

**第一章**  
**規則的釋義、執行及修訂**

定義及釋義

「自選組合」

由交易所參與者使用HKATS電子交易系統自選組合功能設定、涉及交易所合約的策略組合

「交易議價板買賣盤賬目」之定義已刪除。

**第八章**  
**交易安排 – 慣例及系統**

錯價交易

819B. 假如HKATS電子交易系統內有交易以偏離交易所不時訂定並通知交易所參與者的價格參數（「價格參數」）的水平進行成交，而其後該交易的原交易方聲稱價格有錯，則交易所將予處理，但只會按以下程序處理：

- (a) 任何按偏離了價格參數成交而聲稱出錯的交易（「錯價交易」）必須由任何原交易方於交易後 10 分鐘內或 30 分鐘內(若交易是自選組合交易)通知交易所。交易所在收到通知後，會即時在 HKATS 電子交易系統發布有關交易已有交易方報稱為錯價交易，可能要註銷的警告訊息。
- (h) 為免生疑問，謹此說明：對於以價格參數範圍內水平成交的交易，又或在第 819B(a)條規定的時間過後才向交易所報告的交易，上述取消條文概不適用。

第十二章  
自動電子交易系統

一般條文

- 1201 (j) 交易所參與者必須對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電子交易系統並分別記錄於HKATS電子交易系統的中央買賣盤賬目及交易登記冊的所有買賣盤及期貨／期權合約，又或因使用該接駁而產生的其他後果負責，不論該後果是否因該交易所參與者的負責人員、授權人士、遠程聯通客戶或獲准接入HKATS電子交易系統進行莊家活動的任何人士使用該接駁而導致。

買賣盤記錄

- 1210 當輸入的買賣盤記錄於有關交易所合約的HKATS電子交易系統的中央買賣盤賬目後，該項買賣盤便定為已有效地輸入HKATS電子交易系統。
- 1211 於HKATS電子交易系統中央買賣盤賬目中存置的每項買賣盤的記錄詳情，將為輸入HKATS電子交易系統每項買賣盤條款的最終證據。任何人士於釐定買賣盤是否已輸入HKATS電子交易系統或釐定任何該買賣盤條款時不應接納或承認其他證據。
- 1212 除本交易所另行批准外，交易所參與者除可透過HKATS電子交易系統查核其本身買賣盤外，無權接觸儲存在HKATS電子交易系統中央買賣盤賬目的任何資料，亦不能查詢及無權查核將買賣盤輸入中央買賣盤賬目的任何人士的身分。
- 1213 交易所參與者的授權人士可代表一名客戶或交易所參與者更改及取消已輸入HKATS電子交易系統中央買賣盤賬目的任何買賣盤，惟有關的更改或取消須按客戶或交易所參與者（視情況而定）的指示及該買賣盤獲編配的買賣盤號碼進行。本交易所將容許根據本程序更改或取消買賣盤。儘管本程序中有任何條文限制可更改或取消買賣盤的時間，客戶或該交易所參與者的非啟動買賣盤仍可隨時更改或取消，惟有關的更改或取消須按客戶或交易所參與者（視情況而定）的指示進行。

## 交易記錄

- 1215 當涉及一個期貨交付月份或期權系列的一張交易所合約的一個買賣盤，透過HKATS電子交易系統與另一張涉及相同期貨交付月份或期權系列的交易所合約的一個買賣盤配對時，而該等有關期貨／期權合約的配對買賣盤乃記錄於HKATS電子交易系統的交易登記冊，則該期貨／期權合約便被視為於當時執行。緊接該記錄後，並在期貨／期權合約已根據本規則有效執行的前提下，期貨／期權合約須根據結算所規則進行責務變更程序（惟本交易所另有規定除外）。儘管有上述條文，於一個市場的開市前議價時段內記入交易登記冊的配對買賣盤，在開市前不得在結算所登記或進行責務變更；而記入交易登記冊的大手交易或自選組合交易，須於結算所確信記錄的大手交易或自選組合交易為一項有效交易並符合其適用的所有準則，方可於結算所登記或進行責務變更。除非交易所參與者收到本交易所或結算所的任何口頭或書面通知，指該大手交易或自選組合交易為無效或並未符合其適用的所有條件，又或其因任何理由不會獲結算所登記或結算，則應視該大手交易或自選組合交易已獲結算所登記，並於緊接該交易記入交易登記冊後根據結算所規則進行責務變更程序。本交易所將盡力在該交易所參與者執行該大手交易或自選組合交易起計30分鐘內，通知該交易所參與者任何涉及該交易的事宜。

