

2021年4月28日

致持牌法團的通函

有關適用於買賣盤生命周期的數據標準的提示

證券及期貨事務監察委員會（證監會）提醒持牌法團，留意在 2019 年 7 月 31 日發出的《致持牌法團的通函——適用於買賣盤生命周期的數據標準》（“該通函”）。

總括而言，《適用於買賣盤生命周期的數據標準》（“《數據標準》”）訂明了“該範圍內的經紀行”在應要求向證監會提交與交易相關的數據時的最基本內容及呈列格式，而“該範圍內的經紀行”是指在某個曆年（2018 年或其後年度）內，其有關聯交所上市股票的成交額達至或超過該年總市場成交額的 2% 的持牌證券經紀行。

證券經紀行在首次合資格成為該範圍內的經紀行後，一般來說¹應更改系統及作出其他所需的安排，以便在有關曆年完結後 15 個月內符合《數據標準》。在 2018 年及 2019 年被納入該範圍內的經紀行均須在 2021 年 4 月 30 日或之前作出上述系統更改及安排。

在最近數星期，許多該範圍內的經紀行已向證監會提交其交易數據以作測試，並作出查詢，其中部分屬一般性質，其他則與這些經紀行的具體情況有關²。該範圍內的經紀行為確保它們在 2021 年 4 月 30 日前符合《數據標準》而採取積極的步驟，令本會深感鼓舞。由於本會計劃短期內在視察期間開始進行數據分析，以識別潛在的交易相關失當行為或監控缺失的預警跡象，某些該範圍內的經紀行可能很快便會接獲本會的有關要求。

儘管在 2018 年及 2019 年被納入該範圍內的經紀行是完全相同的，但其他持牌證券經紀行亦可能在 2020 年或其後年度達至或超過上述 2% 門檻。因此，所有尚未屬該範圍內但非常活躍地進行聯交所上市股票交易的持牌證券經紀行，應持續監察及評估其在有關曆年的成交額有否超過觸發水平。如某持牌證券經紀行在 2020 年的成交額超過觸發水平，該經紀行應確保其系統在 2022 年 4 月底或之前已符合《數據標準》。在其他情況下，特別是當成交額只是略微低於觸發水平時，本會亦鼓勵持牌證券經紀行遵守《數據標準》，以便協助內部的監控及監督。

任何持牌證券經紀行如已屬該範圍內的經紀行³，即使它的成交額其後跌至低於觸發水平，該經紀行也應在有關的指定期限後持續符合《數據標準》。因此，在 2018 年及 2019 年被納入該範圍內的經紀行，應由 2021 年 4 月 30 日起便能夠應證監會要求以符合《數據標準》的方式提供數據，而有關要求可涵蓋 2021 年 5 月或其後的任何期間。

¹ 在 2018 年被納入該範圍內的經紀行的系統更改和安排期限，原訂於 2020 年 10 月 30 日，但由於 2019 新型冠狀病毒疫情，有關期限被延長至 2021 年 4 月 30 日。

² 如適用，這些問題已被納入登載於證監會網站的常見問題列表。

³ 請參閱附錄於該通函的《適用於買賣盤生命周期的數據標準》第 6 段。



有關以上內容的任何問題應發送至 sfcdastandards_isd@sfc.hk。

證券及期貨事務監察委員會
中介機構部
中介機構監察科

完

SFO/IS/010/2021