

期货合约细则
Futures Contract Specification



金属期货 Metal Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406										
交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
CME_CO MEX	黄金	GC	06:00 -05:00	0.1=USD10	100金衡盎司	当月; 之后2个月; 随后的23个月期间的任何2月、4月、8月、10月; 当前月之后72个月期间的任何6月与12月	±100美元，熔断2分钟	合约月份前1个月 的最后交易日	合约月份最后第3个交易日	实物
	白银	SI		0.005=USD25	5,000金衡盎司	当月; 之后2个月; 随后的23个月期间的任何1月、3月、5月、9月; 当前月之后60个月期间的任何7月与12月	±3美元，熔断2分钟	合约月份前1个月 的最后交易日	合约月份最后第3个交易日	
	铜	HG		0.0005=USD12.5	25,000磅	当月; 当月后连续的23个月; 从当月起60个月期间的任何3,5,7,9,12月	±0.4美元，熔断2分钟			
ICE_NYB OT	小型黄金	YG	08:00-06:00	0.1 = USD3.215	32.15盎司	当月; 之后2个月; 随后的23个月期间的任何2、4、8、10月; 当前月之后60个月期间的任何6月与12月	N.A.	合约月份前一个月的 最后交易日	合约月份最后的第三个交易日	实物
	小型白银	YI	08:00-06:00	0.001 = USD1	1000盎司	当月; 之后2个月; 随后的23个月期间的任何1、3、5、9月; 当前月之后60个月期间的任何7月与12月	N.A.		实物	
CME_NY MEX	白金	PL	06:00 - 05:00	0.1=USD5	50金衡盎司	当月; 最近连续的2个月; 随后的12个月内的1、4、7、10月	±100美元，熔断2分钟			合约月份最后第3个交易日
	美国钯金	PA		0.05 = USD5	100盎司	即月; 最近2个连续月; 其后12个月内任何3、6、9、12月	±100美元，熔断2分钟	合约月份前1个月 的最后交易日	合约月份最后第3个交易日	实物
	黄金（公斤）	GCK		0.1=USD 3.215	1公斤（32.15金衡盎司）	连续3个月以及从现在开始起的12个月内的2、4、6、8、10、12月	±100美元，熔断2分钟	未定（需要等细则确认）	合约月份第三个周三的前三个交易日	实物
	锌	ZNC	06:00 - 05:00	0.5=USD 12.5	25吨	12个连续月	N.A.	合约月份前1个月 的最后交易日	合约月份最后第3个交易日	实物
CME- NYMEX	铁矿石	TIO	06:00 -05:00	0.01=USD5	500千吨		N.A	N.A.	合约月份的最后一个新加坡工作日，如果为新加坡银行假期，则为前一个工作日	现金
LME	铜	CA	08:00-02:00	0.5=USD12.5	25吨	连续123个月	N.A.	N.A.	合约到期日的前2个交易日	实物
	铝	AH								
	铅	PB								
	锌	ZS		连续63个月						
	镍	NI		5.00=USD30.00	6吨					
	锡	SN		5.00=USD25.00	5吨	连续15个月				
DGCX	黄金	DG	11:00-03:30	0.10=USD3.20	32金衡盎司(1千克)	2月、4月、6月、8月、10月、12月	±30美元	N.A.	交割月前月的倒数第三个交易日	实物
HKEX	电解铝	LRA	09:00-16:30(T),17:15-01:00(T+1)	5=25RMB	5吨	连续12个月	N.A.	N.A.	第三个星期三的前两个工作日（若香港假期则再提前一个交易日）	现金
	电解铜	LRC		10=50RMB						
	电解锌	LRZ		5=25RMB						

期货合约细则

Futures Contract Specification



能源期货 Energy Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
DME	DME阿曼原油	OQD	06:00-05:00	0.01=USD10	1,000桶	连续12个月	N.A	N.A	合约月份前两个月的最后一个工作日	实物
ICE_IPE	布兰特期油	BRN	08:00-06:00 (每周一6点开盘)	0.01 = USD10	1,000桶	72个连续月, 以及此后3年 的6月-12月	N.A.	N.A.	合约月份前两个月的最后一个交易日 (2016三月往后)	现金
	西德州原油	WBS	08:00-06:00	0.01 = USD10	1,000桶	72个连续月, 以及此后3年 的6月-12月	N.A.	N.A.	合约月份前一个月的25号的前4个交易日 (25日若为非交易日则前移至最近的工作日)	现金
	柴油	GAS	08:00-06:00	0.25=USD25	100公吨 (mt)	36个连续月及之后12个季月及12个6月, 12月季月	N.A	N.A.	合约月份14日的前两个交易日	实物
CME_NY MEX	原油	CL	06:00 - 05:00	0.01=USD10.00	1,000桶	近6年的连续月份合约, 第7-9年的每年6,12月	±10美元, 熔断2分钟	最后交易日之后2个交易日	合约月份前1月的25号前第3个交易日(25日为交易日)合约月份前1月的25号前第4个交易日(25日为非交易日)	实物
	小型原油	QM		0.025=USD12.50	500桶	当年剩余月份及其后60个连续月(本年度及5个日历年)	±10美元, 熔断2分钟	N.A.	合约月份前1月的25号前第4个交易日	现金
	取暖油	HO		0.0001=USD4.20	42,000加仑	2016年1月前的每个连续月	±0.25美元, 熔断2分钟	最后交易日之后	合约月份前1个月最后1个交易日	实物
	天然气	NG		0.001=USD10.00	10,000mmBtu	本年度加上未来12年在CME Globex : 本年度加上未来八年	±1美元, 熔断2分钟	合约月份前1个月的倒数第2个交易日	交割月份前1个月的倒数第3个交易日	实物
	小型天然气	QG		0.005=USD12.50	2,500mmBtu	当年剩余月份及其后5年	±1.5美元, 熔断2分钟	N.A.	合约月份前1个月的倒数第4个交易日	现金
	布兰特原油	BZ		0.01 = USD10	1000桶	从现在起的连续月份, 直到2019年12月	N.A.	N.A.	合约月份第1天前的15天的前一个交易日 (2016年二月前) 合约月份前两个月的最后一个交易日 (2016三月往后)	现金
	WTI-Brent Financial	BK	06:00-05:00	0.01=USD10	1000桶	目前年度的连续合约, 以及未来8年的连续合约	N.A.	N.A.	合约月份第1天前的15天的前一个交易日	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



