

## 第十四A章

### 中華通服務——上海

#### 釋義

14A02. (2) 在本章中，除文意另有所指外：

<u>「SPSA 集中管理賬號持有人」</u>		<u>與中央結算系統規則中所指的含義相同；</u>
<u>「SPSA 集中管理賬號」</u>		<u>與中央結算系統規則中所指的含義相同；</u>
<u>「SPSA 集中管理買賣盤」</u>	指	<u>出售特別獨立戶口(已配對至 SPSA 集中管理賬號)持有的中華通證券的中華通買賣盤；</u>
<u>「特別獨立戶口管理賬號」</u>		<u>與中央結算系統規則中所指的含義相同；</u>
<u>「特別獨立戶口買賣盤」</u>	指	<u>出售特別獨立戶口(已配對至 SPSA 集中管理賬號者除外)持有的中華通證券的中華通買賣盤；</u>

#### 特別獨立戶口買賣盤

14A06. (2A) (a) 收到客戶指示要出售特別獨立戶口持有的中華通證券的中華通交易所參與者，在向 CSC 輸入特別獨立戶口買賣盤前，須先確保：

- (i) 該特別獨立戶口已根據中央結算系統規則指定予該客戶並由中央結算系統指定一個特別獨立戶口管理賬號投資者識別編號；
  - (ii) 其已獲授權代表該客戶出售指定特別獨立戶口內的中華通證券；及
  - (iii) 其已獲該客戶確認或已通知該客戶須確保該特別獨立戶口內有足夠中華通證券在交收日履行交付責任，以及（如該特別獨立戶口買賣盤已執行）其或其中央結算系統全面結算參與者（視乎情況）將獲交付相關中華通證券以進行交收。
- (b) 在規則第 14A06(2A)(a)條的規限下，中華通交易所參與者在 CSC 輸入特別獨立戶口買賣盤時須按本交易所不時確定的方式，指明相關特別獨立戶口管理賬號投資者識別編號及本交易所要求的其他資料。中華通交易所參與者在 CSC 輸入特別獨立戶口買賣盤，即同意及向本交易所表示其已遵守本規則第 14A06(2A)條所載有關特別獨立戶口買賣盤的規定。

- (c) 在本規則第 14A06(2A)內，對「中華通交易所參與者」的提述不包括規則第 590(1)條所指的交易所參與者（透過中華通交易所參與者進行交易的交易所參與者）。本條規則不適用於該等交易所參與者。

**SPSA 集中管理買賣盤**

- (2B) (a) 收到本身是 SPSA 集中管理賬號持有人的客戶指示要出售一個或多個特別獨立戶口(已配對至 SPSA 集中管理賬號) 所持有的中華通證券的中華通交易所參與者，在向 CSC 輸入 SPSA 集中管理買賣盤前，須先確保：
- (i) SPSA 集中管理賬號持有人已獲編配一個指定的 SPSA 集中管理賬號；
  - (ii) 其已獲授權代表該 SPSA 集中管理賬號持有人出售所配對特別獨立戶口中持有的中華通證券；
  - (iii) 其已獲該 SPSA 集中管理賬號持有人就相關中華通證券作出的預先分配指示；及
  - (iv) 其已獲該 SPSA 集中管理賬號持有人確認或已通知該 SPSA 集中管理賬號持有人須確保所配對的特別獨立戶口持有足夠中華通證券在交收日履行交付責任，以及（如該 SPSA 集中管理買賣盤已執行）其或其中央結算系統全面結算參與者（視乎情況）將獲交付相關中華通證券以進行交收。
- (b) 在規則第 14A06(2B)(a)條的規限下，中華通交易所參與者在 CSC 輸入 SPSA 集中管理買賣盤時須按本交易所不時確定的方式，指明相關 SPSA 集中管理賬號及本交易所要求的其他資料。中華通交易所參與者在 CSC 輸入 SPSA 集中管理買賣盤，即同意及向本交易所表示其已遵守本規則第 14A06(2B)條所載有關 SPSA 集中管理買賣盤的規定。
- (c) 在本規則第 14A06(2B)內，對「中華通交易所參與者」的提述不包括規則第 590(1)條所指的交易所參與者（透過中華通交易所參與者進行交易的交易所參與者）。本條規則不適用於該等交易所參與者。

