

## 期權結算規則

### 第一章

#### 定義及釋義

##### 定義

101. 除文意另有所指外，在此等結算規則中：

- 「授權人士」 其含義與期權交易規則中所界定者相同；
- 「HKATS電子交易系統風險功能」 其含義與期權交易規則中所界定者相同；
- 「指定風險監控」 其含義與期權交易規則中所界定者相同；

### 第四章

#### 聯交所期權結算所參與者的責任

##### 持續責任

404. (1) 每名聯交所期權結算所參與者須自行（作為期權買賣交易所參與者）設置指定風險監控，每名全面結算參與者須為其替之結算的每名期權買賣交易所參與者設置指定風險監控，包括該名聯交所期權結算所參與者的授權人士或該名期權買賣交易所參與者的授權人士，以及任何獲准經該名聯交所期權結算所參與者或該名期權買賣交易所參與者的連接或獲交易所透過該名聯交所期權結算所參與者或該名期權買賣交易所參與者授予的任何連接，透過 HKATS 電子交易系統進行交易的其他人士。
- (2) 每名聯交所期權結算所參與者須向聯交所期權結算所提供不時要求的資料，以便聯交所期權結算所評估聯交所期權結算所參與者所設置的指定風險監控是否合理。
- (3) 凡聯交所期權結算所參與者授權人士使用 HKATS 電子交易系統風險功能或聯交所期權結算所不時指定的其他功能執行暫停或取消買賣盤功能，聯交所期權結算所參與者須立即知會聯交所期權結算所。

- (4) 每名聯交所期權結算所參與者須就其所設置的指定風險監控負責。聯交所期權結算所、交易所及認可交易所控制人概不就個別聯交所期權結算所參與者所設置的指定風險監控制的充分性或有效性、或 HKATS 電子交易系統風險功能、聯交所期權結算所參與者的 HKATS 電子交易系統之連接、或聯交所期權結算所或會提供予聯交所期權結算所參與者的指定風險監控相關報表、警告或通知出現的任何故障、無法使用、失誤或缺失負上任何責任。
- (5) 每名聯交所期權結算所參與者同意，使用 HKATS 電子交易系統風險功能僅為設立、監控及實施指定風險監控，而非作任何其他用途。每名聯交所期權結算所參與者須確保僅有其授權人士可透過 HKATS 電子交易系統風險功能連接 HKATS 電子交易系統。