利率期货 Interest Rates Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
CME_CBOT	2年期 美国国债	ZT	06:00 - 05:00	1/128=USD15.6250	\$200,000	3,6,9,12	±USD 1,2,3,4,无限，每次熔断2分钟	合约月份前1个月的最后1个交易日	合约月份最后1个交易日(最后交易日12:01p.m.闭市)	实物
	5年期 美国国债	ZF		1/128=USD7.8125	\$100,000	3,6,9,12	±USD 2,4,6,8,无限，每次熔断2分钟			
	10年期 美国国债	ZN		1/64=USD15.6250	\$100,000	3,6,9,12	±USD 2,4,6,8,无限，每次熔断2分钟		合约月份倒数第8个交易日	
	美国国债(30年)	ZB		1/32=USD31.2500	\$100,000	3,6,9,12	±USD 3,6,9,12,无限美元，每次熔断2分钟			
	10年超长期 美国国债	TN		1/64=USD15.6250	\$100,000	3,6,9,12(中最近的3个)	±USD 2,4,6,8,无限，每次熔断2分钟	合约月份前1个月的最后1个交易日	合约月份倒数第8个交易日	实物
	30年超长期美国 国债	UB		1/32=USD31.2500	\$100,000	3,6,9,12(中最近的3个)	±USD 3,6,9,12,无限美元，每次熔断2分钟		合约月份倒数第8个交易日，最后交易日智能交易到凌晨2点01分	

SGX	10年期小型日本国债	JB	07:45-17:15, (T+1) 17:30-04:45	0.01/100=JPY1,000	JPY10,000,000	连续5个季月	N.A.	无	每个交割月20号的前六个工作日 (交易时间：7.45-14.15)	现金
CME	欧元-美元利率 (EURO DOLLAR)	ED	06:00-05:00	0.0025 = \$6.25最近到 期月；0.005 = \$12.50 其他月份	USD1,000,000* 0.0025=\$2,500 (3个 月的利息0.25%，年 利1%)	3,6,9,12延续10年季月（总共40个合 约）再加上最近的4个非季月	±0.5，熔断2分钟	N.A.	到期月的第三个周三的前两个伦 敦工作日	现金
HKEX	五年期中国财政 部国债期货	HTF	9：00-12：00&13： 00-16：30(圣诞前 夕、新年前夕及农 历新年前夕不设下 午交易时段)	合约大小的 0.002%=RMB10（报 价按照合约金额的百 分比，以三个小数位 报价）	RMB500,000	3月、6月、9月及12月中最近期的两个 季月	N.A.	N.A.	合约月份的第二个星期五（若当 天为香港或大陆公众假期，则为 前一个同属香港和大陆的交易 日）	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



外汇期货 FX Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
CME	加元 CAD/USD	6C	06:00 - 05:00	0.00005=USD5	100,000加元	连续20个季月(3,6,9,12)及最近3个连续月	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.	合约月份第3个星期三的前1个交易日9：16am（美中时间）	实物
	澳元 AUD/USD	6A		0.0001=USD10	100,000澳元	连续20个季月(3,6,9,12)及最近3个连续月	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.	合约月份第3个星期三前2个交易日9:16a.m. (美中时间)	
	瑞士法郎 CHF/USD	6S		0.0001=USD12.5	125,000瑞士法郎	3,6,9,12	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.		
	欧元 EUR/USD	6E		0.00005=USD6.25	125,000欧元	连续20个季月(3,6,9,12)及最近3个连续月	±0.02美元，熔断2分钟	N.A.		
	日元期货 JPY/USD	6J		0.0000005=USD6.25	12,500,000 日元	连续20个季月(3,6,9,12)及最近3个连续月	±0.0002美元，熔断2分钟	N.A.		
	英镑期货 GBP/USD	6B		0.0001=USD6.25	62,500英镑	连续20个季月(3,6,9,12)及最近3个连续月	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.		
	墨西哥比绍 MXN/USD	6M		0.00001=USD5	500,000比绍	连续13个月及随后的2个季月	±0.004美元，熔断2分钟	N.A.	合约月份第3个星期三之前2个交易日	实物
	纽元 NZD/USD	6N		0.0001= USD10	100,000纽元	3,6,9,12	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.		
	微型澳币	M6A		0.0001=USD1	10,000澳元	3,6,9,12	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.		
	微型欧元	M6E		0.0001=USD1.25	12,500欧元	3,6,9,12	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.		
	小型日元	J7		0.000001=USD6.25	6,250,000日元	3,6,9,12连续两个季月	±0.0004美元，熔断2分钟	N.A.		
	微型英镑	M6B		0.0001=0.625USD	6250英镑	3,6,9,12	±0.04美元，熔断2分钟	N.A.		
	彭博美元现汇指数期货	BDI	06:00 - 05:00	0.1指数点=USD10.00	\$100*INDEX	连续4个季月（3,6,9,12）	N.A.	N.A.	合约月份第3个星期三之前3个交易日伦敦时间下午4点	现金
	人民币期货 RMB/USD	RMB	06:00 - 05:00	0.00001=USD10	1,000,000人民币	连续的13月及随后的2个季月合约	±0.0045美元，熔断2分钟	N.A.	合约月份第3个星期三的前2个交易日香港时间 9:00 a.m.	现金
	欧元/英镑期货 EUR/GBP	RP	06:00 - 05:00	0.00005=GBP6.25	125,000 欧元	连续6个季月(3,6,9,12)及最近3个连续月	±0.02，熔断2分钟	N.A.	合约月份第3个星期三之前2个交易日9：16am（美中时间）	实物

