

## 通告 CIRCULAR

事項: 推出小鵬汽車有限公司股票期貨

查詢: 陳先生 (電話: 2211-6139 電郵: [wallacechan@hkex.com.hk](mailto:wallacechan@hkex.com.hk))

香港期貨交易所(“交易所”)將推出小鵬汽車有限公司(“小鵬汽車”)股票期貨合約。若證監會批准及相關股票成功上市,新股票期貨合約將暫定於同日開始交易,即 **2021年7月7日(星期三)** (開始交易日):

正股名稱 (股票編號)	HKATS 代號	合約買 賣單位 (股數)	最低價格 波幅 (港幣)	正股買賣 單位倍數	期貨 類別	交易費 用(港幣)	於開始交易日供 交易的合約月份
小鵬汽車 (9868)	PEN	200	\$0.01	2	1	\$3	2021年7月、8 月、9月、12月 及2022年3月

有關可供買賣的股票期貨名單已編列於本通告的附件一以供參考。合約細則的詳情請參閱交易所規則。

### 交易費用及證監會徵費安排

項目	詳情
交易費用豁免	市場莊家若達到小鵬汽車股票期貨責任要求,可獲交易費用豁免,該優惠由2021年7月7日至2021年12月31日,包括首尾兩天。

項目	詳情
證監會徵費豁免	證監會徵費將為每張合約每邊港幣 0.1 元。根據對於新推出股票合約之證券及期貨 (徵費) 令 (571Z 章, 第 12 節), 小鵬汽車股票期貨於推出交易的首 6 個月將豁免證監會徵費, 即由 2021 年 7 月 7 日起至 2022 年 1 月 6 日, 包括首尾兩天。

### 持倉限額

小鵬汽車股票期貨的持倉限額為任何一個合約月份未平倉合約均不得超越 5,000 張。

### 市場莊家

交易所現邀申請股票期貨的莊家牌照。有興趣申請者可聯絡 David Lutz 先生 ([DavidLutz@hkex.com.hk](mailto:DavidLutz@hkex.com.hk)) 及 黃小姐 ([EmilyHuang@hkex.com.hk](mailto:EmilyHuang@hkex.com.hk))。

在推出股票期貨的首兩星期(即由2021年7月7日起至2021年7月20日)期間, 市場莊家的最大買賣盤差價責任要求將擴寬為原來的兩倍。

### 交易費用

市場莊家若達到股票期貨責任要求, 於 2020 年 12 月 24 日 (編號: [MKS/EQD/43/20](#)) 通告中公佈的交易費用豁免優惠, 將適用於市場莊家於 2021 年 7 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日前交易的新股票期貨合約, 包括首尾兩天。

### 推出前安排

以下推出前的安排將於 **2021 年 7 月 6 日(星期二)** (即開始交易日的前一個營業日) 實施:

- 甲. 新股票期貨類別的股票期貨系列將被顯示, 但尚未能交易; 及
- 乙. 新股票期貨類別的按金計算風險系數檔案、結算及未平倉合約報表亦會提供。

在開始交易日前一個營業日提供風險系數檔案的用途是協助參與者預算在開始交易日新推出的股票期貨類別的按金要求。

請注意，上述於開始交易日前一個營業日發放的風險系數檔案內的按金要求未必和開始交易日所發放的一樣。因此，香港交易所及其附屬公司對風險系數檔案使用者因使用該檔案而引起的任何損失不會承擔任何責任。參與者若有意應用以上風險系數檔案，需要更新其 PC-SPAN 參數設定檔案。詳情請參閱結算所在隨後發出的通告。

## 交易資訊

由資訊商提供的股票期貨訊息代碼將適時於交易所網站發放。

## 通知有關員工及客戶

交易所參與者請通知有興趣的客戶有關小鵬汽車股票期貨的推出，**特別注意合約股數是正股買賣單位的倍數**。參與者應確保後勤系統就交易上述新股票期貨準備就緒。同時，參與者的員工應清楚理解以上內容，謹慎小心地處理相關期貨買賣及向客戶提供建議。

投資者請留意個別的股票期貨可能沒有市場莊家。市場莊家參與的情況會因應其登記情況而不時改變。最新的股票期貨名單及其有否市場莊家會不時於[交易所網站](#)更新。投資者應小心買賣沒有市場莊家登記的股票期貨及明白其涉及的流動風險。投資者於開倉或平倉股票期貨時，會與不同價格方向取態的投資者進行交易。

市場科

證券產品發展部

聯席主管

蕭沛聰 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。

## 可供買賣的股票期貨名單

以下是可於交易 HKATS 系統進行買賣的股票期貨名單。交易所參與者及其客戶須注意個別股票期貨可能沒有市場莊家登記，因而未能提供買賣報價。投資者若要買賣沒有市場莊家登記的期貨時，應謹慎小心及明白其所涉及的流動風險。

### 1. 股票期貨的合約買賣單位多於一手正股股數

號數	股份代號	正股名稱	HKATS代號	合約買賣單位(股數)	正股買賣單位倍數	類別
1	16	新鴻基地產發展有限公司	SHK	1,000	2	1
2	175	吉利汽車控股有限公司	GAH	5,000	5	1
3	268	金蝶國際軟件集團有限公司	KDS	2,000	2	1
4	688	中國海外發展有限公司	COL	2,000	4	1
5	788	中國鐵塔股份有限公司	TWR	10,000	5	2
6	823	領展房地產投資信託基金	LNK	1,000	10	1
7	981	中芯國際集成電路製造有限公司	SMC	2,500	5	1
8	998	中信銀行股份有限公司	CTB	20,000	20	1
9	1024	快手科技	KST	500	5	1
10	1288	中國農業銀行股份有限公司	ABC	10,000	10	1
11	1299	友邦保險控股有限公司	AIA	1,000	5	1
12	1336	新華人壽保險股份有限公司	NCL	1,000	10	1
13	1359	中國信達資產管理股份有限公司	CDA	5,000	5	3
14	1810	小米集團	MIU	1,000	5	2
15	1816	中國廣核電力股份有限公司	CGN	10,000	10	2
16	1833	平安健康醫療科技有限公司	PHT	500	5	1
17	1876	百威亞太控股有限公司	BUD	1,000	10	2
18	1918	融創中國控股有限公司	SUN	2,000	2	1
19	1988	中國民生銀行股份有限公司	MSB	10,000	20	1

