

目錄

| 標題 | 規則編號 | 頁碼 |
|---|------------|--------|
| 序言 | | (i) |
| 一般資料 | | (i) |
| 參與者資格 | | (i) |
| 與期交所的關係..... | | (i) |
| 期貨結算所作為對手方 | | (ii) |
| 風險管理 | | (iii) |
| 第一章－釋義 | | 1 – 1 |
| 定義 | 101 | 1 – 1 |
| 釋義 | 102 | 1 – 21 |
| 過渡條文 | 103 – 104 | 1 – 21 |
| 通知..... | 105 – 106 | 1 – 21 |
| 責任豁免..... | 107 – 110 | 1 – 22 |
| 第二章－期貨結算所參與者資格 | | 2 – 1 |
| 參與者資格要求..... | 201 – 202 | 2 – 1 |
| 記錄、登記及結算的權利 | 203 – 204 | 2 – 1 |
| 申請程序 | 205 – 213 | 2 – 1 |
| 期貨結算所參與者的持續責任..... | 214 – 214D | 2 – 3 |
| 財政資源要求 | 215 – 215D | 2 – 5 |
| 轉讓期貨結算所參與者資格..... | 216 | 2 – 6 |
| 退任期貨結算所參與者及退還期貨結算所參與者初次供款 及期貨結算所參與者額外供款..... | 217 | 2 – 6 |
| 過渡條文 | 218 | 2 – 8 |
| 資料披露 | 219 – 221 | 2 – 8 |
| 開始結算業務 | 222 | 2 – 9 |
| 數目限制 | 223 | 2 – 10 |
| 稅務 | 224 – 226 | 2 – 10 |
| 向參與者准入上訴委員會上訴..... | 227 – 233 | 2 – 10 |
| 參與者准入上訴委員會訴訟..... | 234 - 244 | 2 – 11 |
| 第三章 – 登記、結算、風險 | | 3 – 1 |
| 一般資料..... | 301 – 302 | 3 – 1 |
| (已刪除) | 303 – 308 | |
| 登記的時間安排..... | 308A | 3 – 1 |
| (已刪除) | 308B | |
| 爭議解決 | 308C | 3 – 2 |
| 登記的法律效力..... | 309 – 310 | 3 – 2 |

目錄

| 標題 | 規則編號 | 頁碼 |
|------------------------------------|------------|--------------|
| 期貨結算所作為對手方的合約條款 | 311 | 3 – 5 |
| 費用及其他..... | 312 | 3 – 6 |
| 合約登記後之轉移 | 313 | 3 – 6 |
| 結算協議書..... | 314 – 319 | 3 – 7 |
| 第四章 – 結算所按金、變價調整、補倉及戶口..... | | 4 – 1 |
| 總則 | 401 | 4 – 1 |
| 結算所按金 | 402 | 4 – 1 |
| 扣押結算所按金 | 403 | 4 – 1 |
| 認可抵押品..... | 404 | 4 – 2 |
| (已刪除) | 405 | |
| 發還結算所按金 | 406 – 407 | 4 – 2 |
| 變價調整 | 408 – 410B | 4 – 3 |
| 強制即日變價調整及按金..... | 410C | 4 – 4 |
| 額外按金及即日追收變價調整 | 411 | 4 – 4 |
| 大手交易特別按金 | 411A | 4 – 5 |
| 收市價 | 412 | 4 – 6 |
| 戶口 | 413 – 414 | 4 – 6 |
| 累計及對銷 | 415 | 4 – 6 |
| 款項運用 | 416 - 416A | 4 – 7 |
| 進賬結餘利息、成本及收費 | 417 | 4 – 7 |
| 支賬結餘利息 | 418 | 4 – 8 |
| 利息、成本及收費計算 | 419 | 4 – 8 |
| 獨立處理的「共同抵押品管理系統客戶抵押品戶口」..... | 420 | 4 – 8 |
| 第五章 – 限額及失責 | | 5 – 1 |
| 持倉限制 | 501 – 506A | 5 – 1 |
| 按期交所指示的持倉限額 | 507 | 5 – 2 |
| 超出持倉限額 | 508 | 5 – 2 |
| 失責事件 | 509 – 509A | 5 – 2 |
| 主席在失責方面的權力..... | 510 – 511 | 5 – 4 |
| 強制平倉、轉移、出售及交收..... | 512 – 515 | 5 – 6 |
| 終止合約..... | 515A | 5 – 8 |
| 導致紀律訴訟的情況 | 516 | 5 – 9 |
| 紀律處分權力 | 517 | 5 – 10 |
| 暫時吊銷資格的影響 | 518 | 5 – 11 |
| 撤銷資格及撤銷資格的影響 | 519 | 5 – 12 |
| 對期貨結算所參與者作出紀律處分行動..... | 520 – 523 | 5 – 13 |
| 轉交指定監察部職員審理的紀律處分事宜 | 524 – 528 | 5 – 14 |

