

## 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：賴小姐

聯絡電話：(02)2369-5678分機3158

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國108年9月23日

發文字號：台期結字第10803009120號

速別：普通件

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「櫃買富櫃200指數期貨契約」、「美國那斯達克100股價指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額，與各選擇權契約賣出買權及賣權混合部位風險保證金(C值)。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會108年8月27日金管證期字第1080329627號函、本公司業務規則第29條、「櫃買富櫃200指數期貨契約」交易規則第15條、「美國那斯達克100股價指數期貨契約」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及「選擇權契約保證金計收方式」辦理。
- 二、本公司「櫃買富櫃200指數期貨契約」及「美國那斯達克100股價指數期貨契約」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「櫃買富櫃200指數期貨契約」及「美國那斯達克100股價指數期貨契約」保證金金額，如附件3。
- 四、本公司各選擇權契約賣出買權及賣權混合部位風險保證金(C值)金額，如附件4。
- 五、公告「櫃買富櫃200指數期貨契約」、「美國那斯達克100股價指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額，自108年9月30日起實施。各選擇權契約賣出買權及



賣權混合部位風險保證金(C值)，自108年9月30日一般交易時段結束後起實施。

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、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、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、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

裝

訂

線





臺灣期貨交易所股份有限公司

「櫃買富櫃 200 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=櫃買富櫃 200 指數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=櫃買富櫃 200 指數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 G2	0.50	1 TX vs 1.85 G2
TE vs G2	0.50	1 TE vs 1.53 G2
TF vs G2	0.50	1 TF vs 1.10 G2
T5 vs G2	0.50	1 T5 vs 2.77 G2
XI vs G2	0.50	1 XI vs 1.05 G2
GT vs G2	0.50	1 GT vs 0.48 G2

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

「美國那斯達克 100 股價指數期貨契約」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=美國那斯達克 100 股價指數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=美國那斯達克 100 股價指數期貨結算保證金  
×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)：無。

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  
 「櫃買富櫃 200 指數期貨契約」、「美國那斯達克 100  
 股價指數期貨契約」保證金金額

生效日期：108 年 9 月 30 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
富櫃 200 期貨	G2F	10,000	11,000	14,000

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
美國那斯達克 100 期貨	UNF	16,000	17,000	22,000

**臺灣期貨交易所股份有限公司**  
**各選擇權契約賣出買權及賣權混合部位風險保證金(C 值)**

各選擇權契約賣出買權及賣權混合部位風險保證金(C 值)列表如下，並自 108 年 9 月 30 日一般交易時段結束後起實施。

一、臺指選擇權(TXO)契約

單位：新臺幣元

TXO	結算保證金 之適用金額	維持保證金 之適用金額	原始保證金 之適用金額
混合部位風險保證金 (C 值)	900	900	1,200

二、除臺指選擇權(TXO)契約，其他採定額計收保證金之契約

單位：元

採定額計收 保證金之契約	結算保證金 之適用金額	維持保證金 之適用金額	原始保證金 之適用金額
混合部位風險保證金 (C 值)	0	0	0

三、採比例計收保證金之契約

單位：比例(%)

採比例計收 保證金之契約	結算保證金 之適用比例	維持保證金 之適用比例	原始保證金 之適用比例
混合部位風險保證金 (C 值)之c%	0%	0%	0%