

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： 跨商品組合及集中持倉量風險

查詢： 2211-6901

跨商品組合

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 9 月 18 日（星期五）起（包括強制即日變價調整及按金追收，如適用），將暫停以下組合的按金對銷及將產品組合的對沖值比率及組合折抵率載於[這裏](#)：

- MSCI 台灣淨總回報（美元）指數 對 恒生中國企業指數產品
- MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報（美元）指數 對 MSCI 馬來西亞淨總回報（美元）指數
- MSCI 新興市場亞洲除韓國淨總回報（美元）指數 對 MSCI 台灣（美元）指數
- MSCI 新興市場歐非中東淨總回報（美元）指數 對 MSCI 中國自由淨總回報（美元）指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 MSCI 台灣（美元）指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 恒生國企淨股息累計指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 恒生國企總股息累計指數
- MSCI 新興市場除中國淨總回報（美元）指數 對 MSCI 中國自由（美元）指數

集中持倉量風險

由 2020 年 9 月 18 日 (星期五) 起,下列產品將合併為一個產品組別以評估參與者集中持倉量的風險:

MSCI 印尼淨總回報(美元)和印尼(美元)指數期貨產品組別

- MSCI 印尼 (美元) 指數
- MSCI 印尼淨總回報 (美元) 指數

MSCI 馬來西亞淨總回報(美元)和馬來西亞(美元)指數期貨產品組別

- MSCI 馬來西亞 (美元) 指數
- MSCI 馬來西亞淨總回報 (美元) 指數

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

戴嘉欣 謹啟