## 第十四章 遠程聯通客戶

1407. 一名交易所一期貨結算所參與者須就因其每名遠程聯通客戶接駁HKATS電子交易系統所產生及分別記錄在HKATS電子交易系統的中央買賣盤賬目及交易登記冊上的所有買賣盤及期貨／期權合約又或因使用該遠程聯通客戶的接駁所產生的其他後果負上責任。交易所一期貨結算所參與者須實行足夠程序及措施以監察其遠程聯通客戶在HKATS電子交易系統上的交易，務求確保遵守其風險管理政策。

## 附錄B - 費用

### 與HKATS電子交易系統相關的費用

CLICK或透過網間連接器進行聯通的程式介面分判牌照費	每月每CLICK或程式介面1,750元
透過中央交易網關以每秒5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2600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個聯通，或以每秒10個交易的買賣盤通過量進行的首個聯通，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
租用SOS中心內之CLICK工作站 / 透過應變交易網關暫時聯通HKATS電子交易系統	每日(或不足一日)每工作站或每次聯通1,000元

於本交易所的自動電子交易系統(「HKATS電子交易系統」)買賣股票指數期貨及股票指數期權的交易程序

## 目錄

<b>第四章</b>	<b>買賣功能</b>
4.1	輸入買賣盤
4.2	買賣盤因暫停交易或站點故障而自動取消
4.3	更改及取消買賣盤
4.4	(已刪除)
4.5	執行標準組合
4.6	(已刪除)
4.7	(已刪除)
4.8	開市前議價
4.9	自訂條款期權的開設、執行及停止交易
4.10	自選組合的開設、執行及刪除

## 第四章 買賣功能

### 4.3 更改及取消買賣盤

代表一名客戶或交易所參與者的股票指數期貨合約或股票指數期權合約的買賣盤可在輸入中央買賣盤賬目及獲分配一個特定買賣盤號碼後進行更改或取消，惟更改或取消該特定買賣盤須遵從該客戶或交易所參與者(視情況而言)的指示。

交易所參與者僅可於交易時間內及(倘開市前議價時段不適用)每個交易時段開始前30分鐘期間內或(倘開市前議價時段適用)開市前議價時段期間的開市前時段為置放中央買賣盤賬目的買賣盤(有效買賣盤)更改、取消登記或使其不啟動。

倘更改有效買賣盤涉及減少合約張數、改變有效期或修訂選擇性(「非必要」)文本資料，不會影響原來有效買賣盤的原有時間優先權。

倘更改有效買賣盤涉及價格或增加合約張數：(i) 倘更改乃於交易時間內作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權；及(ii) 在開市前議價時段適用情況下，倘更改乃於開市前議價時段作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權。有效買賣盤不得在交易時段開始前30分鐘內(在開市前議價時段不適用情況下)進行涉及價格或增加合約張數的更改。

## HKEX 香港交易所

### 4.5 執行標準組合

4.5.2 餌盤乃根據餌盤產生的時間排序。餌盤的價格若根據組成標準組合的個別市場系列的價格變動及／或數量增幅而自動調整，該餌盤將視作新產生的餌盤看待。

4.6 (已刪除)

4.7 (已刪除)

### 4.10 自選組合的開設、執行及刪除

4.10.1 交易所參與者可使用HKATS電子交易系統自選組合功能，於某些交易時段（由本交易所不時通知）內，設定及開設涉及某些股票指數期貨合約及／或股票指數期權合約（由本交易所不時通知）的自選組合。自選組合一經開設，即可如同正常市場系列一樣交易。

4.10.2 交易所參與者開設自選組合時須確保遵守下列準則：

- 該自選組合是本交易所規定的策略組合之一；
- 組成該策略的期貨合約月份或期權系列（「成分系列」）數目是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列之間的比率是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列的合約金額必須相同；
- 該自選組合當其時並非訂明是標準組合；及
- 有活躍買賣盤於開設自選組合的同時呈交。

4.10.3 個別營業日內開設的自選組合不會結轉至下一營業日。

4.10.4 自選組合的交易執行價未必與組成自選組合的股票指數期貨合約或股票指數期權合約的當前市價相對應。在HKATS電子交易系統內，經配對的自選組合交易將記錄為個別市場系列中的獨立交易。