期货合约细则

Futures Contract Specification



农产品期货 Agricultural Products Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
CME_CBOT	玉米	ZC	8:00开市；20:45-21:30交易暂停；02:20收市	1/4cent=USD12.5	5,000蒲式耳	3,5,7,9,12	初始:±0.25美元, 扩展:±0.4美元	合约月份前1月的最后1个交易日	合约月份15日 前1交易日	实物
	大豆	ZS		1/4cent=USD12.5	5,000蒲式耳	1,3,5,7,8,9,11	初始:±0.65美元, 扩展:±1美元			
	豆粕	ZM		10cent=USD10	100美吨	1,3,5,7,8,9,10,12	初始:±20美元, 扩展:±30美元			
	豆油	ZL		1/100cent=USD6	60,000磅	1,3,5,7,8,9,10,12	初始:±2.5美分, 扩展:±4美分			
	小麦	ZW		1/4cent=USD12.5	5,000蒲式耳	3,5,7,9,12	初始:±0.35美元, 扩展:±0.55美元			
	糙米	ZR		1/2cent=USD10	2,000英担	1,3,5,7,9,11	初始:±0.75美元, 扩展:±1.15美元			
	燕麦	ZO		1/4cent=USD12.5	5,000蒲式耳	3,5,7,9,12	初始:±0.2美元, 扩展:±0.3美元			
	小型玉米	XC	8:00开市; 20:45-21:30交易暂停; 02:45收市	1/8cent=USD1.25	1,000蒲式耳	3,5,7,9,12	初始:±0.25美元, 扩展:±0.4美元			
	小型小麦	XW		1/8cent=USD1.25	1,000蒲式耳	3,5,7,9,12	初始:±0.35美元, 扩展:±0.55美元			
	小型大豆	XK		1/8cent=USD1.25	1,000蒲式耳	1,3,5,7,8,9,11	初始:±0.65美元, 扩展:±1美元			
CME	饲牛	GF	21:30-02:05 (到期合约最后交易日01:00收盘)	0.025cent=USD12.5	50,000磅	1,3,4,5,8,9,10,11	初始:±4.5美分, 扩展:±6.75美元	合约月份最后1个星期4	合约月份最后1个星期4, 若当周遇节假日则为之前的1个星期4	现金
	活牛	LE		0.025cent=USD10	40,000磅	2,4,6,8,10,12	初始:±3美分, 扩展:±4.5美分	合约月份第4个交易日	合约月份最后1个交易日的香港时间凌晨2点	实物
	瘦猪	HE		0.025cent=USD10	40,000磅	2,4,5,6,7,8,10,12	初始:±3美分, 扩展:±4.5美分	N.A.	合约月份第10个交易日	现金
	木材	LBS	22:00-05:00 (周五22:00- 02:55)	0.1 =USD11	110,000板英尺	1,3,5,7,9,11	初始:±10美元	最后交易日的后1个交易日	合约月份16号的前1个交易日	实物
TOCOM	橡胶	JRU	07:45-14:15(T) 15:30-18:00(T+1) (到期合约最后交易日仅有日间交易)	0.1JPY/KG=500JPY	5,000KG	连续的6个月	当天最大波幅±20日元, 每次±5日元 (三个扩板) 每次熔断5分钟	N.A.	合约月份最后一个工作日前的第4个交易日	实物
BMD	马棕油	FCPO	10:30-12:30; 15:00-18:00	1=MYR25	25公吨	现月、下五个月及之后24个隔月	±10%, ±15% (前结算价) 熔断10分钟	合约月份第一个工作日	合约月份的15日中午12:00, 若15日非交易日, 则前一个交易日	实物

