

期交所規則、規例及程序

第一章

規則的釋義、執行及修訂

定義及釋義

101. 在本規則中，除文意另有所指外，以下詞句具下列涵義：—

「HKATS電子交易系統風險功能」	指	本交易所要求各交易所參與者安裝（若交易所參與者為非結算參與者，則安排每名替其交易進行結算的期貨結算公司參與者安裝）的HKATS軟件，用以設置、監控及實施該交易所參與者的指定風險監控；
-------------------	---	---

第五章

交易所參與者資格的一般責任

結算所參與者資格

530. (a) 有意以本身名義透過結算所進行交易結算的每名交易所參與者，均須註冊成為結算所的參與者。
- (b) 有意在本交易所運作的市場進行交易（不論為本身戶口或其他）的每名非結算所參與者，均須首先在註冊為「全面結算參與者」的交易所參與者就有關在結算所交易開設交易戶口，並根據結算所可能不時規定的形式或載有結算所可能不時規定的該等條文的形式，~~而與註冊為「全面結算參與者」的期貨結算公司該名全面結算參與者訂立協議~~，且須一直確保該協議繼續具十足效力。除非該名全面結算參與者已根據結算所規則通知期貨結算所終止結算協議，否則，該名非結算參與者擬終止有關協議，須在實際終止協議日期前以書面形式預先通知本交易所。除非或直至交易所參與者成為結算所參與者或與全面結算參與者訂有具效力、具約束力及有效的結算協議，否則，該名交易所參與者不得在本交易所的設施或透過本交易所的設施進行交易。

(ba) 與多於一名全面結算參與者訂立結算協議的非結算參與者，必須確保其已按登入 HKATS 電子交易系統進行交易的基礎或交易所可能不時指定的其他方式，指定相關全面結算參與者結算為該非結算參與者進行結算的每項交易，並必須有安排就上述指定通知該全面結算參與者。交易所可能會限制非結算參與者可訂立的結算協議數目。僅委任一名全面結算參與者以進行結算的非結算參與者會被視為其本身訂立的所有交易均全部指定由該名全面結算參與者結算。

(c) 倘交易所參與者與代表並非結算所參與者的客戶與結算所進行買賣，則該交易所參與者不得將一名客戶與另一名客戶的交易進行對盤，或與該結算所進行平倉。

第十二章

自動電子交易系統

在HKATS電子交易系統中設立指定風險監控

1205A. 在不影響規則第 1208B 條下本交易所權利的情況下，交易所參與者（如屬非結算參與者，則為替其結算交易的期貨結算公司參與者）須就交易所參與者自身及其授權人士、遠程聯通客戶以及任何獲准經其接駁至或透過該交易所參與者批准每名任何接駁至 HKATS 電子交易系統進行交易的其他人士，使用 HKATS 電子交易系統風險功能，設立、監控及實施指定風險監控。交易所參與者知悉輸入 HKATS 電子交易系統的買賣盤須受此等指定風險監控所規限，並可能因其中部分而被暫停或取消，包括（若其屬非結算參與者）被替其交易進行結算的期貨結算公司參與者暫停或取消。