

交易所規則

第一章

釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外：—

「ATS」 具有「條例」給予「自動化交易服務」一詞的涵義；

「ATS 交易」 指 透過交易所參與者根據證監會批給牌照提供的 ATS 買賣於交易所上市的證券所而執行或達成或輸入的交易；

第五章

交易

交易運作規則

延續交易證券

501F. (1) 進行延續交易證券兩邊客交易的交易所參與者有責任於開市前時段，根據規則第 501(1)條所規定及延續早市之交易期間，於以下時限(或其他交易所不時規定的時限)內，將該等交易資料輸入系統中：

- (i) 如屬 ATS 交易的兩邊客交易，在該交易完成後立即及在任何情況下於一分鐘內輸入；及
- (ii) 如屬所有其他兩邊客交易，在該交易完成後十五分鐘內輸入。

及須於當天延續交易證券買賣結束前，將該等交易資料輸入系統中。對於以自動對盤配對完成之交易，此責任則不存在。任何未能按上述規定於延續交易證券買賣結束前記錄在系統中的延續交易證券交易，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交易時段的交易。

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於以下時限(或其他交易所不時規定的時限)內，將該等交易資料輸入系統中：

- (i) 如屬 ATS 交易的兩邊客交易，在該交易完成後立即及在任何情況下須於一分鐘內輸入；及
- (ii) 如屬所有其他兩邊客交易，在交易完成後十五分鐘內輸入，

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；
- (ii) 早市內完成的交易不可遲於早市完結時輸入；
- (iii) 午市內完成的交易則不可遲於午市完結時輸入。

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

- (i) 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；或
- (ii) ATS 交易的兩邊客交易，

按交易所不時指定之形式、時間及資料向本交易所報告。