

香港期货交易所大额未平仓合约申报和持仓限额的客户告知书

尊敬的客户：

为了使您充分了解香港期货交易所（期交所）中关于大额未平仓合约申报和持仓限额的要求，中信期货国际有限公司（“本司”）制定本客户告知书，请您仔细阅读并理解大额未平仓合约申报和持仓限额的相关义务：

- 1、由证券及期货事务监察委员会（证监会）根据《证券及期货条例》第 35（1）条制定之《证券及期货（合约限量及须申报的持仓量）规则》设定的持仓限额及申报水平将会直接影响阁下/贵司的户口。阁下/贵司应注意，未能遵守该等限额或做出申报可能会构成该条例之下的刑事罪行。
- 2、以上条例及规则直接适用于阁下/贵司，阁下/贵司有义务对所持大额未平仓合约进行申报，包括阁下/贵司之大额未平仓合约集中于一家交易所参与者（即期货经纪公司），或在多家交易所参与者开立账户之持仓总和达到大额未平仓合约申报水平的情况。
- 3、阁下/贵司应特别注意，阁下/贵司透过不同户口持有或控制的持仓应合并计算，故如阁下/贵司在本司持有或控制多个户口，在上述义务基础上，阁下/贵司应及时告知我司持有或控制的相关户口和后续变动。
- 4、如阁下/贵司在多家交易所参与者开立账户，阁下/贵司本身须直接向期交所申报，及向期交所提交一份大额未平仓持仓量报告。阁下/贵司可要求本司在未达申报标准也进行申报，但必须向本司出具明确的书面授权并提供相关资料，若本司在次交易日早上 9:30 前收到阁下/贵司明确的书面授权及相关资料，本司会依据阁下/贵司授权进行申报。
- 5、期交所有关合约涵盖范围、持仓限额及申报水平在下面链接中详列：
https://www.hkex.com.hk/Services/Trading/Derivatives/Overview/Trading-Mechanism/Large-Open-Positions-and-Position-Limits?sc_lang=zh-HK
- 6、请通过下方链接查询证监会《证券及期货（合约限量及须申报的持仓量）规则》：
https://www.elegislation.gov.hk/hk/cap571Y!en-zh-Hant-HK?INDEX_CS=N
- 7、请通过下方链接查询证监会《持仓限额及大额未平仓合约的申报规定指引》：
<https://www.sfc.hk/web/TC/assets/components/codes/files-current/zh-hant/guidelines/guidance-note-on-position-limits-and-large-open-position-reporting-requirements/guidance-note-on-position-limits-and-large-open-position-reporting-requirements.pdf>
- 8、法团客户请确认以下问题：
 - （1） 贵司是否属于集团公司的附属公司/子公司？
 是，请回答以下第(2)问并提供集团公司名称。集团公司¹名称为：
 否。
 - （2） 贵司是否接受集团公司或集团公司控制的其他公司向贵司发出交易指示？
 是，发出交易指示的公司名称为：
 否。

吾等已细阅、完全理解并同意以上告知事项。

客户名称：

获授权人签署及盖章（如适用）：

签署日期：

¹ 如某法人团体 ——

(a)控制贵司的董事局的组成；(b)控制贵司超过半数的表决权；或(c)持有贵司超过半数的已发行股本，则该法人团体即属贵司的集团公司。贵司集团公司的集团公司亦属于贵司的集团公司，请一并提供相关名称。