

HKATS 電子交易系統交易程序

目錄

第三章	買賣功能	頁次
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	8
3.4	輸入限價盤	9
3.5	取消買賣盤	9
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	10
3.8	價格資訊	11
3.9	市場成交記錄	11
3.10	買賣盤記錄	12
3.11	市場訊息	12
3.12	[已刪除]	
3.13	交易記錄	12
3.14	大手交易	12
3.15	[已刪除]	
3.16	開市前議價時段	12
 第六章	 報告服務	
6.1	市場成交記錄視窗	14
6.2	交易記錄視窗	14

附錄 II—[已刪除]

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。

第二章 **聯通 HKATS 電子交易系統**

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）*

2.3.5 *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。

2.3.7 (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。

第三章 買賣功能

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。

3.6 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。

3.12 [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。

第四章 莊家

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。

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

7.3 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

附錄 II

[已刪除]