

香港交易及結算所有限公司是香港聯合交易所有限公司、香港期貨交易所有限公司及香港中央結算有限公司之認可控制人
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited is the recognised controller of The Stock Exchange of Hong Kong Limited, Hong Kong Futures Exchange Limited and Hong Kong Securities Clearing Company Limited

通告 CIRCULAR

事項

Subject: **HKATS 軟件提升**

查詢

Enquiry: **HKATS 熱線 2211- 6360**

根據二零一二年就十月十六日發出的通告(編號: DMD/131/12)，HKATS 軟件提升的市場演習已於二零一二年十月二十日(星期六)完成。大部份交易所參與者已確認其對軟件提升正式推出的準備。但由於個別的交易所參與者未能順利完成演習程序，香港交易及結算所有限公司(「香港交易所」)將於二零一二年十一月三日(星期六)進行第二次市場演習以確保正式推行日的順利。交易所會另行通知有關之交易所參與者演習的詳細安排。

於第二次市場演習順利完成後，香港交易所計劃於二零一二年十一月十二日(星期一)推行包括中央通訊閘上數據壓縮功能、已改良之CLICKTrade軟件和推出動態價格帶機制之HKATS軟件提升。

推出的時間表及活動

推出的時間表和活動概述如下：

日期	時間	活動
二零一二年十一月三日 (星期六)	上午九時正 至 上午十時 十五分	第二次市場演習
二零一二年十一月十日 (星期六)	全日	新軟件轉換
二零一二年十一月十一日 (星期日)	上午九時正 至上午十一 時正	交易所參與者連接時段
二零一二年十一月十二日 (星期一)	全日	正式推行
二零一二年十一月十二日 至二十三日	全日	穩定期

交易所參與者必須注意以下活動，而結算所參與者則請注意二零一二年十月二十六日發

香港交易及結算所有限公司
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited

香港中環港景街一號國際金融中心一期12樓
12/F, One International Finance Centre, 1 Harbour View Street, Central, Hong Kong

電話 Tel: +852 2522 1122 傳真 Fax: +852 2295 3106 網址 Website: www.hkex.com.hk 電郵 E-mail: info@hkex.com.hk

出的通告（編號：CD/DCO/DCASS/015/2012）。

新軟件轉換的週末（二零一二年十一月十日至十一日）

香港交易所會為HKATS進行新軟件轉換。交易所參與者請不要於該週末期間關上網間連接器。

於正式推行前，香港交易所已安排於二零一二年十一月十一日（星期日）上午九時正至上午十一時正進行一個連接時段。香港交易所鼓勵所有交易所參與者積極參與該連接時段，除進行連接測試外，交易所參與者亦可藉此機會設定「preferences 視窗」及「user profile」，以方便於推出日使用 CLICK Trade XT 和相應的應用程式介面（「OAPI」）。

交易所參與者若要參與連接時段，必須填妥附件一的參加表格（只有英文版），並於二零一二年十一月二日或以前傳真或電郵至香港交易所。

推行日（二零一二年十一月十二日）

1. 適用於 CLICK 用家

所有 CLICK 用家必須使用 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27)版本登入 HKATS。在執行任何交易指示前，可開啟“Help 目錄”下的“About CLICK Trade XT 視窗”確定運行版本。使用 CLICK Trade XT(v.1.9.1.62 或 v.1.9.1.65) 版本的 CLICK 用家可能會發現非預期的系統反應。

2. 適用於 OAPI 用家

OAPI 使用者應使用通過 HKATS 軟件提升之系統核證測試。所有 HKATS OAPI 需按照下列程序完成重新編寫：

- 在壓縮選項中設定為OMNI-API_OPVAL_ANY
- 利用支援的 HKATS OAPI 程式函式庫重新編寫其 HKATS OAPI 程式
- 利用新的標題檔案重新編寫其 HKATS OAPI 程式

以下為支援的 HKATS OAPI 程式函式庫的清單：

支援的 HKATS OAPI 程式函式庫
Windows Server 2008, Service Pack 2, x86-64 architecture Windows Server 2008, Service Pack 2, x86-32 architecture
Red Hat Enterprise Linux, version 5.2, x86-64 architecture Red Hat Enterprise Linux, version 5.2, x86-32 architecture
SunOS 5.10, SPARC32 architecture

穩定期（二零一二年十一月十二日至二十三日）

推行HKATS軟件升級後的首兩週(即二零一二年十一月十二日至二十三日)為軟件提升的穩定期。在穩定期內，若新版本系統遇到無法修復的問題，香港交易所或會啟動還原程序把系統還原至原本版本以便恢復衍生產品市場交易及結算服務。所有緊急宣佈將透過 CLICK Trade XT 的市場訊息視窗、交易所新聞系統(「ENS」)及其他可用的溝通渠道進行。

請注意還原系統版本的安排只會於穩定期內進行。因此，交易所參與者必須於穩定期內保留現時的 CLICK Trade XT(v.1.9.1.62 或 v.1.9.1.65) 版本及 OAPI 軟件。詳情請參閱附件二的還原安排。有關穩定期的結束，香港交易所將發出通告通知交易所參與者。

為協助交易所參與者確認對軟件提升的準備，香港交易所已為交易所參與者準備了一份核對用的清單，詳情請參閱附件三。香港交易所鼓勵交易所參與者將核對用的清單分派給每一位HKATS用家。

交易所參與者應該注意有關動態價格限制機制，在最初階只適用於現貨月小型恆指期貨，而偏差參數和更新參數將分別設置為 4%和 1%。這些預設參數會因應未來的商業決策而作出適當的調整。

