

期貨結算所規則及程序

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

第二章 結算及交收程序

2.11.2.1 外匯基金債券期貨合約

- (b) 若期貨結算所參與者持有現貨月外匯基金債券期貨短倉，必須填妥 表格 9-「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」 所載之「指定代理／可接納外匯基金債券之通知」~~（該表格樣本請見附錄 IVA—(1)）~~，並於最後交易日下午三時或期貨結算所可能規定的其他時間之前，將表格以傳真方式送抵期貨結算所，表格中註明期貨結算所參與者就履行其交收責任而將交付的在可接納名單中某特定發行的外匯基金債券詳情，以及相應的數量；

若因任何理由未能進行交收，受影響的期貨結算所參與者須盡快通知期貨結算所有關情況，且無論如何須於最後結算日下午五時之前，以傳真方式向期貨結算所遞交 表格 10-「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」 所載之「外匯基金債券末平倉合約未能完成交收通知」作出通知~~（該表格樣本請見附錄 IVA—(2)）~~。

第五章 以資本額釐定的持倉限額

5.1 期貨結算所規定的持倉限額

期貨結算所參與者須根據期貨結算所不時規定的時間表，向期貨結算所遞交 「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」 所載之「速動資金分配申請／更改要求表格 11」，以向期貨結算所通知其速動資金的初步分配或任何有關更改。期貨結算所若在其不時規定的時間前收到任何有關更改速動資金分配的通知，則會在其收到通知的同一交易日生效。否則，該分配更改將會在期貨結算所收到通知後的下一個交易日開始時生效。儘管有上述規定，期貨結算所保留權利以全權接納或拒絕其收到的任何速動資金初步分配或分配更改的通知。若期貨結算所並未收到任何速動資金分配的通知，則其可保留權利代該期貨結算所參與者分配速動資金。

香港期貨結算有限公司

香港德輔道中 199 號 傳真：2868 0134

無限極廣場 7 樓 電話：2211 6932

表格 9: 指定代理/可接納外匯基金債券之通知*

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：

I. 指定代理資料**

指定代理名稱：_____ CMU 會員編號：_____

指定代理之聯絡人：_____ 電話號碼：_____

* 刪去不適用者

** 期貨結算所參與者須於一張外匯基金債券期貨合約最後交易日最少 14 個營業日前，通知期貨結算所有關代其交付該張外匯基金債券期貨合約的指定代理資料之任何變動。

II. 需交付外匯基金債券的資料

我們謹此確認將交付以下外匯基金債券，作為我們交收現貨月外匯基金債券期貨合約的未平倉合約之用。

外匯基金債券發行編號	數量 (每手 50,000 港 元)	面值 (千港元)	短倉 (合約數目)	戶口 客戶、公司 或莊家	備註

期貨結算所參與者授權簽署 (連公司印鑑)

日期

簽署人姓名: _____

期貨結算所專用			
核實/日期	查核/日期	批准/日期	否決/日期

附錄 IVA (2)

香港期貨結算有限公司

—— 香港德輔道中 199 號 —— 傳真: —— 2868 0134
無限極廣場 7 樓 —— 電話: —— 2211 6932

表格 10: 外匯基金債券未平倉合約未能完成交收通知

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: _____

我們謹此確認所有經期貨結算所於結算資料通知提供給我們外匯基金債券合約的未平倉合約，除以下持倉外經已完成交收:

交易參考	外匯基金債券發行編號	D= 交付 R= 接收	面值 (千港元)	交收金額 (港元)	C= 客戶 H= 公司 M= 莊家	對手方 CMU 編號	理由 [†] A 或 B

[†] —— 未能完成交收理由

—— A = 對手方未能於限期前付款: —— B = 對手方未能於限期前交付外匯基金債券

期貨結算所參與者授權簽署 (連公司印鑑)

日期

簽署人姓名: _____

期貨結算所專用			
核實/日期	查核/日期	批准/日期	否決/日期

