附表九、認購（售）權證預定之風險沖銷策略檢查表

申請機構名稱：

承辦人： 填表日期：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 檢查項目 | 發行人填報 | 交易所審查意見 |
| 1.本次發行所表彰之標的數量 |  |  |
| 2.發行人實際避險部位所表彰之標的數額 |  |  |
| 3.發行人是否評估標的價格漲(跌)10﹪、20﹪‧‧之風險及涉險金額 |  |  |
| 4.標的價格漲跌變動達10﹪、20﹪‧‧時，其預計避險之部位（含標的及其衍生性金融商品）。 |  |  |
| 5.發行人是否說明擬採避險之金融工具及參與之市場（含標的及其衍生性金融商品）。 |  |  |
| 6.發行人如係委由其他機構從事風險管理，或轉嫁風險予其他機構者：   * 其約定或交易契約內容 * 如係委由其他機構從事風險管理，或轉嫁風險與其他機構，該機構有關上開檢查項目2至6之說明 |  |  |
| 7.發行人如係部分委由其他機構從事風險管理，或轉嫁風險予其他機構者：   * 其預計之風險沖銷方式或策略說明 * 其約定或交易契約內容 * 如係委由其他機構從事風險管理，或轉嫁風險與其他機構，該機構有關上開檢查項目2至6之說明 |  |  |
| 8.如其委任之其他機構與申請資格認可時所提出之機構不同時，應重新提出評估說明 |  |  |

備註：發行人填報之欄位應由發行人註明所附文件之索引及說明