個 SPSA 集中管理賬號。

為進行前端監控，香港結算會將每個交易日配對至每個 SPSA 集中管理賬號的特別獨立戶口的可沽出餘額匯總，計算出每個 SPSA 集中管理賬號的可沽出餘額，各相關的特別獨立戶口每個有關交易日的可沽出餘額將視為零。任何特別獨立戶口不再配對至 SPSA 集中管理賬號時，該特別獨立戶口的可沽出餘額即不計入 SPSA 集中管理賬號的可沽出餘額，有關特別獨立戶口本身的可沽出餘額將按上文第 2.3.15 節進行前端監控。

香港結算有權依賴 SPSA 集中管理賬號持有人呈交的配對資料並按而行事，若依賴有關配對資料或按該等配對資料行事產生任何偏差、遺漏或錯誤，香港結算概不負責。

第十 A 節

中華通證券交易—持續淨額交收制度

10A.7A 延誤交付：中華通證券可沽出餘額的調整

就中華通結算參與者在持續淨額交收制度下於到期日尚待交付的中華通證券逾期待交付股份數額，結算公司將要求聯交所從中華通結算參與者下一交易日的可沽出餘額中減去該等逾期待交付股份數額；如中華通結算參與者為全面結算參與者，則從其所有非結算參與者下一交易日的可沽出餘額中減去該等逾期待交付股份數額；但如逾期待交付股份數額是或被中華通結算參與者指稱是完全或部分因為特別獨立戶口未能交付所致，則中華通結算參與者及相關特別獨立戶口的可沽出餘額將根據第 2.3.15 節進行調整。

若有 SPSA 集中管理賬號下出現特別獨立戶口交付失敗，而 SPSA 集中管理賬號持有人未能指示相關託管商參與者或相關非交易所參與者的全面結算參與者從相關特別獨立戶口交付相關中華通證券予相關中華通結算參與者，香港結算可全權酌情，將特別獨立戶口交付失敗所牽涉的相關中華通證券的可沽出餘額或該 SPSA 集中管理賬號下所有中華通證券的可沽出餘額，在下一個交易日（或香港結算按其絕對酌情權認為合適的更長時間內）相應歸零。