

附表十八

結構性產品流通量提供者規例（下稱「本規例」）

前言

- (1) 在本規例中：—

「結構性產品流通量買賣盤」指交易所參與者以結構性產品流通量提供者身份為結構性產品發行人在持續交易時段內於系統有效地輸入某一結構性產品的報價或買賣盤；及

「上市文件」其含意與主板上市規則章數一所界定者相同。

結構性產品流通量買賣盤及交易

- (2) 結構性產品流通量提供者須為它擔任發行人的代理人之結構性產品，以結構性產品發行人的帳戶或發行人之聯號的帳戶輸入結構性產品流通量買賣盤及進行交易。結構性產品流通量買賣盤只可在持續交易時段內輸入系統。
- (3) 結構性產品流通量提供者在將結構性產品流通量買賣盤輸入系統時，須以董事會不時指定之形式，顯示該買賣盤為結構性產品流通量買賣盤。
- (4) 如有按盤價，結構性產品流通量買賣盤的價格應不得偏離按盤價九倍或以上。

結構性產品流通量提供者的交易設施

- (5) (a) [已刪除]
- (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，透過莊家專用中央交易網關會話可輸入的買賣盤及/或進行的活動。
- (7) [已刪除]
- (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。
- (10) [已刪除]
- (11) [已刪除]

暫停及終止

- (12) 交易所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指定其莊家專用中央交易網關會話與系統的聯通。

結構性產品流通量提供者賣空

- (14) 即使本規則已另有規定，結構性產品流通量提供者在進行結構性產品流通量提供者賣空時必須遵守本規例。
- (15) 結構性產品流通量提供者賣空交易只能在系統內自動配對的結構性產品上達成。
- (16) 結構性產品流通量提供者賣空盤只可在持續交易時段內輸入系統。結構性產品流通量提供者在將結構性產品流通量提供者賣空盤輸入系統時，必須以本交易所不時指定之方式顯示該沽盤為結構性產品流通量提供者賣空盤。
- (17) 行政總裁可限制或禁止某結構性產品流通量提供者進行結構性產品流通量提供者賣空，但事先須獲董事會主席口頭或書面准許。該等限制或禁止的書面或口頭通知在傳達或送達該結構性產品流通量提供者起即時有效或從通知內所訂時間起有效，及將持續有效直至被行政總裁撤銷、撤除或修改為止。
- (18) 結構性產品流通量提供者賣空可按低於當時最佳沽盤價在本交易所進行。

- (19) 本交易所可不時豁免任何買賣盤、成交及結構性產品流通量提供者，使其毋須遵守本規例的所有或任何條文。