

期貨結算所規則及程序

第九章
衍生產品結算及交收系統

衍生產品結算及交收系統後備中心

- 912A. 期貨結算所參與者若因技術或其他原因而未能聯通其衍生產品結算及交收系統終端機以在衍生產品結算及交收系統進行交易後之調整功能，可要求使用由期貨結算所提供的後備中心以進行有關功能。詳情見衍生產品結算及交收系統終端機使用指引。

第十章
共同抵押品管理系統

共同抵押品管理系統後備中心

1011. 期貨結算所參與者若因技術或其他原因而未能連接聯通其共同抵押品管理系統終端機以在共同抵押品管理系統進行其抵押品管理功能，可要求使用由期貨結算所提供的後備中心以進行有關功能。詳情見共同抵押品管理系統終端機使用者指引。

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

第一章 登記程序

1.4 交易調整程序

1.4.3 持倉調整

期貨結算所參與者可於任何營業日的系統輸入截止時間前，隨時利用衍生產品結算及交收系統向期貨結算所直接遞交持倉調整要求。但若是有關對外持倉轉移及平倉重開，期貨結算所參與者須將分別載於本結算所程序附錄II-2及II-3的指定表格5「要求代處理對外持倉轉移表格」及表格6「要求代取消持倉對銷表格」填妥，並以傳真方式將表格送抵期貨結算所。期貨結算所參與者如欲其持倉調整於同一營業日獲處理，則有關對外持倉轉移及平倉重開的要求持倉調整表格，必須在該營業日的系統輸入截止時間前一小時內送抵期貨結算所。任何於營業日指定時間後送抵期貨結算所的要求，期貨結算所會在下一營業日處理。然而，期貨結算所不會於有關平倉後第五個營業日指定時間後的任何時間，接納平倉重開要求。

1.5 平倉及平倉重開

1.5.1 客戶持倉的平倉

平倉調整只適用於綜合客戶戶口，因為綜合客戶戶口中的持倉是按長倉及短倉毛額基準列賬。期貨結算所參與者無須指示期貨結算所將公司戶口、個別客戶戶口及莊家戶口中的持倉平倉，因該等戶口中的持倉會自動對銷。

除非一名期貨結算所參與者對期貨結算所另有指示，否則期貨結算所會將就該期貨結算所參與者的綜合客戶戶口中的所有持倉作「未平倉」持倉處理。

期貨結算所參與者如欲平掉綜合客戶戶口中的持倉(不包括恆指期貨與小型恆指期貨合約之間的持倉、恆指期權與小型恆指期權合約之間的持倉及恆生國企指數期貨與小型恆生國企指數期貨之間的持倉)，可於任何營業日系統輸入截止時間前之任何時間，透過衍生產品結算及交收系統向期貨結算所直接遞交持倉調整要求。

除恆指期貨與小型恆指期貨合約之間的持倉是按一張恆指期貨合約兌五張小型恆指期貨合約的比例平倉、恆指期權與小型恆指期權合約之間的持倉是按一張恆指期權合約兌五張小型恆指期權合約的比例平倉及恆生國企指數期貨與小型恆生國企指數期貨合約之間的持倉是按一張恆生國企指數期貨合約兌五張小型恆生國企指數期貨合約的比例平倉外，一名期貨結算所參與者所進行持倉的平倉只可涉及同一合約。

儘管有上述規定，期貨結算保留權利隨時全權接納或拒絕任何持倉調整要求。

1.6 代處理服務

期貨結算所參與者若因技術或其他原因而未能聯通其衍生產品結算及交收系統終端機以在衍生產品結算及交收系統進行交易後調整時，可要求期貨結算所代其將交易後之調整要求輸入衍生產品結算及交收系統，期貨結算所參與者須填妥本結算所程序附錄I至II所載之有關要求代處理表格，並於系統輸入截止時間前以傳真方式將表格送抵期貨結算所。

期貨結算所會在其具備有關資源下，以及期貨結算所參與者已繳交期貨結算所不時可能規定的手續費後，方會提供代處理服務。若期貨結算所具備的資源不足以應付於指定時間內須處理的所有要求，則期貨結算所可按其全權認為適當的方式決定處理先後次序。期貨結算所不保證會在某特定時間內處理某一要求。若因期貨結算所代表任何期貨結算所參與者執行或處理指示，或因期貨結算所未能執行或處理指示，而導致有關期貨結算所參與者或任何其他人士蒙受或招致任何直接的、相應產生的、特定的、間接的、懲罰性的或其他性質的損害賠償，期貨結算所、期交所或作為期貨結算所控制人的認可控制人，概不就向有關期貨結算所參與者承擔任何責任，不論是合約責任、民事侵權行為責任或其他責任。

