

2018年5月28日

## 恒生指数公司推出恒生货币对冲指数系列

恒生指数有限公司(「恒生指数公司」)于今天推出恒生货币对冲指数系列(「指数系列」)·旨在协助海外投资者管理及减低货币风险。

该指数系列以恒生指数及恒生中国企业指数为基础,包括4种对冲货币 — 人民币、欧罗、英镑及日圆,合共有8项货币对冲指数。新指数会以各对冲货币100%对冲指数成份股的基础货币,即港币。

恒生指数有限公司董事兼研究及分析主管黄伟雄先生表示:「恒生货币对冲指数系列可协助有兴趣的海外投资者减低投资海外所涉及的货币风险。我们会继续留意市场发展,并以不同基础指数及对冲货币编制更多指数,以配合投资者不断变化的需要。」

该指数系列会于各项基础指数的每个交易日收市后计算及发布。有关该指数系列的详情,请参阅附件。

## 有关恒生指数有限公司

恒生指数有限公司(前称恒指服务有限公司)乃恒生银行之全资附属机构、负责编制及管理恒生指数系列。恒生指数系列由不同系列的指数组成、涵盖在香港/中国内地市场上市的股份/债券。有关恒生指数系列详情、请浏览该公司网页 www.hsi.com.hk。

# 完 #

## 恒生货币对冲指数系列

## 指数概览

指数	指数	¥4.	汤森路透代号
	基础指数: 恒生指数		
	● 恒指 <i>)</i>	(民币对冲指数	.HSIRMBH
	● 恒指図	次罗对冲指数	.HSIEURH
	● 恒指势	<b>总</b> 镑对冲指数	.HSIGBPH
	● 恒指日	日圆对冲指数	.HSIJPYH
	基础指数: 恒生中	国企业指数	
	- ● 恒生国	国指人民币对冲指数	.HSCERMBH
	● 恒生国	国指欧罗对冲指数	.HSCEEURH
	<ul><li>恒生国</li></ul>	国指英镑对冲指数	.HSCEGBPH
	● 恒生国	国指日圆对冲指数	.HSCEJPYH
推出日期	2018年5月28日		
指数基日	2013年1月30日		
指数基值	1,000		
指数发布	收市后发布一次		
对冲比率	100%		
指数计算	对冲指数(t) = 对冲指数(tr) × (对冲前指数收益+对冲收益)		
	其中:		
	tr	:最近对冲调整日	
	对冲前指数收益	:以对冲货币计算的基础指数收益	益
	对冲收益	:一个月远期合约的短仓收益/亏	损
	注: 此对冲策略会于每月月底签订一个月的远期合约·锁定下月月底的货币汇率· 以减低汇率波动带来的影响。		