

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： 推出阿里巴巴集團控股有限公司股票期權

查詢： 陳先生 (電話: 2211-6139 電郵: wallacechan@hkex.com.hk)
盧小姐 (電話: 2211-6137 電郵: floralo@hkex.com.hk)

香港聯合交易所有限公司 (“交易所”) 將推出阿里巴巴集團控股有限公司 (“阿里巴巴”) 股票期權合約。若相關股票成功上市，新股票期權將於 **2019 年 11 月 26 日(星期二)** (“開始交易日”) 同日推出：

正股名稱 (股票編號)	HKATS 代號	合約買賣 單位 (股數)	最低價格波幅 (港元)	正股買賣 單位倍數	期貨 類別	交易費 用 (港幣)	於開始交易日供交 易的合約月份
阿里巴巴 (9988)	ALB	500	\$0.01	5	1	\$3	2019 年: 12 月 ; 2020 年: 1 月、2 月、3 月、6 月及 9 月

有關可供買賣的股票期權名單已編列於本通告的附件一以供參考。合約細則的詳情請參閱交易所規則附錄一。合約細則的詳情請參閱附錄 B 中交易所參與者期權交易流程 (期權合約細則) 。

行使價

為給予投資者更多選擇，交易所在開始交易日將提供港幣 187.5 (即最接近最高正股發售價港幣 188 元之行使價) 之上的 12 個行使價和之下的 12 個行使價作交易(請參閱附件二)。在開始交易日以後，新增的行使價將按期權交易運作程序而釐定。

持倉限額

阿里巴巴股票期權的持倉限額為任何一個市場方向內所有月份未平倉合約合計均不得超越 50,000 張。

市場莊家

交易所現邀請申請市場莊家。有興趣申請者可聯絡關先生(CharlesKwan@hkex.com.hk)、黃小姐 (EmilyHuang@hkex.com.hk) 或薛先生 (EdwardSit@hkex.com.hk) 取得申請詳情。

在推出的首兩星期 (即 2019 年 11 月 26 日至 2019 年 12 月 9 日)，莊家的最大買賣盤差價責任要求將擴寬為原來的兩倍。

於開始交易日至 2019 年 11 月 28 日將提供 6 個合約月份以供交易，2019 年 12 月份合約將定為即月合約 (即不設最後第三個季度月份)。在此期間，市場莊家須於指定 6 個交易月份內選取指定行使價系列提供買賣價。於 2019 年 11 月 29 日及之後將回復提供 7 個交易月份。

推出前安排

以下推出前的安排將於 **2019 年 11 月 25 日(星期一)** (即開始交易日的前一個營業日)實施：

- 甲. 新股票期權類別的股票期權系列將被顯示，但尚未能交易；及
- 乙. 新股票期權類別的按金計算風險系數檔案、結算及未平倉合約報表亦會開始產生。

在開始交易日前一個營業日提供風險系數檔案的用途是協助參與者預算在開始交易日新推出的股票期權類別的按金要求。

請注意，上述於開始交易日前一個營業日發放的風險系數檔案內的按金要求未必和開始交易日所發放的一樣。因此，香港交易所及其附屬公司對風險系數檔案使用者因使用該檔案而引起的任何損失不會承擔任何責任。參與者若有意應用以上風險系數檔案，需要更新其 PC-SPAN 參數設定檔案。詳情請參閱結算所在隨後發出的通告。

交易資訊

由資訊供應商提供的股票期權類別訊息代碼將適用於交易所網站發放。

通知有關員工及客戶

交易所參與者請通知有興趣的客戶有關阿里巴巴股票期權的推出，**特別注意合約買賣單位是正股買賣單位的倍數**。參與者應確保後勤系統就交易上述新股票期權準備就緒。同時，參與者的員工應清楚理解以上內容，謹慎小心地處理相關期權買賣及向客戶提供建議。

投資者請留意個別的股票期權可能沒有市場莊家。市場莊家參與的情況會因應其登記情況而不時改變。最新的股票期權名單及其有否市場莊家會不時於[交易所網站](#)更新。投資者應小心買賣沒有市場莊家登記的股票期權及明白其涉及的流動風險。投資者於開倉或平倉股票期權時，會與不同價格方向取態的投資者進行交易。