**前端監控**

- (6) 如中華通交易所參與者是中華通中央結算系統結算參與者，將按規則第 14A06(8)(a)、(c)及(d)條對其指定中央結算系統股份賬戶的持倉額進行有關其中華通沽盤的前端監控，除非該中華通沽盤是特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤，則規則第 14A06(7A)條或第 14A06(7B)條（視情況而定）適用。
- (7) 如中華通交易所參與者並非中華通中央結算系統結算參與者，則將對其正式委任的中央結算系統全面結算參與者指定給其作為交收中華通證券交易的中央結算系統股份賬戶的持倉額進行有關其中華通沽盤（除非該

買賣盤為特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤）的前端監控。其中華通沽盤的前端監控將按規則第 14A06(8)(a)、(c)及(d)條進行，除非該中華通沽盤是特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤，則規則第 14A06(7A)條或規則第 14A06(7B) 條（視情況而定） 適用。

(7A) 中華通交易所參與者輸入特別獨立戶口買賣盤後，按規則第 14A06(8)(b)、(c)及(d)條在輸入該買賣盤時所指明的特別獨立戶口賬號投資者識別編號的對應特別獨立戶口內的持倉額即會接受前端監控。

(7B) 中華通交易所參與者輸入 SPSA 集中管理買賣盤後，按規則第 14A06(8)(b)、(c)及(d)條在輸入該買賣盤時所指明的 SPSA 集中管理賬號所配對的所有特別獨立戶口內的持倉總額即會接受前端監控。

(8) (a) 除規則第 14A06(8)(c)條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整，每個 CSC 交易日內可就各中華通證券傳遞的中華通沽盤（不包括特別獨立戶口買賣盤及 SPSA 集中管理買賣盤）的股份總數，不得超過緊貼該 CSC 交易日開始提供中華通服務前，規則第 14A06(6)或(7)條所述在相關指定中央結算系統股份賬戶內列示的中華通證券持倉總額。

(b) 除規則第 14A06(8)(c)條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整→：

(i) 每個 CSC 交易日內可就特別獨立戶口內的各中華通證券傳遞的特別獨立戶口買賣盤的股份總數，不得超過緊貼該 CSC 交易日開始提供中華通服務前，規則第 14A06(7A)條所述在相關特別獨立戶口內所顯示的同一中華通證券持倉總額→；及

(ii) 每個 CSC 交易日內可就已配對至 SPSA 集中管理賬號的特別獨立戶口內的各中華通證券傳遞的 SPSA 集中管理買賣盤的股份總數，不得超過緊貼該 CSC 交易日開始提供中華通服務前，規則第 14A06(7B)條所述在已配對至 SPSA 集中管理賬號的所有特別獨立戶口內所顯示的同一中華通證券持倉總額。

(c) 倘中華通中央結算系統結算參與者於持續淨額交收系統中出現中華通證券於到期日尚未進行交收的逾期未交收股份數額，而該中華通中央結算系統結算參與者為中華通交易所參與者，香港結算將要求本交易所從該中華通中央結算系統結算參與者在下一個 CSC 交易日的可售結餘扣減逾期未交收股份數額。倘該中華通中央結算系統結算參與者為任何中華通交易所參與者的中央結算系統全面結算參與者，則會從每名此等中華通交易所參與者在下一個 CSC 交易日的可售結餘中扣減。如此等逾期未交收股份數額是或被該中華通中央結算系統結算參與者指是全部或部分因為特別獨立戶口交付失敗所致，則該中華通中央結算系統結算參與者及／或相關中華通交易所參與者以及相關特別獨立戶口將按中央結算系統規則進行調整。若有 SPSA 集中管理賬號出現特別獨立戶口交付失敗，特別獨立戶口交付失敗所牽涉的相關中華通證券的可售結餘或該 SPSA 集中管理賬號下所有中華通證券的可售結餘可能會在下一個 CSC 交易日（或中央結算系統規則所規定的更長時間內）歸零。

