

期交所規則、規例及程序

附錄 B - 費用

說明

金額¹

本交易所交易費

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 <u>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>
<u>歐元兌人民幣（香港）期貨</u>	<u>公司/客戶賬戶 莊家帳戶</u>	<u>每張人民幣 5.00 元 每張人民幣 5.00 元</u> 或 <u>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>
<u>澳元兌人民幣（香港）期貨</u>	<u>公司/客戶賬戶 莊家帳戶</u>	<u>每張人民幣 5.00 元 每張人民幣 5.00 元</u> 或 <u>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>
<u>日圓兌人民幣（香港）期貨</u>	<u>公司/客戶賬戶 莊家帳戶</u>	<u>每張人民幣 5.00 元 每張人民幣 5.00 元</u> 或 <u>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>
<u>人民幣（香港）兌美元期貨</u>	<u>公司/客戶賬戶 莊家帳戶</u>	<u>每張 0.60 美元 每張 0.60 美元</u> 或 <u>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>

買賣貨幣期貨合約規例

流通量條款

028 不論《規則》有任何其他規定，本交易所所有絕對酌情權，可不時委任交易所參與者隨時按雙方同意的條件及條款在貨幣期貨市場就貨幣期貨合約提供流通量。為釋疑起見，特此聲明：任何委任條件及條款(包括提供流通量的項目、有關安排及規定、本交易所的費用優惠及/或參與者符合流通量提供規定之後可享的其他優惠等)均是由本交易所與相關交易所參與者商議達成，因此不同交易所參與者的委任條件及條款或不盡相同。

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

3.2.1.2.3 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，惟除本交易所不時另有指定外，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
美元兌人民幣 (香港)	現月及下一個月	<u>3020</u>	<u>10</u>
美元兌人民幣 (香港)	第三及第四個月	<u>50</u>	<u>10</u>
美元兌人民幣 (香港)	其他月份	<u>80</u>	<u>10</u>
歐元兌人民幣 (香港)、 澳元兌人民幣 (香港)、 日圓兌人民幣 (香港)	現月及下一個月	<u>50</u>	<u>10</u>
歐元兌人民幣 (香港)、 澳元兌人民幣 (香港)、 日圓兌人民幣 (香港)	其他月份	<u>100</u>	<u>10</u>
人民幣(香港) 兌美元	現月及下一個月	<u>5</u>	<u>10</u>
人民幣(香港) 兌美元	第三及第四個月	<u>10</u>	<u>10</u>
人民幣(香港) 兌美元	其他月份	<u>15</u>	<u>10</u>

3.2.1.3.2 就貨幣期貨合約制定合約月份提供的報價，惟除本交易所不時另有指定外，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
美元兌人民幣 (香港)	現月及下一個月	3020	10
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)	其他月份	80	10
歐元兌人民幣 (香港)、 澳元兌人民幣 (香港)、 日圓兌人民幣 (香港)	現月及下一個月	50	10
歐元兌人民幣 (香港)、 澳元兌人民幣 (香港)、 日圓兌人民幣 (香港)	其他月份	100	10
人民幣(香港) 兌美元	現月及下一個月	5	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	其他月份	15	10

買賣貨幣期貨合約規例

釋義

「立約成價」	指 在結算所登記的貨幣期貨合約價格或，如有不同，按合約細則所規定的價格；
「最後結算價值」	指 最後結算價格乘以合約金額或，如有不同，按合約細則所規定的價格；
「價位值」	指 最低波幅乘以合約金額的價值；或，如有不同，按合約細則所規定的價格；

美元兌人民幣（香港）期貨的合約細則

以下合約細則將適用於美元兌人民幣（香港）期貨合約：

合約月份	現月、下三個月及之後的 <u>四三</u> 個季月（即三月、六月、九月即十二月）。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。
持倉限額	<p>每名交易所參與者就其本身賬戶而言，<u>美元兌人民幣（香港）期貨和人民幣（香港）兌美元期貨加總，以所有合約月份合約淨額 8,000 張未平倉美元兌人民幣（香港）期貨合約為限。計算持倉限額時，每張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於 0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約，每張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於-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，現貨月未平倉美元兌人民幣（香港）期貨合約不超過 2,000 張未平倉合約。直至最後交易日（包括該日）的五個香港營業日內，所有合約月份合約淨額 8,000 張，及現貨月未平倉合約不超過 2,000 張；</u></p> <p>每名客戶而言，<u>美元兌人民幣（香港）期貨和人民幣（香港）兌美元期貨加總，以所有合約月份合約淨額 8,000 張未平倉美元兌人民幣（香港）期貨合約為限。計算持倉限額時，每張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於 0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約，每張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於-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，現貨月未平倉美元兌人民幣（香港）期貨合約不超過 2,000 張未平倉合約。直至最後交易日（包括該日）的五個香港營業日內，所有合約月份合約淨額 8,000 張，及現貨月未平倉合約不超過 2,000 張</u></p>
最後結算價	最後交易日上午 11 時 15 分由財資市場公會公布的美元兌人民幣（香港）即期匯率定盤。 <u>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</u>
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

