

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 MSCI 印度 (美元) 指數期貨合約細則 - 更新

查詢： 技術支援：

- HKATS (熱線¹: 2211-6360 電郵: hkatssupport@hkex.com.hk)

- DCASS (熱線: 2979-7222 電郵: clearingpsd@hkex.com.hk)

商務諮詢:

- 李先生 (電話: 2840-2107 電郵: williamyli@hkex.com.hk)

- 馮先生 (電話: 2211-6320 電郵: dickfung@hkex.com.hk)

參見於 2022 年 12 月 6 日發布的公告 (參考編號: [MKS/EQD/18/22](#))。香港期貨交易所 (「期交所」) 宣布已獲得證券及期貨事務監察委員會批准更改 MSCI 印度 (美元) 指數期貨合約細則，是次更改定於 **2023 年 1 月 16 日 (星期一)** 生效 (「生效日」)。

以下變更將於生效日開始，有關修訂後的合約細則，請參閱附件二：

合約內容	現有	更改後
HKATS 代碼	MDI	MND
合約乘數 (美元)	50	20
最低波幅 (指數點)	0.2	0.05
最低交易量要求 (合約張數)	50	25
持倉限額 (合約張數)	15,000	37,500

¹ 所有與 HKATS 熱線的對話將會被錄音。關於港交所隱私政策條款請參考以下連結：

https://www.hkex.com.hk/global/exchange/privacy-policy?sc_lang=zh-HK

相關規則修訂將於另一張通告公佈。

交易及其他運作安排

因應是次修訂，期交所將於生效日起為經修訂的合約細則使用新的交易代碼（即 HKATS 代碼）：

合約	現有 HKATS 代碼	新 HKATS 代碼
MSCI 印度（美元）指數期貨	MDI	MND

HKATS 代碼的更改將由期交所於生效日實施。參與者應注意，現有 HKATS 代碼「MDI」的合約將於 2023 年 1 月 14 日收市後交易時段後暫停交易。期交所根據現有 HKATS 代碼「MDI」下的任何未平倉合約將按 1：2 的比例與新 HKATS 代碼「MND」下的相應合約月份遷移。決定持有現有 HKATS 代碼「MDI」倉位的參與者於生效日應注意新 HKATS 代碼「MND」可能存在差異的風險，如有需要，參與者應在適當情況下採取適當行動。請詳細參閱附件一。

在此提醒參與者應查看與變更相關的交易及結算系統。參與者的 OAPI 系統不需作出任何更改。

需要檢閱未平倉合約資訊的參與者應參考 OMD-D。

市場科
證券產品發展部
羅博仁 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。

生效日前後的合約倉位遷移示例

假設參與者在遷移前持有 1 張長倉和 1 張短倉 MDI 合約：

日期	MDI 合約數目		MND 合約數目	
	長倉	短倉	長倉	短倉
緊接 2023 年 1 月 14 日收市後 交易時段收市前	1 張	1 張	不適用	不適用
生效日 2023 年 1 月 16 日	不適用	不適用	2 張	2 張

*對於每張 MDI 合約，它將於生效日變成兩張 MND 合約。

生效日後的合約細則

合約	MSCI 印度 (美元) 指數期貨
HKATS 代碼	MND
相關指數	MSCI 印度指數 (以印度盧比計價)
合約乘數	20 美元
合約月份	現月、下月及之後的四個季月
最低波幅	0.05 個指數點
持倉限額	37,500 張合約
大額未平倉合約	任何一個系列 500 張未平倉合約
交易時間 (香港時間)	上午 9 時正至下午 6 時 30 分 (日間交易時段) 下午 7 時 15 分至凌晨 3 時正 (收市後交易時段) 此合約可於香港公眾假期 (元旦假期除外) 買賣
最後交易日的交易時間 (香港時間)	上午 9 正至下午 6 時 30 分
最後交易日	合約月份的最後一個星期四。如非交易日或非印度的營業日，則為緊貼該日的前一個交易日，同日也是印度的營業日
最後結算價	最後交易日的相關指數的官方收報指數價值，調至最接近的兩個小數位
最低交易量要求	25 張合約
交易費	1.00 美元
結算費	1.00 美元
證監會徵費	0.07 美元

MSCI 免責聲明

合約並非由 MSCI Inc. (「MSCI」)、其聯屬公司又或任何其他參與或涉及製作或編制任何指數的人士保薦、認可、出售或推廣。MSCI、其聯屬公司又或任何其他參與或涉及製作或任何指數的人士概無就合約對任何人士或實體而言的合法性或合適性作出推介。MSCI、其聯屬公司及任何其他參與或涉及製作或編制 MSCI 指數的人士均不保證 MSCI 指數或當中數據的原創性、準確性及/或完整性。MSCI、其聯屬公司又或任何其他參與或涉及製作或編制 MSCI 指數的人士概不作任何明示或隱含的保證，並更明確聲明，對於合約、MSCI 指數或當中任何數據有否能進行商售或有否適合個別目的或用途一概不作任何保證。在不限制上述條文的前提下，MSCI、其聯屬公司及任何其他參與或涉及製作或編制 MSCI 指數的人士，對任何直接、特殊、懲罰性、間接或相應而生的損害（包括利潤損失）概不負責，即使已獲告知可能會因任何期貨或期權合約的關係又或因計算或發布 MSCI 指數上的任何錯誤或延遲而引致此等損害、索償、損失或開支。MSCI、其聯屬公司又或任何其他參與或涉及製作或編制 MSCI 指數的人士在釐定、組成或計算 MSCI 指數時概無責任考慮合約的發行人、合約的擁有者或期交所的需要。MSCI、其聯屬公司又或任何其他參與或涉及製作或編制 MSCI 指數的人士概不負責亦無參與釐定所發行合約的時間、定價或數量，也概不負責亦無參與釐定或計算任何合約兌現現金的任何公式。