- (d) 如中華通交易所參與者輸入的中華通沽盤於執行時或會超過規則第 14A06(8)(a)或(b)條所述的有關持倉總額，有關沽盤將遭拒絕（規則第 14A06(8)(c) 條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整除外）。
- (9) 每個 CSC 交易日，香港結算將按中央結算系統規則以及除規則第 14A06(8)(c)條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整，複製規則第 14A06(6)及(7)條所述的中央結算系統股份賬戶持倉記錄（客戶戶口及公司戶口的持倉）及規則第 14A06(7A)條及第 14A06(7B)條所述的特別獨立戶口持倉記錄，並於每個 CSC 交易日中華通服務開始運作前向 CSC 傳送有關資料，以便本交易所及聯交所子公司實施前端監控程序。各中華通交易所參與者均同意及授權複製及傳送上述持倉記錄，以便讓本交易所及聯交所子公司進行前端監控程序。若是特別獨立戶口（不論在特別獨立戶口賬號還是 SPSA 集中管理賬號之下），每名獲授權代客戶（包括 SPSA 集中管理賬號持有人，如適用）執行在上述特別獨立戶口內的中華通證券沽盤的中華通交易所參與者承認及確認其客戶（包括 SPSA 集中管理賬號持有人，如適用）已授權複製及傳送特別獨立戶口的持倉記錄，以便讓本交易所及聯交所子公司進行前端監控程序。
- (10) 與規則第 1421(2)條一致，中華通交易所參與者應訂定適當安排，確保(a)就特別獨立戶口買賣盤及 SPSA 集中管理買賣盤而言，於發出買賣盤前已分別遵守規則第 14A06(2A)條及規則第 14A06(2B)條；及(b)就客戶或本身發出（特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤除外）的中華通沽盤前，中央結算系統內的相關客戶戶口或公司戶口（按適用）有足夠的證券。當中華通沽盤於上交所市場系統配對後，在上文第 14A06(8)-(a)條所指的有關賬戶或有關的特別獨立戶口（視乎情況）內的相關中華通證券數量會根據中央結算系統規則用作股票交收。

## 賣空

14A17. (13) 將賣空盤輸入 CSC 前，中華通交易所參與者：

- (a) 如就客戶（包括 SPSA 集中管理賬號持有人，如適用）賬戶行事：
- (iv) 如將輸入的賣空盤是特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤，其須已要求客戶確認借入的賣空證券由有關的特別獨立戶口持有、買賣盤符合規則第 14A06(7A)條或第 14A06(7B)條（視情況而定）所載的前端監控要求及（若買賣盤是在上交所市場執行）其或其中央結算系統全面結算參與者將獲交付借入的證券作股份交收；及

## 第十四 B 章

### 中華通服務——深圳

#### 釋義

14B02. (2) 在本章中，除文意另有所指外：

<u>「SPSA 集中管理賬號持有人」</u>	與中央結算系統規則中所指的含義相同；
<u>「SPSA 集中管理賬號」</u>	與中央結算系統規則中所指的含義相同；
<u>「SPSA 集中管理買賣盤」</u> 指	出售特別獨立戶口（已配對至 <u>SPSA 集中管理賬號</u> ）持有的中華通證券的中華通買賣盤；
<u>「特別獨立戶口管理賬號」</u>	與中央結算系統規則中所指的含義相同；
<u>「特別獨立戶口買賣盤」</u> 指	出售特別獨立戶口（已配對至 <u>SPSA 集中管理賬號者除外</u> ）持有的中華通證券的中華通買賣盤；

#### 特別獨立戶口買賣盤

- 14B06. (3) (a) 收到客戶指示要出售特別獨立戶口持有的中華通證券的中華通交易所參與者，在向 CSC 輸入特別獨立戶口買賣盤前，須先確保：
- (i) 該特別獨立戶口已根據中央結算系統規則指定予該客戶並由中央結算系統指定一個特別獨立戶口管理賬號投資者識別編號；
  - (ii) 其已獲授權代表該客戶出售指定特別獨立戶口內的中華通證券；及
  - (iii) 其已獲該客戶確認或已通知該客戶須確保該特別獨立戶口內有足夠中華通證券在交收日履行交付責任，以及（如該特別獨立戶口買賣盤已執行）其或其中央結算系統全面結算參與者（視乎情況）將獲交付相關中華通證券以進行交收。
- (b) 在規則第 14B06(3)(a)條的規限下，中華通交易所參與者在 CSC 輸入特別獨立戶口買賣盤時須按本交易所不時確定的方式，指明相關特別獨立戶口管理賬號投資者識別編號及本交易所要求的其他資料。中華通交易所參與者在 CSC 輸入特別獨立戶口買賣盤，即

同意及向本交易所表示其已遵守本規則第 14B06(3)條所載有關特別獨立戶口買賣盤的規定。

- (c) 在本規則第 14B06(3)條內，對「中華通交易所參與者」的提述不包括規則第 590(1)條所指的交易所參與者（透過中華通交易所參與者進行交易的交易所參與者）。本條規則不適用於該等交易所參與者。