期货合约细则

Futures Contract Specification



农产品期货 Agricultural Products Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
BMD	棕榈精炼油	FPOL	09:00-12:00；13:30-18:00	USD0.50	25公吨	现月、下五个月及之后18个隔月	±10%，±15%（前结算价）熔断10分钟	合约月份第一个工作日	合约月份的15日中午12：00，若15日非交易日，则前一个交易日	实物
ICE_NYBOT	可可	CC	16:45-01:30，最后交易日当天交易至23:50	1=USD10	10吨	3,5,7,9,12	N.A.	合约月份第1个交易日的前10个交易日	合约月份最后交易日之前的第11个交易日	实物
	咖啡	KC	16:15-01:30，最后交易日当天交易至01:25	0.05cent=USD18.75	37,500磅	3,5,7,9,12	N.A.	合约月份第1个交易日的前7个交易日	合约月份最后交易日之前的第8个交易日	实物
	棉花	CT	09:00-02:20	0.01cent=USD5	50,000磅	3,5,7,10,12	价格在80以下: ±3美分，80.01-110: ±4美分，110.01-140: ±5美分，140.01-170: ±6美分，170.01以上: ±7美分	合约月份第1个交易日的前5个交易日	合约月份倒数第17个交易日	实物
	糖NO.11	SB	15:30-01:00，最后交易日当天交易至00:55	0.01cent=USD11.2	112,000磅	3,5,7,10	N.A.	最后交易日的后1个交易日	合约月份前1个月的最后1个交易日	实物
	橙汁	OJ	20:00-02:00,	0.05cent=USD7.5	15,000磅	1,3,5,7,9,11	初始±10美分,扩展:±20美分	合约月份第1个交易日	合约月份最后交易日之前的前14个交易日	实物
liffe	白糖	W	15:45-01:00	10cent=USD5	50吨	3.5.8.10.12	N.A.	最后交易日后一日，如果为非工作日，则往后顺延一日	合约月份第一日的前16天，若该日不为工作日，则前移至上一个工作日	实物

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
CME_CBOT	道琼斯指数迷你小合约	YM	周一至周五06:00-4:15; 04:30-5:00	1指数点=USD5.00	\$5*INDEX	连续4个季月	盘中为修订价格的7%，13%，20%(仅跌停,7%和13%暂停15分钟，20%之后全天休市)，6:00-21:30为修订价格上下5%	N.A.	合约月份第3个星期5	现金
CME	标普500指数迷你小合约	ES	周一至周五06:00-4:15; 04:30-5:00	0.25指数点=USD12.50	\$50*INDEX	连续5个季月	盘中为修订价格的7%，13%，20%(仅跌停,7%和13%暂停15分钟，20%之后全天休市)，6:00-21:30为修订价格上下5%	N.A.	合约月份第3个星期5	现金
	罗素1000指数	RS1	周一至周五6:00-4:15,4:30-5:00。最后交易日交易到21:30	0.1指数点=USD5.00	\$50*INDEX	连续5个季月	6:00-21:30为修订价格上下5%；21:30-4:00为修订价格向下7%，13%和20%；4:00-5:00为修订价格的上下5%（如果盘中没有触及20%这个限制）。修订价格为前一个工交易日03:59:30-04:00:00这个时段交易价的加权平均值	N.A	合约月份的第三个周五	
	罗素1000价值指数	RSV		0.1指数点=USD5.00	\$50*INDEX	连续5个季月				
	罗素1000增长指数	RSG		0.1指数点=USD5.00	\$50*INDEX	连续5个季月				
	富时中国A50指数	FT5		06:00-05:00	5指数点=USD10.00	\$2*INDEX				
	纳斯达克100指数迷你小合约	NQ	周一至周五06:00-4:15; 04:30-5:00 (到期合约最后交易日21:30收盘)	0.25指数点=USD5.00	\$20*INDEX	连续5个季月	盘中为修订价格的7%，13%，20%(仅跌停,7%和13%暂停15分钟，20%之后全天休市)，6:00-21:30为修订价格上下5%	N.A.	合约月份第3个星期5	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
CBOE	CBOE波动率指数	VX	04:30-04:15 (周一06:00开市)	0.05指数点=USD50.00	\$1,000*INDEX	9个最近的连续月份以及之后的5个2月开始的连续季月	N.A.	N.A.	合约月份下个月的第三个星期五的前三十天的第一个交易日(通常是周三)的前一日	现金
ICE_NYBOT	美元指数	DX	08:00-05:00 (周一06:00开市)	0.005指数点=USD5.00	\$1,000*INDEX	连续4个季月(3,6,9,12)	N.A.	N.A.	合约月份第3个星期三前的2个交易日	实物
ICE	罗素2000迷你指数	交易所以TF:我司定为LTE	08:00-06:00 最后交易日21:30收市	0.1指数点=USD 5.00	\$50*INDEX (12月5日生效)	连续4个季月(3,6,9,12)	N.A.	N.A.	合约月份第3个星期五	现金
CME	日经指数225	NKD	周一至周五06:00-5:00	5指数点=USD25.00	\$5*INDEX	连续2个(3,6,9,12)中的季月	盘中为修订价格的8%, 12%, 16%	N.A.	合约月份第2个星期五的前1个交易日	现金
XEurex	道琼欧盟50指数	FESX	13:50-04:00	1pt=Euro10	Euro10 xIndex	3,6,9,12里最近的3个 季度月份	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五(若非交易日,则为前1个交易日)	现金
	德国DAX指数	FDAX	13:50-04:00 (到期合约最后交易日19:00收盘)	0.5pt=Euro12.5	Euro25 xIndex	3,6,9,12里最近的3个 季度月份	N.A.			
	德国5年国债	FGBM	14:00-04:00(13:30可开始挂单; 收盘后开始盘后竞价至04:30结束;到期合约最后交易日18:30收盘)	0.01=Euro10	Euro100,000	3,6,9,12里最近的3个 季度月份	N.A.		合约月份的第10天的前两个交易日,如第10天遇非交易日则顺延一天	实物
	德国10年国债	FGBL	14:00-04:00 (13:30可开始挂单; 收盘后开始盘后竞价至04:30结束;到期合约最后交易日18:30收盘)	0.01=Euro10	Euro100,000	3,6,9,12里最近的3个 季度月份	N.A.			

