

2011年第117號法律公告

**《2011年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)
(修訂)規則》**

(由證券及期貨事務監察委員會根據《證券及期貨條例》
(第571章)第35(1)條訂立)

1. 生效日期

本規則自2011年11月25日起實施。

2. 修訂《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》

《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》(第571章，附屬法例Y)現予修訂，修訂方式列於第3條。

3. 取代附表1及2

附表1及2——

廢除該等附表

代以

“附表 1 [第2(1)及5(a)條]

期貨合約的訂明上限及須申報水平

項	期貨合約	訂明上限	須申報水平
1.	在聯交所營辦的證券市場上市的股份的股票期貨合約	任何一個合約月 5 000 份未平倉合約	任何一個合約月 1 000 份未平倉合約
2.	三個月港元利率期貨合約	無	任何一個合約月 1 000 份未平倉合約；所有合約月 4 000 份未平倉合約
3.	一個月港元利率期貨合約	無	任何一個合約月 1 000 份未平倉合約；所有合約月 4 000 份未平倉合約

項	期貨合約	訂明上限	須申報水平
4.	恒生指數期貨及期權合約，以及小型恒生指數期貨合約及期權合約	對沖指定資產價格轉變風險的限額為10 000份好倉或淡倉合約(所有合約月合計)，但小型恒生指數期貨合約或小型恒生指數期權合約的對沖指定資產價格轉變風險的持倉在任何時間均不得超逾2 000份好倉或淡倉合約(所有合約月合計)	任何一個合約月500份未平倉恒生指數期貨合約；任何一個系列500份未平倉恒生指數期權合約；任何一個合約月2 500份未平倉小型恒生指數期貨合約；及任何一個系列2 500份未平倉小型恒生指數期權合約

項	期貨合約	訂明上限	須申報水平
5.	恒生中國企業指數期貨合約及期權合約，以及小型恒生中國企業指數期貨合約	對沖指定資產價格轉變風險的限額為12 000份好倉或淡倉合約(所有合約月合計)，但小型恒生中國企業指數期貨合約的對沖指定資產價格轉變風險的持倉在任何時間均不得超逾2 400份好倉或淡倉合約(所有合約月合計)	任何一個合約月500份未平倉恒生中國企業指數期貨合約；任何一個系列500份未平倉恒生中國企業指數期權合約；及任何一個合約月2 500份未平倉小型恒生中國企業指數期貨合約
6.	恒生中國H股金融行業指數期貨合約	對沖指定資產價格轉變風險的限額為10 000份好倉或淡倉合約(所有合約月合計)	任何一個合約月500份未平倉合約
7.	黃金期貨合約	無	任何一個合約月500份未平倉合約

《2011年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)(修訂)規則》

B3510

2011年第117號法律公告

第3條

項	期貨合約	訂明上限	須申報水平
8.	三年期外匯基金 債券期貨合約	任何一個合約月 5 000 份未平倉合 約，但就現貨月 合約而言，在最 後 6 個交易日的 限額是 1 000 份 未平倉合約	任何一個合約月 1 000 份未平倉合 約，但就現貨月合 約而言，在最後 6 個交易日的須申報 的持倉量是 200 份 未平倉合約
9.	新華富時中國 25 指數期貨及期權 合約	對沖指定資產價 格轉變風險的限 額為 6 000 份好 倉或淡倉合約(所 有合約月合計)	任何一個合約月 500 份未平倉新華 富時中國 25 指數 期貨合約；及任何 一個系列 500 份未 平倉新華富時中國 25 指數期權合約
10.	恒指股息點指數 期貨合約	無	任何一個合約月 1 000 份未平倉合 約
11.	恒生國企股息點 指數期貨合約	無	任何一個合約月 1 000 份未平倉合 約

附表 2

[第2(1)及5(b)條]

股票期權合約的訂明上限及須申報水平

項	股票期權合約	訂明上限	須申報水平
1.	在聯交所營辦的證券市場上市的股份的股票期權合約	每個期權類別任何一個市場方向50 000份未平倉合約(所有到期月合計)	每個期權類別每個到期月1 000份未平倉合約
2.	盈富基金股票期權合約	每個期權類別任何一個市場方向50 000份未平倉合約(所有到期月合計)	每個期權類別每個到期月1 000份未平倉合約
3.	iShares 安碩富時A50 中國指數ETF 股票期權合約	每個期權類別任何一個市場方向50 000份未平倉合約(所有到期月合計)	每個期權類別每個到期月1 000份未平倉合約

《2011年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)(修訂)規則》

B3514

2011年第117號法律公告

第3條

項	股票期權合約	訂明上限	須申報水平
4.	標智滬深300中國指數基金股票期權合約	每個期權類別任何一個市場方向50 000份未平倉合約(所有到期月合計)	每個期權類別每個到期月1 000份未平倉合約”。

證券及期貨事務監察委員會
署理行政總裁
張灼華

2011年7月4日

註釋

根據《證券及期貨條例》(第571章)第35(1)條，證券及期貨事務監察委員會可訂明任何人可持有或控制的期貨合約及期權合約的數目上限，並可就該等合約，訂明須申報的持倉量。

2. 該等上限及須申報的持倉量已就《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》(第571章，附屬法例Y)附表1及2分別指明的期貨合約及股票期權合約設立和訂定。附表1現予修訂，加入2種新的股息點指數期貨合約，而附表2亦予修訂，加入2種新的股票期權合約。為整齊起見，兩個附表內的項目均已重新編號。