

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)
股票指數期貨 ^{註3}	100
<u>恒生科技指數期貨</u>	<u>50</u>

附錄 B - 費用

說明

金額

1

本交易所交易費

小型恒指期貨	公司 / 客戶賬戶 莊家賬戶 恒指期權、 每周恒指期權或 小型恒指期權的莊家 ²	每張3.50元 每張0.50元 每張1.00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
小型恒指期權	公司 / 客戶賬戶 莊家賬戶 恒指期權、 每周恒指期權或 小型恒指期貨的莊家 ²	每張2.00元 每張0.40元 每張0.70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
<u>恒生科技指數期貨</u>	<u>公司 / 客戶賬戶</u> <u>莊家賬戶</u>	<u>每張5.00元</u> <u>每張1.00元</u> 或 <u>本交易所與相關交易</u> <u>所參與者可能不時協</u> <u>定的較低金額</u>

¹除另有註明外，本附錄所列之金額均以港元計算

²合資格繳交較少本交易所交易費的合約數目可能有限，並在此等規則所載有關股票指數期貨及股票指數期權的程序中註明

恒生科技指數期貨
的
合約細則

以下合約細則將適用於恒生科技指數期貨合約:

<u>相關指數／指數</u>	<u>恒生科技指數 (由恒生指數有限公司編纂、計算及發放的股份價格指數) *</u>
<u>合約乘數</u>	<u>每個指數點 50 港元*</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下月及之後的兩個季月(季月指3月、6月、9月及12月)</u>
<u>最低波幅</u>	<u>一個指數點</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>在結算所登記，以完整指數點計算的恒生科技指數期貨合約的價格</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，以恒生科技指數期貨及期權所有合約月份持倉合共對沖值21,000張長倉或短倉為限；及</u> <u>交易所參與者的每名客戶而言，以恒生科技指數期貨及期權所有合約月份持倉合共對沖值21,000張長倉或短倉為限。</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賬戶而言為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>開市前議價時段 (香港時間)</u>	<u>上午八時四十五分至上午九時十五分及</u> <u>中午十二時三十分至下午一時正</u>
<u>交易時間 (香港時間)</u>	<u>上午九時十五分至中午十二時正 (早市)</u> <u>下午一時正至下午四時三十分 (午市)</u> <u>下午五時十五分至凌晨三時正 (收市後交易時段)</u>

聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕均不設午市或收市後交易時段。該三天的早市交易時間為上午九時十五分至下午十二時三十分。

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)

上午九時十五分至中午十二時正(早市)及下午一時正至下午四時正(午市)

若最後交易日為聖誕前夕、新年前夕或農曆新年前夕，當天不設午市或收市後交易時段。

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

最後交易日之後的第一個營業日

結算方式

以現金結算合約

最後交易日

緊接合約月份最後營業日之前一個營業日

最後結算價格

恒生科技指數期貨合約最後結算價格由結算所釐定，並採用恒生科技指數(由恒生指數有限公司編纂、計算及發放)在最後交易日當天下列時間所報指數點的平均數為依歸，下調至最接近的整數指數點*：(i)聯交所持續交易時段開始後的五(5)分鐘起直至持續交易時段完結前的五(5)分鐘止期間每隔五(5)分鐘所報的指數點，與(ii)聯交所收市時。在個別情況下，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 5.00 港元

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

* 與恒生科技指數期權合約相同