HKEX
香港交易所

| | |
|---|---|
| 編號 Ref. No.: | MO/DT/127/18 |
| 日期 Date: | 25/06/2018 |

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： 委任股票期權主要莊家

查詢： 簡小姐 2211 6366

交易所宣佈由 2018 年 7 月 3 日至 2019 年 6 月 28 日期間，下列公司將被委任為主要莊家：

- 法國巴黎證券(亞洲)有限公司
- Citadel Securities (Hong Kong) Limited
- Eclipse Options (HK) Limited
- IMC Asia Pacific Limited
- Optiver Trading Hong Kong Limited

主要莊家須就每個期權類別，在每個月不少於 80%的交易時段內提供不少於 150 個期權系列的持續報價，以及就不少於 80%的報價要求作出回應。有關主要莊家計劃內的股票期權類別名單及主要莊家責任的詳細資料，請參閱本通告的附件一及附件二。

市場科
衍生產品交易
主管
何耀昌 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**

**主要莊家計劃股票期權類別名單**

| 號數 | 股份名稱 | 主要莊家 |
|---|---|---|
| 1 | 中國農業銀行股份有限公司 * | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 2 | 友邦保險控股有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 3 | 中國銀行股份有限公司 * | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 4 | 中國建設銀行股份有限公司 * | 法國巴黎證券(亞洲)有限公司 |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 5 | 中國人壽保險股份有限公司 | 法國巴黎證券(亞洲)有限公司 |
| | | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 6 | 中國移動有限公司 | 法國巴黎證券(亞洲)有限公司 |
| | | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 7 | 中國石油化工股份有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |

| 號數 | 股份名稱 | 主要莊家 |
|---|---|---|
| 8 | 中國海洋石油有限公司 | 法國巴黎證券(亞洲)有限公司 |
| | | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 9 | CSOP 富時中國 A50 ETF | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 10 | 銀河娛樂集團有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 11 | 香港交易及結算所有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 12 | 匯豐控股有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 13 | 中國工商銀行股份有限公司 * | 法國巴黎證券(亞洲)有限公司 |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 14 | iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |

| 號數 | 股份名稱 | 主要莊家 |
|---|---|---|
| 15 | 中國石油天然氣股份有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 16 | 中國平安保險(集團)股份有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 17 | 金沙中國有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |
| 18 | 騰訊控股有限公司 | Citadel Securities (Hong Kong) Limited |
| | | Eclipse Options (HK) Limited |
| | | IMC Asia Pacific Limited |
| | | Optiver Trading Hong Kong Limited |

*股票期權類別的最低變動價格為 0.001 港元。

**附件二**

**主要莊家責任**

**表一：持續報價責任**

| 指定持續報價系列 | | 150 個期權系列<br>(從以下期權系列中選擇) | |
|---|---|---|---|
| | | | |
| 可選擇的期權系列: | | | |
| 合約月份 | 期權價位 | 認購期權系列 | 認沽期權系列 |
| 即月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 第二個曆月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 第三個曆月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 第四個曆月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 第一個季月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 第二個季月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 第三個季月 | 價外期權 | 10 | 10 |
| | 價內期權 | 2 | 2 |
| 小計 | | 84 | 84 |
| 合共 | | 168 | |

| | |
|---|---|
| 開價盤最少合約張數 | 見表三 |
| 最大買賣盤差價 | |
| 最少持續報價時間 | 於一個月內提供持續報價達交易時段的 80% |

**表二：回應報價責任**

| | |
|---|---|
| 最少回應報價要求 | 於一個月內對開價盤要求作出回應達 80% |
| 開價盤最少合約張數 | 見表三 |
| 最大買賣盤差價 | |
| 回應報價最高時限 | 在接獲開價盤要求後 20 秒內作出回應 |
| 開價盤保留最少時限 | 20 秒 |

