

期權交易規則

第一章

定義及釋義

定義

101. 除文意另有所指外，在期權交易規則中，

「授權人士」

指期權買賣交易所參與者僱用或聘用可以聯通HKATS電子交易系統的人士，以及就經HKATS電子交易系統風險功能聯通HKATS電子交易系統以設立、監控及實施指定風險監控而言，授權人士可包括替該結算期權買賣交易所參與者（若屬非結算參與者）的交易進行結算的全面結算參與者就此委任的人士；

「HKATS電子交易系統風險功能」

指交易所要求各期權買賣交易所參與者安裝（若其為非結算參與者，則安排替其交易進行結算的全面結算參與者安裝）的HKATS軟件，用以為設置、監控及實施該交易所參與者的指定風險監控；

「HKATS電子交易系統使用者名稱」

指用以辨識能聯通HKATS電子交易系統的期權買賣交易所參與者或（就HKATS電子交易系統風險功能而言）聯交所期權結算所參與者身份的一組獨有的號碼及字符；

「指定風險監控」

指交易所及聯交所期權結算所可不時要求期權買賣交易所參與者及聯交所期權結算所參與者使用HKATS電子交易系統風險功能設立的指定監控及限制，經其接駁至或本交易所透過該交易所參與者批准任何接駁至HKATS電子交易系統連接，以及全面結算參與者（為非結算參與者的交易進行結算者）的非結算參與者的HKATS電子交易系統的連接又或交易所經由該非結算參與者授予的HKATS電子交易系統連接，所落買賣盤及執行交易的相關風險；

第五章

期權交易系統

505. ~~已刪除~~每名期權買賣交易所參與者任何時候均須設有安排，確保所有經其接駁至或本交易所透過該交易所參與者批准任何接駁至HKATS電子交易系統的買賣盤，均受指定風險監控及其他適當的風險監控及功能的規限。

在HKATS電子交易系統中設立指定風險監控

506. ~~已刪除~~在不影響規則第518B條下交易所權利的情況下，期權買賣交易所參與者（如屬非結算參與者，則為替其結算交易的全面結算參與者）須就期權買賣交易所參與者自身及其授權人士以及任何獲准經由期權買賣交易所參與者的連接或交易所經由期權買賣交易所參與者授予的連接，通過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。期權買賣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授權人士暫停或取消，包括（若其屬非結算參與者）被其全面結算參與者暫停或取消。

506A. 期權買賣交易所參與者須實施足夠程序，確保所有經其接駁至或透過該交易所參與者批准任何接駁至HKATS電子交易系統的人士均遵守適用於其的指定風險監控，並不會使用HKATS電子交易系統風險功能作指定風險監控以外用途。

506B. 期權買賣交易所參與者任何授權人士使用HKATS電子交易系統風險功能或交易所不時指定的其他功能執行買賣盤暫停或取消功能時，期權買賣交易所參與者須立即知會交易所。

506C. 期權買賣交易所參與者自行對就其所設置的指定風險監控負責。交易所、聯交所期權結算所及交易所的認可交易所控制人概不就該等指定風險監控的充分或有效性又或HKATS電子交易系統風險功能的任何失靈或無法使用或錯誤或缺失負任何責任。