

期權交易規則

第四章

期權交易所參與者及其客戶

持倉限額

- 436A. 儘管有上述的規定，交易所不時根據期權交易規則第 435、436 或 438 條訂定的持倉限額，不得比證監會根據《證券及期貨條例》第 35(1) 條訂定的限額寬鬆，除非有關期權交易所參與者本身屬《證券及期貨（合約限額及須申報的持倉量）規則》第 4A 條所指的人士又或有關持倉是替該等人士持有；如屬該等情況，交易所可授權期權交易所參與者持有超逾證監會訂明持倉上限而其認為適當的合約數目。此外，倘期權交易所參與者或有關人士獲證監會根據《證券及期貨（合約限額及須申報的持倉量）規則》第 4(3) 分條授權，並以書面通知交易所已獲證監會授權，則期權交易所參與者可為本身或該人持有超逾交易所不時訂定的持倉限額。

第六章

莊家

持有莊家持倉的莊家聯屬公司（「莊家聯屬公司」）的風險監控

- 614E. 第 614F、614G 及 614H 條適用於透過符合本交易所不時規定的實繳資本及股東資金要求而合資格成為並於本交易所登記為莊家聯屬公司的聯屬公司。
- 614F. 莊家須促使其莊家聯屬公司(i) 於每個曆月完結後三星期內，透過莊家向本交易所呈交每月財務報表，列明有關曆月底莊家聯屬公司流動資產減去流動負債後的營運資金（「營運資金」）；及 (ii) 每日維持若干水平的營運資金，金額至少等同(a)淨額風險按金的一半；或(b)總按金要求的七分一（取較高者），而

淨額風險按金 = 期權交易所參與者莊家戶口及公司戶口的風險按金
(按淨額基準釐定及在適用情況下對銷任何按市價計值按金貸記後)
之總和

總按金要求 = 期權交易所參與者莊家戶口及公司戶口總按金要求之總
和。

就第 614F 條而言，「風險按金」及「總按金要求」具有《聯交所期權結
算所期權買賣交易所參與者結算運作程序》所載的涵義。

614G. 如違反營運資金規定，莊家須在切實可行範圍內盡快向本交易所匯報，
無論如何不遲於下一營業日下午 4 時。如莊家屢次未能通知本交易所，
本交易所可全權決定撤銷莊家的執照。莊家亦須即時促使其莊家聯屬
公司在 10 個營業日內減少其持倉或增加其營運資金。

614H. 如莊家聯屬公司未能就違反營運資金規定作出補救，本交易所可代莊
家結清其未平倉合約或要求結算所代莊家進行有關平倉。本交易所亦
有絕對酌情權可撤銷莊家的執照。本交易所、結算所或屬於本交易所
及結算所控制人的認可交易所控制人概毋須就任何人士因有關平倉而
蒙受損失負上法律責任。莊家須就此等平倉而引起的費用或其他支出
賠償本交易所、結算所及屬於本交易所及結算所控制人的認可交易所
控制人，並使其毋須承擔此等費用或支出。