4.10.5 本交易所可不時訂明營業日內可於HKATS電子交易系統掛牌的自選組合數目上限，以及每次聯通HKATS電子交易系統以開設自選組合時的買賣盤通過量，以保障HKATS電子交易系統的穩健及確保市場妥善運作。

4.10.6 本交易所任何時候均有絕對酌情權，可透過向交易所參與者發出通知，限制交易所參與者在營業日內開設的自選組合數目。

4.10.7 本交易所保留權利，可在下列情況下，隨時刪除在HKATS電子交易系統掛牌的任何自選組合，及取消該自選組合的任何買賣盤：

- (i) 該自選組合不符合程序第4.10.2條訂明的準則；
- (ii) 該自選組合沒有活躍買賣盤；
- (iii) 在HKATS電子交易系統掛牌的自選組合總數超過本交易所不時規定及通知交易所參與者的上限；
- (iv) 開設該自選組合的交易所參與者已超過程序第4.10.6條向其施加的上限；或
- (v) 本交易所裁定該自選組合不恰當。

4.10.8 任何非按程序第4.10.2條所訂準則開設的自選組合交易，本交易所概不視作有效交易，另即使交易所規則或結算所規則有任何條文的規定，結算所也不會為此等交易登記或結算。若交易所參與者在執行自選組合交易的營業日當天接獲本交易所通知，指有關的自選組合交易為無效，則本交易所聯同結算所將從HKATS電子交易系統及結算系統的「交易檔」內刪除該無效的自選組合交易，而無須再通知有關交易所參與者，情況猶如該自選組合交易從未被執行。本交易所或結算所對因刪除任何無效的自選組合交易而直接或間接引起的後果概不負責，亦不承擔任何性質或如何引起的責任，不論是合約法、侵權法或其他法規。

於本交易所的自動電子交易系統(「HKATS 電子交易系統」)買賣股票期貨及股票期貨期權的交易程序

## 目錄

### 第四章 買賣功能

- 4.1 輸入買賣盤
- 4.2 買賣盤因暫停交易或站點故障而自動取消
- 4.3 更改及取消買賣盤
- 4.4 (已刪除)
- 4.5 調整程序
- 4.6 執行標準組合
- 4.7 (已刪除)
- 4.8 (已刪除)
- 4.9 開市前議價
- 4.10 自選組合的開設、執行及刪除

## 第四章 買賣功能

### 4.3 更改及取消買賣盤

倘一項股票期貨合約或股票期貨期權合約的買賣盤乃代表一名客戶或交易所參與者輸入中央買賣盤賬目並獲分配一個特定買賣盤號碼，該買賣盤可予更改或取消，惟更改或取消該特定買賣盤須遵從該客戶或交易所參與者(視情況而言)的指示。

交易所參與者僅可於交易時間內及(倘開市前議價時段不適用)每個交易時段開始前30分鐘期間內或(倘開市前議價時段適用)開市前議價時段期間的開市前時段更改、取消中央買賣盤登記或使其不啟動。

倘更改有效買賣盤涉及減少合約張數、改變有效期間或修訂選擇性(「非必要」)文本資料，不會影響原來有效買賣盤的原有時間優先權。

倘更改有效買賣盤涉及價格或增加合約張數：(i) 倘更改乃於交易時間內作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權；及(ii) 在開市前議價時段適用情況下，倘更改乃於開市前議價時段作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權。有效買賣盤不得在交易時段開始前30分鐘內(在開市前議價時段不適用情況下)進行涉及價格或增加合約張數的更改。

## 4.6 執行標準組合

4.6.2 餌盤乃根據餌盤產生的時間排序。餌盤的價格若根據組成標準組合的個別市場系列的價格變動及／或數量增幅而自動調整，該餌盤將視作新產生的餌盤看待。

## 4.7 (已刪除)

## 4.8 (已刪除)

## 4.10 自選組合的開設、執行及刪除

4.10.1 交易所參與者可使用HKATS電子交易系統自選組合功能，於某些交易時段（由本交易所不時通知）內，設定及開設涉及某些股票期貨合約及／或股票期貨期權合約（由本交易所不時通知）的自選組合。自選組合一經開設，即可如同正常市場系列一樣交易。

