

2026合規評核及現場視察之年度計劃

合規評核問卷

第四部分 - 交易及偏離價格風險監控 (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)

*本節所述之監控措施不包括HKATS 電子交易系統風險功能。

公司名稱

本節包括五組重複的問題 (問題(G1)至(G30))，每組包含六條問題。

- 如貴公司透過OAPI 應用程序發出買賣盤的交易系統超過三個，請就每一個額外的系統，於第四部分完成一整組問題 (例如問題(G1)至(G6))。
- 如貴公司僅使用 HKATS Online，且並無運作任何 OAPI 交易系統，則毋須填寫本部分。

就遵守《期交所規則》第819B條、《期權交易規則》第540條、2017年7月17日發出的《衍生產品市場之錯價交易申報》的通告 (編號：MO/DT/103/17 及 MO/DT/104/17) 內有關錯價交易的規定，以及《期交所規則》第522B條及 / 或《交易所規則》第612條有關內部管控程序的規定，請填寫以下問題：

交易系統 #4

(G1) 交易安排

(G1a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(G1b)至(G1c)提供以上交易系統的類型：

(G1b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(G1c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(G2) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(G2a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(G2b) 如問題(G2a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18] 的買賣盤。*

如問題(G2a)的回答為「是」，請在問題(G2c)至(G2f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(G2c) • 實時價格

(G2d) • 理論價格

(G2e) • 上一個交易日的收盤價

(G2f) • 其他 (請在問題(G2g)中提供其價格偏離監控機制)

(G2g) 如問題(G2f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(G2h) 如問題(G2c)至(G2f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(G2i) 如問題(G2a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (G2j) 如問題(G2i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(G2i)的回答為「是」，請在問題(G2k)至(G2m)中指出所採用的提示及攔截機制。

- (G2k) 軟封鎖機制
- (G2l) 硬封鎖機制
- (G2m) 其他 (請在問題(G2n)說明)
- (G2n) 如問題(G2m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(G3) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

- (G3a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？
- (G3b) 如問題(G3a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (G3c) 如問題(G3a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (G3d) 如問題(G3a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (G3e) 如問題(G3d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(G3d)的回答為「是」，請在問題(G3f)至(G3i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (G3f) 取消買賣盤
- (G3g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (G3h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示
- (G3i) 其他 (請在下方的問題(G3j)中具體說明)
- (G3j) 如問題(G3i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(G4) 價格偏離相關的交易後監控[註20]

- (G4a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G4b) 如問題(G4a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(G5) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(G1c)的回答為「是」，請回答問題(G5a)至(G5h)。

(G5a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(G5b) 如問題(G5a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(G5c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(G5d) 如問題(G5c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(G5e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(G5f) 如問題(G5e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(G5g) 如問題(G5e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(G5h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(G5i) 如問題(G5h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

(G6) 風險監控的審查與測試

(G6a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(G6b) 如問題(G6a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(G6c) 如問題(G6a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(G6d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

交易系統 #5

(G7) 交易安排

(G7a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(G7b)至(G7c)提供以上交易系統的類型：

(G7b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(G7c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(G8) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(G8a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(G8b) 如問題(G8a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(G8a)的回答為「是」，請在問題(G8c)至(G8f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(G8c) • 實時價格

(G8d) • 理論價格

(G8e) • 上一個交易日的收盤價

(G8f) • 其他 (請在問題(G8g)中提供其價格偏離監控機制)

(G8g) 如問題(G8f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(G8h) 如問題(G8c)至(G8f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(G8i) 如問題(G8a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(G8j) 如問題(G8i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(G8i)的回答為「是」，請在問題(G8k)至(G8m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(G8k) 軟封鎖機制

(G8l) 硬封鎖機制

(G8m) 其他 (請在問題(G8n)說明)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G8n) 如問題(G8m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(G9) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(G9a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

(G9b) 如問題(G9a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

(G9c) 如問題(G9a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以避免買賣盤之執行價格偏離相關參考價 / 基準價格的風險。*

(G9d) 如問題(G9a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？

(G9e) 如問題(G9d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(G9d)的回答為「是」，請在問題(G9f)至(G9i)中具體說明所採取的跟進行動。

(G9f) 取消買賣盤

(G9g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤

(G9h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

(G9i) 其他 (請在下方的問題(G9j)中具體說明)

(G9j) 如問題(G9i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(G10) 價格偏離相關的交易所後監控[註20]

(G10a) 貴公司有否設置任何交易所後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(G10b) 如問題(G10a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易所後價格偏離的風險監控的原因。*

(G11) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(G7c)的回答為「是」，請回答問題(G11a)至(G11h)。

