

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： 美元兌人民幣（香港）貨幣期貨推出第六個季月合約及新增跨期組合

查詢： 禰先生（電郵：ThomasHuen@hkex.com.hk；電話：2211-6761）

莫先生（電郵：DennisMok@hkex.com.hk；電話：2211-6405）

香港期貨交易所（以下簡稱「交易所」）欣然宣布美元兌人民幣（香港）貨幣期貨將於 **2018年6月19日（星期二）（日間時段）** 推出第六個季月合約及新增跨期組合。

相關規則修訂將稍後載於另一通告。

推出第六個季月合約

推出第六個季月合約可令買賣合約月份增加至 10 張，到期月份可長達至 22 個月。新增的合約月份有助參與者及其客戶更有效率地管理更長期的人民幣貨幣價格風險。

以下為 2018 年 6 月 19 日（日間時段）可供交易的合約月份：

生效日期	即月	下三個歷月	下六個季月
2018 年 6 月 19 日	2018 年 7 月	2018 年 8 月 2018 年 9 月 2018 年 10 月	2018 年 12 月 2019 年 3 月 2019 年 6 月 2019 年 9 月 2019 年 12 月 <u>2020 年 3 月</u> <u>（新增）</u>

有關可供交易的合約月份圖示載於附件一以供參考。

市場莊家將根據交易所的自動電子系統（「HKATS 電子交易系統」）買賣貨幣期貨的交易程序所述的開價要求，為即月、下三個歷月、及下五個季月合約月份，提供買賣雙向的持續報價。對於新增的第六個季月，市場莊家將以自願性質提供持續報價。

新增跨期組合

為方便市場人士作跨期交易及合約轉月，交易所在 2018 年 6 月 19 日(日間時段)起將新增 19 組跨期組合，包括：

- (i) 與新增第六個季月組成的跨期組合；以及
- (ii) 由曆月及季月組成的其他跨期組合

此次新增跨期組合後，將提供共 45 組跨期組合，涵蓋美元兌人民幣（香港）貨幣期貨任何合約月份對之間組成的跨期組合。

以下為 2018 年 6 月 19 日(日間時段)可供交易的跨期組合

生效日期	跨期組合						
2018 年 6 月 19 日 (日間時段)	現有 (26 組)	18 年 7 月/ 18 年 8 月	18 年 7 月/ 18 年 9 月	18 年 7 月/ 18 年 10 月	18 年 7 月/ 18 年 12 月	18 年 7 月/ 19 年 3 月	18 年 7 月/ 19 年 6 月
		18 年 7 月/ 19 年 9 月	18 年 7 月/ 19 年 12 月				
		18 年 8 月/ 18 年 9 月	18 年 8 月/ 18 年 10 月				
		18 年 9 月/ 18 年 10 月	18 年 9 月/ 18 年 12 月	18 年 9 月/ 19 年 3 月	18 年 9 月/ 19 年 6 月	18 年 9 月/ 19 年 9 月	18 年 9 月/ 19 年 12 月
		18 年 12 月/ 19 年 3 月	18 年 12 月/ 19 年 6 月	18 年 12 月/ 19 年 9 月	18 年 12 月/ 19 年 12 月		
		19 年 3 月/ 19 年 6 月	19 年 3 月/ 19 年 9 月	19 年 3 月/ 19 年 12 月			
		19 年 6 月/ 19 年 9 月	19 年 6 月/ 19 年 12 月				
		19 年 9 月/ 19 年 12 月					
		19 年 12 月/ 20 年 3 月					
		18 年 8 月/ 18 年 12 月	18 年 8 月/ 19 年 3 月	18 年 8 月/ 19 年 6 月	18 年 8 月/ 19 年 9 月	18 年 8 月/ 19 年 12 月	18 年 8 月/ 20 年 3 月
		18 年 9 月/ 20 年 3 月					
		18 年 10 月/ 18 年 12 月	18 年 10 月/ 19 年 3 月	18 年 10 月/ 19 年 6 月	18 年 10 月/ 19 年 9 月	18 年 10 月/ 19 年 12 月	18 年 10 月/ 20 年 3 月
		18 年 12 月/ 20 年 3 月					
		19 年 3 月/ 20 年 3 月					
		19 年 6 月/ 20 年 3 月					
	19 年 9 月/ 20 年 3 月						
	19 年 12 月/ 20 年 3 月						
	19 年 12 月/ 20 年 3 月						
	19 年 12 月/ 20 年 3 月						

參與者請確保交易及後勤系統已為推出第六個季月合約及新增跨期組合作好準備。

市場發展科

定息及貨幣產品發展部主管

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。

附件一

圖示可供買賣的合約月份

美元兌人民幣（香港）貨幣期貨

即月	可供買賣合約月份																							
	2018年						2019年												2020年				2021年	
	7月	8月	9月	10月	11月	12月	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	3月	6月	9月	12月	3月	
18年7月	■	■	■	■	■	■			■			■			■			■		■				
18年8月		■	■	■	■	■			■			■			■			■		■				
18年9月			■	■	■	■			■			■			■			■		■		■		
18年10月				■	■	■	■		■			■			■			■		■		■		
18年11月					■	■	■	■	■			■			■			■		■		■		
18年12月						■	■	■	■	■		■			■			■		■		■		
19年1月							■	■	■	■	■	■			■			■		■		■		
19年2月								■	■	■	■	■	■		■			■		■		■		
19年3月									■	■	■	■	■	■	■			■		■		■		
19年4月										■	■	■	■	■	■	■		■		■		■		
19年5月											■	■	■	■	■	■	■	■		■		■		
19年6月												■	■	■	■	■	■	■		■		■	■	

■ 新增之第六個季月合約