HKEX
香港交易所

編號 Ref. No.:	DCRM/HKCC/101/2016
日期 Date:	24/05/2016

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： 新增人民幣貨幣期貨之按金水平及更新PC-SPAN參數設定檔案

查詢： 2211-6901

本通告參照於 2016 年 5 月 23 日發出有關於 2016 年 5 月 30 日推出新增人民幣貨幣期貨的通告【編號：MKD_FIC_007_16】。參與者謹請留意，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自 **2016 年 5 月 30 日（星期一）** 起，將新增人民幣貨幣期貨的按金水平定為：

		客戶按金		**結算所按金**
		基本按金	維持按金	
		(人民幣)	**(人民幣)**	**(人民幣)**
歐元兌人民幣（香港）期貨	按金	13,820 /每張	11,060 /每張	11,060 /每張
	跨期按金	1,940 /每對	1,550 /每對	1,550 /每對
日圓兌人民幣（香港）期貨	按金	13,450 /每張	10,760 /每張	10,760 /每張
	跨期按金	1,750 /每對	1,400 /每對	1,400 /每對
澳元兌人民幣（香港）期貨	按金	13,210 /每張	10,570 /每張	10,010 /每張
	跨期按金	2,120 /每對	1,700 /每對	1,610 /每對

		客戶按金		**結算所按金**
		基本按金	維持按金	
		(美元)	**(美元)**	**(美元)**
人民幣（香港）兌美元期貨	按金	1,150 /每張	915 /每張	915 /每張
	跨期按金	332 /每對	265 /每對	265 /每對

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，交易所參與者應按照個別客戶的情況設定其按金要求。

參與者若決定使用 PC-SPAN[1] 計算該等產品的按金規定，請於 **2016 年 5 月 30 日（星期一）或之前**更新系數設定檔案。參與者可選擇透過以下任何一種方式進行更新：

1. 使用香港交易所網站最新的系數設定檔案取代現有檔案。
   檔案超連結：
   http://www.hkex.com.hk/eng/market/rm/rm_dcrm/riskdata/orgmast/orgmast.zip
   檔案只載有所有經期貨結算公司及聯交所期權結算所結算的香港交易所產品的更新系數，並無提供其他交易所及結算所的系數；或

2. 使用芝加哥商業交易所（CME）網站登載的系數設定檔案取代現有檔案。
   CME 網站的檔案由 CME 管理。有關檔案的更新時間請參閱 CME 不時刊載的通告；或

3. 透過 PC-SPAN 界面人手輸入：
   參與者應最後才選用此方法，以避免操作過程中的潛在人為錯誤。

參與者如選擇透過方法 2 及 3 更新系數設定檔案，在計算任何按金前，應與香港交易所網站所提供的系數設定檔案（載於上述方法 1 的超連結）作對照檢查，以確保檔案準確無誤。

香港期貨結算有限公司
授權簽署人
勞健滿 謹啟

[1] SPAN（標準風險投資組合分析）為屬於芝加哥商業交易所的註冊商標