

2002 年第 189 號法律公告

《證券及期貨（槓桿式外匯交易——豁免）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 397(1) 條訂立）

1. 生效日期

本規則自《證券及期貨條例》（第 571 章）的指定生效日期起實施。

2. 釋義

在本規則中，"上市貨幣權證"（listed currency warrant）指符合以下說明的權證——

(a) 該權證給予其持有人一項權利，如某指明貨幣在某指明日期的價值是多於或少於（視屬何情況而定）另一指明貨幣的價值，則該持有人於行使該權證時有權向該權證的發行人收取一筆現金付款；及

(b) 該權證——

(i) 已上市；或

(ii) 沒有上市，但可合理預見會在該權證首次要約售賣後 14 日內上市。

3. 為施行 "槓桿式外匯交易" 的定義的

第 (xiii) 段而訂明的人士

為施行本條例附表 5 第 2 部中 "槓桿式外匯交易" 的定義的第 (xiii) 段，現訂明就本條例的任何條文而言，在——

(a) 第 4(1) 條中描述的人；

(b) 第 5 條中描述的人；或

(c) 第 6 條中描述的人，

是該段提述的人。

4. 第 3(a) 條提述的人

(1) 第 3(a) 條提述的人是符合以下說明的法團——

(a) 符合第 (2) 款所列的條件；及

(b) 遵從第 (3) 款的規定。

(2) 第 (1)(a) 款提述的條件是——

(a) (i) 該法團具有合資格信貸評級或該法團的任何債務票據具有合資格信貸評級；或

(ii) 該法團的股份直接或間接由具有合資格信貸評級的另一法團或合夥全資擁有，
或由其任何債務票據具有合資格信貸評級的另一法團或合夥全資擁有；及

(b) (i) 該法團的主要業務並非槓桿式外匯即期交易；或

(ii) 以該法團的每個財政年度計算，該法團訂立的每宗槓桿式外匯即期交易的平均
本金額，不少於 \$7,800,000。

(3) 該法團須每年在其財政年度完結後的 4 個月內——

(a) 以書面通知證監會，表示該法團符合第 (2) 款所列的條件；及

(b) 向證監會提供證監會合理地要求的資料，以令該會能核實該法團符合第(2) 款所列的條件。

(4) 如某法團不再符合第 (2)(a) 款所列的條件，則它須在不再符合該等條件的 7 日內，以書面將此事通知證監會。

(5) 就本條而言，計算法團訂立的每宗槓桿式外匯即期交易的平均本金額的方式，是將該法團在有關財政年度內訂立的槓桿式外匯即期交易的所有本金的總額，除以該法團在該財政年度內訂立的該等交易的總宗數。

5. 第 3(b) 條提述的人

第 3(b) 條提述的人是一一

(a) 為售賣、購買或移轉某上市貨幣權證的合約或安排或為建議的該等合約或安排而作出作為的持牌人，或在與該等合約或安排或與建議的該等合約或安排有關連的情況下作出作為的持牌人，但該人僅在符合以上描述的範圍內是第 3(b) 條提述的人；或

(b) 為他本人作為持牌法團的客戶與該持牌法團訂立的售賣、購買或移轉某上市貨幣權證的合約或安排或為建議的該等合約或安排作出作為的持牌法團的客戶，或在與該等合約或安排或與建議的該等合約或安排有關連的情況下作出作為的持牌法團的客戶，但該客戶僅在符合以上描述的範圍內是第 3(b) 條提述的人。

6. 第 3(c) 條提述的人

第 3(c) 條提述的人，是為符合 (a)、(b) 或 (c) 段所指的合約或安排或為建議的該等合約或安排作出作為，而本身是某上市貨幣權證的發行人的法團 ("首述法團") 或跟某上市貨幣權證的發行人同屬同一公司集團的法團，或在與該等合約或安排或與建議的該等合約或安排有關連的情況下作出作為的該等法團，但該等法團僅在符合上述描述的範圍內是第 3(c) 條提述的人一一

(a) 由本身是該上市貨幣權證的發行人的法團 (不論它是否首述法團) 或跟該權證的發行人同屬同一公司集團的法團與某持牌法團之間訂立的售賣、購買或移轉該權證的合約或安排；

(b) 本身是該權證的發行人的法團 (不論它是否首述法團) 與跟該權證的發行人同屬同一公司集團的法團之間訂立的售賣、購買或移轉該權證的合約或安排；或

(c) 兩間跟該權證的發行人同屬同一公司集團但本身並非該發行人的法團之間訂立的售賣、購買或移轉該權證的合約或安排。

證券及期貨事務監察委員會

主席

沈聯濤

2002 年 11 月 25 日

註 釋

本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 397(1) 條訂立。本規則訂明某些人士屬於本條例附表 5 第 2 部中 "槓桿式外匯交易" 的定義的第 (xiii) 段所指的類別的人士。即是說，由該等人士為合約或安排或為建議的合約或安排而作出的作為，或在與合約或安排或與建議的合約或安排有關連的情況下作出的作為，均不包括在該定義內。因此，該等訂明人士無須就該等活動持有牌照。