HKEX
香港交易所

編號 Ref. No.:	MSM/012/25
日期 Date:	31/10/2025

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： **北向程序化交易報告之最新安排**
查詢： PT_MS@hkex.com.hk

參照交易所於 2025 年 4 月 3 日發出關於上海證券交易所（上交所）及深圳證券交易所（深交所）發佈的有關上交所及深交所程序化交易管理實施細則的通告（編號：MSM/004/2025）；2025 年 7 月 11 日發出關於上交所及深交所發佈的北向程序化交易報告指引的通告（編號：MSM/008/25）；及交易所於 2025 年 10 月 17 日發佈的有關北向程序化交易報告之最新安排（編號：CT/147/25），中華通交易所參與者（CCEP） 及透過中華通交易所參與者買賣之交易所參與者（TTEP）請留意以下安排：

高頻交易報告豁免文件清單

根據北向程序化交易報告制度，達到高頻交易標準的北向程序化交易投資者，須根據北向程序化交易報告要求提交高頻交易相關額外資料。然而，如高頻交易投資者符合特定條件[1]，則可獲豁免該項要求。欲申請豁免的高頻交易投資者，除合格境外投資者[2]外，須連同北向程序交易報告表格一併提交相關證明文件。為方便提交流程，高頻交易報告豁免文件清單已上載至「北向程序化交易報告」專區。高頻交易投資者須連同證明文件一併提交已填妥的清單。高頻交易投資者若自認符合特定條件，在提交清單及相關證明文件後無需再提交高頻交易相關額外資料。但完成提交並不代表獲得豁免。上交所或深交所（視情況而定）仍可要求投資者補交與高頻交易相關額外資料。

[1]特定條件詳情請參閱上交所及深交所北向程序化交易報告指引第七條及北向程序化交易填報說明第四條。
[2]合資格境外資者（QFI）如欲申請高頻交易報告豁免應在程序化交易報告中填寫其 QFI 牌照號碼。

技術文件更新

更新後的文件接口規範（只供英文版）已上載至「北向程序化交易報告」專區。CCEP 及 TTEP 須注意高頻交易豁免文件清單及相關證明文件的技術規格。務請 CCEP 及 TTEP 不時參閱交易所網站以獲取最新資訊。

營運科
市場監察部主管
王秉厚　謹啟