

香港聯合交易所有限公司
(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

THE STOCK EXCHANGE OF HONG KONG LIMITED
(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項： 交易及結算運作安排 – 海底撈國際控股有限公司股票期權合約可能的資本調整 – 有條件以實物分派及分拆 (「建議分派」)

查詢： HKATS 熱線¹ 電話：2211-6360
DCASS 熱線 電話：2979-7222

海底撈國際控股有限公司 (「海底撈」) 建議宣佈以實物分派方式有條件向合資格股東派發本公司將有權擁有的所有特海國際控股有限公司 (「特海」) 股份，即佔當時將予發行的特海股份總數的90% (見於2022年7月29日海底撈發佈的通函) 及將特海建議分拆及於聯交所獨立上市。倘建議分派成為無條件，以下股票期權合約將根據所宣布的公司行動作出資本調整：

股票期權合約的正股名稱 (股票編號)	海底撈國際控股有限公司 (06862)
HKATS 代號	HDO
公司行動事宜	透過以實物方式分派，將特海股份分拆，並於聯交所獨立上市 (「權益」)
權益比例	稍後公布
除淨日	2022年12月16日
特海股份上市日	海底撈稍後公布

¹所有 HKATS 熱線之來電均會被錄音。有關本交易所的私隱政策聲明請參閱以下網址：

http://www.hkex.com.hk/chi/global/privacy_policy_c.htm

有關海底撈於 2022 年 7 月 11 日、7 月 13 日、7 月 29 日及 12 月 5 日關於建議分派所發放的公告 / 通告的詳細內容可經以下網址閱覽：

https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2022/0711/2022071100789_c.pdf

https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2022/0713/2022071301011_c.pdf

https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2022/0728/2022072801569_c.pdf

https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2022/1205/2022120501888_c.pdf

交易安排

1. 轉移未平倉倉盤

於除淨日之前一個營業日收市後，交易代碼 HDO 的海底撈股票期權系列的未平倉倉盤將以一對一比率**轉移**至臨時交易代碼 HDA。

2. 暫停交易

由於特海股份權益的價值有待確定，臨時交易代碼 HDA 的未平倉合約將由除淨日(即 2022 年 12 月 16 日)起至包括特海股份上市日(海底撈稍後公布)在內暫停買賣交易。

3. 推出新股票期權系列以作交易

於除淨日，新的海底撈股票期權系列將會以標準交易代碼 HDO 推出及以標準合約股數買賣。

4. 待特海價值確定後對未平倉合約進行的調整

特海股份的價值將採用成交量加權平均數 (VWAP) 計算，並只限於上市當日所有在聯交所以自動對盤的特海股份交易。當特海股份的價值得以確定，交易代碼 HDA 的未平倉合約倉盤將於上市當日收市後(海底撈稍後公布)作出調整，並轉移至交易代碼 HDB 進行交易。交易代碼 HDB 的倉盤會由特海股份上市日後的第一個營業日(海底撈稍後公布)開始交易。

有關海底撈股票期權系列交易代碼 HDO 的調整程序安排如下：

調整項目	計算程式	備註
調整比率 (AR)	$\frac{S(\text{首交易日})}{S(\text{首交易日}) + E(\text{首交易日})}$	以四捨五入取小數位後 4 個數字
經調整行使價 (AEP)	舊期權系列的行使價 × AR	以四捨五入取小數位後 2 個數字
調整合約張數 (ACS)	$(\text{舊期權系列的行使價} \times 1,000 \text{ 股}) / \text{AEP}$	以四捨五入取小數位後 4 個數字

註：

- S (首交易日) 為海底撈股份於分拆後首個交易日的成交量加權平均價(VWAP)；及
- E (首交易日) 指採用特海股份首個交易日成交量加權平均價(VWAP)計算的分拆權利價值。
- 權益為特海價值乘以海底撈每股的權益比例。

以下為所有海底撈股票期權合約交易安排之摘要:

合約	交易代碼	相關股票	合約張數 (股數)	推出日期	可供交易日期	除淨日或之後 新增股票期權 系列
標準	HDO	已除權益的 海底撈	1,000	除淨日	由除淨日起	有
調整	HDA	包含權益的 海底撈	1,000	除淨日	不適用	無
	HDB	已除權益的 海底撈	ACS	特海上市日後 的第一個營業 日	由推出日期 至稍後公布的 日期	

交易代碼 HDO 及 HDB 的海底撈股票期權之交易費用水平為類別 1，而總持倉限額為 100,000 張。

經調整的股票期權系列及標準的股票期權系列將以不同的交易代碼於 HKATS/DCASS 顯示。於除淨日前一個營業日收市後，有關經調整的股票期權系列及標準的股票期權系列將於 DCASS 的結算處理後於報表 TP011 顯示。

當資本調整（如有）作出後，所有合約調整將會是最終而具約束性的。合約調整後，即使公司行動建議其後被有關當局否決，包括但不限於監管機構和法院，已作出的資本調整亦不會還原。

交易所參與者要特別注意，於到期日調整後的股票期權系列及標準的股票期權系列的結算數額是按照其相應的合約張數計算。未平倉倉盤轉移至調整後的股票期權系列後，持倉數額及其他合約事項是不受影響的。

