

## 第十二章

### 自動電子交易系統

#### 引言

1200. (a) 本交易所須運作為其 **HKATS** 電子交易系統內可能不時指定的一個或多個市場，而此本章所指交易所合約及買賣盤限於在有關市場執行的交易所合約及就有關市場輸入的買賣盤。
- (b) 為免生疑問，除文意另有規定者外，所有的規則、規例及程序均適用於 **HKATS** 電子交易系統的運作。
- (c) 所有透過 **HKATS** 電子交易系統進行的期貨／期權合約交易須根據本交易所不時指定的規則、規例及程序以及其他程序及規定（包括根據香港期交所－**HKATS** 電子交易系統協議指定者）進行，並對該等期貨／期權合約的訂約方具有約束力。

#### 一般條文

1201. (a) 在交易所參與者與 **HKATS** 電子交易系統建立電子接駁（「接駁」）前，須訂立一份形式由本交易所不時規定的期交所－**HKATS** 電子交易系統協議。
- (b) 接駁至 **HKATS** 電子交易系統所採用設備及軟件須由本交易所不時指定。
- (c) 本交易所保留權利批准使用非由本交易所根據規則第 1201(b)條指定的任何設備及軟件。交易所參與者如欲使用非由本交易所指定的任何設備及軟件，本交易所可要求該交易所參與者於聯通前先行徹底測試有關設備及軟件，並經本交易所判定有關設備及軟件對 **HKATS** 電子交易系統的運作並無任何損害。
- (d) 本交易所保留限制每名交易所參與者接駁數量的權利。
- (e) 本交易所保留即時截斷接駁的權利，並禁止任何人士（不論是否交易所參與者）聯通 **HKATS** 電子交易系統，或限制該人士接入或使用 **HKATS** 電子交易系統，包括但不限於按本交易所認為適當的條件減少其聯通的通過量。

- (f) 交易所參與者須安裝本交易所指定的所有適用軟件及系統程式軟件的最新版本。未得本交易所事先書面批准，交易所參與者不得改動、修改、還原、更改或複製本交易所供應的程式。
- (g) 交易所參與者須讓本交易所檢查聯通至 **HKATS** 電子交易系統的設備或安裝在 **HKATS** 電子交易系統的軟件。有關檢查須在雙方同意的時間及實際可行的地點進行，而有關的交易所參與者亦須在場。
- (h) 由本交易所提供所需設備的成本，以及相關的安裝維修費用，概由交易所參與者承擔。該費用須如期交所－**HKATS** 電子交易系統協議所述扣除。
- (i) 交易所參與者須確保透過**HKATS**電子交易系統運作的市場的開市時段以及此前和此後的一小時內，交易所參與者的場所或本交易所認可的其他地點常駐有一名技術聯絡人員或系統聯絡人員。
- (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。
- (k) 交易所參與者必須遵守本交易所不時指定有關接駁所附帶之安全程序。
- (l) 交易所參與者如發現有任何技術或非技術性質的服務中斷而令其交易活動因而受到影響，必須立即通知本交易所。
- (m) 本交易所可不時在其認為適當的情況下，就**HKATS**電子交易系統的操作及聯通事宜等程序對交易所參與者作出規定。

### 交易所活動一般條款

1202. **HKATS**電子交易系統的買賣盤輸入及註銷，以及一般交易活動，將不會顯示交易所參與者的身份。然而，本交易所在其認為適當情況下，有全權決定是否披露交易所參與者的身份。

## 聯通HKATS電子交易系統及透過其進行交易

- 1203. 除獲本交易所另行授權外，所有透過HKATS電子交易系統買賣交易所合約必須透過交易所參與者的接駁設備輸入買賣盤。
- 1204. 除獲本交易所另行授權外，一名交易所參與者只可容許其授權人士及遠程聯通客戶聯通HKATS電子交易系統。
- 1205. 除獲本交易所另行授權外，一名交易所參與者須確保只有其註冊仍然有效的HKATS電子交易系統交易所參與者代方表可輸入、修改及撤銷買賣盤或分配。

## 在HKATS電子交易系統中設立指定風險監控

- 1205A. 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每名接駁至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。

