

2015 年第 228 號法律公告

《2015 年證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)
(修訂)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 2016 年 1 月 15 日起實施。

2. 修訂《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》

《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) 現予修訂，修訂方式列於第 3、4 及 5 條。

3. 修訂第 2 條(釋義)

第 2(1) 條——

按筆劃數目順序加入

“**交易所買賣基金** (exchange traded fund) 指其股份或單位是在認可證券市場上市或交易的開放式集體投資計劃；

要約文件 (offering document) 就某集體投資計劃而言，指符合以下說明的文件——

(a) 邀請可能成為該計劃的股東或單位持有人的
人，參與該計劃；及

(b) 載有關乎該計劃的設立或管理的資料；

組成文件 (constitutive documents) 就某集體投資計劃而言，指管限設立該計劃的主要文件；

開放式集體投資計劃 (open-ended collective investment scheme) 指符合以下說明的集體投資計劃：在其任何股東或單位持有人的要求下，該計劃的股份或單位可——

(a) 以一個完全或主要按該計劃的淨資產值計算的
價格；及

(b) 按照該計劃的要約文件或組成文件所列的回購
或贖回頻密程度、規定及程序，

予以回購或贖回；”。

4. 修訂附表 1 (期貨合約的訂明上限及須申報水平)

附表 1——

加入

“14.	倫敦銅期貨 小型合約	50 000 份好倉或 淡倉淨額合約 (所有合約月合計)	任何一個合約 月 500 份未平 倉合約
15.	倫敦鋁期貨 小型合約	25 000 份好倉或 淡倉淨額合約 (所有合約月合計)	任何一個合約 月 500 份未平 倉合約

16.	倫敦鎳期貨 小型合約	25 000 份好倉或 淡倉淨額合約 (所有合約月合計)	任何一個合約 月 500 份未平 倉合約
17.	交易所買賣 基金的股份 或單位的股 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”。

5. 修訂附表 2 (股票期權合約的訂明上限及須申報水平)

(1) 附表 2——

廢除第 2 項

代以

“2.	交易所買賣 基金的股份 或單位的股 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) 附表 2——

廢除第 3 及 4 項。

證券及期貨事務監察委員會
行政總裁
歐達禮

2015 年 11 月 17 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可持有或控制的期貨合約及期權合約的數目上限，並可就該等合約訂明須申報的持倉量。

2. 上述數目上限及須申報的持倉量已就於《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)(《**規則**》)附表 1 指明的期貨合約及《規則》附表 2 指明的股票期權合約而設立和訂定。
3. 為在《規則》附表 1 及 2 引入在認可證券市場上市或交易的、屬開放式集體投資計劃的股份或單位的合約的目的，《規則》第 2(1) 條現加入**交易所買賣基金**及相關詞句的定義。
4. 《規則》附表 1 現予修訂，加入 3 種商品期貨合約，及交易所買賣基金的股份或單位的所有股票期貨合約。
5. 《規則》附表 2 現予修訂，刪除 3 種交易所買賣基金的現有股票期權合約，而加入交易所買賣基金的股份或單位的所有股票期權合約。