

交易通 - 期貨交易系統用戶手冊

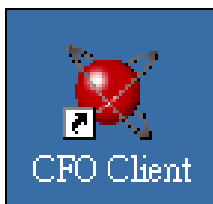
目 錄

(一) 登入程序.....	3
(二) 查詢期貨報價	5
(A) 從「Price Information」查閱報價.....	5
(B) 查詢五個買賣價位的期貨報價	8
(C) 查詢未成交合約的價位排序.....	8
(三) 落盤.....	9
(A) 從「Order Ticket」視窗落盤	9
(B) 從「Price Information」視窗落盤.....	10
(C) 從「Price Depth」視窗落盤	10
(D) 從「Fast Order」視窗落盤.....	11
(四) 風險管理.....	12
(A) 「Alert」提醒視窗	12
(B) 「Approve」審批視窗	13
(C) 「Reject」拒絕視窗	13
(D) 追補按金.....	14
(五) 查閱未成交買賣合約	15
(A) 從「Client Status Enquiry」瀏覽未成交買賣合約	15
(B) 從「Order Book」瀏覽未成交買賣合約.....	15
(六) 取消、啓動或隱藏未成交買賣合約.....	17
(A) 從「Order Book」執行取消、啓動或隱藏未成交買賣合約.....	17
(B) 從「Client Status Enquiry」執行取消、啓動或隱藏未成交買賣合約.....	17
(七) 更改未成交買賣盤的資料	18
(A) 從「Client Status Summary」更改未成交的期貨買賣合約	18
(B) 從「Order Book」更改未成交的期貨買賣合約.....	19
(八) 查閱已成交買賣合約	20
(A) 從「Trade Book」瀏覽已成交買賣合約.....	20
(B) 從「Order History」瀏覽已成交合約.....	20
(C) 從「Client Status Enquiry」瀏覽已成交合約.....	21
(九) 更改已成交買賣盤的資料	22
(十) 追蹤未成交買賣盤的改盤記錄.....	23
(十一) 覆盤	24
(十二) 查詢客戶資料.....	25

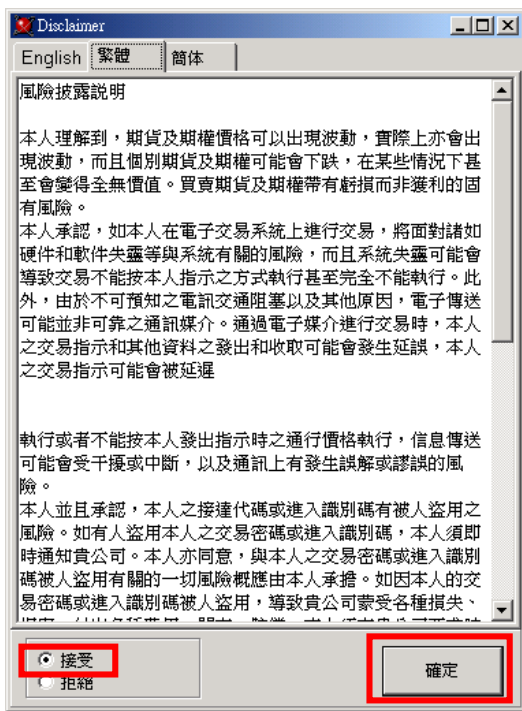
(A) 查閱所選客戶的按金結餘.....	25
(B) 查閱所選客戶的資料及已成交買賣合約及未平倉合約的宗數	25
(C) 查閱所選客戶的期貨買賣狀況	26
(十三) 客戶設置管理.....	27
(A) 設置客戶別名.....	27
(B) 設置客戶群組.....	28
(C) 預設客戶號碼/客戶群組及群組賣盤次序倒置.....	29
(十四) 核對每日的交易總數.....	30
(十五) 從「ET Trade」輸出資料到記事本.....	31
(十六) 系統的其他設定.....	33
(A) 移動列的排序.....	33
(B) 期貨合約的排序設定.....	35
(C) 更改密碼.....	36
(D) 通知音效設定.....	36
(E) 確認視窗設定.....	37
(F) 儲存個人化版面	39
附件《一》：期貨交易時段	40
附件《二》：買賣盤的狀態說明	41
附件《三》：買賣盤有效期的說明.....	41
附件《四》：鎖定期貨系統	42
附件《五》：「Stop」盤的使用說明.....	43
附件《六》：系統發生故障時的應變措施.....	44
(A) 「Primary Order」及「OAPI17.1(2)」出現「Timeout」	44
(B) 「Primary Quote」出現「Timeout」	44
(C) 「OAPI 17.1(1)」出現「Timeout」	44
(D) 「Margin Server」出現「Timeout」	45
(E) 「DB Connection」出現「Timeout」	45

(一) 登入程序

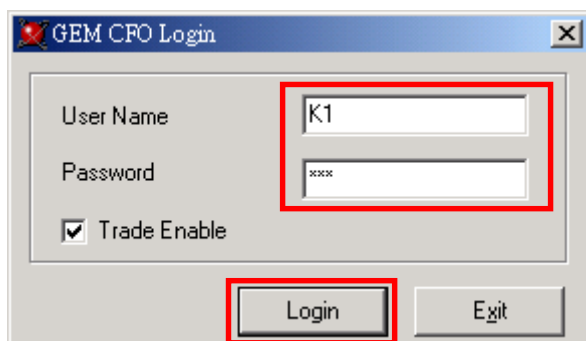
1. 由桌面選擇「CFO」捷徑



2. 閱讀「免責聲明」後，如接受有關內容請選擇「接受」並按「確定」

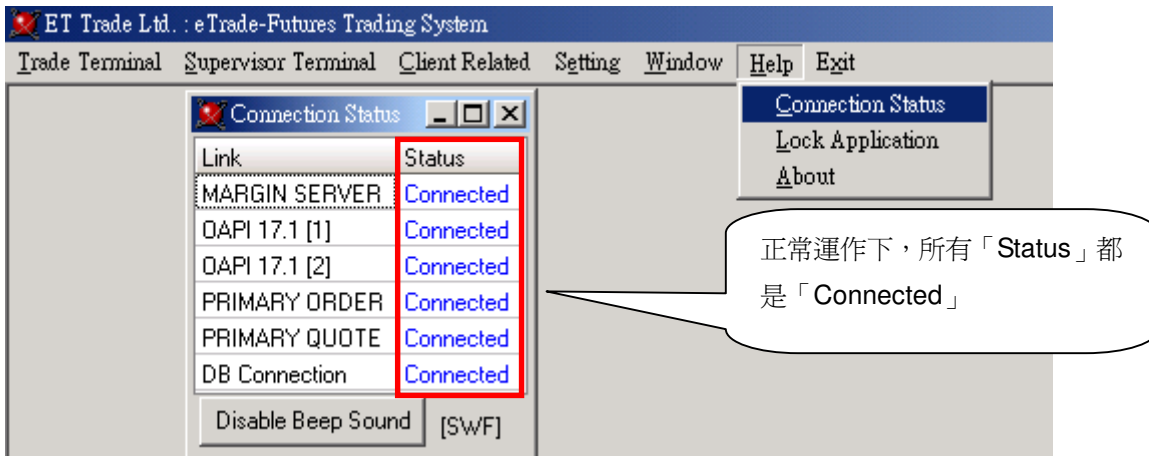


3. 輸入「User Name」及「Password」然後按「Login」



(註: 如此次登入無需落盤, 可不剔選「Trade Enable」)

4. 檢查「Connection Status」視窗，確定系統狀況一切正常



5. 如有任何「Link」不是「Connected」，請盡快聯絡「Help Desk」

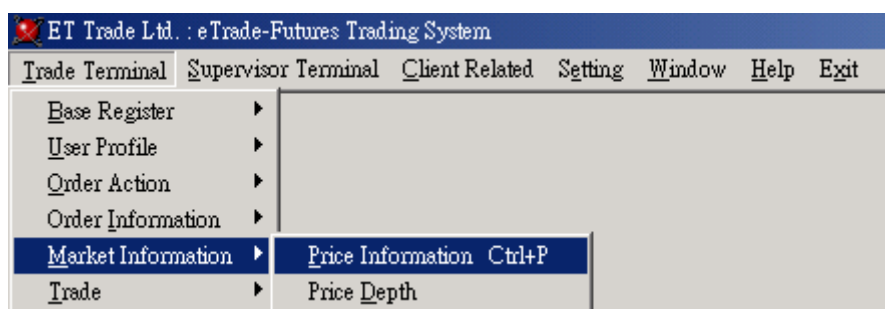
(二) 查詢期貨報價

ET Trade 系統提供了三種報價的介面：「Price Information」、「Price Depth」及「Order Depth」。

- (A) 「Price Information」讓用戶於單一畫面查詢一種或多種期貨產品的報價。
- (B) 「Price Depth」讓用戶查詢單一產品的五個買賣價位報價。
- (C) 「Order Depth」讓用戶查詢單一產品的未成交合約的價位排序。

(A) 從「Price Information」查閱報價

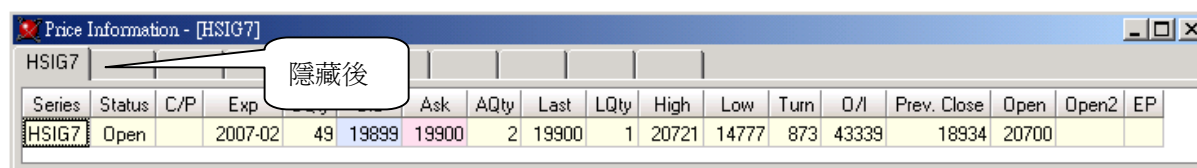
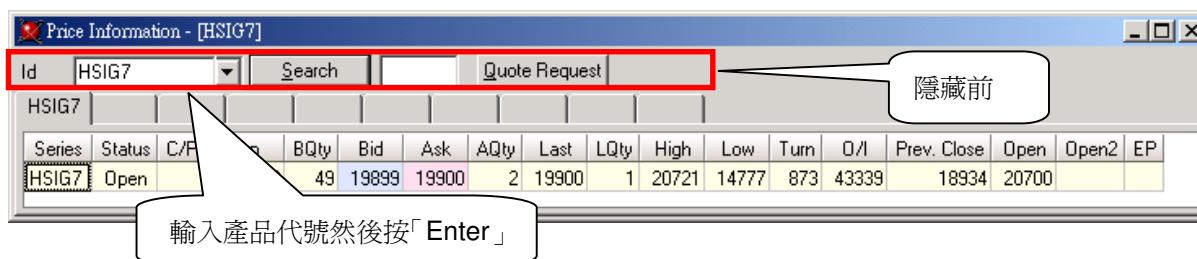
1. 開啓「Price Information」(快捷鍵：「Ctrl+P」)



2a. 單一畫面查詢一種期貨產品的報價

於「Price Information」視窗內按下「F12」鍵可隱藏或取消隱藏輸入資料列

【這個功能同時可應用於「Price Depth」及「Order Depth」】

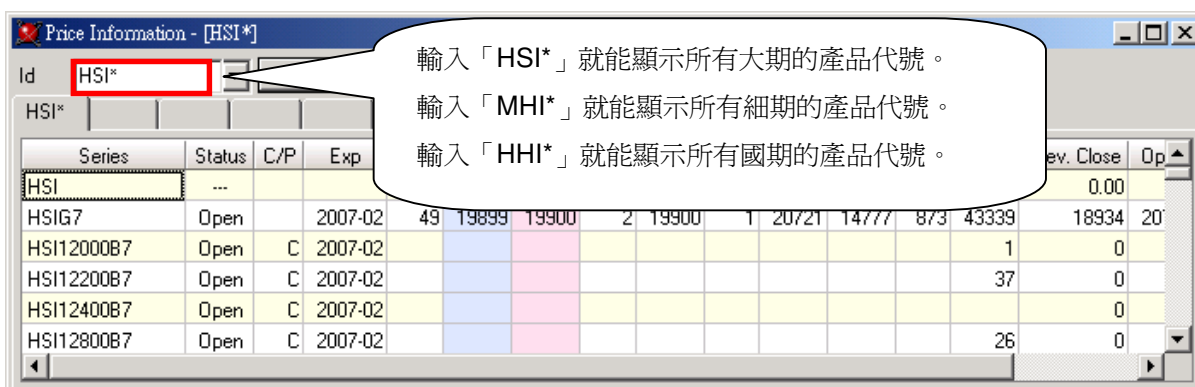


2b. 單一畫面查詢多種期貨產品的報價



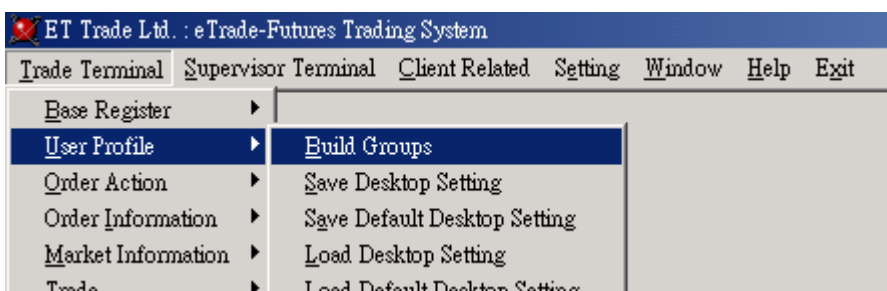
2c. 「Price Information」的相關設定

i. 查詢產品代號

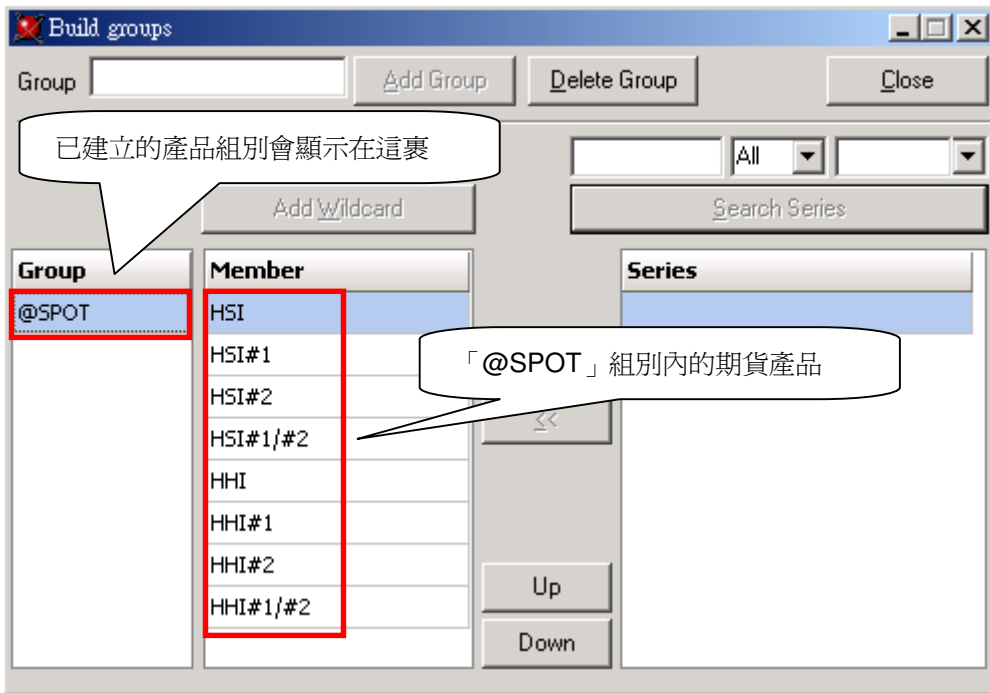


ii. 查詢公司預設的產品組別

1. 開啓「Build Groups」



2. 查詢已建立的期貨組別 (以「@」開始的為公司預設產品)

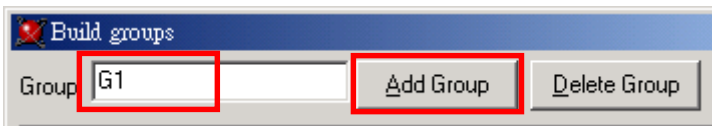


(註: 代號「#1」,「#2」,「#3」及「#4」意思為「現月」,「下月」,「之後的第一個季月」及「之後的第二個季月」, 而此代號同時可應用於「Price Depth」及「Order Depth」)

