

交易所規則

第一章

釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外：—

<u>午市</u>	指	<u>按規則第 501(1)條規定可於本交易所進行交易的下午時段；</u>
「持續交易時段」	指	規則第 501(1)條及(就延續交易證券而言)第 501A 條所訂的交易時段，包括早市(見規則第 501(1)條規定)、午市(見規則第 501(1)條規定)以及(就延續交易證券而言)延續早市；
<u>早市</u>	指	<u>按規則第 501(1)條規定可於本交易所進行交易的早上時段；</u>
「開市前時段」	指	根據董事會不時規定，交易日由早上 9 時正 30 分至早上 10 時早市開始 <u>始市的交易時段</u> （見規則第 501(1) 條規定）；
<u>交易時段</u>	指	<u>按規則第 501 條訂明可於本交易所進行交易的時段；</u>

第五章

交易

交易運作規則

交易時間

501. (1) 除非董事會作出其他規定，否則交易在每個週日（星期六及公眾假日除外）按下列規定時間進行，或照行政總裁經與主席及證監會諮詢後所規定的其他時間進行：—
- (a) 早市由上午九時三十分開始至中午十二時正完結；及
(b) 午市由下午一時三十分開始至下午四時正完結，惟由二〇一二年三月五日起，午市則由下午一時正開始至下午四時正完結
- | | |
|-----------|-----------------------|
| <u>早市</u> | <u>上午十時正至下午十二時三十分</u> |
| <u>午市</u> | <u>下午二時三十分至下午四時正</u> |

在聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕，將沒有午市交易。

開市前時段

- 501G. (1) 除非本交易所作出其他規定，開市前時段包括以下四個順時間序的時段：
- (i) 輸入買賣盤時段由上午九時正開始至上午九時十五分完結；
 - (ii) 對盤前時段由上午九時十五分開始至上午九時二十分完結；
 - (iii) 對盤時段由上午九時二十分開始至上午九時二十八分完結；及
 - (iv) 暫停時段由上午九時二十八分開始至上午九時三十分完結。四個時段的時間由本交易所不時訂定。

結束終端機操作

502. 除非董事會作出其他規定，否則所有終端機操作（除查詢外）將規定於：
- (a) 開市前時段的對盤時段開始時結束；
 - (b) 於早市時完結時的下午十二時三十分結束；
 - (c) 以及於午市完結時的下午四時結束；及
 - (d) 或照行政總裁經與主席及證監會諮詢後所規定的其他時間結束。

取消買賣盤

- 502A. 除非董事會作出其他規定，否則可於以同一個交易日的的午市開市前前三十分鐘取消早市的買賣盤。

交易

- 520(1). 每位賣方交易所參與者須在交易完成後十五分鐘內將沽出交易資料輸入系統中，但惟：
- (a) 在開市前時段內完成的交易不可遲於早市開始後早上十時十五分鐘輸入；
 - (b) 早市內完成的交易不可遲於早市結束時輸入下午十二時三十分；
 - (c) 午市內完成的交易則不可遲於午市結束時輸入下午四時。
- 520(2). 任何未能於交易日交易完結前記錄在系統中的交易，需於下一個交易日開市前時段的輸入買賣盤時段及對盤前時段或持續交易時段開始後的首十五分鐘內向本交易所申報，並將該交易視作為申報時交易日的交易。假如下一個交易日無論由於任何原因導致沒有持續交易時段，上述未能向本交易所申報的有關交易必須在不遲於下一個持續交易時段的首個交易時段開始後的首十五分鐘向本交易所申報，並將有關交易視作為申報時交易時段的交易。
- 520(3). 除兩邊客交易及以自動對盤達成的交易外，此規則第 520(1)條及第 520(2)條適用於所有其他交易。

520(4). 除遵守規則第 520(1)條及第 520(2)條以上規定外，賣方交易所參與者須就某一結構性產品為該結構性產品的發行人的帳戶或它的聯號的帳戶所進行的沽出交易，按董事會不時指定之形式向本交易所報告。

520(5). 不遵守規則第 520(1)條至第 520(4)條此規則的賣方交易所參與者將受到董事會的紀律處分。

覆核及反駁

523. 每位買方交易所參與者應覆核在系統中以其名義記錄的交易資料，並在發現錯誤時，立刻反駁錯誤的輸入資料；但，惟：

(a) 在開市前時段輸入系統的交易，時間須不遲於對盤時段開始時；

(b) 在早市輸入系統的交易，時間須不遲於下午十二時三十分早市完結時；及；

(c) ~~而在~~午市時段輸入系統的交易，時間須不遲於下午市完結四時。

兩邊客交易

526. (1) (a) 進行兩邊客交易的各交易所參與者有責任在開市前時段和規則第 501(1)條所指定之交易時間內在交易完成後十五分鐘內將該等交易資料輸入系統中，惟：

