

期貨結算所規則及程序

第五章

限額及失責

期交所或證監會的持倉限額及申報規定

507. (a) 期貨結算所於收到期交所或證監會的書面要求後，將對期交所或證監會於該要求中指定的期貨結算所參與者實施就期交所或證監會所要求的水平及性質的持倉限額(包括屬投機性質的持倉限額)。
- (b) 在不影響期貨結算所根據規則第 501、502 及 507(a)條對期貨結算所參與者施加持倉限額的權力的情況下，除非獲交易所規則批准或獲證監會根據《證券及期貨（合約限量及須申報的持倉量）規則》第 4(3)分條批准持有或控制超過期交所在相關合約細則中不時規定的持倉限額的期貨及／或期權並（若是獲證監會批准）已書面通知期交所，否則任何人士均不得持有或控制任何超過上述持倉限制的交易所合約持倉。除非是獲上述批准，否則每名屬交易所參與者的期貨結算所參與者均須遵守當中規定的持倉限額，而每名並非交易所參與者的期貨結算所參與者亦須遵守當中規定的持倉限制，猶如其是交易所參與者。
- (c) 每名屬交易所參與者的期貨結算所參與者均須遵守交易所規則有關大額未平倉合約的相關申報規定，而每名並非交易所參與者的期貨結算所參與者亦須遵守當中有關大額未平倉合約的相關申報規定，猶如其是交易所參與者。