

中央結算系統一般規則

甲部：一般適用的規則

第一章

釋義

101. 定義

在本文件內，除非文義另有所指，下列詞語具有下列意義：

「非結算參與者」或「NCP」 指 並非結算參與者的：(i)交易所參與者；或(ii)本身屬可進行香港法例第 571 章《證券及期貨條例》所述第一類受規管活動的註冊認可機構的香港聯合交易所期權結算所有限公司全面結算參與者；

第十七章

參與者的持續責任

1703. 其他責任

每位參與者承諾：

- (vi) 其（不包括投資者戶口持有人）將向結算公司提供任何由與交易結算公司、結算公司或聯交所簽訂了資料共用安排或協議的交易所、結算所、監管權力或機構（無論設於香港或其他地方）要求的任何資料；
- (vii) 將向結算公司提供充份資料以便讓結算公司判斷其根據一般規則下而作出的付款是否屬於稅務資料交換框架下的預扣付款，及使結算公司履行任何適用於結算公司有關稅務資料交換框架下的責任；及
- (viii) 其（不包括投資者戶口持有人）將向結算公司提供以下資料：
  - (a) 其公司集團重組後，在合理可行的情況下盡快提供最新的集團組織架構圖；
  - (b) 每年提供持有參與者 10%或以上股本或投票權的直接及間接股東名單；

- (c) 參與者 10%或以上股本或投票權有任何直接或間接的變更(包括直接或間接持有參與者 10%或以上股本或投票權的現有股東的任何權益變動, 或任何新股東直接或間接購得參與者 10%或以上股本或投票權的權益)後, 在合理可行的情況下盡快提供載有有關變更的相關資料; 及
- (d) 在結算公司指定的期限內提供結算公司可不時要求的資料(包括財務狀況的變動)。

#### **1704. 身份為註冊機構的全面結算參與者**

每名根據香港法例第 571 章《證券及期貨條例》註冊為註冊機構的全面結算參與者若發生以下情況, 須立即以書面形式告知結算公司其所知詳情:

- (i) 未能將一級資本的金額維持在不少於規則第 303 條所規定的金額;
- (ii) 一級資本的金額下降, 比其根據運作程序第 19.2.3 節向結算公司提交的最近期財務資料中的一級資本金額減少 10%以上;
- (iii) 任何與其結算活動有關並涉及本規則不時指明、或結算公司不時向全面結算參與者指明或提示的一般及財務風險承擔的事件或事項;
- (iv) 任何嚴重違反、違背或不遵守本規則的情況, 或有理由懷疑其本身或代其行事的其他人士違反、違背或不遵守本規則; 及
- (v) 按結算公司合理要求, 在結算公司指定的期限內向結算公司提交有關其結算活動或一般及財務風險承擔的報表、賬冊、紀錄、賬目、其他文件或資料, 並即時回應結算公司的所有查詢。

## **第三十七章**

### **失責處理規則—持續淨額交收制度**

#### **3701. 失責事件**

倘若:

- (iiia) 根據香港法例第 571 章《證券及期貨條例》註冊為註冊機構的全面結算參與者未能使結算公司信納其有能力管理由其代為結算的失責非結算參與者的投資組合。有關能力的例子可包括與多於一名由其代為結算的非結算參與者訂有有效、具約束力且仍然生效的結算協議, 允許全面結算參與者在有關非

結算參與者違反交易所規則時將其交易平倉；

- (iv) 結算參與者或結算機構參與者未支付任何應付予結算公司的款項；或就同時是香港交易所或其聯屬公司所營運結算及交收系統的參與者或會員的結算參與者而言：
  - (a) 未向有關係統的中央對手方或營運商履行其須負的任何責任；或
  - (b) 違反有關係統的規則又或系統參與者或會員的條款；或
  - (c) 被中央對手方宣布失責又或吊銷或撤銷其在有關係統的參與者或會員資格；
- (xii) 就根據《證券及期貨條例》(香港法例第 571 章)為「認可結算所」的結算機構參與者而言，不再獲得該項認可；
- (xiii) 結算公司發現會影響結算參與者的客戶、聯繫人或聯屬人士的情況，而結算公司認為有關情況會導致結算參與者未能履行其在本規則或其所訂市場合約中的責任；或