4.10.2 交易所參與者開設自選組合時須確保遵守下列準則：

- 該自選組合是本交易所規定的策略組合之一；
- 組成該策略的期貨合約月份或期權系列（「成分系列」）數目是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列之間的比率是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列的合約金額必須相同；
- 該自選組合當其時並非訂明是標準組合；及
- 有活躍買賣盤於開設自選組合的同時呈交。

4.10.3 個別營業日內開設的自選組合不會結轉至下一營業日。

4.10.4 自選組合的交易執行價未必與組成自選組合的股票期貨合約及／或股票期貨期權合約的當前市價相對應。在HKATS電子交易系統內，經配對的自選組合交易將記錄為個別市場系列中的獨立交易。

4.10.5 本交易所可不時訂明營業日內可於HKATS電子交易系統掛牌的自選組合數目上限，以及每次聯通HKATS電子交易系統以開設自選組合時的買賣盤通過量，以保障HKATS電子交易系統的穩健及確保市場妥善運作。

- 4.10.6 本交易所任何時候均有絕對酌情權，可透過向交易所參與者發出通知，限制交易所參與者在營業日內開設的自選組合數目。
- 4.10.7 本交易所保留權利，可在下列情況下，隨時刪除在HKATS電子交易系統掛牌的任何自選組合，及取消該自選組合的任何買賣盤：
- (i) 該自選組合不符合程序第4.10.2條訂明的準則；
  - (ii) 該自選組合沒有活躍買賣盤；
  - (iii) 在HKATS電子交易系統掛牌的自選組合總數超過本交易所不時規定及通知交易所參與者的上限；
  - (iv) 開設該自選組合的交易所參與者已超過程序第4.10.6條向其施加的上限；  
或
  - (v) 本交易所裁定該自選組合不恰當。
- 4.10.8 任何非按程序第4.10.2條所訂準則開設的自選組合交易，本交易所概不視作有效交易，另即使交易所規則或結算所規則有任何條文的規定，結算所也不會為此等交易登記或結算。若交易所參與者在執行自選組合交易的營業日當天接獲本交易所通知，指有關的自選組合交易為無效，則本交易所聯同結算所將從HKATS電子交易系統及結算系統的「交易檔」內刪除該無效的自選組合交易，而無須再通知有關交易所參與者，情況猶如該自選組合交易從未被執行。本交易所或結算所對因刪除任何無效的自選組合交易而直接或間接引起的後果概不負責，亦不承擔任何性質或如何引起的責任，不論是合約法、侵權法或其他法規。

於本交易所的自動電子交易系統(「HKATS電子交易系統」)買賣一個月及三個月香港銀行同業拆息期貨(「港元利率期貨」)的交易程序

## 目錄

### 第四章 買賣功能

- 4.1 輸入買賣盤
- 4.2 買賣盤因暫停交易或站點故障而自動取消
- 4.3 更改及取消買賣盤
- 4.4 (已刪除)
- 4.5 執行標準組合
- 4.5A 執行港元利率疊期
- 4.6 (已刪除)
- 4.7 (已刪除)
- 4.8 開市前議價
- 4.9 自選組合的開設、執行及刪除

## 第四章 買賣功能

### 4.3 更改及取消買賣盤

倘一項港元利率期貨合約的買賣盤乃代表一名客戶或交易所參與者輸入中央買賣盤賬目並獲分配一個特定買賣盤號碼，該買賣盤可予更改或取消，惟更改或取消該特定買賣盤須遵從該客戶或交易所參與者(視情況而言)的指示。

交易所參與者僅可於交易時間內及(倘開市前議價時段不適用)每個交易時段開始前30分鐘期間內或(倘開市前議價時段適用)開市前議價時段期間的開市前時段更改、取消買賣盤登記或使其不啟動。

倘更改有效買賣盤涉及減少合約張數、改變有效期間或修訂選擇性(「非必要」)文本資料，不會影響原來有效買賣盤的原有時間優先權。

倘更改有效買賣盤涉及價格或增加合約張數：(i) 倘更改乃於交易時間內作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先次序權；及(ii) 在開市前議價時段適用情況下，倘更改乃於開市前議價時段作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權。有效買賣盤不得在交易時段開始前30分鐘內(在開市前議價時段不適用情況下)進行涉及價格或增加合約張數的更改。

