

外國指數股票型基金(ETF)與特別股相關交易規則

■ 交易所規定最小價格變動單位、拒單規則與下單漲跌幅控管

■ 美股 ETF 與普通股、特別股

- 最小價格變動：美股以 0.01 美元為報價單位
- 拒單規則：
 - 盤前時段：(實際仍需以上手回覆狀態為準)
 - 價格：
 - 委買價以高於盤前參考價的 15%設為上限
 - 委賣價以低於盤前參考價的 15%設為下限
 - 委託股數高於 20 日均量的 35%
 - 委託金額高於 2,500 萬美元
 - 委託股數高於 200 萬股
 - 盤中時段：(實際仍需以上手回覆狀態為準)

股價區間	委託限制
股價 ≤ 25	委買價以高於現價的 10% 為上限，委賣價以低於現價的 10% 為下限
25 < 股價 ≤ 50	委買價以高於現價的 5% 為上限，委賣價以低於現價的 5% 為下限
50 < 股價	委買價以高於現價的 3% 為上限，委賣價以低於現價的 3% 為下限

資料來源：元大證券，110/12/01。

■ 港股 ETF 與普通股

- 最小價格變動單位如下表，盤中即時委託機制須符合，買進上 9 檔、下 24 檔 / 賣出下 9 檔、上 24 檔之規定，若不符規定則會進行拒單。

個股		ETF	
股價區間	價格跳動單位(1檔)	股價區間	價格跳動單位(1檔)
0.01~0.25(含)	0.001	0.01~1.00(含)	0.001
0.25(不含)~0.50(含)	0.005	1.00(不含)~5.00(含)	0.002
0.50(不含)~10.00(含)	0.010	5.00(不含)~10.00(含)	0.005
10.00(不含)~20.00(含)	0.020	10.00(不含)~20.00(含)	0.010
20.00(不含)~100.00(含)	0.050	20.00(不含)~100.00(含)	0.020
100.00(不含)~200.00(含)	0.100	100.00(不含)~200.00(含)	0.050
200.00(不含)~500.00(含)	0.200	200.00(不含)~500.00(含)	0.100
500.00(不含)~1,000.00(含)	0.500	500.00(不含)~1,000.00(含)	0.200
1,000.00(不含)~2,000.00(含)	1.000	1,000.00(不含)~2,000.00(含)	0.500
2,000.00(不含)~5,000.00(含)	2.000	2,000.00(不含)~9,999.00(含)	1.000
5,000.00(不含)~9,995.00(含)	5.000		

資料來源：香港交易所，https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Rules-and-Forms-and-Fees/Rules/SEHK/Securities/Rules/Sch_02.pdf?la=zh-HK，110/12/01。