

期貨結算所規則及程序

目錄

標題	規則編號	頁碼
<b>第九章－衍生產品結算及交收系統</b> .....		9 – 1
引言 .....	901	9 – 1
連接衍生產品結算及交收系統 .....	902 – 907	9 – 1
衍生產品結算及交收系統設備及軟件 .....	908 – 91 <del>2</del>	9 – 1
<del>(已刪除).....</del>	<del>912</del>	
衍生產品結算及交收系統後備中心 .....	912A	9 – 2
<del>(已刪除)衍生產品結算及交收系統緊急網關連接 .....</del>	<del>912B</del>	<del>9 – 2</del>
期貨結算所參與者的責任 .....	913 – 914	9 – 2

第一章

釋義

定義

101. 在本規則中，除文意另有所指外，期交所規則及程序(定義見下文)所載定義(倘文意許可，以參照形式在本規則中引用)及以下詞句具下列涵義：

「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」指 經期貨結算所不時修訂，有關衍生產品結算及交收系統網上操作的名為「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」的手冊；

第九章

衍生產品結算及交收系統

引言

901. 期貨結算所參與者須確保於衍生產品結算及交收系統的營運作，以及合約透過衍生產品結算及交收系統進行的結算及交收的合約，皆依據本規則、結算所程序、衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引以及期貨結算所不時指定的其他程序及規定(包括衍生產品結算及交收系統協議所指定者)而進行。

### 連接衍生產品結算及交收系統

902A. 期貨結算所參與者須可選擇透過期貨結算所提供的中央網關連接器或透過期貨結算所參與者的遙距網間連接器連接衍生產品結算及交收系統。

### 連接衍生產品結算及交收系統

912. ~~（已刪除）由期貨結算所供應的所需設備的費用以及有關裝置及保養維修費用概由期貨結算所參與者負責。~~

### 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通過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。有關後備中心的服務時間及其他詳情見衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引。

### 衍生產品結算及交收系統緊急網關連接

912B. ~~（已刪除）若期貨結算所參與者因技術或其他原因而未能透過其遙距網間連接器連接衍生產品結算及交收系統，期貨結算所參與者可申請暫時使用由期貨結算所提供的緊急網關連接器連接衍生產品結算及交收系統，有關費用詳列於附錄 A。詳情見衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引。期貨結算所有絕對酌情權決定是否批准該等要求以及允許期貨結算所參與者使用緊急網關連接器連接衍生產品結算及交收系統。~~

## 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透過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。有關後備中心的服務時間及其他詳情見共同抵押品管理系統終端機使用者指引。

附錄 A

費用

說明

金額<sup>1</sup>

**與衍生產品結算及交收系統相關的費用**

<del>透過期貨結算所參與者的遙距網間連接器連接 (i) 衍生產品結算及交收系統工作站應用軟件的 或 (ii) 應用程式介面的, 分判牌照費</del>	<del>以每個連接計每月1,750元</del>
<u>透過中央網關連接器使用衍生產品結算及交收系統網上服務的連接費</u>	<u>以每個連接計每月2,600元</u>
<del>透過中央網關連接器連接 (i) 衍生產品結算及交收系統工作站應用軟件的 或 (ii) 應用程式介面的, 分判牌照費</del>	<del>以每個連接計每月2,600元</del>
<del>透過緊急網關連接器暫時連接衍生產品結算及交收系統</del>	<del>以每個連接計每日1,000元 (不足一日亦以一日計算)</del>
連接至衍生產品結算及交收系統的測試系統	每日(或不足一日)100元 首5個營業日不收連接費用
於期貨結算所正常工作時間以外進行登入測試或交易測試	每日(或不足一日)1,000元 (不論測試結果)
程式 <u>界面</u> 認證	每次 <u>測試認證</u> 2,000 元 (不論 <u>測試認證</u> 結果)
代參與者處理	每次交易 50 元 (每日最低費用 500 元)
複印報告表	每頁5元 (最高收費為每份報告表 或每隻磁碟1,000元)

<sup>1</sup> 除另有註明外，本附錄所列之金額均以港元計算。

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

### 1.2 衍生產品結算及交收系統的結算戶口類別

期貨結算所參與者如要求欲開立、維持及取消戶口，必須以期貨結算所不時規定的方式及表格提出申請。填妥及遞交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「衍生產品結算及交收系統維持戶口表格」到期貨結算所。期貨結算所可全權接納或拒絕任何開立及維持戶口的要求。

### 1.4 交易及持倉調整

#### 1.4.3 持倉調整

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分別載於「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」內 (i) 適用於自訂條款指數期權系列與標準期權系列之間的平倉之「要求代處理內部持倉調整表格」，或 (ii) 適用於對外持倉轉移之「要求代處理對外持倉轉移表格」。

就對外持倉轉移而言，要求轉移及接收轉移的期貨結算所參與者雙方均須填妥及遞交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「要求代處理對外持倉轉移表格」載於香港交易所網站的相關表格並向到期貨

結算所遞交。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。

## 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「~~衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引~~」所載之「~~要求代取消持倉對銷表格~~」填妥，並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將表格遞交到期貨結算所。

## 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透過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「~~衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引~~」載於香港交易所網站所載之有關「~~要求代處理表格~~」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。

## 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透過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。有關後備中心的服務時間及其他詳情見衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引。

## 第二 A 章 實物交收合約的交收

### 2A.1 外匯基金債券期貨合約

外匯基金債券期貨的交收程序如下：

- (a) 當現貨月外匯基金債券期貨合約買賣於最後交易日上午十一時或期交所可不時規定的其他時間結束後，期交所聯同期貨結算所會公佈外匯基金債券的(i)最後結算價；及(ii)可接納作交收的某特定發行的外匯基金債券詳情（「可接納名單」）連同相應換算因子及應計利息；

- (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「[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](#)」，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以期貨結算所不時規定的有關方式及格式遞交通知，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，以期貨結算所不時規定的有關方式及格式傳真方式向期貨結算所遞交「[衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引](#)」所載之「[外匯基金債券未平倉合約未能完成交收通知](#)」作出通知。

### 第三章 結算文件

於每日交收程序後，[衍生產品結算及交收系統及共同抵押品管理系統](#)會為期貨結算所參與者編製各類結算報表。[期貨結算所參與者可透過衍生產品結算及交收系統及共同抵押品管理系統查閱所有結算報表。](#)有關詳情請參閱[衍生產品結算及交收系統使用者指引](#)及共同抵押品管理系統終端機使用者指引。

### 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以其不時規定的有關方式及格式，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](#)」，以向期貨結算所通知，註明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。