

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： 有關復活節假期的風險管理安排 — **提示**

查詢： 2211-6901

本通告參照 2024 年 3 月 15 日發出的通告(編號：[CD/CDCRM/065/2024](#))，有關聯交所期權結算所就即將來臨的復活節假期所採取的風險管理措施。參與者謹請留意以下安排：

- 股票期權類別的按金間距將於 **2024 年 3 月 27 日**營業時間結束後暫時提高。請參閱附錄有關各期權類別暫時提高的按金間距。按金間距將於 **2024 年 3 月 28 日**營業時間結束後恢復正常。
- 結算所將在 **2024 年 3 月 28 日**約下午 3 時向聯交所期權結算所參與者的所有未平倉合約追收即日按金。

參與者可電郵至 RMinquiry@hkex.com.hk 索取模擬風險系數檔案，用作協助估算按金要求。

結算所於評估以資本釐定的持倉限額及計算假期前交易日必要的額外按金時，將採用正常按金水平而非暫時提高的假期按金水平計算。故此結算所將在 **2024 年 3 月 27 日**營業時間結束後，於網站刊發載以正常按金水平釐定的風險系數檔案（「正常按金風險系數檔案」），以協助參與者監控其以資本釐定的持倉限額。

上述「正常按金風險系數檔案」可在香港交易所網站下載：

http://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Clearing/Listed-Derivatives/Risk-Management/Reports-and-Data-Download/Simulated-RPF-for-Holiday-Margin/holidayrpf_Mar24.zip

請確保閣下的員工完全知悉暫時提高按金間距及即日追收按金兩宗事項，並與閣下指定銀行作出必要安排。閣下應在適當的情況下預先通知客戶有關上述安排，並確保於假期期間向客戶收取足夠的按金金額。

結算所特別提醒閣下於假期前後的正常交收日，必須有適當的安排。如有主要員工因假期而缺席，請確保後備員工熟悉有關的營運與監控程序，使閣下能夠充分地監控風險及按時履行由結算所發出的款項責任。根據期權結算所規則第 701 條，參與者若不能於指定時限內履行由結算所發出的款項責任將會構成失責事件。請參閱於 2024 年 3 月 7 日發出的通告（編號：[CD/CDCRM/056/2024](#)），詳細了解有關參與者的款項責任以及延遲或不能履行款項責任的後果。

香港聯合交易所期權結算所有限公司

授權簽署人

戴嘉欣 謹啟

附錄

股票期權名單	結算所按金率 截至 3 月 22 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF	5	5
瑞聲科技控股有限公司	10	13
安徽海螺水泥股份有限公司	6	8
友邦保險控股有限公司	7	11
中國國際航空股份有限公司	7	9
阿里巴巴集團控股有限公司	8	10
中國鋁業股份有限公司	10	13
阿里健康信息技術有限公司	11	14
華夏滬深 300 指數 ETF	5	5
安踏體育用品有限公司	8	11
交通銀行股份有限公司	5	6
東亞銀行有限公司	5	7
百度集團股份有限公司	9	11
嗶哩嗶哩股份有限公司	13	19
中銀香港(控股)有限公司	5	6
百威亞太控股有限公司	9	12
比亞迪股份有限公司	8	11
比亞迪電子(國際)有限公司	11	13
中國交通建設股份有限公司	6	7
中國中煤能源股份有限公司	8	11
中國信達資產管理股份有限公司	8	10
中國廣核電力股份有限公司	6	8
中國移動有限公司	5	5
中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	7	8
中國中信股份有限公司	8	9
長江和記實業有限公司	5	6