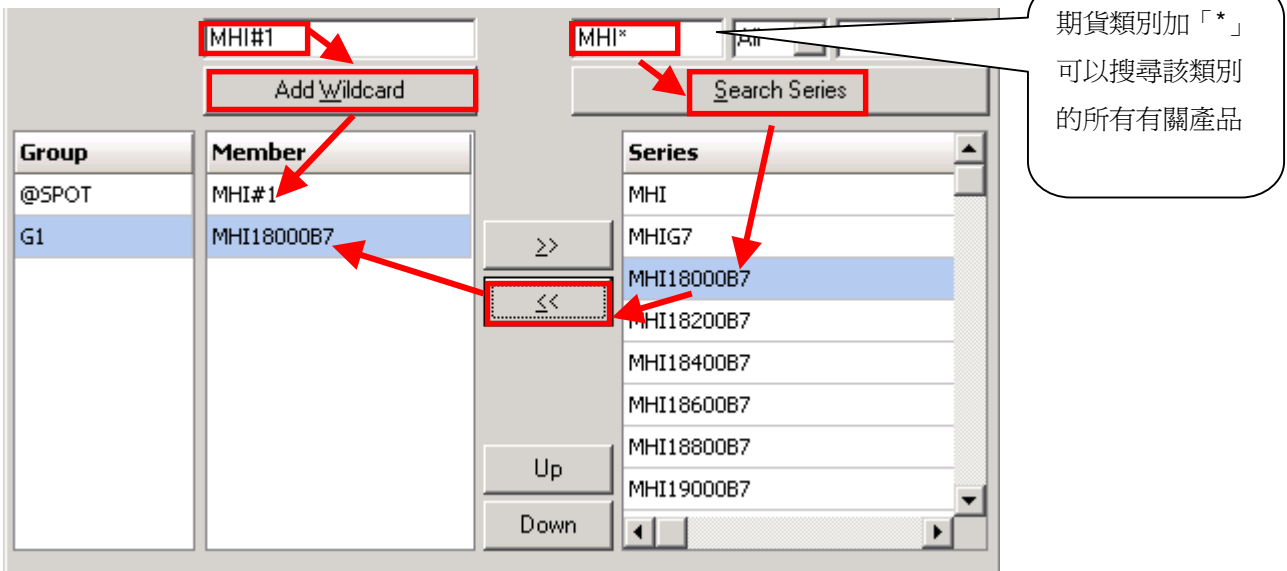
如預設的期貨組別不符合您的需要, 請聯絡 Help Desk。

iii 建立個人的期貨組別

1. 於「Group」欄內輸入個人期貨組別名稱, 然後按「Add Group」

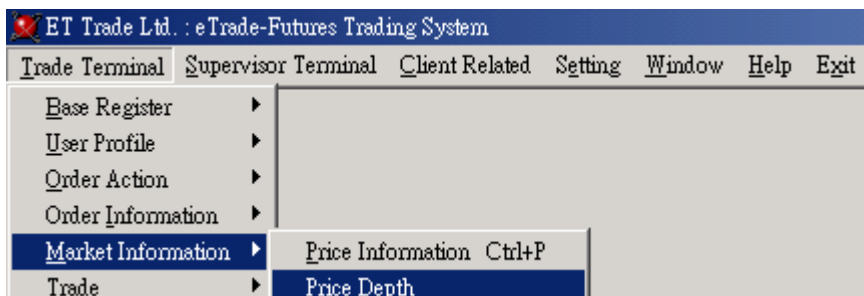


2. 直接輸入期貨產品代號並按「Add Wildcard」加入, 或可以搜尋期貨類別後於「Series」選擇產品, 然後按「<<」加入



(B) 查詢五個買賣價位的期貨報價

1. 開啓「Price Depth」

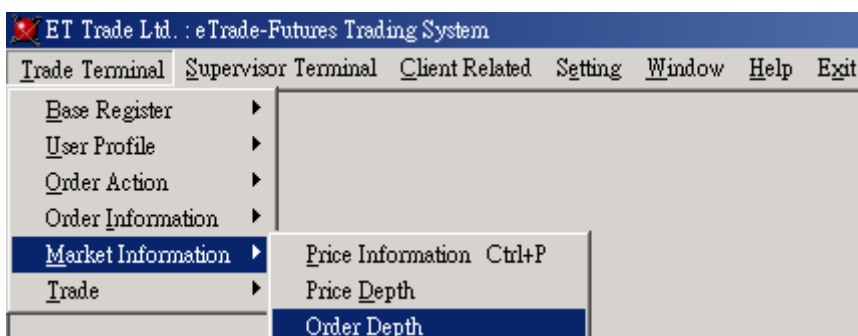


2. 查閱價格

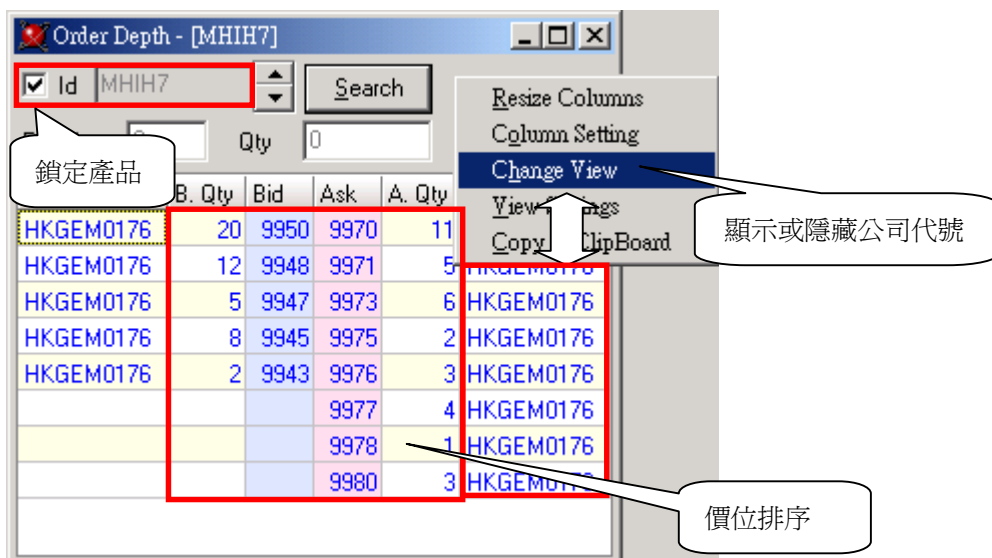


(C) 查詢未成交合約的價位排序

1. 開啓「Order Depth」



2. 查閱價位排序



(三) 落盤

用戶有四個途徑為客戶落盤：

- (A) 從「Order Ticket」視窗落盤
- (B) 從「Price Information」視窗落盤
- (C) 從「Price Depth」視窗落盤
- (D) 從「Fast Order」視窗落盤

從「Order Ticket」落盤容許用戶落買盤、賣盤、限價盤「Rest of Day」、競價盤「Auction」等…，落盤限制最少、最有彈性。

從「Price Information」或「Price Depth」落盤會有限制及預設值，而限制及預設值會根據所選功能而改變。

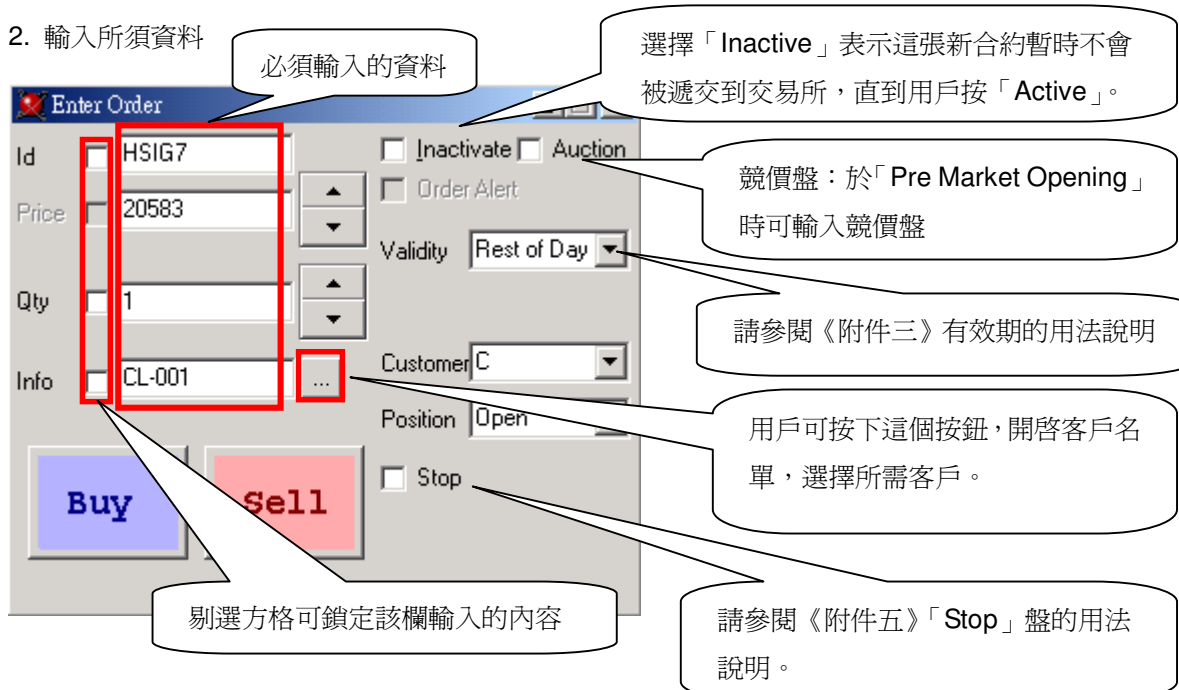
從「Fast Order」落盤，用戶須預先儲存有關的買賣盤內容，當價位到達目標價時用戶可以按下快捷鍵作即時落盤。

(A) 從「Order Ticket」視窗落盤

1. 開啓落盤單（快捷鍵：「F1」）



2. 輸入所須資料



必須輸入的資料

選擇「Inactive」表示這張新合約暫時不會被遞交到交易所，直到用戶按「Active」。

競價盤：於「Pre Market Opening」時可輸入競價盤

請參閱《附件三》有效期的用法說明

用戶可按下這個按鈕，開啓客戶名單，選擇所需客戶。

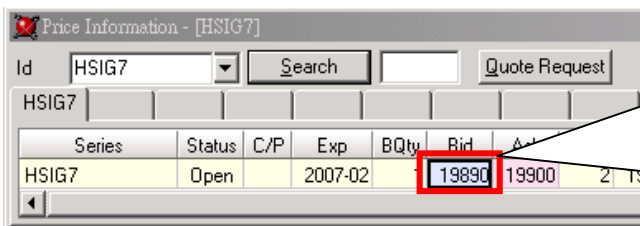
請參閱《附件五》「Stop」盤的用法說明。

別選方格可鎖定該欄輸入的內容

3. 按「Buy」或「Sell」把指令傳送到交易所

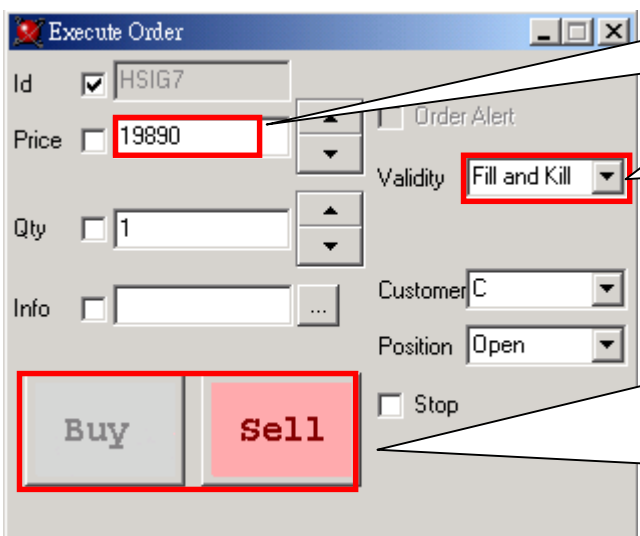
(B) 從「Price Information」視窗落盤

1. 開啓落盤單



於「Bid」或「Ask」內快按滑鼠左鍵兩次會把「Bid」或「Ask」價格自動帶到落盤單。
於「BQty」或「AQty」內快按滑鼠左鍵兩次會把「BQty」或「AQty」數量自動帶到落盤單。

2. 輸入所須資料



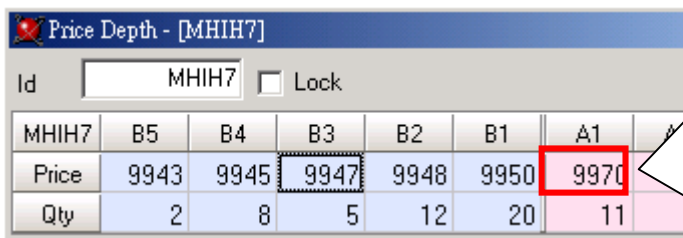
買入價「Bid」會自動由「Price Information」視窗帶到「Executed Order」視窗

只有「Fill and Kill」和「Fill or Kill」可供選擇

如在「Price Information」按下「Bid」或「BQty」，系統會自動設定為「Sell」盤，「Buy」鍵就會自動不能使用；相反，如在「Price Information」按下「Ask」或「AQty」，系統會自動設定為「Buy」盤，「Sell」鍵就會自動不能使用。

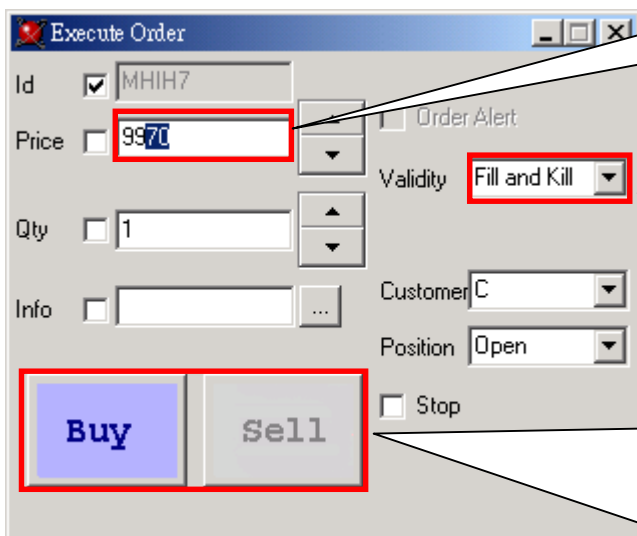
(C) 從「Price Depth」視窗落盤

1. 開啓落盤單



於「Price」內快按滑鼠左鍵兩次會把所選價位「A1」自動帶到落盤單。
於「Qty」內快按滑鼠左鍵兩次會把所選數量「Qty」自動帶到落盤單。
例：於「A1」列的「Price」內快按滑鼠左鍵兩次

2. 輸入所須資料



賣出價「Ask」會自動由「Price Depth」帶到「Executed Order」

只有「Fill and Kill」和「Fill or Kill」可供選擇

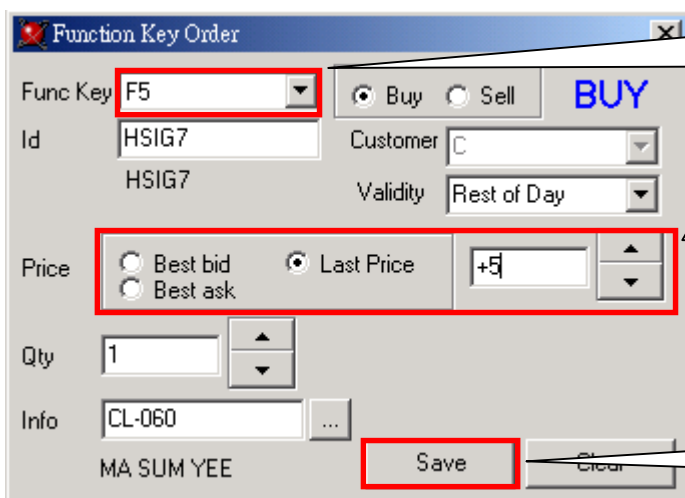
如在「Price Depth」按下「A1」、「A2」、「A3」、「A4」、或「A5」列的「Price」或「Qty」，系統會自動設定為「Buy」盤，「Sell」鍵就會自動不能使用；相反，如在「Price Depth」按下「B1」、「B2」、「B3」、「B4」、或「B5」列的「Price」或「Qty」，系統會自動設定為「Sell」盤，「Buy」鍵就會自動不能使用。

