

香港期貨結算有限公司

(香港交易及結算所有限公司集團全資附屬成員機構)

HKFE Clearing Corporation Limited

(A wholly-owned member of the Hong Kong Exchanges and Clearing Limited Group)

通告 CIRCULAR

事項

Subject: 就人民幣外匯期貨結算作準備

查詢

Enquiry: **DCASS 熱線 2979 7222**

香港期貨交易所有限公司（期交所）計劃於 2012 年第三季推出美元兌人民幣（香港）外匯期貨 [下稱美元兌人民幣期貨]，有關期貨合約有待監管機構批准。交易安排及合約概要已刊載於期交所在 2012 年 4 月 19 日發出的通告（編號：[DMD/051/12](#)）。

結算參與者若有意掌握美元兌人民幣期貨合約的潛在商機，應注意下列結算安排及所需準備工作：

1. 交收貨幣

美元兌人民幣期貨將以人民幣交易。變價調整要求、按金要求、交易及交收費用將以人民幣繳交（貨幣代碼為“CNY”）。現貨月美元兌人民幣期貨合約的最後結算將根據合約條款，由合約賣方以美元交付相關貨幣，並由合約買方以人民幣支付現金。

2. 交收銀行賬戶

合資格為美元兌人民幣期貨進行結算的結算參與者須於 [香港期貨結算有限公司（期貨結算公司）委任之交收銀行](#) 為其公司及客戶開立人民幣及美元賬戶，及依照期貨結算公司的要求完成設立相關 [自動轉賬授權](#)。如參與者已開立所需人民幣及美元賬戶，期貨結算公司在收到參與者填妥的授權表格後，一般需約三週可完成設立相關自動轉賬授權。

3. 最後結算程序

美元兌人民幣期貨為貨幣交付期貨合約。結算參與者將於最後交易日（即最後結算日前兩個營業日）得知最後結算的交付及付款責任（詳情將列於結算準備測試資料冊內）。

賣方須於最後結算時交付美元，而買方須以人民幣支付最後結算價值。在最後結算日前的營業日，結算參與者之交付及付款要求會按貨幣跟在同一個共同抵押品管理系統（CCMS）抵押品戶口內的其他交收責任抵銷。結算參與者須於最後結算日上午 9 時 15 分或之前繳付任何不足的差額，反之任何盈餘將記存於 CCMS 抵押品戶口內。

香港交易及結算所有限公司
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited

4. 系統及內部運作的準備

有興趣的結算參與者應檢視其系統及運作程序及作出充足準備，以確保其系統及內部運作能處理美元兌人民幣期貨之結算，其中包括但不限於以下所列：

1. OMnet 應用程式界面 (OAPI) – 為協助結算參與者確保其 OAPI 程式準備就緒，將由 2012 年 4 月 20 日起在測試平台增設美元兌人民幣期貨合約以供測試
2. 結算及交收系統
3. 其他適當的後端系統及運作。

準備測試

為協助參與者模擬美元兌人民幣期貨的交易、結算活動及相關運作，香港交易所將於 2012 年 6 月 30 日 (星期六) 舉行有關準備測試。

參與者如欲參加準備測試，請填妥有關登記表格 (http://www.hkex.com.hk/chi/market/partcir/hkfe/2012/Documents/DMD_051_12_cform.pdf)，並於 **2012 年 5 月 11 日 (星期五) 或之前** 經傳真 (2509-0724 或 2877-0017) 或電郵 (ClickSupport@hkex.com.hk) 交回香港交易所。結算準備測試資料冊將於稍後提供。

參與者應聯絡其資訊科技部門或系統供應商以作適當的計劃及準備。

如對上述有任何查詢，請致電 DCASS 查詢熱線 2979 7222。

何建威
副總監
衍生產品結算業務