(G11a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (G11b) 如問題(G11a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*
- (G11c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？
- (G11d) 如問題(G11c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*
- (G11e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？
- (G11f) 如問題(G11e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*
- (G11g) 如問題(G11e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*
- (G11h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？
- (G11i) 如問題(G11h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

-
- (G12) **風險監控的審查與測試**
- (G12a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？
- (G12b) 如問題(G12a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*
- (G12c) 如問題(G12a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*
- (G12d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統 #6

- (G13) **交易安排**
- (G13a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(G13b)至(G13c)提供以上交易系統的類型：

- (G13b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G13c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(G14) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(G14a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(G14b) 如問題(G14a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(G14a)的回答為「是」，請在問題(G14c)至(G14f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(G14c) . 實時價格

(G14d) . 理論價格

(G14e) . 上一個交易日的收盤價

(G14f) . 其他 (請在問題(G14g)中提供其價格偏離監控機制)

(G14g) 如問題(G14f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(G14h) 如問題(G14c)至(G14f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(G14i) 如問題(G14a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(G14j) 如問題(G14i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(G14i)的回答為「是」，請在問題(G14k)至(G14m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(G14k) 軟封鎖機制

(G14l) 硬封鎖機制

(G14m) 其他 (請在問題(G14n)說明)

(G14n) 如問題(G14m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(G15) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(G15a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (G15b) 如問題(G15a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (G15c) 如問題(G15a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (G15d) 如問題(G15a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (G15e) 如問題(G15d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(G15d)的回答為「是」，請在問題(G15f)至(G15i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (G15f) 取消買賣盤
- (G15g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (G15h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示
- (G15i) 其他 (請在下方的問題(G15j)中具體說明)
- (G15j) 如問題(G15i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(G16) 價格偏離相關的交易後監控 [註20]

- (G16a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)
- (G16b) 如問題(G16a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離風險監控的原因。*

(G17) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(G13c)的回答為「是」，請回答問題(G17a)至(G17h)。

- (G17a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？
- (G17b) 如問題(G17a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*
- (G17c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G17d) 如問題(G17c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。
*。

(G17e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(G17f) 如問題(G17e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(G17g) 如問題(G17e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(G17h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(G17i) 如問題(G17h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。
*。

(G18) 風險監控的審查與測試

(G18a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(G18b) 如問題(G18a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(G18c) 如問題(G18a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(G18d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統 #7

(G19) 交易安排

(G19a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(G19b)至(G19c)提供以上交易系統的類型：

(G19b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(G19c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(G20) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(G20a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G20b) 如問題(G20a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(G20a)的回答為「是」，請在問題(G20c)至(G20f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(G20c) • 實時價格

(G20d) • 理論價格

(G20e) • 上一個交易日的收盤價

(G20f) • 其他 (請在問題(G20g)中提供其價格偏離監控機制)

(G20g) 如問題(G20f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(G20h) 如問題(G20c)至(G20f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(G20i) 如問題(G20a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(G20j) 如問題(G20i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(G20i)的回答為「是」，請在問題(G20k)至(G20m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(G20k) 軟封鎖機制

(G20l) 硬封鎖機制

(G20m) 其他 (請在問題(G20n)說明)

(G20n) 如問題(G20m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(G21) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(G21a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

(G21b) 如問題(G21a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

(G21c) 如問題(G21a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

(G21d) 如問題(G21a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G21e) 如問題(G21d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(G21d)的回答為「是」，請在問題(G21f)至(G21i)中具體說明所採取的跟進行動。

(G21f) 取消買賣盤

(G21g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤

(G21h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

(G21i) 其他 (請在下方的問題(G21j)中具體說明)

(G21j) 如問題(G21i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(G22) 價格偏離相關的交易後監控 [註20]

(G22a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(G22b) 如問題(G22a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(G23) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(G19c)的回答為「是」，請回答問題(G23a)至(G23h)。

(G23a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(G23b) 如問題(G23a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(G23c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(G23d) 如問題(G23c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(G23e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(G23f) 如問題(G23e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(G23g) 如問題(G23e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(G23h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G23i) 如問題(G23h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。
*。

(G24) **風險監控的審查與測試**

(G24a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(G24b) 如問題(G24a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(G24c) 如問題(G24a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(G24d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統#8

(G25) **交易安排**

(G25a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(G25b)至(G25c)提供以上交易系統的類型：

(G25b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）

(G25c) 算法交易系統（由程序產生訂單）

(G26) **價格偏離相關的交易前監控[註17]**

(G26a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(G26b) 如問題(G26a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(G26a)的回答為「是」，請在問題(G26c)至(G26f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(G26c) • 實時價格

