

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107年5月23日
發文字號：中期商字第1070002088號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：
附件：

主旨：因應期貨商風險控管機制調整，針對第二階段實施之自然人及一般法人從事較不具流動性之商品加收保證金乙節補充說明如下，請 查照。

說明：

- 一、依據107年3月28日金管證期字第1070105917號函及107年5月16日中期商字第1070001993號辦理。
- 二、有關「較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（臺股期貨、電子期貨、金融期貨、小型臺指期貨、臺灣50期貨、櫃買期貨、非金電期貨，共七項）：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契約：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)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%；履約價格超過價外1000點者，A、B值均加收50%。
- 三、依據前項原則，本公會已函請期交所協助系統調整及安排測試，目前規劃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。
- 四、旨揭制度自107年8月1日起實施，第一階段對自然人及一般法人從事選擇權賣方交易A、B值加收20%乙節亦同步調整，調整說明如下表：

商品	8月1日「前」	8月1日「起」	
臺指選擇權	A、B值均加收20%。	具流動性	停止適用A、B值均加收20%之作業。
		較不具流動性	履約價格為價外500點以上未滿1000點者，A、B值均加收20%； 履約價格超過價外1000點者，A、B值均加收50%。
其他選擇權	A、B值均加收20%。	A、B值均加收20%。	

正本：全體會員公司

副本：臺灣期貨交易所股份有限公司

裝

訂

線