

編號 Ref. No.:	MO/DT/255/20
日期 Date:	24/11/2020

香港交易及結算所有限公司是《證券及期貨條例》所述的認可控制人，亦為香港聯合交易所有限公司、香港期貨交易所有限公司、香港中央結算有限公司、香港聯合交易所期權結算所有限公司、香港期貨結算有限公司及香港場外結算有限公司的控制人。

Hong Kong Exchanges and Clearing Limited is a recognized exchange controller under the Securities and Futures Ordinance which is the controller of The Stock Exchange of Hong Kong Limited, Hong Kong Futures Exchange Limited, Hong Kong Securities Clearing Company Limited, The SEHK Options Clearing House Limited, HKFE Clearing Corporation Limited and OTC Clearing Hong Kong Limited.

通告 CIRCULAR

事項： 有關 HKATS 於 2021 年之計劃項目

查詢： HKATS 熱線¹ 2211-6360

香港交易及結算所有限公司（「香港交易所」）計劃於 2021 年實施一系列與 HKATS 電子交易系統（「HKATS」）及其他衍生產品市場系統有關之項目。為了使交易所參與者能為這些項目作出規劃及準備，請參閱下列的暫定時間表：

¹ 所有 HKATS 熱線之來電均會被錄音。有關本交易所的私隱政策聲明請參閱以下網址：

http://www.hkex.com.hk/chi/global/privacy_policy_c.htm

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2021 年第一季	優化市場波動調節機制 (VCM) 和開市前議價時段 (POS)	<p>市場波動調節機制 (VCM) : 允許市調機制同一交易時段多次觸發。</p> <p>開市前議價時段 (POS) : 在開市前議價時段引入隨機停止機制，以防止在競價時段將結束時操控「擬定開市價」的買賣策略。</p> <p>對參與者的影響 : 這優化計劃只涉及 HKATS 設置上改動。儘管如此，交易所參與者亦應為其系統作出評估。</p> <p>有關優化計劃的詳細安排將於 2020 年 12 月公佈。</p>
2021 年第一季	衍生產品市場交易系統基礎設施升級及搬遷後備數據中心	<p>為應對市場和業務發展需要，香港交易所將於 2021 年第一季升級 HKATS 的基礎設施以及搬遷後備數據中心。</p> <p>對參與者的影響 : 為確保升級後的業務連續性，全市場交易所參與者必須參與計劃於 2021 年第一季舉行的強制性市場演習。</p> <p>相關的詳細安排將於 2020 年 12 月公佈。</p>

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
措施落實時間需視乎市場參與者的意見及監管機構的批准	就指定上市衍生產品於香港公眾假期買賣的系統及技術準備	<p>為便利交易所參與者於香港公眾假期期間作出所需的交易及風險管理安排，香港交易所計劃將指定上市衍生產品合約的交易及結算服務延展至包括香港公眾假期。</p> <p>對參與者的影響： 有興趣於香港公眾假期交易的交易所參與者需要參與市場演習及 / 或實習環節去核實其營運程序及系統準備狀況。</p> <p>本項目推出之詳細資料包括時間表將另行通知。</p>
2021 年第一季及第四季	更新 HKATS Online 及 HKATS Risk Functions 之 Google Chrome 瀏覽器版本	<p>為配合 HKATS Online 及 HKATS Risk Functions 之 Google Chrome 瀏覽器的版本升級，香港交易所計劃每年提升 Google Chrome 瀏覽器版本最少兩次。</p> <p>對參與者的影響： 交易所參與者必須根據香港交易所的要求提升其 HKATS Online 和 HKATS Risk Functions 之 Google Chrome 瀏覽器的版本。</p> <p>有關版本之升級安排將於 2020 年 12 月及 2021 年第三季公佈。</p>

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2021 年第三季	推出新的配對引擎	<p>為應對引進新產品的需要以及降低旗艦產品系統集中性風險，香港交易所計劃在 2021 年第三季度初安裝額外兩個配對引擎。</p> <p><u>對參與者的影響：</u> 為確保升級後的業務連續性，市場交易所參與者必須參與暫定計劃於 2021 年第二季舉行的強制性市場演習。</p> <p>相關的詳細安排將於 2021 年第一季度公佈。</p>
2021 年第三季	應對緊急情況之市場演習	<p>為協助交易所參與者驗證其系統在緊急情況下的運作能力，香港交易所將於 2021 年第三季舉行強制性的市場演習。</p> <p><u>對參與者的影響：</u> 市場交易所參與者必須參與該市場演習以確保在緊急情況下其端到端系統和營運能正常運作。</p> <p>有關市場演習的詳細安排將於 2021 年第二季度公佈。</p>

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2021 年第四季	衍生產品市場前端監控風險管理系統 2.0	<p>為保障衍生產品市場的正常秩序，香港交易所計劃提升前端監控風險管理系統，以此交易所參與者能調較一段時間範圍內的風險限額，從而為交易所參與者提供多一重風險控制能力。</p> <p>對參與者的影響： 交易所參與者必須參與市場演習，並需要與香港交易所合作設定新的風險限額。</p> <p>有關市場演習的詳細資料及時間表將於 2021 年第三季 公佈。有關交易所參與者簡報會及培訓將另行通知。</p>
持續進行中	強制性重新認證 OAPI 應用程式	<p>為確保交易所參與者的 OAPI 應用程式符合最新的 HKATS 軟件版本，對於長時間未進行重新認證測試的 OAPI 應用程式，必須進行強制性的重新認證測試。</p> <p>對參與者的影響： 交易所參與者必須每三年重新認證其 OAPI 應用程式。</p>

香港交易所強烈鼓勵交易所參與者聯絡其資訊科技部門或系統供應商以作適當的計劃及準備。如有任何查詢，請致電 HKATS 熱線 2211 6360。

市場科
交易營運
聯席主管
何耀昌 謹啟

本通告已以英文及另以中文譯文刊發。如本通告中文本的字義或詞義與英文本有所出入，概以英文本為準。