

香港期貨交易所有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

HONG KONG FUTURES EXCHANGE LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項:: 更改恒生指數期貨期權及恒生中國企業指數期貨期權的正式結算價計算方法

查詢:: 陳先生 (電話: 2211-6139 電郵: wallacechan@hkex.com.hk)

David Lutz 先生 (電話: 28403618 電郵: DavidLutz@hkex.com.hk)

香港期貨交易所(「交易所」)將優化現有恒生指數(「恒指」)期貨期權及恒生中國企業指數(「國企指數」)期貨期權的正式結算價計算方法,若獲監管機構批准,更改後的正式結算價計算方法暫定於**2022年6月17日(星期五)**生效。為免生疑問,現有正式結算價計算方法仍然適用於2022年5月20日到期的恒指期貨期權及國企指數期貨期權。更改後的正式結算價計算方法將採用期權合約到期日由下午3:55至下午4:00之間相應月份的期貨價格。

相關資訊請參閱以下表格:

	現有正式結算價計算方法	更改後的正式結算價計算方法 暫定於2022年6月17日生效
恒指期貨期權	恒指期貨期權的正式結算價由結算所決定,並採用到期日當天相應合約月份恒指期貨在下列時間所報恒指期貨價格的平均數為依歸,下調至最接近的整數:上午9:30至中午12:00以及下午1:00至4:00期間每隔五(5)分鐘所報的恒指期貨價格。	恒指期貨期權的正式結算價由結算所決定,並採用到期日當天相應合約月份恒指期貨在下列時間所報恒指期貨價格的平均數為依歸,下調至最接近的整數: <u>下午3:55至下午4:00</u> 期間每隔 <u>五(5)秒鐘</u> 所報的恒指期貨價格。

	現有正式結算價計算方法	更改後的正式結算價計算方法 暫定於 2022 年 6 月 17 日生效
國企指數期貨期權	國企指數期貨期權的正式結算價由結算所決定，並採用到期日當天相應合約月份國企指數期貨在下列時間所報國企指數期貨價格的平均數為依歸，下調至最接近的整數：上午 9:30 至中午 12:00 以及下午 1:00 至 4:00 期間每隔五(5)分鐘所報的國企指數期貨價格。	國企指數期貨期權的正式結算價由結算所決定，並採用到期日當天相應合約月份國企指數期貨在下列時間所報國企指數期貨價格的平均數為依歸，下調至最接近的整數： <u>下午 3:55 至下午 4:00</u> 期間每隔 <u>五(5)秒鐘</u> 所報的國企指數期貨價格。

相關規則修訂將於另一張通告公佈。

市場科
證券產品發展部
聯席主管
蕭沛聰 謹啟

本通告已以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本的字義或詞義與英文本有所出入，概以英文本為準。