

香港聯合交易所期權結算所有限公司
(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

THE SEHK OPTIONS CLEARING HOUSE LIMITED
(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

Subject: 新股票期權合約按金參數及更新 PC-SPAN 參數設定檔案

Enquiry: 2211-6901

本通告參照於 2019 年 11 月 20 日發出有關於 2019 年 11 月 26 日推出新股票期權合約的通告【編號：[MKS/EQD/11/19](#)】。參與者謹請留意，聯交所期權結算所決定自 **2019 年 11 月 26 日 (星期二)** 起，將新股票期權合約的按金參數定為：

	<u>價格校驗範圍</u>	<u>期權短倉最低按金</u>
阿里巴巴集團控股有限公司	4%	結算所按金間距的 10%

參與者若決定使用 PC-SPAN¹ 計算該等產品的按金規定，請於 **2019 年 11 月 26 日 (星期二)** 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

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。

香港聯合交易所期權結算所有限公司

授權簽署人

薛家傑 謹啟

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