

編號 DMD/106/11
Ref. No.:
日期 2011 年 8 月 19 日
Date: 19 August 2011

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 - 太古股份有限公司 'A' 期貨合約的資本調整 — 特別中期股息

Subject:

查詢 HKATS 熱線 2211-6360
Enquiry: DCASS 熱線 2979-7222

交易所參與者請留意，如太古股份有限公司 'A' 董事委員會於二零一一年八月三十日授權派發特別中期股息，以下期貨合約將於除淨日根據所宣佈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)	太古股份有限公司 'A' (19)
HKATS 代號	SWA
公司行動事宜	特別中期股息每股3.00 港元
除淨日	2011年9月14日

有關太古股份有限公司 'A' 於 2011 年 8 月 18 日發放的公告詳細內容可經以下網址閱覽：
http://www.hkexnews.hk/listedco/listconews/sehk/20110818/LTN20110818096_C.pdf

調整程序

於除淨日前一個營業日收市後，上述股票期貨的尚未平倉倉盤將作出資本調整。調整程序的詳情如下：

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
經調整立約成價 (ACP)	未平倉期貨合約價 $\times$ AR	以四捨五入取小數位後 2 個數字
調整合約乘數 (ACM)	未平倉期貨合約價 $\times$ (500 股 / ACP)	以四捨五入取小數位後 4 個數字

香港交易及結算所有限公司
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited

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。

平行交易

於除淨日前一個營業日收市後，未平倉倉盤將被轉移至調整後的期貨合約。此外，於除淨日當日將推出新的期貨合約，並以標準合約乘數買賣。經調整的期貨合約及標準的期貨合約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，有關經調整的期貨合約及標準的期貨合約將於 DCASS 的結算處理後於報表 TP011 顯示。於除淨日當日及其後的並行買賣細節安排如下：

合約	交易代碼	合約乘數 (股數)	可供交易日期	除淨日或之後 新增期貨合約
調整	SWB	ACM	由除淨日至 2012 年 3 月 29 日	無
標準	SWA	500	由除淨日起	有

交易所參與者要特別注意，於到期日調整後的期貨合約及標準的期貨合約的現金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期貨合約後，持倉數額及其他合約事項是不受影響的。

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資本調整，交易及結算運作的詳細安排。務請各參與者確保後勤系統作出有關準備以確保運作暢順。交易所參與者務必提醒員工明白上述交易及結算運作的安排，當為客戶處理買賣以及提供諮詢時，小心處理有關標準及調整後期貨合約的交易。

交易科
衍生產品市場部
總監
何耀昌 謹啓

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。