

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：

「失責資料」 指 由期貨結算所提供給期貨結算所參與者接收方有關失責中的期貨結算所參與者的任何資料，包括根據期貨結算所規則第510條所執行行動的任何資料；

「已准許目的」 指 任何目的，其用意為准許期貨結算所參與者接收方在期貨結算所根據期貨結算所規則第510條執行任何行動時，向結算所提供協助；

「期貨結算所參與者接收方」 指 期貨結算所規則第513A(a)條賦予的相同涵義；

「期貨結算所參與者接收方聯號」 指 就期貨結算所參與者接收方而言，與該期貨結算所參與者接收方有關聯的任何附屬公司、控股公司或控股公司之附屬公司。為釐清定義，本規則中提及的「控股公司」及「附屬公司」二詞與《公司條例》（香港法例第622章）所指的涵義相同；

本規則所提及的任何法律或條例須解作不時施行的法律或條例。

如文意許可，單數詞包括複數的含義，反之亦然，而陽性詞亦包括陰性及中性的含義。

各標題僅為方便查詢而加入，不影響本規則的釋義。

第五章

限額及失責

主席在失責方面的權力

510. 儘管有本規則的任何其他規定，若發生失責事件，期貨結算所在毋須事先通知該期貨結算所參與者或獲得其同意的情況下，可於根據主席所作出之決定後宣佈該期貨結算所參與者為失責者及/或對該失責的期貨結算所參與者採取任何下列行動，或主席可能認為適當的其他行動：

- (h) ~~按主席於諮詢證監會後作出的指示，~~委任任何人士以拍賣及/或私人安排形式持有適當持倉，或由期貨結算所直接於任何市場(包括期交所運作的該等市場)代表該失責的期貨結算所參與者持有適當持倉，用以對沖登記於該期貨結算所參與者名下的任何或所有未平倉期貨/期權合約的風險；

強制平倉、轉移、出售及交收

513A. (a) 就所接收的失責資料而言，每名期貨結算所參與者（以「期貨結算所參與者接收方」的身份）須同意及承諾：(i)確保一切失責資料嚴格保密及安全；(ii)僅將失責資料用於已准許目的；及(iii)僅在符合已准許目的（及僅限於此）及必須知道的情況下，向其僱員、高級人員、代表、顧問或期貨結算所參與者接收方聯號披露失責資料。

- (b) 按期貨結算所提出的要求及在合理可行的情況下，並根據期貨結算所規則第510條總結的任何行動內，期貨結算所參與者接收方須盡快將全部或任何部份由期貨結算所參與者接收方、其僱員、高級人員、代表、顧問或期貨結算所參與者接收方聯號管有以任何形式存在的失責資料經安全方式交還期貨結算所，或銷毀失責資料，或促使銷毀任何包含失責資料的材料、紙張、程式或記錄的副本或複製本，包括從任何存儲裝置或途徑銷毀或刪除該資料，但期貨結算所參與者接收方可按法律要求保留任何失責資料的副本。按期貨結算所提出的要求，期貨結算所參與者接收方須以書面形式向期貨結算所確認已完全符合上述規定。

- (c) 每名期貨結算所參與者接收方須建立適當的程序及機制，以保證失責資料在任何時候也僅用於其已准許目的及其任何僱員、高級人員、代表、顧問或期貨結算所參與者接收方聯號。
- (d) 如有以下情況，本規則不得禁止披露或禁止使用失責資料：(i)該失責資料已公開（因期貨結算所參與者接收方違反本規則除外）；(ii)期貨結算所參與者接收方根據由第三方向合資格司法權區的法院申請後，法院所發出的指令而必須作出的相關行動；(iii)任何政府機構對期貨結算所參與者接收方執行監察或監管職能時，向期貨結算所參與者接收方提出要求；或(iv)披露事宜已事先取得期貨結算所的書面批准。