

HKATS 電子交易系統交易程序

第二章 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及其他相關表格

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，如聯通 HKATS 電子交易系統的 HKATS 電子交易系統使用者名稱（表格 CA）（該表格樣本見附錄 II）。

2.3.3 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。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。

2.3.6 （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。交易所參與者提出申請須繳付期交所指定的費用。

2.6 HKATS 電子交易系統的網絡問題

交易所參與者若受網絡、系統或其它故障影響，可申請使用交易所後備運作中心的 CLICK 工作站進行交易，並須遵從所有有關將指示輸入 HKATS 電子交易系統的期交所規則、規例及程序，且該交易所參與者須對所有按此方式訂立的期貨期權合約負責。

第三章 買賣功能

3.1 中央買賣盤賬目

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：

- 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；
- 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；

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：

3.2.4 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。於交易時段（若開市前議價時段不適用）前 30 分鐘期間內增加買賣盤數量或更改價格，會導致買賣盤變為不動盤。

3.3 買賣盤類別

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：

- (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）。

3.4 輸入限價盤

有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 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。

3.5 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「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。

3.7 買賣盤排序及對盤

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。

3.9 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。

3.13 結算交易

「結算交易視窗」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。

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

熱線：2211 6360
傳真：2877 0017 / 2509 0724

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_____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
連同公司印鑑

日期

負責人員姓名

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授權人士重設密碼，並同意繳付期交所規則、規例及程序規定所需收費。

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	編制的 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授權人士重發密碼通知信，並同意繳付期交所規則、規例及程序規定所需收費。

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	編制的 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 工作站要求表格

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 _____

所需服務(請在所需服務旁的空格打剔號。)	
<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	_____ GB RAM
硬碟	_____ GB
顯示卡	_____ MB RAM

我們謹此要求安裝／終止 CLICK 工作站，並同意繳付期交所規則、規例及程序規定所需收費。

授權簽署 _____ 日期 _____
(連同公司印鑑)
正寫名稱／稱銜 (_____)

職員專用	
設定指引發出日期	_____ 備註 _____
CLICK 安裝日期	_____