編號 Ref. No.:	OPS/CS/003/24
日期 Date:	01/03/2024

香港聯合交易所有限公司
(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)
THE STOCK EXCHANGE OF HONG KONG LIMITED
(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項： **交易所參與者設定買賣盤價值限制及應用名義價值檢查**

查詢： **參與者一般查詢熱線** [1] **（電話：2840 3626 電子郵箱：trd@hkex.com.hk）**

為了更有效減低錯誤輸入買賣盤/非自動對盤成交的風險及影響，現提醒各交易所參與者按其公司業務需要及財務基礎來檢討及決定買賣盤價值限制（「限制」）（於領航星中央交易網關 — 證券市場接口規範也稱為「名義價值」）。如發生錯誤輸入買賣盤/非自動對盤成交，交易所參與者應有足夠流動資金及 資源以履行責任和處理後續事宜。

這個限制是按個別公司訂定及唯有對輸送到 OTP-C 系統的買賣盤/非自動對盤成交應用了名義價值檢查（Notional Value Checks），才可有效以上述限制控制風險。使用由供應商提供經紀自設系統（BSS）的交易所參與者，須向其 BSS 供應商查核及安排名義價值檢查的系統設置。

請注意，設定限制及應用名義價值檢查是防範買賣盤 / 非自動對盤成交錯誤輸入的額外監管措施，並非以作取代各交易所參與者現有的內部監管。交易所參與者在處理客戶的買賣盤及交易時需承擔維持適當及足夠的交易運作和內部監管程序之所有責任。

交易所強烈建議所有交易所參與者審慎及適時地檢討其限制及內部監管。若交易所參與者有意修定該限制，需於擬生效日期前最少三個工作天填妥及透過 Client Connect 遞交電子服務表格「CT027」或填妥及交回香港交易所網站上之「確實領航星交易平台 – 證券市場的買賣盤價值限制設定」表格 （只提供英文版本）。

營運科
客戶服務部主管
林麗豹　謹啟

[1] 所有參與者一般查詢熱線之通話可能會被錄音。請按此參閱香港交易所的私隱政策聲明。