

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 第三部分 - 指定風險監控 (交易系統 #4 - #8)

(此部分只適用於期交所參與者及聯交所的期權交易所參與者)

公司名稱

#### 交易系統 #4 - #8

- 本節包含五組重複的問題，每組由六個問題組成。
- 請貴公司按每個通過OAPI發送訂單的交易系統填寫一組問題(例如，問題 (G1) – (G6))。
- 您最多可以在此問卷模板為五個交易系統填寫答案(即，問題 (G1) – (G30))。
- 您不用就HKATS Online ( 瀏覽器開啟的前端應用程式 ) 填寫此問卷。

關於遵守有關使用HKATS的期交所規則第807A條和/或期權交易規則第 505條以及2020年1月22日發出的“強制性定期重新認證 OAPI 應用程式”通函(編號: MO/DT/010/20)的要求，請填寫以下問題：

#### 交易系統 #4

(G1) 交易安排

(G1a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( G1b ) 至 ( G1f ) 提供以上交易系統的使用方法

(G1b) 手動交易系統 ( 由人手輸入訂單 )

(G1c) 算法交易系統 ( 由程式產生訂單 )

(G1d) 只限交易期貨產品之交易系統

(G1e) 只限交易期權產品之交易系統

(G1f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

(G2) 在交易系統中設置的前端監控 ( 非HKATS提供的前端監控風險管理系統 )

(G2a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G2b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( G2b ) 的回答為「是」，請在 ( G2c ) 至 ( G2e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G2c) • 實時價格

(G2d) • 理論價格

(G2e) • 其他 (請在 ( G2f ) 中提供其價格偏差控制機制)

(G2f) 如 ( G2e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G2g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(G2h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

(G2i) 如 ( G2a ) 、 ( G2b ) 、 ( G2g ) 及 ( G2h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

(G3) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- 
- (G3a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？(基於價值的限制控制)
- (G3b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)
- 

(G4) **其他交易系統監控**

- (G4a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？
- (G4b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]
- (G4c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]
- (G4d) 請提供所有其他相關的風險控制。
- 

(G5) **算法交易系統訂單控制 (僅適用於算法交易系統)**

如 (G1c) 的回答為「是」，請回答問題 (G5a) 至 (G5c)。

- (G5a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (G5b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (G5c) 如 (G5a) 及 (G5b) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*
- 

(G6) **測試環境**

- (G6a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？
- (G6b) 如 (G6a) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*
- (G6c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期
- 

**交易系統 #5**

- (G7) **交易安排**
- (G7a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。
- 

請在 (G7b) 至 (G7f) 提供以上交易系統的使用方法

- (G7b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）
- (G7c) 算法交易系統（由程式產生訂單）
- (G7d) 只限交易期貨產品之交易系統
- (G7e) 只限交易期權產品之交易系統
- (G7f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統
-

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G8) 在交易系統中設置的前端監控（非HKATS提供的前端監控風險管理系統）

(G8a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G8b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( G8b ) 的回答為「是」，請在 ( G8c ) 至 ( G8e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G8c) • 實時價格

(G8d) • 理論價格

(G8e) • 其他 (請在 ( G8f ) 中提供其價格偏差控制機制)

(G8f) 如 ( G8e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G8g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G8h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

(G8i) 如 ( G8a )、( G8b )、( G8g ) 及 ( G8h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

(G9) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(G9a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G9b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

---

(G10) 其他交易系統監控

(G10a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(G10b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]

(G10c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]

(G10d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(G11) 算法交易系統訂單控制 (僅適用於算法交易系統)

如 ( G7c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( G11a ) 至 ( G11c )。

(G11a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G11b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G11c) 如 ( G11a ) 及 ( G11b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(G12) 測試環境

(G12a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G12b) 如 ( G12a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(G12c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

### 交易系統 #6

(G13) 交易安排

(G13a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( G13b ) 至 ( G13f ) 提供以上交易系統的使用方法

(G13b) 手動交易系統 ( 由人手輸入訂單 )

(G13c) 算法交易系統 ( 由程式產生訂單 )

(G13d) 只限交易期貨產品之交易系統

(G13e) 只限交易期權產品之交易系統

(G13f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

---

(G14) 在交易系統中設置的前端監控 ( 非HKATS提供的前端監控風險管理系統 )

(G14a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G14b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( G14b ) 的回答為「是」，請在 ( G14c ) 至 ( G14e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G14c) • 實時價格

