

(生效日期：二零二四年七月二十二日)

香港期貨交易所有限公司

HKATS 電子交易系統交易程序

本交易所並未刊發香港期貨交易所有限公司 HKATS 電子交易系統交易程序的中文印刷版本。本網頁所登載的香港期貨交易所有限公司 HKATS 電子交易系統交易程序的中文譯本僅供公眾參考，不得視之為真確正本。公眾人士須參閱該等程序的英文印刷版本連同有關修訂或更改附頁為真確正本。中文譯本文義如與英文印刷版本有歧異，概以英文印刷版本為準。

目錄

第一章	HKATS 電子交易系統的操作	頁次
1.1	HKATS 電子交易系統	3
1.2	透過 HKATS 電子交易系統進行交易	3
1.3	期貨結算所的結算系統	3
1.4	交易時間	3
第二章	聯通 HKATS 電子交易系統	
2.1	聯通技術要求	3
2.2	聯通資格	4
2.3	聯通HKATS電子交易系統的申請程序	4
2.4	保安措施	5
2.5	[已刪除]	
2.6	[已刪除]	
第三章	買賣功能	
3.1	中央買賣盤賬目	6
3.2	買賣盤賬目	7
3.3	買賣盤類別	7
3.4	輸入限價盤	8
3.5	取消買賣盤	8
3.6	利用執行買賣盤視窗執行買賣盤	9
3.7	買賣盤排序及對盤	9
3.8	價格資訊	10
3.9	市場成交記錄	10
3.10	買賣盤記錄	11
3.11	市場訊息	11
3.12	[已刪除]	
3.13	交易記錄	11
3.14	大手交易	11
3.15	[已刪除]	
3.16	開市前議價時段	11
第四章	莊家	
4.1	莊家	12
4.2	莊家報價	12
4.3	HKATS 電子交易系統中的莊家活動	12
4.4	監察莊家	12
4.5	莊家戶口	12
第五章	客戶按金	
5.1	追收按金	13
5.2	客戶按金	13

第六章	報告服務	
6.1	市場成交記錄視窗	13
6.2	交易記錄視窗	13
第七章	應變程序	
7.1	系統故障	14
7.2	[已刪除]	
7.3	設備故障	14
7.4	[已刪除]	
7.5	[已刪除]	
附錄 I—[已廢除]		
附錄 II—[已廢除]		

HKATS 電子交易系統交易程序（「程序」）應與期交所規則一併閱讀，並屬期交所規則一部分。除另有所指外，本程序所用詞彙與香港期貨交易所有限公司（「期交所」）及香港期貨結算有限公司（「期貨結算所」）的規則所載者具有相同含義。本程序與期交所規則或期貨結算所規則如有歧義，概以期交所規則及期貨結算所規則為準。

第一章 HKATS 電子交易系統的操作

1.1 HKATS 電子交易系統

HKATS 電子交易系統是期交所營運的交易系統，其主機配置由期交所提供，而交易工作站則位於交易所參與者的處所。交易所參與者使用其根據期交所向他們分判牌照的 HKATS 電子交易系統應用程式界面軟件（「應用程式界面」）所開發出來的應用程式，或透過期交所批准交易所參與者登入的瀏覽器前置應用程式 HKATS Online，聯通 HKATS 電子交易系統中央交易網關而在 HKATS 電子交易系統進行交易。HKATS 電子交易系統的功能載於《HKATS 使用者指南》中。

1.2 透過 HKATS 電子交易系統進行交易

交易所參與者如欲以 HKATS 電子交易系統進行交易，必須透過 HKATS 電子交易系統輸入買賣盤及／或報價以供自動對盤。除期交所規則、規例及程序或期貨結算所規則及程序另有規定外，緊隨期貨期權合約已對盤及合約交易詳情已記入系統的交易登記冊後，並在期貨期權合約已獲有效執行的前提下，交易詳情會被傳送到期貨結算所的結算系統中，供進行期貨期權合約的登記、結算及交收。

