

檔 號：

保存年限：

## 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：張瓊文

聯絡電話：02-8773-7303 分機814

電子郵件：linda929@futures.org.tw

傳 真：02-2772-8378

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國103年4月3日

發文字號：中期商字第1030001453號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：Eurex預收保證金-常務理監事決議附件0402

主旨：有關臺灣期貨交易所授權歐洲期貨交易所上市以臺股期貨及臺指選擇權為標的之一天期期貨契約（以下稱本商品）乙案，本公會訂定之期貨商預收保證金等風險控管措施如附件，請 查照。

說明：

- 一、依據金融監督管理委員會103年2月13日金管證期字第1030004472號函暨本公會第4屆常務理監事第1次聯席會議決議辦理。
- 二、為兼顧市場發展、國際競爭力及風險管理原則，本公會訂定之期貨商預收保證金標準，為各會員公司收取之最低標準，各公司得依交易人之信用狀況及交易性質，另加收保證金，且本公會未來將視市場發展狀況適時檢討調整相關規範。
- 三、期貨商接受交易人委託從事本商品交易之預收保證金標準說明如下：
  - (一)以臺股期貨為標的：依臺灣期貨交易所公告當日沖銷交易之原始保證金收取，如為與國內部位反向沖銷者，則不收保證金。
  - (二)以臺指選擇權為標的：
    - 1、買進選擇權：依交易人所交易序列之臺灣期貨交易所當日結算價乘以契約乘數，加上變動保證金（為委託

價與結算價之差額乘以契約乘數)收取。若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

2、賣出選擇權：收取變動保證金加上臺灣期貨交易所公告之風險保證金【Max (A-價外值, B)】，若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

3、如為與國內部位反向沖銷者，則無論買進選擇權或賣出選擇權均不收保證金。

(三)上述預收保證金為最低標準，各公司得依交易人之信用狀況及交易性質，另加收保證金。

四、具備臺灣期貨交易所交易會員資格之期貨自營商之預收保證金標準：

(一)以臺股期貨為標的：以不低於變動保證金收取，若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

(二)以臺指選擇權為標的：買進選擇權或賣出選擇權均依交易人所交易序列之變動保證金收取，若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

五、本公會訂定本商品之風險控管措施如下：

(一)下單前保證金檢核方式：檢視交易人國外期貨帳戶可動用餘額。

(二)本商品無需進行盤中風險控管，不列入國外期貨交易風險指標之計算，僅須將成交後計算出之應收取保證金列為國外期貨帳戶權益數減項。

正本：全體會員公司

副本：金融監督管理委員會、臺灣期貨交易所股份有限公司