XEurex	迷你德国DAX指数	FDXM	13:50-04:00(到期合约最后交易日19:00收盘)	1pt=Euro5	Euro5 xIndex	连续3个（3,6,9,12）中的季月	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期5,若为交易所假期，则为前一日	现金
	迷你VSTOXX指数	FVS	14:50-04:00 (13:30可开始挂单; 收盘后开始盘后竞价至04:30结束; 到期合约最后交易日18:00收盘)	0.05pt=Euro5	Euro100 xIndex	最近的连续8个月份	N.A.	N.A.	合约月份倒数第2个星期5所在星期的星期3,若为交易所假期，则为前一日	现金
ICE_UK	可可	C	16:30 - 23:55 pre-open 08:00	1=GBP10	10吨	最近的10个3,5,7,9,12月份	N.A.	N.A.	最后交易日前的第十一个交易日12:00	实物
ICE_UK	英国富时	Z	08:00 - 04:00 pre-open 07:45	0.5pt=GBP 5	GBP10 × Index	3,6,9,12	N.A.	N.A.	合约月份第3个星期5	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
Liffe-Euronext	CAC40	FCE	14:00-00:30,(T+1)00:30-04:00 (到期合约最后交易日22:00收盘)	0.5pt=Euro 5	Euro10 xIndex	最近3个连续月及之后3个季月及之后8个6月、12月	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五(22:00HKT) (若非交易日,则为前1个交易日)	现金
SGXQ	摩根台湾指数	TW	08:45-13:50(T) 14:15-04:45(T+1) (到期合约最后交易日无T+1交易)	0.1 pt = USD10	USD100 × Index	现月, 下月及之后12个季月	±10%(熔断10分钟), ±15%(熔断10分钟),之后不能超过 ±15%限制;最后交易日无价格限制	N.A.	合约月份最后第2个交易日	现金
	日经平均指数225	NK	(7:15-7:28开市前时段, 7:28-7:30不可取消时段) 07:30 - 14:30(T) (其中14:29-14:30为不可取消时段) 14:55 - 04:45(T+1)(14:45-14:53可以挂单, 14:53-14:55不可取消时段)	5 pt = JPY2500	JPY500 × Index	3个连续月及之后12个季月	指数低于7000点时: ±1000 (熔断10分钟), ±1500 (熔断10分钟), 之后±2000; 指数 7000至10000点之间: ±1500 (熔断10分钟), 之后±2000; 指数 10000点之上: ±2000		合约月份第2个星期五之前1个交易日	
	中国A50指数	CN	09:00 - 16:35 (T) (08:45-08:58,16:30-16:34可以挂单, 08:58-09:00 及 16:34-16:35 的挂单不可撤) 17:00-04:45 (T+1) (16:50-16:58可以挂单, 16:58-17:00的挂单不可撤, 到期合约最后交易日无T+1交易)	2.5 pt = USD 2.5	USD 1 × Index	现月, 下月及之后4个季月	±10%, ±15%(熔断10分钟), 之后无限制。最后交易日无价格限制		合约月份最后第2个交易日	

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
SGXQ	MSCI中国指数	CH	09:00 – 16:35 (T) (08:45-08:58,16:30-16:34可以挂单; 08:58-09:00 及 16:34-16:35 的挂单不可撤) 17:15-02:00 (T+1) (17:05-17:13可以挂单, 17:13-17:15的挂单不可撤)到期合约最后交易日无T+1交易)	2 pt = USD 10	USD 5 x Index	现月，下月及之后4个季月	±10%，±15%(熔断10 分钟), 之后无限制。最后交易日无价格限制	N.A.	合约月份最后第2个交易日	现金
	印度Nifty指数	IN	09:00 – 18:15(T) 18:40-04:45(T+1) (到期合约最后交易日无T+1交易)	0.5pt=USD1	USD 2 x Index	现月，下月及之后5个季月	±10%，±15%，±20%(熔断5分钟), 之后无限制。最后交易日无价格限制		合约月份最后一个星期四，若为印度假期，则为前一个交易日	
	TSI CFR铁矿石指数期货	FEF	8 : 00-20 : 00(T) 20 : 15- 04 : 45(T+1)(到期合约最后交易日无T+1交易)	0.01= USD1	100公吨 (议定大宗交易 (NLT) 最少5手)	48个连续月份	N.A.	N.A.	每个合约月份最后一个（非新加坡假日）的交易日	实物
	SICOM20号标准胶	TF	07 : 55-18 : 00	0.1美分/公斤=USD5.00	5吨=5000公斤	12个连续月	±10%（冷静期15分钟-可挂单，但不成交），之后无限制	N.A.	交割月份前一个月的最后交易日	

