

## 目錄

標題	規則編號	頁碼
<b>序言</b> .....		i
本交易所 .....		i
目標 .....		i
交易所參與者資格 .....		i
結算 .....		ii
<b>第一章 - 規則的詮釋、執行及修訂</b> .....		1-1
釋義及詮釋 .....	101-105	1-1
管理 .....	106-110	1-13
修訂 .....	111	1-14
對交易所參與者及期交所 交易權持有人發出的通知 .....	112	1-14
過渡性條文 .....	113-114	1-15
<b>第二章 - 市場及委員會</b> .....		2-1
市場的成立及分類 .....	201	2-1
(已刪除) .....	202-217	
委任常務委員會 .....	218	2-1
(已刪除) .....	219-234	
再轉委 .....	235	2-1
<b>第三章 - 交易所參與者資格及期交所交易權</b> .....		3-1
總則 .....	301-302	3-1
申請交易所參與者資格 .....	303-304	3-1
批准或拒絕 .....	305	3-1
條件 .....	306-307	3-2
成為交易所參與者的日期 .....	308	3-2
監管程序 .....	309-310	3-3
證明書 .....	311	3-3
交易所參與者資格類別 .....	312	3-4
財務規定 .....	313-315B	3-4

<u>標題</u>	.....	<u>規則編號</u>	<u>頁碼</u>
交易所參與者登記冊	.....	316	3-5
公佈交易所參與者的名單	.....	316A	3-6
立法會條例	.....	317	3-6
 <b><u>第三 A 章 -期交所交易權</u></b> .....			<b>3A-1</b>
遵守規則	.....	3A-01	3A-1
期交所交易權乃獲接納為			
交易所參與者的先決條件	.....	3A02-3A03	3A-1
申請發出期交所交易權	.....	3A03A-3A03B	3A-1
批准	.....	3A03C	3A-1
條件	.....	3A03D-3A03E	3A-2
持有期交所交易權	.....	3A04 - 3A06	3A-2
期交所交易權持有人登記冊	.....	3A07 -3A08	3A-2
期交所交易權證明書	.....	3A09	3A-3
(已刪除)	.....	3A10	
不得抵押期交所交易權	.....	3A11	3A-3
期交所交易權不得轉讓	.....	3A12	3A-3
(已刪除)	.....	3A13	
期交所交易權的分割	.....	3A14	3A-5
撤銷期交所交易權	.....	3A15	3A-5
放棄期交所交易權	.....	3A16-3A18	3A-5
對期交所交易權持有人的			
紀律處分行動	.....	3A19-3A22	3A-6
 <b><u>第四章 -市場定位</u></b> .....			<b>401-409</b>
 <b><u>第五章 -交易所參與者資格的一般責任</u></b> .....			<b>5-1</b>
遵守規則	.....	501	5-1
交易所參與者的持續責任	.....	502	5-1
交易所參與者權利不得作			
信託	.....	503	5-2
(已刪除)	.....	504	
退任限制	.....	505	5-2

<u>標題</u>	.....	<u>規則編號</u>	<u>頁碼</u>
一般責任及通知本交易所及證監會的責任	.....	506-508A	5-3
交易所參與者的名稱	.....	5090	5-4
(已刪除)	.....	510	
交易所參與者的地址	.....	511	5-4
(已刪除)	.....	512	
(已刪除)	.....	513-514	
(已刪除)	.....	515-516	
業務及交易的一般操守	.....	517-522C	5-5
(已刪除)	.....	523-527	
負責人員及僱員	.....	527A-529	5-7
結算所參與者資格	.....	530	5-10
(已刪除)	.....	531-533	
專業會計師報告	.....	534	5-10
徵求資料	.....	535	5-12
審核	.....	536-538	5-12
保密性	.....	539	5-13

<b><u>第六章 -交易所參與者及其客戶</u></b>	.....		6-1
(已刪除)	.....	601 - 605	
客戶披露資料	.....	606	6-1
(已刪除)	.....	607-612	
綜合戶口	.....	613	6-1
(已刪除)	.....	614-615	
交易所參與者有關保證金的合約規定	.....	616	6-2
交易所參與者有關變價調整的合約規定	.....	616A	6-2
最低按金	.....	617	6-2
釐定變價調整	.....	617B	6-3
(已刪除)	.....	618	
監察補倉通知、變價調整要求及實物交收合約的交收責任	.....	619	6-3

