

## 期權買賣交易所參與者結算運作程序

### I. 期權結算運作程序引言

#### 1. 引言

#### 1.2 聯交所期權結算所辦事處

辦公時間為營業日上午九時至下午六時。

### V. 特別事件

#### 15. 颱風及暴雨

於八號或以上颱風訊號懸掛或卸下、或黑色暴雨警告發出或取消時，期權市場的交易將依照聯交所現貨市場的交易規則所述而運作。詳情請參閱交易所規則及《期權交易運作程序》。

在該等情況下，除非聯交所期權結算所董事會另有決定，否則有關本程序第4.1及4.3條所述的結算功能、現金交收、透過共同抵押品管理系統存入或提取現金、在聯交所期權結算所參與者的共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間轉移抵押品證券，以及股票交收程序的事宜，會按下文所述方式處理。

#### 15.1 結算功能

##### 15.1.1 颱風

- i. 倘香港天文台於營業日上午九時前懸掛八號或以上颱風訊號，而在同日中午十二時仍未卸下，結算功能不會於當日提供。
- ii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛，亦於同日中午十二時或之前卸下，所有結算功能將於兩小時後恢復。
- iii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時或以後懸掛，所有結算功能將繼續提供至訊號懸掛後兩小時暫停。

##### 15.1.2 暴雨

- i. 倘香港天文台於營業日上午九時前發出黑色暴雨警告，而在同日中午十二時仍未取消，結算功能不會於當日提供。
- ii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，亦於同日中午十二時或之前取消，所有結算功能會於兩小時後恢復。

- iii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時或以後發出，所有結算功能將如常提供，唯聯交所期權結算所或會視乎情況所需而暫停所有或部份結算及交收服務。

## 15.2 款項交收

就本節而言，所提述(i)每日交收通知及(ii)即日額外按金或大手交易特別按金通知，分別指根據《期權結算規則》第611(1)條聯交所期權結算所參與者須於營業日上午九時十五分或以前繳付有關款項，及聯交所期權結算所於營業日當日向聯交所期權結算所參與者發出的通知則必須於通知發出後一小時內繳付。

若向聯交所期權結算所參與者的儲備基金供款的到期日受八號或以上颱風訊號懸掛或卸下、或黑色暴雨警告發出或取消而影響，則有關交收程序將依照下文所述每日交收通知處理方式進行。

### 15.2.1 颱風

- i. 倘香港天文台於營業日上午九時前懸掛八號或以上颱風訊號而在中午十二時仍未卸下：
  - 一般而言，現金交收交易包括收取每日交收通知，即日額外按金及聯交所期權結算所參與者的現金存入或現金提取之交收將不會於當日進行。在該情況下，每日交收通知會於香港銀行業恢復向公眾提供服務的第一個營業日（「首個營業日」）到期；若首個營業日為整日銀行營業日，則最後到期繳付時間為上午九時十五分；若首個營業日並非整日銀行營業日，則有關款項須於香港銀行業提供服務時立即繳付；及
  - 由於共同抵押品管理系統不會於當日提供服務，該日將不會處理聯交所期權結算所參與者的現金存入或現金提取指示；聯交所期權結算所亦不會發出任何即日額外按金或大手交易特別按金通知。
- ii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛，亦於同日中午十二時或之前卸下：
  - 每日交收通知會於訊號卸下兩小時後到期繳付；
  - 一般而言，即日額外按金或大手交易特別按金通知（如有），將於訊號卸下兩小時後發出。即日額外按金或大手交易特別按金通知（如有），將與一般營業日相同，即於通知發出後一小時內到期繳付；及
  - 於當日正常截止時間上午十一時之前，透過共同抵押品管理系統輸入的現金存入或現金提取指示，將根據本程序第10.4條盡量處理，但須視乎相應銀行能否提供適當服務。