1.7 衍生產品結算及交收系統後備中心

期貨結算所參與者若因技術或其他原因而未能聯通其衍生產品結算及交收系統終端機以在衍生產品結算及交收系統進行交易後之調整功能，可要求使用由期貨結算所提供的後備中心以進行有關功能。詳情見衍生產品結算及交收系統終端機使用指引。

香港期貨結算有限公司

香港德輔道中 199 號
維德廣場 7 樓

傳真： 2868 0134
電話： 2211 6932

表格 4： 要求代處理內部持倉調整表格

期貨結算所參與者資料

期貨結算所參與者名稱：	衍生產品結算及交收系統用戶編號：
-------------	------------------

本表格之聯絡人：

姓名：	電話號碼：
職位：	傳真號碼：

持倉調整詳情

內部戶口持倉轉移

	舊戶口	新戶口	系列	長倉轉移	短倉轉移	O/C/N/D
1.						
2.						
3.						
理由：						

持倉對銷 (恒指期貨與小型恒指期貨之間、恒指期權與小型恒指期權之間及恆生國企指數期貨與小型恆生國企指數期貨之間的持倉淨額結算除外)

	戶口	系列	對銷數量
1.			
2.			
3.			
理由：			

附註：至於恒指期貨與小型恒指期貨之間及恒指期權與小型恒指期權之間的持倉淨額結算，請使用表格 8：要求代處理恒指 - 小型恒指期貨/期權持倉調整表格。恆生國企指數期貨與小型恆生國企指數期貨之間的持倉淨額結算，請使用表格 8A：要求代處理恆生國企指數 - 小型恆生國企指數期貨持倉調整表格。

期貨結算所參與者授權簽署

日期

簽署人姓名： _____

期貨結算所專用				
核實/日期	批准/日期	輸入	輸入日期/時間	查核/日期

香港期貨結算有限公司

香港德輔道中 199 號
維德廣場 7 樓

傳真： 2868 0134
電話： 2211 6932

表格 8： 要求代處理恒指 - 小型恒指期貨/期權持倉調整表格

期貨結算所參與者資料

期貨結算所參與者名稱：	衍生產品結算及交收系統用戶編號：
-------------	------------------

本表格之聯絡人：

姓名：	電話號碼：
職位：	傳真號碼：

恒指 - 小型恒指期貨/期權持倉調整資料

	戶口	恒指 系列*	長倉 轉移	短倉 轉移	小型恒指 系列*	長倉 轉移	短倉 轉移
1.		恒指			小型恒指		
2.		恒指			小型恒指		
3.		恒指			小型恒指		
4.		恒指			小型恒指		
5.		恒指			小型恒指		
6.		恒指			小型恒指		
7.		恒指			小型恒指		
8.		恒指			小型恒指		
9.		恒指			小型恒指		
10.		恒指			小型恒指		
		總數：			總數：		

* 「恒指系列」及「小型恒指系列」欄下同一列的系列應有相同合約月份、行使價、認購/認沽，但有 1:5 比例的相反持倉。

期貨結算所參與者授權簽署

日期

簽署人姓名： _____

期貨結算所專用				
核實/日期	批准/日期	輸入	輸入日期/時間	查核/日期

香港期貨結算有限公司

香港德輔道中 199 號
維德廣場 7 樓

傳真： 2868 0134
電話： 2211 6932

表格 8A： 要求代處理恆生國企指數 - 小型恆生國企指數期貨持倉調整表格

期貨結算所參與者資料

期貨結算所參與者名稱：	衍生產品結算及交收系統用戶編號：
-------------	------------------

本表格之聯絡人：

姓名：	電話號碼：
職位：	傳真號碼：

恆生國企指數 - 小型恆生國企指數期貨持倉調整資料

	戶口	恆生國企指數 系列*	長倉 轉移	短倉 轉移	小型恆生國企指數 系列*	長倉 轉移	短倉 轉移
1.		國指			小型國指		
2.		國指			小型國指		
3.		國指			小型國指		
4.		國指			小型國指		
5.		國指			小型國指		
6.		國指			小型國指		
7.		國指			小型國指		
8.		國指			小型國指		
9.		國指			小型國指		
10.		國指			小型國指		
		總數：			總數：		

* 「恆生國企指數系列」及「小型恆生國企指數系列」欄下同一列的系列應有相同合約月份，但有 1:5 比例的相反持倉。

期貨結算所參與者授權簽署

日期

簽署人姓名： _____

期貨結算所專用				
核實／日期	批准／日期	輸入	輸入日期／時間	查核／日期