

臺灣期貨交易所 新聞稿

中華民國 108年5月9日

臺灣期貨交易所於108年5月9日公告調整臺指選擇權契約(TXO)、元大寶滬深ETF期貨契約(NZF)、富邦上證ETF期貨契約(OAF)、元大上證50ETF期貨契約(OBF)、FH滬深ETF期貨契約(OCF)、國泰中國A50ETF期貨契約(OJF)、元大寶滬深ETF選擇權契約(NZO)、富邦上證ETF選擇權契約(OAO)、元大上證50ETF選擇權契約(OBO)、FH滬深ETF選擇權契約(OCO)及國泰中國A50ETF選擇權契約(OJO)之期貨契約保證金及選擇權契約風險保證金(A值)、風險保證金最低值(B值)所有月份保證金額，並自108年5月10日一般交易時段結束後起實施。

本次保證金調整情形列表如下：

單位：新臺幣元

TXO	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	計算賣出選擇權原始保證金之適用金額	計算賣出選擇權維持保證金之適用金額	計算賣出選擇權結算保證金之適用金額	計算賣出選擇權原始保證金之適用金額	計算賣出選擇權維持保證金之適用金額	計算賣出選擇權結算保證金之適用金額
風險保證金(A值)	26,000	20,000	19,000	25,000	19,000	18,000
風險保證金最低值(B值)	13,000	10,000	10,000	13,000	10,000	9,000

單位：新臺幣元

契約名稱	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	原始保證金	維持保證金	結算保證金	原始保證金	維持保證金	結算保證金
NZF	14,000	11,000	10,000	13,000	10,000	9,000
OAF	23,000	18,000	17,000	22,000	17,000	16,000
OBF	25,000	19,000	18,000	22,000	17,000	16,000
OCF	19,000	15,000	14,000	18,000	14,000	13,000
OJF	17,000	13,000	12,000	15,000	12,000	11,000

單位：新臺幣元

NZO	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額
風險保證 金(A值)	14,000	11,000	10,000	13,000	10,000	9,000
風險保證 金最低值 (B值)	7,000	6,000	5,000	7,000	5,000	5,000

單位：新臺幣元

OAO	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額
風險保證 金(A值)	25,000	19,000	18,000	22,000	17,000	16,000
風險保證 金最低值 (B值)	13,000	10,000	9,000	11,000	9,000	8,000

單位：新臺幣元

OBO	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額
風險保證 金(A值)	25,000	19,000	18,000	22,000	17,000	16,000
風險保證 金最低值 (B值)	13,000	10,000	9,000	11,000	9,000	8,000

單位：新臺幣元

OCO	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額
風險保證 金(A值)	19,000	15,000	14,000	18,000	14,000	13,000
風險保證 金最低值 (B值)	10,000	8,000	7,000	9,000	7,000	7,000

單位：新臺幣元

OJO	調整後保證金金額			調整前保證金金額		
	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權原 始保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權維 持保證金 之適用金 額	計算賣出 選擇權結 算保證金 之適用金 額
風險保證 金(A值)	17,000	13,000	12,000	15,000	12,000	11,000
風險保證 金最低值 (B值)	9,000	7,000	6,000	8,000	6,000	6,000