(D) 從「Fast Order」視窗落盤

1. 開啓「Fast Order」



2. 輸入所須資料



設定「Fast Order」所使用的快捷鍵，可選擇「F5」、「F6」、「F7」、「F8」為快捷鍵

設定此買盤/賣盤價位是參考「Best bid」、「Best ask」或「Last Price」作落盤，同時亦可以對該參考價位作調整

完成輸入所須資料，按「Save」儲存

(四) 風險管理

如果客戶的買或賣盤沒有足夠按金，用戶在落盤時會因應風險管理員的系統設定而出現以下三種情況：

- (A) 落盤後出現提醒視窗（例：客戶的 $70\% \leq \text{Margin Ratio} < 100\%$ ），雖然已即時將該交易指示直接傳送到交易所，但系統會提醒用戶該客戶的按金不足八成，但亦未低於公司的可接受按金要求，需向客戶追補按金。
- (B) 落盤後出現審批視窗（例：客戶的 $30\% \leq \text{Margin Ratio} < 70\%$ ），客戶的按金低於可接受的按金要求，該盤須經主管審批，批核後，系統會把該宗買或賣指令傳送到交易所。
- (C) 落盤後出現拒絕視窗（例：客戶的 $0\% \leq \text{Margin Ratio} < 30\%$ ），因為客戶沒有足夠按金，該盤不能傳送到交易所。

用戶可利用「Client Margin List」追補客戶的按金或在「Client Status Enquiry」查閱個別客戶的按金狀況。

(D) 會詳細介紹查閱按金狀況的途徑。

計算公式：

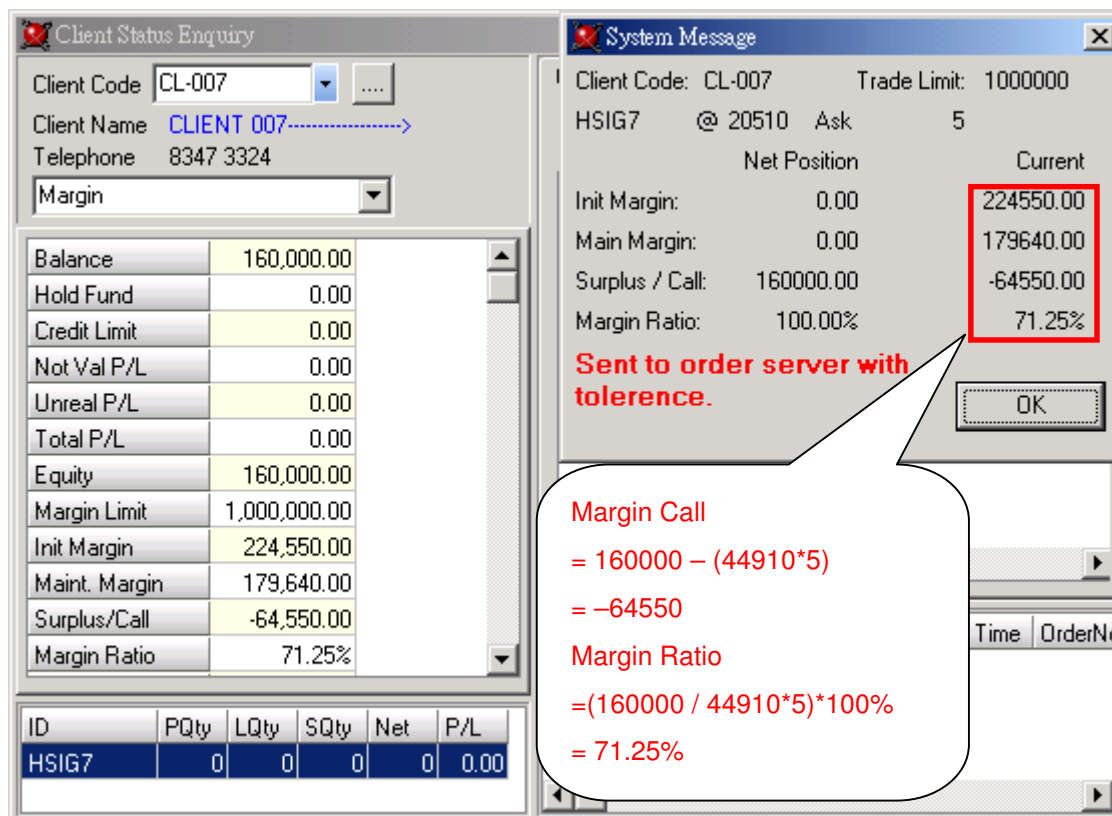
$$\text{Equity} = \text{Balance} + \text{Total P/L} + \text{Credit Limit} + \text{Hold Fund}$$

$$\text{Total P/L} = \text{Not Val P/L} + \text{Unreal P/L}$$

$$\text{Surplus / Call} = \text{Equity} - \text{Initial Margin}$$

$$\text{Margin Ratio} = (\text{Equity} / \text{Initial Margin}) * 100\%$$

(A) 「Alert」提醒視窗



The screenshot shows two windows. The 'Client Status Enquiry' window displays the following data for Client CL-007:

Balance	160,000.00
Hold Fund	0.00
Credit Limit	0.00
Not Val P/L	0.00
Unreal P/L	0.00
Total P/L	0.00
Equity	160,000.00
Margin Limit	1,000,000.00
Init Margin	224,550.00
Maint. Margin	179,640.00
Surplus/Call	-64,550.00
Margin Ratio	71.25%

The 'System Message' window displays the following data:

Client Code:	CL-007	Trade Limit:	1000000
HSIG7	@ 20510	Ask	5
	Net Position		Current
Init Margin:	0.00		224550.00
Main Margin:	0.00		179640.00
Surplus / Call:	160000.00		-64550.00
Margin Ratio:	100.00%		71.25%

The System Message window also contains the text: "Sent to order server with tolerance." and an "OK" button.

The callout box contains the following calculation:

$$\begin{aligned} \text{Margin Call} &= 160000 - (44910 * 5) \\ &= -64550 \\ \text{Margin Ratio} &= (160000 / (44910 * 5)) * 100\% \\ &= 71.25\% \end{aligned}$$

(B) 「Approve」 審批視窗

Client Status Enquiry

Client Code: CL-007
Client Name: CLIENT 007
Telephone: 8347 3324

Margin

Balance	160,000.00
Hold Fund	0.00
Credit Limit	0.00
Not Val P/L	0.00
Unreal P/L	0.00
Total P/L	0.00
Equity	160,000.00
Margin Limit	1,000,000.00
Init Margin	0.00
Maint. Margin	0.00
Surplus/Call	160,000.00
Margin Ratio	100.00%

frmApprove

Client: CL-007
CLIENT 007

Series: HSIG7
Qty: Sell 6
Price: 20510
Margin Call: 109460.00
Margin Ratio: 59.38%

Buttons:

Callout 1: 按下「Approve」, 這宗交易便會傳送到交易所

Callout 2: 按下「Reject」, 該盤便不會被傳送到交易所

Callout 3: Margin Call = 160000 - (44910*6) = -109460
Margin Ratio = (160000 / 44910*6)*100% = 59.38%

(C) 「Reject」 拒絕視窗

Client Status Enquiry

Client Code: CL-007
Client Name: CLIENT 007
Telephone: 8347 3324

Margin

Balance	160,000.00
Hold Fund	0.00
Credit Limit	0.00
Not Val P/L	0.00
Unreal P/L	0.00
Total P/L	0.00
Equity	160,000.00
Margin Limit	1,000,000.00
Init Margin	0.00
Maint. Margin	0.00
Surplus/Call	160,000.00
Margin Ratio	100.00%

System Message

Client Code: CL-007 Trade Limit: 1000000
HSIG7 @ 20510 Ask 12

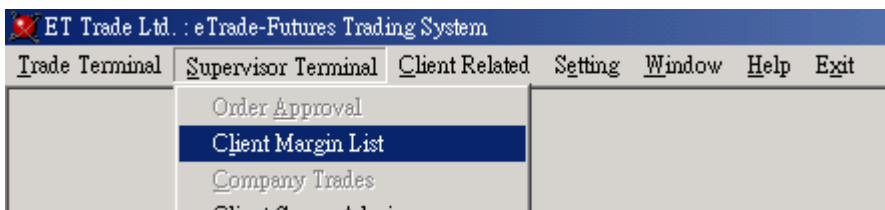
Net Position	Current
Init Margin:	538920.00
Main Margin:	431136.00
Surplus / Call:	-378920.00
Margin Ratio:	29.69%

Rejected by Margin Server. (Margin Call)

Callout: Margin Call = 160000 - (44910*12) = -378920
Margin Ratio = (160000 / 44910*12)*100% = 29.69%

(D) 追補按金

i. 從「Client Margin List」, 追收客戶的合約按金。



Margin Call / Trade Limit Exceed (追補按金清單)

Client I	Client Name	AE Code	Status	Surplus/Cal	Margin Ratio (%)	Balance	Hold Fund	Credit Limit	Not Val P/L	Unr
CL-042	CHAN KA HC	AE01	Active	-299,500.00	76.95	10,000.00	0.00	0.00	0.00	
CL-010	CLIENT 010	AE01	Active	-7,484.50	0.00	-7,484.50	0.00	0.00	0.00	
CL-011	CLIENT 011	AE01	Active	1,702,969.00	0.00	12,969.00	0.00	0.00	0.00	
CL-012	CLIENT 012	AE01	Active	-296,770.00	0.00	16,770.00	0.00	0.00	0.00	
				2,306,723.50		17,223.50	0.00	0.00	0.00	

Surplus (客戶結餘大於基本按金)

Client I	Client Name	AE Code	Status	Surplus/Cal	Margin Ratio (%)	Balance	Hold Fund	Credit Limit	Not Val P/L	Unr
KAM1	KAM 1	AE01	Active	1,083,060.10	100.00	13,060.10	0.00	0.00	0.00	
KAM2	KAM 2	AE01	Active	41,699.50	100.00	11,699.50	0.00	0.00	0.00	
CL-043	CHOI WING	AE01	Active	500,000.00	100.00	10,000.00	0.00	0.00	0.00	
CL-044	CHOW HIU	AE01	Active	300,000.00	100.00	10,000.00	0.00	0.00	0.00	
CL-045	HON FONG	AE01	Active	1,000,000.00	100.00	10,000.00	0.00	0.00	0.00	
				1,416,566.30		14,363.30	0.00	0.00	0.00	

Day Trade Client Positions (顯示 Day Trade 的客戶的未平倉合約)

Client ID	Client Name	AE Code	Series	L/S	Qty
CL-002	CLIENT 002	AE01	HSI14200C5	S	1
CL-002	CLIENT 002	AE01	HSIH5	S	2
CL-012	CLIENT 012	AE01	HSIH5	S	1

ii. 從「Client Status Enquiry」, 追收客戶的合約按金。

請參閱第十二章 A 節：【查閱所選客戶的按金結餘】。

(五) 查閱未成交買賣合約

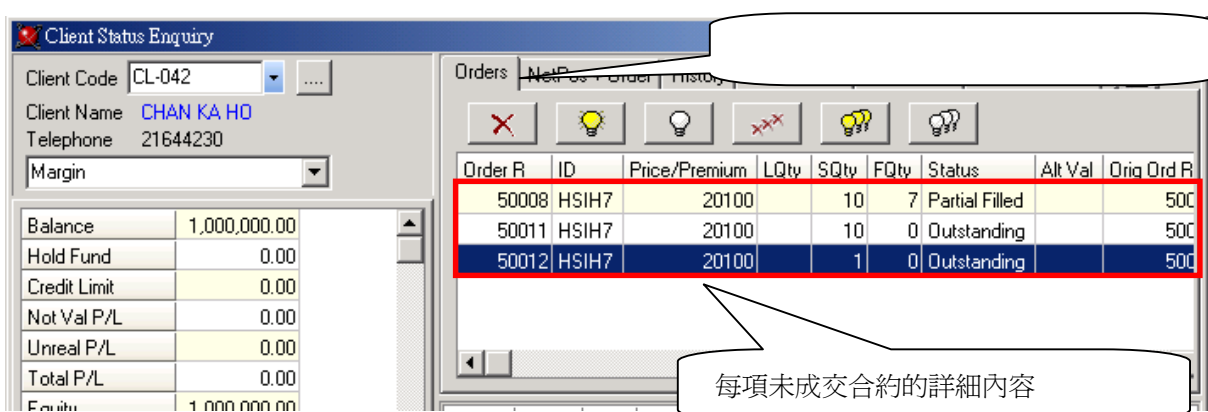
用戶可從「Order Book」瀏覽所有客戶的未成交合約。如只想查閱個別客戶的未成交合約，則可到「Client Status Enquiry」閱覽。

(A) 從「Client Status Enquiry」瀏覽未成交買賣合約

1. 開啓「Client Summary」



2. 查閱所選客戶的未成交合約

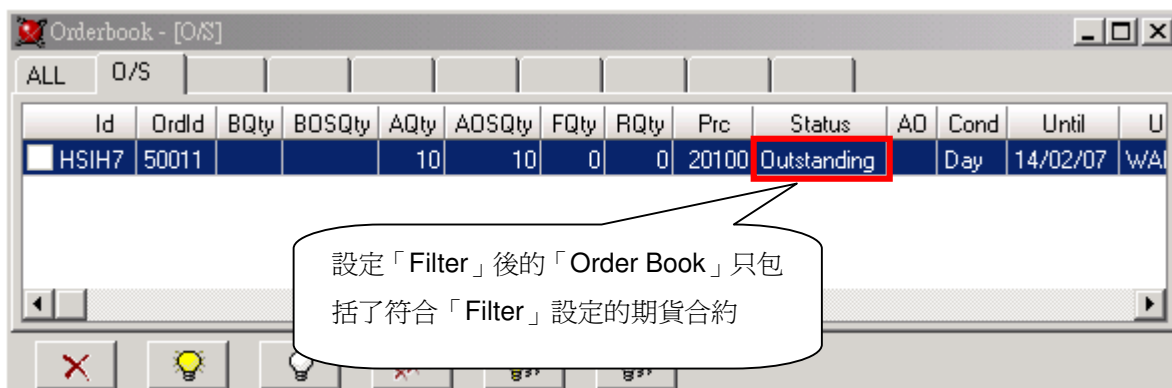
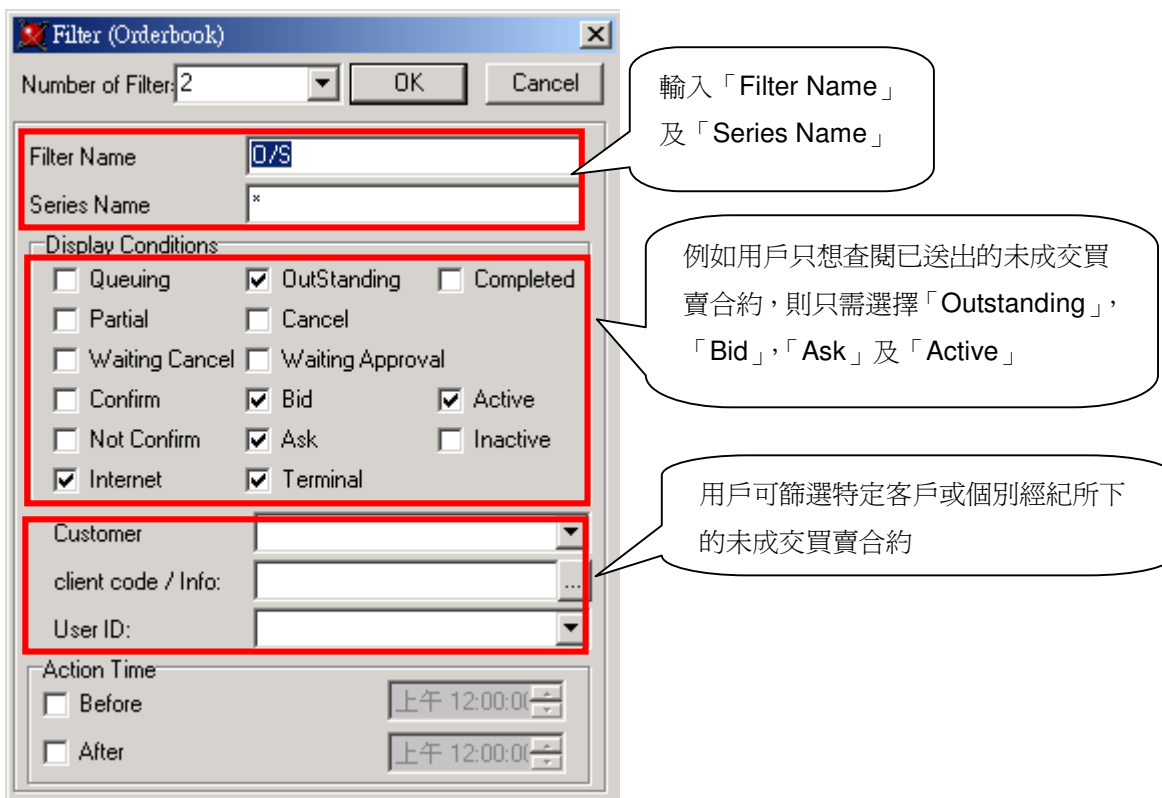
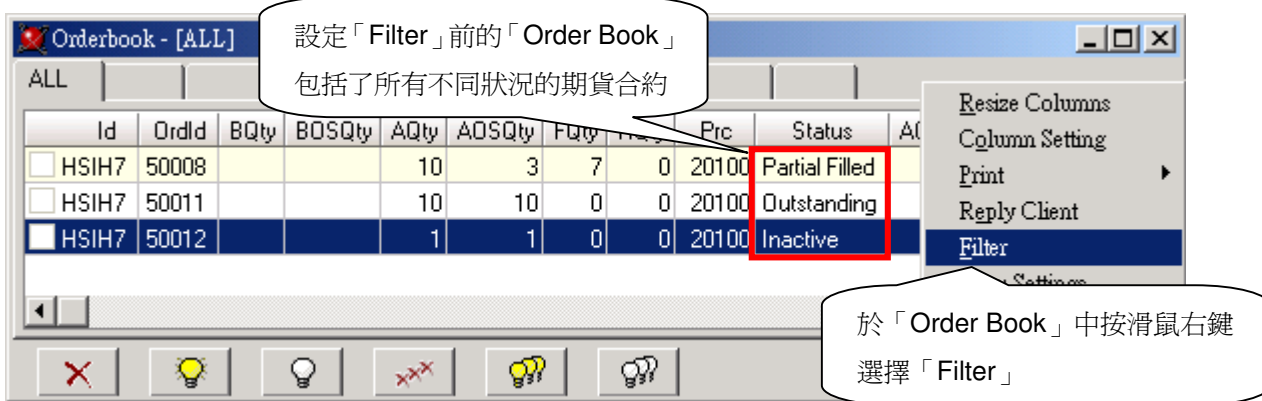