1.3 期貨結算所的結算系統

期貨結算所專責處理在期交所或透過期交所設施完成的所有期貨及期權合約（「期貨期權合約」）的結算及交收，並作為期貨期權合約的對手。

1.4 交易時間

適用於期交所運作的每個「市場」的交易時間可能不同。交易所參與者應參閱每個個別「市場」適用的合約細則，以釐定有關「市場」適用的交易時間。

第二章 聯通 HKATS 電子交易系統

2.1 聯通技術要求

交易所參與者聯通HKATS電子交易系統的硬件、軟件、網絡配置及費用要求已於期交所－HKATS電子交易系統的使用及許可協議（定義見下文第2.3.1條）列明。期交所可不時預先通知交易所參與者而更改該等規定。有關聯通HKATS電子交易系統的規定詳情亦刊登在香港交易及結算所有限公司（「香港交易所」）的網站內供交易所參與者查閱。

要聯通 HKATS 電子交易系統，交易所參與者亦須向期交所批准的電訊供應商訂用數據通訊網絡服務。電訊線路應為可支持多條接駁 HKATS 電子交易系統的線路的數據線。期交所會不時訂明聯通 HKATS 電子交易系統的頻寬要求及連線數目上限。

2.2 聯通資格

在以登記方式獲期交所事先批准後，所有交易所參與者均有資格透過HKATS電子交易系統進行交易。已登記透過HKATS電子交易系統進行交易的交易所參與者可透過使用應用程式界面的應用程式或HKATS Online，聯通HKATS電子交易系統中央交易網關而進行交易。這實際上是交易所參與者聯通HKATS電子交易系統的唯一途徑。交易所參與者須按下文第2.3條所規定方式，就每個應用程式界面或HKATS Online連接申請及簽署期交所－HKATS電子交易系統的使用及許可協議，方可聯通HKATS電子交易系統。

2.3 聯通 HKATS 電子交易系統的申請程序

以下概述有意透過 HKATS 電子交易系統進行交易的交易所參與者的申請程序：

2.3.1 簽署使用及許可協議

交易所參與者須按照期交所不時可能規定的方式，簽署一份使用及許可協議（「期交所－HKATS 電子交易系統使用及許可協議」）。

交易所參與者亦須簽署期交所不時可能規定的其它有關表格，如期交所不時規定並於香港交易所網站登載的要求聯通 HKATS 電子交易系統表格。

2.3.2 (已刪除)

2.3.3 至 2.3.4 (已刪除)

2.3.5 分配新使用者名稱及使用者節點

當收到經簽署的期交所－HKATS 電子交易系統使用及許可協議以及填妥要求聯通 HKATS 電子交易系統的表格後，期交所會通知有關的交易所參與者其 HKATS 電子交易系統使用者名稱及密碼，以聯通至 HKATS 電子交易系統。交易所參與者須遵從期交所不時訂明及建議有關使用 HKATS 電子交易系統使用者名稱及密碼的保安及監控措施。要求聯通 HKATS 電子交易系統的表格所載資料如有任何改動（包括刪除 HKATS 電子交易系統使用者名稱），交易所參與者須知會期交所。

2.3.6 (已刪除)

2.3.7 (已刪除)

2.3.8 取消交易所參與者的聯通／使用者名稱／交易所參與者節點

交易所參與者如欲終止透過 **HKATS** 電子交易系統交易，可填妥期交所不時規定並於香港交易所網站登載的終止聯通 **HKATS** 電子交易系統表格，向期交所提交申請。

2.3.9 重設使用者密碼

交易所參與者可填妥期交所不時規定並於香港交易所網站登載的重設密碼申請表格，向期交所申請重設密碼或重發密碼通知信。

2.4 保安措施

保安控制共有三個層面，即硬件層面、應用程式層面及使用者層面。

在硬件層面，登記交易所參與者的節點僅可透過期交所規定的授權程序連接至網絡。當使用者嘗試透過一個交易所參與者節點登入**HKATS**電子交易系統主電腦時，**HKATS**電子交易系統會自動核實節點地址以檢查其是否獲授權。若無適當授權便不能聯通。

