

## HKATS 電子交易系統交易程序

### 目錄

第二章	聯通HKATS電子交易系統
2.1	聯通 <del>技術要求方法</del>
2.2	聯通資格 <del>及控制</del>
2.3	聯通HKATS電子交易系統的申請程序
2.4	保安措施
2.5	<del>聯通層面[已刪除]</del>
2.6	HKATS電子交易系統的網絡問題
第七章	應變程序
7.1	系統故障
7.2	<del>遺失數據[已刪除]</del>
7.3	設備故障
7.4	<del>系統備份[已刪除]</del>
7.5	<del>颱風及黑色暴雨警告[已刪除]</del>

## 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自動交易系統，由瑞典 ~~OM Technology AB~~（「OM」）提供。期交所已從 ~~OM~~ 取得開發 ~~HKATS~~ 電子交易系統的許可證，以供處理期交所產品買賣。該系統是以處理交易為主的網絡系統，其主機配置位於由期交所提供，而交易工作站則位於交易所參與者的處所。交易所參與者透過使用名為「CLICK Trading」的軟件進行交易。此外，交易所參與者亦可經期交所同意而自行開發應用軟件聯通 HKATS 電子交易系統。HKATS 電子交易系統的功能載於《HKATS 使用者指南》中。\_\_\_

## 第二章 聯通 HKATS 電子交易系統

### 2.1 聯通~~技術要求方法~~

~~交易所參與者的配置須包括一個連接區域網絡點點通網絡的以太網區域網絡，方可聯通HKATS電子交易系統。~~  
~~電信線路的數據線路須具備期交所可能不時指定的頻寬，而數據通信網絡服務亦由期交所可能批准的電信供應商提供及支援。為確保單點連接可提供最多網絡服務，該數據通信網絡服務除提供電信線路外，還提供網絡路由器安裝、網絡監控、保養服務及持續最終使用者支援服務。每條電信線路均可支持多個交易連接到HKATS電子交易系統，而最高的連接數量由期交所不時規定。~~  
~~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規定於期交所—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）列明內。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電子交易系統的該等規定的詳情亦刊登在香港交易及結算有限公司（「香港交易所」）的網站內供交易所參與者查閱。~~

# HKEX 香港交易所

為進一步確保可提供高水準的網絡服務，交易所參與者應安裝多一條數據傳輸連接作為主要連接的後備連接。交易所參與者務須安裝該後備連接，以減低因發生任何網絡設備問題而導致連接中斷的潛在風險。

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 聯通資格及控制

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 Click Trading 或 HKATS OMnet 電子交易系統應用程式介面（「應用程式介面」）參與自動交易。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CLICK工作站或應用程式介面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。

~~HKATS 電子交易系統實施兩個層面的網絡監控環境，以監控主機系統與所有交易所參與者的 CLICK 工作站及應用程式介面連接間的聯通。在應用層面，會定時對來自工作站的本地連接進行偵測。若有連接停止回應，便會發出警報及廣播訊息。受影響的交易所參與者的買賣盤會保持為非啟動盤，直至聯通恢復為止。此外，HKATS 電子交易系統的偵測特性提供全面周詳的網絡管理，可監控實時分析資料及將網絡問題與既定標準進行對比。該多層面偵測能力可確保交易所參與者的 CLICK 工作站或應用程式介面連接順利運作。~~

### 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，可向期交所提交安裝／終止 Click 工作站申請表格作出申請。

## 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介面聯通HKATS電子交易系統主電腦。應用程式介面是聯通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。

# HKEX 香港交易所

## 2.5 ~~[已刪除]~~ 聯通層面

~~在HKATS電子交易系統的現行設置下共分兩類使用者，即外部使用者及內部使用者。~~

~~外部使用者透過CLICK工作站或應用程式介面連接以聯通HKATS電子交易系統的主電腦。相對而言，內部使用者則透過MPA、CIBOIS、PD及Decterm應用程式進行聯通。~~

~~為保安理由並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。~~

## 第七章 應變程序

期交所透過HKATS電子交易系統運作的「市場」的營業時間在期交所規則、規例及程序中註明。以下情況可導致期交所更改運作時間：

### 7.1 系統故障

HKATS電子交易系統設有多重措施以減少全面系統故障的影響。若發生直接影響HKATS電子交易系統主電腦的火災、爆炸、事故、水災等事件，期交所會立即收市，並將運作轉換至位於灣仔電訊大廈修復站點的後備主電腦，並會在實際可行情況下盡快恢復「市場」的運作。

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]~~ 遺失數據

~~HKATS電子交易系統採用日記概念設計以減低遺失數據的可能性。儘管如此，但仍會進行行內部操作及命令程序以修復所有遺失的數據及重新編製當日的過往記錄存檔。對所有交易所參與者及其它市場使用者與投資者而言，該操作的透明度應該更高，不應影響「市場」整體的完整性。~~

### 7.3 設備故障

HKATS電子交易系統設有多重措施以減少全面系統故障的影響。根據各種設備故障情況進行的設備測試，涉及由第一伺服器轉換至第二伺服器，且證實測試結果理想。在現實緊急情況中，該轉換的透明度對交易所參與者、其它市場使用者及投資者而言應該更高。

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（包括但不限於終端機、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。

若交易所參與者無法接駁 HKATS 電子交易系統，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該項申請而准許交易所參與者使用有關的 HKATS 電子交易系統終端機。

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

## HKEX 香港交易所

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]系統備份~~

~~在每個交易日的整個交易過程中，HKATS 電子交易系統內所載數據均會備份。當收市後，即會進行交易後運作及每日備份以確保數據的完整性。~~

~~期交所裝有兩套並行電腦設施，每套均可支持 HKATS 電子交易系統的運作。其工作站點位於中環亞太金融中心。兩套電腦之間會即時持續同步處理數據。若第一伺服器發生故障，電腦會自動轉換至第二伺服器，並會繼續處理交易而不受任何干擾。~~

~~若於交易時間內工作站點發生災禍，則在正常情況下工作站點可在短時間內轉換至備份站點，因而減小對交易所參與者的買賣、交易處理及買賣相關活動的影響。~~

~~若備份電腦發生故障，則行政總裁可全權作出必要的安排。~~

### 7.5 ~~[已刪除]颱風及黑色暴雨警告~~

~~於颱風趨近及取消及／或發出及取消黑色暴雨警告時，期交所董事會會決定期交所運作的各「市場」的交易及交收安排。安排詳情在期交所規則、規例及程序所載各有關市場適用的程序中有更詳盡說明。~~