(i) 開市前時段內完成的交易不可遲於早市開始後十五分鐘輸入上午十時十五分；

(ii) ~~早市內~~完成的交易不可遲於早市完結時輸入下午十二時三十分；

(iii) 午市內完成的交易則不可遲於午市完結時輸入下午四時。
對於以自動對盤配對完成之交易此責任則不存在。

(b) 任何未能於交易日交易完結前記錄在系統中的交易，需於下一個交易日開市前時段的輸入買賣盤時段及對盤前時段或持續交易時段開始後的首十五分鐘內向本交易所申報，並將該交易視作為申報時交易日的交易。假如下一個交易日無論由於任何原因導致沒有持續交易時段，上述未能向本交易所申報的有關交易必須在不遲於下一個持續交易時段的首個交易時段開始後的首十五分鐘向本交易所申報，並將有關交易視作為申報時交易時段的交易。

(c) 除以上規定外，交易所參與者須就某一結構性產品為該結構性產品的發行人的帳戶或它的聯號的帳戶所進行的兩邊客交易，按董事會不時指定之形式向本交易所報告。

每日覆核買入/賣出記錄日記賬

528. (1) 各交易所參與者有責任在每段交易時間結束時覆核記賬。倘有任何差異、錯誤的交易或投訴，交易所參與者應在下個交易日早市開始後十五分鐘上午十時十五分前以董事會不時規定的格式向本交易所報告。

颱風及暴雨

571. 除董事會另有決定外，否則懸掛颱風來襲及卸下颱風減弱訊號及/或發出及取消黑色暴雨警告時的交易及交收時間安排列於下表：—

(1)	(a) <u>所有交易日(除聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕外)所有交易日香港天文台懸掛或卸下八號或更高風球的颱風來襲/颱風減弱</u> 時的交易時間安排	
(i)	若八號或更高風球於上午九時 <u>正三十分</u> 之前懸掛	<p><u>開始交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>開市前時段交易如常於上午九時正開始於上午九時三十分若八號風球在上午七時正三十分或之前卸下。</u> - <u>開市前時段交易將不進行不進行開市前時段交易若八號風球在上午七時正三十分之後卸下。</u> - <u>早市交易開始：</u> <ul style="list-style-type: none"> (iii)- <u>於上午九時三十分十時若八號風球在上午七八時三十分或之前卸下；</u> (iv)- <u>於上午十時正三十分若八號風球在上午八時正三十分或之前卸下；</u> (v)- <u>於上午十時三十分一時若八號風球在上午九八時三十分或之前卸下；</u> (vi)- <u>於上午十一時三十分若八號風球在上午九時正三十分或之前卸下。</u> - <u>早市交易將不進行若風球在上午九時正之後卸下。</u> - <u>午市交易將於下列時間開始：</u> <ul style="list-style-type: none"> (vii)- <u>二〇一二年三月五日前：於下午一時三十分若風球在上午十一時正或之前卸下；二〇一二年三月五日或之後：於下午一時正若風球在上午十一時正或之前卸下；</u> - <u>於下午一時三十分若風球在上午十一時三十分或之前卸下；或</u> - <u>於下午二時正三十分若八號風球在中午十二時正或之前卸下。</u> - <u>該日不進行交易若八號風球在中午十二時正之後卸下，該日將不進行交易。</u>

(ii)	<p>若八號或更高風球於開市前時段內懸掛</p>	<p>開市前時段的交易將會繼續，而交易安排將如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>開市前時段交易繼續進行至完結，但不會進行早市交易及延續早市交易。</u> - <u>午市交易將於下列時間開始：</u> <ul style="list-style-type: none"> - <u>二〇一二年三月五日前：於下午一時三十分若風球在上午十一時正或之前卸下；</u> - <u>二〇一二年三月五日或之後：於下午一時正若風球在上午十一時正或之前卸下；</u> - <u>於下午一時三十分若風球在上午十一時三十分或之前卸下；或</u> - <u>於下午二時正若八號風球在中午十二時正或之前卸下，午市會由下午二時三十分開始。</u> - 若八號風球在中午十二時正之後卸下，該日<u>便將</u>不進行早市交易、延續早市交易及午市交易。
(iii)	<p>若八號或更高風球於早市時間內懸掛</p>	<p>交易活動在八號或更高風球懸掛後十五分鐘停止，而交易安排將如下：</p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>交易活動在風球懸掛後十五分鐘停止，並不會進行延續早市交易。</u> - <u>午市交易將於下列時間開始：</u> <ul style="list-style-type: none"> - <u>二〇一二年三月五日前：於下午一時三十分若風球在上午十一時正或之前卸下；</u> - <u>二〇一二年三月五日或之後：於下午一時正若風球在上午十一時正或之前卸下；</u> - <u>於下午一時三十分若風球在上午十一時三十分或之前卸下；或</u> - <u>於下午二時正若風球在中午十二時正或之前卸下。</u> - 若八號風球在中午十二時或之前卸下，便不進行延續早市交易而交易會於下午二時三十分恢復。 - 若八號風球在中午十二時正之後卸下，該日<u>便將</u>不進行延續早市交易及午市交易。