(G26d) • 理論價格

(G26e) • 上一個交易日的收盤價

(G26f) • 其他（請在問題(G26g)中提供其價格偏離監控機制）

(G26g) 如問題(G26f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (G26h) 如問題(G26c)至(G26f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*
- (G26i) 如問題(G26a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？
- (G26j) 如問題(G26i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(G26i)的回答為「是」，請在問題(G26k)至(G26m)中指出所採用的提示及攔截機制。

- (G26k) 軟封鎖機制
- (G26l) 硬封鎖機制
- (G26m) 其他 (請在問題(G26n)說明)
- (G26n) 如問題(G26m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(G27) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

- (G27a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？
- (G27b) 如問題(G27a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (G27c) 如問題(G27a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (G27d) 如問題(G27a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (G27e) 如問題(G27d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(G27d)的回答為「是」，請在問題(G27f)至(G27i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (G27f) 取消買賣盤
- (G27g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (G27h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示
- (G27i) 其他 (請在下方的問題(G27j)中具體說明)
- (G27j) 如問題(G27i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G28) **價格偏離相關的交易後監控[註20]**

(G28a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(G28b) 如問題(G28a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(G29) **算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)**

如問題(G25c)的回答為「是」，請回答問題(G29a)至(G29h)。

(G29a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(G29b) 如問題(G29a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(G29c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(G29d) 如問題(G29c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(G29e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(G29f) 如問題(G29e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(G29g) 如問題(G29e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(G29h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(G29i) 如問題(G29h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

(G30) **風險監控的審查與測試**

(G30a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(G30b) 如問題(G30a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G30c) 如問題(G30a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(G30d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

*如問卷的回答空間不足夠，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17] 「交易前」是指買賣盤尚未輸入至HKATS中央買賣盤紀錄的階段。

[註18] 有關期交所及聯交所訂明的價格參數，請參閱香港交易所網站「錯價交易處理程序」

： https://www.hkex.com.hk/Services/Trading/Derivatives/Overview/Trading-Mechanism/Error-Trades?sc_lang=zh-HK

[註19] 「交易時」是指買賣盤已被接納至HKATS中央買賣盤紀錄的階段。

[註20] 「交易後」是指買賣盤已於 HKATS中央買賣盤紀錄執行後的階段。

2026合規評核及現場視察之年度計劃

合規評核問卷

第四部分 - 交易及偏離價格風險監控 (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)

*本節所述之監控措施不包括HKATS 電子交易系統風險功能。

公司名稱

本節包括五組重複的問題 (問題(H1)至(H30))，每組包含六條問題。

- 如貴公司透過OAPI 應用程序發出買賣盤的交易系統超過三個，請就每一個額外的系統，於第四部分完成一整組問題 (例如問題(H1)至(H6))。
- 如貴公司僅使用 HKATS Online，且並無運作任何 OAPI 交易系統，則毋須填寫本部分。

就遵守《期交所規則》第819B條、《期權交易規則》第540條、2017年7月17日發出的《衍生產品市場之錯價交易申報》的通告 (編號：MO/DT/103/17 及 MO/DT/104/17) 內有關錯價交易的規定，以及《期交所規則》第522B條及 / 或《交易所規則》第612條有關內部管控程序的規定，請填寫以下問題：

交易系統 #9

(H1) 交易安排

- (H1a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(H1b)至(H1c)提供以上交易系統的類型：

- (H1b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

- (H1c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(H2) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

- (H2a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

- (H2b) 如問題(H2a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(H2a)的回答為「是」，請在問題(H2c)至(H2f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

- (H2c) • 實時價格

- (H2d) • 理論價格

- (H2e) • 上一個交易日的收盤價

- (H2f) • 其他 (請在問題(H2g)中提供其價格偏離監控機制)

- (H2g) 如問題(H2f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

- (H2h) 如問題(H2c)至(H2f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

- (H2i) 如問題(H2a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (H2j) 如問題(H2i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(H2i)的回答為「是」，請在問題(H2k)至(H2m)中指出所採用的提示及攔截機制。

- (H2k) 軟封鎖機制
- (H2l) 硬封鎖機制
- (H2m) 其他 (請在問題(H2n)說明)
- (H2n) 如問題(H2m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(H3) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

- (H3a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？
- (H3b) 如問題(H3a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (H3c) 如問題(H3a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (H3d) 如問題(H3a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (H3e) 如問題(H3d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(H3d)的回答為「是」，請在問題(H3f)至(H3i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (H3f) 取消買賣盤
- (H3g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (H3h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示
- (H3i) 其他 (請在下方的問題(H3j)中具體說明)
- (H3j) 如問題(H3i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(H4) 價格偏離相關的交易後監控[註20]

