

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： 跨商品組合
查詢： 2211-6901

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 2018 年 7 月 23 日（星期一）起，將以下的產品組合的對沖值比率及組合折抵率定為：

產品組合		組合對沖值比率*	組合折抵率
TSI CFR 中國鐵礦石	對 TSI CFR 中國鐵礦石	1 比 1	40%
62%鐵粉期貨月度合約	62%鐵粉期貨季度合約		

*帶有正號之比率是指兩種產品之對沖值須為相反方向方可組成跨商品組合。於 PRIME 的參數配置中，則以 A 對 B 代表兩種產品為相反的市場方向。詳情請參照《[結算公司按金計算方法 – PRIME](#)》<只有英文版>。

香港期貨結算有限公司
授權簽署人
薛家傑 謹啟