

臺灣期貨交易所 新聞稿

中華民國111年1月25日

新聞稿內容：期交所為加強市場運作安全，依循往年作法，於111年春節长假前，調高股價指數類契約、匯率類契約、商品類契約及標的證券為受益憑證之股票類契約保證金，並預計於新春開紅盤日視市場狀況再另行公告保證金適用金額

考量111年春節假期休市(111年1月27日至2月06日)長達11日，為因應國際金融市場於國內期貨休市期間可能發生之價格波動，期交所鑒於以往春節假期採行調高保證金之作法，有助於市場運作安全之確保，於111年春節假期，調高股價指數類契約、匯率類契約、商品類契約及標的證券為受益憑證之股票類契約保證金。以1月25日之保證金為基礎調高約10%(例如，臺股期貨現行原始保證金184,000將調高至203,000元，調幅約10.3%)，以強化期貨市場之風險承受度，維護市場安全。同時也請交易人多加注意春節假期期間國際行情之變化及持有部位狀況，並適時繳存足額之保證金。

期交所於111年1月25日(調整生效日前一日)公告之股價指數類契約、匯率類契約、商品類契約及標的證券為受益憑證之股票類契約保證金調整後金額，實施期間為111年1月26日(春節前最後之交易日)一般交易時段結束後生效，預計於111年2月7日開紅盤日再視市場狀況公告2月8日一般交易時段結束後起前揭各契約之保證金適用金額。

另提醒交易人注意，111年1月26日為期貨集中交易市場農曆春節前最後之交易日，當日下午3時開始之盤後交易時段仍將交易至次日上午5時。交易人於1月26日一般交易時段收盤後之未沖銷部位及當日盤後交易時段之新增部位，應以調高後之原始保證金數額計收。交易人應注意保證金調高後，帳戶權益數之變化及長假期間未沖銷部位之風險；期貨商對期貨交易人亦應加強注意並落實風險控管。

本次保證金調整情形列表如下：

股價指數類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：新臺幣元

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
台股期貨契約(TX)	150,000	156,000	203,000	136,000	141,000	184,000
小型臺指期貨契約(MTX)	37,500	39,000	50,750	34,000	35,250	46,000
電子期貨契約(TE)	147,000	153,000	199,000	133,000	138,000	180,000
小型電子期貨契約(ZEF)	18,375	19,125	24,875	16,625	17,250	22,500
金融期貨契約(TF)	64,000	67,000	87,000	58,000	61,000	79,000
小型金融期貨契約(ZFF)	16,000	16,750	21,750	14,500	15,250	19,750
臺灣50期貨契約(T5F)	61,000	64,000	83,000	55,000	57,000	75,000
櫃買期貨契約(GTF)	39,000	41,000	53,000	35,000	37,000	48,000
富櫃200期貨契約(G2F)	22,000	23,000	30,000	20,000	21,000	27,000
非金電期貨契約(XIF)	80,000	83,000	108,000	72,000	75,000	98,000
臺灣永續期貨契約(E4F)	36,000	38,000	49,000	32,000	34,000	44,000
臺灣生技期貨契約(BTF)	13,000	14,000	18,000	11,000	12,000	15,000
東證期貨契約(TJF)	17,000	18,000	23,000	15,000	16,000	21,000
美國道瓊期貨契約(UDF)	38,000	40,000	52,000	34,000	36,000	46,000
美國標普500期貨契約(SPF)	47,000	49,000	64,000	42,000	44,000	57,000
美國那斯達克100期貨契約(UNF)	41,000	43,000	56,000	37,000	39,000	50,000
英國富時100期貨契約(F1F)	22,000	23,000	30,000	20,000	21,000	27,000
臺指選擇權契約(TXO)風險保證金(A值)	39,000	41,000	53,000	35,000	37,000	48,000
臺指選擇權契約(TXO)風險保證金最低值(B值)	20,000	21,000	27,000	18,000	19,000	24,000
臺指選擇權契約(TXO)混合部位風險保證金(C值)	2,000	2,100	2,700	1,800	1,900	2,400
電子選擇權契約(TEO)風險保證金(A值)	38,000	40,000	52,000	34,000	36,000	46,000
電子選擇權契約(TEO)風險保證金最低值(B值)	19,000	20,000	26,000	17,000	18,000	23,000
金融選擇權契約(TFO)風險保證金(A值)	16,000	17,000	22,000	14,000	15,000	19,000
金融選擇權契約(TFO)風險保證金最低值(B值)	8,000	9,000	11,000	7,000	8,000	10,000

※ 上揭股價指數類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金，除臺指選擇權契約，其餘契約調整前後適用金額為0。

