HKEX
香港交易所

新聞稿

九龍倉集團結構性產品、期貨及期權或須作出的調整安排

由於九龍倉集團有限公司（九龍倉集團）宣布預期約於 2017 年 11 月 14 日（星期二）向其董事會提交決議案，旨在（其中包括）批准建議分拆九龍倉置業地產投資有限公司（九龍倉置業集團）及有條件宣派一項特別中期股息並以分派方式派付，香港交易及結算所有限公司（香港交易所）今天（星期二）宣布，如果分拆九龍倉置業集團上市建議獲通過，九龍倉集團期權、期貨及結構性產品須作相應調整安排。

摘要

公司名稱（股票編號）	九龍倉集團 （4）
公司行動事宜	透過以九龍倉集團向九龍倉集團合資格股東分派九龍倉置業集團股份的方式 （分派方式），將九龍倉置業集團分拆，並於聯交所獨立上市 （權益）
權益比例	1 （每持有一股九龍倉集團股份獲取一股九龍倉置業集團股份）
除淨日	2017 年 11 月 16 日
九龍倉置業集團上市日	將稍後公布

有關九龍倉集團於 2017 年 9 月 4 日及 2017 年 11 月 2 日所發放的公告的詳細內容可經以下網址閱覽：
http://www.hkexnews.hk/listedco/listconews/SEHK/2017/0904/LTN201709041759_C.pdf

http://www.hkexnews.hk/listedco/listconews/SEHK/2017/1102/LTN201711021464_C.pdf

.../2

香港交易及結算所有限公司
香港中環港景街一號國際金融中心一期12樓
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited
12/F, One International Finance Centre, 1 Harbour View Street, Central, Hong Kong
info@hkex.com.hk
(t) +852 2522 1122 (f) +852 2295 3106
hkexgroup.com | hkex.com.hk

以九龍倉集團股份作為相關資產的結構性產品

所有以九龍倉集團作相關資產的結構性產品，其上市文件均載有處理相關股份公司行動的條文。由於分拆九龍倉置業集團上市，以九龍倉集團作相關資產的結構性產品細則，包括權利及行使價，將於九龍倉置業集團上市翌日作出調整。

以九龍倉集團作相關資產的結構性產品會於 2017 年 11 月 16 日至九龍倉置業集團上市日（包括首尾兩天）暫停買賣。

結構性產品發行商須就上述調整及暫停買賣發表公告，投資者應細閱公告的內容。

九龍倉集團期貨

交易安排

現時以交易代碼 WHL 的九龍倉集團股票期貨交易安排如下：

1. 調動未平倉合約

   於除淨日之前一個交易日收市後，九龍倉集團股票期貨合約的未平倉合約將以**一對一**比率**轉移**至臨時交易代碼 WHA。

2. 暫停交易

   由於九龍倉置業集團權益的價值有待確定，臨時交易代碼 WHA 以下的未平倉合約將由除淨日起至包括九龍倉置業集團上市日在內暫停買賣交易。

3. 推出新期貨月份以作交易

   於除淨日，新的九龍倉集團股票期貨系列將會以標準合約股數及交易代碼 WHL 推出並進行買賣。

4. 待九龍倉置業集團價值確定後對未平倉合約進行的調整

   九龍倉置業集團的價值將採用成交量加權平均數〈VWAP〉計算，並只限於上市當日所有在聯交所以自動對盤的九龍倉置業集團交易。當九龍倉置業集團的價值得以確定，交易代碼 WHA 的未平倉合約倉盤便會作出調整，並轉倉至交易代碼 WHB 進行交易。交易代碼 WHB 的倉盤會由九龍倉置業集團上市日後的第一個營業日開始交易。

有關九龍倉集團股票期貨系列的調整程序安排如下：

調整項目	計算程式	備註
調整比率 (AR)	(相關股票於除淨日前一個交易日收市價減去權益) / 相關股票於除淨日前一個交易日收市價	以四捨五入取小數位後 4 個數字
經調整合約價值 (ACP)	未平倉股票期貨合約月份 × AR	以四捨五入取小數位後 2 個數字
經調整合約乘數 (ACM)	(未平倉股票期貨合約月份 × 1,000 股) / ACP	以四捨五入取小數位後 4 個數字