(B) 從「Order Book」瀏覽未成交買賣合約

1. 開啓「Order Book」(快捷鍵 : 「Ctrl+O」)



2. 用戶可設定「Filter」以篩選個別的未成交合約



(六) 取消、啓動或隱藏未成交買賣合約

用戶可於「Order Book」或「Client Status Summary」執行取消、啓動或隱藏未成交的買賣合約。

(A) 從「Order Book」執行取消、啓動或隱藏未成交買賣合約

The screenshot shows the 'Orderbook - [O/S]' window. It contains a table of orders with columns: Id, OrdId, BQty, BOSQty, AQty, ADSQty, FQty, RQty, P, Status, Day, and U. The row for order ID 50024 is highlighted in red. Below the table is a toolbar with icons: a red 'X' (cancel), a lit lightbulb (toggle on), a dimmed lightbulb (toggle off), a red 'XXX' (delete), a lit lightbulb (toggle on), and a dimmed lightbulb (toggle off). Callouts point to these icons with the following text:

- 取消未成交買賣合約 (Cancel unexecuted orders)
- 啓動及隱藏未成交買賣合約 (Toggle unexecuted orders on/off)
- 取消「Order Book」內所有未成交買賣合約 (Cancel all unexecuted orders in the Order Book)
- 啓動及隱藏「Order Book」內所有未成交買賣合約 (Toggle all unexecuted orders in the Order Book on/off)

A callout also points to the highlighted row: 選擇需更改的未成交合約 (Select the unexecuted order to be modified).

(B) 從「Client Status Enquiry」執行取消、啓動或隱藏未成交買賣合約

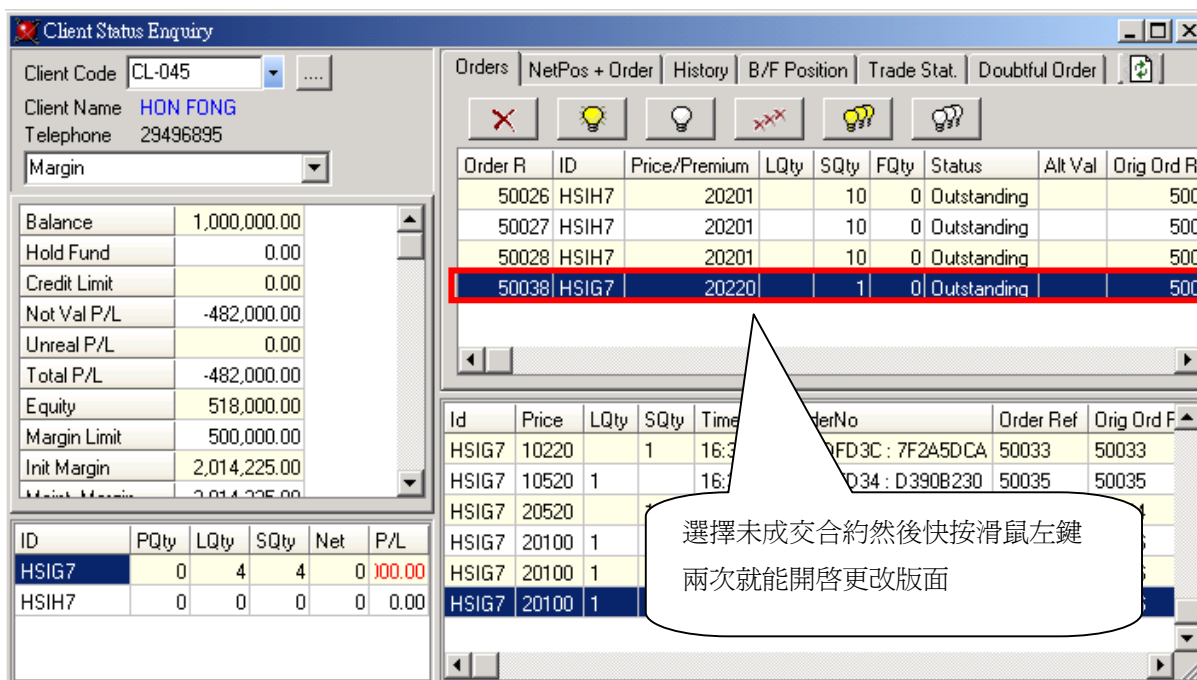
The screenshot shows the 'Client Status Enquiry' window. On the left, there are fields for Client Code (CL-045), Client Name (HON FONG), Telephone (29496895), and Margin. Below these are financial summary items like Balance, Hold Fund, Credit Limit, etc. On the right, there is a table of orders with columns: Order R, ID, Price/Premium, LQty, SQty, FQty, Status, Alt Val, and Orig Ord R. The row for order ID 50028 is highlighted in red. Above this table is a toolbar with the same icons as in the Orderbook window. A callout points to this toolbar with the text: 啓動及隱藏「Order Book」內所有未成交買賣合約 (Toggle all unexecuted orders in the Order Book on/off).

(七) 更改未成交買賣盤的資料

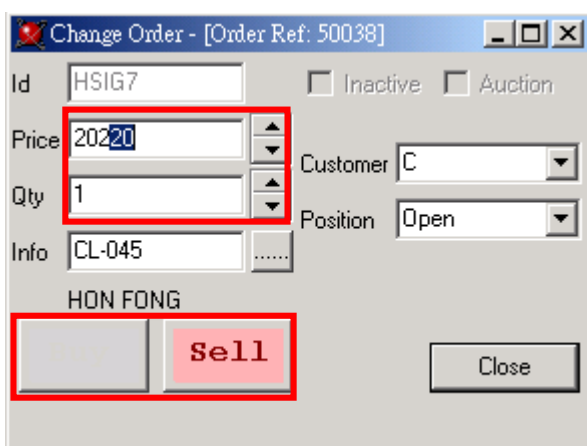
用戶可從「Client Status Summary」或「Order Book」更改未成交的期貨買賣合約。

(A) 從「Client Status Summary」更改未成交的期貨買賣合約

1. 開啓「Client Status Summary」
2. 開啓未成交合約的更改版面



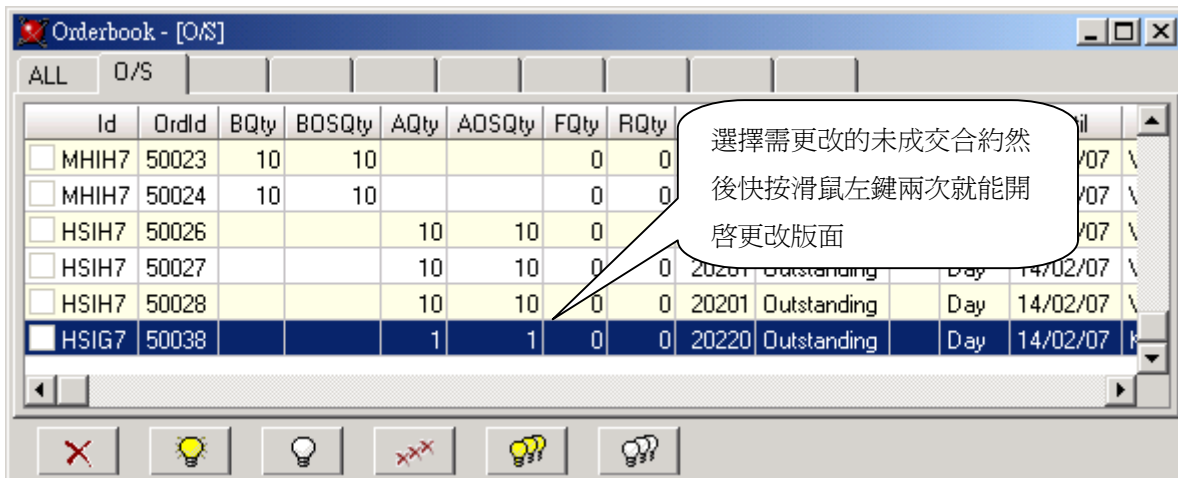
3. 輸入新的價格或數量



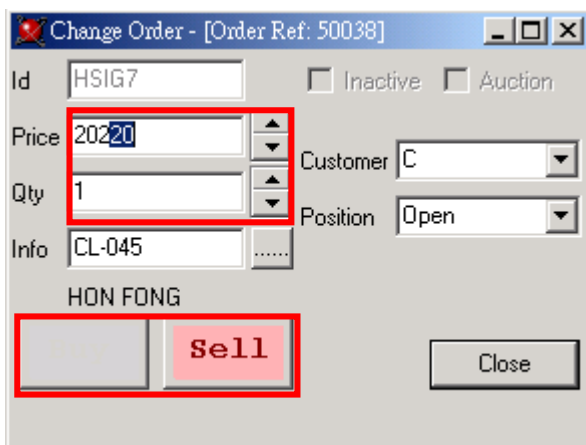
4. 按「Buy」/「Sell」把更改資料傳送到交易所

(B) 從「Order Book」更改未成交的期貨買賣合約

1. 開啓「Order Book」
2. 開啓未成交合約的更改版面



3. 輸入新的價格或數量



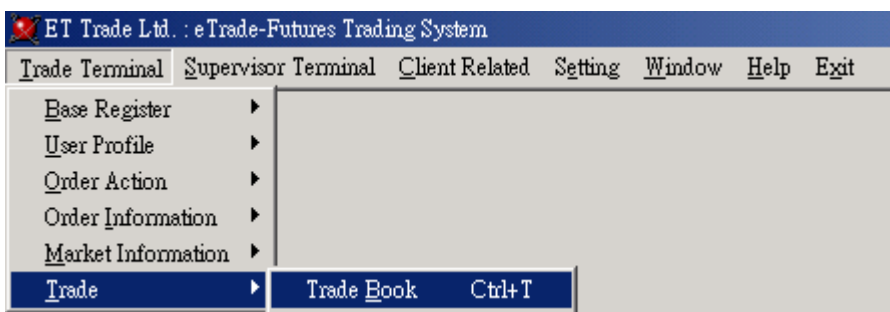
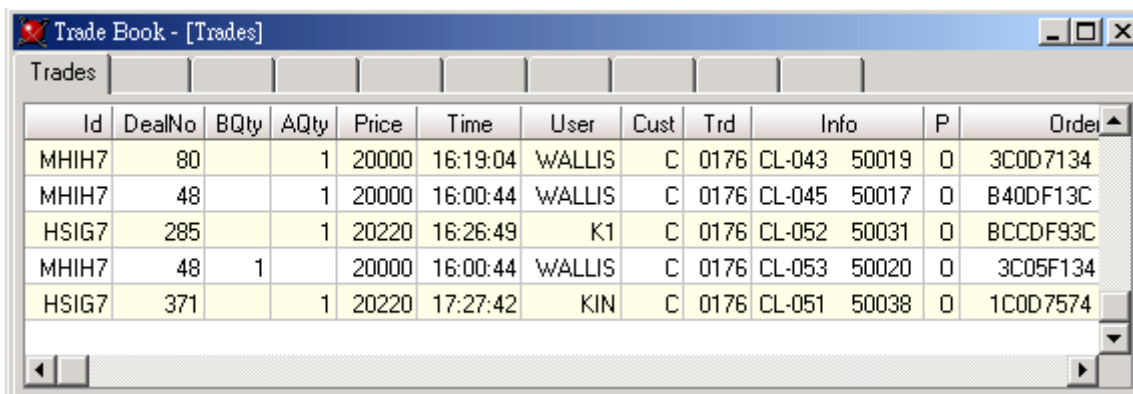
4. 按「Buy」/「Sell」把更改資料傳送到交易所

(八) 查閱已成交買賣合約

用戶可於「Trade Book」或「Order History」設定「Filter」，瀏覽已成交合約。如只想查閱個別客戶的已成交合約，則可到「Client Status Enquiry」閱覽。

(A) 從「Trade Book」瀏覽已成交買賣合約

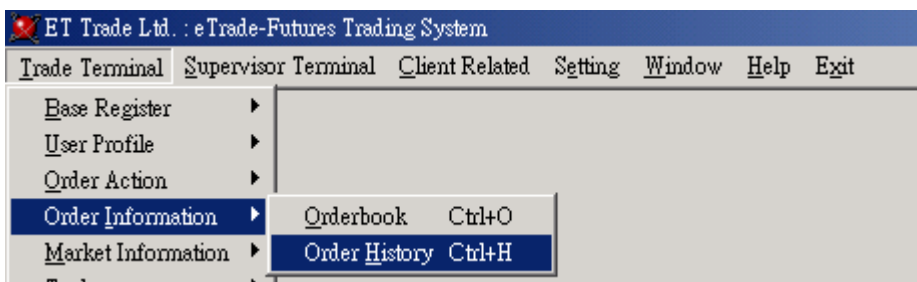
1. 開啓「Trade Book」(快捷鍵：「Ctrl+T」)

Id	DealNo	BQty	AQty	Price	Time	User	Cust	Trd	Info	P	Order
MHIH7	80		1	20000	16:19:04	WALLIS	C	0176	CL-043 50019	0	3C0D7134
MHIH7	48		1	20000	16:00:44	WALLIS	C	0176	CL-045 50017	0	B40DF13C
HSIG7	285		1	20220	16:26:49	K1	C	0176	CL-052 50031	0	BCCDF93C
MHIH7	48	1		20000	16:00:44	WALLIS	C	0176	CL-053 50020	0	3C05F134
HSIG7	371		1	20220	17:27:42	KIN	C	0176	CL-051 50038	0	1C0D7574

(B) 從「Order History」瀏覽已成交合約

1. 開啓「Order History」(快捷鍵：「Ctrl+H」)



2. 設定「Filter」, 瀏覽已成交合約

rd	Action	Cnv	Time	Id	BQty	AQty	Orig	TPrc	Prc	AO	Cond	Until	Cust
50006	TRADE		15:49:07	MHIH7	7		7	20000	20000		Day	15/02/07	C
50007	TRADE		17:51:24	MHIH7		1	7	20000	20000		Day	15/02/07	C
50011	TRADE		17:51:24	MHIH7	1		1	20000	20000		Fak		C
50007	TRADE		17:51:48	MHIH7		2	7	20000	20000		Day	15/02/07	C
50012	TRADE		17:51:48	MHIH7	2		2	20000	20000		Fak		C

