

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： 新增按金對銷的產品組合

查詢： 2211-6901

謹請留意，為作持續支持按金對銷倡議，香港期貨結算有限公司欣然宣佈，將根據以下生效日期透過PRIME¹的跨商品組合功能於以下產品組合提供按金對銷。

於 2019 年 10 月 2 日生效

1. 恒生指數 (總股息累計指數) 期貨 對 恒生指數產品
2. 恒生中國企業指數 (總股息累計指數) 期貨 對 恒生指數產品
3. 恒生中國企業指數 (淨股息累計指數) 期貨 對 恒生指數產品
4. 恒生指數 (總股息累計指數) 期貨 對 恒生中國企業指數產品
5. 恒生指數 (淨股息累計指數) 期貨 對 恒生中國企業指數產品
6. 恒生中國企業指數 (總股息累計指數) 期貨 對 恒生中國企業指數產品

於 2019 年 11 月 1 日生效

7. 恒生指數 (淨股息累計指數) 期貨 對 恒生指數 (總股息累計指數) 期貨
8. 恒生中國企業指數 (總股息累計指數) 期貨 對 恒生指數 (總股息累計指數) 期貨
9. 恒生中國企業指數 (淨股息累計指數) 期貨 對 恒生指數 (總股息累計指數) 期貨
10. 恒生中國企業指數 (總股息累計指數) 期貨 對 恒生指數 (淨股息累計指數) 期貨
11. 恒生中國企業指數 (淨股息累計指數) 期貨 對 恒生指數 (淨股息累計指數) 期貨
12. 恒生中國企業指數 (淨股息累計指數) 期貨 對 恒生中國企業指數 (總股息累計指數) 期貨

¹詳情請參照 [PRIME Margining Guide](#) 的 2.7 段

以上產品組合按金對銷的參數，即對沖值比率及組合折抵率將，將適時另行通知。參與者應作出相應的安排。

在上述按金抵銷安排實施後，以上產品組合將會合併為同一個產品組別以評估參與者集中持倉量的風險。參與者應安排充足的資金，以確保在指定時限內繳清因上述變更而產生的集中持倉量額外按金（如有）。有關集中持倉量風險政策的詳情及產品組別列表，請瀏覽香港交易所網站²。

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

葉善佳 謹啟

² https://www.hkex.com.hk/Services/Clearing/Listed-Derivatives/Risk-Management/The-Safeguards?sc_lang=zh-HK