在應用程式層面，交易所參與者可透過應用程式界面或**HKATS Online**聯通**HKATS**電子交易系統主電腦。應用程式界面或**HKATS Online**是聯通**HKATS**電子交易系統以確保高系統完整性的唯一方法。

在使用者層面，由於設有使用者名稱及密碼控制，未獲授權者因而無法聯通及使用系統。所有有效使用者均會獲發一個獨特的使用者名稱、密碼及識別號碼。當一名使用者嘗試登錄時，**HKATS**電子交易系統會查閱主機系統的中央數據庫以檢查該使用者名稱是否已經登記。使用者名稱亦須與密碼配合。未能符合任何上述條件均會導致被拒絕聯通。

所有交易所參與者及其登記 **HKATS** 使用者均有責任對獲分配的密碼保密。

基於保安理由及為確保每個使用者類別的獨特性，其授權及聯通能力將分別局限於多套不同的可執行交易指示類別及功能表類別。

2.5 [已刪除]

2.6 [已刪除]

第三章 買賣功能

本章載列在 **HKATS** 電子交易系統中可提供的主要買賣功能。有關該等功能的詳細輸入程序在《**HKATS** 使用者指南》及《**HKATS** 電子交易系統風險功能用戶指引》中有更詳盡說明。

3.0 HKATS 電子交易系統風險監控及功能

交易所參與者須設有安排，確保所有傳送至 HKATS 電子交易系統的買賣盤均受指定風險監控及其他適當的風險監控及功能的規限。

3.1 中央買賣盤賬目

HKATS 電子交易系統會就每個到期月份、期權系列及系列名稱存置一套中央買賣盤賬目。輸入 HKATS 電子交易系統的買賣盤會記存在有關的中央買賣盤賬目中，並會與其它買賣盤對盤或記存於中央買賣盤賬目中（視乎情況而定）。

於交易時間內，交易所參與者僅可在 HKATS 電子交易系統輸入限價盤。交易所參與者亦可就限價盤規定若干條件，包括「特定時間」、「當日有效盤」、「直至到期」、「全額或取消」及「成交及取消」。

3.1.1 可記存於中央買賣盤賬目的限價盤（僅限於不附帶「全額或取消」及「成交及取消」條件的限價盤）會繼續留在中央買賣盤賬目中，直至發生任何以下事件為止：

- a) 有關限價盤與新輸入的買賣盤全部或部分對盤。若該買賣盤全部對盤，會從中央買賣盤賬目中取消；若僅部分對盤，則餘下部分會記存於中央買賣盤賬目中，直至已對盤、取消或處於適用時段（視乎情況而定）為止；
- b) 輸入限價盤的授權人士或同一交易所參與者的另一名授權人士取消該買賣盤，或作出會影響排列優先次序的更改；
- c) 交易所職員應一名交易所參與者的要求更改或取消有關買賣盤；
- d) 因懷疑有行為失當，交易所職員取消該買賣盤或該交易所參與者輸入的所有其它買賣盤；
- e) 於該買賣盤的特定有效期屆滿、特定 SMP 識別碼對相關交易所參與者不再有效或特定 SMP 識別碼的 SMP 指示如此設定時，HKATS 電子交易系統將自動取消該買賣盤；
- f) 當一名授權人士的所有買賣盤因本身交易工作站與主電腦失去接駁而 HKATS 電子交易系統自動將該買賣盤轉為不動盤；
- g) 在有關交易所合約暫停買賣情況下，HKATS 電子交易系統自動取消該買賣盤；
- h) 在「市場」情況需要採取有關行動情況下，期交所可取消該買賣盤以及指定有效時限為「當日有效盤」的所有其它買賣盤；或
- i) HKATS 電子交易系統會於 T 時段結束時自動將該買賣盤轉為不動盤（如適用），授權人士訂明該買賣盤在 T+1 時段亦屬有效者作別論。有效時間超逾同一個交易日的不動盤於下一個交易日的 T 時段開始時自動重新啟動。