結算、交收及風險管理安排

標準的 HDO 股票期權系列及經調整的 HDA 及 HDB 股票期權系列之間倉盤對銷是不允許的。

有關備兌股份、股票期權行使及分配的結算與交收安排，詳情請參考附件。

通知有關員工及客戶

交易所參與者應通知所有持有上述股票期權未平倉合約的客戶，有關本通告所述交易及結算的詳細安排及附帶的風險。交易所參與者應與其客戶為未平倉合約轉移至臨時交易代碼 HDA 及其由除淨日起至包括特海上市日在內暫停買賣交易事宜將可能會持續一段時間作全面溝通。該建議分派是有條件及資本調整安排（以及其他條件外）須待特海成功上市方可作實。務請各參與者確保後勤系統能作出有關資本調整的配合。再者，當為客戶處理買賣以及提供諮詢時，小心處理有關標準及調整股票期權系列的交易及結算運作安排。

營運科

交易部

聯席主管

何耀昌 謹啟

本通告以英文及中文譯本刊發。如本通告中文本的字義或詞義與英文本有所出入，概以英文本為準。

結算、交收及風險管理安排

除淨日前

於除淨日前一個交易日或之前行使及分配 HDO 股票期權合約而出現的有待交收股票倉盤，將如常連權益在 CCASS 交收。

所有經備兌的 HDO 認購股票期權短倉將於除淨日之前一個營業日的日終按金計算程序後自動解除備兌。參與者可於除淨日利用除權後的海底撈股份對標準 HDO 股票期權系列進行備兌。

於除淨日至特海上市日期間

參與者不可利用除權後的海底撈股份對 HDA 股票期權合約進行備兌。

由除淨日 (即 2022 年 12 月 16 日) 至特海上市日(有待海底撈稍後公布)，參與者可透過衍生產品結算及交收系統如常自行輸入行使要求以行使 HDO 及 HDA 股票期權合約。然而，特海上市日之前的任何到期日，自動行使安排將不適用於現貨月 HDA 股票期權系列。

參與者應留意以下有關行使及分配 HDA 股票期權合約的交收安排：

- (a) 交收金額：透過 CCASS 按 HDA 股票期權合約行使價全額交收；
- (b) 海底撈股份部份：透過 CCASS 交收除權後的海底撈股份。HDA 股票期權合約的行使及分配結果，全額交收金額的交收責任及海底撈股份部份將於 DCASS 的交收及分配撮要報表(TP009)刊載；及
- (c) 權益部份(特海股份)：會按權益比率及特海的價值以現金交收。現金交收會延至特海之

價值確定後，並會於特海上市日後的第一個營業日交收。參與者應每日留意 TP009 估算將會以現金交收的特海股份數量。特海股份的現金交收資料會在 CCMS manual posting 的備註欄(包括股份數量及單價資料) 顯示。

海底撈在除淨日(即 2022 年 12 月 16 日)的開市價及除淨日前一交易日(即 2022 年 12 月 15 日)的收市價之差額¹會用於估算²權益的價值，以作為 HDA 股票期權合約每日的結算價及按金計算的根據。參與者應留意 HDA 股票期權合約倉盤按金將與標準 HDO 股票期權合約分開計算，因其相關股票不同³。

HDA 股票期權倉盤被行使或被分配後，對於持有有待現金結算的特海股份(即行使認沽期權或被分配認購期權)倉盤的參與者，由行使/分配當日的下一個營業日至權益結算日(即特海上市日之後一個營業日)，期權結算所將根據上述海底撈股份價格之差額對有待現金結算特海股份收取特別按金。上述特別按金會記錄於 CCMS 特別抵押品戶口內，期權結算所將向個別有關參與者發出收取/發放特別按金的通知。

由特海上市日後之第一個營業日起

行使及分配調整之交易代碼 HDB 股票期權系列會帶有碎股及分數股份，整數股份(包括碎股在內)將透過中央結算系統 CCASS 根據正常程序交收，而有關分數股份將在行使日透過 CCMS 以現金方式交收。實際分數股份的現金交收數額是以行使/分配日現貨市場收市價與行使價之差乘以分數股份數額。

若行使股票期權股份買賣確認單上只包括整數股份，以現金交收之分數股份是不需要繳交印花稅的。

行使及分配標準 HDO 股票期權系列，將按每張合約一手正股股份，根據正常程序透過中央結算系統 CCASS 交收。

¹ 若除淨日的開市價高於除淨日前一交易日的收市價，則會置為零。

² 期權結算所有權調整價值的估計。

³ HDA 股票期權合約的相關股票為海底撈及權益(即特海)，而 HDO 股票期權合約的相關股票為海底撈。

參與者可利用海底撈股份對調整後的 HDB 股票期權系列進行備兌。由於該等經調整後的股票期權系列將會帶有碎股及分數股份，參與者請注意，該等調整後的股票期權系列必需以準確的碎股股數作備兌用途。

HDO 及 HDB 股票期權合約將有共同的相關股票(即海底撈)，兩者之倉盤將按正常程序以組合基礎計算按金。