(iv)	若八號或更高風球於早市結束後午市開始前懸掛（即在 <u>延續交易證券</u> 的延續早市內）	<p><u>交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - 如該日有早市交易，<u>延續早市交易</u>則交易活動會在<u>八號或更高風球</u>懸掛後十五分鐘停止<u>延續早市交易</u>，而該日將不進行午市交易。 - 如該日沒有早市交易，根據規則第 501B 條不進行延續早市交易，而該日將不進行午市交易。
(v)	若八號或更高風球於 <u>下午三時四十五分前</u> 的午市時間內懸掛	<p><u>交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - 交易活動在<u>八號或更高風球</u>懸掛後十五分鐘停止，<u>而</u>該日餘下時間不進行交易。

(1)	(aa) 聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕 <u>香港天文台懸掛及卸下八號或更高風球交易日的颱風來襲/颱風減弱時</u> 的交易時間安排	
(i)	若八號或更高風球於上午九時 <u>正三十分</u> 之前懸掛	<p><u>開始交易：交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>開市前時段交易</u>如常於上午九時正開始於上午九時三十分若<u>八號風球</u>在上午七時<u>正三十分</u>或之前卸下。 - 不進行開市前時段交易若<u>八號風球</u>在上午七時<u>正三十分</u>之後卸下。 <p><u>早市交易開始：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - 於上午<u>九時三十分</u>至<u>十時</u>若<u>八號風球</u>在上午<u>七時三十分</u>至<u>八時</u>或之前卸下； - 於上午<u>十時</u>至<u>正三十分</u>若<u>八號風球</u>在上午<u>八時</u>至<u>正三十分</u>或之前卸下；<u>或</u> - 於上午<u>十一時</u>至<u>三十分</u>若<u>八號風球</u>在上午<u>八時</u>至<u>九時三十分</u>或之前卸下；<u>或</u> (viii) 於上午<u>十一時</u>至<u>正三十分</u>若<u>八號風球</u>在上午<u>九時</u>至<u>正三十分</u>或之前卸下。 - 該日不進行交易若<u>八號風球</u>在上午九時<u>正三十分</u>之後卸下。
(ii)	若八號或更高風球於開市前時段內懸掛	<p><u>交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>開市前時段</u>的交易將會繼續<u>至完結</u>，但不進行早市交易。
(iii)	若八號或更高風球於早市時間內懸掛	<p><u>交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - 交易活動在<u>八號或更高風球</u>懸掛後十五分鐘停止，<u>而</u>該日餘下時間不進行交易。

(1)	(b) <u>所有交易日香港天文台</u> 發出/取消黑色暴雨警告時的交易時間安排	
(i)	<p>若於上午九時<u>正三十分</u>之前發出黑色暴雨警告</p>	<p><u>開始交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>開市前時段交易如常於上午九時正開始於上午九時三十分若警告在上午七時<u>正三十分</u>或之前取消。</u> - <u>不進行開市前時段交易若警告在上午七時<u>正三十分</u>之後取消。</u> - <u>早市交易開始：</u> <ul style="list-style-type: none"> <u>一於上午十時<u>九時三十分</u>若警告在上午<u>八時三十分</u>或之前取消；</u> <u>二於上午十時<u>正三十分</u>若警告在上午八時<u>正三十分</u>或之前取消；</u> <u>三於上午十一時<u>三十分</u>若警告在上午<u>八時三十分</u>或之前取消；</u> <u>四於上午十一時<u>正三十分</u>若警告在上午九時<u>正三十分</u>或之前取消</u> - <u>早市交易將不進行若警告在上午九時正之後卸下。</u> - <u>午市交易將於下列時間開始：</u> <ul style="list-style-type: none"> - <u>二〇一二年三月五日前：於下午一時三十分若警告在上午十一時正或之前卸下；</u> <u>二〇一二年三月五日或之後：於下午一時正若警告在上午十一時正或之前卸下；</u> - <u>於下午一時三十分若警告在上午十一時三十分或之前卸下；或</u> - <u>於下午二時<u>正三十分</u>若警告在中午十二時<u>正</u>或之前取消。</u> - <u>該日不進行交易若警告在中午十二時<u>正</u>之後取消</u>
(ii)	<p>若黑色暴雨警告於開市前時段、早市或午市交易時間內發出</p>	<p><u>交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - <u>若警告發出前已有交易，交易活動如常繼續進行。</u> - <u>若警告發出前並無任何交易則不會進行交易，惟若警告是在開市前時段或早市時刻內發出，則該日的午市交易將於下列時間開始：</u>