(C) 從「Client Status Enquiry」, 瀏覽已成交合約

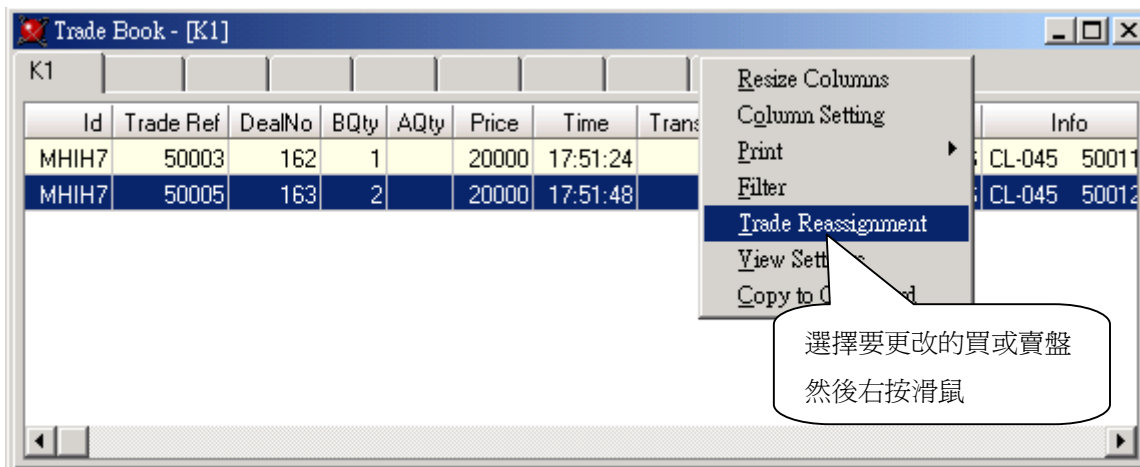
1. 開啓「Client Status Enquiry」
2. 查閱所選客戶的已成交合約

Balance	1,000,000.00							
Hold Fund	0.00							
Credit Limit	0.00							
Not Val P/L	450.00							
Unreal P/L	-80,000.00							
Order Ref	ID	Price	LQty	SQty	Time	OrderNo	Order Ref	Orig Ord Ref
50001	MHIH7							
50002	MHIH7							
50003	MHIH7							
50004	MHIH7							
50005	MHIH7							
50006	MHIH7	20000	7		15:49:07	1C0EF53C : 9FC27E62	50006	50006
50007	MHIH7	20000	1		17:51:24	14067D34 : 647F431F	50007	50007
50007	MHIH7	20000	2		17:51:48	14067D34 : 647F431F	50007	50007
50013	MHIH7	8998	9		17:56:43	1853796C : 7B795A19	50013	50013
50016	MHIH7	8999	9		17:57:36	18D37D64 : D5B2B452	50016	50016

這位客戶的所有已成交期貨合約會顯示在「Trade」表單內

(九) 更改已成交買賣盤的資料

如用戶錯誤地輸入了客戶的戶口號碼而該宗買或賣盤已經成交了，用戶可於「Trade Book」使用 Trade Reassignment 這個功能修改該宗已成交合約的張數及客戶戶口號碼。(註：只限 Administrator 使用)



(十) 追蹤未成交買賣盤的改盤記錄

用戶可使用「Orig. Ref」，追蹤改盤記錄。

OrdlId	Orig	Action	Cnv	Time	Id	BQty	AQty	Orig	TPrc	Prc	AQ	Cond
50039	50039	NEW		18:26:54	MHIH7	1		1		18000		Day
50039	50039	DELETE		18:27:16	MHIH7	1		1		18000		Day
50040	50039	NEW		18:27:16	MHIH7	1		1		18100		Day

合約的原本編號

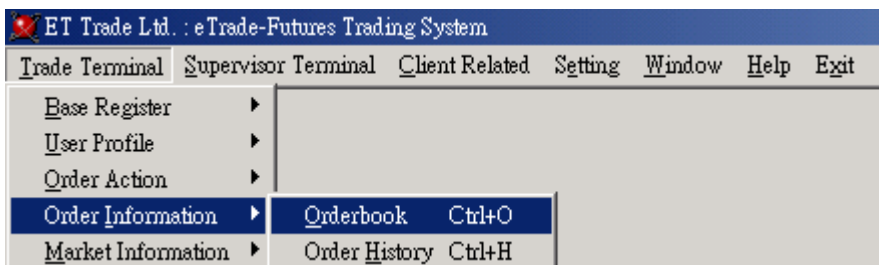
新的合約編號(交易更改後的合約編號)

用戶先以18000買入一張三月小型期指，然後把這張未成交合約的價格改為18100。

(十一) 覆盤

用戶可在系統內記錄成交了的合約是否已回覆客戶。

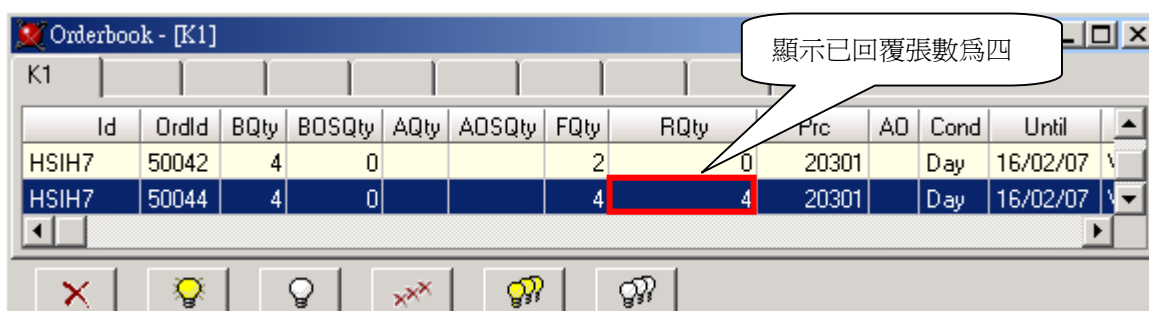
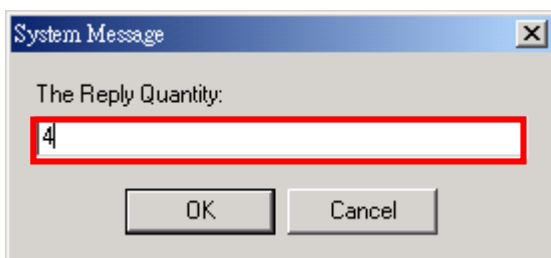
1. 開啓「Order Book」



2. 回覆交易張數



3. 確認已回覆張數



(十二) 查詢客戶資料

(A) 查閱所選客戶的按金結餘

Client Code: CL-042
Client Name: CHAN KA HO
Telephone: 21644230

Margin

Balance: 1,000,000.00
Hold Fund: 0.00
Credit Limit: 0.00
Not Val P/L: 450.00
Unreal P/L: 204,370.00
Total P/L: 204,820.00
Equity: 1,204,820.00
Margin Limit: 500,000.00
Init Margin: 545,790.00
Maint. Margin: 436,632.00
Surplus/Call: 659,030.00

Order R

Order R	Alt Val	Orig Ord
5000		50
50002 MHIH7		50
50003 MHIH7		50
50004 MHIH7		50
50046 MHIH7		50
50051 MHIH7		50

Not Val P/L : 已平倉合約的 P/L

買賣交易額上限

期貨合約的基本按金及維持按金

ID	PQty	LQty	SQty	Net
HHIH7	0	9	9	0
HSIH7	0	1	0	+1
MHIH7	0	7	28	-21

(B) 查閱所選客戶的資料及已成交買賣合約及未平倉合約的宗數

Client Code: CL-042
Client Name: CHAN KA HO
Telephone: 21644230

Info

Status: Active
AE: AE01
Contact:
Address:
Telephone: 21644230
Fax:
Pager:
Mobile:
Email:

Orders

SQty	FQty	Status	Alt Val	Orig Ord		
5	0	Outstanding		50		
5	0	Outstanding		50		
50003 MHIH7		20001	5	0	Outstanding	50
50004 MHIH7		20001	5	0	Outstanding	50
50046 MHIH7		20001	7	0	Inactive	50
50051 MHIH7		20001	1	0	Outstanding	50

顯示所選客戶的個人資料

Id	Price	LQty	SQty	Time	OrderNo	Order Ref	Orig Ord R
MHIH7	20000		1	18:29:32	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7	20000		1	18:30:05	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7	20000		1	18:30:09	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7					3483F124 : DE48BCE8	50033	50033

顯示所選客戶的已成交買賣合約宗數及未平倉合約宗數

ID	PQty	LQty	SQty	Net
HHIH7	0	9	9	0
HSIH7	0	1	0	+1
MHIH7	0	7	28	-21

(C) 查閱所選客戶的期貨買賣狀況

Client Status Enquiry

Client Code: CL-042
Client Name: CHAN KA HO
Telephone: 21644230

Margin: [Dropdown]

Balance: 1,000,000.00
Hold Fund: [Blank]
Credit Limit: [Blank]
Not Val P/L: [Blank]
Unreal P/L: [Blank]
Total P/L: [Blank]
Equity: [Blank]
Margin Limit: [Blank]
Init Margin: [Blank]
Maint. Margin: [Blank]
Surplus/Call: 659,000.00

Order R | ID | Price/Premium | LQty | SQty | Alt Val | Orig Ord

50001	MHIH7	20001				50010
-------	-------	-------	--	--	--	-------

「Order」：顯示未成交的買賣合約
 「NetPos + Order」：未成交及已成交的買賣合約宗數及未平倉合約宗數
 「History」：交易紀錄
 「B/F Position」：昨日未平倉合約
 「Trade Stat」：交易數據
 「Doubtful Order」：顯示客戶於網上落盤但未能成功送出市場的買賣合約

ID	PQty	LQty	SQty	Net
HIIH7	0	9	9	0
HSIH7	0	1	0	+1
MHIH7	0	7	28	-21

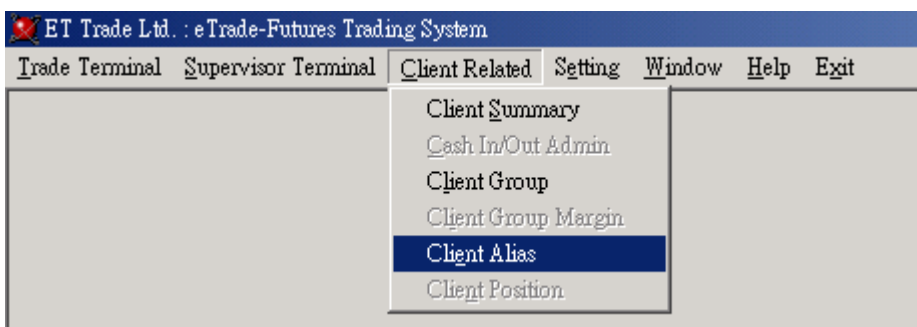
ID	PQty	LQty	SQty	Net	Time	Code	Alt Val	Orig Ord
MHIH7	20000		1		18:31:06	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7	20000		1		18:31:28	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7	20000		1		18:31:45	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
MHIH7	20000		1		18:32:39	948E7D34 : EF4ECDEE	50010	50010
HSIH7	20300	1			18:32:28	3483F124 : DE48BCE8	50033	50033

