

交易所規則

第一章

釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外：—

- 「後備中央交易網關會話」 指 按規則第364AA條，指定作為後備之用的中央交易網關會話；
- 「後備執行報告會話」 指 執行報告服務的後備連接；
- 「中央交易網關」 指 由交易所操作，提供系統與經紀自設系統，以及其它設備之通訊界面的硬件及軟件；
- 「中央交易網關訊息」 指 經紀自設系統及中央交易網關之間買賣盤或交易相關通訊的單一事例；
- 「中央交易網關會話」 指 一個中央交易網關的連接以作經紀自設系統和中央交易網關之間的通訊聯繫；
- 「中央交易網關過渡期」 指 交易所通知交易所參與者的一段時期；在此期間，開放式網間連接器及中央交易網關會話可用作系統與多工作站系統或經紀自設系統及其它設備(視乎情況而定)之間的通訊聯繫。在此期間之後，只可使用中央交易網關會話；
- 「執行報告服務」 指 交易所就交易所參與者已輸入記錄在系統的買賣盤及交易的實時報告服務；
- 「執行報告會話」 指 執行報告服務的通訊聯繫；
- 「莊家專用中央交易網關會話」 指 根據本規則，供下列一種或多種用途（視屬何種情況而定）的中央交易網關會話：
- (a) 作為證券莊家，該交易所參與者為一隻或多隻莊家證券進行莊家活動；
  - (b) 作為結構性產品流通量提供者，該交易所參與者為結構性產品進行提供流通量活動；

「標準中央交易網關節流率」 指 由董事會不時訂定，經配有一份聯交所交易權的中央交易網關會話傳輸往系統的劃一中央交易網關訊息通過量；

「備用終端機」 指 本交易所根據規則第364A或364AA條，於交易所參與者的後備業務中心或註冊營業地址裝置後備之用的自動對盤終端機；

### 第三章

## 交易所參與者資格

### 備用終端機及後備中央交易網關會話

- 364AA. (1) (a) 除交易所另行決定外，在規則第364AA(2)條的規限下，交易所參與者在其經紀自設系統根據規則第365(1)條所享有或根據規則第364B條或規則第365C條所申請之已連接中央交易網關會話以進入系統之後 (i) 就根據規則第365(1)條每一份聯交所交易權分配到中央交易網關會話或規則第364B條或規則第365C條分配到中央交易網關的每一個標準中央交易網關節流率而言，可向交易所申請安裝備用終端機或 (ii) 後備中央交易網關會話作為該中央交易網關會話的後備，分配至其後備中央交易網關會話的聯交所交易權及標準中央交易網關節流率的數目必須等同分配至相關中央交易網關會話的數目。交易所參與者只可就每一個中央交易網關會話申請一個後備中央網關會話，不論分配至該中央交易網關會話的聯交所交易權及標準中央交易網關節流率的數目。
- (b) 在規則第364AA(2)條的規限下，交易所參與者在其經紀自設系統已連接莊家專用中央交易網關會話以進入系統之後，就每一個標準中央交易網關節流率分配至莊家專用中央交易網關會話而言，可向交易所申請安裝備用終端機作為該莊家專用中央交易網關會話的後備，除本交易所另有決定外。交易所參與者亦可根據規則第364AA(2)條，向交易所申請後備中央交易網關會話作為該莊家專用中央交易網關會話的後備。分配至其後備莊家專用中央交易網關會話的標準中央交易網關節流率的數目必須等同分配至相關莊家專用中央交易網關會話的數目。不論分配至莊家專用中央交易網關會話的標準中央交易網關節流率的數目，交易所參與者只可申請一個後備中央交易網關會話作為該莊家專用中央交易網關會話的後備。
- (2) 已安裝備用終端機或已連接後備中央交易網關會話的交易所參與者須遵從交易所不時的條款或條件，以及繳付由董事會不時訂定的費用。
- (3) 根據交易所規則第364AA(1)條，安裝的備用終端機會處於「非交易」狀態，直至在規則第364AA(4)條的情況下，相關的交易所參與者要求交易所將其轉為「交易」狀態為止。

