

第八章

交易安排 – 慣例及系統

錯誤交易

- 819C. (a) 若一名交易所參與者因本身疏漏未有執行客戶的買賣盤或錯誤地執行一名客戶的買賣盤，以致所產生的交易在數量、合約月或持倉（例如買而非賣）上與該名客戶所指定者有異，及該項疏漏或錯誤交易直至相關市場收市後或於該市場即將收市前才被察覺，以致不可能於相關市場內矯正有關疏漏或錯誤，則該名交易所參與者可於相關市場收市後盡快（但不遲於相關市場收市後一小時內）向交易所呈交交易所不時指定的表格，把因該疏漏或錯誤持倉而產生的倉盤撥存入其公司戶口內。
- (b) 交易所可要求交易所參與者向交易所提供其為實現此程序的使用而需要或認為必須的資料和文件。
- (c) 若一名客戶由於一名交易所參與者錯誤地執行買賣盤時出現錯漏而蒙受損失，該損失將由該名交易所參與者承擔受。

第十二章

自動電子交易系統

- 1215 當涉及一個期貨交付月份或期權系列的一張交易所合約的一個買賣盤，透過HKATS電子交易系統與另一張涉及相同期貨交付月份或期權系列的交易所合約的一個買賣盤配對時，而該等有關期貨／期權合約的配對買賣盤乃記錄於HKATS電子交易系統的交易登記冊，則該期貨／期權合約便被視為於當時執行。緊接該記錄後，並在期貨／期權合約已根據本規則有效執行的前提下，期貨／期權合約須根據結算所規則進行責務變更程序。儘管有上述條文，於一個市場的開市前議價時段內記入交易登記冊的配對買賣盤，在開市前不得在結算所登記或進行責務變更；而記入交易登記冊的大手交易，須於結算所確信記錄的大手交易為一項有效大手交易並符合大手交易適用的所有準則，方可在結算所登記或進行責務變更。倘除非於進行一項大手交易起計30分鐘內一名交易所參與者並無收到本交易所或結算所的任何口頭或書面通知，指該大手交易為無效或並未符合該大手交易適用的所有條件，又或大手交易因任何理由不會獲結算所登記或結算，則應視該大手交易已獲結算所登記，並於緊接該大手交易記入交易登記冊後根據結算所規則進行責務變更程序。本交易所將盡力在該交易所參與者執行大手交易起計30分鐘內，通知該交易所參與者任何涉及規則第815A條所載條件的事宜。