

香港期貨結算有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

HKFE CLEARING CORPORATION LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

## 通告 CIRCULAR

事項： 農曆新年假期後的按金水平

查詢： 2211-6901

本通告參照於 2018 年 2 月 9 日 (編號：[CD/CDCRM/040/2018](#)) 發出的通告，就有關即將來臨的農曆新年假期所作的風險管理安排。參與者謹請留意以下事宜：

- 根據《交易所規則》第 617(d)條及《期貨結算公司規則》第 402 條，期交所及結算所決定將於 2018 年 2 月 15 日營業時間結束後，將恒生指數(“恒指”)、小型恒生指數(“小型恒指”)、恒生中國企業指數(“H 股指數”)、小型恒生中國企業指數(“小型 H 股指數”)、美元兌人民幣(香港)期貨及人民幣(香港)兌美元期貨合約的按金水平定為：

		<u>客戶按金</u>		<u>結算所按金</u>
		基本按金	維持按金	
		<u>(港元)</u>	<u>(港元)</u>	<u>(港元)</u>
恒生指數	按金	136,990 /每張	109,592 /每張	103,000 /每張
	跨期按金	27,398 /每對	21,918 /每對	20,600 /每對
小型恒生指數	按金	27,398 /每張	21,918 /每張	20,600 /每張
	跨期按金	5,479 /每對	4,383 /每對	4,120 /每對
恒生中國企業指數	按金	55,594 /每張	44,475 /每張	41,800 /每張
	跨期按金	16,691 /每對	13,352 /每對	12,550 /每對

小型恒生中國企業指數	按金	11,118 /每張	8,894 /每張	8,360 /每張
	跨期按金	3,338 /每對	2,670 /每對	2,510 /每對
		<u>(人民幣)</u>	<u>(人民幣)</u>	<u>(人民幣)</u>
美元兌人民幣(香港)期貨	按金	14,696 /每張	11,756 /每張	11,050 /每張
	跨期按金	4,269 /每對	3,415 /每對	3,210 /每對
	現貨月按金*	2,939 /每張	2,351 /每張	2,210 /每張
		<u>(美元)</u>	<u>(美元)</u>	<u>(美元)</u>
人民幣(香港)兌美元期貨	按金	1,062 /每張	849 /每張	799 /每張
	跨期按金	308 /每對	246 /每對	232 /每對

\* 現貨月合約的現貨月按金將於最後結算日前一個營業日之前的最後四個營業日收取。

請注意，以上最低按金率是為貴公司擁有最佳財政狀況的客戶而設，參與者應按照個別客戶的情況設定其按金要求。

- 就農曆新年假期而於 2018 年 2 月 14 日 T 時段營業時間結束後暫時提高之按金水平，結算所已於 2 月 9 日在香港交易所網站刊發了「模擬風險系數檔案」，以協助參與者更有效評估其潛在按金影響。結算所就該「模擬風險系數檔」案作了**更新版本**，並於 2 月 13 日將該更新版本刊發在香港交易所網站。結算所建議參與者利用該更新版本「模擬風險系數檔案」估算其產品組合在暫時提高按金水平下的結算所按金要求及預計資金要求。參與者應留意，該「模擬風險系數檔案」**僅供參考**，不可代替每個營業日結束時用作計算實際日終按金要求的日終風險系數檔案。上述「模擬風險系數檔案」可在香港交易所網站下載：

[http://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Clearing/Listed-Derivatives/Risk-Management/Reports-and-Data-Download/Simulated-RPF-for-Holiday-Margin/holidayrpf\\_feb18.zip](http://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Clearing/Listed-Derivatives/Risk-Management/Reports-and-Data-Download/Simulated-RPF-for-Holiday-Margin/holidayrpf_feb18.zip)

為免混淆，現將以下合約之現行按金水平及於 2018 年 2 月 14 日 T 時段營業時間結束後暫時提高之按金水平重列如下：

		<u>客戶按金</u>		<u>結算所按金</u>
		<u>基本按金</u>	<u>維持按金</u>	
		<u>(港元)</u>	<u>(港元)</u>	<u>(港元)</u>
恒指	現行水平	每張 127,879 元	每張 102,303 元	每張 96,150 元
	暫時提高水平	每張 161,595 元	每張 129,276 元	每張 121,500 元
小型恒指	現行水平	每張 25,575 元	每張 20,460 元	每張 19,230 元
	暫時提高水平	每張 32,319 元	每張 25,855 元	每張 24,300 元
H 股指數	現行水平	每張 53,466 元	每張 42,772 元	每張 40,200 元
	暫時提高水平	每張 65,968 元	每張 52,774 元	每張 49,600 元
小型 H 股指數	現行水平	每張 10,693 元	每張 8,554 元	每張 8,040 元
	暫時提高水平	每張 13,193 元	每張 10,554 元	每張 9,920 元
		<u>(人民幣)</u>	<u>(人民幣)</u>	<u>(人民幣)</u>
美元兌人民幣(香港)期貨	現行水平	每張 12,714 元	每張 10,171 元	每張 9,560 元
	暫時提高水平	每張 17,343 元	每張 13,874 元	每張 13,040 元
		<u>(美元)</u>	<u>(美元)</u>	<u>(美元)</u>
人民幣(香港)兌美元期貨	現行水平	每張 924 元	每張 739 元	每張 695 元
	暫時提高水平	每張 1,254 元	每張 1,003 元	每張 943 元

請確保閣下的員工完全知悉暫時提高之按金水平，並與閣下指定銀行作出必要安排。閣下應在適當的情況下預先通知客戶有關上述安排，並確保於假期期間向客戶收取足夠的按金金額。

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

薛家傑 謹啟