

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 10 月 21 日（星期三）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 新興市場歐非中東淨總回報（美元）指數 對 恒生國企總股息累計指數
- 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

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 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 MSCI 新興市場亞洲淨總回報（美元）指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 MSCI 新興市場淨總回報（美元）指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 MSCI 新興市場（美元）指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 MSCI 亞洲除日本淨總回報指數
- MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報（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 恒生指數產品
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數 對 恒生中國企業指數產品

- MSCI 太平洋除日本淨總回報 (美元) 指數 對 恒生指數產品
- MSCI 新興市場除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒生中國企業指數產品
- MSCI 新興市場除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒生指數產品
- MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒生國企淨股息累計指數
- MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒生國企總股息累計指數
- MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒指淨股息累計指數
- MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒指總股息累計指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報 (美元) 指數 對 恒指淨股息累計指數
- MSCI 太平洋除日本淨總回報 (美元) 指數 對 恒指總股息累計指數
- MSCI 新興市場除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒生國企淨股息累計指數
- MSCI 新興市場除中國淨總回報 (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 恒指淨股息累計指數
- MSCI 新興市場除中國淨總回報 (美元) 指數 對 恒指總股息累計指數

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

李麗儀 謹啟