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
SGXQ	美元/离岸人民币期货	UC	07:00 - 18:00(T) 18:15 - 04:45(T+1) (06:45-06:58及17:55-17:59 可以挂单;开盘前06:58-07:00 及收盘前17:59-18:00 挂单不可撤; 18:05-18:13可以挂单;开盘前 18:13-18:15挂单不可撤; 最后交易日: 07:00-11:00)	0.0001 = 10 离岸人民币	100000美元	13个连续月份+之后的八个季月 (3,6,9,12)	N.A.	N.A.	合约月份第三个周三之前的两个香港营业日	现金
	人民币/美元期货	CY	07:40 - 18:00(T), 18:45 - 02:00(T+1) 10月22日生效 最后交易日7:40am-9:00am	0.0001 (每10 CNY) = 5 美元	500,000人民币	13个连续月份+之后的八个季月 (3,6,9,12)	N.A.	N.A.	合约月份第三个周三前的两个北京营业日	现金
	摩根新加坡指数	SGP	8 : 30-17 : 15 (T) 17 : 40- 04 : 45(T+1)	0.05=5新币	100新币*期货价格	现月, 下月及之后4个季月	±15%(熔断10 分钟), 之后无限制。最后交易日无价格限制	N.A.	合约月份最后第2个交易日	现金
	摩根马来西亚指数	MY	8 : 30-17 : 30(T) , 18 : 30-02 : 00(T+1)	0.25pt = USD 5	USD 20 X Index	2个连续月份以及这一年度的季月 (3,6,9,12)	±20%(熔断10 分钟), 之后无限制。最后交易日无价格限制	N.A.	合约月份最后一个交易日	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
HKEX	H股指数	HHI	9:15-12:00 & 13:00-16:30(T) 17:15-23:45 (T+1) (08:45-09:11可以开始挂单,9:11-9:15不可挂,撤,改单, ,12:30-12:56可以挂单,12:56-13:00不可以挂,改,撤单 到期合约最后交易日收市时间为下午4时正)	1指数点=HKD50.00	HKD50 ×指数	现月，下月及之后两个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	该月的最后第二个营业日	现金
	恒生指数	HSI		1指数点=HKD50.00	HKD50 ×指数	现月，下月及之后两个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	该月的最后第二个营业日	现金
	小型恒生指数	MHI		1指数点=HKD10.00	HKD10 ×指数					
	小型H股指数	MCH	9:15-12:00&13:00-16:30(T) 17:15-23:45 (T+1) (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	1指数点=HKD10.00	HKD10 ×指数	现月，下月及之后两个季月	N.A.	N.A.	该月的最后第二个营业日	现金
	博彩业指数	GTI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数					
	内银指数	MBI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数					

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
HKEX	内房指数	MPI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数	现月，下月及之后两个季月	N.A.	N.A.	该月的最后第二个营业日	现金
	内油指数	MOI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数					
	软件指数	SSI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数					
	IT器材指数	ITI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数					
	藥业指数	MCI	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午4时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数					
	中华交易服务中国120指数 (中华120)	CHH	9:15-12:00&13:00-16:30 (到期合约月份在最后交易日收市时间为下午3时正)	0.5指数点= HKD 25.00	HKD50 ×指数	现月，下月及之后两个季月	N.A.	N.A.	该月的最后第二个营业日(若该日为中国内地假日，则最后交易日为之前的一个香港和内地的交易日)	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易 (夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
HKEX	美元兑人民币 (香港) 期货	CUS	9:00-16:30(T)& 17:15-23:45(T+1) (到期合约月份在最后交易日收市时间为上午11时正)	0.0001 =RMB 10	100,000美元	现月，接下来的三个连续月以及之后的四个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	合约月份的第三个星期三的前两个营业日	实物
	欧元兑人民币 (香港) 期货	CEU	9:00-16:30(T)& 17:15-23:45(T+1) (到期合约月份在最后交易日收市时间为上午11时正)	0.0001 =RMB 5	50,000欧元	现月，下月及之后两个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	合约月份的第三个星期三的前两个营业日	现金
	日元兑人民币 (香港) 期货	CJP	9:00-16:30(T)& 17:15-23:45(T+1) (到期合约月份在最后交易日收市时间为上午11时正)	0.0001 =RMB 6 (报价单位是每100日元兑人民币)	6,000,000日元	现月，下月及之后两个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	合约月份的第三个星期三的前两个营业日	现金
	澳元兑人民币 (香港) 期货	CAU	9:00-16:30(T)& 17:15-23:45(T+1) (到期合约月份在最后交易日收市时间为上午11时正)	0.0001 =RMB 8	80,000澳元	现月，下月及之后两个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	合约月份的第三个星期三的前两个营业日	现金
	人民币兑美元 (香港) 期货	UCN	9:00-16:30(T)& 17:15-23:45(T+1) (到期合约月份在最后交易日收市时间为上午11时正)	0.0001 =USD 3 (报价单位是每10人民币兑美元)	300,000人民币	现月，接下来的三个连续月以及之后的四个季月	T+1时段的可委托价格区间为T时段最后成交价的5%	N.A.	合约月份的第三个星期三的前两个营业日	现金
KRX	韩国KOSPI200期货	-	08:00- 14:45	0.05=KRW12,500 (2017.03.27生效)	KRW250,000*KOSPI 200期货价格 (2017.03.27生效)	3, 6, 9, 12	±8%, ±15%, ±20%	N.A.	合约月份的第二个星期四	现金
	韩国KOSPI200期权	-	08:00- 14:45(现金交割月的合约2:20收盘，其他合约2:35-2:45为公开喊价时段)	0.01=KRW2,500 (<10权利金) 0.05 = KRW12,500 (>10的权利金) (2017.03.27生效)	KRW250,000*KOSPI 200期权价格 (2017.03.27生效)	接下来的3个月以及最近的一个 (3,6,9,12) 的季月	N.A.	N.A.	合约月份的第二个星期四	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
	美元/韩元 USD/KRX	-	08:00- 14:45(最后交易日08:00-10:30)	0.1=KRW1000	10000美金	6个连续月加接下来的两个季月	N.A.	N.A.	合约月份第三个周一	实物
	日元/韩元 JPY/KRX	-	08:00- 14:45(最后交易日08:00-10:30)	0.1=KRW1000	1000000日元	6个连续月加接下来的两个季月	N.A.	N.A.	合约月份第三个周一	实物
ASX	悉尼SPI200指数	AP	从3月的第二个周日到冬令转换2017年4月2日&夏令转换2017年10月1日到11月的第一个周日 6:50am-1:30pm & 2:10pm-4:00am; 从4月2日到夏令转换2017年10月1日 7:50am-2:30pm & 3:10pm-5:00am; 从11月的第一个周日到3月的第二个周日 6:50am-1:30pm & 2:10pm-5:00am	1指数点=AUD25	AUD25x指数	接下来的六个季月和最近的两个非季月	N.A.	N.A.	合约月份第三个周四的12.00pm	现金