(G14d) • 理論價格

(G14e) • 其他 ( 請在 ( G14f ) 中提供其價格偏差控制機制 )

(G14f) 如 ( G14e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G14g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？ ( 基於價值的限制控制 )

(G14h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？ ( 基於合同數量的限制控制 )

(G14i) 如 ( G14a ) 、 ( G14b ) 、 ( G14g ) 及 ( G14h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

(G15) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(G15a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？ ( 基於價值的限制控制 )

(G15b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？ ( 基於合同數量的限制控制 )

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(G16) **其他交易系統監控**

- (G16a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？
- (G16b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]
- (G16c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]
- (G16d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(G17) **算法交易系統訂單控制（僅適用於算法交易系統）**

如 ( G13c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( G17a ) 至 ( G17c ) 。

- (G17a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (G17b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (G17c) 如 ( G17a ) 及 ( G17b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(G18) **測試環境**

- (G18a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？
- (G18b) 如 ( G18a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*
- (G18c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

**交易系統 #7**

(G19) **交易安排**

- (G19a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( G19b ) 至 ( G19f ) 提供以上交易系統的使用方法

- (G19b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）
- (G19c) 算法交易系統（由程式產生訂單）
- (G19d) 只限交易期貨產品之交易系統
- (G19e) 只限交易期權產品之交易系統
- (G19f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

---

(G20) **在交易系統中設置的前端監控（非HKATS提供的前端監控風險管理系統）**

- (G20a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G20b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( G20b ) 的回答為「是」，請在 ( G20c ) 至 ( G20e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G20c) • 實時價格

(G20d) • 理論價格

(G20e) • 其他 (請在 ( G20f ) 中提供其價格偏差控制機制)

(G20f) 如 ( G20e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G20g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G20h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

(G20i) 如 ( G20a ) 、 ( G20b ) 、 ( G20g ) 及 ( G20h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

### (G21) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(G21a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G21b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

---

### (G22) 其他交易系統監控

(G22a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(G22b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]

(G22c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]

(G22d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

### (G23) 算法交易系統訂單控制 (僅適用於算法交易系統)

如 ( G19c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( G23a ) 至 ( G23c )。

(G23a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G23b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G23c) 如 ( G23a ) 及 ( G23b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

### (G24) 測試環境

(G24a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施 (包括前端控制，交易後控制和其他相關控制) 進行任何功能測試？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G24b) 如 ( G24a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(G24c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

### 交易系統 #8

(G25) 交易安排

(G25a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( G25b ) 至 ( G25f ) 提供以上交易系統的使用方法

(G25b) 手動交易系統 ( 由人手輸入訂單 )

(G25c) 算法交易系統 ( 由程式生訂單 )

(G25d) 只限交易期貨產品之交易系統

(G25e) 只限交易期權產品之交易系統

(G25f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

(G26) 在交易系統中設置的前端監控 ( 非HKATS提供的前端監控風險管理系統 )

(G26a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G26b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( G26b ) 的回答為「是」，請在 ( G26c ) 至 ( G26e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G26c) • 實時價格

(G26d) • 理論價格

(G26e) • 其他 ( 請在 ( G26f ) 中提供其價格偏差控制機制 )

(G26f) 如 ( G26e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G26g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(G26h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

(G26i) 如 ( G26a ) 、 ( G26b ) 、 ( G26g ) 及 ( G26h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

(G27) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(G27a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(G27b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(G28) **其他交易系統監控**

- (G28a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？
- (G28b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]
- (G28c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]
- (G28d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(G29) **算法交易系統訂單控制（僅適用於算法交易系統）**

如 ( G25c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( G29a ) 至 ( G29c ) 。

- (G29a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (G29b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (G29c) 如 ( G29a ) 及 ( G29b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(G30) **測試環境**

- (G30a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？
- (G30b) 如 ( G30a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*
- (G30c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

\*如回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照問卷內B部的「指引」。

[註9]: 訊息節流是指在規定的時間內超過規定的訊息量值時觸發的風險控制措施。

[註10]: 成交節流是指在規定的時間內超過規定的成交量值時觸發的風險控制措施。

[註11]: 交易截斷機制是指參與者在緊急情況下中斷交易的機制。

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 第三部分 - 指定風險監控 (交易系統 #9 - #13)

(此部分只適用於期交所參與者及聯交所的期權交易所參與者)

