

## 期貨結算所規則及程序

### 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：

「授權人士」 指 期交所規則及程序賦予的相同涵義；

「HKATS電子交易系統風險功能」 指 期交所規則及程序賦予的相同涵義；

「指定風險監控」 指 期交所規則及程序賦予的相同涵義；

### 第二章

#### 期貨結算所參與者資格

##### 期貨結算所參與者的持續責任

214B. (a) 每名期貨結算所參與者須自行（作為期交所參與者）設置指定風險監控，每名全面結算參與者須為其替之結算的每名期交所參與者設置指定風險監控，包括該名期貨結算所參與者的授權人士或該名期交所參與者的授權人士，以及任何獲准經該名期貨結算所參與者或該名期交所參與者的連接或獲期交所透過該名期貨結算所參與者或該名期交所參與者授予的任何連接，透過 HKATS 電子交易系統進行交易的其他人士。

(b) 每名期貨結算所參與者須向結算所提供不時要求的資料，以便結算所評估期貨結算所參與者所設置的指定風險監控是否合理。

- (c) 凡期貨結算所參與者授權人士使用 HKATS 電子交易系統風險功能或結算所不時指定的其他功能執行暫停或取消買賣盤功能，期貨結算所參與者須立即知會結算所。
- (d) 每名期貨結算所參與者須就其所設置的指定風險監控負責。期貨結算所、期交所及認可交易所控制人概不就個別期貨結算所參與者所設置的指定風險監控的充分性或有效性、或 HKATS 電子交易系統風險功能、期貨結算所參與者的 HKATS 電子交易系統之連接、或期貨結算所或會提供予期貨結算所參與者的指定風險監控相關報表、警告或通知出現的任何故障、無法使用、失誤或缺失負上任何責任。
- (e) 每名期貨結算所參與者同意，使用 HKATS 電子交易系統風險功能僅為設立、監控及實施指定風險監控，而非作任何其他用途。每名期貨結算所參與者須確保僅有其授權人士可透過 HKATS 電子交易系統風險功能連接 HKATS 電子交易系統。