

香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

HONG KONG FUTURES EXCHANGE LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項： 衍生產品市場之錯價交易申報提示

查詢： HKATS 熱線¹ TEL: 2211-6360

參照於 2017 年 7 月 14 日發出之通告 (編號: [MO/DT/103/20](#))，根據香港期貨交易所有限公司 (「交易所」) 的期交所規則、規例及程序的第 819B 條，交易所參與者可就偏離了交易所訂定的價格參數之交易，在不遲於以下指定時限內向交易所提出錯價交易提出申報：

- 1) 交易後的 10 分鐘內；或
- 2) 如此交易是自選組合交易，則可在交易後的 30 分鐘內

當交易所參與者提出錯價交易申報時，應確保連同以下的資料以指定方式一併或分別在不遲於錯價交易申報時限內提交以下的資料：

申報內容	備註
時間	以 hh:mm:ss 表示
系列	HKATS 系列代號 有關詳情，請參考 HKATS 操作手冊 的附錄 —
Match ID	HKATS 提供的交易識別號

¹ 所有 HKATS 熱線之來電均會被錄音。有關本交易所的私隱政策聲明請參閱以下網址：

http://www.hkex.com.hk/Global/Exchange/Privacy-Policy?sc_lang=zh-HK

申報內容	備註
Trade number	DCASS 提供的交易識別號
買/賣	註明該交易是買方或賣方
價格	成交價
數量	成交數量
交易所參與者申報時用的參考基準價格	價格值 ²

交易所參與者必須提醒其員工不可對任何已被交易所定為錯價的交易作出任何交易和持倉調整。

交易所參與者可以通過 HKATS 熱線 (+852) 2211-6360 提出錯價交易申報，並以電子表格模式提交以上的申報內容。收到申報者的所有申報內容後，交易所將按照期交所規則、規例及程序第 819B 條規定的相關程序處理。

HKATS 電子交易系統錯價交易評審委員會的決定對錯價交易的所有各方均具有約束力。交易所參與者應注意不是所有申報的錯價交易均會被註銷。

交易所參與者可瀏覽以下網址以詳細了解錯價交易處理程序：

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

²在有需要的情况下，交易所可要求交易所參與者提供其參考基準價格的計算方法和以此參考基準價格提出錯價交易申報的理據

參照於以下通告 (編號: [MO/DT/267/21](#))。為更有效防止輸入錯誤的買賣盤，交易所參與者務必按其買賣模式、常規及風險管理要求為各 HKATS 使用者和 HKATS Online 進行檢討及設定其最大買賣盤價格差距及數量參數，並將操作類別設定為 "Restriction" (限制)。使用 OMnet Application Programming Interface ("OAPI") 的參與者亦要制定價格及張數的相關限制，以減少因錯誤輸入交易指令引致的錯價交易。

營運科
交易部
聯席主管
何耀昌 謹啟

本通告以英文及中文譯本刊發。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。