

## 期貨結算所規則及程序

### 第一章

#### 釋義

##### 通知及其他通訊

105. 除此等規則另有規定外，所有由期貨結算所向期貨結算所參與者發出的通知、請求、要求或其他通訊，可透過口頭或書面、以專人遞送或郵遞寄發，透過電子或傳輸線、電話、圖文傳真方式發出、於香港交易所網站發佈或以任何電腦數據傳送方式（包括但不限於HKATS電子交易系統或衍生產品結算及交收系統的廣播訊息或電子郵件）發出。
106. 就符合此等規則而言，透過衍生產品結算及交收系統或HKATS電子交易系統或電子郵件或於香港交易所網站發佈的通訊將構成書面通知。

106A. 除此等規則另有規定外，所有由期貨結算所參與者向期貨結算所發出的通知須透過書面以專人遞送或透過圖文傳真、郵遞寄發或期貨結算所接納的其他方式向期貨結算所發出。期貨結算所參與者給予期貨結算所的通知於期貨結算所收到時視作已經發出。

期貨結算所參與者或代表及／或以期貨結算所參與者名義代表期貨結算所參與者的人士向期貨結算所發出的一切指示及通訊，須按期貨結算所不時規定或接納的方式及格式發出。

期貨結算所有權接受及依賴期貨結算所參與者或其代表或以期貨結算所參與者名義代表期貨結算所參與者的人士向期貨結算所發出或聲稱發出的任何指示或通訊，不論它們是否嚴格遵照規定的方式或格式或任何適用的權限，只要期貨結算所忠誠認為或相信它們乃由期貨結算所參與者或其獲授權代表或以期貨結算所參與者名義代表期貨結算所參與者的人士發出便可。

期貨結算所倘認為期貨結算所參與者或其獲授權代表或以期貨結算所參與者名義代表期貨結算所參與者的人士向期貨結算所發出或聲稱發出的任何指示或通訊所載述的資料不足，則無責任就該指示或通訊採取行動。

## 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。

### 第一章 登記程序

#### 1.4 交易及持倉調整

##### 1.4.3 持倉調整

提供予期貨結算所參與者的持倉調整類別包括 (1) 平倉及平倉重開（進一步詳情載於下文第 1.5 條）、(2) 期貨結算所參與者各戶口之間的內部持倉轉移、(3) 由一名期貨結算所參與者戶口轉移至另一名期貨結算所參與者戶口的對外持倉轉移及 (4) 於同一戶口內的持倉對銷。除本結算所程序另有規定外，期貨結算所參與者可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。

期貨結算所參與者可於任何營業日系統輸入截止時間前之任何時間，向期貨結算所遞交持倉調整要求。又或，就 T+1 時段適用的交易所合約，以及任何於合約細則內訂明該等合約可與其他相關交易所合約互相對銷而言，該等合約之持倉調整，可於 T 時段結束批量處理完成後，至 T+1 時段截止時間前的任何時間，向期貨結算所遞交持倉調整要求。但若是有關於：

~~(i) 相關商品、期權種類、行使價及到期日相同的自訂條款指數期權系列與標準期權系列之間的平倉；及~~

~~(ii) 對外持倉轉移~~

期貨結算所參與者須填妥載於香港交易所網站（或期貨結算所不時通知期貨結算所參與者的其他渠道）的相關表格及於期貨結算所不時規定及列明於相關表格內的截止時間前向期貨結算所遞交。

期貨結算所參與者如欲於同一營業日內完成其自訂條款指數期權系列與標準期權系列之間的平倉或其持倉的對外持倉轉移，則必須在該營業日的系統輸入截止時間前向期貨結算所遞交有關持倉調整要求表格。又或，若T+1時段適用，期貨結算所將會盡力於該營業日內處理於系統輸入截止時間後，但在T+1時段截止時間前遞交到期貨結算所的有關持倉調整要求表格。

就對外持倉轉移要求而言，要求轉移及接收轉移的期貨結算所參與者雙方均須填妥載於香港交易所網站的相關表格並向期貨結算所遞交並確認有關轉移要求。任何對外持倉轉移的要求將於獲期貨結算所接納時生效。若作為接收方的期貨結算所參與者未有確認持倉的轉移，或期貨結算所拒絕有關轉移要求，則有關持倉仍屬於作為轉移方的期貨結算所參與者。至於因發生失責事件而需要在期貨結算所參與者的客戶按金對銷戶口進行持倉對外轉移時，其轉移的必須是該戶口內全部持倉而非部份持倉。

至於在同一戶口內對銷持倉，衍生產品結算及交收系統容許期貨結算所參與者指明及平掉暫存戶口及中轉戶口以外任何戶口中同一系列的任何數目之長倉及短倉。

儘管有上述規定，期貨結算所可全權接納或拒絕任何持倉調整要求。

## 1.5 平倉及平倉重開

### 1.5.2 重開持倉

期貨結算所參與者如欲重開持倉，必須將載於香港交易所網站的相關表格填妥並於期貨結算所不時規定及列明於相關表格內的截止時間前透過 DCASS 向期貨結算所遞交重開持倉要求到期貨結算所。，惟涉及以下持倉除外：

(i) 自訂條款指數期權系列與標準期權系列之間之前已平倉的持倉；及

(ii) 期貨結算所參與者之前因任何交易調整或持倉轉移而已平倉的持倉；

若為上述持倉，期貨結算所參與者必須將載於香港交易所網站（或期貨結算所不時通知期貨結算所參與者的其他渠道）的相關表格填妥並於期貨結算所不時規定及列明於相關表格內的截止時間前遞交到期貨結算所。

任何透過 DCASS 或相關表格向期貨結算所遞交的重開持倉要求將於獲期貨結算所接納時生效。任何遭期貨結算所拒絕的重開持倉要求將維持平倉。

期貨結算所參與者若要求重開持倉，必須向期貨結算所提供期貨結算所可能要求的重開持倉之有關資料，包括重開持倉的理由。

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要求。

### 1.5.3 (已刪除)

## 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透過衍生產品結算及交收系統進行交易後調整，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載於香港交易所網站 ([或期貨結算所不時通知期貨結算所參與者的其他渠道](#)) 之有關表格，並於期貨結算所不時規定及列明於相關表格內的截止時間前將表格遞交到期貨結算所。

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，概不就此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。