

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：陳小姐

聯絡電話：(02)2369-5678分機3186

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國109年6月1日

發文字號：台期結字第10903007110號

速別：最速件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：公告本公司「FTSE4GOOD臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」及「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會109年5月12日金管證期字第1090341797號函、本公司業務規則第29條、「FTSE4GOOD臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」交易規則第15條、「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」交易規則第15條、「結算保證金收取方式及標準」第4條、第5條之2辦理。
- 二、本公司「FTSE4GOOD臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」及「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值，如附件1、2。
- 三、本公司「FTSE4GOOD臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」及「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」保證金金額，如附件3。
- 四、公告「FTSE4GOOD臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」及「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額，自109年6月

8日起實施。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商
副本：金融監督管理委員會證券期貨局、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、臺灣集中保管結算所股份有限公司、中華民國期貨商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、台北國際金融資訊協會、植根國際資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 黃炳鈞

臺灣期貨交易所股份有限公司

「FTSE4GOOD 臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」

整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺灣永續期貨契約結算保證金

二、極端變動倍數(Extreme Move Multiplier)及極端涵蓋百分比
(Extreme Move Covered Fraction)

(一) 極端變動倍數定為 3 倍

(二) 極端涵蓋比率定為 32%

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)：不適用。

四、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)

跨月價差風險值=臺灣永續期貨契約結算保證金×50%

五、跨商品價差折抵率(Inter-Commodity Spread Credit Rate)及契約價值耗用比率(Delta Per Spread Ratio)

跨商品價差折抵契約	跨商品價差折抵率	契約價值耗用比率
TX vs E4	0.50	1 TX vs 1.01 E4
TE vs E4	0.50	1 TE vs 0.89 E4
TF vs E4	0.50	1 TF vs 0.57 E4
T5 vs E4	0.50	1 T5 vs 1.55 E4
XI vs E4	0.50	1 XI vs 0.52 E4
GT vs E4	0.50	1 GT vs 0.26 E4
G2 vs E4	0.50	1 G2 vs 0.54 E4
E4 vs BT	0.50	1 E4 vs 2.61 BT

六、空方選擇權最低風險值(Short Option Minimum Charge)：不適用。

臺灣期貨交易所股份有限公司

「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」

整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺灣生技期貨契約結算保證金

二、極端變動倍數(Extreme Move Multiplier)及極端涵蓋百分比
(Extreme Move Covered Fraction)

(一) 極端變動倍數定為 3 倍

(二) 極端涵蓋比率定為 32%

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)：不適用。

四、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)

跨月價差風險值=臺灣生技期貨契約結算保證金×50%

五、跨商品價差折抵率(Inter-Commodity Spread Credit Rate)及契約價
值耗用比率(Delta Per Spread Ratio)

跨商品價差折抵契約	跨商品價差折抵率	契約價值耗用比率
TX vs BT	0.50	1 TX vs 2.63 BT
TE vs BT	0.50	1 TE vs 2.33 BT
TF vs BT	0.50	1 TF vs 1.48 BT
T5 vs BT	0.50	1 T5 vs 4.06 BT
XI vs BT	0.50	1 XI vs 1.35 BT
GT vs BT	0.50	1 GT vs 0.67 BT
G2 vs BT	0.50	1 G2 vs 1.41 BT
E4 vs BT	0.50	1 E4 vs 2.61 BT

六、空方選擇權最低風險值(Short Option Minimum Charge)：不適用。

臺灣期貨交易所股份有限公司
 「FTSE4GOOD 臺灣指數公司臺灣永續指數期貨契約」、
 「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」
 保證金金額

生效日期：109 年 6 月 8 日

單位：新臺幣元

中文簡稱	契約代碼	結算保證金	維持保證金	原始保證金
臺灣永續期貨	E4F	28,000	29,000	38,000

單位：新臺幣元

中文簡稱	契約代碼	結算保證金	維持保證金	原始保證金
臺灣生技期貨	BTF	15,000	16,000	21,000