## 4.5 執行標準組合

4.5.2 餌盤乃根據餌盤產生的時間排序。餌盤的價格若根據組成標準組合的個別市場系列的價格變動及／或數量增幅而自動調整，該餌盤將視作新產生的餌盤看待。

## 4.6 (已刪除)

## 4.7 (已刪除)

## 4.9 自選組合的開設、執行及刪除

4.9.1 交易所參與者可使用HKATS電子交易系統自選組合功能，於某些交易時段（由本交易所不時通知）內，設定及開設涉及某些港元利率期貨合約（由本交易所不時通知）的自選組合。自選組合一經開設，即可如同正常市場系列一樣交易。

4.9.2 交易所參與者開設自選組合時須確保遵守下列準則：

- 該自選組合是本交易所規定的策略組合之一；
- 組成該策略的期貨合約月份（「成分系列」）數目是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列之間的比率是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列的合約金額必須相同；
- 該自選組合當其時並非訂明是標準組合；及
- 有活躍買賣盤於開設自選組合的同時呈交。

4.9.3 個別營業日內開設的自選組合不會結轉至下一營業日。

4.9.4 自選組合的交易執行價未必與組成自選組合的港元利率期貨合約的當前市價相對應。在HKATS電子交易系統內，經配對的自選組合交易將記錄為個別市場系列中的獨立交易。

4.9.5 本交易所可不時訂明營業日內可於HKATS電子交易系統掛牌的自選組合數目上限，以及每次聯通HKATS電子交易系統以開設自選組合時的買賣盤通過量，以保障HKATS電子交易系統的穩健及確保市場妥善運作。

- 4.9.6 本交易所任何時候均有絕對酌情權，可透過向交易所參與者發出通知，限制交易所參與者在營業日內開設的自選組合數目。
- 4.9.7 本交易所保留權利，可在下列情況下，隨時刪除在HKATS電子交易系統掛牌的任何自選組合，及取消該自選組合的任何買賣盤：
- (i) 該自選組合不符合程序第4.9.2條訂明的準則；
  - (ii) 該自選組合沒有活躍買賣盤；
  - (iii) 在HKATS電子交易系統掛牌的自選組合總數超過本交易所不時規定及通知交易所參與者的上限；
  - (iv) 開設該自選組合的交易所參與者已超過程序第4.9.6條向其施加的上限；  
或
  - (v) 本交易所裁定該自選組合不恰當。
- 4.9.8 任何非按程序第4.9.2條所訂準則開設的自選組合交易，本交易所概不視作有效交易，另即使交易所規則或結算所規則有任何條文的規定，結算所也不會為此等交易登記或結算。若交易所參與者在執行自選組合交易的營業日當天接獲本交易所通知，指有關的自選組合交易為無效，則本交易所聯同結算所將從HKATS電子交易系統及結算系統的「交易檔」內刪除該無效的自選組合交易，而無須再通知有關交易所參與者，情況猶如該自選組合交易從未被執行。本交易所或結算所對因刪除任何無效的自選組合交易而直接或間接引起的後果概不負責，亦不承擔任何性質或如何引起的責任，不論是合約法、侵權法或其他法規。

於本交易所的自動電子交易系統(「HKATS 電子交易系統」)買賣外匯基金債券期貨(「外匯基金債券期貨」)的交易程序

## 目錄

### 第四章 買賣功能

- 4.1 輸入買賣盤
- 4.2 買賣盤因站點故障須暫停交易而自動取消
- 4.3 更改及取消買賣盤
- 4.4 執行標準組合
- 4.5 (已刪除)
- 4.6 (已刪除)
- 4.7 開市前議價
- 4.8 自選組合的開設、執行及刪除

## 第四章 買賣功能

### 4.3 更改及取消買賣盤

倘外匯基金債券期貨合約的買賣盤乃代表一名客戶或交易所參與者輸入中央買賣盤賬目並獲分配一個特定買賣盤號碼，該買賣盤可予更改或取消，惟更改或取消該特定買賣盤須遵從該客戶或交易所參與者(視情況而言)的指示。

交易所參與者僅可於交易時間內及(倘開市前議價時段不適用)每個交易時段開始前30分鐘期間內或(倘開市前議價時段適用)開市前議價時段期間的開市前時段更改、取消買賣盤登記或使其不啟動。

