

期貨結算所規則及程序

目錄

| <u>標題</u> | <u>規則編號</u> | <u>頁碼</u> |
|-------------------|-------------|-----------|
| 第八章－緊急情況 | 801 | 8 – 1 |
| 暫停服務..... | 801A 8 – 1 | |
| 颱風、極端情況及暴雨程序..... | 802 – 803 | 8 – 1 |

第一章

釋義

定義

101. 在本規則中，除文意另有所指外，期交所規則及程序 (定義見下文)所載定義(倘文意許可，以參照形式在本規則中引用)及以下詞句具下列涵義：

「極端情況」 指 香港任何政府機關於八號或以上颱風訊號改掛為三號或以下颱風訊號前公布，因公共交通服務嚴重受阻、廣泛地區水浸、嚴重山泥傾瀉、大規模停電或任何其他惡劣情況而出現的「極端情況」；

第八章

緊急情況

颱風、極端情況及暴雨程序

802. 倘在任何營業日懸掛八號或以上颱風訊號、公布極端情況、或發出黑色暴雨警告，期貨結算所將根據結算所程序暫停其結算、交收及抵押品管理服務。
- (a) (已刪除)
 - (b) (已刪除)
 - (c) (已刪除)
 - (d) (已刪除)
803. 在不限制規則第 802 條的原則下，期貨結算所可就於颱風、極端情況或暴雨情況下個別市場的結算、交收及抵押品管理服務作出安排（包括但不限於押後到期合約的最後結算及延遲任何相關結算、交收及抵押品管理服務），有關安排將載述於適用的結算所程序或以其他方式通知期貨結算所參與者。

於期交所自動電子交易系統（「HKATS 電子交易系統」）內買賣的期貨／期權合約的結算所程序

目錄

| 標題 | 規則編號 | 頁碼 |
|-----------------------|------|--------------|
| 第六章－颱風、極端情況及暴雨 | | |
| 結算服務..... | 6.1 | CC-ATS-P-6-1 |
| 款項交收服務..... | 6.2 | CC-ATS-P-6-2 |
| 抵押品管理服務 | 6.3 | CC-ATS-P-6-3 |
| 實物交收合約的交收服務..... | 6.4 | CC-ATS-P-6-4 |

於期交所自動電子交易系統（「HKATS 電子交易系統」）內買賣的期貨／期權合約的結算所程序

以下結算所程序概述於 HKATS 電子交易系統內買賣的期貨／期權合約（本程序中稱為「合約」）的登記、交收、結算及計算按金程序。該等程序分為下列篇章：第一章－登記程序；第二章－結算及交收程序；第二 A 章－實物交收合約的交收；第三章－結算文件；第四章－儲備基金供款；第五章－以資本額釐定的持倉限額；第六章－颱風、極端情況及暴雨；第七章－結算服務終止事件；及第八章－期貨結算所未能支付事件及期貨結算所資不抵債事件。

第六章 颱風、極端情況及暴雨

除期貨結算所或期交所另有決定外(即因應其酌情權在指定時間及以指定條款，而暫停、終止、押後或延長期貨結算所之任何結算、款項交收或抵押品管理服務)，倘在任何營業日懸掛或卸下八號或以上颱風訊號、公布或取消極端情況、發出或取消黑色暴雨警告時，期貨結算所將按以下程序處理。

6.1 結算服務

6.1.1 颱風及極端情況

如於任何營業日衍生產品結算及交收系統提供結算服務前懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時或之前卸下颱風訊號及極端情況取消（如適用），此等服務將於颱風訊號卸下及取消極端情況（如適用）兩小時後恢復並按正常服務時間提供。

如於任何營業日衍生產品結算及交收系統提供結算服務前懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時仍未卸下颱風訊號或取消極端情況，對於設有 T+1 時段的市場及與該市場有相同或類似相關工具的任何其他市場所成交的合約，此等服務將於中午十二時其後兩小時恢復直至系統輸入截止時間，所有其他合約於該日則不設結算服務。倘該等營業日為期交所合約的最後交易日或到期日，該等即將到期的期交所合約的結算服務將會進一步延長一個營業日。

如於任何營業日衍生產品結算及交收系統提供結算服務後懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時或之前卸下颱風訊號及取消極端情況（如適用），此等服務將繼續按正常服務時間提供。

