

MSCI中国指数包含在环球不同市场上市的大型及中型中资企业。指数成份股包括A股、B股、H股、红筹股、P股及外地上市股票。

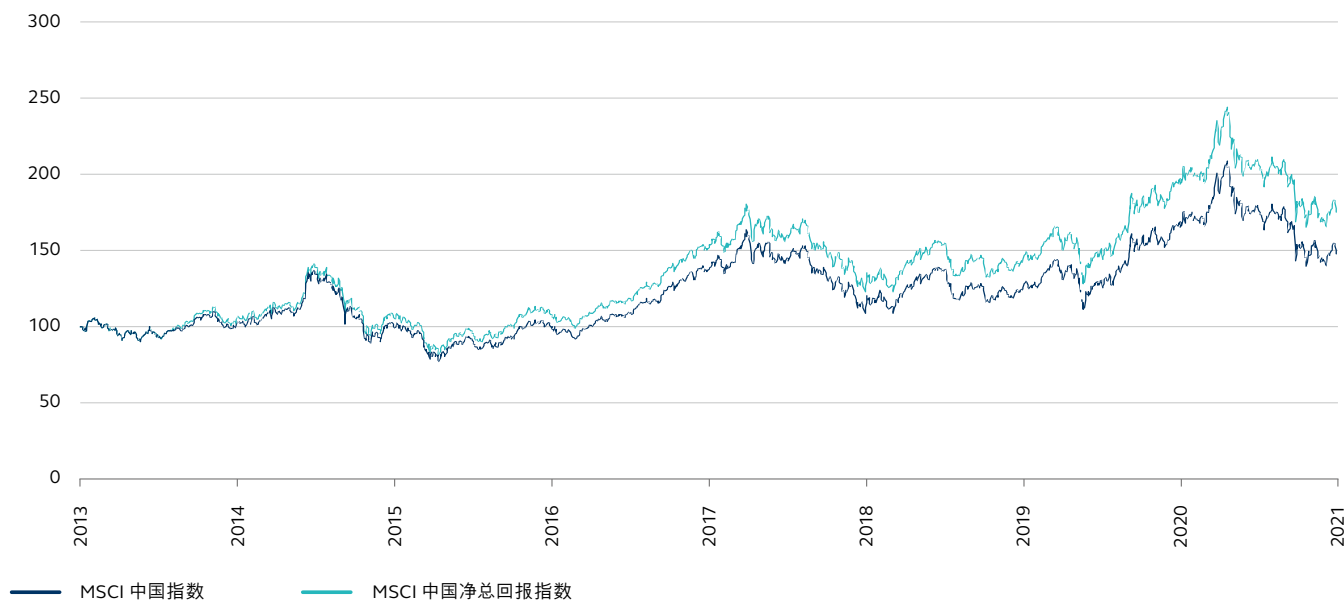
MSCI中国净总回报指数以美元计值，以总回报净额形式（将派息净额再投资于指数组合）计算全球上市中资企业的表现。

美国商品期货交易委员会 (CFTC) 批准 - 符合美国合格投资者投资

特色

香港交易所推出MSCI中国 (美元) 指数期货及MSCI中国净总回报 (美元) 指数期货，为投资者提供投资及对冲中国股票市场的新工具。这期货合约以美元计值，交易时间覆盖亚洲时区（日间交易时段）及欧美时区（收市后交易时段）。

指数表现 (2013年11月至2021年10月)



资料来源：彭博，截至2021年10月29日，指数基值为100

10大成份股

股票	行业	自由流通调整市值 (十亿美元)	指数比重
腾讯	电讯服务	355.97	12.91%
阿里巴巴	可选择消费品	318.12	11.54%
美团	可选择消费品	139.72	5.07%
JD.com	可选择消费品	68.02	2.47%
建设银行	金融	65.40	2.37%
药明生物	医疗保健	54.83	1.99%
蔚来汽车	可选择消费品	53.67	1.95%
平安保险	金融	45.49	1.65%
百度	电讯服务	45.02	1.63%
小米	资讯科技	39.41	1.43%
总计		1,185.66	42.99%

资料来源: MSCI, 截至2021年10月29日

资讯供应商讯息代码

指数

	彭博资讯	路孚特
MSCI 中国指数	M3CN Index	.MICN00000PUS
MSCI 中国净总回报指数	M1CN Index	.MICN00000NUS

期货

	ACTIV Financial	经济通	彭博资讯	汇港资讯	联盛亚富 资讯科技	路孚特	SIX Financial Information Ltd
MSCI 中国 (美元) 指数期货	CHI/ <yy><m>.HF	Access code: CHI	CSIA Index	CHI	870979	0#HCHI:	CHImy
MSCI 中国净总回报 (美元)指数期货	CHN/ <yy><m>.HF	Access code: CHN	CJEA Index	CHN	870980	0#HCHN:	CHNmy