(已刪除)	620-625	
<u>標題</u>	<u>規則編號</u>	<u>頁碼</u>
結算所戶口及執行代理	626	6-4
佣金	627	6-5
監察大額未平倉持倉	628	6-5
交易限制及持倉限制	629-630	6-5
超過持倉限制	631-632	6-7
以客戶為基礎的持倉無對沖 風險限額	632A	6-7
調高持倉限制	632B	6-8
證監會根據條例第 35(1)節規 定的合約限量及須申報的 持倉量	633	6-8
<b>第七章 - 紀律處分事宜</b>		7-1
引起紀律訴訟的情況	701	7-1
紀律處分權力	702	7-3
暫時吊銷資格的影響	703	7-4
撤銷資格	704	7-5
撤銷資格影響	705	7-6
對交易所參與者採取簡易程 序	706-707	7-6
對一名交易所參與者作出的 紀律處分行動	708-711	7-7
轉交指定監察部職員審理的 紀律處分事宜	712-716	7-8
轉交紀律委員會審理的紀律 處分事宜	717-718	7-9
紀律上訴委員會	719-721	7-10
上訴程序	722-726	7-10
合作	727	7-13
和解	728	7-13
自然公正原則	729	7-13
本交易所的責任	730	7-13
判決通知	731	7-13
過渡條文	732	7-14

<u>標題</u>	.....	<u>規則編號</u>	<u>頁碼</u>
<b><u>第八章 - 交易安排 - 慣例及系統</u></b>	.....		8-1
規例及交易限制	.....	801-802	8-1
營業時間	.....	803-804	8-1
(已刪除)	.....	805-807	
一般常規- HKATS 電子交易 系統	.....	807A	8-1
交易地點	.....	808	8-2
不得在交易時段外進行交易	.....	809	8-2
交易方式	.....	810	8-2
交易語言	.....	811	8-2
(已刪除)	.....	812-813	
與客戶指示/買賣盤相反的持 倉	.....	814	8-2
執行大手交易	.....	815-815D	8-2
(已刪除)	.....	816	
不得披露買賣盤	.....	817	8-6
禁止預先安排交易	.....	818	8-6
(已刪除)	.....	819 - 819A	
錯價交易	.....	819B	8-6
大宗錯價交易	.....	819BA - 819BB	8-7
錯誤交易	.....	819C	8-8
取消大手交易	.....	819D	8-8
交易違規事項	.....	820	8-9
交易系統	.....	821	8-9
(已刪除)	.....	822 - 824	
HKATS電子交易系統	.....	825	8-9
市場波動調節機制	.....	826-828	8-12
短暫停牌機制	.....	829	8-14
假期交易的交易所合約	.....	830 - 831	8-16
<b><u>第九章 - 緊急及特別情況</u></b>	.....	901 - 903	9-1
<b><u>第十章 - 已刪除</u></b>			

## 第十一章 - 已刪除

### 第十一 A 章 - 莊家 ..... 11A-1

引言	11A01 - 11A02	11A-1
申請莊家執照	11A03 - 11A06	11A-1
莊家執照的形式及期限	11A07 - 11A08	11A-2
莊家的持續義務	11A09 - 11A12	11A-2
暫停或修訂莊家的莊家規定	11A13 - 11A15	11A-2
暫時吊銷、撤銷及交回執照	11A16 - 11A19	11A-3

### 第十二章 - 自動電子交易系統 ..... 12-1

引言	1200	12-1
一般條文	1201	12-1
交易所活動一般條款	1202	12-2
聯通 HKATS 電子交易系統 及透過其進行交易	1203 - 1205	12-3
在 HKATS 電子交易系統中 設立指定風險監控	1205A - 1205D	12-3
未經授權使用 HKATS 電子 交易系統	1206 - 1206A	12-3
輸入買賣盤	1207 - 1208B	12-4
HKATS 電子交易系統的買賣 盤配對及排序	1209	12-4
買賣盤記錄	1210 - 1212	12-4
更改及取消買賣盤	1213	12-5
報價要求	1214	12-5
交易記錄	1215 - 1217	12-5
大手交易	1218	12-6
調整	1219	12-6
(已刪除)	1220	
責任限制	1221	12-6

### 第十三章 - 海外聯號參與者資格 ..... 1301 - 1309 13-1

### 第十四章 - 遠程聯通客戶 ..... 14-1

為客戶申請批准直接聯通 HKATS 電子交易系統 .....	1401 - 1403	14-1
條件 .....	1404	14-1
交易所一期貨結算所參與者 就有關遠程聯通客戶的責 任 .....	1405 - 1409	14-2
遠程聯通客戶在HKATS 電子 交易系統進行交易 .....	1410 - 1412	14-3
<b>第十五章 - 繳付費用及收費</b> .....		15-1
費用及收費 .....	1501	15-1
徵費 .....	1502	15-1
<b>第十六章 - 指定指數套戥交易及股票期貨對沖交易</b> .....		16-1
總則 .....	1601 - 1602	16-1
有關指定指數套戥交易的 「賣空價規則」豁免 .....	1603 - 1613	16-1
有關股票期貨對沖交易的 「賣空價規則」豁免 .....	1614 - 1619	16-3
<b>第十七章 - (已刪除)</b>		
----- 0 -----		
附錄 A - (已刪除)		A-1
附錄 B - 費用		A-2
目錄 1 - (已刪除)		S1-1
目錄 2 - (已刪除)		S2-1
目錄 3 - (已刪除)		S3-1
目錄 4 - (已刪除)		S4-1