**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：

<u>合約金額</u>	<u>50,000 歐元</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下一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。</u>
<u>報價</u>	<u>每歐元兌人民幣（如 1 歐元兌人民幣 6.8028 元）</u>
<u>最低波幅</u>	<u>人民幣 0.0001 元（四個小數位）</u>
<u>最高波幅</u>	<u>按本交易所不時規定</u>
<u>價位值</u>	<u>人民幣 5 元</u>
<u>立約成價</u>	<u>由結算所登記的每張歐元兌人民幣（香港）期貨合約價格</u>
<u>立約價值</u>	<u>立約成價乘以合約金額（如人民幣 6.8028 元 x 50,000）</u>
<u>交易時間 （香港時間）</u>	<u>上午 9 時至下午 4 時 15 分（日間交易時段） 下午 5 時至下午 11 時 45 分（收市後交易時段）</u> <u>聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越正午 12 時正。該三天的交易時間為上午 9 時正至正午 12 時正（香港時間）</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>上午 9 時正至 11 時正（香港時間）</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>持倉限額</u>	<u>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</u> <u>每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限</u>

<u>大額未平倉合約</u>	<u>每名交易所參與者就其本身賬戶而言，於任何一個合約月份，500張未平倉合約為限，及</u> <u>每名客戶而言，於任何一個合約月份，500張未平倉合約為限</u>
<u>結算方式</u>	<u>以現金結算合約</u>
<u>結算貨幣</u>	<u>人民幣</u>
<u>最後結算日</u>	<u>最後交易日後第一個香港營業日</u>
<u>最後交易日</u>	<u>合約月份的第三個星期三之前兩個香港營業日</u>
<u>最後結算價</u>	<u>歐元兌人民幣（香港）期貨合約的最終結算價是由結算所釐定，以 WM/Reuters 上午 11 時（香港時間）歐元兌美元的即期匯率價乘以香港財資市場公會上午 11 時 15 分（香港時間）公佈的美元兌人民幣（香港）即期匯率定盤價，並以四捨五入法準確至四個小數位。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</u>
<u>交易費</u> <u>(每張合約單邊計算)</u>	<u>期交所費用</u> <u>人民幣5.00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>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>

**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：

<u>合約金額</u>	<u>80,000 澳元</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下一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。</u>
<u>報價</u>	<u>每澳元兌人民幣（如 1 澳元兌人民幣 4.6942 元）</u>
<u>最低波幅</u>	<u>人民幣 0.0001 元（四個小數位）</u>
<u>最高波幅</u>	<u>按本交易所不時規定</u>
<u>價位值</u>	<u>人民幣 8 元</u>
<u>立約成價</u>	<u>由結算所登記的每張澳元兌人民幣（香港）期貨合約價格</u>
<u>立約價值</u>	<u>立約成價乘以合約金額（如人民幣 4.6942 元 x 80,000）</u>
<u>交易時間 （香港時間）</u>	<u>上午 9 時至下午 4 時 15 分（日間交易時段） 下午 5 時至下午 11 時 45 分（收市後交易時段）</u> <u>聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越正午 12 時正。該三天的交易時間為上午 9 時正至正午 12 時正（香港時間）</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>上午 9 時正至 11 時正（香港時間）</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>持倉限額</u>	<u>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</u> <u>每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限</u>
<u>大額未平倉合約</u>	<u>每名交易所參與者就其本身賬戶而言，於任何一個合約月份，500 張未平倉合約為限，及</u> <u>每名客戶而言，於任何一個合約月份，500 張未平倉合約為限</u>

<u>結算方式</u>	<u>以現金結算合約</u>
<u>結算貨幣</u>	<u>人民幣</u>
<u>最後結算日</u>	<u>最後交易日後第一個香港營業日</u>
<u>最後交易日</u>	<u>合約月份的第三個星期三之前兩個香港營業日</u>
<u>最後結算價</u>	<u>澳元兌人民幣(香港)期貨合約的最終結算價是由結算所釐定，以 WM/Reuters 上午 11 時(香港時間) 澳元兌美元的即期匯率價乘以香港財資市場公會上午 11 時 15 分(香港時間)公佈的美元兌人民幣(香港)即期匯率定盤價，並以四捨五入法準確至四個小數位。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</u>
<u>交易費</u> <u>(每張合約單邊計算)</u>	<u>期交所費用</u> <u>人民幣5.00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>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>

