

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 已廢除

1.5.1 衍生產品結算及交收系統戶口

個別客戶戶口

為方便計算聯交所期權結算所參與者客戶持倉的淨額按金，聯交所期權結算所（在一名聯交所期權結算所參與者要求下），可全權為該聯交所期權結算所參與者開立及維持一個或多個個別客戶戶口，用作按個別客戶基準記錄聯交所期權結算所參與者客戶的交易及持倉。聯交所期權結算所可為個別聯交所期權結算所參與者設定其開立個別客戶戶口的上限。個別客戶戶口的持倉按淨額基準列賬及計算按金。聯交所期權結算所參與者須確保在每一個別客戶戶口列賬的所有交易及持倉均只屬一名客戶，且有關交易及持倉並非由一名聯交所期權結算所參與者之經營綜合戶口業務的客戶持有。聯交所期權結算所參與者須就開立、維持及終止個別客戶戶口而填報「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**維持衍生產品結算及交收系統戶口表格**」。聯交所期權結算所可全權決定接納或拒絕任何戶口的開立及任何維持戶口要求。個別客戶戶口是為方便聯交所期權結算所參與者分別記錄持倉以達致淨額按金計算而設，不應視作認可因該個別客戶戶口而產生的任何信託或其它衡平權權益。

客戶按金對銷戶口

在一名聯交所期權結算所參與者的要求下及聯交所期權結算所規定的任何費用已繳付後，聯交所期權結算所可全權為該聯交所期權結算所參與者開立及維持一個或多個客戶按金對銷戶口。客戶按金對銷戶口只用作記錄聯交所期權結算所參與者的個別客戶屬對銷性質的合資格短倉，並不得用作記錄長倉。每個按金對銷組合中之持倉必須屬於同一客戶（請參閱9.3.1.2條），且須事先取得該客戶同意，方可將該客戶之持倉撥入客戶按金對銷戶口。客戶按金對銷戶口中的持倉按毛額基準列賬，但卻按淨額基準計算按金。聯交所期權結算所參與者須確保在客戶按金對銷戶口中列賬用作對銷按金的所有持倉，均可與其內部記錄對賬。聯交所期權結算所參與者須就開立、維持及終止客戶按金對銷戶口而填報「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**維持衍生產品結算及交收系統戶口表格**」。聯交所期權結算所可全權決定接納或拒絕任何戶口的開立及任何維持戶口要求。客戶按金對銷戶口是為方便聯交所期權結算所參與者分別記錄持倉以達致淨按金計算而設，不應視作認可因該客戶按金對銷而產生的任何信託或其它衡平權權益。

1.7.2 開立及其後維持戶口的程序

莊家必須填妥及提交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**開立／維持指定交易員莊家戶口表格**」，方可為每個指定交易員開設莊家戶口及／或其

它戶口並於其後維持有關戶口之事宜（包括取消戶口、增加或取消指定交易員可進行莊家活動的期權類別）。

1.7.4 聯交所期權結算所終止服務

- iii. 有關莊家向聯交所期權結算所提交妥善授權及填妥的「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「開立／維持指定交易員莊家戶口表格」，要求終止莊家戶口；或

1.8.4 申請開立期權經紀交易所參與者個別客戶戶口

聯交所期權結算所參與者如欲開立期權經紀交易所參與者個別客戶戶口，必須向聯交所期權結算所遞交填妥的「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「維持期權經紀交易所參與者個別客戶戶口表格」。聯交所期權結算所可全權決定是否為一名期權經紀交易所參與者開立及維持期權經紀交易所參與者個別客戶戶口，且所有期權經紀交易所參與者個別客戶戶口均須受聯交所期權結算所董事會不時規定的條款及條件所規管。

1.8.5 終止期權經紀交易所參與者個別客戶戶口

- i. 可進行結算的聯交所期權結算所參與者遞交填妥的「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「維持期權經紀交易所參與者個別客戶戶口表格」，通知聯交所期權結算所終止某指定的期權經紀交易所參與者個別客戶戶口，前提是該期權經紀交易所參與者個別客戶戶口中並無須予終止的未平倉持倉。若有任何未平倉持倉，可進行結算的聯交所期權結算所參與者須向聯交所期權結算所提供如何將該等未平倉持倉平倉的計劃，而聯交所期權結算所須認為可接納該計劃方會處理終止程序；或

