編號 Ref. No.:	MO/DT/204/19
日期 Date:	16/12/2019

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： 有關 HKATS 於 2020 年之計劃項目

查詢： HKATS 熱線[1] 2211-6360

香港交易及結算所有限公司 (「香港交易所」) 計劃於 2020 年實施一系列與 HKATS 電子交易系統 (「HKATS」) 及其他衍生產品市場系統有關之項目。為了使交易所參與者能為這些項目作出規劃及準備，請參閱下列的暫定時間表：

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2020 年第一季及第四季	更新 HKATS Online 及 HKATS 電子交易風險管理系統之 Google Chrome 瀏覽器的版本	為配合 HKATS Online 工作站及 HKATS 電子交易風險管理系統之 Google Chrome 瀏覽器的版本升級，香港交易所計劃每年提升 Google Chrome 瀏覽器版本兩次。 **對參與者的影響：** 交易所參與者**必須**根據香港交易所的要求提升其 HKATS Online 工作站和 HKATS 電子交易風險管理系統之 Google Chrome 瀏覽器的版本。 有關版本之升級安排將於 **2020 年第一季及第三季**公佈。

[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/chi/global/privacy_policy_c.htm

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2020 年第一季	HGC SDNet/2 綫路終止服務	參閱通告 MO/DT/105/19，環球全域電訊有限公司(HGC)由 2020 年 5 月 1 日起終止擔任證券及衍生產品市場綜合網絡(SDNet/2)認可供應商。 **對參與者的影響：** 基於終止服務通知期和安裝新的 SDNet/2 綠路或香港交易所服務網絡(HSN)之所需時間，香港交易所建議目前使用 HGC SDNet/2 服務之交易所參與者，應儘早計劃更換至其他 SDNet/2 認可供應商或 HSN 之服務。
2020 年第二季	推出新的批量報價交易指令	爲協助交易所參與者更好地管理其系統以提供莊家/流通量提供者的報價，交易所計劃推出新的於標準合約上的批量報價交易指令 MO93，該指令允許交易所參與者可以在同一合約上放置多個報價。 **對參與者的影響：** 有興趣使用這種新交易指令作報價的交易所參與者應當根據其業務需要進行內部評估/修改。若 OAPI 應用程式有任何改動，請與交易所進行程式認證測試。 相關的技術規範將於 **2020 年第一季**初提供。

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2020 年第二季	應對緊急情況之市場演習	為協助交易所參與者驗證其系統在緊急情況下的運作能力，香港交易所將於 2020 年第二季舉行强制性的市場演習。 **對參與者的影響：** 全市場交易所參與者**必須**參與該市場演習以確保在緊急情況下其端到端系統和營運能正常運作。 有關市場演習的詳細安排將於 **2020 年第一季度**公佈。
2020 年第二季	强制性使用莊家保護功能	為保障衍生產品市場的正常秩序，期權市場的莊家和流通量提供者必須使用 HKATS 莊家保護(“MMP”)功能。 **對參與者的影響：** 莊家和流通量提供者**必須**在 **2020 年第二季或之前**完成其系統更新（如有適用）和相應的 MMP 參數設置。 有關安排將於 **2020 年 1 月**通知相關莊家和流通量提供者。
2020 年第三季	升級 RHEL v7 的 OAPI 文庫	爲了應對 Red Hat Enterprise Linux (RHEL) 版本 6 (v6) 的維護支持的終止，當前使用 RHEL v6 的 OAPI 應用程式需要將其 OAPI 文庫升級到 RHEL v7。 **對參與者的影響：** 受影響之交易所參與者需要在 **2020 年 9 月 30 日或之前**升級相應的 OAPI 文庫版本及完成相關程式驗證。

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2020 年第四季	衍生產品市場交易系統基礎設施升級及搬遷後備數據中心	為應對市場和業務發展需要，香港交易所將於 2020 年升級 HKATS 的基礎設施以及搬遷後備數據中心。 **對參與者的影響：** 為確保升級後的業務連續性，全市場交易所參與者**必須**參與計劃於 2020 年第四季舉行的強制性市場演習。 相關的詳細安排將於 **2020 年第三季度**公佈。
2020 年第四季	衍生產品市場前端監控風險管理系統 2.0	為保障衍生產品市場的正常秩序，香港交易所計劃提升前端監控風險管理系統，以此交易所參與者能調較一段時間範圍內的風險限額，從而為交易所參與者提供多一重風險控制能力。 **對參與者的影響：** 交易所參與者**必須**參與市場演習，並需要與香港交易所合作設定新的風險限額。 有關市場演習的詳細資料及時間表將於 **2020 年第四季**提供。

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
2020 年第四季	自成交防範功能 2.0	為提供交易所參與者多一重方法以防範自成交，及允許自成交可於不同賬戶上作更細微的設定，香港交易所計劃提升自成交防範功能。 **對參與者的影響：** 交易所參與者**必須**參與強制性市場演習以確保其熟悉此項提升措施。 有關市場演習的詳細資料及時間表將於 **2020 年第四季**公佈。
2020 年下半年	OMD-D 技術更新	為了保持市場數據系統的穩定性，OMD-D 將於 2020 年下半年度進行技術更新，該技術更新內容包括硬件更新、操作系統升級和軟件架構更新。 **對參與者的影響：** 此技術更新將會在現有的功能上進行輕微的改動。因此，我們將會安排市場演習，以便 OMD-D 客戶驗證其系統可連接到相應的市場數據系統並能正常運作。 更改內容和測試時間表的詳情將分別在 **2020 年第一季**度提供。

暫定推出時間	計劃進行之項目	內容 / 對參與者的影響
持續進行中	强制性重新認證 OAPI 應用程式	為確保交易所參與者的 OAPI 應用程式符合最新的 HKATS 軟件版本，對於長時間未進行重新認證測試的 OAPI 應用程式，必須進行强制性的重新認證測試。 **對參與者的影響：** 交易所參與者**必須每三年**重新認證其 OAPI 應用程式。

香港交易所強烈鼓勵交易所參與者聯絡其資訊科技部門或系統供應商以作適當的計劃及準備。

如有任何查詢，請致電 HKATS 熱線 2211 6360。

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文刊發。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。