### **SPSA 集中管理買賣盤**

(3A) (a) 收到本身是 SPSA 集中管理賬號持有人的客戶指示要出售一個或多個特別獨立戶口(已配對至 SPSA 集中管理賬號) 所持有的中華通證券的中華通交易所參與者，在向 CSC 輸入 SPSA 集中管理買賣盤前，須先確保：

(i) SPSA 集中管理賬號持有人已獲編配一個指定的 SPSA 集中管理賬號；

(ii) 其已獲授權代表該 SPSA 集中管理賬號持有人出售所配對特別獨立戶口中持有的中華通證券；

(iii) 其已獲該 SPSA 集中管理賬號持有人就相關中華通證券作出的預先分配指示；及

(iv) 其已獲該 SPSA 集中管理賬號持有人確認或已通知該 SPSA 集中管理賬號持有人須確保所配對的特別獨立戶口持有足夠中華通證券在交收日履行交付責任，以及（如該 SPSA 集中管理買賣盤已執行）其或其中央結算系統全面結算參與者（視乎情況）將獲交付相關中華通證券以進行交收。

(b) 在規則第 14B06(3A)(a)條的規限下，中華通交易所參與者在 CSC 輸入 SPSA 集中管理買賣盤時須按本交易所不時確定的方式，指明相關 SPSA 集中管理賬號及本交易所要求的其他資料。中華通交易所參與者在 CSC 輸入 SPSA 集中管理買賣盤，即同意及向本交易所表示其已遵守本規則第 14B06(3A)條所載有關 SPSA 集中管理買賣盤的規定。

(c) 在本規則第 14B06(3A)內，對「中華通交易所參與者」的提述不包括規則第 590(1)條所指的交易所參與者（透過中華通交易所參與者進行交易的交易所參與者）。本條規則不適用於該等交易所參與者。

### **前端監控**

- (7) 如中華通交易所參與者是中華通中央結算系統結算參與者，將按規則第 14B06(10)(a)、(c)及(d)條所述方式對其指定中央結算系統股份賬戶的持倉額進行有關其中華通沽盤的前端監控，除非該中華通沽盤是特別獨立戶口買賣盤或 **SPSA 集中管理買賣盤**，則規則第 14B06(9)條或**第 14B06(9A)**

條（視情況而定）適用。

(8) 如中華通交易所參與者並非中華通中央結算系統結算參與者，則將對其正式委任的中央結算系統全面結算參與者指定給其作為交收中華通證券交易的中央結算系統股份賬戶的持倉額進行有關其中華通沽盤（除非該買賣盤為特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤）的前端監控。其中華通沽盤的前端監控將按規則第 14B06(10)(a)、(c)及(d)條進行，除非該中華通沽盤是特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤，則規則第 14B06(9)條或第 14B06(9A) 條（視情況而定） 適用。

(9) 中華通交易所參與者輸入特別獨立戶口買賣盤後，在輸入該買賣盤時所指明的特別獨立戶口賬號投資者識別編號的對應特別獨立戶口內的持倉額將按規則第 14B06(10)(b)、(c)及(d)條接受前端監控。

(9A) 中華通交易所參與者輸入 SPSA 集中管理買賣盤後，在輸入該買賣盤時所指明的 SPSA 集中管理賬號所配對的所有特別獨立戶口內的持倉總額將按規則第 14B06(10)(b)、(c)及(d)條接受前端監控。

(10) (a) 除規則第 14B06(10)(c)條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整，每個 CSC 交易日內可就各中華通證券傳遞的中華通沽盤（不包括特別獨立戶口買賣盤及 SPSA 集中管理買賣盤）的股份總數，不得超過緊貼該 CSC 交易日開始提供中華通服務前，規則第 14B06(7)或(8)條所述在相關指定中央結算系統股份賬戶內列示的中華通證券持倉總額。

(b) 除規則第 14B06(10)(c)條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整—：

(i) 每個 CSC 交易日內可就特別獨立戶口內的中華通證券傳遞的特別獨立戶口買賣盤的股份總數，不得超過緊貼該 CSC 交易日開始提供中華通服務前，規則第 14B06(9)條所述在相關特別獨立戶口內所顯示的同一中華通證券持倉總額—；及