交易所謹此多謝各位參與者參與市場演習及支持 HKATS 軟件升級的推出。

如有任何查詢，請致電 HKATS 熱線 2211 6360。

交易科
衍生產品市場部
總監
何耀昌 謹啟

本通告已以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本的字義或詞義與英文本有所出入，概以英文本為準。

Connection Session Enrolment Form for HKATS Software Upgrade

To: Derivatives Market Department
 Hong Kong Exchanges and Clearing Limited

Email: clicksupport@hkex.com.hk
 Fax No: 2509 0724 or 2877 0017
 HKATS Hotline: 2211 6360

From: Participant Name: _____

- We will not participate in the connection session on Sunday
- We will participate in the connection session between **9:00 a.m. and 11:00am on Sunday, 11 November 2012**. The contacts for the connection session are as follows:

	Name	Phone no.	Mobile no.	Email
1				
2				

- Completed form should be returned by fax at 2509-0724 or 2877-0017 or email to clicksupport@hkex.com.hk on or before **Friday, 2 November 2012**
- Exchange Participants are advised to keep the completed enrolment form for record
- There is no order input session during the connection session

系統還原程序安排

請注意還原系統版本的安排只會於穩定期(即二零一二年十一月十二日至二十三日)內進行。若發生任何系統問題，交易所會調查問題的原因並盡可行的方法將其修復。如必須啟動還原程序，交易所內部會把 HKATS 系統還原至原本版本，同時於還原程序完成後通知交易所參與者，而還原程序預計約需三小時三十分完成。

1. 系統還原程序的訊息渠道

交易所會於決定還原系統時及完成還原程序後通知交易所參與者。在進行還原程序時，交易所會於 CLICK Trade XT 的市場訊息視窗、交易所新聞系統(「ENS」)及其他可用的溝通渠道把預期之系統還原時間以及所有市場的開市時段通知交易所參與者。

2. 交易所參與者安排

為確保交易所參與者能繼續在還原後的系統進行交易及營運，交易所參與者必須於系統提升後之穩定期的兩星期內保留現時的 HKATS 版本及相關的交易工具。

適用於 CLICK 用家

交易所參與者必須於穩定期內保留現時的 CLICK Trade XT(v.1.9.1.62 或 v.1.9.1.65) 版本，以便 CLICK 用家於系統還原程序完成後重新連接到 HKATS。

適用於 OAPI 用家

交易所參與者必須於穩定期內保留現時的 OAPI 軟件及所有能與還原後的系統兼容的工作站，以便 OAPI 用家於系統還原程序完成後重新連接到 HKATS。

3. 系統還原程序後的活動

HKATS 連接的建設

當系統還原程序完成後，交易所會即時通知所有交易所參與者。交易所參與者應使用 CLICK Trade XT (v.1.9.1.62 or v.1.9.1.65) 版本並以二零一二年就十一月九日的密碼登入。同時，參與者應確定“Information Feed Status 視窗”下的“Status 列”顯示“ON”。

HKEX 香港交易所

登入 HKATS 後，交易所參與者應於“Market Messages 視窗”查詢並獲得以下交易所訊息：

- 開市時段;
- 所有 HKATS 的特別交易安排; 及
- 其他重要的市場訊息

已完成交易確認

為確保系統還原程序前後交易訊息的準確，交易所參與者必須於還原程序完成後確認所有交易記錄。

4. 查詢

如查詢任何有關係統還原程序安排，請致電 HKATS 熱線 2211 6360。

5. 系統還原程序核對清單

已核對項目		√
1.	注意交易所發佈有關係統還原程序的市場訊息及交易所訊息	
2.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 當 HKATS 於系統還原程序後恢復後，使用 CLICK Trade XT(v.1.9.1.62 或 v.1.9.1.65) 版本登入	
3.	<u>適用於 OAPI 用家</u> : 當 HKATS 於系統還原程序後恢復後，使用能與還原系統兼容的 OAPI 程式登入	
4.	以二零一二年就十一月九日的密碼登入 HKATS	
5.	注意交易所發佈有關市場重開時段的市場訊息及交易所訊息	

核對清單- HKATS 軟件提升

已核對項目		√
(A) 於新軟件轉換的週末之前		
1.	於新軟件轉換的週末把網間連接器保持開啟	
(B) 二零一二年十一月十一日(星期日)的參與者連接時段		
2.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 使用 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27) 版本登入	
3.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 於 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27) 版本設定「preferences 視窗」	
4.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 於 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27) 版本設定「user profile」	
5.	<u>適用於 OAPI 用家</u> : 使用通過 HKATS 軟件提升之系統核證測試的 OAPI 程式登入	
6.	<u>適用於 OAPI 用家</u> : 設定 OAPI 程式的合適限制參數	
(C) 二零一二年十一月十二日(星期一)的正式推行日		
8.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 使用 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27) 版本登入	
9.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 於 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27) 版本設定「preferences 視窗」(如未完成)	
10.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 於 CLICK Trade XT (v.1.9.2.27) 版本設定「user profile」(如未完成)	
11.	<u>適用於 CLICK 用家</u> : 在執行任何交易指示前, 開啟“Help 目錄”下的“About CLICK Trade XT 視窗” 確定運行版本	
12.	<u>適用於 OAPI 用家</u> : 使用通過 HKATS 軟件提升之系統核證測試的 OAPI 程式登入	
13.	<u>適用於 OAPI 用家</u> : 設定 OAPI 程式的合適限制參數 (如未完成)	