- (4) (a) 交易所參與者如欲在其根據規則第365(1)條所享有或根據規則第364B條、第365C條或規則第364AA條（視屬何種情況而定）所申請之中央交易網關會話連接失靈時轉用其備用終端機，必須以交易所不時規定的形式及方式要求交易所截斷系統與該中央交易網關會話的連接，並把相應的備用終端機轉為「交易」狀態。
- (b) 交易所參與者如欲在其莊家專用中央交易網關會話連接失靈時轉用其備用終端機，必須以交易所不時規定的形式及方式要求交易所截斷系統與其莊家專用中央交易網關會話的連接，並把相應的備用終端機轉為「交易」狀態。
- (5) 儘管本文中另有相反規定，在交易所轉換一部備用終端機為「交易」狀態後，就本規則而言，已把該備用終端機當作附加自動對盤終端機或莊家專用自動對盤終端機（視屬何種情況而定），而相關的交易所參與者須根據本規則對附加自動對盤終端機或莊家專用自動對盤終端機（視屬何種情況而定）的規定來操作該備用終端機，直至交易所把它轉回「非交易」狀態。
- (5A) 儘管本文中另有相反規定，在交易所參與者轉換後備中央交易網關會話為「交易」狀態後，就本規則而言，已把該後備中央交易網關會話當作根據規則第365(1)條所享有之中央交易網關會話或莊家專用中央交易網關會話（視屬何種情況而定），而相關的交易所參與者須根據本規則對根據規則第365(1)條所享有之中央交易網關會話或莊家專用中央交易網關會話（視屬何種情況而定）的規定來操作該中央交易網關會話，直至交易所參與者把它轉回「非交易」狀態。
- (6) 交易所參與者如欲把其「交易」備用終端機轉回「非交易」狀態，及把相應之中央交易網關會話或莊家專用中央交易網關會話（視屬何種情況而定）與系統重新連接，必須：
- (a) 以交易所不時規定的形式及方式向交易所提出要求，把其「交易」備用終端機轉回「非交易」狀態，及把相應之中央交易網關會話或莊家專用中央交易網關會話（視屬何種情況而定）與系統重新連接；及
- (b) 有關重新連接中央交易網關會話或莊家專用中央交易網關會話，按照規則第365(10)向交易所提交聲明或聲明連報表。
- (7) 為免生疑問，在此規則第364AA條提及的「根據規則第365(1)條所享有之中央交易網關會話」應包括根據規則第364B(3)(c)條之新的中央交易網關會話及根據規則第365C(2)條之新的中央交易網關會話。

交易設施

364B. (1) [已刪除]

(1A) 若交易所參與者就其持有的任何聯交所交易權而獲得的席位享用權已按照規則第305A條自終止日期起終止及消失，而交易所參與者又沒有就其交出享用權在終止日期前成功申請證券交易臺或任何以下其中一項，交易所參與者仍可於終止日期或之後就該聯交所交易權向交易所申請下列任何其中一項但不包括證券交易臺：

- (a) 安裝附加自動對盤終端機；~~或~~
- (b) 遞加經該交易所參與者之開放式網間連接器傳輸往系統的買賣盤通過量~~+~~；~~或~~
- (c) 遞加經指定給該交易所參與者之中央交易網關會話傳輸往系統的中央交易網關訊息通過量。

(1B) 在不損害規則第365(1)條的權利下，交易所參與者可就每份由交易所在終止日期或之後向其賦予或發出的聯交所交易權，根據本規則第364B(1B)條，在交易所通知交易所參與者的日期之前，向交易所申請下列任何其中一項：

- (a) 安裝附加自動對盤終端機；~~或~~
- (b) 遞加經該交易所參與者之開放式網間連接器傳輸往系統的買賣盤通過量~~+~~；~~或~~
- (c) 遞加經指定給該交易所參與者之中央交易網關會話傳輸往系統的中央交易網關訊息通過量。

(1C) (b) 交易所可隨時於現行承諾使用期到期前向交易所參與者發出通告按指定時期及條款為承諾使用期續期。若交易所參與者未擬為其證券交易臺使用權續期，可於指定日期前向交易所申請下列任何其中一項：

