

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：陳乃睿

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3144

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國110年11月26日

發文字號：台期結字第1100301525號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：公告本公司「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」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110年11月5日金管證期字第1100372405號函、本公司業務規則第29條、「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」交易規則第15條、「結算保證金收取方式及標準」第4條、第5條及第5條之2辦理。
- 二、本公司「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值，如附件1。
- 三、本公司「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」保證金金額，如附件2。
- 四、公告「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額，自110年12月6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、中華民國期貨業商業同業公會、臺灣集中保管結算所股份有限公司、中華民國證券商業同業公會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、台北國際金融資訊協會、博仲法律事務所、植根國際資訊股份有限公司、本公司各部門、本公司網站、記者室(均含附件)

總經理 黃炳鈞

臺灣期貨交易所股份有限公司

「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」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)

$$PSR = TF \text{ 結算保證金} \times 0.25$$

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)

$$\text{跨月價差風險值} = \text{小型金融期貨結算保證金} \times 30\%$$

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)：

臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約屬 TF 商品
組，跨商品價差折抵率及契約價值耗用比率參數數值同現行，如
下：

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 商品組 VS TF 商品組	0.5	1:2.26
TE 商品組 VS TF 商品組	0.5	1:2.21
TF 商品組 VS T5 商品組	0.5	1:0.27
TF 商品組 VS XI 商品組	0.5	1:0.96

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
TF 商品組 VS GT 商品組	0.5	1:1.76
TF 商品組 VS G2 商品組	0.5	1:0.83
TF 商品組 VS E4 商品組	0.5	1:0.44
TF 商品組 VS BT 商品組	0.5	1:1.48

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
「臺灣證券交易所金融保險類股價指數小型期貨契約」
保證金金額

生效日期：110年12月6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
小型金融期貨	ZFF	14,500	15,250	19,750