

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： 交易及結算運作安排 – 新世界發展有限公司股票期貨合約的資本調整 – 有條件特別股息

查詢： HKATS 熱線¹ 電話：2211-6360
DCASS 熱線 電話：2979-7222

交易所參與者請留意，以下股票期貨合約將於除淨日根據所宣布的公司行動作出資本調整：

| | |
|-----------------------|-----------------------------------|
| 股票期貨合約的正股名稱 (股票編號) | 新世界發展有限公司 (“新世界發展”) (00017) |
| HKATS 代號 | NWD |
| 公司行動事宜 | 有條件特別股息每股港幣 1.59 元 ² |
| 除權日 | 2023 年 11 月 23 日 |

有關新世界發展於 2023 年 9 月 29 日所發放的公告的詳細內容可經以下網址閱覽：

https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2023/0929/2023092900498_c.pdf
https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2023/0929/2023092900554_c.pdf
https://www1.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/2023/0929/2023092900546_c.pdf

¹所有 HKATS 熱線之來電均會被錄音。有關本交易所的私隱政策聲明請參閱以下網址：

https://www.hkex.com.hk/Global/Exchange/Privacy-Notice?sc_lang=zh-HK

² 請留意新世界發展同時宣布每股派發普通股息港幣 0.30 元，其普通股息將包括在調整比率 (AR) 計算當中。

交易安排

現時以交易代碼 NWD 的新世界發展股票期貨交易安排如下：

1. 調整及轉移未平倉倉盤

於除淨日之前一個營業日收市後，交易代碼 NWD 的新世界發展股票期貨系列的未平倉倉盤將被調整及轉移至股票期貨系列交易代碼 NWA。

2. 推出新股票期貨系列以作交易

於除淨日，新的新世界發展股票期貨系列將會以標準交易代碼 NWD 推出及以標準合約乘數買賣。

有關新世界發展股票期貨系列交易代碼 NWD 的調整程序安排如下：

| 調整項目 | 計算程式 | 備註 |
|------------------|---|------------------|
| 調整比率 (AR) | $(\text{股份收市價} - \text{普通股息} - \text{特別股息}) / (\text{股份收市價} - \text{普通股息})$ | 以四捨五入取小數位後 4 個數字 |
| 經調整合約成價 (ACP) | 未平倉股票期貨系列的合約價 \times AR | 以四捨五入取小數位後 2 個數字 |
| 調整合約乘數 (ACM) | 未平倉股票期貨系列的合約價 \times (1,000 股 / ACP) | 以四捨五入取小數位後 4 個數字 |

| 合約 | 交易代碼 | 合約乘數 (股數) | 可供交易日期 | 除權日或之後 新增股票期貨系 列 |
|----|------|--------------|------------------------|------------------------|
| 調整 | NWA | ACM | 由除淨日起至 2024 年 6 月 27 日 | 無 |
| 標準 | NWD | 1,000 | 由除淨日起 | 有 |

交易代碼 NWD 及 NWA 的新世界發展期貨之交易費用水平為類別 1。

經調整的股票期貨系列及標準的股票期貨系列將以不同的交易代碼於 HKATS/DCASS 顯示。於除淨日前一個營業日收市後，有關經調整的股票期貨系列及標準的股票期貨系列將於 DCASS 的結算處理後於報表 TP011 顯示。

當資本調整作出後，所有合約調整將會是最終而具約束性的。合約調整後，即使公司行動建議其後被有關當局否決，包括但不限於監管機構和法院，已作出的資本調整亦不會還原。

交易所參與者要特別注意，於到期日調整後的股票期貨系列及標準的股票期貨系列的結算數額是按照其相應的合約乘數計算。未平倉倉盤轉移至調整後的股票期貨系列後，持倉數額及其他合約事項是不受影響的。

結算及交收安排

標準的 NWD 股票期貨系列及經調整的 NWA 股票期貨系列之間倉盤對銷是不允許的。

通知有關員工及客戶

交易所參與者應通知所有持有上述股票期貨未平倉合約的客戶，有關本通告所述交易及結算運作的詳細安排及附帶的風險。務請各參與者確保後勤系統能作出有關資本調整的配合。再者，當為客戶處理買賣以及提供諮詢時，小心處理有關標準及已調整股票期貨合約的交易及結算運作安排。

營運科
交易部
聯席主管
張宙 謹啟

本通告以英文及中文譯本刊發。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。