

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：劉先生

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3290

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國115年7月1日

發文字號：台期結字第1150301341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「黃金類商品及非金電期貨契約」保證金金額及整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值，並自115年7月6日一般交易時段起實施，請查照。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會115年6月10日金管證期字第1150343223號函、本公司結算保證金收取方式及標準、旨揭契約交易規則及115年7月1日台期交字第1150201214號函辦理。
- 二、因應本公司黃金類商品及非金電期貨契約規格調整，公告本公司「黃金類商品及非金電期貨契約」保證金金額及整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值，如附件1及附件2。

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、財政部賦稅署、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、內部稽核、交易部、結算部、監視部、期貨商輔導部、資訊規劃部、資訊作業部、企劃部、管理部、本公司網站(均含附件)

總經理 周建隆

臺灣期貨交易所股份有限公司
「黃金類商品及非金電期貨契約」保證金金額

生效日期：115年7月6日

單位：美元

黃金期貨(GDF)	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	560	430	410

單位：新臺幣元

臺幣黃金期貨(TGF)	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	22,000	17,000	16,000

單位：新臺幣元

黃金選擇權(TGO)	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)	18,000	14,000	13,000
風險保證金最低值 (B值)	9,000	7,000	7,000
混合部位風險保證金 (C值)	0	0	0

單位：新臺幣元

非金電期貨(XIF)	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	9,000	7,000	6,000

臺灣期貨交易所股份有限公司

黃金期貨契約

整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

$$\text{PSR} = \text{黃金期貨契約結算保證金}$$
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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

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)

$$\text{跨月價差風險值} = \text{GD 商品組}^1 \text{PSR} \times 50\%$$
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)：不適用。

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

¹GD 商品組包括黃金期貨契約(GDF)，GD 商品組跨月價差風險值為 GD 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

臺灣期貨交易所股份有限公司
臺幣黃金期貨契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺幣黃金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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

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=TG 商品組²PSR×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)：不適用。

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

²TG 商品組包括臺幣黃金期貨契約(TGF)及黃金選擇權契約(TGO)，TG 商品組跨月價差風險值為 TG 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

臺灣期貨交易所股份有限公司

黃金選擇權契約

整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺幣黃金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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)

股價指數類選擇權契約(代號)	波動度偵測全距
黃金選擇權(TGO)	7.4%

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

跨月價差風險值= TG 商品組³PSR×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)：不適用。

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

股價指數類選擇權契約	訂定方式	空方選擇權最低風險值
黃金選擇權(TGO)	1 個最小升降單位	新臺幣 5 元

³TG 商品組包括臺幣黃金期貨契約(TGF)及黃金選擇權契約(TGO)，TG 商品組跨月價差風險值為 TG 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

臺灣期貨交易所股份有限公司
非金電期貨契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=非金電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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

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=XI 商品組⁴PSR×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)

非金電期貨契約屬 XI 商品組，跨商品價差折抵率及契約價值耗用比率參數數值如下：

⁴XI 商品組包括非金電期貨契約(XI)，XI 商品組跨月價差風險值為 XI 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

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 XI	0.5	1 TX vs 30.2 XI
TE vs XI	0.5	1 TE vs 32.5 XI
TF vs XI	0.5	1 TF vs 15.0 XI
XI vs GT	0.5	1 XI vs 0.15 GT
XI vs G2	0.5	1 XI vs 0.09 G2
XI vs E4	0.5	1 XI vs 0.03 E4
XI vs SO	0.5	1 XI vs 0.12 SO
XI vs M1	0.5	1 XI vs 0.19 M1

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