市場科

證券產品發展部

聯席主管

蕭沛聰 謹啟

本通告已以英文及另以中文譯本刊發。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。

附件一

可供買賣的股票期權類別名單

甲. 股票期權類別的合約買賣單位多於一手正股股數

號數	股票 編號	正股名稱	HKATS 代號	合約買賣 單位 (股數)	正股買 賣單位 倍數	期權 類別*	持倉限額 (合約張數)
1	16	新鴻基地產發展有限公司	SHK	1,000	2	1	50,000
2	175	吉利汽車控股有限公司	GAH	5,000	5	1	50,000
3	788	中國鐵塔股份有限公司	XTW	10,000	5	2	150,000
4	823	領展房地產投資信託基金	LNK	1,000	2	1	50,000
5	1099	國藥控股股份有限公司	SNP	800	2	1	50,000
6	1113	長江實業地產有限公司	CKP	1,000	2	1	50,000
7	1288	中國農業銀行股份有限公司	XAB	10,000	10	1	100,000
8	1299	友邦保險控股有限公司	AIA	1,000	5	1	150,000
9	1336	新華人壽保險股份有限公司	NCL	1,000	10	1	50,000
10	1339	中國人民保險集團股份有限公司	PIN	5,000	5	2	50,000
11	1359	中國信達資產管理股份有限公司	CDA	5,000	5	2	50,000
12	1658	中國郵政儲蓄銀行股份有限公司	XPB	5,000	5	1	50,000
13	1810	小米集團	MIU	1,000	5	2	150,000
14	1816	中國廣核電力股份有限公司	CGN	10,000	10	2	50,000
15	1876	百威亞太控股有限公司	BUD	1,000	10	1	50,000
16	1918	融創中國控股有限公司	SUN	2,000	2	1	100,000
17	1988	中國民生銀行股份有限公司	MSB	2,500	5	2	50,000
18	2007	碧桂園控股有限公司	COG	5,000	5	1	50,000
19	2018	瑞聲科技控股有限公司	AAC	1,000	2	1	50,000
20	2202	萬科企業股份有限公司	VNK	1,000	10	1	50,000
21	2238	廣州汽車集團股份有限公司	GAC	4,000	2	1	50,000
22	2382	舜宇光學科技(集團)有限公司	SNO	2382	10	1	50,000

23	2601	中國太平洋保險(集團)股份有限公司	CPI	1,000	5	1	100,000
24	2822	CSOP 富時中國 A50 ETF	CSA	5,000	25	1	50,000
25	2823	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF	A50	5,000	50	1	50,000
26	2828	恒生 H 股指數上市基金	HCF	1,000	5	1	50,000
27	3188	華夏滬深 300 指數 ETF	AMC	2,000	10	1	50,000
28	3333	中國恒大集團	EVG	2,000	2	1	100,000
29	3690	美團點評	MET	500	5	1	50,000
30	6030	中信證券股份有限公司	CTS	1,000	2	2	100,000
31	6837	海通證券股份有限公司	HAI	2,000	5	2	50,000
32	9988	阿里巴巴集團控股有限公司^	ALB	500	5	1	50,000

乙. 股票期權的合約買賣單位等於一手正股股數

號數	股票 編號	正股名稱	HKATS 代號	合約買賣 單位(股數)	期權類別 *	持倉限額 (合約張數)
1	1	長江和記實業有限公司	CKH	500	1	50,000
2	2	中電控股有限公司	CLP	500	1	50,000
3	3	香港中華煤氣有限公司	HKG	1,000	2	100,000
4	4	九龍倉集團有限公司	WHL	1,000	2	50,000
5	5	匯豐控股有限公司	HKB	400	1	150,000
6	6	電能實業有限公司	HEH	500	1	50,000
7	11	恒生銀行有限公司	HSB	100	2	100,000
8	12	恒基兆業地產有限公司	HLD	1,000	1	50,000
9	17	新世界發展有限公司	NWD	1,000	2	100,000
10	19	太古股份有限公司'A'	SWA	500	1	50,000
11	23	東亞銀行有限公司	BEA	200	3	50,000
12	27	銀河娛樂集團有限公司	GLX	1,000	1	100,000
13	66	香港鐵路有限公司	MTR	500	2	50,000
14	135	昆倫能源有限公司	KLE	2,000	2	50,000
15	151	中國旺旺控股有限公司	WWC	1,000	3	100,000

