

第八章

交易安排 – 慣例及系統

815A. 交易所參與者如執行大手交易，必須確保符合下列條件：

(2) 最低交易量要求

- (a) 在規則第815A(2A)條的規限下，交易所參與者不得以大手交易的方式執行任何買賣盤，除非該買賣盤達到下列適用的最低交易量要求，及交易所參與者接獲指示或獲特別授權以大手交易的方式執行該買賣盤：

交易所合約	最低交易量要求 (合約數量)
貨幣期貨 (小型美元兌 人民幣 (香港) 期貨 除外)	50
小型美元兌人民幣 (香港) 期貨	100

## 附錄 B - 費用

說明		金額 <sup>1</sup>
<b>本交易所交易費</b>		
澳元兌人民幣（香港）期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 5.00 元 每張人民幣 5.00 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
歐元兌人民幣（香港）期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 5.00 元 每張人民幣 5.00 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
印度盧比兌人民幣（香港）期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 2.50 元 每張人民幣 2.50 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
日圓兌人民幣（香港）期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 5.00 元 每張人民幣 5.00 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
美元兌人民幣(香港)期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 8.00 元 每張人民幣 1.60 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協

<sup>1</sup>除另有註明外，本附錄所列之金額均以港元計算

		定的較低金額
小型美元兌人民幣（香港）期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 1.60 元 每張人民幣 1.60 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
人民幣（香港）兌美元期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張 0.60 美元 每張 0.60 美元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
印度盧比兌美元期貨	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張 0.60 美元 每張 0.60 美元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額
美元兌人民幣（香港）期權	公司/客戶賬戶 莊家帳戶	每張人民幣 8.00 元 每張人民幣 8.00 元 或 本交易所與相關交易所參與者可能不時協定的較低金額

澳元兌人民幣（香港）期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於澳元兌人民幣（香港）期貨合約：

合約金額	80,000 澳元
交易時間 （香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越 下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至 下午 12 時 30 分
最後交易日的交易 時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至 11 時正
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，以所有合約月份合 約淨額合共 12,000 張為限，及  每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張 為限

歐元兌人民幣（香港）期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於歐元兌人民幣（香港）期貨合約：

合約金額	50,000 歐元
交易時間 （香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的交易時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至 11 時正
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限，及  每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限

印度盧比兌人民幣（香港）期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於印度盧比兌人民幣（香港）期貨合約：

合約金額	2,000,000 印度盧比
合約月份	現月、下五個月及之後的兩個季月（即三月、六月、九月及十二月）。行政總裁可經諮詢證監會而不時增設其認為合適的合約月份以供交易。
交易時間 （香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的交易 時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 3 時正  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 30,000 張為限，及  每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 30,000 張為限

日圓兌人民幣（香港）期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於日圓兌人民幣（香港）期貨合約：

合約金額	6,000,000 日圓
交易時間 （香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的交易 時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至 11 時正
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限，及  每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限

美元兌人民幣（香港）期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於美元兌人民幣（香港）期貨合約：

合約金額	100,000 美元
立約成價	由結算所登記的每張美元兌人民幣（香港）期貨合約價格
交易時間 （香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的交易時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至 11 時正
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值 8,000（長倉或短倉）為限；及  每名客戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值 8,000（長倉或短倉）為限  就此而言，（i）小型美元兌人民幣（香港）期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約及（ii）人民幣（香港）兌美元期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約的對沖值等值計算如下：

倉位	等值對沖值
一張長倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張短倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	-0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約

直至最後交易日（包括該日）的五個香港營業日內，現月美元兌人民幣（香港）期貨及現月美元兌人民幣（香港）期權持倉對沖值不可超過2,000（長倉或短倉）

小型美元兌人民幣（香港）期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於小型美元兌人民幣（香港）期貨合約：

合約金額	20,000 美元
合約月份	現月、下三個月及之後的六個季月（即三月、六月、九月及十二月）。行政總裁可經諮詢證監會而不時增設其認為合適的合約月份以供交易。
報價	每美元兌人民幣（如 1 美元兌人民幣 6.2486 元）
最低波幅	人民幣 0.0001 元（四個小數位）
最高波幅	按本交易所不時規定
價位值	人民幣 2 元
立約成價	由結算所登記的每張小型美元兌人民幣（香港）期貨合約價格
立約價值	立約成價乘以合約金額（如人民幣 6.2486 元 x 20,000）
交易時間 （香港時間）	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的交易 時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至 11 時正
交易方法	本交易所的自動電子交易系統（HKATS 電子交易系統）

