

香港交易及結算有限公司是《證券及期貨條例》所述的認可控制人，亦為香港聯合交易所有限公司、香港期貨交易所有限公司、香港中央結算有限公司、香港聯合交易所期權結算有限公司、香港期貨結算有限公司及香港場外結算有限公司的控制人。

Hong Kong Exchanges and Clearing Limited is a recognized exchange controller under the Securities and Futures Ordinance which is the controller of The Stock Exchange of Hong Kong Limited, Hong Kong Futures Exchange Limited, Hong Kong Securities Clearing Company Limited, The SEHK Options Clearing House Limited, HKFE Clearing Corporation Limited and OTC Clearing Hong Kong Limited.

通告 CIRCULAR

事項： 更新 PC-SPAN 參數設定檔案
查詢： 2211-6901

本通告參照於 2022 年 1 月 17 日所發出的通告 (編號: [MO/DT/16/22](#) 及 [MO/DT/17/22](#))，中信証券股份有限公司(CTS) 期貨合約將於 2022 年 1 月 26 日起因應資本化發行作出資本調整。參與者若決定使用 PC-SPAN¹計算該等產品的按金規定，請於 2022 年 1 月 26 日或之前更新系數設定檔案。參與者可選擇透過以下任何一種方式進行更新：

1. 使用香港交易所網站最新的系數設定檔案取代現有檔案。

檔案超連結：

http://www.hkex.com.hk/eng/market/rm/rm_dcrm/riskdata/orgmast/orgmast.zip

檔案只載有所有經期貨結算公司及聯交所期權結算所結算的香港交易所產品的更新系數，並無提供其他交易所及結算所的系數；或

2. 使用芝加哥商業交易所 (CME) 網站登載的系數設定檔案取代現有檔案。

CME 網站的檔案由 CME 管理。有關檔案的更新時間，請參閱 CME 不時刊載的通告；或

¹ SPAN (標準風險投資組合分析) 為屬於芝加哥商業交易所的註冊商標

3. 透過 PC-SPAN 界面人手輸入：

參與者應最後才選用此方法，以避免操作過程中的潛在人為錯誤。

參與者如選擇透過方法 2 及 3 更新系數設定檔案，在計算任何按金前，應與香港交易所網站所提供的系數設定檔案（載於上述方法 1 的超連結）作對照檢查，以確保檔案準確無誤。

結算風險管理
副總裁

戴嘉欣 謹啟