倘更改有效買賣盤涉及減少合約張數、改變有效期或修訂選擇性(「非必要」)文本資料，不會影響原來有效買賣盤的原有時間優先權。

倘更改有效買賣盤涉及價格或增加合約張數：(i) 倘更改乃於交易時間內作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權；及(ii) 在開市前議價時段適用情況下，倘更改乃於開市前議價時段作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權。有效買賣盤不得在交易時段開始前30分鐘內(在開市前議價時段不適用情況下)進行涉及價格或增加合約張數的更改。

## 4.4 執行標準組合

4.4.2 餌盤乃根據餌盤產生的時間排序。餌盤的價格若根據組成標準組合的個別市場系列的價格變動及／或數量增幅而自動調整，該餌盤將視作新產生的餌盤看待。

4.5 (已刪除)

4.6 (已刪除)

## 4.8 自選組合的開設、執行及刪除

4.8.1 交易所參與者可使用HKATS電子交易系統自選組合功能，於某些交易時段（由本交易所不時通知）內，設定及開設涉及某些外匯基金債券期貨合約（由本交易所不時通知）的自選組合。自選組合一經開設，即可如同正常市場系列一樣交易。

4.8.2 交易所參與者開設自選組合時須確保遵守下列準則：

- 該自選組合是本交易所規定的策略組合之一；
- 組成該策略的期貨合約月份（「成分系列」）數目是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列之間的比率是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列的合約金額必須相同；
- 該自選組合當其時並非訂明是標準組合；及
- 有活躍買賣盤於開設自選組合的同時呈交。

4.8.3 個別營業日內開設的自選組合不會結轉至下一營業日。

4.8.4 自選組合的交易執行價未必與組成自選組合的外匯基金債券期貨合約的當前市價相對應。在HKATS電子交易系統內，經配對的自選組合交易將記錄為個別市場系列中的獨立交易。

4.8.5 本交易所可不時訂明營業日內可於HKATS電子交易系統掛牌的自選組合數目上限，以及每次聯通HKATS電子交易系統以開設自選組合時的買賣盤通過量，以保障HKATS電子交易系統的穩健及確保市場妥善運作。

- 4.8.6 本交易所任何時候均有絕對酌情權，可透過向交易所參與者發出通知，限制交易所參與者在營業日內開設的自選組合數目。
- 4.8.7 本交易所保留權利，可在下列情況下，隨時刪除在HKATS電子交易系統掛牌的任何自選組合，及取消該自選組合的任何買賣盤：
- (i) 該自選組合不符合程序第4.8.2條訂明的準則；
  - (ii) 該自選組合沒有活躍買賣盤；
  - (iii) 在HKATS電子交易系統掛牌的自選組合總數超過本交易所不時規定及通知交易所參與者的上限；
  - (iv) 開設該自選組合的交易所參與者已超過程序第4.8.6條向其施加的上限；  
或
  - (v) 本交易所裁定該自選組合不恰當。
- 4.8.8 任何非按程序第4.8.2條所訂準則開設的自選組合交易，本交易所概不視作有效交易，另即使交易所規則或結算所規則有任何條文的規定，結算所也不會為此等交易登記或結算。若交易所參與者在執行自選組合交易的營業日當天接獲本交易所通知，指有關的自選組合交易為無效，則本交易所聯同結算所將從HKATS電子交易系統及結算系統的「交易檔」內刪除該無效的自選組合交易，而無須再通知有關交易所參與者，情況猶如該自選組合交易從未被執行。本交易所或結算所對因刪除任何無效的自選組合交易而直接或間接引起的後果概不負責，亦不承擔任何性質或如何引起的責任，不論是合約法、侵權法或其他法規。

### 目錄

#### 第三章 交易方法

3.1 輸入買賣盤	3-1
3.2 買賣盤因暫停交易或站點故障而自動取消	3-1
3.3 更改及取消買賣盤	3-1
3.4 執行標準組合	3-2
3.5 (已刪除)	3-3
3.6 (已刪除)	3-3
3.7 開市前議價	3-4
3.8 自選組合的開設、執行及刪除	

### 第三章 買賣功能

#### 3.3 更改及取消買賣盤

代表一名客戶或交易所參與者的金屬期貨合約的買賣盤可在輸入中央買賣盤賬目及獲分配一個特定買賣盤號碼後進行更改或取消，惟更改或取消該特定買賣盤須遵從該客戶或交易所參與者(視情況而言)的指示。