目錄

| 標題 | 規則編號 | 頁碼 |
|--|------------|--------------|
| 轉交紀律委員會審理的紀律處分事宜 | 529 – 530 | 5 – 14 |
| 紀律上訴委員會 | 531 – 533 | 5 – 16 |
| 上訴程序 | 534 – 538 | 5 – 16 |
| 合作 | 539 | 5 – 18 |
| 和解 | 540 | 5 – 18 |
| 自然公正原則 | 541 | 5 – 19 |
| 期貨結算所、期交所及作為期貨結算所控制人的認可控制人的責任 | 542 | 5 – 19 |
| 判決通知 | 543 | 5 – 19 |
| 過渡條文 | 544 | 5 – 20 |
| 期貨結算所未能支付事件..... | 545 - 549 | 5 – 20 |
| 期貨結算所資不抵債事件..... | 550 - 551 | 5 – 21 |
| 期貨結算所未能支付事件或期貨結算所資不抵債事件下淨額支付計算..... | 552 - 554 | 5 – 22 |
| 期貨結算所未能支付事件或期貨結算所資不抵債事件下期貨計算所的法律責任..... | 555 | 5 – 23 |
| <u>第六章－現金結算、交付及交換期貨</u>..... | | 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 |
| 分配程序..... | 603 – 605A | 6 – 1 |
| 有關期貨結算所參與者交付責任的資料 | 606 | 6 – 2 |
| 非實物交收期貨結算所參與者於實物交收金屬期貨合約的未平倉持倉..... | 606A | 6 – 3 |
| 期貨結算所對實物交收金屬期貨合約涉及的非實物交收期貨結算所參與者採取的行動..... | 606B | 6 – 3 |
| 未能履行交付及／或付款責任..... | 607 – 609 | 6 – 3 |
| 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 - 611B | 6 – 4 |
| 「交換期貨」 | 612 | 6 – 5 |
| <u>第七章－儲備基金及虧損分配程序</u>..... | | 7 – 1 |
| 總則 | 701 | 7 – 1 |
| 賬目及會計方法 | 702 | 7 – 3 |
| 儲備基金的資源通知 | 703 | 7 – 3 |
| 撥入儲備基金的款項 | 704 | 7 – 3 |
| 儲備基金的支持 | 705 – 705A | 7 – 3 |

目錄

| 標題 | 規則編號 | 頁碼 |
|--|-------------|--------|
| 儲備基金的用途及運用次序和期貨結算所參與者額外供款 豁免額的運用..... | 706 | 7 - 4 |
| (已刪除) | 706A-706D | |
| 追加儲備基金..... | 707 - 707A | 7 - 6 |
| 儲備基金的補充..... | 707B - 707C | 7 - 7 |
| 期貨結算所參與者結算規則在責任上限期後的責任 以儲備基金付款 | 707D | 7 - 8 |
| | 708 | 7 - 9 |
| 自願性供款..... | 709 | 7 - 9 |
| 虧損分配程序..... | 710 - 714 | 7 - 10 |
| 第八章 – 緊急情況 | 801 | 8 - 1 |
| 暫停服務..... | 801A | 8 - 1 |
| 颱風、極端情況及暴雨程序..... | 802 - 803 | 8 - 1 |
| 第九章 – 衍生產品結算及交收系統 | | 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 - 911 | 9 - 1 |
| (已刪除) | 912 | |
| 衍生產品結算及交收系統後備中心..... | 912A | 9 - 2 |
| (已刪除) | 912B | |
| 期貨結算所參與者的責任 | 913 - 914 | 9 - 2 |
| 第十章 – 共同抵押品管理系統 | | 10 - 1 |
| 引言..... | 1001 | 10 - 1 |
| 連接共同抵押品管理系統 | 1002 - 1005 | 10 - 1 |
| 共同抵押品管理系統設備及軟件 | 1006 - 1010 | 10 - 1 |
| 共同抵押品管理系統後備中心 | 1011 | 10 - 2 |
| 期貨結算所參與者的責任 | 1012 - 1013 | 10 - 2 |
| 第十一章 – 結算服務終止事件 | | 11 - 1 |
| 結算服務終止事件..... | 1101-1103 | 11 - 1 |
| 結算服務終止事件下期貨結算所的法律責任..... | 1104 | 11 - 1 |
| ----- o ----- | | |
| 附錄 A – 費用 | | A - 1 |
| 附錄 B – T+1 時段截止時間 | | B - 1 |