

2005 年第 232 號法律公告

《2005 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 2006 年 2 月 10 日起實施。

2. 期貨合約的訂明上限及須申報水平

(1) 《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，廢除第 1 至 37 項而代以——

“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

- | | | |
|----------------------------------|--|--|
| 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過 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 |
| 5. 恒生中國企業指數期貨合約 | 任何一個合約月 6 000 份未平倉合約 | 任何一個合約月 500 份未平倉合約 |
| 6. 恒生中國企業指數期權合約 | 任何一個系列 6 000 份未平倉合約 | 任何一個系列 500 份未平倉合約 |

- | | | | |
|----|---------------------|--|--|
| 7. | 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 |
| 8. | 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”。 |

(2) 附表 1 現予修訂，廢除第 40 至 127 項。

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，廢除第 1 至 66 項而代以——

- | | | | |
|-----|-----------------------------|---|---------------------------------|
| “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 每個期權類別每
何一個市場方向 個到期月 1 000
50 000 份未平倉 份未平倉合約”。

合約 (所有到期
月合計)

證券及期貨事務監察委員會
主席
韋奕禮

2005 年 12 月 13 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。本規則旨在修訂《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，以統一在香港證券市場上市的股份的所有股票期權合約的訂明上限及須申報水平，以及除去有關已被取消上市資格的期貨合約的訂明上限及須申報水平。