3.1.2 HKATS 電子交易系統的「價格深度視窗」可顯示中央買賣盤賬目中記存的任何特定到期月份、期權系列或系列名稱的最佳買入及賣出價以及各自的數量。該視窗可顯示每個到期月份、期權系列或系列名稱的每個買入及賣盤深達 5 條價格輪候隊伍的價格深度。

3.2 買賣盤賬目

「買賣盤賬目視窗」顯示記存於有關中央買賣盤賬目的買賣盤。該視窗會顯示每個買賣盤的買入及賣出價、數量及有效時限以及輸入買賣盤的 HKATS 電子交易系統使用者名稱。該視窗還有助授權人士執行以下功能：

- 3.2.1 取消 — 此功能可取消買賣盤及不動盤。
- 3.2.2 停止啓動 — 此功能一次可停止啓動一個或多個買賣盤。
- 3.2.3 啓動 — 此功能可啓動不動盤。若記存於中央買賣盤賬目的買賣盤是不動盤但其後被啓動，則其將失去先前的排列優先次序而作為新買賣盤處理，而其排列位置會於當時決定。
- 3.2.4 更改 — 此功能可更改買賣盤的詳情（如價格、數量、有效時限等）。若干更改不會導致失去優先次序。減少數量、更改有效時限及修訂自由文本資料，將不會影響買賣盤的原有優先次序。在交易時間或開市前議價時段內增加買賣盤數量或更改價格，會導致失去原買賣盤的時間優先權。授權人士如欲保持原買賣盤的輪候位置，應就增加的數量輸入一個新買賣盤而保持原買賣盤的數量不變。交易時段（若開市前議價時段不適用）前 30 分鐘期間內不得增加買賣盤數量或更改價格。

3.3 買賣盤類別

買賣盤分為兩類，即「限價盤」及「競價盤」。

3.3.1 「限價盤」

「限價盤」指規定買入價或賣出價的買賣盤。「限價盤」可指定以下有效時限：

(a) 「全額或取消」

整套買賣盤須按指定數量全額完成配對，否則整套買賣盤會被取消。

(b) 「成交及取消」

買賣盤可盡量完成配對到指定數量，而餘下未完成配對的買賣盤會被取消。

(c) 「當日有效盤」

買賣盤維持有效至同一交易日結束為止。若整套買賣盤至同一交易日結束前仍未對盤或取消，則 HKATS 電子交易系統會自動取消仍然在市場的該部份買賣盤。

(d) 「特定時間」

買賣盤維持有效至買賣盤中指定日期為止。若整套買賣盤至該日期前仍未對盤或取消，則 **HKATS** 電子交易系統會自動取消仍然在市場的該部份買賣盤。

(e) 「直至到期」

就有到期月份或期權系列的交易所合約而言，若指定該條件，則買賣盤會維持有效至該買賣盤已對盤、取消或有關合約到期為止。就無到期日的交易所合約而言，指定該條件即表示該買賣盤會維持有效至已對盤或交易所參與者發出進一步指示為止（即有效至取消）。

3.3.2 「競價盤」

指並無指定買入／賣出價，於開市前議價時段的開市前時段或開市前分配時段輸入 **HKATS** 電子交易系統並按擬定開市價格執行的買賣盤。

3.4 輸入限價盤

指定有效時限的限價盤可透過「輸入買賣盤視窗」輸入。該視窗可透過 **HKATS Online** 功能表條內的「Order Actions」開啓。授權人士應根據需要輸入識別資料（即到期月份、期權系列或系列名稱）、價格及數量。於確認後買賣盤即已輸入。任何未對盤的買賣盤繼而會在中央買賣盤賬目中顯示。

限價盤亦可透過「執行買賣盤視窗」輸入，進一步詳情請見第 3.6 條。

3.4.1 已輸入中央買賣盤賬目的限價盤須包含以下資料：

- a) 時間、到期月份、期權系列或系列名稱（如適用）；
- b) 買入或賣出；
- c) 價格；
- d) 數量；及
- e) 有效時限或條件。

3.4.2 戳記時間規則

每名交易所參與者均須記錄客戶發出交易指示的時間、日期及完成資料，從而即時戳記自客戶收到每個買賣盤的時間。就透過 **HKATS** 電子交易系統進行的交易而言，**HKATS** 電子交易系統接納買賣盤的時間及執行交易的時間會在 **HKATS** 電子交易系統中自動記錄。

