

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： 惡劣天氣交易的大額未平倉合約申報程序

查詢： lophkfe@hkex.com.hk

參考 2024 年 9 月 16 日發出有關香港證券及衍生產品市場實施惡劣天氣下交易的通告（參考編號：[CT/148/24](#) 及 [MO/DT/206/24](#)）。

為維持在惡劣天氣交易日期間對大額未平倉合約的監察能力，現行的申報安排會根據香港期貨交易所有限公司（「交易所」或「期交所」）規則、規例及程序第628條將於惡劣天氣交易日維持適用。

交易所參與者為其自身或任何客戶持有的交易所合約超出大額未平倉合約水平，須於相關交易所合約的下一個交易日¹中午12時或之前就須申報的持倉向交易所提交大額未平倉合約報告，若其後持倉持續超出大額未平倉合約水平，須繼續在每一日後的一個交易日內提交報告。

任何人士（如交易所參與者的客戶）持有的交易所合約持倉超出大額未平倉合約水平並直接向交易所提交大額未平倉合約報告（而非透過交易所參與者提交），須根據以上申報程序作出申報。

為避免混淆，於 2005 年 10 月 25 日向交易所參與者發出的通告（參考編號：[ED/DMD/MD/024/05](#)）所附的大額未平倉合約申報程序已作出更新（見附件 1），目的為管理和取代過時的內容（如三年期外匯基金債券期貨已終止交易等），及反映以上的大額未平倉合約申報程序。

交易所參與者須注意及遵守本通告的申報程序，並須將申報要求及申報責任告知其客戶。

如市場參與者對本通告有任何查詢，請聯絡市場監察部（電郵：lophkfe@hkex.com.hk）。

營運科

市場監察部

主管

王秉厚 謹啟

本通告以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本與英文本有所出入，概以英文本為準。

¹ 「交易日」指就交易所合約而言，根據交易所不時規定的交易日曆，即該交易所合約於交易所開放交易的任何日子（包括任何香港公眾假期）。

大額未平倉合約申報程序

(自 2024 年 9 月 23 日起)

A. 一般事項

- 1 此程序根據香港期貨交易所有限公司(「交易所」或「期交所」)的《期交所規則、規例及程序》第628及633條(「程序」)訂明，並取代2005年10月25日向交易所參與者發出的通告(參考編號：[ED/DMD/MD/024/05](#))所附的大額未平倉合約申報程序。除另作定義外，本程序所用詞彙與交易所規則所義具有相同涵義。
- 2 任何交易所參與者為其自身或其客戶(視情況而定)於特定期貨合約月份或期權系列持有的未平倉合約超出任何一個合約月份或任何一個期權系列的指定數目，將被視為持有大額未平倉合約。請注意，這與《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》(「證券及期貨規則」)規定的「須申報水平」概念相似，大額未平倉合約應按未平倉合約的總額計算。

任何交易所參與者為其自身或其客戶持有的交易所合約持倉超出大額未平倉合約水平，須根據此程序，於有關交易所合約的下一個交易日¹中午12時之前，就須申報的持倉向交易所提交大額未平倉合約報告，若其後的持倉持續超出大額未平倉合約水平，須繼續在每一日後的一個交易日內提交大額未平倉合約報告。

B. 交易所參與者向交易所的申報

1. **交易所參與者的持倉** - 交易所參與者為其自身持有的未平倉合約超出合約細則指定的合約數目，交易所參與者須使用交易所指定的表格提交大額未平倉合約報告。
2. **交易所參與者客戶的持倉** - 交易所參與者為其客戶持有的未平倉合約超出合約細則指定的合約數目，交易所參與者須使用交易所指定的表格提交大額未平倉合約報告。

C. 大額未平倉合約報告

1. 交易所參與者須在大額未平倉合約報告向交易所提供以下資料：

¹「交易日」指就交易所合約而言，根據交易所不時規定的交易日曆，即該交易所合約於交易所開放交易的任何日子(包括任何香港公眾假期)。

- i. 帳戶號碼；
 - ii. 帳戶名稱；
 - iii. 帳戶的最終實益擁有人（「最終實益擁有人」）；
 - iv. 交易發起人（如交易指示並非由最終實益擁有人發起）；
 - v. 產品代碼；
 - vi. 申報持倉人士是否為最終實益擁有人，交易發起人或綜合帳戶操作者；
 - vii. 帳戶類別；
 - viii. 須申報的持倉性質（即對沖、交易或套戩目的）；
 - ix. 合約類別；
 - x. 合約系列；及
 - xi. 持有好倉及／或淡倉的數目。
2. 如交易所參與者代綜合帳戶操作者持倉，各子賬戶應被視為單獨客戶作計算及申報大額未平倉合約。
 3. 如交易所參與者獲悉若干客戶賬戶為同一人持有，須將應些客戶賬戶作出合併計算及申報大額未平倉合約。

D. 非交易所參與者向交易所的申報

- 1 交易所參與者須告知其客戶在交易所規則、此程序及「證券及期貨規則」以及相關由證券及期貨事務監察委員會發出的指引中規定的申報要求及申報責任。
- 2 持有大額未平倉合約的人士（如客戶）可選擇直接向交易所提交大額未平倉合約報告，或透過交易所參與者提交。如該人士在多於一個交易所參與者持倉，即使個別帳戶的持倉未必超出大額未平倉合約水平，該客戶可指示任何或所有交易所參與者代其向交易所申報大額未平倉合約，使得已申報的持倉總數代表該客戶的持倉總數。
- 3 任何人士持有交易所合約超出大額未平倉合約申報水平並直接向交易所提交大額未平倉合約報告（而非透過交易所參與者提交），須根據以上程序作出申報。