編號 Ref. No.:	MO/DT/197/19
日期 Date:	29/11/2019

香港交易及結算所有限公司是《證券及期貨條例》所述的認可控制人，亦為香港聯合交易所有限公司、香港期貨交易所有限公司、香港中央結算有限公司、香港聯合交易所期權結算所有限公司、香港期貨結算有限公司及香港場外結算有限公司的控制人。

Hong Kong Exchanges and Clearing Limited is a recognized exchange controller under the Securities and Futures Ordinance which is the controller of The Stock Exchange of Hong Kong Limited, Hong Kong Futures Exchange Limited, Hong Kong Securities Clearing Company Limited, The SEHK Options Clearing House Limited, HKFE Clearing Corporation Limited and OTC Clearing Hong Kong Limited.

通告 CIRCULAR

事項： HKATS 買賣盤價格及數量差距參數設定

查詢： HKATS 熱線[1] 電話：2211-6360

參照交易所於 2018 年 12 月 3 日發出的通告 (編號：MO/DT/207/18) 。

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。

交易所參與者如已更新參數設定請填妥附上的確認表格並於 **2019 年 12 月 31 日**或之前傳真或電郵至香港交易所。

是項設定是為避免錯價交易的額外監管措施，並非以作取代各交易所參與者現有的內部監管。交易所參與者在處理客戶的買賣盤及交易時仍需承擔所有維持適當的交易運作和內部監管程序之責任。

[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

香港交易及結算所有限公司
香港中環康樂廣場8號交易廣場2期8樓
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited
8/F, Two Exchange Square, 8 Connaught Place, Central, Hong Kong
info@hkex.com.hk
(t) +852 2522 1122 (f) +852 2295 3106
hkexgroup.com | hkex.com.hk

有關如何在 HKATS Online 建立以上參數，請翻閱 HKATS 使用者手冊（只有英文版）第 7.5 節。
https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Trading/Derivatives/Infrastructure/HKATS/HKATSOnlineUsersGuide.pdf

市場科
衍生產品交易
主管
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。

HKEX
香港交易所

確認買賣盤價格及數量差距參數設定

送交　衍生產品交易

HKATS 熱線 : 2211 6360
傳真號碼: 2877 0017 or 2509 0724
電郵: hkatssupport@hkex.com.hk

由　交易所參與者名稱: _____

聯絡代表: _____

電話號碼: _____

日期: _____

HKATS 使用者名稱: _____(e.g. XXX1234)

Instrument Type	Price (% / ABS / MAX)	Volume
CES INDEX FUTURES – FUTURES		
CES INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
STOCK FUTURES – FUTURES		
STOCK FUTURES – TIME SPREAD		
MINI-HANG SENG FUTURES & OPTIONS – FUTURES		
MINI-HANG SENG FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
MINI-HANG SENG FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
MINI-HANG SENG FUTURES & OPTIONS – TIME SPREAD		
MINI-HANG SENG FUTURES & OPTIONS – TM COMBO		
STOCK OPTIONS – AMERICAN CALL OPTIONS		
STOCK OPTIONS – AMERICAN PUT OPTIONS		
STOCK OPTIONS – SYNTHETIC FUTURES		
STOCK OPTIONS – TM COMBO		
HIBOR FUTURES – FUTURES		
HIBOR FUTURES – TIME SPREAD		
DIVIDEND FUTURES – FUTURES		

HKEX
香港交易所

DIVIDEND FUTURES – TIME SPREAD		
HANG SENG FUTURES & OPTIONS – FUTURES		
HANG SENG FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
HANG SENG FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
HANG SENG FUTURES & OPTIONS – TIME SPREAD		
HANG SENG FUTURES & OPTIONS – TM COMBO		
FLEXIBLE HANG SENG INDEX OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
FLEXIBLE HANG SENG INDEX OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
FLEXIBLE HSCEI OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
FLEXIBLE HSCEI OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
HSCEI FUTURES & OPTIONS – FUTURES		
HSCEI FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
HSCEI FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
HSCEI FUTURES & OPTIONS – TIME SPREAD		
HSCEI FUTURES & OPTIONS – TM COMBO		
WEEKLY HANG SENG INDEX OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
WEEKLY HANG SENG INDEX OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
WEEKLY HANG SENG INDEX OPTIONS – TM COMBO		
HSI VOLATILITY INDEX FUTURES – FUTURES		
HSI VOLATILITY INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
SECTOR INDEX FUTURES – FUTURES		
SECTOR INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
RMB CURRENCY FUTURES & OPTIONS – FUTURES		
RMB CURRENCY FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
RMB CURRENCY FUTURES & OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
RMB CURRENCY FUTURES & OPTIONS – TIME SPREAD		
RMB CURRENCY FUTURES & OPTIONS – TM COMBO		
HSI & HSCEI TRI FUTURES – FUTURES		
HSI & HSCEI TRI FUTURES – TIME SPREAD		
WEEKLY HSCEI OPTIONS – FUTURES STYLE CALL		
WEEKLY HSCEI OPTIONS – FUTURES STYLE PUT		
WEEKLY HSCEI OPTIONS – TM COMBO		
BRAZIL INDEX FUTURES – FUTURES		
BRAZIL INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
SOUTH AFRICA INDEX FUTURES – FUTURES		
SOUTH AFRICA INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
RUSSIA INDEX FUTURES – FUTURES		
RUSSIA INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
MSCI AXJ NTR INDEX FUTURES – FUTURES		
MSCI AXJ NTR INDEX FUTURES – TIME SPREAD		
CNH GOLD FUTURES – FUTURES		
CNH GOLD FUTURES – TIME SPREAD		
USD GOLD FUTURES – FUTURES		
USD GOLD FUTURES – TIME SPREAD		
USD BASE AND FERROUS FUTURES – FUTURES		