## 未經授權使用 HKATS 電子交易系統

- 1206. 交易所參與者須實施足夠程序，以確保可透過其接駁或本交易所批准透過該交易所參與者批准的任何接駁入HKATS電子交易系統的任何人士（不論是否交易所參與者）遵守規則第807A(a)條的規定。交易所參與者須確保透過其接駁或本交易所透過該交易所參與者批准的

任何接駁入HKATS電子交易系統的所有人士，於操作HKATS電子交易系統時採取適當審慎態度，且HKATS電子交易系統的操作及買賣盤的輸入、修改或取消乃符合本交易所不時規定的程序及指引。

- 1206A. 若交易所參與者或任何透過該交易所參與者聯通HKATS電子交易系統的任何人士未經認可使用HKATS電子交易系統，或因有關人士未有遵守規則第1206條的規定，導致HKATS電子交易系統或交易所參與者的HKATS電子交易系統工作站運作不穩定、不能操作或損壞，有關交易所參與者必須承擔全部責任。

#### 輸入買賣盤

1207. 所有買賣盤須根據本規則、適用規例及程序以及HKATS電子交易系統用戶指南輸入HKATS電子交易系統。
1208. 每項輸入HKATS電子交易系統的買賣盤須遵從本程序及HKATS電子交易系統用戶指南的規定並載有其中規定資料。
- 1208A. 除可於開市前議價時段的開市前時段及開市前分配時段由交易所參與者輸入HKATS電子交易系統的競價盤外，交易所參與者須確保每名客戶的買賣盤均有價格限制。
- 1208B. 本交易所可不時訂定由交易所參與者輸入HKATS電子交易系統的每個買賣盤的張數上限。本交易所可就任何交易所合約、任何類別或組別的交易所參與者或就任何特定參與者訂定該買賣盤的張數上限。HKATS電子交易系統將拒絕受理，超過訂定的買賣盤張數上限的買賣盤。

#### HKATS電子交易系統的買賣盤配對及排序

1209. 買賣盤在HKATS電子交易系統中的配對及排序嚴按價格／時間的優先次序進行：系統會先取最佳價格者，再按買賣盤發出的時間先後，順序處理。在不影響上述的原則下，倘於開市前議價時段同時出現競價盤及限價盤，競價盤將優先於所有限價盤，而倘緊隨開市後競價盤轉為限價盤，則價格相同的轉換競價盤及限價盤的排序將依據於開市前議價時段買賣盤輸入HKATS電子交易系統的時間。

#### 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。

### 更改及取消買賣盤

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。

### 報價要求

1214. 報價要求可於透過HKATS電子交易系統運作的任何市場適用的交易時間內，隨時利用HKATS電子交易系統的報價要求功能輸入HKATS電子交易系統，而莊家將就回應而（根據適用規則、規例、程序及HKATS電子交易系統用戶指南並在其規限下）提供報價。

### 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，方可在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。

1216. 在規則第1215條的規限下，於HKATS電子交易系統的交易登記冊存置由配對買賣盤而產生的期貨／期權合約的記錄詳情，或本交易所可能酌情接納的其他記錄，將為每張期貨／期權合約的不可推翻憑證。
1217. 除本交易所另有批准外，交易所參與者除可透過HKATS電子交易系統查其本身執行的期貨／期權合約的詳情外，不得聯通儲存於交易登記冊中有關記錄於交易登記冊的已執行期貨／期權合約的任何人士身份的資料。

### 大手交易

1218. 一名交易所參與者僅可根據規則第815條, 815A條 及 815B條以及本交易所可能不時規定的其他程序，在HKATS電子交易系統進行大手交易。

### 調整

1219. 有關透過HKATS電子交易系統執行而已獲結算所更新約務的期貨／期權合約作責務變更的調整之所有事宜，必須遵守結算所規則的規定。

1220. (已刪除)

### 責任限制

1221. 在任何情況下，本交易所及作為本交易所控制人的認可控制人，概不就有關任何交易所參與者或其任何客戶或任何第三者透過HKATS電子交易系統進行或與HKATS電子交易系統有關的活動所引致數據遺失、欠付利潤或其他損害賠償負任何責任。