

期交所規則、規例及程序

第一章

規則的釋義、執行及修訂

定義及釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外，以下詞句具下列涵義：—

「授權人士」	指	交易所參與者僱用或聘用可以聯通HKATS電子交易系統的人士， <u>以及就經HKATS電子交易系統風險功能聯通HKATS電子交易系統以設立、監控及實施指定風險監控而言，授權人士可包括替該交易所參與者（若屬非結算參與者）的交易進行結算的期貨結算公司參與者就此委任的人士；</u>
<u>「HKATS電子交易系統風險功能」</u>	指	<u>本交易所要求各交易所參與者安裝（若交易所參與者為非結算參與者，則安排替其交易進行結算的期貨結算公司參與者安裝）的HKATS軟件，用以設置、監控及實施該交易所參與者的指定風險監控；</u>
「HKATS電子交易系統使用者名稱」	指	用以辨識能聯通HKATS電子交易系統的交易所參與者 <u>或（就HKATS電子交易系統風險功能而言）期貨結算公司參與者身份的一組獨有的號碼及字符；</u>
<u>「《HKATS電子交易系統風險功能用戶指引》」</u>	指	<u>本交易所不時修訂之有關HKATS電子交易系統風險功能操作的手冊，名為《HKATS電子交易系統風險功能用戶指引》；</u>
<u>「指定風險監控」</u>	指	<u>本交易所及結算所可不時要求交易所參與者及期貨結算公司參與者使用HKATS電子交易系統風險功能設立的指定監控及限制，用以管理經其接駁至或本交易所透過該交易所參與者批准任何接駁至HKATS電子交易系統的連接，以及期貨結算公司參與者（為非結算參與者的交易進行結算者）的非結算參與者的HKATS電子交易系統連接又或本交易所經由該非結算參與者授予的HKATS電子交易系統連接，所落買賣盤及執行交易的相關風險；</u>

## 第八章

### 交易安排 – 慣例及系統

#### 一般常規 – HKATS電子交易系統

- 807A. (c) 每名交易所參與者任何時候均須設有安排，確保所有經其接駁至或本交易所透過該交易所參與者批准任何接駁至HKATS電子交易系統的買賣盤，均受指定風險監控及其他適當的風險監控及功能的規限。

## 第十二章

### 自動電子交易系統

#### 在HKATS電子交易系統中設立指定風險監控

- 1205A [已刪除]在不影響規則第1208B條下本交易所權利的情況下，交易所參與者（如屬非結算參與者，則為替其結算交易的期貨結算公司參與者）須就交易所參與者自身及其授權人士、遠程聯通客戶以及任何獲准經其接駁至或透過該交易所參與者批准任何接駁至HKATS電子交易系統進行交易的其他人士，使用HKATS電子交易系統風險功能，設立、監控及實施指定風險監控。交易所參與者知悉輸入HKATS電子交易系統的買賣盤須受此等指定風險監控所規限，並可能因其中部分而被暫停或取消，包括（若其屬非結算參與者）被替其交易進行結算的期貨結算公司參與者暫停或取消。
- 1205B 交易所參與者須實施足夠程序，確保所有經由其連接或透過交易所參與者授出的任何連接聯通至HKATS電子交易系統的人士均遵守適用於其的指定風險監控，並不會使用HKATS電子交易系統風險功能作指定風險監控以外用途。
- 1205C 交易所參與者任何授權人士使用HKATS電子交易系統風險功能或本交易所不時指定的其他功能執行買賣盤暫停或取消功能時，交易所參與者須立即知會本交易所。
- 1205D 交易所參與者自行對就其所設置的指定風險監控負責。本交易所、結算所及本交易所的認可交易所控制人概不就該等指定風險監控的充分或有效性又或 HKATS 電子交易系統風險功能的任何失靈或無法使用或錯誤或缺失負任何責任。

附錄B -費用

說明

金額<sup>1</sup>

---

**與HKATS 電子交易系統相關的費用**

透過中央交易網關以每秒 10 個交易的買賣盤通過量進行聯通的程式介面分判牌照費

每月每程式介面5200元，惟交易所參與者以每秒5個交易的買賣盤通過量進行的首兩次聯通，或以每秒10個交易的買賣盤通過量進行的首次聯通，其中一項毋須支付程式介面分判牌照費

透過中央交易網關進行聯通的HKATS電子交易系統風險功能分判牌照費

每月每次聯通1000元，惟交易所參與者首三次聯通毋須支付費用