- (i) 安裝附加自動對盤終端機；~~或~~
- (ii) 遞加經該交易所參與者之開放式網間連接器傳輸往系統的買賣盤通過量~~+~~；~~或~~
- (iii) 遞加經指定給該交易所參與者之中央交易網關會話傳輸往系統的中央交易網關訊息通過量。

(3) (a) (i) 除董事會另有規定外，根據規則第364B條遞加經開放式網間連接器傳輸往系統的買賣盤通過量須等同標準節流率的四分之一。

- (ii) 除董事會另有規定外，根據規則第364B條遞加經中央交易網關會話傳輸往系統的中央交易網關訊息通過量須等同一個標準中央交易網關節流率。
- (c) 任何根據規則第364B條遞加的中央交易網關訊息通過量，須經交易所參與者現有的中央交易網關會話傳輸往系統。要是交易所參與者向交易所申請新的中央交易網關會話，除交易所另有規定外，遞加的通過量可應用於該新的中央交易網關會話。為免生疑問，除董事會另有規定外，新的中央交易網關會話申請若獲批准，便須完全符合所有適用於規則第365(1)條所述「中央交易網關會話」的規定。
- (5) 在符合規則第364B(2A)(a)條要求繳交提前終止費用的情況下(若適用)，交易所參與者可向交易所申請，將其根據規則第364B條所申請或獲得的附加自動對盤終端機改為遞加經其開放式網間連接器傳輸往系統的買賣盤通過量或經指定其中央交易網關會話傳輸往系統的中央交易網關訊息通過量，反之亦然。交易所參與者一概無權申請恢復任何席位。
365. (1) 交易所參與者在繳付由董事會不時訂定的費用後，可就其持有的每一份聯交所交易權，享有一部開放式網間連接器或一部附加自動對盤終端機：
- (i) 一部附加自動對盤終端機；
- (ii) 一部開放式網間連接器，若是在中央交易網關過渡期之前已取得交易所參與者資格；或
- (iii) 一個中央交易網關會話。
- (4) (a) 交易所參與者可把一部開放式網間連接器與其經紀自設系統連接，或在繳付由董事會不時訂定的費用後，與交易所提供的多工作站系統連接。交易所參與者可把一部後備開放式網間連接器與其經紀自設系統連接作為後備之用，或在繳付由董事會不時訂定的費用後，與交易所提供的多工作站系統連接作為後備之用。
- (b) 交易所參與者可把一個指定其中央交易網關會話與其經紀自設系統連接及連接後備中央交易網關會話用作後備之用。
- (6) 交易所參與者須為授權、監察及管理有關接觸其開放式網間連接器、後備開放式網間連接器、經紀自設系統、多工作站系統、備用終端機、及附加自動對盤終端機及任何指定其中央交易網關會話或後備中央交易網關會話單獨負上責任。

- (7) 交易所參與者必須確保只有交易所參與者及其授權人士（視乎情況而定）才可接觸及操作其開放式網間連接器、後備開放式網間連接器、多工作站系統及、附加自動對盤終端機（包括已轉作「交易」狀態的備用終端機）及任何指定其中央交易網關會話或後備中央交易網關會話。