交易所參與者僅可於交易時間內及(倘開市前議價時段不適用)每個交易時段開始前30分鐘期間內或(倘開市前議價時段適用) 開市前議價時段期間的開市前時段對置於中央買賣盤賬目的買賣盤(「有效買賣盤」)作出更改、取消登記或使其不啟動。

倘更改有效買賣盤涉及減少合約張數、改變有效期或修訂選擇性(「非必要」)文本資料，不會影響原來有效買賣盤的原有時間優先權。

倘更改有效買賣盤涉及價格或增加合約張數：(i) 倘更改乃於交易時間內作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權；及(ii) 在開市前議價時段適用情況下，倘更改乃於開市前議價時段作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權。有效買賣盤不得在交易時段開始前30分鐘內(在開市前議價時段不適用情況下)進行涉及價格或增加合約張數的更改。

## 3.4 執行標準組合

3.4.2 餌盤乃根據餌盤產生的時間排序。餌盤的價格若根據組成標準組合的個別市場系列的價格變動及／或數量增幅而自動調整，該餌盤將視作新產生的餌盤看待。

## 3.5 (已刪除)

## 3.6 (已刪除)

## 3.8 自選組合的開設、執行及刪除

3.8.1 交易所參與者可使用HKATS電子交易系統自選組合功能，於某些交易時段（由本交易所不時通知）內，設定及開設涉及某些金屬期貨合約（由本交易所不時通知）的自選組合。自選組合一經開設，即可如同正常市場系列一樣交易。

3.8.2 交易所參與者開設自選組合時須確保遵守下列準則：

- 該自選組合是本交易所規定的策略組合之一；
- 組成該策略的期貨合約月份（「成分系列」）數目是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列之間的比率是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列的合約金額必須相同；
- 該自選組合當其時並非訂明是標準組合；及
- 有活躍買賣盤於開設自選組合的同時呈交。

3.8.3 個別營業日內開設的自選組合不會結轉至下一營業日。

3.8.4 自選組合的交易執行價未必與組成自選組合的金屬期貨合約的當前市價相對應。在HKATS電子交易系統內，經配對的自選組合交易將記錄為個別市場系列中的獨立交易。

3.8.5 本交易所可不時訂明營業日內可於HKATS電子交易系統掛牌的自選組合數目上限，以及每次聯通HKATS電子交易系統以開設自選組合時的買賣盤通過量，以保障HKATS電子交易系統的穩健及確保市場妥善運作。

3.8.6 本交易所任何時候均有絕對酌情權，可透過向交易所參與者發出通知，限制交易所參與者在營業日內開設的自選組合數目。

3.8.7 本交易所保留權利，可在下列情況下，隨時刪除在HKATS電子交易系統掛牌的任何自選組合，及取消該自選組合的任何買賣盤：

- (i) 該自選組合不符合程序第3.8.2條訂明的準則；
- (ii) 該自選組合沒有活躍買賣盤；
- (iii) 在HKATS電子交易系統掛牌的自選組合總數超過本交易所不時規定及通知交易所參與者的上限；
- (iv) 開設該自選組合的交易所參與者已超過程序第3.8.6條向其施加的上限；  
或
- (v) 本交易所裁定該自選組合不恰當。

3.8.8 任何非按程序第3.8.2條所訂準則開設的自選組合交易，本交易所概不視作有效交易，另即使交易所規則或結算所規則有任何條文的規定，結算所也不會為此等交易登記或結算。若交易所參與者在執行自選組合交易的營業日當天接獲本交易所通知，指有關的自選組合交易為無效，則本交易所聯同結算所將從HKATS電子交易系統及結算系統的「交易檔」內刪除該無效的自選組合交易，而無須再通知有關交易所參與者，情況猶如該自選組合交易從未被執行。本交易所或結算所對因刪除任何無效的自選組合交易而直接或間接引起的後果概不負責，亦不承擔任何性質或如何引起的責任，不論是合約法、侵權法或其他法規。

### 目錄

#### 第四章 買賣功能

- 4.1 輸入買賣盤
- 4.2 買賣盤因站點故障須暫停交易而自動取消
- 4.3 更改及取消買賣盤
- 4.4 執行標準組合
- 4.5 (已刪除)
- 4.6 (已刪除)
- 4.7 開市前議價
- 4.8 自選組合的開設、執行及刪除