- (H4a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H4b) 如問題(H4a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(H5) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(H1c)的回答為「是」，請回答問題(H5a)至(H5h)。

(H5a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(H5b) 如問題(H5a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(H5c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(H5d) 如問題(H5c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(H5e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(H5f) 如問題(H5e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(H5g) 如問題(H5e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(H5h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(H5i) 如問題(H5h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

(H6) 風險監控的審查與測試

(H6a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(H6b) 如問題(H6a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(H6c) 如問題(H6a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(H6d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

交易系統 #10

(H7) 交易安排

(H7a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(H7b)至(H7c)提供以上交易系統的類型：

(H7b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(H7c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(H8) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(H8a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(H8b) 如問題(H8a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(H8a)的回答為「是」，請在問題(H8c)至(H8f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(H8c) • 實時價格

(H8d) • 理論價格

(H8e) • 上一個交易日的收盤價

(H8f) • 其他 (請在問題(H8g)中提供其價格偏離監控機制)

(H8g) 如問題(H8f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(H8h) 如問題(H8c)至(H8f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(H8i) 如問題(H8a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(H8j) 如問題(H8i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(H8i)的回答為「是」，請在問題(H8k)至(H8m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(H8k) 軟封鎖機制

(H8l) 硬封鎖機制

(H8m) 其他 (請在問題(H8n)說明)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H8n) 如問題(H8m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(H9) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(H9a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

(H9b) 如問題(H9a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

(H9c) 如問題(H9a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

(H9d) 如問題(H9a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？

(H9e) 如問題(H9d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(H9d)的回答為「是」，請在問題(H9f)至(H9i)中具體說明所採取的跟進行動。

(H9f) 取消買賣盤

(H9g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤

(H9h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

(H9i) 其他 (請在下方的問題(H9j)中具體說明)

(H9j) 如問題(H9i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(H10) 價格偏離相關的交易後監控[註20]

(H10a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(H10b) 如問題(H10a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(H11) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(H7c)的回答為「是」，請回答問題(H11a)至(H11h)。

(H11a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (H11b) 如問題(H11a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*
- (H11c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？
- (H11d) 如問題(H11c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*
- (H11e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？
- (H11f) 如問題(H11e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*
- (H11g) 如問題(H11e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*
- (H11h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？
- (H11i) 如問題(H11h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

-
- (H12) **風險監控的審查與測試**
- (H12a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？
- (H12b) 如問題(H12a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*
- (H12c) 如問題(H12a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*
- (H12d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統 #11

- (H13) **交易安排**
- (H13a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(H13b)至(H13c)提供以上交易系統的類型：

- (H13b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H13c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(H14) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(H14a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(H14b) 如問題(H14a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(H14a)的回答為「是」，請在問題(H14c)至(H14f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(H14c) • 實時價格

(H14d) • 理論價格

(H14e) • 上一個交易日的收盤價

(H14f) • 其他 (請在問題(H14g)中提供其價格偏離監控機制)

(H14g) 如問題(H14f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(H14h) 如問題(H14c)至(H14f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(H14i) 如問題(H14a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(H14j) 如問題(H14i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(H14i)的回答為「是」，請在問題(H14k)至(H14m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(H14k) 軟封鎖機制

(H14l) 硬封鎖機制

(H14m) 其他 (請在問題(H14n)說明)

(H14n) 如問題(H14m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(H15) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(H15a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (H15b) 如問題(H15a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (H15c) 如問題(H15a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (H15d) 如問題(H15a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (H15e) 如問題(H15d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(H15d)的回答為「是」，請在問題(H15f)至(H15i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (H15f) 取消買賣盤
- (H15g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (H15h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示
- (H15i) 其他 (請在下方的問題(H15j)中具體說明)
- (H15j) 如問題(H15i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(H16) 價格偏離相關的交易後監控 [註20]

- (H16a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)
- (H16b) 如問題(H16a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(H17) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(H13c)的回答為「是」，請回答問題(H17a)至(H17h)。

- (H17a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？
- (H17b) 如問題(H17a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*
- (H17c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H17d) 如問題(H17c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。
*。

(H17e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(H17f) 如問題(H17e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(H17g) 如問題(H17e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(H17h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(H17i) 如問題(H17h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。
*。

(H18) 風險監控的審查與測試

(H18a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(H18b) 如問題(H18a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(H18c) 如問題(H18a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(H18d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統 #12

(H19) 交易安排

(H19a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(H19b)至(H19c)提供以上交易系統的類型：

