

HKATS 電子交易系統交易程序

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。

3.1 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。