### 遞加中央交易網關會話通過量

- 365C. (1) 交易所參與者擁有中央交易網關會話，可向交易所申請遞加經中央交易網關會話傳輸往系統的中央交易網關訊息通過量。該申請須獲交易所批准。任何遞加的訊息通過量須為一個標準中央交易網關節流率或其倍數。
- (2) 交易所參與者已經根據規則第365C(1)或365C(5)條申請或取得遞加訊息通過量使用權，可申請新的中央交易網關會話。至於新的中央交易網關會話的申請須獲交易所批准，而獲批准的申請須受董事會認為適當的條件及須繳付的費用所規限。在不損害上述原則下，除董事會另有規定外，新的中央交易網關會話申請若獲批准，便須完全符合所有適用於規則第365(1)條所述「中央交易網關會話」的規定。
- (3) 若交易所參與者根據規則第365C(1)條提出的申請獲交易所批准，以及若交易所參與者根據規則第365C(5)條取得遞加訊息通過量使用權，均須同樣遵守董事會不時訂明的條款及細則，以及繳付董事會不時釐定的費用。在不損害上述原則下，任何根據規則第365C(1)條或根據規則第365C(5)條的轉移而遞加的訊息通過量，須經現有的中央交易網關會話或經根據規則第365C(2)條之新的中央交易網關會話。除交易所另有規定外，必須有不少於一個標準中央交易網關節流率經（如有）新的中央交易網關會話。
- (4) 為免生疑問，在此規則第365C條提及的中央交易網關會話將等同根據規則第365(1)條所享有之中央交易網關會話或根據規則第364B(3)(c)條之新的中央交易網關會話之定義。
- (5) 交易所參與者根據規則第365C(1)條獲批准之遞加訊息通過量使用權或根據規則第365C(5)條取得的遞加訊息通過量使用權可作轉移，但須遵守交易所不時訂明的條款及細則，包括(但不限於)接受該轉移的交易所參與者公司必須是與有關交易所參與者屬同一公司集團的公司。交易所參與者若擬轉移遞加訊息通過量使用權，須向交易所申請；有關申請須經交易所批准，方可作實轉移。

## 第五章

### 交易

#### 交易運作規則

##### 報價

505. 規則第506、506A、507及507A條不適用於一般競價盤。或一般競價盤只可按規則第501G條在開市前時段輸入系統。限價盤、增強限價盤及特別限價盤只可在規則第501(1)條規定的交易時間內輸入系統中，但延續交易證券的該類買賣盤亦可在延續早市輸入系統。為免生疑問，如買賣盤是透過交易所參與者的開放式網間連接器或交易所參與者的指定中央交易網關會話輸入系統，則在任何情況下根據本交易所規則，該買賣盤將被視為是在有關交易所參與者知悉的情況下，由交易所參與者輸入系統。

## 第七章

### 紀律

- 702 (14) 按董事會酌情認為適宜的該等條款及期間暫停、收回或撤銷證券莊家及/或結構性產品流通量提供者經莊家專用開放式網間連接器、莊家專用中央交易網關會話及/或莊家專用自動對盤終端機登入系統的權利。

## 第八章

### 繳付費用

802A. 在不限制上述規則第801條的一般性的情況下，董事會可就中央交易網關徵收以下費用：—

<u>收費類別</u>	<u>金額（港幣）</u>
<u>(1) 根據規則第365(1)、364B(3)(c)、365C(2)、364AA(1)(a)、364AA(1)(b)條、附表十四規則第15(b)條或附表十八規則第5(b)條申請的每一個中央交易網關會話、莊家專用中央交易網關會話或後備中央交易網關會話行政費；</u>	<u>每個會話20,000元</u>
<u>(2) 依照規則第365C(1)條申請遞加的中央交易網關的訊息通過量；</u>	<u>每個標準中央交易網關節流率50,000元</u>
<u>(3) 除了以上列明的任何一次性費用外，每月費用為：</u>	
<u>(a) 根據分配的標準中央交易網關節流率數目而使用中央交易網關會話、莊家專用中央交易網關會話或後備中央交易網關會話，如下：</u>	
<u>(i) 低用量</u>	<u>中央交易網關會話：第一個交易或後備會話為2,000元，之後每個額外會話為7,500元</u>
<u>- 1至20個標準中央交易網關節流率</u>	<u>莊家專用中央交易網關會話：每個交易或後備會話為7,500元</u>
<u>(ii) 標準用量</u>	<u>10,000元</u>
<u>- 21至60個標準中央交易網關節流率</u>	

