

期交所規則、規例及程序

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)
MSCI中國A50互聯互通(美元)指數期貨	25
<u>MSCI中國(美元)指數期貨</u>	<u>50</u>
<u>MSCI中國淨總回報(美元)指數期貨</u>	<u>25</u>
MSCI中國自由(美元)指數期貨	50

附錄 B - 費用

說明		金額 ¹
本交易所交易費		
MSCI 中國 A50 互聯互通 (美元) 指數期貨	公司/客戶賬戶 莊家賬戶	每張 1.00 美元 每張 0.50 美元 或 本交易所與相關交易所參與者不時協定的較低金額
<u>MSCI 中國 (美元) 指數期貨</u>	<u>公司/客戶賬戶</u> <u>莊家賬戶</u>	<u>每張 1.00 美元</u> <u>每張 0.50 美元</u> 或 <u>本交易所與相關交易所參與者不時協定的較低金額</u>
<u>MSCI 中國淨總回報 (美元) 指數期貨</u>	<u>公司/客戶賬戶</u> <u>莊家賬戶</u>	<u>每張 0.60 美元</u> <u>每張 0.30 美元</u> 或 <u>本交易所與相關交易所參與者不時協定的較低金額</u>
MSCI 中國自由(美元)指數期貨	公司/客戶賬戶 莊家賬戶	每張 1.00 美元 每張 0.50 美元 或 本交易所與相關交易所參與者不時協定的較低金額

¹除另有註明外，本附錄所列之金額均以港元計算

MSCI中國（美元）指數期貨
合約細則

以下合約細則將適用於 MSCI 中國（美元）指數期貨合約：

<u>相關指數／指數</u>	<u>MSCI 中國指數（由 MSCI 有限公司編纂、計算及發布的美元指數）</u>
<u>交易貨幣</u>	<u>美元</u>
<u>合約乘數</u>	<u>每個指數點 500 美元</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下月及之後的四個季月（季月指 3 月、6 月、9 月及 12 月）</u>
<u>最低波幅</u>	<u>0.02 個指數點</u>
<u>最高波幅</u>	<u>按本交易所不時規定</u>
<u>立約成價</u>	<u>MSCI 中國（美元）指數期貨合約在結算所登記的價格</u>
<u>立約價值</u>	<u>立約成價乘以合約乘數</u>
<u>持倉限額</u>	<u>每名交易所參與者就其本身而言，所有合約月份長短倉淨額 35,000 張合約為限；及</u> <u>每名客戶而言，所有合約月份長短倉淨額 35,000 張合約為限</u> <u>為免生疑問，所有合約月份訂明的上限按淨額基準計算。為確定是否達到規定上限，不論到期日，長倉合約獲分配正數 1，短倉合約獲分配負數 1</u>
<u>大額未平倉合約</u>	<u>於任何一個合約月份，每名交易所參與者就其本身而言為 500 張未平倉合約；及</u>

於任何一個合約月份，每名客戶為 500 張未平倉合約

交易時間
(香港時間)

上午 9 時正至下午 4 時 30 分 (日間交易時段)
下午 5 時 15 分至凌晨 3 時正 (收市後交易時段)

聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕中午 12 時 30 分後不進行交易。該三天的交易時間為上午 9 時正至中午 12 時 30 分

在英國及美國銀行假期不設收市後交易時段

最後交易日的交易時間
(香港時間)

上午 9 時正至下午 4 時 30 分

聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕中午 12 時 30 分後不進行交易。該三天的交易時間為上午 9 時正至中午 12 時 30 分

交易方法

本交易所的自動電子交易系統 (HKATS 電子交易系統)

最後結算日

釐定最後結算價格之後的營業日

結算方式

以現金 (美元) 結算合約差價

最後交易日

緊接合約月份最後營業日之前一個營業日，前提是該日是指數所有成份股都可供買賣的一般營業日。若當日並非一般營業日，則以該日的前一個一般營業日作為最後交易日

最後結算價格

MSCI 中國 (美元) 指數期貨合約最後結算價格由結算所釐定，將為合約月份的最後交易日的 MSCI 中國指數的官方收報指數價值，若第三個小數位的數字是 5 或大於 5，則四捨五入上調至最接近的兩個小數位，如第三個小數位的數字小於 5，則四捨五入下調至最接近的兩個小數位。若干情況下，本交易所行政總裁有權根據買賣股票指數期貨合約規例釐定最後結算價