匯率類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：人民幣、美元及日圓

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
小型美元兌人民幣期貨契約(RTF)	2,500	2,590	3,380	2,200	2,280	2,970
美元兌人民幣期貨契約(RHF)	11,800	12,220	15,930	10,700	11,080	14,450
澳幣兌美元期貨契約(XAF)	470	490	640	420	440	570
英鎊兌美元期貨契約(XBF)	810	840	1,100	730	760	990
歐元兌美元期貨契約(XEF)	510	530	690	460	480	630
美元兌日圓期貨契約(XJF)	48,000	50,000	65,000	43,000	45,000	59,000
小型美元兌人民幣選擇權契約(RTO)風險保證金(A值)	2,500	2,590	3,380	2,200	2,280	2,970
小型美元兌人民幣選擇權契約(RTO)風險保證金最低值(B值)	1,300	1,300	1,690	1,100	1,140	1,490
美元兌人民幣選擇權契約(RHO)風險保證金(A值)	11,800	12,220	15,930	10,700	11,080	14,450
美元兌人民幣選擇權契約(RHO)風險保證金最低值(B值)	5,900	6,110	7,970	5,400	5,540	7,230

※ 上揭契約保證金收取幣別，小型美元兌人民幣期貨契約、美元兌人民幣期貨契約、小型美元兌人民幣選擇權契約及美元兌人民幣選擇權契約為人民幣；澳幣兌美元期貨契約、英鎊兌美元期貨契約、歐元兌美元期貨契約為美元；美元兌日圓期貨契約為日圓。

※ 上揭匯率類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金調整前後適用金額為0。

商品類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：黃金期貨為美元計價，其餘商品為新臺幣元

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
黃金期貨契約(GDF)	1,030	1,070	1,400	930	970	1,260
臺幣黃金期貨契約(TGF)	37,000	39,000	50,000	33,000	35,000	45,000
布蘭特原油期貨契約(BRF)	42,000	44,000	57,000	38,000	40,000	52,000
黃金選擇權契約(TGO)風險保證金(A值)	19,000	20,000	26,000	17,000	18,000	23,000
黃金選擇權契約(TGO)風險保證金最低值(B值)	10,000	10,000	13,000	9,000	9,000	12,000

※ 上揭商品類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金調整前後適用金額為0。

標的證券為受益憑證之股票類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：新臺幣元

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
元大台灣50ETF期貨(NYF)	58,000	61,000	79,000	52,000	54,000	71,000
元大寶滬深ETF期貨(NZF)	14,000	15,000	19,000	12,000	13,000	17,000
富邦上証ETF期貨(OAF)	20,000	21,000	27,000	18,000	19,000	25,000
元大上證50ETF期貨(OBF)	24,000	25,000	33,000	21,000	22,000	29,000
FH滬深ETF期貨(OCF)	18,000	19,000	25,000	16,000	17,000	22,000
國泰中國A50ETF期貨(OJF)	15,000	16,000	21,000	13,000	14,000	18,000
富邦深100ETF期貨(OKF)	11,000	12,000	15,000	10,000	11,000	14,000
群益深証中小ETF期貨(OOF)	11,000	12,000	15,000	10,000	11,000	14,000
元大高股息ETF期貨(PFF)	13,000	14,000	18,000	11,000	12,000	15,000
元大台灣50ETF選擇權(NYO)風險保證金(A值)	58,000	61,000	79,000	52,000	54,000	71,000
元大台灣50ETF選擇權(NYO)風險保證金最低值(B值)	29,000	31,000	40,000	26,000	27,000	36,000
元大寶滬深ETF選擇權(NZO)風險保證金(A值)	14,000	15,000	19,000	12,000	13,000	17,000
元大寶滬深ETF選擇權(NZO)風險保證金最低值(B值)	7,000	8,000	10,000	6,000	7,000	9,000
富邦上証ETF選擇權(OAO)風險保證金(A值)	20,000	21,000	27,000	18,000	19,000	25,000
富邦上証ETF選擇權(OAO)風險保證金最低值(B值)	10,000	11,000	14,000	9,000	10,000	13,000
元大上證50ETF選擇權(OBO)風險保證金(A值)	24,000	25,000	33,000	21,000	22,000	29,000
元大上證50ETF選擇權(OBO)風險保證金最低值(B值)	12,000	13,000	17,000	11,000	11,000	15,000
FH滬深ETF選擇權(OCO)風險保證金(A值)	18,000	19,000	25,000	16,000	17,000	22,000
FH滬深ETF選擇權(OCO)風險保證金最低值(B值)	9,000	10,000	13,000	8,000	9,000	11,000
國泰中國A50ETF選擇權(OJO)風險保證金(A值)	15,000	16,000	21,000	13,000	14,000	18,000
國泰中國A50ETF選擇權(OJO)風險保證金最低值(B值)	8,000	8,000	11,000	7,000	7,000	9,000

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
富邦深100ETF選擇權(OOK)風險保證金(A值)	11,000	12,000	15,000	10,000	11,000	14,000
富邦深100ETF選擇權(OOK)風險保證金最低值(B值)	6,000	6,000	8,000	5,000	6,000	7,000
群益深証中小ETF選擇權(OOO)風險保證金(A值)	11,000	12,000	15,000	10,000	11,000	14,000
群益深証中小ETF選擇權(OOO)風險保證金最低值(B值)	6,000	6,000	8,000	5,000	6,000	7,000

※ 上揭標的證券為受益憑證之股票類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金調整前後適用金額為0。