如於任何營業日衍生產品結算及交收系統提供結算服務後懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時仍未卸下颱風訊號或取消極端情況，此等服務將繼續提供至颱風訊號懸掛或公布極端情況後兩小時止。

如於任何營業日中午十二時後懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，衍生產品結算及交收系統所提供的結算服務將繼續至颱風訊號懸掛，極端情況公布後兩小時或直至正常服務時間完結（以較早者為準）。

6.2 款項交收服務

6.2.1 颱風及極端情況

如於任何營業日上午九時前懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時仍未卸下颱風訊號或取消極端情況，當日將不提供款項交收服務。在該情況下，款項交收將於期交所在下一個營業日恢復開市前執行；若該營業日為整日銀行營業日，則款項交收須不遲於上午九時十五分完成；若該營業日並非整日銀行營業日，則有關款項須於款項交收服務恢復後一小時內繳付。

如於任何營業日中午十二時或之前卸下八號或以上颱風訊號及取消極端情況（如適用），款項交收服務將於訊號卸下後兩小時內恢復。期貨結算所參與者須於款項交收服務恢復後一小時內繳付期貨結算所要求之相關金額。

如於任何營業日上午九時或之後懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，期貨結算所參與者須按本程序第二章所載之正常交收程序繳付到期結欠款項。款項交收服務將於颱風訊號懸掛或公布極端情況後兩小時停止。

6.2.2 暴雨

如黑色暴雨警告於任何營業日上午九時前發出，並於中午十二時仍未取消，當日將不提供款項交收服務。在該情況下，款項交收將於期交所在下一個營業日恢復開市前執行；若該營業日為整日銀行營業日，則款項交收須不遲於上午九時十五分完成；若該營業日並非整日銀行營業日，有關款項須於款項交收服務恢復後一小時內繳付。

如黑色暴雨警告於任何營業日上午九時前發出，並於中午十二時或之前取消，款項交收服務將於警告取消後兩小時內恢復。期貨結算所參與者須於款項交收服務恢復後一小時內繳付期貨結算所要求之有關金額。

如黑色暴雨警告於任何營業日上午九時或之後發出，期貨結算所參與者須按本程序第二章所載之正常交收程序繳付到期之結欠款項。而款項交收服務將繼續按正常服務時間提供。

在不限制於本程序第 6.2.1 及 6.2.2 條的原則下，款項交收服務須視乎香港銀行業能否於颱風、極端情況或暴雨期間提供服務。倘有關銀行服務未能於任何營業日內提供，期貨結算所各指定銀行、認可交收銀行及主要交收銀行將於有關銀行服務恢復營業的首個營業日，按本程序第二章扣除期貨結算所參與者之到期結欠款項。期貨結算所參與者應確保其銀行戶口內有足夠資金以繳付其付款責任。期貨結算所參與者若未能履行其款項交收責任，將被根據規則第 510 條及／或第 517 條接受紀律處分。

6.3 抵押品管理服務

下文所述之程序適用於透過共同抵押品管理系統提供的抵押品管理服務，款項交收服務則按本程序第 6.2 條處理。

6.3.1 颱風及極端情況

如於任何營業日上午九時前懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時或之前卸下颱風訊號及取消極端情況（如適用），透過共同抵押品管理系統提供之抵押品管理服務將於訊號卸下兩小時後恢復，而期貨結算所將盡力處理歸還現金盈餘要求，但須視乎相關銀行能否提供適當服務。

如於任何營業日上午九時前懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，並於中午十二時仍未卸下颱風訊號或取消極端情況，當日將不提供共同抵押品管理系統之抵押品管理服務。

如於任何營業日上午九時或之後，並於提交歸還現金盈餘要求之截止時間前（正常為上午十一時）懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，已透過共同抵押品管理系統提交的歸還現金盈餘要求，將如常被接納，但須視乎相關銀行能否提供適當服務。

6.4 有關實物交收合約的交收服務

6.4.1 颱風及極端情況

如於即將到期的實物交收合約的最後交易日或到期日之後至最後結算日期（包括該日）期間的營業日懸掛八號或以上颱風訊號或公布極端情況，以致債務工具中央結算系統、核准交收倉庫或執行該實物交收合約的實物交收的任何其他相關交收倉庫或設施（視情況而定）無法於該日執行相關商品或工具的實物交收以最後結算該實物交收合約，與該實物交收合約的最終交收有關的服務（即實物交收及相應款項交收）將押後一個營業日。