

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 2025 年 9 月 29 日（星期一）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 香港淨總回報（美元）指數 對 MSCI 亞洲除日本淨總回報指數
- MSCI 新興市場歐非中東淨總回報（美元）指數 對 MSCI 新興市場亞洲淨總回報（美元）指數
- MSCI 新興市場亞洲除韓國淨總回報（美元）指數 對 MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數
- MSCI 台灣 25/50（美元）指數 對 MSCI 新興市場亞洲除中國淨總回報（美元）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，相關修訂載於[這裏](#)：

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

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

戴嘉欣 謹啟