

(根據第 134(6)(a) 條發出的公告)

證券及期貨事務監察委員會 ('證監會') 已根據該條例第 134(1) 條所賦予的權力，在 2011 年 7 月 6 日，就根據該條例第 116 條所施加於批給德意志證券亞洲有限公司 ('申請人') 的牌照的條件作出修改。證監會作出有關修改是基於該申請人使證監會信納，作出此寬免將不會損害投資大眾的利益。

在作出修改之前，該申請人的牌照受以下條件所限制，即

牌照條件二

就第 7 類受規管活動而言，持牌人：

(1) 在提供自動化交易服務上：

(a) 只可經在該交易系統 Deutsche Bank Alternative Trading System ('DBATS') 或其他／增添並獲得證券及期貨事務監察委員會批准的交易系統進行；並

(b) 設立黑池作上市證券交易。

(2) 須制訂一套交易方法，使交易得以在該交易系統 ('DBATS') 上公平及有秩序地進行。

(3) 須設立適當的安排，確保：

(a) 需要的已在香港交易所完成的上市證券交易的資訊在設定時限內向香港交易所提交報告；及

(b) DBATS 用戶定期獲得交易分析的資訊。

(4) 須就透過 DBATS 進行的活動保存下列紀錄不少於七年，而該等紀錄應易於取覽，及可隨時轉換成中文或英文的書面形式；並須應證監會的要求提供任何該等紀錄：

(a) 會員資料，包括其登記名稱及地址、准入及終止准入日期、認可交易員及有關詳情，以及客戶協議；

(b) 限制、暫停或終止任何用戶登入的詳情，包括有關的原因；

(c) 由 DBATS 常發給用戶的所有通知及其他資料，不論為書面形式或透過電子形式傳達；

(d) 在 DBATS 上的買賣指示及任何其他行動或活動的時序紀錄，包括：

(i) 買賣指示的接收、執行、修改、取消及屆滿 (視乎適用者而定) 日期及時間；

(ii) 輸入、修改、取消及執行買賣指示的用戶及認可交易員的身分；

(iii) 買賣指示的詳情及買賣指示的任何繼後修改及執行 (視乎適用者而定)，包括但不限於所涉及的證券、買賣指示的證券數量及屬於買方或賣方、買賣指示的種類、任何買賣指示編號、時間及價格限制，以及發出買賣指示的用戶指定的任何其他條件；及

(iv) 分配及重新分配 (視乎適用者而定) 指示的執行的詳情；

(e) 在 DBATS 上進行的交易的每日及每月例行摘要，當中載列：

(i) 已執行交易所涉及的證券；及

(ii) 交易量 (以交易宗數表示)；買賣股份數目；及交收總值。

牌照條件三

就第 7 類受規管活動而言，持牌人：

(1) 須設立適當的安排，以便持牌人：

- (a) 監察在 DBATS 上進行的交易，以識別涉嫌違反任何有關在 DBATS 上公平及有秩序地進行買賣的規則的情況，以及可能構成市場舞弊的行為；
- (b) 向證監會報告涉嫌嚴重違反持牌人有關在 DBATS 上公平及有秩序地進行買賣的規則的情況，或涉嫌市場舞弊行為；及
- (c) 在切實可行的情況下，盡快應證監會的要求向證監會提供有關任何涉嫌違規或涉嫌市場舞弊的相關資料，並就證監會對涉嫌違規或涉嫌市場舞弊進行的查訊或調查向證監會提供全力協助。

(2) 須如在《監管自動化交易服務的指引》(2003 年 3 月) 第 52 段所載列的事宜方面有任何重大更改，尤其是下列指明事宜，須於更改生效前通知證監會：

- (a) 公司架構及管治安排；
- (b) 業務計劃／運作；
- (c) DBATS (包括交易規則、系統營運商、硬件、軟件及其他技術的更改)；
- (d) 可透過 DBATS 進行交易的市場及產品；
- (e) 持牌人在合約下對 DBATS 用戶所負有的責任；及
- (f) 接納或不接納成為 DBATS 用戶的準則。

(3) 須為持牌人本身的運作及 DBATS 設立適當的業務延續計劃及災後恢復程序，並將該等計劃或程序的任何重大更改通知證監會。

牌照條件四

就第 7 類受規管活動而言，持牌人須：

(1) 如 DBATS 的運作出現任何影響會員的重大服務故障或中斷事件，須通知證監會。

(2) 當有關 DBATS 的任何最新獨立檢討報告備妥後，向證監會提供有關報告。

(3) 在每月結束後兩個星期內或在證監會提出要求後向證監會提供以下統計數據：

- (a) 十大最活躍會員各自在 DBATS 上進行各類香港上市證券交易的成交量；及
- (b) 在 DBATS 上及由交易部門進行的各類香港上市證券交易的總成交量。

