

**五年期中國財政部國債期貨的
合約細則**

以下合約細則將適用於五年期中國財政部國債期貨合約：

相關債券	境內發行的五年期中國財政部國債，3%年度票面息率
合約金額	人民幣 500,000 元
合約月份	最近期的兩個季月（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。
報價	按照合約金額的百分比，以三個小數位報價
最低波幅	合約金額的 0.002%，即人民幣 10 元
最高波幅	按本交易所不時規定
立約成價	由結算所登記的五年期中國財政部國債期貨價格
立約價值	立約成價乘以合約金額，再除以 100（如 101.000 x 人民幣 500,000 元 / 100）
交易時間 （香港時間）	上午 9 時至中午 12 時（早市）及 下午 1 時至下午 4 時 30 分（午市） 聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕均不設午市交易 時段。該三天的交易時間為上午 9 時至中午 12 時
最後交易日的交易時間 （香港時間）	上午 9 時至中午 12 時（早市）及 下午 1 時至下午 4 時 30 分（午市） 聖誕前夕、新年前夕及農曆新年前夕均不設午市交易 時段。該三天的交易時間為上午 9 時至中午 12 時
交易方法	本交易所的自動電子交易系統(HKATS電子交易系統)

持倉限額	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 20,000 張為限；及 每名客戶而言，以所有合約月份合約淨額合共 20,000 張為限
大額未平倉合約	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 1,000 張未平倉合約；及 於任何一個合約月份，就每名客戶而言為 1,000 張未平倉合約
結算方式	以現金結算合約
結算貨幣	人民幣
最後結算日	最後交易日之後第二個香港營業日
最後交易日	合約月份的第二個星期五 如當天為香港或中國內地公眾假期，最後交易日為緊貼該日的前一個同屬香港及中國內地的營業日
最後結算價	五年期中國財政部國債期貨的最後結算價是由結算所釐定，以中央國債登記結算有限責任公司在最後交易日下午6時左右提供的五年期中國財政部國債籃子參考結算價，並以四捨五入法準確至三個小數位。
現金結算價值	最後結算價乘以合約金額，再除以100（如 最後結算價 x 人民幣 500,000元 / 100）
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)	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