

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> |
|----------------------------------|-------------|-----------|
| 第六章－現金結算、交付及交換期貨 | | 6 – 1 |
| 現金結算合約及實物交收合約 | 601 | 6 – 1 |
| 現金結算及交付須受期交所規則、本規則及結算所程序所監管..... | 602 | 6 – 1 |
| 期貨結算所對期貨結算所參與者於現金結算合約上行使的權利..... | 602A | 6 – 1 |
| 隨機分配程序 | 603 – 605 | 6 – 1 |
| 有關期貨結算所參與者交付責任的資料 | 606 | 6 – 1 |
| 未能履行交付及／或付款責任..... | 607 – 609 | 6 – 2 |
| 期貨結算所對期貨結算所參與者於實物交收合約上行使的權利..... | 610 – 611A | 6 – 3 |
| 「交換期貨」 | 612 | 6 – 3 |

第六章

現金結算、交付及交換期貨

現金結算及交付須受期交所規則、本規則及結算所程序所監管

602. 期貨結算所參與者根據現金結算合約進行現金支付，或根據實物交收合約進行交付及／或收取交付物的責任以及相關之時間安排，須受期交所規則、本規則及結算所程序所監管。

期貨結算所對期貨結算所參與者於現金結算合約上行使的權利

- 602A. 除期貨結算所根據此等結算規則而擁有其他權利外，當期貨結算所根據一張現金結算合約有責任支付該合約之結算貨幣款項予期貨結算所參與者，期貨結算所可於有關結算貨幣仍可能於市場上流通時，以其他一種或以上的貨幣按其自行釐定的匯率計算以支付全部或部份款額予有關的期貨結算所參與者。期貨結算所會全面考慮整件個案後，自行釐定其認為公平和合理的安排。期貨結算所只會在其認為合理的意見下，當有關結算貨幣未能在市場上自由流通或兌換時，才會依照本結算規則行使其權力。

期貨結算所對期貨結算所參與者於實物交收合約上行使的權利

611. 除期貨結算所根據此等結算規則而擁有其他權利外：-
- (b) 當期貨結算所根據一張實物交收合約有責任支付該合約之結算貨幣款項予賣方期貨結算所參與者，期貨結算所可於有關結算貨幣仍可能於市場上流通時，以其他一種或以上的貨幣按其自行釐定的匯率計算以支付全部或部份款額予有關的賣方期貨結算所參與者。期貨結算所會全面考慮整件個案後，自行釐定其認為公平和合理的安排。期貨結算所只會在其認為合理的意見下，當有關結算貨幣未能在市場上自由流通或兌換時，才會依照本結算規則行使其權力。

附錄 A

費用

說明

金額¹

結算費(期貨)及行使費(期權)

金屬產品

黃金期貨

每張 1.30 美元

倫敦鋁期貨小型合約

每張人民幣3.00元

倫敦鋅期貨小型合約

每張人民幣3.00元

倫敦銅期貨小型合約

每張人民幣5.00元

附錄 B

T+1 時段截止時間

產品

時間

金屬產品

倫敦鋁期貨小型合約

凌晨一時四十五分

倫敦鋅期貨小型合約

凌晨一時四十五分

倫敦銅期貨小型合約

凌晨一時四十五分