

市場

股票市場交易互聯互通機制

香港證監會與中國證券監督管理委員會(中國證監會)於4月11日發表聯合公告，提高內地與香港股票市場交易互聯互通機制下的每日額度。滬股通及深股通的新額度各為人民幣520億元，而滬港通及深港通下的港股通新額度則各為人民幣420億元。新額度已於5月1日起生效。

投資者識別

我們與中國證監會和香港交易及結算所有限公司(香港交易所)合作，暫定在系統測試和市場演習完成後，於9月在股票市場交易互聯互通機制下的滬股通及深股通中實施投資者識別碼制度。我們會在該制度實施後，盡快為港股通引入類似制度。

對香港交易所的監管

我們在5月批准了香港交易所旗下結算所的建議，以強化結算參與者的准入標準及違約管理程序，進一步與國際慣例看齊。

繼本會在3月批准相關規則的修改後，香港交易所於6月採取加強結算保證基金的措施，包括在結算所供款方面引入以風險為本的方針。

自動化交易服務提供者

	截至 30.06.2018	截至 31.03.2018	變動 (%)	截至 30.06.2017	按年變動 (%)
根據第III部	58	57	1.8	50	16
根據第V部	25	24	4.2	24	4.2

場外衍生工具

本會與香港金融管理局曾於3月就改善場外衍生工具監管制度，以便就匯報責任強制使用法律實體識別編碼¹、擴大結算責任，以及為引入平台交易責任而採用交易確定程序進行諮詢；有關的總結文件已於6月發表。

市場監察

本會與香港交易所在6月完成了一項聯合計劃，以便利對衍生工具交易的監察，這是我們市場監察系統優化的第二階段。

為了更有效地管理市場波動風險，我們改為以自動化方式實時就股價波動對持牌機構財政穩健性的影響發出監察警報。

自動化交易服務

截至6月30日，根據《證券及期貨條例》第III部獲認可的自動化交易服務²有58個，而根據該條例第V部獲發牌提供自動化交易服務的公司則有25家，包括16家黑池營辦商。

¹ 由20個字母及數字組成的獨有編碼，用來識別某金融交易的機構。

² 《證券及期貨條例》下監管自動化交易服務提供者的制度有兩種。提供與傳統交易所或結算所的設施相類似的設施的自動化交易服務提供者，通常根據《證券及期貨條例》第III部獲認可。提供交易服務及以附加設施形式提供自動化交易服務的中介機構，則根據《證券及期貨條例》第V部獲發牌。