III. 結算服務

5. 交易及持倉管理

5.5.2 對外持倉轉移

對外持倉轉移涉及不同聯交所期權結算所參與者之間一個或多個戶口中持倉的轉移。聯交所期權結算所只會在系統輸入截止時間前收到聯交所期權結算所參與者的正確指示後，以及在出現失責事件後有要求對聯交所期權結算所參與者的客戶按金對銷戶口中的持倉進行對外持倉轉移（但該轉移必須是涉及所有而非部分持倉）情況下，方會執行轉移。聯交所期權結算所參與者可在衍生產品結算及交收系統終端機的持倉報告中及持倉查詢顯示屏上核實對外持倉轉移的結果。

聯交所期權結算所參與者可透過向聯交所期權結算所提交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「要求代處理對外持倉轉移表格」進行對外持倉轉移。對外持倉轉移要求須獲聯交所期權結算所批准，並由聯交所期權結算所執行。

5.5.3 取消持倉對銷

若聯交所期權結算所參與者於使用持倉對銷功能時錯誤對銷持倉，其可於執行原來的持倉對銷後的第五個營業日的系統輸入截止時間前，向聯交所期權結算所提交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**要求代取消持倉對銷表格**」而要求取消有關持倉對銷。取消要求須獲聯交所期權結算所批准，並由聯交所期權結算所執行。

IV. 聯交所期權結算所參與者的職責及責任

8. 股票交易的交收及交付

8.6.1.3 為收取差額繳款、按金及集中抵押金指定共同抵押品管理系統抵押品戶口

若聯交所期權結算所參與者選擇委託聯交所期權結算所經其指定的聯交所期權結算所共同抵押品管理系統抵押品公司戶口收取及支付透過中央結算系統「持續淨額交收」制度交收的待交收股票數額之差額繳款、按金及集中抵押金，該聯交所期權結算所參與者須在聯交所期權結算所不時指定的時間內向聯交所期權結算所提交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**共同抵押品管理系統抵押品戶口指定表格（透過聯交所期權結算所收取差額繳款、按金及集中抵押金適用）**」。在營業日指定時間前接納的表格將於下一個營業日起生效。儘管有上述規定，聯交所期權結算所保留權利以全權接納或拒絕其收到的任何有關收取差額繳款、按金及集中抵押金的共同抵押品管理系統抵押品戶口指定表格的申請。

10. 款項交收

10.5A 大手交易特別按金的交收程序

於追收大手交易特別按金情況下，聯交所期權結算所會向有關聯交所期權結算所參與者發出「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**大手交易特別按金追收通知書**」。聯交所期權結算所參與者須於其在指定銀行或交收銀行的戶口中安排存放足夠款項，以於發出通知後一小時內或聯交所期權結算所可能不時規定的更短期間內支付大手交易特別按金。大手交易特別按金只可以結算貨幣現金支付。

12. 持倉控制

12.3A 分配速動資金

鑑於聯交所期權結算所參與者是中央結算系統結算參與者，亦可能同時為期貨結算所參與者或從事《證券及期貨條例》下的各類受規管活動。因此，聯交所期權結算所參與者須從其速動資金（除非聯交所期權結算所另行決定，否則按其根據財政資源規則向證監會提交並由證監會提供予聯交所期權結算所的最新月報表作計算）中分配指定金額或百分比，用作其交易所交易期權的業務，或向聯交所期權結算所履行其作為聯交所期權結算所參與者所需承擔的的付款或其他責任；而該聯交所期權結算所參與者以資本額釐定的持倉限額將會根據其通知聯交所期權結算所的分配速動資金數額計算。聯交所期權結算所參與者須根據聯交所期權結算所不時規定的時間表，向聯交所期權結算所遞交「衍生產品結算及交收系統終端機使用者指引」所載之「**速動資金分配申請／更改要求表格**」，以通知聯交所期權結算所其速動資金的初步分配或任何有關更改。聯交所期權結算所若在其不時規定的時間內收到任何

有關更改速動資金分配的通知，則會在其收到通知的同一營業日生效。否則，該分配更改將會在聯交所期權結算所收到通知後的下一個營業日開始時生效。儘管有上述規定，聯交所期權結算所保留權利以全權接納或拒絕其收到的任何速動資金初步分配或分配更改的通知。若聯交所期權結算所並未收到任何速動資金分配的通知，則其可保留權利代該聯交所期權結算所參與者分配速動資金。

- 附錄A1- 已刪除
- 附錄A2- 已刪除
- 附錄A3- 已刪除
- 附錄A4- 已刪除
- 附錄A5- 已刪除
- 附錄A6- 已刪除
- 附錄A7- 已刪除
- 附錄A8- 已刪除
- 附錄A9- 已刪除
- 附錄A10- 已刪除
- 附錄A11- 已刪除
- 附錄B9- 已刪除
- 附錄B10- 已刪除
- 附錄C5- 已刪除