

香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

HONG KONG FUTURES EXCHANGE LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項: 人民幣貨幣期權合約將引入流通量提供者保護功能

查詢: 許小姐 (電郵: IrisHui@hkex.com.hk ; 電話: 2840-3726)

顏先生 (電郵: RayYen@hkex.com.hk ; 電話: 2211-6122)

香港期貨交易所有限公司 (「交易所」) 宣佈美元兌人民幣 (香港) 期權合約將推出流通量提供者保護功能，自 2019 年 6 月 3 日開始生效。

在流通量提供者保護功能下，如流通量提供者於個別美元兌人民幣 (香港) 期權合約的報價獲市場接納的數額超過預設時間內的預設數量，HKATS 將會取消該報價。在取消機制被啟動後，HKATS 也會防止此流通量提供者在指定時間內輸入新報價。

此流通量提供者保護功能適用於為美元兌人民幣 (香港) 期權提供持續報價並滿足以下表 1 所列責任的流通量提供者。

表 1：美元兌人民幣（香港）期權流通量提供者責任

最低需提供報價的期權系列數目*	最高買賣差價（點）	最少開盤張數（合約張數）	最少持續報價時間（%）
所有合約月份需有 100 個系列	<ul style="list-style-type: none"> • 現月及下一個曆月：50； • 第二及第三個曆月和第一個季月：70； • 第二個季月：100； • 第三個季月：120； • 第四個季月：140 	5 張合約	50%

*須從以下美元兌人民幣（香港）期權系列選擇：

合約月份	期權系列	
	認購	認沽
現月	5	5
第一個曆月	5	5
第二個曆月	7	7
第三個曆月	9	9
第一個季月	9	9
第二個季月	13	13
第三個季月	17	17
第四個季月	20	20
合計	85	85
總計	170	

有關流通量提供者保護功能的申請，美元兌人民幣（香港）期權合約的流通量提供者可聯絡許小姐 (IrisHui@hkex.com.hk)或顏先生(RayYen@hkex.com.hk)。

市場發展科
定息及貨幣發展部主管
馬俊禮謹啟

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。