#### 交易系統 #9 - #13

- 本節包含五組重複的問題，每組由六個問題組成。
- 請貴公司按每個通過OAPI發送訂單的交易系統填寫一組問題(例如，問題(H1) – (H6))。
- 您最多可以在此問卷模板為五個交易系統填寫答案(即，問題(H2) – (H30))。
- 您不用就HKATS Online ( 瀏覽器開啟的前端應用程式 ) 填寫此問卷。

關於遵守有關使用HKATS的期交所規則第807A條和/或期權交易規則第 505條以及2020年1月22日發出的“強制性定期重新認證 OAPI 應用程式”函(編號: MO/DT/010/20)的要求，請填寫以下問題：

#### 交易系統 #9

##### (H1) 交易安排

- (H1a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

**請在 ( H1b ) 至 ( H1f ) 提供以上交易系統的使用方法**

- (H1b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

- (H1c) 算法交易系統 (由程式產生訂單)

- (H1d) 只限交易期貨產品之交易系統

- (H1e) 只限交易期權產品之交易系統

- (H1f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

---

##### (H2) 在交易系統中設置的前端監控 (非HKATS提供的前端監控風險管理系統)

- (H2a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

- (H2b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( H2b ) 的回答為「是」，請在 ( H2c ) 至 ( H2e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

- (H2c) • 實時價格

- (H2d) • 理論價格

- (H2e) • 其他 (請在 ( H2f ) 中提供其價格偏差控制機制)

- (H2f) 如 ( H2e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

- (H2g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？(基於價值的限制控制)

- (H2h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

- (H2i) 如 ( H2a )、( H2b )、( H2g ) 及 ( H2h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

##### (H3) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

- (H3a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？(基於價值的限制控制)

- (H3b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

### (H4) 其他交易系統監控

- (H4a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？
- (H4b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]
- (H4c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]
- (H4d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

### (H5) 算法交易系統訂單控制（僅適用於算法交易系統）

如 ( H1c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( H5a ) 至 ( H5c )。

- (H5a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (H5b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (H5c) 如 ( H5a ) 及 ( H5b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

### (H6) 測試環境

- (H6a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？
- (H6b) 如 ( H6a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*
- (H6c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

### 交易系統 #10

#### (H7) 交易安排

- (H7a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( H7b ) 至 ( H7f ) 提供以上交易系統的使用方法

- (H7b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）
- (H7c) 算法交易系統（由程式產生訂單）
- (H7d) 只限交易期貨產品之交易系統
- (H7e) 只限交易期權產品之交易系統
- (H7f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

#### (H8) 在交易系統中設置的前端監控（非HKATS提供的前端監控風險管理系統）

- (H8a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H8b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( H8b ) 的回答為「是」，請在 ( H8c ) 至 ( H8e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(H8c) • 實時價格

(H8d) • 理論價格

(H8e) • 其他 (請在 ( H8f ) 中提供其價格偏差控制機制)

(H8f) 如 ( H8e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(H8g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H8h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

(H8i) 如 ( H8a ) 、 ( H8b ) 、 ( H8g ) 及 ( H8h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

### (H9) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(H9a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H9b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

---

### (H10) 其他交易系統監控

(H10a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(H10b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]

(H10c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]

(H10d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

### (H11) 算法交易系統訂單控制 ( 僅適用於算法交易系統 )

如 ( H7c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( H11a ) 至 ( H11c ) 。

(H11a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(H11b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(H11c) 如 ( H11a ) 及 ( H11b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

### (H12) 測試環境

(H12a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施 ( 包括前端控制，交易後控制和其他相關控制 ) 進行任何功能測試？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H12b) 如 ( H12a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(H12c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

### 交易系統 #11

(H13) 交易安排

(H13a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( H13b ) 至 ( H13f ) 提供以上交易系統的使用方法

(H13b) 手動交易系統 ( 由人手輸入訂單 )

(H13c) 算法交易系統 ( 由程式產生訂單 )

(H13d) 只限交易期貨產品之交易系統

(H13e) 只限交易期權產品之交易系統

(H13f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

(H14) 在交易系統中設置的前端監控 ( 非HKATS提供的前端監控風險管理系統 )

(H14a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(H14b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( H14b ) 的回答為「是」，請在 ( H14c ) 至 ( H14e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(H14c) • 實時價格

