

香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

HONG KONG FUTURES EXCHANGE LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項： 人民幣貨幣期貨的產品優化計劃

查詢： 禰先生 (電郵：ThomasHuen@hkex.com.hk；電話：2211-6761)

黃先生 (電郵：KennethKKWong@hkex.com.hk；電話：2840-3524)

香港期貨交易所有限公司(「交易所」)欣然宣佈以下有關美元兌人民幣(香港)、歐元兌人民幣(香港)、日圓兌人民幣(香港)、澳元兌人民幣(香港)和人民幣(香港)兌美元期貨合約(「人民幣貨幣期貨」)的產品優化計劃：

1. 延長人民幣貨幣期貨的交易時間；及
2. 推出兩級的美元兌人民幣(香港)期貨莊家計劃

(1) 延長人民幣貨幣期貨的交易時間

自 2017 年 7 月 10 日日間交易時段起，人民幣貨幣期貨日間交易時段的開市時間將由上午 9 時正更改至上午 8 時 30 分，收市後期貨交易時段的收市時間將由下午 11 時 45 分延長至翌日凌晨 1 時正。

根據現行做法，香港期貨結算有限公司(「期貨結算公司」)將在收市後期貨交易時段結束後提供 45 分鐘的後交易調整時段。因此，自 2017 年 7 月 11 日凌晨起(即 7 月 10 日晚收市後期貨交易時段後)，人民幣貨幣期貨的收市後期貨交易時段的結算服務，將由凌晨 12 時 30 分更改為凌晨 1 時 45 分。

參與者請留意期貨結算公司的後交易調整時段將仍然於上午 7 時 30 分開始。參與者應在上午 8 時

正前完成人民幣貨幣期貨前一個收市後期貨交易時段的後交易調整，以便該調整能納入日間交易時段開市前 30 分鐘進行的強制即日變價調整及按金計算中。

交易所強烈鼓勵參與者檢視其營運及後勤辦公室系統，以確保已就此產品優化計劃準備就緒。參與者請通知其員工和所有有興趣的客戶有關上述的人民幣貨幣期貨產品優化計劃。相關規則修訂將於另函通告。

(2) 推出兩級的美元兌人民幣 (香港) 期貨莊家計劃

交易所將於 2017 年 7 月 10 日 (日間時段) 起推出以下兩級的莊家計劃：

1. 主要莊家；及
2. 輔助莊家

相應的責任及獎勵計劃安排詳情如下：

	現有計劃	新推出的計劃 (自 2017 年 7 月 10 日 (日間時段) 起生效)	
	莊家	主要莊家	輔助莊家
指定合約月份	所有合約月份	所有合約月份	所有合約月份
交易時間	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 僅日間交易時段; 或 ▪ 日間交易時段及收市後期貨交易時段 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 僅日間交易時段; 或 ▪ 日間交易時段及收市後期貨交易時段 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ 僅日間交易時段; 或 ▪ 僅收市後期貨交易時段
報價要求	於一個月內提供持續報價達交易時段之 70% 或以上	於一個月內提供持續報價達交易時段之 70% 或以上	於一個月內提供持續報價達交易時段之 40% 或以上
最大的買賣盤差價	<ul style="list-style-type: none"> - 即月及下月：20 個點子 - 第三及第四個曆月：50 個點子 - 其他月份：80 個點子 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ <u>日間交易時段</u> <ul style="list-style-type: none"> - 即月及下月：20 個點子 - 第三及第四個曆月：50 個點子 - 下四個季月：80 個點子 - 其他月份：100 個點子 ▪ <u>收市後期貨交易時段</u> <ul style="list-style-type: none"> - 即月及下月：20 個點子 - 第三及第四個曆月：60 個點子 - 其他月份：100 個點子 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ <u>日間交易時段</u> <ul style="list-style-type: none"> - 即月及下月：20 個點子 - 第三及第四個曆月：50 個點子 - 下四個季月：80 個點子 - 其他月份：100 個點子 ▪ <u>收市後期貨交易時段</u> <ul style="list-style-type: none"> - 即月及下月：20 個點子 - 第三及第四個曆月：60 個點子 - 其他月份：100 個點子

	現有計劃	新推出的計劃 (自 2017 年 7 月 10 日 (日間時段) 起生效)	
	莊家	主要莊家	輔助莊家
開價盤所須涉及最少合約張數	不少於 10 張合約	不少於 10 張合約	不少於 10 張合約
獎勵	<ul style="list-style-type: none"> - 折扣後的交易費用：1.6 元人民幣 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ <u>僅日間交易時段</u> - 日間交易時段折扣後的交易費用：1.6 元人民幣 - 豁免一個程式界面分判牌照月費¹ ▪ <u>日間交易時段及收市後期貨交易時段</u> - 交易費豁免 - 豁免三個程式界面分判牌照的月費 - 豁免市場數據費用 	<ul style="list-style-type: none"> ▪ <u>僅日間交易時段</u> - 日間交易時段折扣後的交易費用：4 元人民幣 ▪ <u>僅收市後期貨交易時段</u> - 日間交易時段及收市後期貨交易時段折扣後的交易費用：1.6 元人民幣 - 豁免兩個程式界面分判牌照的月費 - 豁免市場數據費用

所有現有的美元兌人民幣 (香港) 期貨莊家將被分別告知上述兩級莊家計劃，並依據其意願自 2017 年 7 月 10 日起被聘任為主要莊家或輔助莊家。此外，此項新的莊家計劃現正開放申請。有興趣的參與者可聯絡莫先生(電郵：DennisMok@hkex.com.hk)或顧小姐 (電郵：Rinaku@hkex.com.hk)

市場發展科

定息及貨幣產品發展部主管

馬俊禮謹啟

本通告已以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本的字義或詞義與英文本有所出入，概以英文本為準

¹ 參照程式介面分判牌照月費的豁免，現時為每個程式介面每月2,600元港幣