

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 2020 年 8 月 6 日 (星期四) 起 (包括強制即日變價調整及按金追收，如適用)：

1. 將暫停以下組合的按金對銷：

- MSCI 中國自由 (美元) 指數 對 MSCI 台灣 (美元) 指數
- MSCI 中國自由 (美元) 指數 對 MSCI 台灣淨總回報 (美元) 指數

2. 將修訂以下的產品組合的對沖值比率及組合折抵率載於[這裏](#)：

- MSCI 台灣 (美元) 指數 對 恒生國企淨股息累計指數
- MSCI 台灣 (美元) 指數 對 恒生國企總股息累計指數
- MSCI 台灣 (美元) 指數 對 恒指淨股息累計指數
- MSCI 台灣 (美元) 指數 對 恒指總股息累計指數
- MSCI 台灣 (美元) 指數 對 恒生中國企業指數產品
- MSCI 台灣淨總回報 (美元) 指數 對 恒生中國企業指數產品
- MSCI 印度 (美元) 指數 對 MSCI 印度淨總回報 (美元) 指數
- MSCI 新加坡自由淨總回報 (美元) 指數 對 恒生國企淨股息累計指數
- MSCI 新加坡自由淨總回報 (美元) 指數 對 恒生國企總股息累計指數
- MSCI 新加坡自由淨總回報 (美元) 指數 對 恒生中國企業指數產品

香港期貨結算有限公司
授權簽署人

戴嘉欣 謹啟