

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: 提示 – 指數期貨及期權大額未平倉持倉呈報

查詢: lophkfe@hkex.com.hk

參照於2014年11月26日發出有關加強監管指數期貨及期權大額未平倉持倉呈報的通告(編號: [EFIC/DT/178/14](#))。

請注意有關要求參與者本身戶口或其客戶的戶口所持的未平倉合約若超出指數期貨及期權持倉限額的60%，須向交易所呈報該相關指數期貨及期權的所有持倉的規定只適用於恒生指數及恒生中國企業指數。

為避免引起疑問，所持的參與者本身戶口或其客戶的戶口的未平倉期貨及期權合約應以淨(即淨長倉或短倉)對沖值(Delta)計算。

若相關持倉呈報措施延伸至其他指數期貨及期權，將另發出通知會參與者。

市場科
證券產品發展部
聯席主管
黃柏中謹啟

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。