(十三) 客戶設置管理

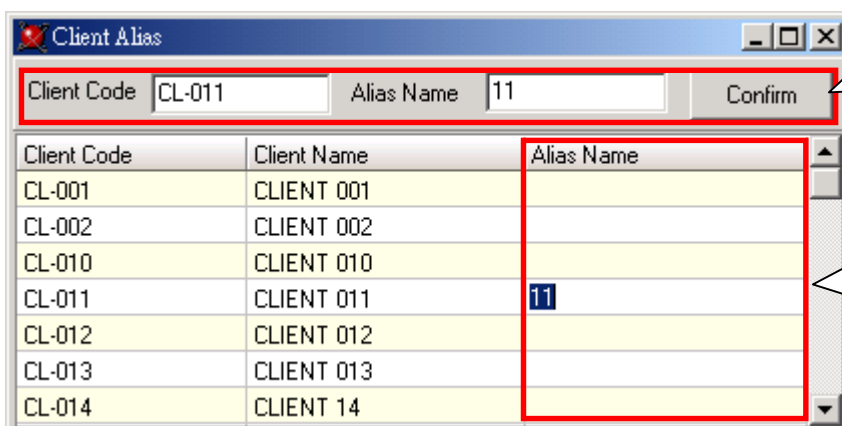
(A) 設置客戶別名

用戶可為個別客戶設置別名，此別名可用於落盤或查詢客戶資料，以方便用戶無須每次輸入完整的客戶號碼。

1. 開啓「Client Alias」

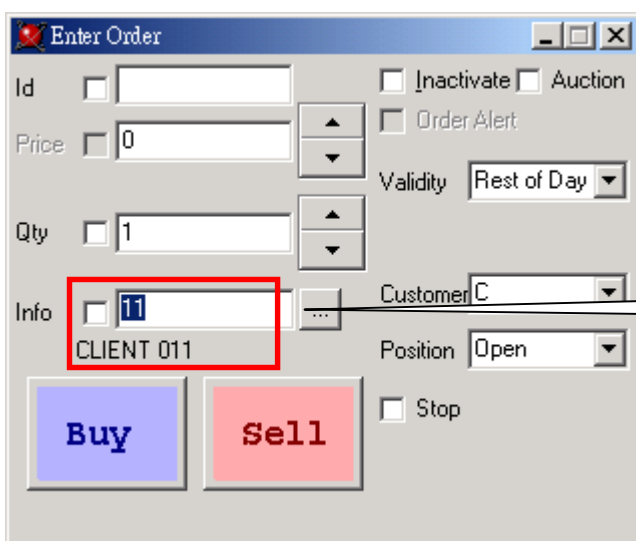


2. 輸入客戶別名



輸入客戶號碼及客戶別名，然後按「Confirm」儲存

用戶亦可於「Alias Name」欄中直接點選要加入或刪除別名的客戶作更改

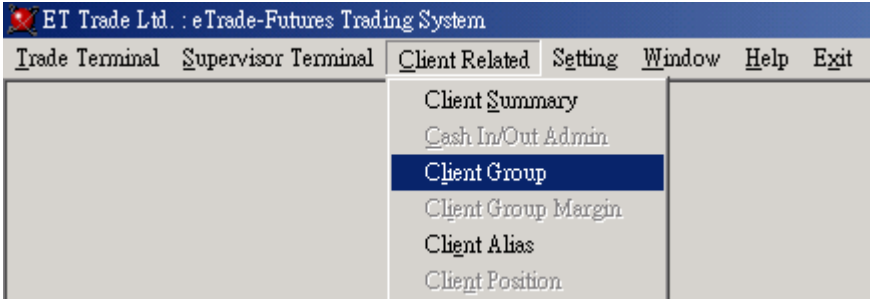


已生效的客戶別名

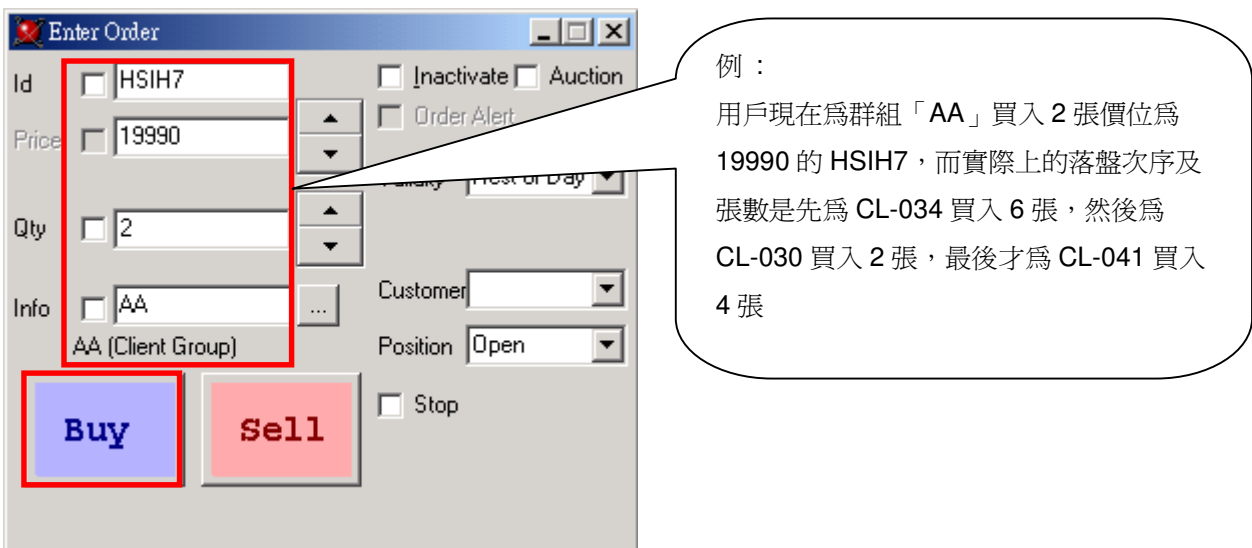
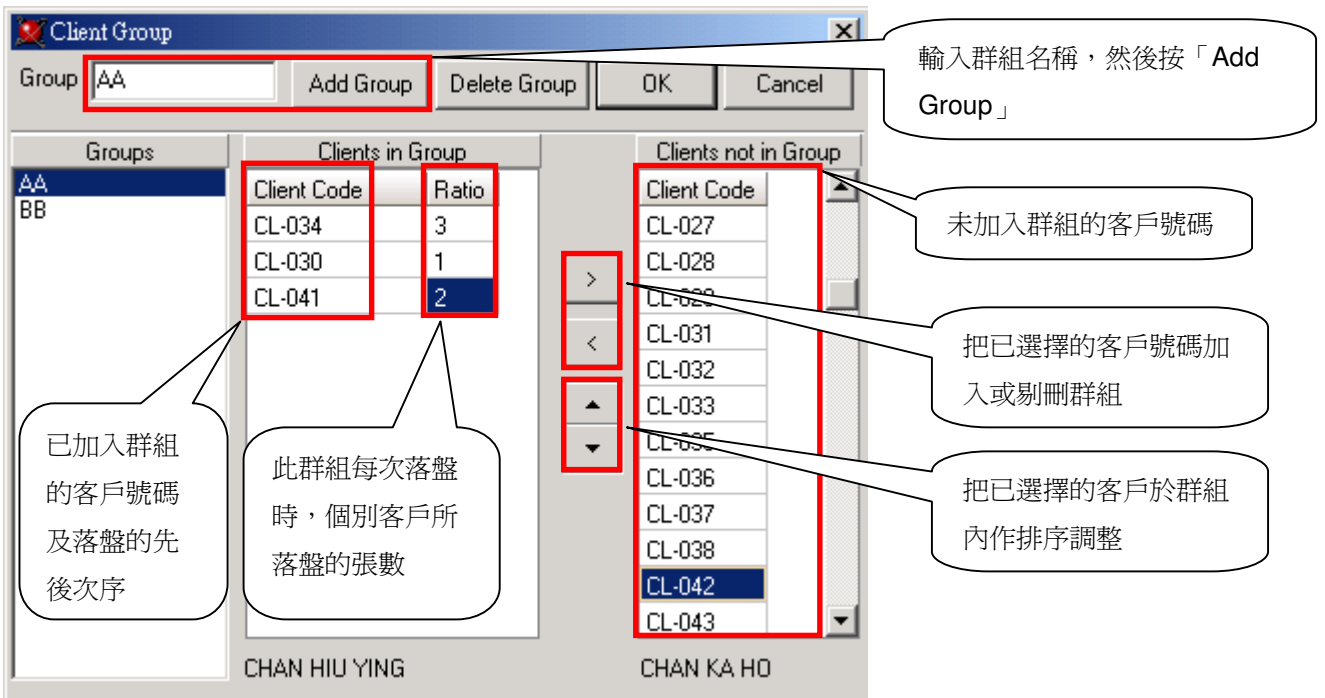
(B) 設置客戶群組

設置客戶群組可方便用戶於一次落盤中為一群客戶作相同產品及價位的買/賣盤。

1. 開啓「Client Group」

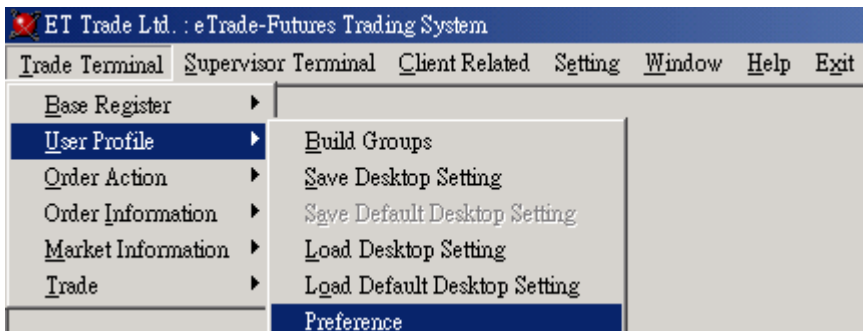


2. 輸入群組資料

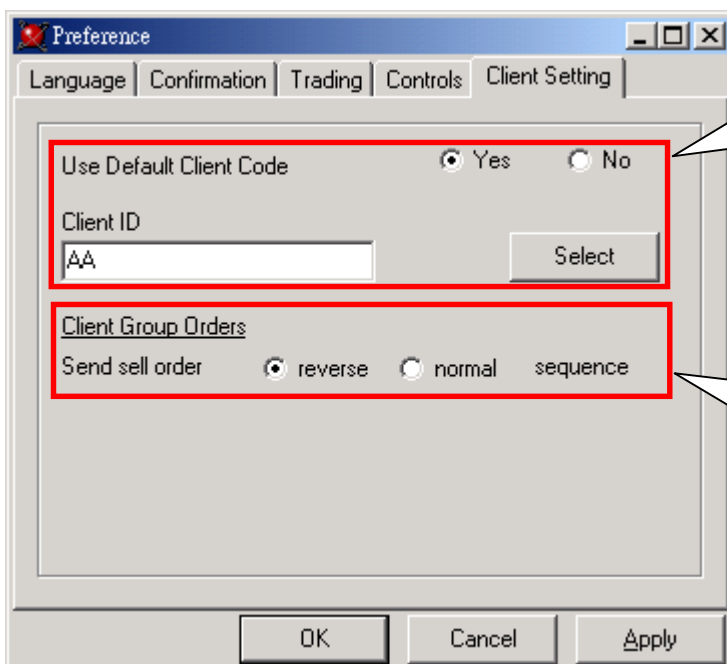


(C) 預設客戶號碼/客戶群組及群組賣盤次序倒置

1. 開啓「Preference」



2. 選擇「Client Setting」



預設客戶號碼/客戶群組

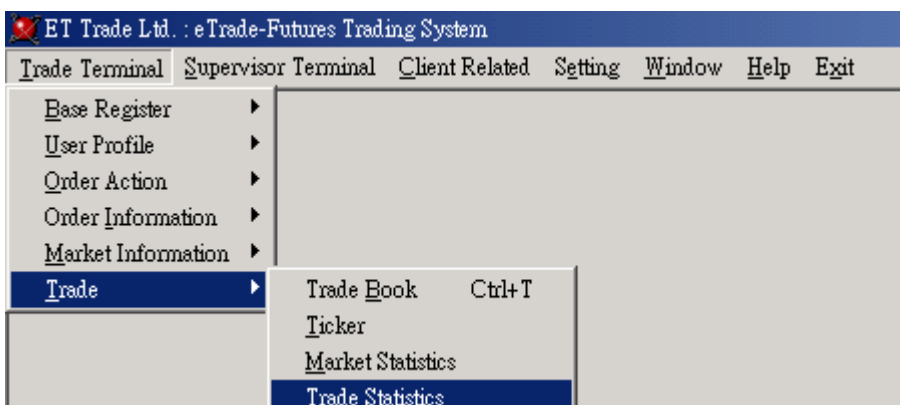
選擇「Yes」及輸入要預設客戶號碼/客戶群組名稱，儲存後該客戶號碼/群組名稱便會預先填入於「Order Ticket」中的「Info」欄

群組賣盤次序倒置

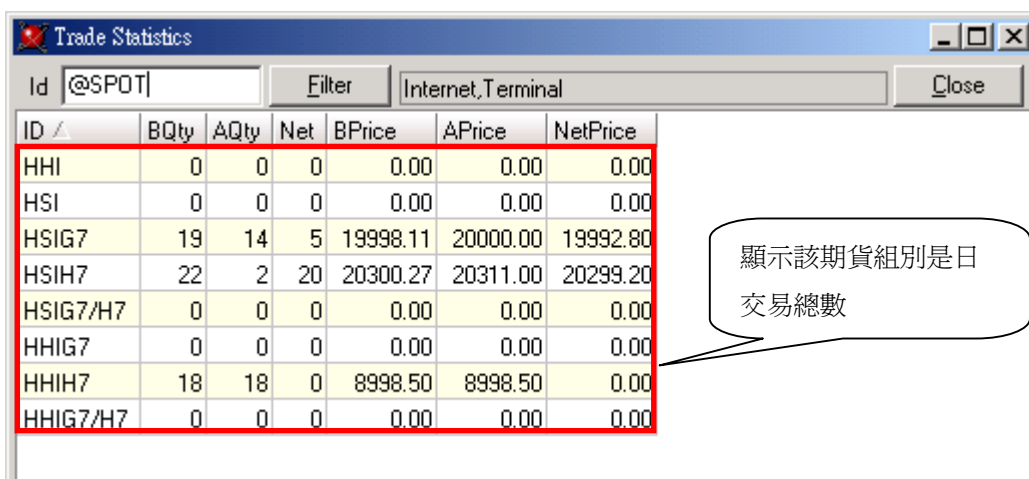
選擇「reverse」，在群組落盤時便會以倒置的客戶次序為客戶落盤
如選擇「normal」，則會以群組內的客戶次序為客戶落盤

(十四) 核對每日的交易總數

1. 開啓「Trade Statistics」



2. 按「Filter」篩選要核對的個別已成交產品總數

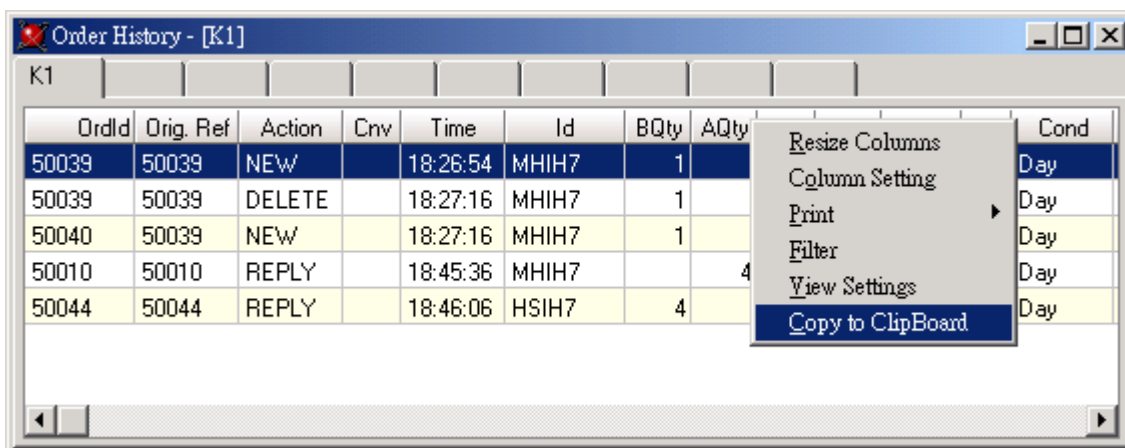


(十五) 從「ET Trade」輸出資料到記事本

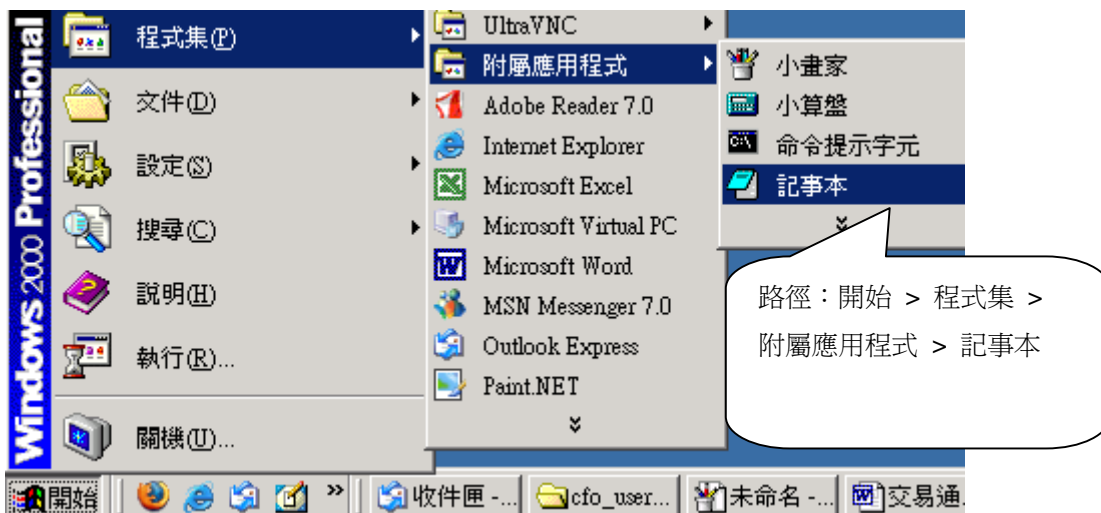
【這個功能可應用於「Order Book」、「Order History」、「Trade Book」、「Client Status Enquiry」及「Client Margin List」】

