

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	資訊狀態	12
3.13	結算交易記錄	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	結算交易記錄 視窗	14

附錄 II – ~~表格~~

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。交易所參與者透過使用交易所參與者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名為「~~CLICK-Trading~~」的軟件在 HKATS 電子交易系統進行交易。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

2.2 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 ~~Click Trading~~ 或 ~~HKATS 電子交易系統應用程式界面~~（「應用程式界面」）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 電子交易系統表格的 HKATS 電子交易系統使用者名稱（表格 CA）（該表格樣本見附錄 II）。

2.3.2 提交安裝/終止 HKATS 電子交易系統工作站申請表格（已刪除）

~~交易所參與者如欲申請使用新線路及/或新硬件，必須填妥安裝/終止 HKATS 電子交易系統工作站申請表格（該表格樣本載於附錄 II），該表格須經獲正式授權的交易所參與者人員簽署及提交予交易所。其後，有關文件會~~

~~提供予指定供應商供處理該申請之用。期交所會密切監察交易所參與者的安裝狀況。~~

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~~—CA~~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~~—CA~~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 ~~交易所參與者裝置清單（已刪除）~~

~~登記程序完成後，就每名交易所參與者而言，該交易所參與者會獲提供一份該交易所參與者的「區域網絡線路／工作站裝置清單」，作為該交易所參與者的裝置清單。該概要亦載有該交易所參與者所安裝工作站及線路的數目，亦載有線路號碼。~~

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，可填妥向期交所提交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，向期交所提交安裝／終止 Click 工作站申請表格作出申請。

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報重設密碼申請表格或重發密碼通知信申請表格（該等表格樣本見附錄 II）（以適用者為準），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-Click](#) 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「價格」及「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 ~~資訊狀態~~~~[已刪除]~~

~~交易所參與者須確保其本身交易工作站與主電腦妥當地聯通。使用 **CLICK** 的交易所參與者須就此開啓「資訊狀態視窗」。若聯通中斷，則該視窗的狀態欄會顯示「OFF」指示標誌。若聯通正常，則同一狀態欄會顯示「ON」指示標誌。~~

3.13 ~~結算交易記錄~~

~~「結算交易記錄視窗」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~~CLICK-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~~「~~CLICK~~」應用程式，可同時透過「市場成交記錄」及「~~結算交易記錄~~」視窗顯示及~~列印輸出~~交易數據。

6.1 市場成交記錄視窗－利用該視窗可~~列印輸出~~交易資料。

6.2 ~~結算交易記錄~~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~~~~印~~出來。

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~~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。

~~使用網間連接器的交易所參與者若遇到聯通故障，可向期交所申請暫時聯通應變交易網關。~~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~~聯通應變交易網關~~、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 — 表格

[已刪除]

致：

香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司的全資附屬公司)

香港中環
港景街1號
國際金融中心一期10樓
(Ref: DTMO)

傳真：2509-0724/
2877-0017
熱線：2211-6360

重設密碼申請

交易所參與者資料

交易所參與者名稱	交易所參與者公司編號
----------	------------

HKATS 電子交易系統使用者資料

授權人士名稱		
HKATS 電子交易系統使用者名稱	電話	傳真

詳情

重設密碼原因	
--------	--

我們謹此要求為上述使用者重設密碼，並同意期交所規則、規例及程序規定。

授權簽署 _____
(連同公司印鑑)

日期 _____

職員專用		
簽署核實	確認使用者	編製的 NU 表格
重設密碼	通知使用者	收費

致：

香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司的全資附屬公司)

香港中環
港景街1號
國際金融中心一期10樓
(Ref: DTMO)

傳真：—2509-0724/
2877-0017
熱線：—2211-6360

重發密碼通知信申請

交易所參與者資料

交易所參與者名稱	交易所參與者公司編號
----------	------------

HKATS 電子交易系統使用者資料

授權人士名稱		
HKATS 電子交易系統使用者名稱	電話	傳真

詳情

重發密碼通知信原因	
-----------	--

我們謹此要求為上述使用者重發密碼通知信，並同意期交所規則、規例及程序規定。

授權簽署 _____
(連同公司印鑑)

日期 _____

職員專用		
簽署核實	確認使用者	編製的 NU 表格
重設密碼	通知使用者	收費

致：香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司的全資附屬公司)

香港中環 港景街 1 號
國際金融中心一期 10 樓
(Ref: DM)

傳真：2877-0017
熱線：2211-6360

安裝/終止 CLICK 工作站申請表格

交易所參與者資料	
交易所參與者	
聯絡人	電郵
電話號碼	傳真號碼

所需服務 (請在所需服務旁的空格打別號。)	
<input type="checkbox"/> 安裝 CLICK	計劃安裝日期
<input type="checkbox"/> 終止 CLICK	計劃終止日期
<input type="checkbox"/> 重新安裝 CLICK	計劃重新安裝日期
CLICK 的數目	
所需服務地址	