## 持倉限額

每名交易所參與者就其本身賬戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值**8,000**（長倉或短倉）為限；及

每名客戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值**8,000**（長倉或短倉）為限

就此而言，（i）小型美元兌人民幣（香港）期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約及（ii）人民幣（香港）兌美元期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約的對沖值等值計算如下：

倉位	等值對沖值
一張長倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張短倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	-0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約

## 大額未平倉合約

於任何一個合約月份，每名交易所參與者就其本身賬戶而言為**2,500**張未平倉合約；及

於任何一個合約月份，每名客戶為 **2,500** 張未平倉合約

## 結算方式

以現金結算合約

## 結算貨幣

人民幣

## 最後結算日

最後交易日後第一個香港營業日

## 最後交易日

合約月份的第三個星期三之前兩個香港營業日

最後結算價	由香港財資市場公會在最後交易日上午 11 時 30 分左右公佈的美元兌人民幣（香港）即期匯率。在個別情況下，期交所行政總裁有權根據《貨幣期貨合約交易規例》釐定最後結算價	
交易費 (每張合約單邊計算)	期交所費用 以上金額不時可予更改	人民幣1.60元
徵費 (每張合約單邊計算)	投資者賠償徵費須按「條例」不時規定的收費率或金額繳付	
佣金	商議	

人民幣（香港）兌美元期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於人民幣（香港）兌美元期貨合約：

合約金額	人民幣 300,000 元
交易時間 (香港時間)	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分（日間交易時段） 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正（收市後交易時段）  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的交易時間（香港時間）	上午 8 時 30 分至 11 時正
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值 8,000（長倉或短倉）為限；及  每名客戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值 8,000（長倉或短倉）為限  就此而言，（i）小型美元兌人民幣（香港）期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約及（ii）人民幣（香港）兌美元期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約的對沖值等值計算如下：

倉位	等值對沖值
一張長倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張短倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	-0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約

無論在任何時間，所有合約月份的人民幣（香港）兌美元期貨合約淨額之倉位不可超過 16,000 張（長倉或短倉）

印度盧比兌美元期貨  
合約細則

以下合約細則將適用於印度盧比兌美元期貨合約：

合約金額	2,000,000 印度盧比
合約月份	現月、下五個月及之後的兩個季月 (即三月、六月、九月及十二月)。行政總裁可經諮詢證監會而不時增設其認為合適的合約月份以供交易。
交易時間 (香港時間)	上午 8 時 30 分至下午 4 時 30 分 (日間交易時段) 下午 5 時 15 分至翌日凌晨 3 時正 (收市後交易時段)  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
最後交易日的 交易時間 (香港時間)	上午 8 時 30 分至下午 3 時正  聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越下午 12 時 30 分。該三天的交易時間為上午 8 時 30 分至下午 12 時 30 分
持倉限額	每名交易所參與者就其本身賬戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 30,000 張為限，及  每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 30,000 張為限

美元兌人民幣（香港）期權  
合約細則

以下合約細則將適用於美元兌人民幣（香港）期權合約：

合約金額 100,000 美元

持倉限額 每名交易所參與者就其本身賬戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值 8,000（長倉或短倉）為限；及

每名客戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨、小型美元兌人民幣（香港）期貨、人民幣（香港）兌美元期貨和美元兌人民幣（香港）期權合約加總，以所有合約月份持倉合共對沖值 8,000（長倉或短倉）為限

就此而言，（i）小型美元兌人民幣（香港）期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約及（ii）人民幣（香港）兌美元期貨合約和美元兌人民幣（香港）期貨合約的對沖值等值計算如下：

倉位	等值對沖值
一張長倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉小型美元兌人民幣（香港）期貨合約	0.2 張短倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約
一張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約	-0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約

直至到期日（包括該日）的五個香港營業日內，現月美元兌人民幣（香港）期貨及現月美元兌人民幣（香港）期權持倉合共對沖值不可超過 2,000（長倉或短倉）