注1: <yy>=年, <m>=月

注2: y: 合约年份, m: 合约月份



合约概要

项目	主要合约细则
合约	MSCI 中国 (美元) 指数期货
相关指数	MSCI 中国指数
HKATS代码	CHI
交易货币	美元
相关指数货币	美元
每指数点合约乘数	500美元
最低价格波幅 (指数点)	0.02
合约月份	现月、下月及之后的四个季月
假期交易	此合约可在香港公众假期交易 (新年假期除外)
交易时段	上午9时正至下午4时30分 (日间交易时段) ; 下午5时15分至凌晨3时正 (收市后交易时段) (最后交易日收市时间为下午4时30分)
最后交易日	合约月份的倒数第二个交易日, 前提是该日是指数所有成份股都可供买卖的一般营业日。若当日并非一般营业日, 则以该日的前一个同属一般营业日的交易日作为最后交易日。
最后结算价	MSCI中国 (美元) 指数期货合约最后结算价格由结算所厘定, 将为合约月份的最后交易日的MSCI中国指数的官方收报指数价值, 若第三个小数位为5或以上, 则调高至最接近的两个小数位, 若为5以下, 则调低至最接近的两个小数位。
最后结算日	厘定最后结算价格之后的交易日
大额未平仓合约	于任何一个合约月份的500张平仓合约
持仓限额	所有合约月份长仓或短仓合约净额计35,000张为限
最低大手交易量要求	50
交易费	1.00美元
结算费	1.00美元
证监会收费*	0.07美元
CFTC	符合美国合资格投资者投资

* 证监会收费以相关合约的交易货币收取, 为0.54港元的等价金额, 按期交所不时厘定的汇率换算。



合约概要

项目	主要合约细则
合约	MSCI 中国净总回报（美元）指数期货
相关指数	MSCI 中国净总回报指数
HKATS代码	CHN
交易货币	美元
相关指数货币	美元
每指数点合约乘数	50美元
最低价格波幅 (指数点)	0.001
合约月份	现月、下月及之后的四个季月
假期交易	此合约可在香港公众假期交易（新年假期除外）
交易时段	上午9时正至下午4时30分（日间交易时段）； 下午5时15分至凌晨3时正（收市后交易时段） (最后交易日收市时间为下午4时30分)
最后交易日	合约月份的第三个星期五。如非交易日，则为前一个交易日
最后结算价	MSCI中国净总回报（美元）指数期货合约最后结算价格由结算所厘定，将为合约月份的第三个星期五的MSCI中国净总回报指数的官方收报指数价值，若第四个小数位为5或以上，则调高至最接近的三个小数位，若为5以下，则调低至最接近的三个小数位，若MSCI有限公司宣布有与MSCI中国净总回报指数相关的非预期的市场关闭事件，则为MSCI有限公司在合约月份的第三个星期五后公布的MSCI中国净总回报指数最终非预期市场关闭指数水平。
最后结算日	厘定最后结算价格之后的第一个交易日
大额未平仓合约	于任何一个合约月份的500张平仓合约
持仓限额	所有合约月份长仓或短仓合约净额计53,000张为限
最低大手交易量要求	25
交易费	0.60美元
结算费	0.60美元
证监会收费*	0.07美元
CFTC	符合美国合格投资者投资

* 证监会收费以相关合约的交易货币收取，为0.54港元的等价金额，按期交所不时厘定的汇率换算。

香港交易所免责声明

本文件所载资料仅供一般信息性参考，并不构成提出要约、招揽、邀请或建议以购买或出售任何期货合约或其他产品，亦不构成提出任何投资建议或任何形式的服务。本文件并非针对亦不拟分派给任何其法律或法规不容许的司法权区或国家的人士或实体又或供其使用，也非针对亦不拟分派给任何会令香港交易及结算有限公司（「香港交易所」）及香港期货交易所有限公司（「期交所」）（统称「该等实体」，各称「实体」）或其任何附属公司又或此等公司所营运的任何公司须受该司法权区或国家任何注册规定所规管的人士或实体又或供其使用。本文件概无任何章节或条款可视为对任何该等实体带来任何责任。任何在香港交易所或期交所执行的期货合约，其有关交易、结算和交收的权利与责任将完全取决于香港交易所或期交所及相关结算所的适用规则以及香港的适用法律、规则及规例。尽管本文件所载资料均取自认为是可靠的来源或按当中内容编备而成，该等实体概不就有关资料或数据就任何特定用途而言的准确性、有效性、时效性或完备性作任何保证。若资料出现错漏或其他不准确又或由此引起后果，该等实体及其营运的公司概不负责或承担任何责任。本文件所载资料乃按「现况」及「现有」的基础提供，资料内容可能被修订或更改。有关资料不能取代根据阁下具体情况而提供的专业意见，而本文件概不构成任何法律意见。该等实体对使用或依赖本文件所提供的资料而直接或间接产生的任何损失或损害概不负责或承担任何责任。

MSCI免责声明

MSCI及MSCI指数的名称均属MSCI Inc.（「MSCI」）或其附属机构的服务商标并已授权香港期货交易所有限公司使用。任何MSCI指数的期货合约及期权合约（「指数合约」）并非由MSCI、其附属机构又或任何其他参与或涉及制作或编制该MSCI指数的人士保荐、担保或许可。MSCI、其附属机构又或任何其他参与或涉及制作或编制任何MSCI指数的人士概不就是否适合投资于该等指数合约发表任何陈述。对于任何人士或任何实体使用任何MSCI指数或当中所载任何数据会取得同样的结果，MSCI、其附属机构又或任何其他参与或涉及制作或编制任何MSCI指数的人士亦概不作任何明示或暗示的保证或承担任何责任。未有事先联络MSCI以确定是否需要取得其批准，则此证券的买方、卖方或持有人又或任何其他人士或实体均不得使用或引述任何MSCI的商号、商标或服务标记以保荐、许可、推广或宣传此证券。

香港交易及结算所有限公司

香港中环康乐广场8号交易广场二期8楼

info@hkex.com.hk 电话 +852 2522 1122 | 传真 +852 2295 3106 hkexgroup.com | hkex.com.hk

