

## 於 2010 年 1 月 18 日實施提升 AMS/3 容量及提高市場資料播送訊息量後之穩定期期間的系統轉回安排

### 1 序言

於 2010 年 1 月 18 日實施提升 AMS/3 容量及提高市場資料播送訊息量至每秒 3,000 個買賣盤及每秒 700 個股份更新資料後，將會有為期兩週的穩定期。而在穩定期期間，交易所會以備用模式保存原有之 AMS/3 系統版本作應變安排之用。在不太可能發生的情況下，若 AMS/3 系統需要轉回至提升前的版本，將會在交易恢復之前啓動已制定之系統轉回安排。系統轉回需要 2.5 小時才可完成，在這情況下，若於上午發生故障，交易將會於下午交易時段恢復；若於下午發生故障，交易將會於下一個交易日恢復。交易所參與者需留意及遵守下列所述的系統轉回安排，而此系統轉回安排交易所參與者亦已於以前之常規事故復原演習中演習過。

### 2 系統轉回安排

#### 2.1 提供於系統發生故障前的成交資料給交易所參與者

##### 於系統發生故障前的所有成交資料

根據現時習慣，交易所參與者應可透過以下日常渠道獲得/收取所有於系統發生故障前的成交資料，以作核對、客戶確認及其他目的：

##### *AMS/3 終端機用戶*

交易所參與者必須於系統發生故障後的一小時內於其終端機按「TRAN ENQ」鍵列印完整的成交資料。隨後系統將會清除所有儲存於終端機內的成交資料。

##### *OG/MWS 用戶*

交易所參與者必須於系統發生故障後的一小時內經由其 MWS 透過中央傳輸交易資料功能下載完整的成交資料。隨後系統將會清除所有儲存於 MWS 內的成交資料。

##### *OG/BSS 用戶*

交易所參與者必須經由其 OG 透過中央傳輸交易資料功能下載完整的成交資料及必須確保其 BSS 將能夠保存此資料作為其交易及結算運作。

##### 系統發生故障前的最後五分鐘的成交資料<sup>1</sup>

爲了方便交易所參與者分辨任何因系統發生故障而遺失的成交，交易所將會透過參與者電子通訊系統提供於系統發生故障前的最後五分鐘的成交資料（成交資料技術說明書見附件二）予交易所參與者。有關成交資料檔案將於系統發生故障後的一小時內以電郵形式個別發放至交易所參與者的參與者電子通訊系統中的電子郵箱內，而成交資料的顯示方式與現時之成交紀錄格式相同。交易所參與者必須確保此類成交資料收妥並由有關授權代表處理。如果發現有任何差異會以此檔案的成交資料作準。現附上（見附件三）在緊急情況下可透過參與者電子通訊系統查閱成交記錄檔案的步驟以便參考。

---

<sup>1</sup> 祇提供被交易所系統確認的成交資料。

## 2.2 系統故障前輸入的未完成買賣盤

系統恢復後將不會保留系統故障前輸入的未完成買賣盤。系統將會重新啓動而中央買賣盤記錄亦會重新開始。交易所參與者需於交易恢復後再重新輸入其未完成的買賣盤（如適當）。

## 2.3 交易恢復後的首個證券價格

經調整公司活動後（例如：股息費用，股份合併等）（如適用）的上一個交易日收市價將會成爲下午恢復交易時的首個按盤價<sup>2</sup>。交易所參與者於輸入其買賣盤至 AMS/3 系統前必須小心了解系統故障後的證券市場狀況。

## 2.4 交易恢復後的即時市場資料

當下午恢復交易後，恒生指數系列會採用上一個交易日的收市價指數。於系統發生故障前的交易資料及資訊（例如最高、最低成交價、成交額等）將不會轉帶，並將會重新計算（如新一日開始時一樣）。交易所參與者必須留意交易所透過交易所訊息或其他方式的通知。

## 2.5 開市報價規則的放寬

開市報價規則（即交易所規則的規則 503 條）於交易恢復時將會被放寬（即輸入買賣盤不會局限於 +/- 24 個價位的限制）。因此當輸入買賣盤價時交易所參與者必須小心。

## 2.6 於收市後提供合併成交檔案

一個合併成交資料檔案包括於系統發生故障前及交易恢復後的成交（如適用），將會透過現時的成交資料傳送系統服務在收市後發放至交易所參與者。但是，發放服務的開始時間預計將會有大概二小時之延遲（即下午 6 時 30 分開始）。爲避免於系統發生故障前的成交參考編號會被重複，所有於系統恢復後的成交（如適用），其參考編號將會由“100000”開始。

## 2.7 日報表

記載於日報表內的相關市場資料，例如最高/低、收市價等，將根據系統發生故障前及恢復後的合併股份及成交資料作調整。

## 2.8 反駁成交/成交修正

交易所參與者於系統發生故障前經 AMS/3 自動對盤或輸入的成交將不可以於當日進行反駁。交易所參與者須根據交易取消/修正批核程序於下一個交易日的上午 10 時 15 分前個別申請取消有關成交。而有關成交亦只能於下一個交易日由交易所取消。

有關系統轉回安排的進一步資料，請致電參與者一般查詢熱線 2840-3626，有關技術問題的進一步資料，請致電技術支援熱線 2840-3351。

---

<sup>2</sup> 不適用於試驗計劃的證券。