股票期權名單	結算所按金率 截至 3 月 22 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
長江實業地產有限公司	8	8
中國人壽保險股份有限公司	7	10
中電控股有限公司	5	6
招商銀行股份有限公司	7	10
中國海洋石油有限公司	7	8
碧桂園控股有限公司	14	18
中國海外發展有限公司	10	13
中遠海運控股股份有限公司	9	9
國泰航空有限公司	6	7
中國石油化工股份有限公司	5	7
中國太平洋保險(集團)股份有限公司	9	12
中國鐵建股份有限公司	6	8
中國中鐵股份有限公司	7	9
華潤置地有限公司	11	14
CSOP 富時中國 A50 ETF	8	8
中國神華能源股份有限公司	6	8
石藥集團有限公司	8	10
中信銀行股份有限公司	5	5
中國電信股份有限公司	5	7
中信証券股份有限公司	8	9
東風汽車集團股份有限公司	14	16
中國恒大集團	20	25
廣州汽車集團股份有限公司	7	9
吉利汽車控股有限公司	7	8
信義玻璃控股有限公司	9	13
江西贛鋒鋰業集團股份有限公司	14	17
銀河娛樂集團有限公司	7	9
長城汽車股份有限公司	8	10

股票期權名單	結算所按金率 截至 3 月 22 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
海通證券股份有限公司	8	8
恒生中國企業指數上市基金	6	8
海底撈國際控股有限公司	12	15
電能實業有限公司	5	5
香港交易及結算所有限公司	8	9
恒安國際集團有限公司	7	9
匯豐控股有限公司	5	5
香港中華煤氣有限公司	6	7
恒基兆業地產有限公司	7	9
華能國際電力股份有限公司	8	11
恒生銀行有限公司	6	9
信達生物製藥	13	16
京東集團股份有限公司	11	16
京東健康股份有限公司	12	14
江西銅業股份有限公司	8	11
金蝶國際軟件集團有限公司	11	14
昆倫能源有限公司	8	8
金山軟件有限公司	9	13
快手科技	10	13
理想汽車	16	23
聯想集團有限公司	10	12
李寧有限公司	13	17
領展房地產投資信託基金	5	6
中國蒙牛乳業有限公司	10	13
美團	11	16
美高梅中國控股有限公司	8	11
小米集團	10	13
洛陽樂川鋁業集團股份有限公司	9	14

股票期權名單	結算所按金率 截至 3 月 22 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
中國民生銀行股份有限公司	5	6
香港鐵路有限公司	6	8
中國建材股份有限公司	9	11
新華人壽保險股份有限公司	8	10
農夫山泉股份有限公司	5	6
網易	10	12
新世界發展有限公司	10	14
中國平安保險(集團)股份有限公司	8	11
中國石油天然氣股份有限公司	6	8
小鵬汽車有限公司	14	18
平安健康醫療科技有限公司	12	16
中國人民財產保險股份有限公司	6	9
中國人民保險集團股份有限公司	8	8
金沙中國有限公司	7	10
中國生物製藥有限公司	9	12
商湯集團股份有限公司	19	19
新鴻基地產發展有限公司	5	7
信義光能控股有限公司	16	22
申洲國際集團控股有限公司	8	10
中芯國際集成電路製造有限公司	11	11
舜宇光學科技(集團)有限公司	13	16
國藥控股股份有限公司	7	9
融創中國控股有限公司	15	20
太古股份有限公司 A	6	8
騰訊控股有限公司	7	9
創科實業有限公司	9	10
盈富基金	5	7
攜程集團有限公司	7	10

股票期權名單	結算所按金率 截至 3 月 22 日 (%)	暫時提高的 結算所按金率 (%)
萬科企業股份有限公司	12	16
微博股份有限公司	11	15
萬洲國際有限公司	6	8
九龍倉集團有限公司	8	10
中國旺旺控股有限公司	5	6
藥明生物技術有限公司	23	30
中國農業銀行股份有限公司	5	5
中國銀行股份有限公司	5	5
中國建設銀行股份有限公司	5	6
中國工商銀行股份有限公司	5	5
中國郵政儲蓄銀行股份有限公司	5	7
中國鐵塔股份有限公司	8	11
兗礦能源集團股份有限公司	9	12
眾安在綫財產保險股份有限公司	11	15
紫金礦業集團股份有限公司	8	12
中升集團控股有限公司	12	14