號數	股份代號	正股名稱	HKATS代號	合約買賣單位(股數)	正股買賣單位倍數	類別
20	2007	碧桂園控股有限公司	COG	5,000	5	1
21	2018	瑞聲科技控股有限公司	AAC	1,000	2	1
22	2238	廣州汽車集團股份有限公司	GAC	4,000	2	1
23	2333	長城汽車股份有限公司	GWM	10,000	20	1
24	2382	舜宇光學科技(集團)有限公司	SNO	1,000	10	1
25	2601	中國太平洋保險(集團)股份有限公司	CPI	1,000	5	2
26	2800	盈富基金	TRF	50,000	100	1
27	2822	CSOP 富時中國 A50 ETF	CSA	5,000	25	1
28	2823	iShares 安碩富時 A50 中國指數 ETF	A50	5,000	50	1
29	2828	恒生中國企業指數上市基金	HCF	5,000	25	1
30	3188	華夏滬深 300 指數 ETF	AMC	2,000	10	1
31	3333	中國恒大集團	EVG	2,000	2	1
32	3690	美團點評	MET	500	5	1
33	3888	金山軟件有限公司	KSO	1,000	5	1
34	6030	中信証券股份有限公司	CTS	1,000	2	2
35	6618	京東健康股份有限公司	JDH	500	10	1
36	6837	海通證券股份有限公司	HAI	10,000	25	1
37	9618	京東集團股份有限公司	JDC	500	10	1
38	9626	嚶哩嚶哩集團股份有限公司	BIL	60	3	1
39	9868	小鵬汽車有限公司 <sup>^</sup>	PEN	200	2	1
40	9888	百度集團股份有限公司	BIU	150	3	1
41	9988	阿里巴巴集團控股有限公司	ALB	500	5	1
42	9999	網易	NTE	500	5	1

<sup>^</sup>暫定將於2021年7月7日起進行買賣

## 2. 股票期貨合約買賣單位等於一手正股股數

號數	股份代號	正股名稱	HKATS代號	合約買賣單位(股數)	類別
1	1	長江和記實業有限公司	CKH	500	1
2	2	中電控股有限公司	CLP	500	1
3	3	香港中華煤氣有限公司	HKG	1,000	2
4	4	九龍倉集團有限公司	WHL	1,000	2
5	5	匯豐控股有限公司	HKB	400	2
6	6	電能實業有限公司	HEH	500	2
7	11	恒生銀行有限公司	HSB	100	2
8	12	恒基兆業地產有限公司	HLD	1,000	1
9	17	新世界發展有限公司	NWD	1,000	1
10	19	太古股份有限公司'A'	SWA	500	2
11	23	東亞銀行有限公司	BEA	200	3
12	27	銀河娛樂集團有限公司	GLX	1,000	1
13	66	香港鐵路有限公司	MTR	500	2
14	241	阿里健康信息技術有限公司	ALH	2,000	1
15	267	中國中信股份有限公司	CIT	1,000	3
16	386	中國石油化工股份有限公司	CPC	2,000	3
17	388	香港交易及結算所有限公司	HEX	100	1
18	700	騰訊控股有限公司	TCH	100	1
19	728	中國電信股份有限公司	CTC	2,000	3
20	762	中國聯合網絡通信(香港)股份有限公司	CHU	2,000	3
21	857	中國石油天然氣股份有限公司	PEC	2,000	3
22	883	中國海洋石油有限公司	CNC	1,000	3
23	902	華能國際電力股份有限公司	HNP	2,000	3
24	914	安徽海螺水泥股份有限公司	ACC	500	1

號數	股份代號	正股名稱	HKATS代號	合約買賣單位(股數)	類別
25	939	中國建設銀行股份有限公司	CCB	1,000	3
26	941	中國移動有限公司	CHT	500	1
27	1088	中國神華能源股份有限公司	CSE	500	3
28	1171	兗州煤業股份有限公司	YZC	2,000	2
29	1398	中國工商銀行股份有限公司	ICB	1,000	3
30	1800	中國交通建設股份有限公司	CCC	1,000	3
31	1898	中國中煤能源股份有限公司	CCE	1,000	3
32	1928	金沙島中國有限公司	SAN	400	2
33	2269	藥明生物技術有限公司	WXB	500	1
34	2318	中國平安保險(集團)股份有限公司	PAI	500	1
35	2328	中國人民財產保險股份有限公司	PIC	2,000	2
36	2388	中銀香港(控股)有限公司	BOC	500	2
37	2600	中國鋁業股份有限公司	ALC	2,000	3
38	2628	中國人壽保險股份有限公司	CLI	1,000	2
39	2899	紫金礦業集團股份有限公司	ZJM	2,000	3
40	3328	交通銀行股份有限公司	BCM	1,000	3
41	3968	招商銀行股份有限公司	CMB	500	2
42	3988	中國銀行股份有限公司	BCL	1,000	3