

中華民國期貨業商業同業公會 函

地 址：10688台北市大安區安和路一段27號12樓

聯絡人：謝美惠

聯絡電話：02-8773-7303 分機816

電子郵件：bonnie@futures.org.tw

傳 真：02-2772-8378

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國113年1月8日

發文字號：中期商字第1130000158號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：

主旨：因應臺灣期貨交易所客製化商品上市，調整本公會「自然人及一般法人從事較不具流動性之商品加收保證金」適用商品範圍及加收保證金執行方式，請查照。

說明：

- 一、依據金融監督管理委員會113年1月2日金管證期字第1120366206號函辦理。
- 二、有關「不具流動性之商品加收保證金」執行方式：
 - (一)臺股股價指數期貨類（如：臺股期貨、電子期貨、金融期貨、小型臺指期貨等商品）：以到期交割月份為三個最近月份「以外」之契約加收保證金20%。
 - (二)除臺股股價指數期貨類之其他期貨商品：以到期交割月份為二個最近月份「以外」之契約加收保證金20%。
 - (三)客製化臺股股價指數期貨類（如：客製化小型臺指期貨等商品）：各契約均加收保證金25%。
 - (四)臺指選擇權：履約價格為價外500點以上未滿1000點者，風險保證金（A值）及風險保證金最低值（B值）均加收20%；履約價格為價外1000點以上者，A、B值均加收50%。
 - (五)其他選擇權：A、B值均加收20%。

裝

訂

線

(六)加收比例所計算保證金金額，以元為整數，元以下部分四捨五入至元。

三、依據前項原則，本公會已函請臺灣期貨交易所協助系統調整，於每日一般交易時段開盤前及收盤後各傳送一次商品序列，各期貨商於接收後加上倍數並立即針對上述契約之委託保證金及未平倉部位所需保證金加收或釋放。

正本：全體會員公司

副本：

裝

訂

線

中華民國期貨業