	<u>(iii) 高用量</u>	
	- <u>61至100個標準中央交易網關節流率</u>	<u>15,000元</u>
	- <u>101至150個標準中央交易網關節流率</u>	<u>20,000元</u>
	- <u>151至200個標準中央交易網關節流率</u>	<u>25,000元</u>
	- <u>201至250個標準中央交易網關節流率</u>	<u>30,000元</u>
<u>(b)</u>	<u>分配到中央交易網關會話的聯交所交易權；</u>	<u>每份分配的聯交所交易權480元</u>
<u>(c)</u>	<u>根據規則第364B條遞加經現有中央交易網關會話傳輸往系統的訊息通過量；</u>	<u>每個標準中央交易網關節流率480元</u>
<u>(d)</u>	<u>根據規則第364B(3)(c)條遞加新的中央交易網關會話遞加傳輸往系統的訊息通過量；</u>	<u>每個標準中央交易網關節流率480元</u>
<u>(e)</u>	<u>根據規則第365C條遞加經現有中央交易網關會話傳輸往系統的訊息通過量；</u>	<u>每個標準中央交易網關節流率960元</u>
<u>(f)</u>	<u>根據規則第365C條遞加新的中央交易網關會話傳輸往系統的訊息通過量；</u>	<u>每個標準中央交易網關節流率960元</u>
<u>(g)</u>	<u>分配到莊家專用後備中央交易網關會話的每個標準中央交易網關節流率；</u>	<u>每個標準中央交易網關節流率480元</u>
<u>(h)</u>	<u>執行報告會話或後備執行報告會話；</u>	<u>除了第一個會話不收費外，每個會話4,500元</u>

附表十四  
證券莊家規例（下稱「本規例」）

莊家專用開放式網間連接器及、莊家專用自動對盤終端機及莊家專用中央交易網關會話

- (15) (a) 證券莊家在繳付董事會不時訂定的費用後，可享有連接本身經紀自設系統或交易所提供的多工作站系統的莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機以登入系統。董事會可不時規定證券莊家在任何時候可安裝莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機的數目。除董事會另有規定外，否則在合適情況下，有關規則第 365(1)條所指的「開放式網間連接器」及「附加自動對盤終端機」的規則將同時適用於莊家專用開放式網間連接器及莊家專用自動對盤終端機；
- (b) 證券莊家在繳付董事會不時訂定的費用後，可享有連接本身經紀自設系統的莊家專用中央交易網關會話以登入系統。董事會可不時規定證券莊家在任何時候指定的莊家專用中央交易網關會話的數目。除董事會另有規定外，否則在合適情況下，有關規則第 365(1)條所指的「中央交易網關會話」的規則將同時適用於莊家專用中央交易網關會話。
- (16A) 證券莊家須為授權、監察及管理有關接觸其莊家專用開放式網間連接器、及莊家專用自動對盤終端機及任何指定其莊家專用中央交易網關會話之事宜負上責任。
- (17) 證券莊家或任何其僱員或其代表人士均不可修改或嘗試修改任何莊家專用開放式網間連接器或及莊家專用自動對盤終端機。
- (17A) 莊家專用開放式網間連接器或莊家專用中央交易網關會話會按董事會不時規定而獲分配一個標準節流率或其倍數、標準中央交易網關節流率或其倍數（視情況而定），供證券莊家把莊家盤及/或董事會不時指定的其它買賣盤輸入系統。
- (17B) 證券莊家須按董事會不時訂定的方式透過莊家專用開放式網間連接器及、莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話把莊家盤輸入系統。董事會可不時規定證券莊家按照董事會不時指明的條件及方式，透過莊家專用網間連接器、及莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話可輸入的買賣盤及/或進行的活動。
- (19A) 當證券莊家的證券莊家執照被暫停、收回、撤銷或交回，交易所須終止它經其莊家專用網間連接器及莊家專用自動對盤終端機及任何指定其莊家專用中央交易網關會話登入系統。

- (19B) 交易所有絕對酌情權按董事會認為適宜的條款及期間隨時暫停、收回或撤銷證券莊家透過任何莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話與系統聯通，而毋須給予任何理由或通知。董事會作出的決定為最終及具決定性的決定。在不影響此一般性權力下，倘證券莊家未能遵守本規例或它被暫停、開除，或由於任何其它原因，不再是交易所參與者，交易所有權按董事會認為適宜的條款及期間暫停、收回或撤銷它以證券莊家透過任何莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話與系統聯通。董事會作出的決定為最終及具決定性的決定。為免生疑問，交易所參與者仍須為未能遵守本規則負責，及仍須如其作為證券莊家的登入權並未被暫停、收回或撤銷般而根據本規則繳交到期應付的款項。