### 第四章 買賣功能

#### 4.3 更改及取消買賣盤

倘貨幣期貨合約的買賣盤乃代表一名客戶或交易所參與者輸入中央買賣盤賬目並獲分配一個特定買賣盤號碼，該買賣盤可予更改或取消，惟更改或取消該特定買賣盤須遵從該客戶或交易所參與者(視情況而言)的指示。

交易所參與者僅可於交易時間內及(倘開市前議價時段不適用)每個交易時段開始前 30 分鐘期間內或(倘開市前議價時段適用) 開市前議價時段期間的開市前時段更改、取消買賣盤登記或使其不啟動。

倘更改有效買賣盤涉及減少合約張數、改變有效期或修訂選擇性(「非必要」)文本資料，不會影響原來有效買賣盤的原有時間優先權。

倘更改有效買賣盤涉及價格或增加合約張數：(i) 倘更改乃於交易時間內作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權；及(ii) 在開市前議價時段適用情況下，倘更改乃於開市前議價時段作出，將導致原來有效買賣盤失去原有的時間優先權。有效買賣盤不得在交易時段開始前30分鐘內(在開市前議價時段不適用情況下)進行涉及價格或增加合約張數的更改。

## 4.4 執行標準組合

4.4.2 餌盤乃根據餌盤產生的時間排序。餌盤的價格若根據組成標準組合的個別市場系列的價格變動及／或數量增幅而自動調整，該餌盤將視作新產生的餌盤看待。

## 4.5 (已刪除)

## 4.6 (已刪除)

## 4.8 自選組合的開設、執行及刪除

4.8.1 交易所參與者可使用HKATS電子交易系統自選組合功能，於某些交易時段（由本交易所不時通知）內，設定及開設涉及某些貨幣期貨合約（由本交易所不時通知）的自選組合。自選組合一經開設，即可如同正常市場系列一樣交易。

4.8.2 交易所參與者開設自選組合時須確保遵守下列準則：

- 該自選組合是本交易所規定的策略組合之一；
- 組成該策略的期貨合約月份（「成分系列」）數目是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列之間的比率是在本交易所規定的範圍內；
- 這些成分系列的合約金額必須相同；
- 該自選組合當其時並非訂明是標準組合；及
- 有活躍買賣盤於開設自選組合的同時呈交。

4.8.3 個別營業日內開設的自選組合不會結轉至下一營業日。

4.8.4 自選組合的交易執行價未必與組成自選組合的貨幣期貨合約的當前市價相對應。在HKATS電子交易系統內，經配對的自選組合交易將記錄為個別市場系列中的獨立交易。

4.8.5 本交易所可不時訂明營業日內可於HKATS電子交易系統掛牌的自選組合數目上限，以及每次聯通HKATS電子交易系統以開設自選組合時的買賣盤通過量，以保障HKATS電子交易系統的穩健及確保市場妥善運作。

4.8.6 本交易所任何時候均有絕對酌情權，可透過向交易所參與者發出通知，限制交易所參與者在營業日內開設的自選組合數目。

4.8.7 本交易所保留權利，可在下列情況下，隨時刪除在HKATS電子交易系統掛牌的任何自選組合，及取消該自選組合的任何買賣盤：

- (i) 該自選組合不符合程序第4.8.2條訂明的準則；
- (ii) 該自選組合沒有活躍買賣盤；
- (iii) 在HKATS電子交易系統掛牌的自選組合總數超過本交易所不時規定及通知交易所參與者的上限；
- (iv) 開設該自選組合的交易所參與者已超過程序第4.8.6條向其施加的上限；  
或
- (v) 本交易所裁定該自選組合不恰當。

4.8.8 任何非按程序第4.8.2條所訂準則開設的自選組合交易，本交易所概不視作有效交易，另即使交易所規則或結算所規則有任何條文的規定，結算所也不會為此等交易登記或結算。若交易所參與者在執行自選組合交易的營業日當天接獲本交易所通知，指有關的自選組合交易為無效，則本交易所聯同結算所將從HKATS電子交易系統及結算系統的「交易檔」內刪除該無效的自選組合交易，而無須再通知有關交易所參與者，情況猶如該自選組合交易從未被執行。本交易所或結算所對因刪除任何無效的自選組合交易而直接或間接引起的後果概不負責，亦不承擔任何性質或如何引起的責任，不論是合約法、侵權法或其他法規。