<u>交易費</u> <u>(每張合約單邊計算)</u>	<u>期交所費用</u> <u>1.00 美元</u>
	<u>以上金額不時可予更改</u>
<u>徵費</u> <u>(每張合約單邊計算)</u>	<u>證監會徵費及投資者賠償徵費須按「條例」不時規定的收費率或金額繳付</u>
<u>佣金</u>	<u>商議</u>

MSCI 中國淨總回報（美元）指數期貨
合約細則

以下合約細則將適用於 MSCI 中國淨總回報（美元）指數期貨合約：

<u>相關指數／指數</u>	<u>MSCI 中國淨總回報指數（由 MSCI 有限公司編纂、計算及發布的美元總回報淨額指數）</u>
<u>交易貨幣</u>	<u>美元</u>
<u>合約乘數</u>	<u>每個指數點 50 美元</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下月及之後的四個季月（季月指 3 月、6 月、9 月及 12 月）</u>
<u>最低波幅</u>	<u>0.001 個指數點</u>
<u>最高波幅</u>	<u>按本交易所不時規定</u>
<u>立約成價</u>	<u>MSCI 中國淨總回報（美元）指數期貨合約在結算所登記的價格</u>
<u>立約價值</u>	<u>立約成價乘以合約乘數</u>
<u>持倉限額</u>	<u>每名交易所參與者就其本身而言，所有合約月份長短倉淨額 53,000 張合約為限；及</u> <u>每名客戶而言，所有合約月份長短倉淨額 53,000 張合約為限</u> <u>為免生疑問，所有合約月份訂明的上限按淨額基準計算。為釐定是否達到規定上限，不論到期日，長倉合約獲分配正數 1，短倉合約則獲分配負數 1</u>

<u>大額未平倉合約</u>	<u>於任何一個合約月份，每名交易所參與者就其本身而言為 500 張未平倉合約；及</u> <u>於任何一個合約月份，每名客戶為 500 張未平倉合約</u>
<u>交易時間</u> <u>(香港時間)</u>	<u>上午 9 時正至下午 4 時 30 分 (日間交易時段)</u> <u>下午 5 時 15 分至凌晨 3 時正 (收市後交易時段)</u> <u>聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕中午 12 時 30 分後不進行交易。該三天的交易時間為上午 9 時正至中午 12 時 30 分</u> <u>在英國及美國銀行假期不設收市後交易時段</u>
<u>最後交易日的交易時間</u> <u>(香港時間)</u>	<u>上午 9 時正至下午 4 時 30 分</u> <u>聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕中午 12 時 30 分後不進行交易。該三天的交易時間為上午 9 時正至中午 12 時 30 分</u>
<u>交易方法</u>	<u>本交易所的自動電子交易系統 (HKATS 電子交易系統)</u>
<u>最後結算日</u>	<u>釐定最後結算價格之後的營業日</u>
<u>結算方式</u>	<u>以現金 (美元) 結算合約差價</u>
<u>最後交易日</u>	<u>合約月份的第三個星期五。如非營業日，則為前一個營業日</u>
<u>最後結算價格</u>	<u>MSCI 中國淨總回報 (美元) 指數期貨合約最後結算價格由結算所釐定，將為合約月份的第三個星期五的 MSCI 中國淨總回報指數的官方收報指數價值，若第四個小數位的數字是 5 或大於 5，則四捨五入上調至最接近的三個小數位，如第四個小數位的數字小於 5，則四捨五入下調至最接近的三個小數位；若 MSCI 有限公司宣布有與 MSCI 中國淨總回報指數相關的非預期的市場關</u>

閉事件，則為 MSCI 有限公司在合約月份的第三個星期五後公布的 MSCI 中國淨總回報指數最終非預期市場關閉指數水平

儘管如此，若干情況下，本交易所行政總裁有權根據買賣股票指數期貨合約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 0.60 美元

以上金額不時可予更改

徵費
(每張合約單邊計算)

證監會徵費及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