電腦配置	
主機名稱 (例如 ABCWA1)	
中央處理機 (例如 Pentium 4)	
中央處理機速度	GHz
記憶體	GB RAM
硬碟	GB
顯示卡	MB RAM

我們謹此要求安裝/終止 CLICK 工作站，並同意期交所規則、規例及程序規定。

授權簽署

日期

(連同公司印鑑)

正寫名稱/稱銜

職員專用	
	備註
設定指引發出日期	
CLICK 安裝日期	

表格—B

**期交所—HKATS 電子交易系統交易所參與者
聯絡名單**

致 ÷ 香港期貨交易所有限公司

部門 ÷ 市場運作

傳真號碼 ÷ (852) 2509 0724 / 2877 0017 日期 ÷

交易所參與者 ÷

提交人 ÷

稱銜 ÷ 聯絡號碼

市場* ÷ 股票指數期貨及期權 / ~~日轉期匯~~ / 股票期貨 / 港元利率期貨

請提供聯絡人的詳細資料：

	姓名	電話號碼	傳真號碼		
				非辦公時間	電話
				生效日期	

行政					
結算					
交易					
技術					

*請選擇適當類別

致：~~香港期貨交易所有限公司~~

~~(香港交易及結算所有限公司的全資附屬公司)~~

表格 ~~AS~~

香港中環
港景街1號
國際金融中心一期10樓
(Ref: DTMO)

傳真：~~25090724/
28770017
熱線：22116360~~

授權簽署人

交易所參與者資料	
交易所參與者	
聯絡人	_____
電話號碼	_____
日期	_____

請只選擇下列空格其中一項：

- 新交易所參與者首次提交
- 替代之前提交的表格
- 補充之前提交的表格 下列人士獲授權代表我們簽署特定指示。

簽署人姓名 簽名式樣 職位 指示 ^(附註1)

(請用印本) (從「a」至「e」選擇)

1. _____
2. _____
3. _____
4. _____
5. _____
6. _____

附註1

- a. 所有交易相關表格 (單獨/共同*)
- b. 所有 HKATS 電子交易系統設備相關表格 (單獨/共同*)
- e. 所有應用程式介面相關表格 (個別/共同*)

*請刪除不適當者

印本：簽署人姓名 負責職員簽署並加蓋公司印鑑

請將本表格連同交易所參與者的董事會會議記錄一併交回期交所，會議記錄中聲明授權名列本表格人士代表交易所參與者發出註明的指示。

若本表格中資料有任何改變，請立即通知期交所。

香港期貨交易所有限公司
 (香港交易及結算所有限公司的全資附屬公司)

香港中環——熱線：2211-6360
 港景街1號——傳真：2877-0017 / 2509-0724
 國際金融中心一期10樓

可聯通 **HKATS** 電子交易系統的使用者名稱

交易所參與者資料

記號	參與者名稱
----	-------

聯絡人

姓名	電話	傳真
職位	電郵	

第 I 部分 — 申請額外 **HKATS 電子交易系統使用者名稱**

我們謹此要求期交所額外發出一個可聯通 **HKATS** 電子交易系統的使用者名稱，並確認期交所可全權酌情發出 **HKATS** 電子交易系統使用者名稱，亦可撤回或暫時吊銷有關名稱。

負責人員姓名	辦公室電話號碼	流動電話號碼	電郵地址

第 II 部分 — 授權人士的詳情 (適用於新增 **HKATS 電子交易系統使用者名稱及更改聯絡人)**

我們謹此知會期交所，除我們的負責人員外，期交所亦可就我們聯通 **HKATS** 電子交易系統的事宜，聯絡下表所列的授權人士。

現有使用者名稱 / 申請新使用者名稱數目	CLICK / 應用程式介面 / HKATS 電子交易系統風險功能使用者 (僅適用於新使用者名稱的申請)	授權人士名稱	香港身份證 / 護照首 4 個數字	辦公室電話號碼	流動電話號碼

~~第 III 部分 – 刪除 HKATS 電子交易系統使用者名稱~~

~~我們謹此要求由下列日期起刪除下表所載的 HKATS 電子交易系統使用者名稱。下表亦載有該等 HKATS 電子交易系統使用者的授權人士，以供期交所參考。~~

HKATS 電子交易系統 使用者名稱	生效日期	現有授權人士

~~我們承諾，若上述資料有任何變動，會即時通知期交所。~~

代表

[交易所參與者名稱]

負責人員簽署 日期
連同公司印鑑

負責人員姓名