

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: 人民幣貨幣期權 – 美元兌人民幣 (香港) 期權合約的交易及結算安排

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

趙先生 (電郵: MichaelZhao@hkex.com.hk; 電話: 2211-6122)

參照香港期貨交易所 (以下簡稱「交易所」) 於 2017 年 1 月 4 日 (編號: [MKD/FIC/001/17](#)) 有關推出美元兌人民幣 (香港) 期權合約之通告。交易所欣然宣佈人民幣貨幣期權 – 美元兌人民幣 (香港) 期權合約將於 **2017 年 3 月 20 日星期一** (「開始交易日」) 推出。

交易所參與者及結算所參與者需就以下交易及結算安排作出準備。

(1) 交易安排

開始交易前的安排

為方便市場參與者對美元兌人民幣 (香港) 期權合約的交易和結算作好準備，以下開始交易前的安排將於 2017 年 3 月 17 日星期五 (即開始交易日的前一個工作日) 進行：

- 甲、美元兌人民幣 (香港) 期權合約的交易代碼將於 HKATS 交易系統顯示，但尚未能交易；及
- 乙、美元兌人民幣 (香港) 期權合約的按金計算風險參數檔案、結算及未平倉合約報表亦會開始產生。

開始交易時之合約月份

在開始交易日，可供交易的美元兌人民幣 (香港) 期權合約月份為 2017 年 4 月、2017 年 5 月、2017 年 6 月、2017 年 7 月、2017 年 9 月、2017 年 12 月、2018 年 3 月及 2018 年 6 月。

大手交易的最低合約交易量和價格幅度限制

相對於每個合約月份，美元兌人民幣（香港）期權的大手交易最低合約交易量为 50 張。參照期交所規則第 815A(5)條，大手交易的執行價格必須公平合理，修訂後的價格幅度限制將按以下方式訂立：

甲、交易價格相當於該合約的最高成交價、最低成交價、買入價與賣出價或在此等價格範圍內；
或

乙、交易價格與參考價格（根據當時市場價格或（如有需要）按相關資產的理論價值釐定）之間相差幅度在下述範圍內：

參考價格	價格幅度
小於 0.4000	0.0400
大於或等於 0.4000	參考價格的 10%

(2) 交易所參與者準備情況

交易所鼓勵交易所參與者在人民幣貨幣期權 – 美元兌人民幣（香港）期權推出之前做好運作準備。為增強市場透明度，並協助交易所參與者的客戶推廣，交易所將在交易所網站上公佈提供美元兌人民幣（香港）期權的交易所參與者名單，並不時更新。

交易所參與者應於 2017 年 3 月 3 日或之前填妥並交回相關問卷（附件一），以確認推出日前準備就緒，並同意將參與者的公司名稱及聯絡方式公佈在香港交易所網站上。如有任何查詢，請聯絡閻先生(FrederickYim@hkex.com.hk) 或黃先生(RaymondCWWong@hkex.com.hk)。

(3) 交易資訊

美元兌人民幣（香港）期權最新的資訊供應商訊息代碼列於附件二以供參考。該列表將於交易所的產品主頁上不時更新 www.hkex.com.hk/FX_c。

(4) 表揚活躍參與者

交易所計劃將頒發獎座予在產品推出後首三個月（即 2017 年 3 月 20 日至 6 月 30 日）積極參與的參與者，以表揚他們的支持。活躍參與者獎項將基於以下標準評選：

參與者	條件
交易所參與者	於 2017 年 3 月 20 日至 6 月 30 日，交易量總和最高的前 10 名交易所參與者，並符合最少 100 張結算合約的要求
交易所參與者提名的公司盤交易員	於 2017 年 3 月 20 日至 6 月 30 日，交易量總和最高的前 5 名交易所參與者提名的公司盤交易員，並符合最少 100 張結算合約的要求
流通量提供者	於 2016 年 3 月 20 日至 6 月 30 日，交易量總和最高的前 3 名流通量提供者，並符合最少 100 張結算合約的要求

(5) 結算安排

對於美元兌人民幣（香港）期權合約，結算參與者需在期貨結算公司指定的交收銀行設立人民幣及美元賬戶，並與該銀行設立自動轉賬授權，方可進行合約買賣。

結算參與者需確保銀行賬戶運作正常及可進行現金交付。非結算所參與者應委任合資格的全面結算參與者代其結算美元兌人民幣（香港）期權合約。

(6) 風險管理安排

人民幣貨幣期權 - 美元兌人民幣（香港）期權合約的按金要求及 PC-SPAN 的更新檔將適時另行通知。

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。

附件一

交易所參與者就人民幣貨幣期權 – 美元兌人民幣 (香港) 期權合約準備工作問卷

致: 香港交易所市場發展科定息及貨幣產品發展部
電郵: FICD@hkex.com.hk; 傳真: +852 2295 3106

發件人: _____ (參與者名稱)
_____ (聯絡資料 (電郵及電話))
_____ (日期)

-
1. 在操作層面，我們已對提供美元兌人民幣 (香港) 期權合約交易服務準備就緒
 2. 我們確認並同意香港交易所將本公司名稱及聯絡方式公佈於交易所網站 (<http://www.hkex.com.hk/FX>)，以列示提供美元兌人民幣 (香港) 期權合約的參與者名單。

授權簽署: _____ 公司印章: _____

全名: _____

填妥的表應通過電郵 FICD@hkex.com.hk 或傳真+852 2295 3106 交回香港交易所。

資訊供應商產品訊息代碼

人民幣貨幣期權 - 美元兌人民幣 (香港) 期權

(名單將於交易所的產品主頁上不時更新 www.hkex.com.hk/FX_c)

	資訊供應商	人民幣貨幣期權 – 美元兌人民幣 (香港) 期權
1	阿斯達克網絡信息有限公司	340900
2	ACTIV Financial Systems, Inc.	CUS/1701/9999P.HF
3	亞富資訊科技有限公司	873181-7
4	彭博資訊公司	UCAA Curncy OMON <GO>
5	CQG	C/P.CUS
6	財經智珠網有限公司	CUS
7	東方財富資訊股份有限公司	CUS
8	經濟通有限公司	CUS
9	Fidessa Ltd	CUS_Osmy.HF
10	FIS Global	CUS+ <STRIKE PRICE> + <MONTH CODE> + <LAST DIGIT OF THE YEAR>
11	浙江核新同花順網絡信息股份有限公司	CUS
12	匯港資訊有限公司	CUS (Menu > Derivatives > Options > Select ""CUS"")
13	Interactive Data Real-Time Services, Inc.	O:CUS\MYYDD\[Strike Price]
14	Market Prizm Hong Kong Limited	CUS <Strikes> my
15	報價王科技國際有限公司	P11370-P11375
16	SIX Financial Information Ltd	CUSmy
17	電資訊國際有限公司	CUSOmy
18	捷利資訊有限公司	Open->Options->CUS
19	路透社有限公司	0#HCUS*.HF
20	上海萬得信息技術股份有限公司	Quant -> CUSO.HK