

立法會參考資料摘要

《證券及期貨條例》(第 571 章)

《2004 年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)(修訂)(第 2 號)規則》

引言

1. 證券及期貨事務監察委員會(“證監會”)在 2004 年 4 月 19 日的會議上訂立了載於附件的《2004 年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)(修訂)(第 2 號)規則》(“《修訂規則》”。

背景及論點

2. 《證券及期貨條例》(第 571 章)第 35(1)條規定，證監會可訂明期貨合約及期權合約的數目上限及就該等合約的須申報的持倉量。該等合約限量及須申報持倉量訂明在《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》(第 571Y 章，“《有關規則》”)內，並與香港期貨交易所有限公司(“期交所”)(就期貨合約而言)及香港聯合交易所有限公司(“聯交所”)(就期權合約而言)在其各自的規章中訂明的合約限量及須申報的持倉量相符。
3. 由於有關的相關指定股份的名稱有所改變，因此 4 種現有股票期貨合約及 4 種現有股票期權合約的名稱都已相應地作出更改。因此，證監會建議《有關規則》內對該等合約的提述應作出相應修訂。
4. 此外，1 種現有期貨指數合約及 1 種現有期權指數合約已除牌。因此，證監會建議從《有關規則》中刪去對該等合約的提述。

5. 第三，證監會建議就 15 種新增股票期貨合約及 15 種新增股票期權合約設定合約限量及須申報水平。建議設定的合約限量及須申報水平將反映期交所及聯交所在其各自的規章所訂明的合約限量及須申報水平。
6. 目前，新增股票期貨及股票期權合約的交易尚未開始。期交所(就新增股票期貨合約而言)及聯交所(就新增股票期權合約而言)將於有關合約開始交易時發出公布。

《修訂規則》

7. 《修訂規則》對《有關規則》附表 1 及 2 作出下述修訂 -
 - (1) 更改 4 種現有股票期權合約及 4 種現有股票期貨合約的名稱；
 - (2) 刪除 1 種現有股票指數期權合約及 1 種現有股票指數期貨合約；及
 - (3) 加入 15 種新增股票期權合約及 15 種新增股票期貨合約。

諮詢公眾意見

8. 由於有關修訂純屬技術性質且不具爭議性，因此證監會認為無需進行公開諮詢。

對財務及人手方面的影響

9. 上述修訂不會對政府在財務或人手編制方面構成任何影響。

生效日期

10. 《修訂規則》將會自 2004 年 6 月 25 日起實施。

就《修訂規則》作出公布

11. 《修訂規則》將於 2004 年 4 月 30 日在憲報刊登。

查詢

12. 如對以上參考資料摘要有任何查詢，請致電 28409209 與證監會法律服務部高級律師穆嘉琳女士或 22836133 與證監會市場監察部高級經理吳國榮先生聯絡。

證券及期貨事務監察委員會

2004 年 4 月 29 日

《2004 年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)(修訂)(第 2 號)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 2004 年 6 月 25 日起實施。

2. 期貨合約的訂明上限及須申報水平

《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 現予修訂 -

- (a) 在第 37 項中，在第 2 欄中，廢除 “Legend Group Ltd.” 而代以 “Lenovo Group Ltd.”；
- (b) 廢除第 38 及 39 項；
- (c) 在第 40 項中，在第 2 欄中，廢除 “淘大置業有限公司” 而代以 “恒隆地產有限公司”；
- (d) 在第 48 項中，在第 2 欄中，廢除 “恒隆有限公司” 而代以 “恒隆集團有限公司”；
- (e) 在第 58 項中，在第 2 欄中，廢除 “南華早報(集團)有限公司” 而代以 “SCMP 集團有限公司”；
- (f) 加入 -

“112. 中國鋁業股份 有限公司股票 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
--------------------------------	-----------------------------	---------------------------------

113. ASM Pacific Technology Ltd. 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
---	-----------------------------	---------------------------------

114.	北京大唐發電股份有限公司股票期貨合約	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
115.	華晨中國汽車控股有限公司股票期貨合約	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
116.	中國人壽保險股份有限公司股票期貨合約	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
117.	中海發展股份有限公司股票期貨合約	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
118.	中國電信股份有限公司股票期貨合約	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
119.	嘉里建設有限公司股票期貨合約	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
120.	中國人民財產保險股份有限公司股票期貨合約	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
121.	中國外運股份有限公司股票期貨合約	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

122.	渣打集團有限公司股票期貨合約	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
123.	創科實業有限公司股票期貨合約	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
124.	康師傅控股有限公司股票期貨合約	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
125.	兗州煤業股份有限公司股票期貨合約	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
126.	浙江滬杭甬高速公路股份有限公司股票期貨合約	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”。

3. 股票期權合約的訂明上限及須申報水平

附表 2 現予修訂 –

- (a) 在第 10 項中，在第 2 欄中，廢除 “淘大置業有限公司” 而代以 “恒隆地產有限公司”；
- (b) 在第 20 項中，在第 2 欄中，廢除 “恒隆有限公司” 而代以 “恒隆集團有限公司”；
- (c) 在第 25 項中，在第 2 欄中，廢除 “南華早報(集團)有限公司” 而代以 “SCMP 集團有限公司”；
- (d) 在第 34 項中，在第 2 欄中，廢除 “Legend Group Ltd.” 而代以 “Lenovo Group Ltd.”；
- (e) 加入 –

“52. 中國鋁業股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
53. ASM Pacific Technology Ltd. 股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
54. 北京大唐發電股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
55. 華晨中國汽車控股有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
56. 中國人壽保險股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
57. 中海發展股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
58. 中國電信股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
59. 嘉里建設有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
60. 中國人民財產保險股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
61. 中國外運股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約

62.	渣打集團有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
63.	創科實業有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
64.	康師傅控股有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
65.	兗州煤業股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約
66.	浙江滬杭甬高速公路股份有限公司股票期權合約	任何一個到期月內 25 000 份合約	任何一個到期月內 5 000 份合約”。


 證券及期貨事務監察委員會
 主席
 沈聯濤

2004年4月26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持有或控制的期貨合約及期權合約的數目上限，並且可就該等合約訂明須申報的持倉量。

2. 該等合約限量及須申報的持倉量已就分別於《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 內指明的期貨合約及股票期權合約設立和訂定。該等附表現予修訂，以反映 4 種現有期貨合約及 4 種現有股票期權合約的名稱的更改、刪除 2 種現有期貨合約以及加入 15 種新的期貨合約及 15 種新的股票期權合約。