

編號	CD/CDCRM/092/2024
Ref. No.:	
日期	22/04/2024
Date:	

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： 推出 MSCI 中國 A50 互聯互通 (美元) 指數期貨及 MSCI 印度 (美元) 指數期貨多層跨期按金
查詢： 2211-6901

香港期貨結算有限公司 (期貨結算所) 宣布，多層跨期按金方法將延伸至 MSCI 中國 A50 互聯互通 (美元) 指數期貨及 MSCI 印度 (美元) 指數期貨並將於 2024 年 4 月 29 日推出。

多層跨期按金為組合風險按金系統 (PRiME)¹ 現有方法及功能，並且現正應用於期貨結算所的產品²。最新的[組合風險按金系統 \(PRiME\)](#) 和多層跨期按金例子亦已在香港交易所網站刊發。

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 2024 年 4 月 29 日 (星期一) 起 (包括強制即日變價調整及按金追收，如適用)，將修訂以上提及的期貨合約的跨期按金，相關修訂可在[這裏](#)查閱。以上提及的期貨合約的按金水平將維持不變。

MSCI 中國 A50 互聯互通 (美元) 指數期貨及 MSCI 印度 (美元) 指數期貨多層跨期按金水平會於日後透過參與者及會員通告定期更新。結算所參與者應作出相應調整。

¹ 期貨結算公司的組合風險按金系統 (PRiME) 是 DCASS 用以計算期貨及期權產品按金要求的按金計算方法。

² 港元利率期貨及美元兌人民幣(香港)期貨及期權

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

李麗儀 謹啟

本通告原文為英文，此乃中譯本。如譯本內的字義或詞義與英文本有所出入，一概以英文原文為準。