用戶可利用這個功能，核對每天的買賣盤。

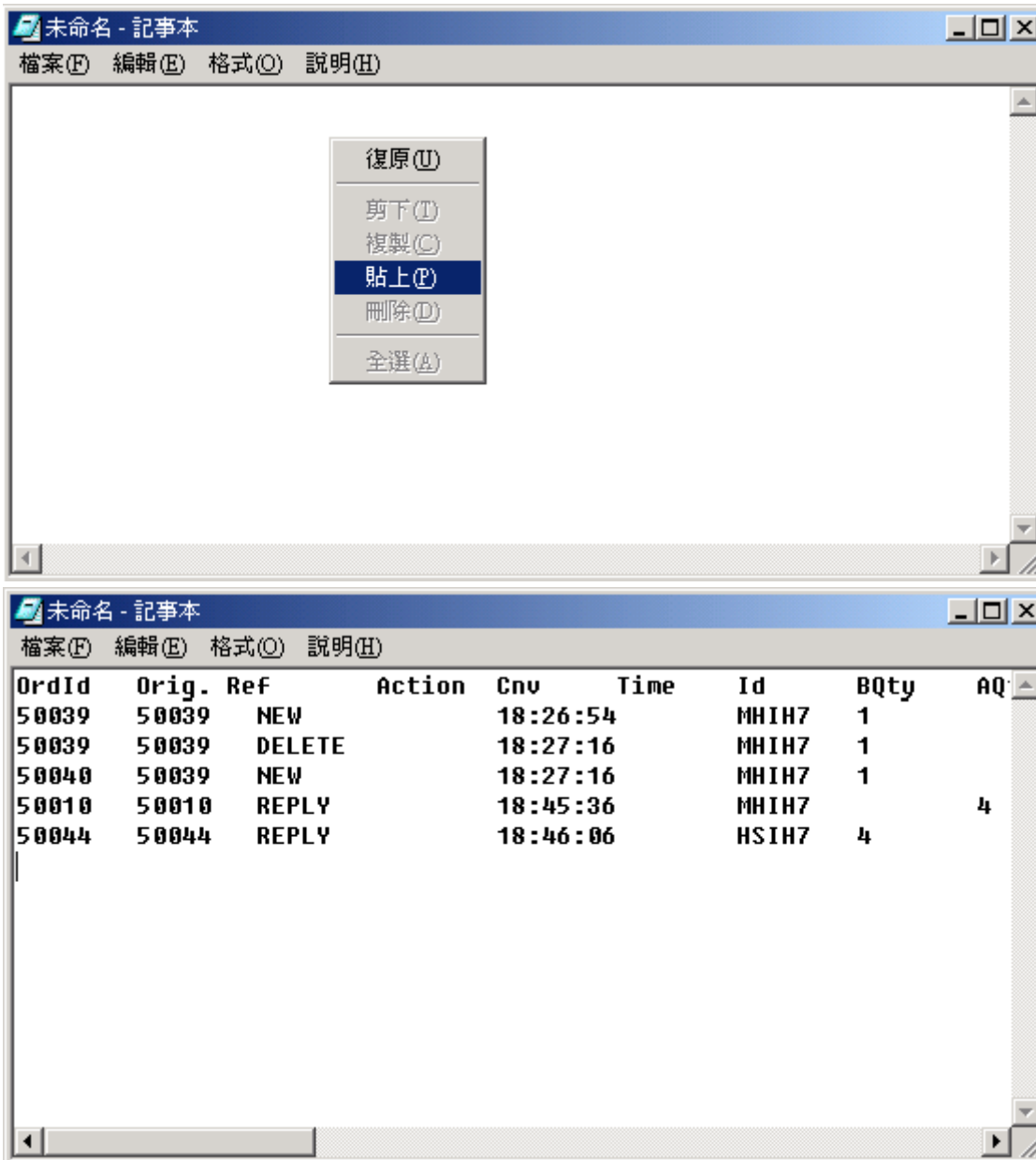
1. 於所選視窗右按滑鼠，然後選取「Copy to Clipboard」



2. 從電腦的「開始」鍵開啓「記事本」



3. 於記事本右按滑鼠，然後選擇貼上

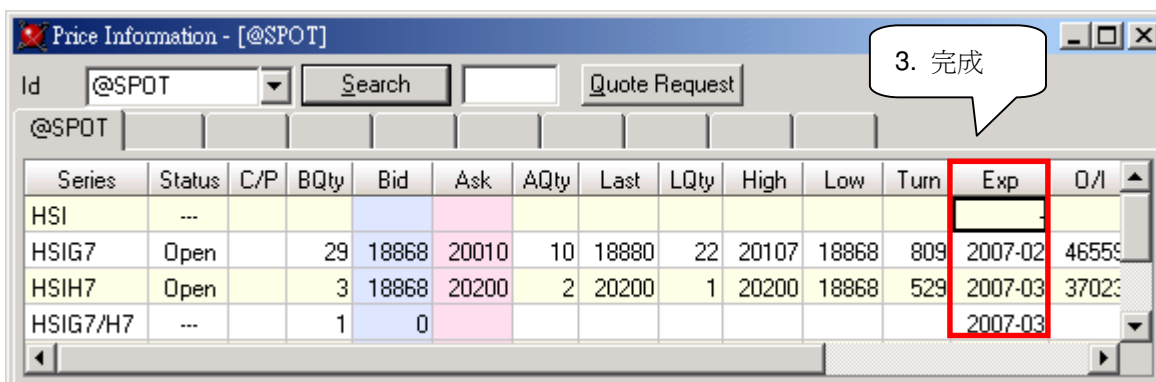
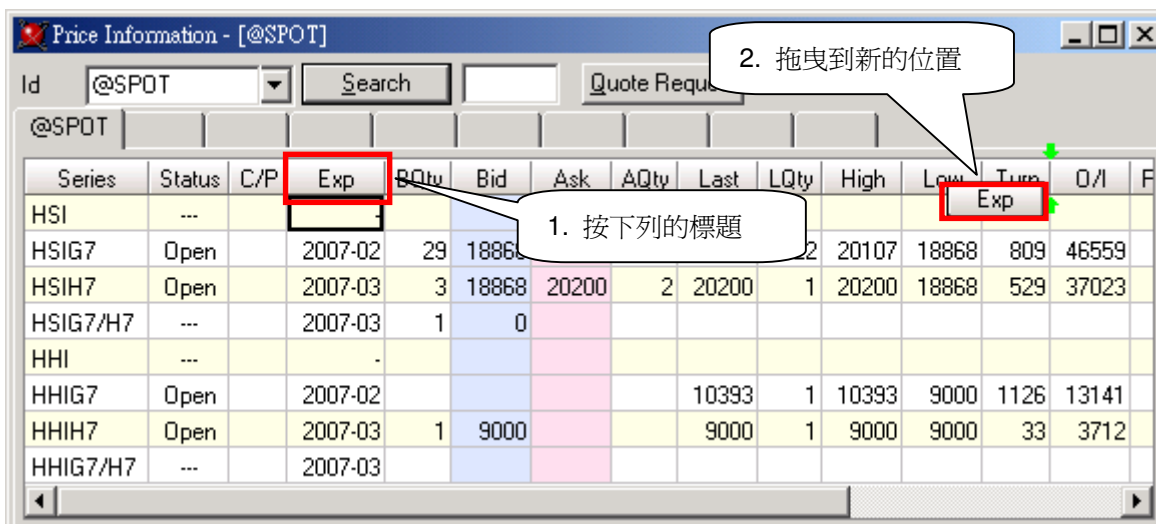


(十六) 系統的其他設定

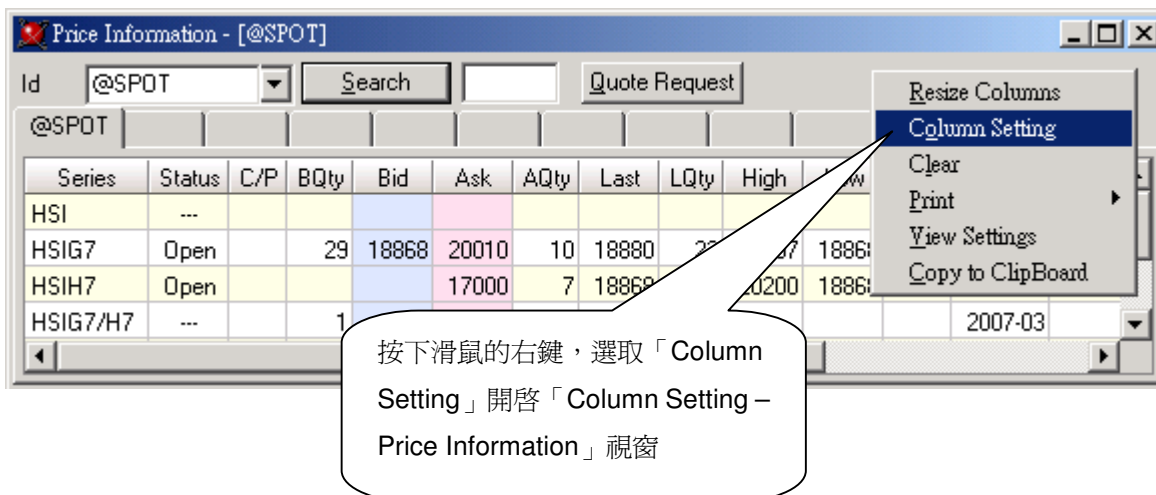
(A) 移動列的排序

【這個功能也可應用於「Order Book」、「Trade Book」、「Order History」】

i. 以「Drag and Drop」的方式移動列的排序



ii. 從「Column Setting」移動列的排序



Price Information - [@SPOT]

Id: @SPOT

Quote Request

Series	Status	C/P	BQty	Bid	Ask	AQty	Last	LQty	High	Low	Turn	Exp	O/I
HSI	...												
HSIG7	Open												
HSIH7	Open												
HSIG7/H7	...												

Column Setting - Price Information

Selected Columns

Column	Width
Series	62
Status	40
C/P	29
BQty	33
Bid	40
Ask	40
AQty	33
Last	40
LQty	32
High	40

Available Columns

Hidden Key: 0

Buttons: Show All, Hide, Hide All, Up, Down, OK, Cancel

Callouts:

- 由上至下的資料列，會由左至右顯示於「Price Information」視窗中
- 把所選資料列向左移
- 把所選資料列向右移

Price Information - [@SPOT]

Id: @SPOT

Quote Request

Series	Status	C/P	BQty	Bid	Ask	AQty	Last	LQty	High	Low	Turn	Exp	O/I
HSI	...												
HSIG7	Open												
HSIH7	Open												
HSIG7/H7	...												

Column Setting - Price Information

Selected Columns

Column	Width
Series	62
Status	40
C/P	29
BQty	33
Bid	40
Ask	40
AQty	33
Last	40
LQty	32
High	40

Available Columns

Column	Width
Chg	30
%Chg	30
Hidden Key	0

Buttons: Show, Show All, Hide, Hide All, Up, Down, OK, Cancel

Callouts:

- 把所選列顯示於「Price Information」視窗中
- 顯示於「Price Information」的資料列
- 不會顯示於「Price Information」視窗中的資料列
- 把所選列從「Price Information」視窗中移走

(B) 期貨合約的排序設定

Orderbook

	Id	OrdId	BQty	BOSQty	AQty	AOSQty	FQty	RQty	Prc	AO	Cond	Until	Cust	Trd
<input type="checkbox"/>	HSIH7	50002										21/02/07	C	0176 W
<input type="checkbox"/>	HSIH7	50013										21/02/07	C	0176 KI
<input type="checkbox"/>	HSIH7	50014	1									21/02/07	C	0176 KI
<input checked="" type="checkbox"/>	HSIG7	50015										21/02/07	C	0176 KI

按下列的標題就會有一個三角形在標題的左下角出現，這表示期貨合約會以「Ordid」由小至大排列先後次序。如要由大至小排列，則只須在「Ordid」再按一次。

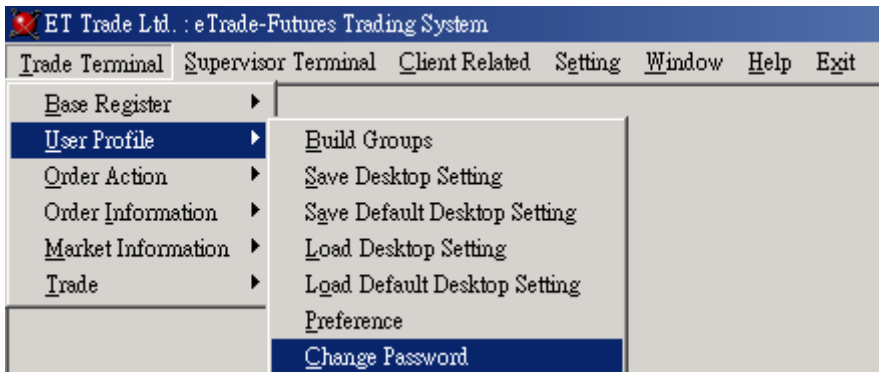
Orderbook

	Id	OrdId	BQty	BOSQty	AQty	AOSQty	FQty	RQty	Prc	AO	Cond	Until	Cust	Trd
<input type="checkbox"/>	HSIH7	50002							0	0	18870	Day	21/02/07	C 0176 W
<input type="checkbox"/>	HSIH7	50013	1		1				0	0	18867	Day	21/02/07	C 0176 KI
<input type="checkbox"/>	HSIH7	50014	1		1				0	0	20007	Day	21/02/07	C 0176 KI
<input checked="" type="checkbox"/>	HSIG7	50015				1	1		0	0	20007	Day	21/02/07	C 0176 KI

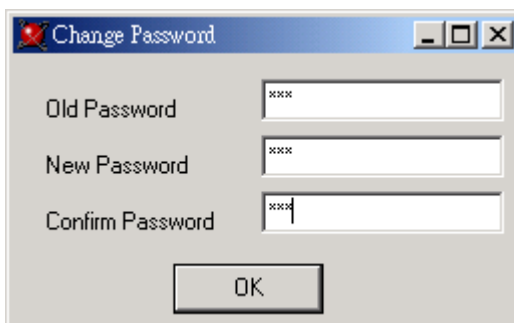
如要使用多於一個列進行排序，則只須按著「Shift」然後把滑鼠移到要排序的列的標題上。

(C) 更改密碼

1. 開啓「Change Password」



2. 更改密碼

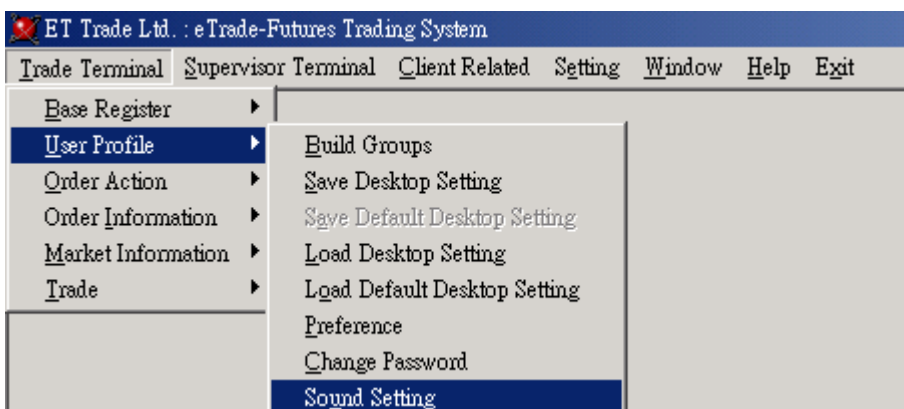


3. 確定密碼已成功地被更改

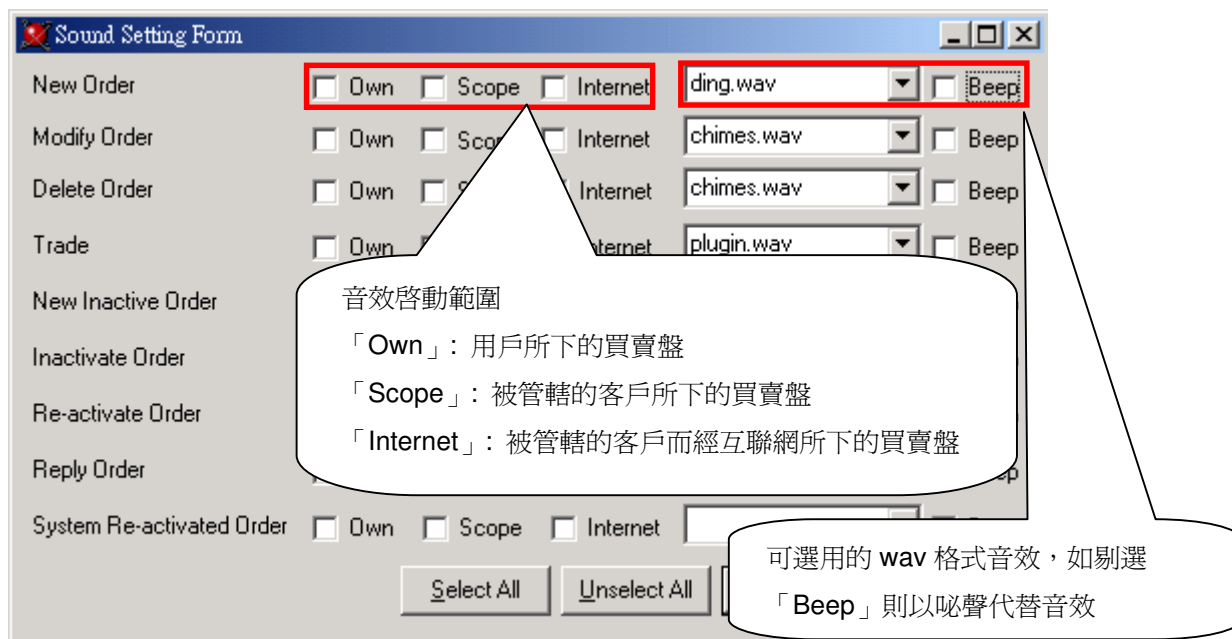


(D) 通知音效設定

1. 開啓「Sound Setting」



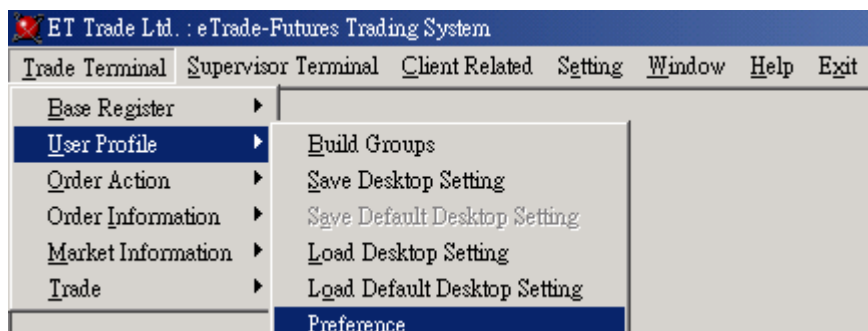
2. 選擇要使用通知音效的項目及所使用的音效



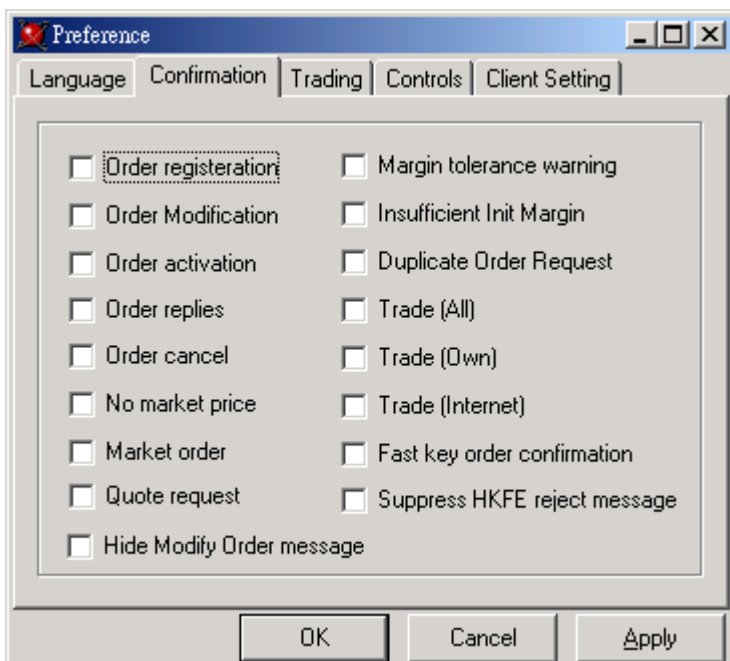
音效啟動項目	說明
New Order	新的買賣盤
Modify Order	更改落盤
Delete Order	取消落盤
Trade	已成交落盤
New Inactive Order	新的隱藏買賣盤
Inactivate Order	將已下的買賣盤隱藏
Re-activate Order	將已隱藏的買賣盤從新啟動
Reply Order	已回覆客戶
System Re-activated Order	設置的 Stop 盤已被啟動