HKEX
香港交易所

USD BASE AND FERROUS FUTURES – TIME SPREAD		
CNH LONDON METAL MINI FUTURES – FUTURES		
CNH LONDON METAL MINI FUTURES – TIME SPREAD		
CASH-SETTLED RMB CURRENCY FUT – FUTURES		
CASH-SETTLED RMB CURRENCY FUT – TIME SPREAD		
CASH-SETTLED USD CURRENCY FUT – FUTURES		
CASH-SETTLED USD CURRENCY FUTURES – TIME SPREAD		

(Note: Please fill in one form for each HKATS user and update us when you change your parameter)

私隱政策聲明

香港交易及結算所有限公司以及其不時的附屬公司（統稱「**本集團**」）（在本私隱政策聲明中，各自稱為「**香港交易所**」、「**我們**」或「**本集團成員公司**」，視適用情況而定）明白根據香港法例第 486 章《個人資料（私隱）條例》（該「**《條例》**」）其在收集、持有、處理、使用及／或轉移個人資料方面的責任。個人資料的收集只限作合法且相關的用途，並會採取一切實際可行方法去確保我們持有的個人資料準確無誤。我們將會根據本私隱政策聲明使用我們不時所收集閣下的個人資料。

我們定期檢討這項私隱政策聲明，並可能不時加以修訂或加入具體指示、政策及條款。本私隱政策聲明如有任何重要修訂，我們會通過 閣下提供給我們的聯絡方式通知 閣下，也會按該《條例》的規定，讓 閣下可以透過屆時通知 閣下的途徑選擇拒絕接收此類修訂通知。否則，關於通過香港交易所網站或其他方式而提供給我們的個人資料，閣下繼續使用香港交易所網站或繼續維持與我們的關係即被視為同意並接受此項私隱政策聲明（不時修訂）。

如對這項私隱政策聲明或我們如何使用 閣下的個人資料有任何疑問，請通過下文「聯繫我們」所載的任何一個通訊渠道與我們聯繫。

我們會採取一切實際可行方法確保個人資料的安全，以及避免個人資料在未經授權或意外的情況下被取用、刪除或作其他用途。這包括在實物具體上、技術上及程序上的適當安全措施，確保只有經授權人士才能取用個人資料。

請注意：如 閣下沒有向我們提供個人資料（或有關 閣下代理人的個人資料），我們可能無法提供 閣下要求的資訊、產品或服務又或無法處理 閣下的要求、申請、訂購或登記，亦可能無法執行或履行監管職能（定義見下文）。

目的
我們或會為了以下目的而不時收集 閣下的個人資料（包括但不限於閣下的姓名、郵寄地址、電話號碼、電郵地址、出生日期和登入名稱）：
1. 處理 閣下的申請、訂購及登記使用我們的產品及服務；
2. 執行或履行香港交易所以及任何由其作為認可控制人的公司（定義見香港法例第 571 章《證券及期貨條例》）的職能（「監管職能」）；
3. 向 閣下提供我們的產品和服務，以及與此相關的賬戶管理；
4. 進行研究和統計分析；
5. 處理 閣下應聘香港交易所職位或工作的申請，以評估 閣下是否為適合人選，並向 閣下的前僱主進行相關的背景查證；及
6. 與上列任何一項有直接關聯的其他目的。

直接營銷
如 閣下已經給予同意而其後並無撤回，我們也可能會使用 閣下的姓名、郵寄地址、電話號碼和電郵地址，用以寄送宣傳資料，就香港交易所以及本集團其他成員公司的金融和資訊服務進行直接營銷活動。

如不希望收到我們的宣傳和直接營銷資料，或不希望收到某類宣傳和直接營銷資料，又或不希望在某種途徑收到此類材料，請通過下文「聯繫我們」所載的其中一種通訊渠道聯絡我們。為確保可以迅速處理 閣下的要求，請提供 閣下的全名、電郵地址、登入名稱及所訂閱產品及／或服務的詳情。

