**中国金融期货交易所** **欧元兑美元期货仿真合约交易细则**

**第一章 总则**

**第一条** 为规范中国金融期货交易所（以下简称交易所）欧元兑美元期货仿真合约（以下简称本合约）交易行为，根据《中国金融期货交易所交易规则》及相关实施细则，制定本细则。

**第二条** 交易所、会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当遵守本细则。

**第三条** 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

**第二章 合约**

**第四条** 本合约的合约标的为欧元兑美元即期汇率。

**第五条** 本合约的合约面值为10,000欧元。

**第六条** 本合约的报价方式为每100欧元的美元价格，如100欧元兑换138.08美元。

**第七条** 本合约的最小变动价位为0.01美元/100欧元，合约交易报价为0.01美元/100欧元的整数倍。

**第八条** 本合约的合约月份为最近的三个连续月及随后的三个季月。季月是指3月、6月、9月、12月。

**第九条** 本合约的最后交易日为合约到期月份的第三个周三，遇到国家法定假日或者因异常情况等原因未交易的，以下一交易日为最后交易日。

交割日期同最后交易日。

到期合约交割日的下一交易日，新的月份合约开始交易。

**第十条** 本合约的交易代码为EF。

**第三章 交易业务**

**第十一条**  本合约的交易单位为手，合约交易以交易单位的整数倍进行。

**第十二条** 本合约交易指令每次最小下单数量为1手，市价指令每次最大下单数量为50手，限价指令每次最大下单数量为200手。

**第十三条** 本合约的交易时间为前一工作日21:00-当日2:30，9:00-11:30和13:00-15:15。其中前一工作日21:00-当日2:30为夜盘交易时间。

交易日是指从前一个工作日的夜盘交易开始至当日15:15结束。交易日的第一节为前一工作日21:00-当日2:30和9:00-11:30，交易日的第二节为13:00-15:15。

**第十四条** 本合约采用集合竞价和连续竞价两种交易方式。

集合竞价在夜盘交易开市前5分钟内进行，其中20:55-20:59为指令申报时间，20:59-21:00为指令撮合时间。夜盘交易不开市，集合竞价顺延至该交易日上午8:55-9:00进行。

连续竞价时间为前一个工作日21:00-当日2:30，9:00-11:30和13:00-15:15。最后交易日连续竞价时间为前一个工作日21:00-当日2:30，9:00-11:30和13:00-15:00。

**第四章 结算业务**

**第十五条** 本合约交易盈亏、交易保证金、手续费均以人民币结算。

**第十六条** 本合约的当日结算价为合约最后1小时成交价格按照成交量的加权平均价。计算结果保留至小数点后2位。

**第十七条** 本合约的当日折算汇率为该交易日15:15外汇市场美元兑人民币即期汇率。

**第十八条** 本合约以当日结算价以及折算汇率作为计算当日盈亏的依据。具体计算公式如下：

当日盈亏=｛∑[（卖出成交价－当日结算价）×卖出量]+∑[（当日结算价－买入成交价）×买入量]+（上一交易日结算价－当日结算价）×（上一交易日卖出持仓量－上一交易日买入持仓量）｝/100×上一交易日折算汇率×合约面值

**第十九条**  本合约的手续费标准为每手不高于1元。

**第二十条** 本合约的交割结算价为最后交易日中国金融期货交易所编制的欧元兑美元价格。

**第二十一条** 本合约采用现金交割方式。

**第二十二条** 本合约的交割手续费标准为每手1元。

**第五章 风险管理**

**第二十三条** 本合约的最低交易保证金标准为合约价值的3%。其中，合约价值＝（合约价格/100）×折算汇率×合约面值，当日结算时本合约所有持仓按照当日折算汇率计算合约价值并收取相应交易保证金。

**第二十四条** 本合约的每日价格最大波动限制是指其每日价格涨跌停板幅度，为上一交易日结算价的±3％。

合约上市首日涨跌停板幅度为挂盘基准价的±6％。上市首日有成交的，于下一交易日恢复到合约规定的涨跌停板幅度；上市首日无成交的，下一交易日继续执行前一交易日的涨跌停板幅度。如上市首日连续三个交易日无成交的，交易所可以对挂盘基准价作适当调整。

**第二十五条** 本合约实行持仓限额制度。

（一）进行投机交易的客户某一合约单边持仓限额为5000手。

（二）进行投机交易的非期货公司会员持仓限额由交易所另行规定。

（三）某一合约结算后单边总持仓量超过10万手的，结算会员下一交易日该合约单边持仓量不得超过该合约单边总持仓量的25%。进行套期保值交易和套利交易的持仓按照交易所有关规定执行。

**第六章 附则**

**第二十六条**  违反本细则规定的，交易所按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》有关规定处理。

**第二十七条** 本细则由交易所负责解释。

**第二十八条** 本细则所称的“工作日”指自然日，即该日0:00至24:00。

**第二十九条** 本细则自2014年 月 日起实施。