

期交所規則、規例及程序

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、下三個月及之後的五六個季月（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。

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

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）	現月及下一個月	20	10
美元兌人民	第三及第四個	50	10

幣（香港）	月		
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）	其他月份第五個季月	100	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）	現月及下一個月	20	10
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）	其他月份第一、第二、第三、第四及第五個季月	100	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
美元兌人民幣（香港）	現月及下一個月	20	10
美元兌人民幣（香港）	第三及第四個月	50	10
美元兌人民幣	第一、第	80	10

幣（香港）	二、第三及第四個季月		
美元兌人民幣（香港）	其他月份第五個季月	100	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：

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	20	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）	第一、第二、第三及第四個季月	80	10
美元兌人民幣（香港）	其他月份第五個季月	100	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）	現月及下一個月	20	10
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）	其他月份第一、第二、第三、第四及第五個季月	100	10