HKEX
香港交易所

| | |
|---|---|
| 編號 Ref. No.: | MO/DT/281/24 |
| 日期 Date: | 02/12/2024 |

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 電子交易系統風險功能 – 衍生產品市場前端監控風險管理系統（「PTRM」）：提示各參與者定期檢測

查詢： HKATS 熱線[1] 電話：2211-6360

參照於 2023 年 12 月 1 日發出之通告（編號:MO/DT/289/23）所有參與者應定期檢測 PTRM 系統，並留意相關匯報規定：

| 項目 | 事件 | 說明 |
|---|---|---|
| 1 | 定期審查風險上限設定 | • 風險上限**必須**合理地反映參與者交易活動所存在的風險及目前的市場狀況。<br>• 新加入的參與者需要在 6 個月內與交易所預約以進行首次風險上限設定。<br>• PTRM 授權人員應要對 PTRM 系統運作有基本認識。 |
| 2 | 更新 PTRM 授權人員的資料 | • 如要更新 PTRM 授權人員資料，請填妥聯絡表格並儘快提交到交易所。 |
| 3 | 使用緊急按鈕後的匯報規定 | • 參與者使用下列緊急按鈕後**必須**經 HKATS 熱線匯報：<br>1) Stop<br>2) Mass Order Cancellation<br>3) Kill Switch |

[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

HKEX
香港交易所

PTRM 授權人員的類別：

| 類別 | 使用權 | 適用於 |
|---|---|---|
| 1. 風險額度管理權限（Risk Limit Managers） | 調整風險上限及行使緊急按鈕的全面使用權 | • 直接結算參與者，亦為交易所參與者<br>• 全面結算參與者<br>• 全面結算參與者，亦為註冊機構 |
| 2. 交易單位權限（Trading Units） | 行使緊急按鈕的部分使用權 | • 非結算參與者 |

如有任何查詢，請致電 HKATS 熱線 2211 6360或電郵至hkatssupport@hkex.com.hk。
香港交易所謹此感謝所有參與者的一切支持。

營運科
交易部
聯席主管
張宙 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。*