

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： 有關結算規則之責任的指引¹

查詢：surveillance@hkex.com.hk

為持續提高市場參與者對規則和規例的理解，香港聯合交易所期權結算所有限公司（「期權結算所」）現就期權結算所參與者的持續責任發出指引。根據《期權結算規則》，若期權結算所參與者的資料有任何更改，其須通知期權結算所。

根據近期對參與者遵守相關結算所規則和要求的審查，期權結算所觀察到不少期權結算所參與者未有通知期權結算所其在獲接納為參與者時及往後的資料更改，當中包括但不限於：

- (1) 其日常運作（即追加保證金及款項結算、衍生產品結算及交收系統日間/夜間運作及衍生產品結算、及交收系統資訊科技日間/夜間）的主要聯絡人；及/或
- (2) 其在從事新業務時更新的風險和監控文件，例如自營交易。

就此而言，期權結算所謹此提醒參與者注意以下事項：

- 根據《期權結算規則》第403(17)條，各期權結算所參與者在任何時候，均須將其獲接納為期權結算所參與者時及其後向期權結算所提供的資料的任何更改，通知期權結算所。該更改包括但不限於任何有關該期權結算所參與者本身、其董事或僱員資料的更改，而有關更改將導致該期權結算所參與者之前已遞交給期權結算所的聲明或資料失確、不完整，或使其取代該期權結算所參與者之前已遞交的聲明或資料。

¹ 除文義另有所指外，本通函所用詞彙及縮寫與《期權結算規則》所界定者俱有相同涵義。

期權結算所謹此提醒各參與者:

- 應制定適當的監控措施（包括足夠的政策和程序以及工作流程），以確保及時向期權結算所發出其任何資料更改的通知，包括但不限於更改日常運作主要聯絡人的資料或更新的風險和監控資料文件；及
- 如有任何違反《期權結算規則》或期權結算所批准的任何條件的情況，應通知期權結算所。

期權結算所強烈建議期權結算所參與者檢討其當前政策，實施適當措施以加強監控，並在必要時採取適當行動處理任何潛在的不當或違規行為。任何未能遵守相關結算所規則下之責任的行為可能會受到期權結算所的潛在紀律行動，包括罰款或紀律程序。

如期權結算所參與者對上述事項有任何疑問，請聯絡市場監察部（電郵：surveillance@hkex.com.hk）。

營運科

市場監察部主管

王秉厚 謹啟

本通告以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本與英文本有所出入，概以英文本為準。