

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

辦公時間為營業日是星期一至星期五上午九時至下午一時及下午二時至下午六時。

V. 特別事件

15. 颱風及黑色暴雨

誠如交易所規則所述，於颱風八號或以上颱風訊號懸掛或卸下、接近及撤離及／或黑色暴雨警告發出或取消黑色暴雨警告時，期權市場的交易將依照與聯交所現貨市場的交易所規則所述而運作同步。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其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 颱風接近及／或發出黑色暴雨警告

- i. 倘香港天文台於營業日上午九時前任何時間懸掛八號或以上颱風訊號風球或發出黑色暴雨警告，而在同日中午十二時仍未卸下或取消，

當日將不能使用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. 倘上午十時或之後懸掛八號或以上颱風訊號風球於營業日上午九時或以後懸掛或發出黑色暴雨警告

若為八號風球，則可在風球懸掛後兩小時內使用所有結算功能將繼續提供至訊號懸掛後兩小時暫停。若為黑色暴雨警告，則可如正常營業日般繼續使用結算功能。

15.1.2 ~~颱風撤離及／或取消黑色暴雨警告~~

- 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. ~~在交易日中午十二時或之前卸下八號風球或取消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。~~

~~於卸下八號風球或取消黑色暴雨警告兩小時後，將可使用所有結算功能。~~

- 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。在中午十二時之後任何時間卸下八號風球或取消黑色暴雨警告~~

~~當日將不能使用結算功能。~~

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追補通知三詞，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在不遲於一個交易營業日上午九時十五分或以前繳付有關交收的聯交所期權結算所參與者欠款項，以及因在一個交易日上午九時至下午四時任何時間，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須在一小時內交收款項的追補通知則必須於通知發出後一小時內繳付而導致的聯交所期權結算所參與者的欠款。

若向聯交所期權結算所參與者追補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、是在受颱風及／或黑色暴雨警告發出或取消而事件影響的交易日到期交收，則有關交收程序將依照與下文所述每日交收通知相同的方式處理方式進行。

15.2.1 ~~颱風接近及／或發出黑色暴雨警告~~

- i. ~~倘香港天文台於營業日上午九時十五分或之前懸掛八號或以上颱風訊號風球或發出黑色暴雨警告，而在中午十二時或之前仍未卸下或取消：~~

~~一般而言，現金交收交易包括當日不會收取每日交收通知款項，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，每日交收通知款項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」）到期收取；若首個營業日為整全日是銀行營業日，則最後到期繳付交收時間為不得遲於上午九時十五分；若首個營業日並非整日全日均不是銀行營業日，則有關款項須於香港銀行業在提供銀行服務時立即繳付交；及收。~~

- ~~由於不能~~使用共同抵押品管理系統不會於當日提供服務，因此該日將不會處理聯交所期權結算所參與者提出的現金存入或現金提取指示要求；~~一~~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追補通知。
- 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十五分之或以後但於上午十時之前懸掛八號風球或發出黑色暴雨警告，而在中午十二時或之前仍未卸下或取消
 - 將如常收取每日交收款項，而聯交所期權結算所參與者須如常於同日不遲於上午九時十五分或以前繳付到期交每日交收通知收追補款項；~~一~~

由於不能使用共同抵押品管理系統，因此該日不會處理聯交所期權結算所參與者提出的現金存入或現金提取要求。聯交所期權結算所亦不會發出任何即日按金或大手交易特別按金追補通知。
- iii. ~~上午十時或之後懸掛八號風球或發出黑色暴雨警告~~
 - ~~於訊號懸掛八號風球或發出黑色暴雨警告前一小時或以前~~發出的任何即日額外按金或大手交易特別按金追補通知，將於發出有關即日額外按金或大手交易特別按金追補通知發出後一小時內到期繳付；~~交收款項。~~
 - 至於在當日正常截止時間上午十一時之前，提交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要求，聯交所期權結算所參與者就有關現金存入或現金提取要求的交收，會將根據本程序第10.4條盡量力處理聯交所期權結算所參與者現金存入或現金提取指示，但須會視乎相應銀行能否提供適當用的服務；~~及一~~
 - 在任何情況下，會於在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要求是否可按同日價值進行交收。

15.2.2 颱風撤離或取消黑色暴雨警告

- 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. 在交易日中午十二時或之前卸下八號風球或取消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：
 - 於卸下八號風球或取消黑色暴雨警告兩小時後，每日交收通知會於警告取消兩小時後到期繳付；追補款項便會生效及到期交收。
 - 一般而言，於卸下八號風球或取消黑色暴雨警告後兩小時內，不會發出即日額外按金或大手交易特別按金追補通知（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追補通知（如有）一旦發出，將與一般營業日相同，即於在發出追補通知發出後一小時內到期；及交收款項，猶如追補通知是在正常交易日發出一般。
 - 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提交的現金存入或現金提取指示要求，將會根據本程序第10.4條盡量處理有關指示交收，但須會視乎相應銀行能可否提供適當用的服務。
- iii. 在交易日中午十二時之後卸下八號風球或取消倘黑色暴雨警告於營業日上午九時或以後發出，正常
 - 當日不會處理現金交收交易（包括收取每日交收通知追補款項、即日額外按金款項）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 颱風接近及發出黑色暴雨警告

- i. 倘上午十時之前懸掛八號或以上颱風訊號於營業日上午九時前懸掛風球或發出黑色暴雨警告，而在中午十二時或之前仍未卸下，或取消

——當日將不會處理任何於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其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. 上午十時或之後懸掛倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時或以後懸掛風球或發出黑色暴雨警告，

——會將盡量處理在聯交所期權結算所參與者的於共同抵押品管理系統抵押品戶口與其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的服務。

15.3.2 颱風撤離或取消黑色暴雨警告

- 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。在交易日中午十二時或之前卸下八號風球或取消黑色暴雨警告

——會盡量處理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其中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移，但會視乎共同抵押品管理系統及中央結算系統可否提供適用的服務。

- 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在交易日中午十二時之後卸下八號風球或取消黑色暴雨警告

——當日不會處理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

口與其中央結算系統股票戶口之間抵押品證券的轉移。

15.4 股票交收

一般而言，倘營業日受在颱風或黑色暴雨影响情況下，聯交所期權結算所的股票交收程序將會遵照中央結算系統就相關市場的慣例。

15.4.1 颱風接近及發出黑色暴雨警告

- i. 倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時三十分之前懸掛，八號風球而在中午十二時仍未卸下，或上午九時之前發出黑色暴雨警告而在中午十二時之前仍未取消

~~該交易當日將不被視為交收股票交收的交收日。在該情況下，聯交所期權結算所會將順延一個交收日，以便交收因在該日前於兩個營業交易日前因執行行使或被指定分配交易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. 上午九時三十分或之後懸掛倘八號或以上颱風訊號於營業日上午九時或以後懸掛，風球或上午九時或之後發出黑色暴雨警告

~~該交易日將會被視為交收股票交收的交收日，而交收程序會如正常進行營業日般執行。~~

15.4.2 颱風撤離或取消黑色暴雨警告

- i. ~~在交易日中午十二時或之前卸下八號風球或取消黑色暴雨警告~~

~~該交易日會被視為股票交收的交收日，而交收程序會如正常營業日般執行。~~

- ii. 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，當在交易日中午十二時之後卸下八號風球或取消黑色暴雨警告。

~~該交易日將不被視為股票交收的交收日。在該情況下，聯交所期權結算所將會順延一個交收日，以便交收因在該日前於兩個營業交易日前因執行行使或被指定分配交易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。