身份證號碼
我們也可能會根據適用法律或規例又或任何對我們有管轄權限的監管者的要求而收集並處理 閣下的身份證號碼，另外亦可能因為需要識別 閣下的身份而（在不抵觸該《條例》的前提下）收集並處理閣下的身份證號碼。

轉移 閣下的個人資料作直接營銷
除非 閣下已經拒絕，否則我們可能會將 閣下的姓名、郵寄地址、電話號碼和電郵地址轉交本集團其他成員公司，使其可向 閣下寄送宣傳資料，就其金融和資訊服務進行直接營銷活動。

其他轉移個人資料的情況
為了以上一個或多於一個目的，閣下的個人資料可能會被：
1. 轉交予本集團其他成員公司，而使本集團（在香港或其他地方）的相關人員獲得 閣下的個人資料；就此，閣下同意將 閣下的個人資料轉離香港；
2. 提供予任何向香港交易所及/或本集團在香港或其他地方的其他成員提供行政、電訊、電腦、付款、追收欠款、資料處理或其他服務的代理、承判商或第三方；及
3. 轉交予其他人士（收集資料時會通知 閣下）。

我們如何使用 cookies
閣下通過香港交易所網站查閱我們的資訊或服務時，應當留意到網站有使用 cookies。Cookies 是指儲存在 閣下瀏覽器內的資料檔。閣下進入香港交易所網站時，網站即在 閣下瀏覽器內自動安裝並使用 cookies。香港交易所網站使用兩種 cookies。

Session Cookies：一種只在 閣下瀏覽香港交易所網站期間留存於瀏覽器內的短暫性質 cookies，用處在於取得並儲存配置資訊及管理網站，包括「攜帶」資訊以隨 閣下瀏覽網站的不同版頁，譬如以免 閣下每到一個版頁也要重新輸入資訊。Session cookies 也會用來編備關於香港交易所網站使用的匿名統計資料。

Persistent Cookies：一種留存於瀏覽器內較長時間的 cookies，用以編備關於香港交易所網站使用的匿名統計資料，或追蹤和記錄使用者的習慣偏好。

香港交易所網站所用的 cookies 不包含個人資料。閣下可以更改瀏覽器或網路安全軟件中的設定，拒絕接受瀏覽器內的 cookies。不過，這樣或會令 閣下不能使用或啟動香港交易所網站中的某些功能。

法律與法規的遵守
香港交易所及本集團其他成員公司或要為了遵守適用法律及規例，或遵守法院指令、傳票或其他法定程序（無論於香港或其他地方），或遵從政府機關、執法機構或類似機構（無論位於香港或其他地方）提出的要求，又或執行或履行監管職能，而必須保留、處理及/或披露 閣下的個人資料。香港交易所及本集團其他成員公司或須披露 閣下的個人資料，以履行與 閣下的協議，或保護我們或我們僱員的權利、財產或安全，又或執行或履行監管職能。

公司重組
隨著我們持續發展業務，我們可能會重組集團架構或出現控制權易手或業務合併。在這些情況下，閣下的個人資料或會按這份私隱政策聲明或另一份將會通知 閣下的私隱政策聲明而移交繼續運營我們業務或類似服務的第三方。此等第三方或在香港以外的地方，就此等收購或重組而使用 閣下個人資料的地點也可能不在香港。

查閱及更正個人資料
根據該《條例》，閣下有權查明我們是否持有 閣下的個人資料、取得資料的備份及更正任何不準確資料，也可以要求我們通知 閣下其持有資料的種類。如欲查閱有關資料，須使用個人資料私隱專員（「**私隱專員**」）指定的表格（可於私隱專員公署的官方網站下載）或經此連接 https://www.pcpd.org.hk/english/publications/files/Dforme.pdf 提出。

如欲查閱和更正個人資料，或查閱有關政策與常規以及我們所持有資料種類，應以書面及郵遞形式提出要求（見以下「聯繫我們」）。

我們或會因應 閣下查閱資料要求而產生的行政及實際成本而收取合理的費用。

終止或取消
任何時候如果 閣下在我們的賬戶或與我們的關係被取消或終止，我們會隨即在合理情況下盡快終止處理 閣下的個人資料，但也可按合理需要而保留有關資料，合理的需要包括：資料歸檔；解決實際或潛在的爭議；遵守適用法律及規例；履行與 閣下的任何協議；保障我們及我們僱員的權利、財產或安全；以及執行或履行我們的職能、義務及責任等。

一般資料
本私隱政策聲明的中英文本如有差異，概以英文版為準。

聯繫我們
郵寄：
香港中環康樂廣場 8 號
交易廣場 2 期 8 樓
香港交易及結算所有限公司
個人資料隱私主任

電郵：
DataPrivacy@HKEX.COM.HK