- iii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時或以後懸掛
- 聯交所期權結算所參與者須如常於同日上午九時十五分或以前繳付每日交收通知款項；
  - 於訊號懸掛前一小時或以前發出的任何即日額外按金或大手交易特別按金通知，將於有關即日額外按金或大手交易特別按金通知發出後一小時內到期繳付；
  - 至於當日正常截止時間上午十一時之前，透過共同抵押品管理系統輸入的現金存入或現金提取指示，將根據本程序第10.4條盡量處理聯交所期權結算所參與者現金存入或現金提取指示，但須視乎相應銀行能否提供適當服務；及
  - 在任何情況下，會於當日辦公時間結束前通知有關聯交所期權結算所參與者其指示能否按同日價值進行交收。

### 15.2.2 暴雨

- i. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，而在同日中午十二時仍未取消：
- 一般而言，現金交收交易包括收取每日交收通知、即日額外按金及聯交所期權結算所參與者的現金存入或現金提取之交收將不會於當日進行。在該情況下，每日交收通知會於香港銀行業恢復向公眾提供服務的第一個營業日（「首個營業日」）到期繳付；若首個營業日為整日銀行營業日，則最後到期繳付時間為上午九時十五分；若首個營業日並非整日銀行營業日，則有關款項須於香港銀行業提供服務時立即繳付；及
  - 由於共同抵押品管理系統不會於當日提供服務，該日將不會處理聯交所期權結算所參與者的現金存入或現金提取指示；交所期權結算所亦不會發出任何即日額外按金或大手交易特別按金通知。
- ii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，亦於同日中午十二時或之前取消：
- 每日交收通知會於警告取消兩小時後到期繳付；
  - 一般而言，出即日額外按金或大手交易特別按金通知（如有），將於警告取消兩小時後發出。即日額外按金或大手交易特別按金通知（如有），將與一般營業日相同，即於通知發出後一小時內到期；及

- 於當日正常截止時間上午十一時之前透過共同抵押品管理系統輸入的現金存入或現金提取指示，將根據本程序第10.4條盡量處理有關指示，但須視乎相應銀行能否提供適當服務。

- iii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時或以後發出，正常現金交收交易包括收取每日交收通知、即日額外按金及聯交所期權結算所參與者的現金存入或現金提取的交收將於當日如常進行。

### 15.3 聯交所期權結算所參與者要求在共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間轉移抵押品證券

#### 15.3.1 颱風

- i. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛，而在中午十二時仍未卸下，當日將不會處理任何於共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移指示。
- ii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛，亦於同日中午十二時或之前卸下，將盡量處理於共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移指示，但須視乎共同抵押品管理系統及中央結算系統能否提供適當服務。
- iii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時或以後懸掛，將盡量處理於共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移指示，但須視乎共同抵押品管理系統及中央結算系統能否提供適當服務。

#### 15.3.2 暴雨

- i. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，而在中午十二時仍未取消，當日將不會處理任何於共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移指示。
- ii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，亦於同日中午十二時或之前取消，將盡量處理於共同抵押品管理系統抵押品戶口與中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移指示，但須視乎共同抵押品管理系統及中央結算系統能否提供適當服務。
- iii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時或以後發出，所有共同抵押品管理系統服務包括抵押品證券轉移將如常提供。

### 15.4 股票交收

一般而言，倘營業日受颱風或暴雨影響，聯交所期權結算所的股票交收程序將遵照中央結算系統就相關市場的慣例。

#### 15.4.1 颱風

- i. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛，而在中午十二時仍未卸下，當日將不被視為交收股票的交收日。在該情況下，聯交所期權結算所將順延一個交收日，以便交收於兩個營業日前因行使或被指定分配而產生的待交收股票交易。
- ii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛，亦於同日中午十二時或之前卸下，該日將被視為交收股票的交收日，而交收程序會如常進行。
- iii. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時或以後懸掛，該日將被視為交收股票的交收日，而交收程序會如常進行。

#### 15.4.2 暴雨

- i. 在倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，而在同日中午十二時仍未取消，當日將不被視為交收股票的交收日。在該情況下，聯交所期權結算所將順延一個交收日，以便交收於兩個營業日前因行使或被指定分配而產生的待交收股票交易。
- ii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時前發出，亦於同日中午十二時或之前取消，該日將被視為交收股票的交收日，而交收程序會如常進行。
- iii. 倘黑色暴雨警告於營業日上午九時或以後發出，正常股票交收程序將於當日如常進行。