## 附表十八

### 結構性產品流通量提供者規例（下稱「本規例」）

#### 結構性產品流通量提供者的交易設施

- (5) (a) 結構性產品流通量提供者在繳付董事會不時訂定的費用後，可享有一部連接本身經紀自設系統或交易所提供的多工作站系統的莊家專用開放式網間連接器及/或一部莊家專用自動對盤終端機以登入系統。董事會可不時規定結構性產品流通量提供者在任何時候可安裝莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機的數目。除董事會另有規定外，否則在合適情況下，有關規則第 365(1)條所指的「開放式網間連接器」及「附加自動對盤終端機」的規則將同時適用於莊家專用開放式網間連接器及莊家專用自動對盤終端機~~一~~；
- (b) 結構性產品流通量提供者在繳付董事會不時訂定的費用後，可享有連接本身經紀自設系統的莊家專用中央交易網關會話以登入系統。董事會可不時規定結構性產品流通量提供者在任何時候指定的莊家專用中央交易網關會話的數目。除董事會另有規定外，否則在合適情況下，有關規則第 365(1)條所指的「中央交易網關會話」的規則將同時適用於莊家專用中央交易網關會話。
- (6) 結構性產品流通量提供者應使用莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話，按發行人在相關結構性產品的上市文件所述輸入結構性產品流通量買賣盤，及按董事會不時指定之方式申報所有以結構性產品流通量提供者身份為發行人的帳戶或它的聯號的帳戶達成的非自動對盤交易。董事會可不時規定結構性產品流通量提供者按照董事會不時指明的條件及方式，透過莊家專用開放式網間連接器及/或莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話可輸入的買賣盤及/或進行的活動。

- (8) 結構性產品流通量提供者須為授權、監察及管理有關接觸其莊家專用開放式網間連接器、~~及莊家專用自動對盤終端機~~及任何指定其莊家專用中央交易網關會話之事宜負上責任。
- (9) 莊家專用開放式網間連接器或莊家專用中央交易網關會話會按董事會不時規定而獲分配一個標準節流率或其倍數、標準中央交易網關節流率或其倍數（視情況而定），供結構性產品流通量提供者根據本附表規例第(6)條輸入結構性產品流通量買賣盤及申報交易，及/或供輸入董事會不時指定的其它買賣盤及進行董事會不時指定的活動。

### 暫停及終止

- (12) 交易所有絕對酌情權按董事會認為適宜的條款及期間隨時禁止任何交易所參與者被委聘為或擔任結構性產品流通量提供者及/或暫停、收回或撤銷結構性產品流通量提供者透過任何莊家專用開放式網間連接器、~~及/或莊家專用自動對盤終端機~~或莊家專用中央交易網關會話與系統聯通，而毋須給予任何理由或通知。董事會作出的決定為最終及具決定性的決定。在不影響此一般性的權力下，倘交易所參與者未能遵守本規例或它被暫停、開除，或由於任何其他原因，不再是交易所參與者，交易所有權禁止它被委聘為或擔任結構性產品流通量提供者及有權按董事會認為適宜的條款及期間暫停、收回或撤銷它以結構性產品流通量提供者身份透過莊家專用開放式網間連接器及/或、莊家專用自動對盤終端機或莊家專用中央交易網關會話與系統聯通。董事會作出的決定為最終及具決定性的決定。為免生疑問，交易所參與者仍須為未能遵守本規則負責，及仍須如並未暫停、收回或撤銷其作為結構性產品流通量提供者的登入權般根據本規則繳交到期應付的款項。
- (13) 當結構性產品流通量提供者的委聘終止，交易所將終止其所有莊家專用開放式網間連接器、~~及莊家專用自動對盤終端機~~及指定其莊家專用中央交易網關會話與系統的聯通。