**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：

<u>合約金額</u>	<u>6,000,000 日圓</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下一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。</u>
<u>報價</u>	<u>每 100 日圓兌人民幣（如 100 日圓兌人民幣 5.5923 元）</u>
<u>最低波幅</u>	<u>人民幣 0.0001 元（四個小數位）</u>
<u>最高波幅</u>	<u>按本交易所不時規定</u>
<u>價位值</u>	<u>人民幣 6 元</u>
<u>立約成價</u>	<u>由結算所登記的每張日圓兌人民幣（香港）期貨合約價格</u>
<u>立約價值</u>	<u>立約成價除以 100，再乘以合約金額 (如人民幣 5.5923 元 / 100 x 6,000,000)</u>
<u>交易時間 (香港時間)</u>	<u>上午 9 時至下午 4 時 15 分（日間交易時段） 下午 5 時至下午 11 時 45 分（收市後交易時段）</u> <u>聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超越正午 12 時正。該三天的交易時間為上午 9 時正至正午 12 時正（香港時間）</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>上午 9 時正至 11 時正（香港時間）</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>持倉限額</u>	<u>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</u> <u>每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 12,000 張為限</u>
<u>大額未平倉合約</u>	<u>每名交易所參與者就其本身賬戶而言，於任何一個合約月份，500 張未平倉合約為限，及</u>

每名客戶而言，於任何一個合約月份，500張未平倉合約為限

結算方式
結算貨幣

以現金結算合約
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

日圓兌人民幣（香港）期貨合約的最終結算價是由結算所釐定，以 WM/Reuters 上午 11 時（香港時間）美元兌日圓的即期匯率價的倒數乘以 100，再乘以香港財資市場公會上午 11 時 15 分（香港時間）公佈的美元兌人民幣（香港）即期匯率定盤價，並以四捨五入法準確至四個小數位。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

最後結算值

最後結算價除以 100，再乘以合約金額（如人民幣 5.5923 元 / 100 x 6,000,000）

交易費
(每張合約單邊計算)

期交所費用 人民幣5.00元

以上金額不時可予更改

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：

<u>合約金額</u>	<u>人民幣 300,000 元</u>
<u>合約月份</u>	<u>現月、下三個月及之後的四個季月（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。</u>
<u>報價</u>	<u>每 10 人民幣兌美元（如 10 人民幣兌 1.5288 美元）</u>
<u>最低波幅</u>	<u>美元 0.0001（四個小數位）</u>
<u>最高波幅</u>	<u>按本交易所不時規定</u>
<u>價位值</u>	<u>美元 3 元</u>
<u>立約成價</u>	<u>由結算所登記的每張人民幣（香港）兌美元期貨合約價格</u>
<u>立約價值</u>	<u>立約成價除以 10，再乘以合約金額 (如美元 1.5288 元 / 10 x 300,000)</u>
<u>交易時間 (香港時間)</u>	<u>上午 9 時至下午 4 時 15 分（日間交易時段） 下午 5 時至下午 11 時 45 分 (收市後交易時段)</u> <u>聖誕節前夕、新年前夕及農曆新年前夕交易時段不會超 越正午 12 時正。該三天的交易時間為上午 9 時正至正午 12 時正（香港時間）</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>上午 9 時正至 11 時 正（香港時間）</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>持倉限額</u>	<u>每名交易所參與者就其本身賬戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨和人民幣（香港）兌美元期貨加總，以所有合約月份合約淨額 8,000 張未平倉美元兌人民幣（香港）期貨合約為限。計算持倉限額時，每張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於 0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約，每張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於-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</u>

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）

每名客戶而言，美元兌人民幣（香港）期貨和人民幣（香港）兌美元期貨加總，以所有合約月份合約淨額 8,000 張未平倉美元兌人民幣（香港）期貨合約為限。計算持倉限額時，每張短倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於 0.5 張長倉美元兌人民幣（香港）期貨合約，每張長倉人民幣（香港）兌美元期貨合約的倉位將等值於-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）

<u>大額未平倉合約</u>	<u>每名交易所參與者就其本身賬戶而言，於任何一個合約月份，500 張未平倉合約為限，及</u> <u>每名客戶而言，於任何一個合約月份，500 張未平倉合約為限</u>
<u>結算方式</u>	<u>以現金結算合約</u>
<u>結算貨幣</u>	<u>美元</u>
<u>最後結算日</u>	<u>最後交易日後第一個香港營業日</u>
<u>最後交易日</u>	<u>合約月份的第三個星期三之前兩個香港營業日</u>
<u>最後結算價</u>	<u>人民幣（香港）兌美元期貨合約的最終結算價是由結算所釐定，以最後交易日上午 11 時 15 分由財資市場公會公佈的美元兌人民幣（港元）即期匯率定盤的倒數乘以 10，並以四捨五入法準確至四個小數位。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</u>
<u>最後結算值</u>	<u>最後結算價除以 10，再乘以合約金額（如美元 1.5288 元 / 10 x 300,000）</u>
<u>交易費</u> <u>(每張合約單邊計算)</u>	<u>期交所費用</u> <u>0.60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>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>