

期貨結算所規則及程序

目錄

<u>標題</u>	<u>規則編號</u>	<u>頁碼</u>
<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 – 912	9 – 1
衍生產品結算及交收系統後備中心 .....	912A	9 – 2
衍生產品結算及交收系統緊急網關連接 .....	912B	9 – 2
期貨結算所參與者的責任 .....	913 – 914	9 – 2

**第九章**

**衍生產品結算及交收系統**

連接衍生產品結算及交收系統

902. 期貨結算所參與者於設置電子聯繫以連接衍生產品結算及交收系統 (下稱「衍生產品結算及交收系統連接」) 之前，須先按期貨結算所不時規定的格式訂立衍生產品結算及交收系統協議。

902A. 期貨結算所參與者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。

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。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. 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。

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**

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

以每個連接計每月1,750元

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

以每個連接計每月2,600元

透過緊急網關連接器暫時連接衍生產品結算及交收系統

以每個連接計每日1,000元  
(不足一日亦以一日計算)

<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

##### 1.2.8 平均價交易戶口

平均價交易戶口是為將多宗個別的交易組合成一宗並以平均價交易計算而設的暫時記錄戶口。平均價交易戶口不會就任何持倉作記錄或列賬。

### 第二章 交收程序

#### 2.8 即日追收變價調整

此外，當一個市場的價格特別波動，以致該市場的結算所按金損耗達約 25%，或在期貨結算所認為適當的任何其他情況下，期貨結算所可就期貨結算所參與者在當時及在該市場及／或擁有與該市場相同或類似相關工具的任何其他市場所持有的全部未平倉合約，作出即日追收變價調整。

### 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「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。