(4) 為免生疑問，設立安排以確保持牌人及其客戶 (包括 DBATS 的用戶及該等用戶的最終客戶) 均能遵從證監會發出的《客戶身分規則的政策》。

(5) 在每月結束後兩個星期內或在證監會提出要求後向證監會提供每月狀況報告，當中載列 DBATS 用戶的身分及所在地。

條件現已修改為：

牌照條件二

‘就第 7 類受規管活動而言，持牌人：

- (1) 在提供自動化交易服務上：
 - (a) 只可經在該交易系統 SuperX 或其他／增添並獲得證券及期貨事務監察委員會批准的交易系統進行；並
 - (b) 設立黑池作上市證券交易。
- (2) 須制訂一套交易方法，使交易得以在 SuperX 上公平及有秩序地進行。
- (3) 須設立適當的安排，確保：
 - (a) 需要的已在香港交易所完成的上市證券交易的資訊在設定時限內向香港交易所提交報告；及
 - (b) SuperX 用戶定期獲得交易分析的資訊。
- (4) 須就透過 SuperX 進行的活動保存下列紀錄不少於七年，而該等紀錄應易於取覽，及可隨時轉換成中文或英文的書面形式；並須應證監會的要求提供任何該等紀錄：
 - (a) 會員資料，包括其登記名稱及地址、准入及終止准入日期、認可交易員及有關詳情，以及客戶協議；
 - (b) 限制、暫停或終止任何用戶登入的詳情，包括有關的原因；
 - (c) 由 SuperX 常發給用戶的所有通知及其他資料，不論為書面形式或透過電子形式傳達；
 - (d) 在 SuperX 上的買賣指示及任何其他行動或活動的時序紀錄，包括：
 - (i) 買賣指示的接收、執行、修改、取消及屆滿（視乎適用者而定）日期及時間；
 - (ii) 輸入、修改、取消及執行買賣指示的用戶及認可交易員的身分；
 - (iii) 買賣指示的詳情及買賣指示的任何繼後修改及執行（視乎適用者而定），包括但不限於所涉及的證券、買賣指示的證券數量及屬於買方或賣方、買賣指示的種類、任何買賣指示編號、時間及價格限制，以及發出買賣指示的用戶指定的任何其他條件；及
 - (iv) 分配及重新分配（視乎適用者而定）指示的執行的詳情；
 - (e) 在 SuperX 上進行的交易的每日及每月例行摘要，當中載列：
 - (i) 已執行交易所涉及的證券；及
 - (ii) 交易量（以交易宗數表示）；買賣股份數目；及交收總值。’

牌照條件三

‘就第 7 類受規管活動而言，持牌人：

- (1) 須設立適當的安排，以便持牌人：
 - (a) 監察在 SuperX 上進行的交易，以識別涉嫌違反任何有關在 SuperX 上公平及有秩序地進行買賣的規則的情況，以及可能構成市場舞弊的行為；
 - (b) 向證監會報告涉嫌嚴重違反持牌人有關在 SuperX 上公平及有秩序地進行買賣的規則的情況，或涉嫌市場舞弊行為；及
 - (c) 在切實可行的情況下，盡快應證監會的要求向證監會提供有關任何涉嫌違規或涉嫌市場舞弊的相關資料，並就證監會對涉嫌違規或涉嫌市場舞弊進行的查訊或調查向證監會提供全力協助。

(2) 須如在《監管自動化交易服務的指引》(2003年3月)第52段所載列的事宜方面有任何重大更改，尤其是下列指明事宜，須於更改生效前通知證監會：

- (a) 公司架構及管治安排；
- (b) 業務計劃／運作；
- (c) SuperX (包括交易規則、系統營運商、硬件、軟件及其他技術的更改)；
- (d) 可透過 SuperX 進行交易的市場及產品；
- (e) 持牌人在合約下對 SuperX 用戶所負有的責任；及
- (f) 接納或不接納成為 SuperX 用戶的準則。

(3) 須為持牌人本身的運作及 SuperX 設立適當的業務延續計劃及災後恢復程序，並將該等計劃或程序的任何重大更改通知證監會。

牌照條件四

就第7類受規管活動而言，持牌人須：

- (1) 如 SuperX 的運作出現任何影響會員的重大服務故障或中斷事件，須通知證監會。
- (2) 當有關 SuperX 的任何最新獨立檢討報告備妥後，向證監會提供有關報告。
- (3) 在每月結束後兩個星期內或在證監會提出要求後向證監會提供以下統計數據：
 - (a) 十大最活躍會員各自在 SuperX 上進行各類香港上市證券交易的成交量；及
 - (b) 在 SuperX 上及由交易部門進行的各類香港上市證券交易的總成交量。
- (4) 為免生疑問，設立安排以確保持牌人及其客戶 (包括 SuperX 的用戶及該等用戶的最終客戶) 均能遵從證監會發出的《客戶身分規則的政策》。
- (5) 在每月結束後兩個星期內或在證監會提出要求後向證監會提供每月狀況報告，當中載列 SuperX 用戶的身分及所在地。

2011年7月15日

證券及期貨事務監察委員會發牌科高級經理鄭嘉慧