期货合约细则

Futures Contract Specification



指数期货 Equity Index Futures *注：保证金会根据交易所标准变动，最新更新日期：20170406

交易所	合约名称	交易所代码	香港交易(夏令时)	最低波幅	合约大小	合约月份	涨跌停	首次通知日	最后交易日	交割方式
ASX	ASX30天银行间现金利率合约期货	IB	从3月的第二个周日到至4月第一个周日 &十月第一个周日到11月第一个周日 日：2:14pm-4:00am & 5:34am-1:30pm； 4月第一个周日到十月第一个周日： 3:14pm-5:00am & 6:34am-2:30pm，11月第一个周日到3月第二个周日2:14pm-4:30am & 5:34am-1:30pm	0.005=AUD12.33 (计算方法： AUD3,000,000*0.01%*30/365=AUD24.66 per 1 bp	AUD3,000,000	连续的十八个月份	N.A.	N.A.	合约月份最后一个交易日	现金
ASX	澳大利亚90银行本票期货	IR	从3月的第二个周日到至4月第一个周日 &十月第一个周日到11月第一个周日 日：2:08pm-4:00am & 5:28am-1:30pm； 4月第一个周日到十月第一个周日： 3:08pm-5:00am & 6:28am-2:30pm，11月第一个周日到3月第二个周日2:08pm-4:30am & 5:28am-1:30pm	0.01≈AUD24 (0.01%相等近乎AUD \$24)	AUD1,000,000	3，6，9，12的季月最多5年	N.A.	N.A.	交割月第二个周五的前一天早上9点	实物

ASX	澳大利亚3年国债	YT	从3月的第二个周日到至4月第一个周日 &十月第一个周日到11月第一个周日：2:10pm-4:00am & 5:30am-1:30pm； 4月第一个周日到十月第一个周日：3:10pm-5:00am & 6:30am-2:30pm，11月第一个周日至3月第二个周日2:10pm-4:30am & 5:30am-1:30pm	0.005 = （交割月第8天 到 交割月15天） 0.01（剩下的时间段） (0.01%相等近乎AUD \$30)	AUD100,000	3，6，9，12中的两个季月	N.A.	N.A.	交割月第15天（如果是非交易日则为之后一天交易日）早上九点	实物
ASX	澳大利亚10年国债	XT	从3月的第二个周日到至4月第一个周日 &十月第一个周日到11月第一个周日：2:12pm-4:00am & 5:32am-1:30pm； 4月第一个周日到十月第一个周日：3:12pm-5:00am & 6:32am-2:30pm，11月第一个周日至3月第二个周日2:12pm-4:30am & 5:32am-1:30pm	0.0025 = （交割月第8天 到 交割月15天） 0.005（剩下的时间段）(0.005%相等近乎AUD \$47)	AUD 100,000	3，6，9，12中的两个季月	N.A.	N.A.	交割月第15天（如果是非交易日则为之后一天交易日）早上九点	实物
ASX	澳大利亚20年国债	XX	从3月的第二个周日到至4月第一个周日 &十月第一个周日到11月第一个周日：2:12pm-4:00am & 5:32am-1:30pm； 4月第一个周日到十月第一个周日：3:12pm-5:00am & 6:32am-2:30pm，11月第一个周日至3月第二个周日2:12pm-4:30am & 5:32am-1:30pm	0.0025 = （交割月第8天 到 交割月15天） 0.005~AUD40（剩下的时间段）(0.005%相等近乎AUD \$40)	AUD50,000	3，6，9，12中的两个季月	N.A.	N.A.	交割月第15天（如果是非交易日则为之后一天交易日）早上九点	实物
BMD	富时大马吉隆坡综合指数	FKLI	08: 45-12:45, 14: 35-17: 15	0.5指数点= MYR 25.00	MYR 50x指数	现货月份、下一月份以及两个日历季月份	除现货月之外的相应合约月份，每一交易时段为20%。现货合约月份无价格限制。到期前最后五个交易日内，第二个月份合约无价格限制	N.A	合约月份最后一个交易日	现金

