

## 整戶風險保證金系統(SPAN) 調整 (草案)



### SPAN調整內容(一)

- 人民幣匯率選擇權上市案
  - 於風險參數檔內，對人民幣匯率(RH與RT)此兩種商品組合，分別增加人民幣匯率選擇權商品(RHO與RTO)之各項參數資訊與風險陣列內容
  - RHO與RTO之Product Type Code欄位為OOF (Option on Future)
- 美元計價黃金期貨縮小契約規模
  - 風險參數檔中有關GDF契約規模將配合調整
- 黃金類商品延長交易時間至16:15
  - 作法同現行16:15收盤商品

## SPAN調整內容(二)

- 高價位股票期貨加掛小型契約案
  - 加掛之小型股票期貨契約，將設定與相同標的證券之股票期貨與股票選擇權為同一商品組合
- 櫃買生技醫療指數期貨上市案
  - 於風險參數檔內，增加櫃買生技醫療類股指數商品組合(BT)及櫃買生技醫療指數期貨(BTF)相關內容
  - 櫃買生技醫療類股指數商品組合(BT)與櫃買指數商品組合(GT) 適用跨商品價差折抵

簡報完畢  
敬請指教