

期貨結算所規則及程序

第四章

結算所按金、變價調整、補倉及戶口

強制即日變價調整及按金

410C. (a) 於每個營業日的 T 時段開市後，期貨結算所會根據結算所程序，就期貨結算所參與者於期貨結算所指定的時間開市前，在設有 T+1 時段的市場及與該設有 T+1 時段的市場有相同或類似相關工具的任何其他市場所持有的全部未平倉合約，追收強制即日變價調整及按金。

附錄 A

費用

說明

金額<sup>1</sup>

結算費(期貨)及行使費(期權)

MSCI 澳洲淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 中國自由 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 中國自由淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場亞洲 (中國除外) 淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場亞洲 (韓國除外) 淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場亞洲淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場歐非中東淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場 (中國除外) 淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場 (韓國除外) 淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場拉丁美洲淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元

MSCI 香港淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 印度 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 印度淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 印尼 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 印尼淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
<u>MSCI 日本 (日元) 指數期貨</u>	<u>每張65日元</u>
<u>MSCI 日本淨總回報 (日元) 指數期貨</u>	<u>每張65日元</u>
MSCI 日本淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 馬來西亞 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 馬來西亞淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 紐西蘭淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 太平洋 (日本除外) 淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 太平洋淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 菲律賓 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 菲律賓淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
<u>MSCI 新加坡自由 (新加坡元) 指數期貨</u>	<u>每張1.40新加坡元</u>
MSCI 新加坡自由淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新加坡淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 台灣 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
<u>MSCI 台灣25/50 (美元) 指數期貨</u>	<u>每張1.00美元</u>
<u>MSCI 台灣25/50淨總回報 (美元) 指數期貨</u>	<u>每張0.60美元</u>
MSCI 台灣淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 泰國 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 泰國淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 越南 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 越南淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	每張0.60美元

附錄 B

T+1 時段截止時間

產品	時間
MSCI 澳洲淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 中國自由 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 中國自由淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場亞洲 (中國除外) 淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場亞洲 (韓國除外) 淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場亞洲淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場歐非中東淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場 (中國除外) 淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場 (韓國除外) 淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場拉丁美洲淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 香港淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印度 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印度淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印尼 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印尼淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
<u>MSCI 日本 (日元) 指數期貨</u>	<u>凌晨三時正</u>
<u>MSCI 日本淨總回報 (日元) 指數期貨</u>	<u>凌晨三時正</u>
MSCI 日本淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 馬來西亞 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 馬來西亞淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 紐西蘭淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 太平洋 (日本除外) 淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 太平洋淨總收益回報 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 菲律賓 (美元) 指數期貨	凌晨三時正

MSCI 菲律賓淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	凌晨三時正
<u>MSCI 新加坡自由 (新加坡元) 指數期貨</u>	<u>凌晨三時正</u>
MSCI 新加坡自由淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新加坡淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 台灣 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 台灣淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	凌晨三時正
<u>MSCI 台灣 25/50 (美元) 指數期貨</u>	<u>凌晨三時正</u>
<u>MSCI 台灣 25/50 淨總回報 (美元) 指數期貨</u>	<u>凌晨三時正</u>
MSCI 泰國 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 泰國淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 越南 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 越南淨總 <u>收益回報</u> (美元) 指數期貨	凌晨三時正

於期交所自動電子交易系統（「HKATS電子交易系統」）內買賣的期貨／期權合約的結算所程序

## 第二章 結算及交收程序

### 2.8B 強制即日變價調整及按金

除期貨結算所另行規定外，於每個營業日T時段開市後，期貨結算所會就期貨結算所參與者於期貨結算所指定的時間開市前，在設有T+1時段的市場及任何擁有與該市場相同或類似相關工具的任何其他市場所持有的全部未平倉合約，當中包括於前一個T+1時段交易的合約，追收強制即日變價調整及按金。期貨結算所參與者宜於T時段開市前一段由期貨結算所不時指定的時間內完成所有根據程序第1.4條及第1.5條對於T+1時段執行的交易之後交易調整。此後之任何後交易調整有可能不被納入計算強制即日變價調整及按金中。

附錄 V - (5)

#### 附表 V

#### 認可貨幣列表

認可貨幣列表如下： -

#### 6. 新加坡元