

香港聯合交易所期權結算所有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

THE SEHK OPTIONS CLEARING HOUSE LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項： 有關農曆新年假期的風險管理安排 — **提示**

查詢： 2211-6901

本通告參照 2018 年 2 月 2 日發出的通告(編號：[CD/CDCRM/032/2018](#))，有關聯交所期權結算所就即將來臨的農曆新年假期所採取的風險管理措施。參與者謹請留意以下安排：

1. 股票期權類別的按金間距將於 **2018 年 2 月 14 日**營業時間結束後暫時提高。請參閱附錄有關各期權類別暫時提高的按金間距。按金間距將於 **2018 年 2 月 15 日**營業時間結束後恢復正常。
2. 結算所將在 **2018 年 2 月 15 日**約中午 12 時向聯交所期權結算所參與者的所有未平倉合約追收即日按金。

為協助參與者更有效評估其潛在按金影響，結算所已在香港交易所網站刊發模擬風險系數檔案，以便參與者估算按金要求。該模擬風險系數檔案乃根據 **2018 年 2 月 7 日**的結算價及暫時提高的按金水平編制。參與者可利用該模擬風險系數檔案估算其產品組合在暫時提高按金水平下的結算所按金要求及預計資金要求。參與者應留意，該模擬風險系數檔案**僅供參考**，不可代替每個營業日結束時用作計算實際日終按金要求的日終風險系數檔案。

結算所於評估以資本釐定的持倉限額及計算假期前交易日必要的額外按金時，將採用正常按金水平而非暫時提高的假期按金水平計算。故此結算所將在 **2018 年 2 月 14 日**營業時間結束後，於網站刊發載以正常按金水平釐定的風險系數檔案（「正常按金風險系數檔案」），以協助參與者監控其以資本釐定的持倉限額。

上述「模擬風險系數檔案」及「正常按金風險系數檔案」可在香港交易所網站下載：

http://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Clearing/Listed-Derivatives/Risk-Management/Reports-and-Data-Download/Simulated-RPF-for-Holiday-Margin/holidayrpf_feb18.zip

請確保閣下的員工完全知悉暫時提高按金間距及即日追收按金兩宗事項，並與閣下指定銀行作出必要安排。閣下應在適當的情況下預先通知客戶有關上述安排，並確保於假期期間向客戶收取足夠的按金金額。

香港聯合交易所期權結算所有限公司

授權簽署人

薛家傑 謹啟

附錄

股票期權名單	結算所按金率 截至 2 月 9 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF	5	8
瑞聲科技控股有限公司	10	14
安徽海螺水泥股份有限公司	9	12
友邦保險控股有限公司	5	8
中國鋁業股份有限公司	11	15
華夏滬深 300 指數 ETF	5	7
交通銀行股份有限公司	6	8
東亞銀行有限公司	5	5
中銀香港(控股)有限公司	5	7
比亞迪股份有限公司	8	12
中國交通建設股份有限公司	5	8
中國中煤能源股份有限公司	9	12
中遠海運控股股份有限公司	10	13
中國信達資產管理股份有限公司	8	9
中國廣核電力股份有限公司	5	6
中國移動有限公司	5	5
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	6	8
中國中信股份有限公司	8	8
長江和記實業有限公司	5	5
長江實業集團有限公司	8	8
中國人壽保險股份有限公司	6	9
中電控股有限公司	5	5
招商銀行股份有限公司	8	12
中國海洋石油有限公司	7	9
碧桂園控股有限公司	12	18
中國海外發展有限公司	9	13

股票期權名單	結算所按金率 截至 2 月 9 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
國泰航空有限公司	5	6
中國石油化工股份有限公司	6	9
中國太平洋保險 (集團) 股份有限公司	7	10
中國鐵建股份有限公司	5	7
中國中鐵股份有限公司	5	6
華潤置地有限公司	9	15
標智滬深 300 中國指數基金	5	7
CSOP 富時中國 A50 ETF	8	8
中國神華能源股份有限公司	8	11
中信銀行股份有限公司	9	13
中國電信股份有限公司	5	6
中信証券股份有限公司	11	14
東風汽車集團股份有限公司	6	8
思捷環球控股有限公司	11	13
中國恒大集團	11	16
富智康集團有限公司	8	8
廣州汽車集團股份有限公司	8	11
吉利汽車控股有限公司	9	13
銀河娛樂集團有限公司	7	9
長城汽車股份有限公司	8	10
海通証券股份有限公司	8	8
恒生 H 股指數上市基金	6	8
電能實業有限公司	5	5
香港交易及結算所有限公司	8	10
恒安國際集團有限公司	6	7
匯豐控股有限公司	5	5
香港中華煤氣有限公司	5	5
恒基兆業地產有限公司	5	7

股票期權名單	結算所按金率 截至 2 月 9 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
華能國際電力股份有限公司	8	8
恒生銀行有限公司	5	5
江西銅業股份有限公司	8	12
昆倫能源有限公司	8	10
金山軟件有限公司	10	14
聯想集團有限公司	8	8
利豐有限公司	6	9
領展房地產投資信託基金	5	5
中國蒙牛乳業有限公司	8	10
美高梅中國控股有限公司	9	11
中國民生銀行股份有限公司	8	9
香港鐵路有限公司	5	5
中國建材股份有限公司	11	16
新華人壽保險股份有限公司	8	10
新世界發展有限公司	5	7
中國平安保險(集團)股份有限公司	8	11
中國石油天然氣股份有限公司	7	11
中國人民財產保險股份有限公司	6	9
中國人民保險集團股份有限公司	8	12
保利協鑫能源控股有限公司	10	12
廣州富力地產股份有限公司	10	16
金沙中國有限公司	6	9
新鴻基地產發展有限公司	5	6
舜宇光學科技(集團)有限公司	11	15
渣打集團有限公司	5	8
融創中國控股有限公司	14	20
太古股份有限公司'A'	5	6
騰訊控股有限公司	8	11

股票期權名單	結算所按金率 截至 2 月 9 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
盈富基金	5	7
九龍倉集團有限公司	7	12
中國旺旺控股有限公司	7	10
中國農業銀行股份有限公司	7	11
中國銀行股份有限公司	7	10
中國建設銀行股份有限公司	8	11
中國工商銀行股份有限公司	7	10
兗州煤業股份有限公司	15	22
紫金礦業集團股份有限公司	13	19