

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： 跨商品組合及集中持倉量風險

查詢： 2211-6901

### 跨商品組合

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 10 月 2 日（星期四）起（包括強制即日變價調整及按金追收，如適用），將暫停以下組合的按金對銷及將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 新興市場歐非中東淨總回報（美元）指數 對 MSCI 新興市場除韓國淨總回報（美元）指數
- MSCI 新興市場除中國淨總回報（美元）指數 對 MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數
- MSCI 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
- MSCI 台灣 25/50（美元）指數 對 MSCI 新興市場除中國淨總回報（美元）指數

**集中持倉量風險**

由 2025 年 10 月 2 日（星期四）起，下列產品將合併為一個產品組別以評估參與者集中持倉量的風險：

MSCI 太平洋淨總回報（美元）期貨產品組別：

- MSCI 太平洋淨總回報（美元）指數期貨
- MSCI 日本淨總回報（美元）指數期貨
- MSCI 太平洋除日本淨總回報（美元）指數期貨
- MSCI 澳洲淨總回報（美元）指數期貨

香港期貨結算有限公司

授權簽署人

戴嘉欣 謹啟