(H19b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(H19c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(H20) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(H20a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H20b) 如問題(H20a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(H20a)的回答為「是」，請在問題(H20c)至(H20f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(H20c) • 實時價格

(H20d) • 理論價格

(H20e) • 上一個交易日的收盤價

(H20f) • 其他 (請在問題(H20g)中提供其價格偏離監控機制)

(H20g) 如問題(H20f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(H20h) 如問題(H20c)至(H20f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(H20i) 如問題(H20a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(H20j) 如問題(H20i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(H20i)的回答為「是」，請在問題(H20k)至(H20m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(H20k) 軟封鎖機制

(H20l) 硬封鎖機制

(H20m) 其他 (請在問題(H20n)說明)

(H20n) 如問題(H20m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(H21) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(H21a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

(H21b) 如問題(H21a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

(H21c) 如問題(H21a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H21d) 如問題(H21a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？

(H21e) 如問題(H21d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(H21d)的回答為「是」，請在問題(H21f)至(H21i)中具體說明所採取的跟進行動。

(H21f) 取消買賣盤

(H21g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤

(H21h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

(H21i) 其他 (請在下方的問題(H21j)中具體說明)

(H21j) 如問題(H21i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(H22) 價格偏離相關的交易後監控 [註20]

(H22a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(H22b) 如問題(H22a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(H23) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(H19c)的回答為「是」，請回答問題(H23a)至(H23h)。

(H23a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(H23b) 如問題(H23a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(H23c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(H23d) 如問題(H23c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(H23e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(H23f) 如問題(H23e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(H23g) 如問題(H23e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (H23h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？
- (H23i) 如問題(H23h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。^{*}

(H24) 風險監控的審查與測試

- (H24a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？
- (H24b) 如問題(H24a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。^{*}
- (H24c) 如問題(H24a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。^{*}
- (H24d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。^{*}

交易系統 #13

- (H25) 交易安排
- (H25a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(H25b)至(H25c)提供以上交易系統的類型：

- (H25b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）
- (H25c) 算法交易系統（由程序產生訂單）

(H26) 價格偏離相關的交易前監控[註17]

- (H26a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？
- (H26b) 如問題(H26a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。^{*}

如問題(H26a)的回答為「是」，請在問題(H26c)至(H26f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

- (H26c) • 實時價格
- (H26d) • 理論價格
- (H26e) • 上一個交易日的收盤價
- (H26f) • 其他 (請在問題(H26g)中提供其價格偏離監控機制)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (H26g) 如問題(H26f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*
- (H26h) 如問題(H26c)至(H26f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*
- (H26i) 如問題(H26a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？
- (H26j) 如問題(H26i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(H26i)的回答為「是」，請在問題(H26k)至(H26m)中指出所採用的提示及攔截機制。

- (H26k) 軟封鎖機制
- (H26l) 硬封鎖機制
- (H26m) 其他 (請在問題(H26n)說明)
- (H26n) 如問題(H26m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

-
- (H27) 交易時偏離價格風險監控 [註19]
- (H27a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？
- (H27b) 如問題(H27a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (H27c) 如問題(H27a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (H27d) 如問題(H27a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (H27e) 如問題(H27d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(H27d)的回答為「是」，請在問題(H27f)至(H27i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (H27f) 取消買賣盤
- (H27g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (H27h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H27i) 其他 (請在下方的問題(H27j)中具體說明)

(H27j) 如問題(H27i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(H28) 價格偏離相關的交易後監控[註20]

(H28a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(H28b) 如問題(H28a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(H29) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(H25c)的回答為「是」，請回答問題(H29a)至(H29h)。

(H29a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(H29b) 如問題(H29a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(H29c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(H29d) 如問題(H29c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(H29e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(H29f) 如問題(H29e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(H29g) 如問題(H29e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(H29h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(H29i) 如問題(H29h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

(H30) 風險監控的審查與測試

(H30a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(H30b) 如問題(H30a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(H30c) 如問題(H30a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

(H30d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

- END -

*如問卷的回答空間不足夠，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17] 「交易前」是指買賣盤尚未輸入至HKATS中央買賣盤紀錄的階段。

[註18] 有關期交所及聯交所訂明的價格參數，請參閱香港交易所網站「錯價交易處理程序」

：https://www.hkex.com.hk/Services/Trading/Derivatives/Overview/Trading-Mechanism/Error-Trades?sc_lang=zh-HK

[註19] 「交易時」是指買賣盤已被接納至HKATS中央買賣盤紀錄的階段。

[註20] 「交易後」是指買賣盤已於 HKATS中央買賣盤紀錄執行後的階段。