(E) 確認視窗設定

1. 開啓「Preference」



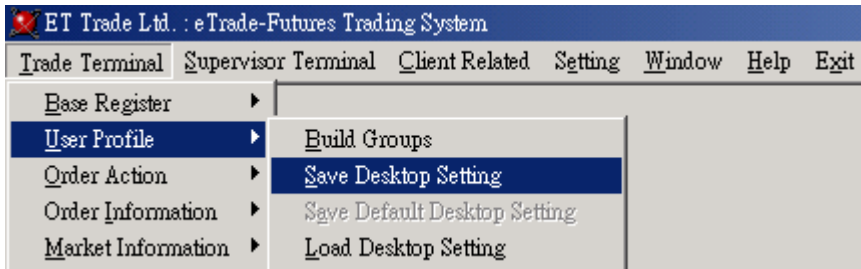
2. 於「Confirmation」中剔選要顯示的確認視窗



確認視窗項目	說明
Order registration	送出新的買賣盤時會顯示確認視窗
Order Modification	更改落盤時會顯示確認視窗
Order activation	啓動已隱藏落盤時會顯示確認視窗
Order replies	回覆已成交落盤時會顯示確認視窗
Order cancel	取消落盤時會顯示確認視窗
No market price	落盤時，該商品如沒有 Bid, Ask 及 Last 價便會顯示確認視窗
Market order	送出競價盤時會顯示確認視窗
Quote request	使用「Option Quotation」並按下「Quote request」進行查詢時顯示確認視窗
Hide Modify Order message	如剔選，當用戶更改落盤時，而該落盤在確認改盤前被部份或全數成交，便不會顯示落盤變動の確認視窗
Margin tolerance warning	當客戶落盤時，其 Margin Ratio 少於 80%而又多於 Tolerance Ratio 則會顯示確認視窗
Insufficient Init Margin	當客戶落盤時，其 Equity 少於 Init Margin 則會顯示確認視窗
Duplicate Order Request	當連續送出兩次相同的落盤時，第二次的落盤會顯示確認視窗
Trade (All)	顯示用戶管轄的客戶的買賣盤已被成交
Trade (Own)	顯示用戶所下的買賣盤已被成交
Trade (Internet)	顯示用戶管轄的客戶經互聯網所下的買賣盤已被成交
Fast key order confirmation	使用「Fast Order」落盤時顯示確認視窗
Suppress HKFE reject message	如剔選，送出的落盤被交易所拒絕後，不顯示該拒絕信息

(F) 儲存個人化版面

用戶可在「Save Desktop Setting」設定自己喜好的版面，然後把它儲存起來。如需要呼出這個版面，則只須按「Load Desktop Setting」。



附件《一》：期貨交易時段

市場狀況	時段	容許的活動
Close	09:14:59	<ul style="list-style-type: none"> 不能傳送任何買賣指令到交易所。 可在「ET Trade」輸入「Inactive Order」，待市場轉為「Pre-opening」，就可即時把「Inactive Order」轉為「Active Order」，傳送買賣指令到交易所。
Pre-opening	09:15:00 - 09:40:59	<ul style="list-style-type: none"> 可以輸入，更改及取消限價盤（Rest of Day）及競價盤（Auction）。 根據輸入的買賣盤價格及合約張數而計算的「擬定開市價」，會不斷地在 HKATS 上更新及顯示。
Pre-open allocation	09:41:00 - 09:42:59	<ul style="list-style-type: none"> 只可以輸入競價盤（Auction）。 不可以更改及取消已輸入的買賣盤。
Open allocation	09:43:00 - 09:43:59	<ul style="list-style-type: none"> 輸入的買賣盤會以最後的「擬定開市價」配對。
Pause	09:44:00 - 09:44:59	<ul style="list-style-type: none"> 不能傳送任何買賣指令到交易所。 可在「ET Trade」輸入「Inactive Order」，待市場轉為「Open」，就可即時把「Inactive Order」轉為「Active Order」，傳送買賣指令到交易所。
Open	09:45:00 - 12:29:59	<ul style="list-style-type: none"> 可以輸入，更改及取消限價盤（Rest of Day）。 可以輸入（FAK）及（FOK）盤。 不可輸入競價盤（Auction）。
Pause	12:30:00 - 13:59:59	<ul style="list-style-type: none"> 不能傳送任何買賣指令到交易所。 可在「ET Trade」輸入「Inactive Order」，待市場轉為「Pre-opening」，就可即時把「Inactive Order」轉為「Active Order」，傳送買賣指令到交易所。
Pre-opening	14:00:00 - 14:25:59	<ul style="list-style-type: none"> 可以輸入，更改及取消限價盤（Rest of Day）及競價盤（Auction）。 根據輸入的買賣盤價格及合約張數而計算的「擬定開市價」，會不斷地在 HKATS 上更新及顯示。
Pre-open allocation	14:26:00 - 14:27:59	<ul style="list-style-type: none"> 只可以輸入競價盤（Auction）。 不可以更改及取消已輸入的買賣盤。
Open allocation	14:28:00 - 14:28:59	<ul style="list-style-type: none"> 輸入的買賣盤會以最後的「擬定開市價」配對。
Pause	14:29:00 - 14:29:59	<ul style="list-style-type: none"> 不能傳送任何買賣指令到交易所。 可在「ET Trade」輸入「Inactive Order」，待市場轉為「Open」，就可即時把「Inactive Order」轉為「Active Order」，傳送買賣指令到交易所。
Open	14:30:00 - 16:14:59	<ul style="list-style-type: none"> 可以輸入，更改及取消限價盤（Rest of Day）。 可以輸入（FAK）及（FOK）盤。 不可輸入競價盤（Auction）。
Close	16:15:00	<ul style="list-style-type: none">

附件《二》：買賣盤的狀態說明

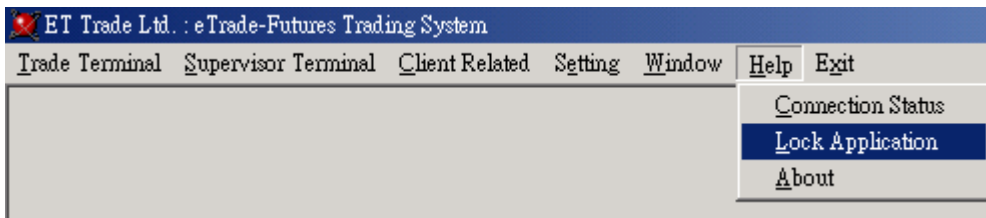
買賣盤的狀態	說明
Outstanding / New	在交易所排隊的買賣盤
Filled / Trade	已成交的買賣盤
Partial filled	部分期貨合約被成交，餘數仍然在市場排隊的買賣盤
Partial filled cancel	部分期貨合約被成交，餘數被取消的買賣盤
No fill no OB / Delete	被取消的買賣盤
Reject	交易所拒絕這個買賣盤指令
New Inactive	有兩種情況會出現「New Inactive」： 甲) 新的隱藏買賣盤，這宗交易不會出現在交易所的「Order Book」。只需按「Activate」，就可把這個買賣盤啟動及傳送到交易所。 乙) 系統設定止蝕或止賺盤，當市場的價格到達設定的啟動價，系統會自動把這個買賣盤的指令（以用戶所指定的價格）傳送到交易所。
Reactivate	啟動被隱藏買賣盤
Inactive	再次隱藏的買賣盤

附件《三》：買賣盤有效期的說明

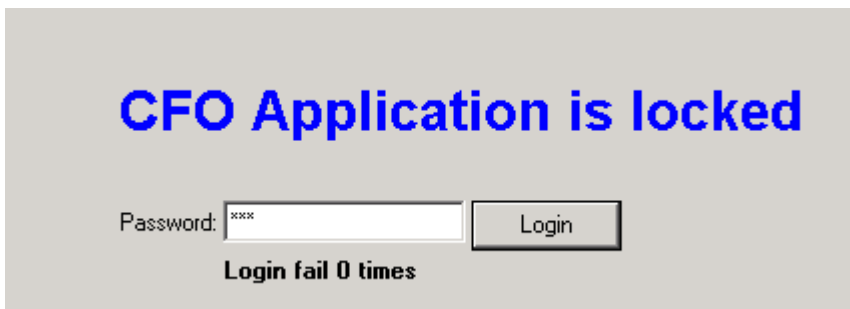
Validity	說明
Rest of Day	全日有效盤
Fill and Kill	全數成交或部分成交，餘數取消
Fill or Kill	全數成交或全數取消

附件《四》：鎖定期貨系統

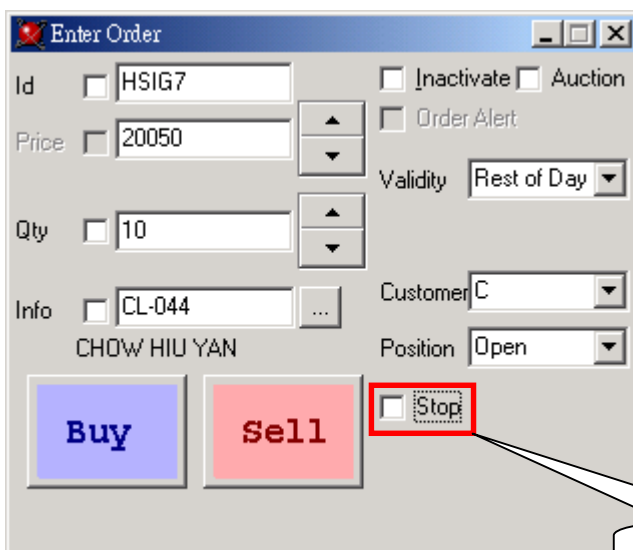
1. 開啓「Lock Application」



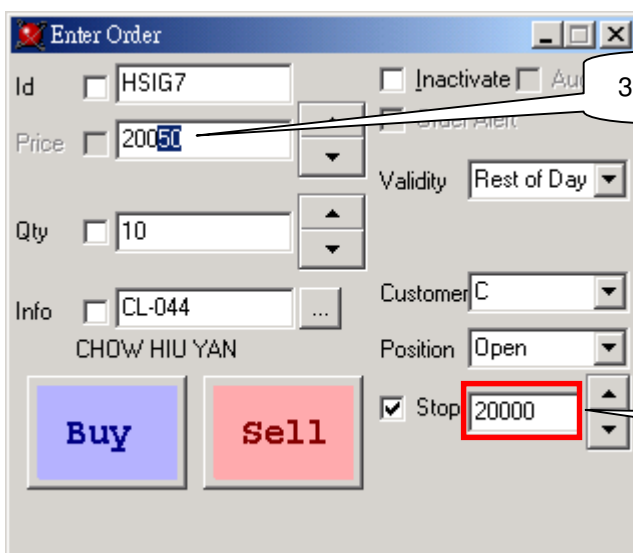
2. 如要解鎖，只需重新輸入一次登入密碼



附件《五》：「Stop」盤的使用說明



1. 按下「Stop」方格



3. 輸入期貨合約的買 / 賣價

2. 輸入啟動價

例子

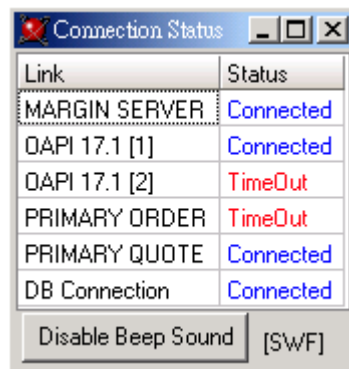
如客戶希望在市價「Last」到達 20000 點後，以最高 20050 點買入 1 張期指合約，當市價到達 20000 點時，系統會以 20050 點或以下買入 1 張期指合約。

注意：視乎市況，買入價有機會低於啟動價。

附件《六》：系統發生故障時的應變措施

(A) 「Primary Order」及「OAPI17.1(2)」出現「Timeout」

不能使用「CFO」落盤，請致電盤房或聯絡行家落盤。

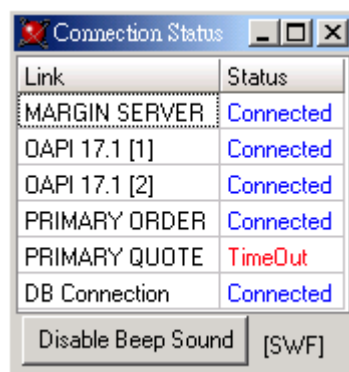


Link	Status
MARGIN SERVER	Connected
OAPI 17.1 [1]	Connected
OAPI 17.1 [2]	TimeOut
PRIMARY ORDER	TimeOut
PRIMARY QUOTE	Connected
DB Connection	Connected

Disable Beep Sound [SWF]

(B) 「Primary Quote」出現「Timeout」

- 報價不會自動更新
- 可以落「Rest of Day」、「FOK」和「FAK」盤
- 不可以落「Stop」盤及「Order Alert」盤

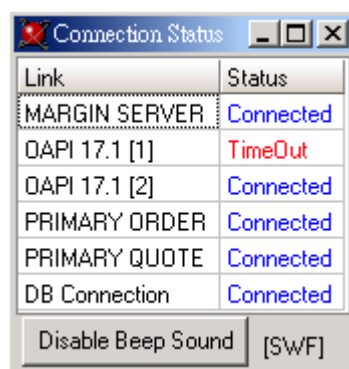


Link	Status
MARGIN SERVER	Connected
OAPI 17.1 [1]	Connected
OAPI 17.1 [2]	Connected
PRIMARY ORDER	Connected
PRIMARY QUOTE	TimeOut
DB Connection	Connected

Disable Beep Sound [SWF]

(C) 「OAPI 17.1(1)」出現「Timeout」

- 報價不會自動更新
- 可以落「Rest of Day」、「FOK」和「FAK」
- 不可以落「Stop」盤及「Order Alert」盤

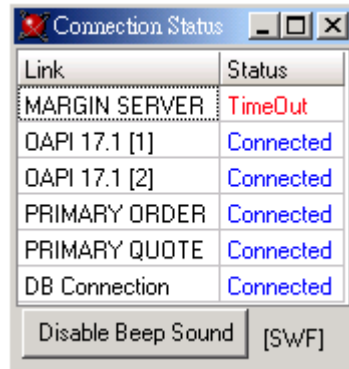


Link	Status
MARGIN SERVER	Connected
OAPI 17.1 [1]	TimeOut
OAPI 17.1 [2]	Connected
PRIMARY ORDER	Connected
PRIMARY QUOTE	Connected
DB Connection	Connected

Disable Beep Sound [SWF]

(D) 「Margin Server」出現「Timeout」

- 可以繼續落盤
- 「Client Margin List」及「Client Status Enquiry」不會被更新

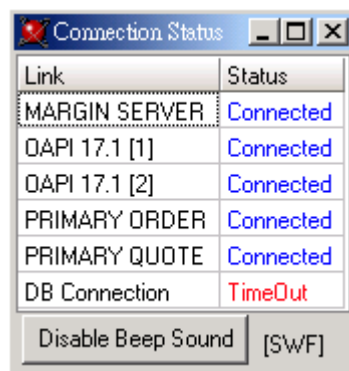


Link	Status
MARGIN SERVER	TimeOut
OAPI 17.1 [1]	Connected
OAPI 17.1 [2]	Connected
PRIMARY ORDER	Connected
PRIMARY QUOTE	Connected
DB Connection	Connected

Disable Beep Sound [SWF]

(E) 「DB Connection」出現「Timeout」

- 已登入「CFO」的用戶可以繼續落盤
- 新用戶不能登入系統



Link	Status
MARGIN SERVER	Connected
OAPI 17.1 [1]	Connected
OAPI 17.1 [2]	Connected
PRIMARY ORDER	Connected
PRIMARY QUOTE	Connected
DB Connection	TimeOut

Disable Beep Sound [SWF]