號數	股票 編號	正股名稱	HKATS 代號	合約買賣 單位 (股數)	期權類別 *	持倉限額 (合約張數)
16	267	中國中信股份有限公司	CIT	1,000	2	50,000
17	293	國泰航空有限公司	CPA	1,000	2	50,000
18	358	江西銅業股份有限公司	JXC	1,000	3	50,000
19	386	中國石油化工股份有限公司	CPC	2,000	2	150,000
20	388	香港交易及結算所有限公司	HEX	100	2	150,000
21	390	中國中鐵股份有限公司	CRG	1,000	3	150,000
22	489	東風汽車集團股份有限公司	DFM	2,000	2	50,000
23	494	利豐有限公司	LIF	2,000	3	100,000
24	688	中國海外發展有限公司	COL	2,000	1	50,000
25	700	騰訊控股有限公司	TCH	100	1	150,000
26	728	中國電信股份有限公司	CTC	2,000	3	150,000
27	753	中國國際航空股份有限公司	AIR	2,000	2	50,000
28	762	中國聯合網絡通信 (香港) 股份有限公司	CHU	2,000	2	100,000
29	857	中國石油天然氣股份有限公司	PEC	2,000	2	150,000
30	883	中國海洋石油有限公司	CNC	1,000	2	150,000
31	902	華能國際電力股份有限公司	HNP	2,000	2	100,000
32	914	安徽海螺水泥股份有限公司	ACC	500	2	150,000
33	939	中國建設銀行股份有限公司	XCC	1,000	3	150,000
34	941	中國移動有限公司	CHT	500	1	150,000
35	992	聯想集團有限公司	LEN	2,000	3	150,000
36	998	中信銀行股份有限公司	CTB	1,000	3	150,000
37	1044	恒安國際集團有限公司	HGN	500	1	50,000
38	1088	中國神華能源股份有限公司	CSE	500	3	150,000
39	1093	石藥集團有限公司	CSP	2,000	1	150,000
40	1109	華潤置地有限公司	CRL	2,000	1	50,000
41	1171	兗州煤業股份有限公司	YZC	2,000	2	50,000

號數	股票 編號	正股名稱	HKATS 代號	合約買賣 單位(股數)	期權類別 *	持倉限額 (合約張數)
42	1186	中國鐵建股份有限公司	CRC	500	3	150,000
43	1211	比亞迪股份有限公司	BYD	500	2	50,000
44	1398	中國工商銀行股份有限公司	XIC	1,000	3	150,000
45	1800	中國交通建設股份有限公司	CCC	1,000	3	150,000
46	1898	中國中煤能源股份有限公司	CCE	1,000	3	50,000
47	1928	金沙中國有限公司	SAN	400	2	150,000
48	2282	美高梅中國控股有限公司	MGM	400	3	150,000
49	2318	中國平安保險(集團)股份有限公司	PAI	500	1	150,000
50	2319	中國蒙牛乳業有限公司	MEN	1,000	1	100,000
51	2328	中國人民財產保險股份有限公司	PIC	2,000	2	150,000
52	2333	長城汽車股份有限公司	GWM	500	3	150,000
53	2388	中銀香港(控股)有限公司	BOC	500	2	150,000
54	2600	中國鋁業股份有限公司	ALC	2,000	3	100,000
55	2628	中國人壽保險股份有限公司	CLI	1,000	2	150,000
56	2777	廣州富力地產股份有限公司	RFP	400	3	100,000
57	2800	盈富基金	TRF	500	2	150,000
58	2888	渣打集團有限公司	STC	50	3	150,000
59	2899	紫金礦業集團股份有限公司	ZJM	2,000	3	100,000
60	3323	中國建材股份有限公司	NBM	2,000	2	150,000
61	3328	交通銀行股份有限公司	BCM	1,000	3	150,000
62	3888	金山軟件有限公司	KSO	1,000	2	50,000
63	3968	招商銀行股份有限公司	CMB	500	2	150,000
64	3988	中國銀行股份有限公司	XBC	1,000	3	150,000

^ 將於2019年11月26日起進行買賣

* 除非另有規定，調整合約的期權類別與標準合約相同

開始交易日可供交易的股票期權行使價列表

行使價(HK\$)

157.5
160.0
162.5
165.0
167.5
170.0
172.5
175.0
177.5
180.0
182.5
185.0
187.5
190.0
192.5
195.0
197.5
200.0
205.0
210.0
215.0
220.0
225.0
230.0
235.0