EUREX	意大利长期国债	FBTP	14:00-01:00 最后交易日交易到18:30	0.01= EUR 10	EUR 100000	最近的3,6,9,12季月循环里的3个	N.A.	N.A	合约月份的10号的前两个工作日，如果10号为假期，则为10号下一日的前两个工作日	实物
EUREX	法国长期国债	FOAT	14:00-01:00 最后交易日交易到18:30	0.01= EUR 10	EUR 100000	最近的3,6,9,12季月循环里的前3个	N.A.	N.A	合约月份的10号的前两个工作日，如果10号为假期，则为10号下一日的前两个工作日	实物
EUREX	西班牙长期国债	FBON	14:00-01:00 最后交易日交易到18:30	0.01= EUR 10	EUR 100000	最近的3,6,9,12季月循环里的前3个	N.A.	N.A	合约月份的10号的前两个工作日，如果10号为假期，则为10号下一日的前两个工作日	实物
EUREX	欧元区STOXX银行指数	FESB	13:50-04:00 最后交易日18:00收盘	0.1 pt = EUR 5	EUR 50 x Index	最近的3,6,9,12季月循环里的前3个	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五,若为交易所假期, 则为前一日	现金
EUREX	STOXX欧洲600银行指数	FSTB	13:50-04:00 最后交易日18:00收盘	0.1 pt = EUR 5	EUR 50 x Index	最近的3,6,9,12季月循环里的前3个	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五,若为交易所假期, 则为前一日	现金
EUREX	德银x-trackers嘉实沪深300指数ETF	CRQF	14: 51-23:30 (13:30-14:51为盘前交易)	0.01 EUR = EUR 10	1000 ETF	最近的3,6,9,12季月循环里的前3个	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五,若为交易所假期, 则为前一日	现金
JPX	日本TOPIX指数	TOPIX	7:45-14:15 (T), 15:30-4:30 (T+1) (14:10-14: 15以及4:25-4:30收市集合竞价)	0.5 pt = JPY 5000	JPY 10000 x Index	连续5个 (3,6,9,12) 中的季月	±8%,±12%,±16%	N.A.	合约月份的第2个星期五的前一日, 若为交易所假期, 则为再前一日	现金
JPX (OSE)	迷你日经225指数	Mini NK	7:45-14:15(T),15:30-4:30 (T+1) (14:10-14: 15以及4:25-4:30收市集合竞价)	5 pt = JPY 500	JPY 100 x Index	最近的3个连续合约 (非季度合约) 以及季度合约 (3, 6, 9, 12) 中3, 9最近的3个合约, 6, 12最近的10个合约	±8%,±12%,±16%	N.A.	合约月份的第2个星期五的前一日, 若为交易所假期, 则为再前一日	现金
JPX	日经225指数	NK225	7:45-14:15 (T), 15:30-4:30 (T+1) (14:10-14: 15以及4:25-4:30收市集合竞价)	10 pt=JPY 10000	JPY1000 x Index	最长5年的季度合约 (6月和12月: 最近10个合约月份; 3月和9月: 最近3个合约月份)	±8%, ±12%, ±16%(熔断10分钟), 之后不再扩板。	N.A.	合约月份的第二个星期五 (如果非工作日, 则为前一个工作日) 的前一个工作日	现金

EUREX	俄罗斯RDX指数-美元计价	FRDX	13:50-04:00 (13:30可开始挂单; 收盘后开始盘后竞价至04:30结束; 到期 合约最后交易日 22:30收盘)	0.5 pt = USD 5	USD 10 x Index	连续4个（3,6,9,12）中的季月,之后的连续4个半年月（6,12）,以及接下来的2个整年月（12）	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五,若为交易所假期, 则为前一日	现金
ICE_US	迷你摩根新兴市场指数	MME	08:00-06:00 (周一早上6点开市, 最后交易日收市时间是凌晨4:15)	0.1pt = USD 5	USD 50 x Index	连续5个（3,6,9,12）中的季月	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五(纽约时间下午4:15分)	现金
Euronext	荷兰AEX指数	FTI	14:00-00:30(T),00:30-04:00(T+1) (到期合约最后交易日22:00收盘)	0.05 pt = EUR 10	EUR 200 x Index	最近连续3个月以及4个（3,6,9,12）中的季月	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五,若为交易所假期, 则为前一日	现金
EUREX	迷你德国DAX指数	FDXM	13:50-04:00 (13:30可开始挂单; 收盘后开始盘后竞价至04:30结束; 到期 合约最后交易日 19:00收盘)	1pt=Euro5	Euro5 xIndex	连续3个（3,6,9,12）中的季月	N.A.	N.A.	合约月份的第3个星期五,若为交易所假期, 则为前一日	现金
SGX	摩根印度尼西亚指数	ID	09:00 - 17:25 (T) (08:45可以挂单, 08:58-09:00 及 17:29-1730 的挂单不可撤) 18:30-02:00 (T+1) (18:20可以挂单, 18:28-18:30的挂单不可撤, 到期合约最后交易日交易到17:30, 无T+1交易)	5 pt= USD 10	USD 2 x Index	最近连续2个月以及4个（3,6,9,12）中的季月	±15%（10分钟熔断）	N.A.	合约月份倒数第二个交易日, 若为印尼假期, 则为前一日	现金

TAIFEX	电子期货	TE	上午8:45-13:45（到期合约最后交易日8:45-13:30）	0.05 pt=NTD 200	TWD 4000 x Index	最近2个连续月，及3、6、9、12中三个连续季月。共5个月份合约在市场交易	±10%（前结算价）	N.A.	合约月份的第三个星期三	现金
	金融期货	TF(我司代码T-TF)	上午8:45-13:45（到期合约最后交易日8:45-13:30）	0.2 pt=NTD 200	TWD 1000 x Index	最近2个连续月，及3、6、9、12中三个连续季月。共5个月份合约在市场交易	±10%（前结算价）	N.A.	合约月份的第三个星期三	现金
	台股期货	TX	上午8:45-13:45（到期合约最后交易日8:45-13:30）	1 pt=NTD 200	TWD 200 x Index	最近2个连续月，及3、6、9、12中三个连续季月。共5个月份合约在市场交易	±10%（前结算价）	N.A.	合约月份的第三个星期三	现金
单位换算	1磅=0.000454吨		1盎司=28.349523克	1英担=112磅=0.050802吨		1桶=158.987295升	1美吨（短吨）=907.18474千克		1加仑=3.785412升	
	1板英尺=0.00236立方米		1000蒲式耳（燕麦）=17.2吨		1000蒲式耳（黄豆）=27吨		1000蒲式耳（小麦）=27吨		1000蒲式耳（玉米）=25.4吨	