(H14d) • 理論價格

(H14e) • 其他 ( 請在 ( H14f ) 中提供其價格偏差控制機制 )

(H14f) 如 ( H14e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(H14g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H14h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

(H14i) 如 ( H14a ) 、 ( H14b ) 、 ( H14g ) 及 ( H14h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

(H15) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(H15a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H15b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(H16) **其他交易系統監控**

- (H16a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？
- (H16b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]
- (H16c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]
- (H16d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(H17) **算法交易系統訂單控制（僅適用於算法交易系統）**

如 ( H13c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( H17a ) 至 ( H17c )。

- (H17a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (H17b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (H17c) 如 ( H17a ) 及 ( H18b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(H18) **測試環境**

- (H18a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？
- (H18b) 如 ( H18a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*
- (H18c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

**交易系統 #12**

(H19) **交易安排**

- (H19a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( H19b ) 至 ( H19f ) 提供以上交易系統的使用方法

- (H19b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）
- (H19c) 算法交易系統（由程式產生訂單）
- (H19d) 只限交易期貨產品之交易系統
- (H19e) 只限交易期權產品之交易系統
- (H19f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

---

(H20) **在交易系統中設置的前端監控（非HKATS提供的前端監控風險管理系統）**

- (H20a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H20b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( H20b ) 的回答為「是」，請在 ( H20c ) 至 ( H20e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(H20c) • 實時價格

(H20d) • 理論價格

(H20e) • 其他 (請在 ( H20f ) 中提供其價格偏差控制機制)

(H20f) 如 ( H20e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(H20g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H20h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

(H20i) 如 ( H20a ) 、 ( H20b ) 、 ( H20g ) 及 ( H20h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

(H21) **交易系統中設置之交易後監控 [註9]**

(H21a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H21b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

---

(H22) **其他交易系統監控**

(H22a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(H22b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註10]

(H22c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註11]

(H22d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(H23) **算法交易系統訂單控制 ( 僅適用於算法交易系統 )**

如 ( H19c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( H23a ) 至 ( H23c ) 。

(H23a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(H23b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(H23c) 如 ( H23a ) 及 ( H23b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(H24) **測試環境**

(H24a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施 ( 包括前端控制，交易後控制和其他相關控制 ) 進行任何功能測試？

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H24b) 如 ( H24a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(H24c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

### 交易系統 #13

(H25) 交易安排

(H25a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( H25b ) 至 ( H25f ) 提供以上交易系統的使用方法

(H25b) 手動交易系統 ( 由人手輸入訂單 )

(H25c) 算法交易系統 ( 由程式生訂單 )

(H25d) 只限交易期貨產品之交易系統

(H25e) 只限交易期權產品之交易系統

(H25f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

(H26) 在交易系統中設置的前端監控 ( 非HKATS提供的前端監控風險管理系統 )

(H26a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(H26b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( H26b ) 的回答為「是」，請在 ( H26c ) 至 ( H26e ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(H26c) • 實時價格

(H26d) • 理論價格

(H26e) • 其他 ( 請在 ( H26f ) 中提供其價格偏差控制機制 )

(H26f) 如 ( H26e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(H26g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H26h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

(H26i) 如 ( H26a ) 、 ( H26b ) 、 ( H26g ) 及 ( H26h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

(H27) 交易系統中設置之交易後監控 [註9]

(H27a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？( 基於價值的限制控制 )

(H27b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？( 基於合同數量的限制控制 )

## 2023合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(H28) **其他交易系統監控**

- (H28a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？
- (H28b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？<sup>[註10]</sup>
- (H28c) 貴公司有否設置交易截斷機制？<sup>[註11]</sup>
- (H28d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(H29) **算法交易系統訂單控制（僅適用於算法交易系統）**

如 ( H25c ) 的回答為「是」，請回答問題 ( H29a ) 至 ( H29c )。

- (H29a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (H29b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？
- (H29c) 如 ( H29a ) 及 ( H29b ) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(H30) **測試環境**

- (H30a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？
- (H30b) 如 ( H30a ) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*
- (H30c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

- END -

\*如回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照問卷內B部的「指引」。

[註9]: 訊息節流是指在規定的時間內超過規定的訊息量值時觸發的風險控制措施。

[註10]: 成交節流是指在規定的時間內超過規定的成交量值時觸發的風險控制措施。

[註11]: 交易截斷機制是指參與者在緊急情況下中斷交易的機制。