(ii) 每個 CSC 交易日內可就已配對至 SPSA 集中管理賬號的特別獨立戶口內的各中華通證券傳遞的 SPSA 集中管理買賣盤的股份總數，不得超過緊貼該 CSC 交易日開始提供中華通服務前，規則第 14B6(9A)條所述在已配對至 SPSA 集中管理賬號的所有特別獨立戶口內所顯示的同一中華通證券持倉總額。

(c) 倘中華通中央結算系統結算參與者於持續淨額交收系統中出現中華通證券於到期日尚未進行交收的逾期末交收股份數額，而該中華通中央結算系統結算參與者為中華通交易所參與者，香港結算將要求本交易所從該中華通中央結算系統結算參與者在下一個 CSC 交易日的可售結餘扣減逾期末交收股份數額。倘該中華通中央結算系統結算參與者為任何中華通交易所參與者的中央結算系統全面結算參與者，則會從每名此等中華通交易所參與者在下一個 CSC 交易日的可售結餘中扣減。如此等逾期末交收股份數額是或被該中華通中央結算系統結算參與者指是全部或部分因為特別獨立戶口交付失敗所致，則該中華通中央結算系統結算參與者及

／或相關中華通交易所參與者以及相關特別獨立戶口的可售結餘將按中央結算系統規則進行調整。若有 SPSA 集中管理賬號出現特別獨立戶口交付失敗，特別獨立戶口交付失敗所牽涉的相關中華通證券的可售結餘或該 SPSA 集中管理賬號下所有中華通證券的可售結餘可能會在下一個 CSC 交易日（或中央結算系統規則所規定的更長時間內）歸零。

- (d) 如中華通交易所參與者輸入的中華通沽盤於執行時或會超過規則第 14B06(10)(a)或(b)條所述的有關持倉總額，有關沽盤將遭拒絕（規則第 14B06(10)(c)條及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整除外）。
- (11) 每個 CSC 交易日，香港結算將按中央結算系統規則以及除規則第 14B06(10)(c)條所述及按中央結算系統規則就前端監控進行的任何可出售結餘調整，複製規則第 14B06(7)及(8)條所述的中央結算系統股份賬戶持倉記錄（客戶戶口及公司戶口的持倉）及規則第 14B06(9)條及第 14B06(9A)條所述的特別獨立戶口持倉記錄，並於每個 CSC 交易日中華通服務開始運作前向 CSC 傳送有關資料，以便本交易所及聯交所子公司實施前端監控程序。各中華通交易所參與者均同意及授權複製及傳送上述持倉記錄，以便讓本交易所及聯交所子公司進行前端監控程序。若是特別獨立戶口（不論在特別獨立戶口賬號還是 SPSA 集中管理賬號之下），每名獲授權代客戶（包括 SPSA 集中管理賬號持有人，如適用）執行在上述特別獨立戶口內的中華通證券沽盤的中華通交易所參與者承認及確認其客戶（包括 SPSA 集中管理賬號持有人，如適用）已授權複製及傳送特別獨立戶口的持倉記錄，以便讓本交易所及聯交所子公司進行前端監控程序。
- (12) 與規則第 1421(2)條一致，中華通交易所參與者應訂定適當安排，確保(a)就特別獨立戶口買賣盤及 SPSA 集中管理買賣盤而言，於發出買賣盤前已分別遵守規則第 14B06(3)條及規則第 14B06(3A)條；及(b)就客戶或本身發出（特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤除外）的中華通沽盤前，中央結算系統內的相關客戶戶口或公司戶口（按適用）有足夠的證券。當中華通沽盤於深交所市場系統配對後，在上文第 14B06(10)(a)條所指的有關賬戶或有關的特別獨立戶口（視乎情況）內的相關中華通證券數量會根據中央結算系統規則用作股票交收。

## 賣空

14B17. (13) 將賣空盤輸入 CSC 前，中華通交易所參與者：

- (a) 如就客戶（包括 SPSA 集中管理賬號持有人，如適用）賬戶行事：
- (iv) 如將輸入的賣空盤是特別獨立戶口買賣盤或 SPSA 集中管理買賣盤，其須已要求客戶確認借入的賣空證券由有關的特別獨立戶口持有、買賣盤符合規則第 14B06(9)條或第 14B06(9A)條（視情況而定）所載的前端監控要求及（若買賣盤是在深交所市場執行）其或其中中央結算系統全面結算參與者將獲交付借入的證券作股份交收；及