**表三：股票期權的責任水平及最大買賣盤差價類別**

| | **股份名稱** | **責任水平**<br>(見下表) | **買賣盤差價類別**<br>(見下表) |
|---|---|---|---|
| 1 | 中國農業銀行股份有限公司 * | 1 | 甲 |
| 2 | 友邦保險控股有限公司 | 1 | 甲 |
| 3 | 中國銀行股份有限公司 * | 1 | 甲 |
| 4 | 中國建設銀行股份有限公司 * | 1 | 甲 |
| 5 | 中國人壽保險股份有限公司 | 1 | 甲 |
| 6 | 中國移動有限公司 | 1 | 甲 |
| 7 | 中國石油化工股份有限公司 | 1 | 甲 |
| 8 | 中國海洋石油有限公司 | 1 | 甲 |
| 9 | CSOP 富時中國 A50 ETF | 1 | 甲 |
| 10 | 銀河娛樂集團有限公司 | 1 | 甲 |
| 11 | 香港交易及結算所有限公司 | 1 | 乙 |
| 12 | 匯豐控股有限公司 | 1 | 甲 |
| 13 | 中國工商銀行股份有限公司 * | 1 | 甲 |
| 14 | iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF | 1 | 甲 |

| | **股份名稱** | **責任水平**<br>(見下表) | **買賣盤差價類別**<br>(見下表) |
|---|---|---|---|
| 15 | 中國石油天然氣股份有限公司 | 1 | 甲 |
| 16 | 中國平安保險(集團)股份有限公司 | 1 | 甲 |
| 17 | 金沙中國有限公司 | 1 | 甲 |
| 18 | 騰訊控股有限公司 | 1 | 乙 |

*股票期權類別的最低變動價格為 0.001 港元。

| | | **合約月份** | | **責任水平** |
|---|---|---|---|---|
| | | | | **水平 1** |
| **開價盤最少合約張數** | | 即月及隨後的 3 個曆月 | | 30 |
| | | 隨後的 3 個季月 | | 15 |
| **最大買賣盤差價** | **甲類** | 即月 | 離到期日不多於 3 個營業日 | 買盤價的 20%或正股的最佳買賣盤差價的 4 倍，以較低者為準。 |
| | | | 離到期日最少 4 個營業日 | 買盤價的 10%或正股的最佳買賣盤差價的 4 倍，以較低者為準。 |
| | | 最近的 3 個到期月份 | | |
| | | 之後的 2 個季月 | | 買盤價的 20%或正股的最佳買賣盤差價的 6 倍，以較低者為準。 |
| | | 第 3 個季月 | | 買盤價的 20%或正股的最佳買賣盤差價的 12 倍，以較低者為準。 |
| | **乙類** | 即月 | 離到期日不多於 3 個營業日 | 買盤價的 35%或正股的最佳買賣盤差價的 9 倍，以較低者為準。 |
| | | | 離到期日最少 4 個營業日 | 買盤價的 20%或正股的最佳買賣盤差價的 9 倍，以較低者為準。 |
| | | 最近的 3 個到期月份 | | |
| | | 之後的 2 個季月 | | 買盤價的 35%或正股的最佳買賣盤差價的 12 倍，以較低者為準。 |
| | | 第 3 個季月 | | 買盤價的 45%或正股的最佳買賣盤差價的 21 倍，以較低者為準。 |

註： 縱使如此，交易所將會按月檢閱所有股票期權類別的買賣盤差價類別(即甲類或乙類), 以反映市場情況的變動。 另外，

- 主要莊家在最低變動價格為 0.01 港元的股票期權類別，將不會有責任提供買 / 賣差價少於:

| 買賣盤差價類別 | 正股按盤價 | 主要莊家不會有責任提供買 / 賣差價少於 |
|---|---|---|
| 甲類 | < $100 | 正股最佳買 / 賣差價 + 5 個最低價格波幅 |
| | >= $100 | 正股最佳買 / 賣差價+ 10 個最低價格波幅 |
| 乙類 | < $100 | 正股最佳買 / 賣差價+ 15 個最低價格波幅 |
| | >= $100 | 正股最佳買 / 賣差價+ 30 個最低價格波幅 |

- 主要莊家在最低變動價格為 0.001 港元的股票期權類別，將不會有責任提供買 / 賣差價少於 0.03 港元之報價。

另外，主要莊家也不會有責任就價值接近零的極價外合約回應買盤報價要求。不過，主要莊家仍有責任在所需回應時限內，在最低變動價格分別為0.01港元及0.001港元的股票期權類別，發出價格上限分別不超過 10 個及30個最低價格波幅的限價賣盤報價，當中所涉及的數量及報價有效時間須符合有關最低規定。