註：權益為九龍倉置業集團價值乘以九龍倉集團每股的權益比例。

以下為所有九龍倉集團股票期貨合約交易安排之摘要：

合約	交易代碼	相關股票	合約張數 (股數)	推出日期	可供交易日期	除淨日或之後新增股票期貨系列
標準	WHL	已除權益的九龍倉集團	1,000	除淨日	由除淨日起	有
調整	WHA	包含權益的九龍倉集團	1,000	除淨日	無	無
調整	WHB	已除權益的九龍倉集團	ACM	九龍倉置業集團上市日後的第一個營業日	由推出日期至 2018 年 6 月 28 日	無

有關結算與交收安排，詳情請參閱通告。
（http://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Circulars-and-Notices/Participant-and-Members-Circulars/HKFE/2017/MO_DT_169_17_c.pdf）

投資者應注意，調整後的股票期貨系列及標準的股票期貨系列的合約乘數並不相同。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條款均不受影響。

九龍倉集團期權

交易安排

現時以交易代碼 WHL 的九龍倉集團股票期權交易安排如下：

1. 調動未平倉合約

   於除淨日之前一個營業日收市後，交易代碼 WHL 的九龍倉集團股票期權系列的未平倉倉盤將以**一對一**比率**轉移**至臨時交易代碼 WHA。

2. 暫停交易

   由於九龍倉置業集團權益的價值有待確定，臨時交易代碼 WHA 以下的未平倉合約將由除淨日(即 2017 年 11 月 16 日)起至包括九龍倉置業集團上市日在內暫停買賣交易。

3. 推出新股票期權系列以作交易

   於除淨日，新的九龍倉集團股票期權系列將會以標準交易代碼 WHL 推出及以標準合約股數買賣。

4. 待九龍倉置業集團價值確定後對未平倉合約進行的調整

   九龍倉置業集團的價值將採用成交量加權平均數〈VWAP〉計算，並只限於上市當日所有 在聯交所以自動對盤的九龍倉置業集團交易。當九龍倉置業集團的價值得以確定，交易代碼 WHA 的未平倉合約倉盤便會作出調整，並轉倉至交易代碼 WHB 進行交易。交易代碼 WHB 的倉盤會由九龍倉置業集團上市日後的第一個營業日開始交易。

有關九龍倉集團股票期權系列交易代碼 WHL 的調整程序安排如下：

調整項目	計算程式	備註
調整比率 (AR)	(相關股票於除淨日前一個交易日收市價減去權益) / 相關股票於除淨日前一個交易日收市價	以四捨五入取小數位後 4 個數字
經調整行使價 (AEP)	未平倉期權系列的行使價 × AR	以四捨五入取小數位後 2 個數字
調整合約張數 (ACS)	(未平倉期權系列的行使價 × 1,000 股) / AEP	以四捨五入取小數位後 4 個數字

註：權益為九龍倉置業集團價值乘以九龍倉集團每股的權益比例。

以下為所有九龍倉集團股票期權合約交易安排之摘要：

合約	交易代碼	相關股票	合約張數 (股數)	推出日期	可供交易日期	除淨日或之後新增股票期權系列
標準	WHL	已除權益的九龍倉集團	1,000	除淨日	由除淨日起	有
調整	WHA	包含權益的九龍倉集團	1,000	除淨日	不適用	無
調整	WHB	已除權益的九龍倉集團	ACS	九龍倉置業集團上市日後的第一個營業日	由推出日期至 2018 年 9 月 27 日	無

有關結算與交收安排，詳情請參閱通告 。
（http://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Circulars-and-Notices/Participant-and-Members-Circulars/SEHK/2017/MO_DT_170_17_c.pdf）

投資者應注意，調整後的股票期權及標準的股票期權的合約張數並不相同。未平倉倉盤轉移至調整後的股票期權後，持倉數額及其他合約條款均不受影響。