

期貨結算所規則及程序

附錄 A

費用

說明

金額¹

結算費(期貨)及行使費(期權)

股票指數產品

恆指期貨	每張10.00元
恆指期權	每張10.00元
小型恆指期貨	每張3.50元
小型恆指期權	每張2.00元
恆生國企指數期貨	每張3.50元
恆生國企指數期權	每張3.50元
小型恆生國企指數期貨	每張2.00元
新華富時中國25指數期貨	每張5.00元
新華富時中國25指數期權	每張5.00元
恆生中國H股金融行業指數期貨	每張5.00元
<u>恆指股息點指數期貨</u>	每張3.00元
<u>恆生國企股息點指數期貨</u>	每張1.50元

於期交所自動電子交易系統（「HKATS 電子交易系統」）內買賣的期貨／期權合約的結算所程序

第二章 交收程序

2.3.1 期貨合約

2.3.1.1 (c)

若於收市前最後兩分鐘期間並無任何交易或配對之買賣價，或期貨結算所根據(b)段所述認為應遵從本(c)段的程序，則期貨結算所會參考相關工具或商品價格及以下各項來釐定收市價：

- (1) 期貨合約於最後兩分鐘交易期間之前的最後交易價；
- (2) 若最後兩分鐘交易期間之前並無任何成交，則參考上一個營業日該期貨合約較現貨月期貨合約的溢價／折讓價；

- (3) 若該期貨合約較現貨月期貨合約的溢價／折讓價於上一個營業日並不存在，則參考有關市場莊家所提供的其他資料。

當期貨結算所釐定收市價時，判斷出參考相關工具或商品價格為不恰當，便將會考慮參考以下而釐定收市價：

- (1) 期貨合約交易價於最後兩分鐘之交易時段；
- (2) 若該期貨合約當日於最後兩分鐘之交易時段並無成交，則採用上一個交易日的結算價；及
- (3) 若該期貨合約於上一個交易日並無結算價，便參考相關莊家提供之有關資訊。