3.5 取消買賣盤

「取消買賣盤視窗」用於取消由某授權人士輸入的所有買賣盤，或由所有授權人士所輸入而涉及某交易所參與者的所有買賣盤。於確認後買賣盤即會取消。

就取消單一買賣盤或指定買賣盤而言，應利用上述「買賣盤賬目視窗」。

3.6 利用執行買賣盤視窗執行買賣盤

授權人士亦可利用「執行買賣盤視窗」執行買賣盤，方法是雙擊「價格資訊視窗」、「價格深度視窗」或「買賣盤深度視窗」（視乎所想執行的買賣盤動作）中買入價或賣出價（「參考價」）其中一邊。

「執行買賣盤視窗」會顯示「價格」、「數量」及「平均價」各欄。若不作出調整，「價格」欄會顯示「參考價」，即代表授權人士可就「數量」欄內註明數量執行一個買賣盤的最差買入價或賣出價（視乎情況而定）。「數量」欄會顯示可供按「參考價」執行的總數量，而參考價（如適用）會包括「市場」內可提供的所有較佳買入價或賣出價。「平均價」欄會顯示授權人士可按「數量」欄內顯示的數量執行買賣盤的指示平均價。「價格」及「數量」欄可透過將有關箭號上下滾動而予以調整。若授權人士更改價格水平或數量，則「數量」或「價格」欄（視乎情況而定）以及「平均價」欄會自動重新計算。若有關「市場」可提供數量少於「數量」欄註明的數量，則「平均價」欄內會顯示「零」以反映該情況。若授權人士確認買賣盤，則買賣盤會按「市場」內當時可提供的數量執行。有效時限亦須註明：(i)全額或取消；或(ii)成交及取消（預設值）。

輸入限價盤時，授權人士須於「價格」欄內註明價格，即其須設定按「市場」可提供數量執行買賣盤的最低或最高價。

3.7 買賣盤排序及對盤

對 HKATS 電子交易系統收到的買賣盤進行排序及對盤的主要規則，是首先根據最佳價格（即最高買入價及最低賣出價有最高優先權），其次則根據 HKATS 電子交易系統收到買賣盤的時間來排列優先次序。HKATS 電子交易系統運用對盤、排序及價格的多個方法，載述於下文第 3.7.1、3.7.2 及 3.7.3 條。莊家所提供報價亦須按照同樣的排序、對盤及價格方法。

3.7.1 對盤方法

交易時間內的對盤方法如下：

當一個買賣盤輸入 HKATS 電子交易系統後，HKATS 電子交易系統會盡可能地將該買賣盤與收到該買賣盤時中央買賣盤賬目中記存的限價盤對盤。除非直至所有記存的可對盤的限價盤已獲對盤，否則於該買賣盤輸入後才輸入 HKATS 電子交易系統的買賣盤不會與該買賣盤對盤。

- i) 將該買賣盤盡可能地與記存於中央買賣盤賬目中反映最佳價格並且在中央買賣盤賬目中記存時間最長（最高優先權）的限價盤對盤。
- ii) 繼而與中央買賣盤賬目中記存的具有其次最高優先權的限價盤對盤，如此類推。

若 HKATS 電子交易系統的開市前議價適用於有關交易所合約，則開市前議價時段內對盤須按照期交所規則、規例及程序中規管該合約的程序所述方法。

3.7.2 排序方法

買賣盤排序亦採用價格／時間優先權方法。以下買賣盤的更改不會導致失去其在中央買賣盤賬目中的優先權：

- a) 減少數量；
- b) 更改有效時限；及
- c) 更改自由文本。

除上述者外，所有其他對買賣盤作出的更改，均會影響其在中央買賣盤賬目中的優先權（請亦見上文第 3.2.4 條）。

若 HKATS 電子交易系統的開市前議價適用於有關交易所合約，則開市前議價時段內競價盤及限價盤的排序須按照期交所規則、規例及程序第 1209 條所述方法。

3.7.3 價格方法

買賣盤中可註明價格條件以限制買賣盤可對盤的價格。例如，授權人士若有意在 100 的價位買入，亦同樣會同意在 100 及 99 的價位買入，但未必會同意在 101 的價位買入。限價盤表示買方願意支付的最高價或賣方願意接受的最低價，而該等參數可透過在買賣盤中指定「限」價來設定。

