

期交所規則、規例及程序

於本交易所的自動電子交易系統(「HKATS 電子交易系統」)買賣貨幣期貨及貨幣期權的交易程序

第三章

貨幣期貨合約莊家

3.2 莊家的莊家活動要求

莊家如欲享有莊家獎勵(在適用情況下就其本身及在如有情況就其每項根據有關莊家執照作出的莊家活動安排)，該莊家(在適用情況下就其本身)及每項所述的莊家活動安排分別須符合本程序第 3.2 條所述的莊家活動要求。程序第 3.2 條、3.3 條及 3.4 條所指「莊家」、「主要莊家」或「輔助莊家」因而將理解為「該莊家、該主要莊家或該輔助莊家(在適用情況下就其本身)及其每項根據有關莊家執照作出的莊家活動安排」，或如文意另有要求，則指其中任何一項

3.2.1 貨幣期貨合約主要莊家的莊家活動要求

3.2.1.1 每名主要莊家須於其委任信指定的以下一段或兩段期間內：
(i)上午 9 時至日間交易時段結束時；及／或(ii)收市後交易時段，就其委任為主要莊家的每隻貨幣期貨合約：

3.2.1.1.2 就指定合約月份提供報價，買賣差價須不大於最低價格波幅，涉及合約數目不少於下述適用於其莊家活動時間的數字：

由上午 9 時至日間交易時段結束期間：

貨幣期貨合約	合約月份	最高買賣差價 (最低價格波幅)	報價最低合約數目
美元兌人民幣 (香港)	第三及第四個月	50	10
美元兌人民幣 (香港)	第一、第二、第三及第四個季月	80	10
美元兌人民幣 (香港)	第五個季月	100	10

人民幣（香港）兌美元	第三及第四個月	10	10
人民幣（香港）兌美元	第一、第二、第三、第四及第五個季月	15	10

收市後交易時段：

貨幣期貨合約	合約月份	最高買賣差價 (最低價格波幅)	報價最低合約數目
美元兌人民幣（香港）	第三及第四個月	60	10
美元兌人民幣（香港）	第一、第二、第三、第四及第五個季月	100	10
人民幣（香港）兌美元	第三及第四個月	10	10
人民幣（香港）兌美元	第一、第二、第三、第四及第五個季月	15	10

3.2.2 貨幣期貨合約輔助莊家的莊家活動要求

3.2.2.2 回應報價要求

倘貨幣期貨合約輔助莊家選擇回應報價要求，其須於其委任信指定的以下一段或兩段期間內：(i)上午 9 時至日間交易時段結束時；及／或(ii)收市後交易時段：

3.2.2.2.3 就貨幣期貨合約中指定合約月份的報價要求作出回應而報價，惟除行政總裁不時另有指定外，買賣差價須不大於最低價格波幅，涉及合約數目不少於下述數字：

貨幣期貨合約	合約月份	最高買賣差價 (最低價格波幅)	報價最低合約數目
人民幣（香港）兌美元	第一、第二、第三、第四及第五個季月	15	10

3.2.2.3 提供持續報價

倘貨幣期貨合約輔助莊家選擇提供持續報價，其須：

3.2.2.3.2 就貨幣期貨合約指定合約月份提供報價，買賣差價須不大於最低價格波幅，涉及合約數目不少於下述適用於其莊家活動時間的數字：

由上午 9 時至日間交易時段結束期間：

<u>貨幣期貨合約</u>	<u>合約月份</u>	<u>最高買賣差價 (最低價格波幅)</u>	<u>報價最低合約數目</u>
人民幣(香港)兌美元	第一、第二、第三、第四及第五個季月	15	10

收市後交易時段：

<u>貨幣期貨合約</u>	<u>合約月份</u>	<u>最高買賣差價 (最低價格波幅)</u>	<u>報價最低合約數目</u>
人民幣(香港)兌美元	第一、第二、第三、第四及第五個季月	15	10

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
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 10 人民幣兌美元（如 10 人民幣兌 1.5288 美元）

美元兌人民幣（香港）期權的
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
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
價位值	人民幣 10 元