		<ul style="list-style-type: none"> - <u>二〇一二年三月五日前：於下午一時三十分若警告在上午十一時正或之前取消；二〇一二年三月五日或之後：於下午一時正若警告在上午十一時正或之前取消；</u> - <u>於下午一時三十分若警告在上午十一時三十分或之前取消；或</u> - <u>於下午二時正若警告在中午十二時正或之前取消。</u> <p><u>若警告在中午十二時正之後取消，該日將不進行交易。</u></p>
(iii)	若黑色暴雨警告於早市時段結束後午市時段開始前發出（即在 <u>延續交易證券</u> 的 <u>延續早市時段</u> 內）	<p><u>交易安排將如下：</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - 如該日有早市交易，延續早市及午市交易將<u>如常繼續</u>進行。 - 如該日沒有早市交易，根據規則第 501B 條不進行延續早市交易，而該日將不進行午市交易。

(2)	<u>(a) 中央結算系統規則訂明香港天文台懸掛或卸下八號或更高風球時所有交易日的交收時間安排。詳情請參閱中央結算系統規則。颱風來襲/颱風減弱時的交收時間安排</u>	
(i)	八號或更高風球於上午九時三十分之前懸掛	<ul style="list-style-type: none"> - 若八號風球於中午十二時或之前卸下，交收會在兩小時後開始。在該日對上之第二個交易日成交的交易必須最遲於下午三時四十五分完成交收。 - 若八號風球於中午十二時後卸下，該日不進行交收。（關於除淨的證券，請參閱附註）
(ii)	八號或更高風球於開市前時段或早市時間內懸掛	<ul style="list-style-type: none"> - 交收在八號或更高風球懸掛後十五分鐘停止，而： - 若八號風球於中午十二時或之前卸下，交收會在兩小時後恢復。在該日對上之第二個交易日成交的交易必須最遲於下午三時四十五分完成交收。 - 若八號風球於中午十二時後卸下，該日餘下時間不進行交收。
(iii)	八號或更高風球於早市結束後午市開始前懸掛（在 <u>延續交易證券</u> 的 <u>延續早市</u> 內）	<ul style="list-style-type: none"> - 交收在八號或更高風球懸掛後十五分鐘停止。 - 該日餘下時間不進行交收。

(iv)	八號或更高風球於午市時間內懸掛	交收在八號或更高風球懸掛後十五分鐘停止。 該日餘下時間不進行交收。

(2) (b) 中央結算系統規則訂明香港天文台發出或取消黑色暴雨警告時所有交易日的交收時間安排。詳情請參閱中央結算系統規則。發出/取消黑色暴雨警告時的交收時間安排

(i)	於上午九時三十分之前發出黑色暴雨警告	<p>若黑色暴雨警告於中午十二時或之前取消，交收會在兩小時後開始。在該日對上之第二個交易日成交的交易必須最遲於下午三時四十五分完成交收。</p> <p>若黑色暴雨警告於中午十二時後取消，該日不進行交收。（關於除淨的證券，請參閱附註）</p>
(ii)	黑色暴雨警告於開市前時段、早市或午市交易時間內發出	交收繼續如常進行。在特殊情況需要下，本交易所有權決定局部或全部停止交收及付款。
(iii)	黑色暴雨警告於早市結束後午市開始前發出（在延續交易證券的延續早市內）	<p>如該日有早市交易，交收將繼續如常進行。在特殊情況需要下，本交易所有權決定局部或全部停止交收及付款。</p> <p>如該日沒有早市交易，該日將不進行交收。（關於除淨的證券，請參閱附註）</p>

印花稅集體收集制度運作程序

5. 在交易日成交的交易修正

- 5.1 若交易所參與者需要申請修正某交易日的成交，則須於不遲於交易+1日上午~~十時十五分~~九時四十五分前向交易所提出申請。逾期提出的申請將不會受理。

7. 未能在收市前記錄於系統的成交

- 7.1 任何未能於~~交易日午市完結前下午四時正~~（如無午市則於~~上午十二時三十分~~早市完結前）前記錄在交易所之系統中的交易，需於下一個交易日開市前時段的輸入買賣盤時段及對盤前時段或持續交易時段開始後的首十五分鐘內向交易所申報，而交易所會將申報日視作該交易的交易日。