在嘗試為限價盤對盤時，可能出現以下三種情況：

- a) 賣出「限」價可能低於買入「限」價；
- b) 賣出「限」價可能高於買入「限」價；及
- c) 賣出「限」價可能等於買入「限」價；

就上述第一種情況而言，會按中央買賣盤賬目中所記存買賣盤的「限」價對盤。

3.8 價格資訊

「價格資訊視窗」內顯示的資料包括每個到期月份、期權系列或系列名稱的當時最佳買入價及賣出價以及各自數量、最後成交價和數量、當日最高、當日最低及每日成交量。所有該等資料均會實時更新。

3.9 市場成交記錄

「市場成交記錄視窗」顯示所有交易所參與者執行的期貨期權合約的有關資料。所顯示資料包括：到期月份、期權系列或系列名稱（視乎情況而定）；成交價；執行時間；數量以及交易是否屬大手交易。授權人士可選擇首先按「市場」及其次按以下分類查看資料：

-
-
- | | | |
|-------|---|-------------------------------|
| a) 本身 | — | 該特定授權人士完成的交易； |
| b) 公司 | — | 交易所參與者公司的交易，不包括由該特定授權人士完成的交易； |
| c) 外部 | — | 其它交易所參與者完成的交易。 |

3.10 買賣盤記錄

「買賣盤記錄視窗」提供某特定交易所參與者公司的買賣盤的當前狀況的有關資料。

3.11 市場訊息

期交所會不時利用「市場訊息視窗」公佈重要資訊。交易所參與者應時刻保持該視窗處於開啓狀態。

3.12 [已刪除]

3.13 交易記錄

「交易記錄視窗」顯示授權人士本身的交易所參與者公司所進行交易的資料。

3.14 大手交易

涉及同一交易所參與者公司的客戶或一名客戶與該交易所參與者的公司戶口或莊家戶口間的大手交易，可使用大手交易機制進行。

有關大手交易程序及標準的詳情，請參閱期交所規則、規例及程序。

3.15 [已刪除]

3.16 開市前議價時段

開市前議價機制主要旨在於適用「市場」開市前設定開市價，以防開市時出現大幅價格波動及操縱價格情況。

HKATS 電子交易系統的開市前議價將適用於期交所可能不時通知交易所參與者的交易所合約。

有關 HKATS 電子交易系統開市前議價的詳情，請參閱期交所規則、規例及程序所載個別市場各自的交易程序。

第四章 莊家

本章適用於透過 HKATS 電子交易系統運作並設有莊家的市場。

4.1 莊家

期交所可將任何「市場」的交易所參與者註冊為莊家，以幫助確保流通性。期交所須釐定莊家的責任、符合該等莊家責任的莊家獎勵，以及莊家適用的其它要求。各有關「市場」的莊家架構詳情，在期交所規則、規例及程序所載各有關交易程序中有更詳盡說明。

4.2 莊家報價

莊家提供的報價指就特定期貨到期月份、期權系列或系列名稱（視乎情況而定）所報的一對買入及賣出價（由期交所規定其差價上限及最低數量）。報價提交後與一般「當日有效」的限價盤無異。

中央買賣盤賬目中所示的報價與限價盤無異。只有輸入報價的莊家及期交所才知道某特定買盤或賣盤是買賣盤或是一個報價。有關莊家提供報價標準的詳情，在期交所規則、規例及程序所載各「市場」適用的交易程序中有更詳盡說明。

4.3 HKATS 電子交易系統中的莊家活動

莊家如欲享有莊家獎勵，便須符合其莊家責任，利用 HKATS Online 的「報價視窗」或「報價回覆視窗」或應用程式介面連接的等同報價功能提供報價。該等視窗的使用方法於《HKATS 使用者指南》中進一步詳述。

4.4 監察莊家

莊家表現會根據期交所規則、規例及程序受到監控。

4.5 莊家戶口

莊家會獲提供各獨立莊家戶口，以記錄莊家本身進行的莊家活動及其各莊家活動安排的交易。

第五章 客戶按金

5.1 追收按金

當一名交易所參與者或一名客戶適用的按金要求超出該交易所參與者或客戶存置用作擔保其各自的未平倉持倉的抵押品價值時，便須追收按金。所追收額外按金的金額，相等於最新按金要求與該抵押品價值兩者間的差額。

5.2 客戶按金

客戶按金指交易所參與者應收客戶或全面結算參與者應收非結算參與者的按金。

客戶按金包括即日追收按金，由交易所參與者計算。期交所會指定交易所參與者應收客戶的最低按金，但不會為交易所參與者計算個別客戶按金。應收客戶最低按金須遵守各個別「市場」適用的程序。

除期交所另有決定外，申報跨期持倉的客戶及非結算參與者須就有關持倉繳付跨期按金。就跨期按金而言，客戶或非結算參與者是該等持倉的實益擁有人。除非可識別申報跨期按金所涉及持倉的實益擁有人，否則不得在綜合戶口中申報跨期按金。跨期按金由期貨結算所釐定及公佈。

第六章 報告服務

藉着 HKATS Online 應用程式，可同時透過「市場成交記錄」及「交易記錄」視窗顯示及輸出交易數據。

- 6.1 市場成交記錄視窗－利用該視窗可輸出交易資料。
- 6.2 交易記錄視窗－交易所參與者公司於一個交易日內完成的所有交易可利用該視窗輸出。

第七章 應變程序

7.1 系統故障

期交所置備有一套並行的作業與後備電腦設施，兩者本身均可單獨支持HKATS電子交易系統的運作。

若發生影響作業設施的災難事故或其他事件，導致 HKATS 電子交易系統全部或部分失效且系統未能修復，期交所或會暫停 HKATS 電子交易系統上的交易，直至有關系統完成轉駁至後備設施及 HKATS 電子交易系統可以恢復運作。交易所參與者應參閱《HKATS 使用者指南》，以了解有關應付系統失靈或故障情況的進一步詳情及程序。

7.2 [已刪除]

7.3 設備故障

若交易所參與者用於連接 HKATS 電子交易系統的任何交易設備（包括但不限於網絡設備及通訊線路）出現故障、錯誤或缺損，不論該等設施是安裝在交易所參與者的辦公場地或任何其他地點，交易所參與者應即時致電 HKATS 熱線報告事故。交易所參與者須遵守《HKATS 使用者指南》內關於設備故障的程序。

若在收市後交易時段內發生聯通故障，交易所參與者可向期交所申請臨時租用其後備運作中心的 HKATS 電子交易系統終端機。期交所可全權酌情決定是否批准這些申請。

暫時未能接駁 **HKATS** 電子交易系統的交易所參與者亦可要求期交所代其刪除其在 **HKATS** 電子交易系統的買賣盤或進行其他程序（「代處理服務」）。代處理服務主要作用是在真正緊急情況下啟動，以減低交易所參與者因突發情況暫時未能接駁系統出現的財務風險，而絕不是給交易所參與者的長遠替代安排。期交所預期交易所參與者盡可能以最短時間恢復聯通 **HKATS** 電子交易系統。代處理服務須視乎期交所在交易所參與者提出要求時可提供的資源而定。期交所會按個別情況評估每項代處理服務要求，並可全權酌情拒絕其認為不適當的任何要求。期交所概不就其代交易所參與者進行任何代處理服務而向有關交易所參與者承擔任何責任。

交易所參與者租用後備運作中心的 **HKATS** 電子交易系統終端機及要求期交所代其執行代處理服務均須支付費用。

7.4 [已刪除]

7.5 [已刪除]

附錄 I
[已廢除]

附錄 II
[已廢除]
