

臺灣期貨交易所 新聞稿

中華民國109年1月17日

期交所為加強市場運作安全，依循往年作法，於109年春節長假前，調高股價指數類契約、匯率類契約及商品類契約保證金，並預計於新春開紅盤日之次日一般交易時段結束後回調

考量109年春節假期休市(109年1月21日至1月29日)長達9日，為因應國際金融市場於國內期貨休市期間可能發生價格波動，期交所鑒於以往春節假期採行調高保證金作法，有助於市場運作安全之確保，於109年春節假期，調高股價指數類契約、匯率類契約及商品類契約保證金。以1月17日之結算保證金為基礎調高約10%(例如，臺股期貨現行原始保證金91,000元將調高至100,000元，調幅約9.89%)，以強化期貨市場之風險承受度，維護市場安全。同時也請交易人多加注意春節假期期間國際行情變化及持有部位狀況，並適時繳存足額保證金。

期交所於109年1月17日(調整生效日前一日)公告股價指數類契約、匯率類契約及商品類契約保證金調整後金額，實施期間為109年1月20日(春節前最後交易日)一般交易時段結束後生效，預計至1月31日一般交易時段結束後恢復為調整前1月17日之保證金(例如，臺股期貨原始保證金將自調高後100,000元調回調整前91,000元)，屆時期交所將另行公告調整後金額。

另提醒交易人注意，109年1月20日為期貨集中交易市場農曆春節前之最後交易日，當日下午3時開始之盤後交易時段仍將交易至次日上午5時。交易人於1月20日一般交易時段收盤後之未沖銷部位及當日盤後交易時段之新增部位，應以調高後之原始保證金數額計收。交易人應注意保證金調高後，帳戶權益數之變化及長假期間未沖銷部位之風險；期貨商對期貨交易人亦應加強注意並落實風險控管。

本次調整保證金之商品及其金額情形列表如下：

股價指數類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：新臺幣元

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
臺股期貨契約(TX)	74,000	77,000	100,000	67,000	70,000	91,000
小型臺指期貨契約(MTX)	18,500	19,250	25,000	16,750	17,500	22,750
電子期貨契約(TE)	65,000	68,000	88,000	59,000	62,000	80,000
金融期貨契約(TF)	42,000	44,000	57,000	38,000	40,000	52,000
臺灣50期貨契約(T5F)	32,000	34,000	44,000	29,000	31,000	40,000
櫃買期貨契約(GTF)	21,000	22,000	29,000	19,000	20,000	26,000
富櫃200期貨契約(G2F)	11,000	12,000	15,000	10,000	11,000	14,000
非金電期貨契約(XIF)	43,000	45,000	59,000	39,000	41,000	53,000
東證期貨契約(TJF)	15,000	16,000	21,000	13,000	14,000	18,000
美國道瓊期貨契約(UDF)	21,000	22,000	29,000	19,000	20,000	26,000
美國標普500期貨契約(SPF)	25,000	26,000	34,000	22,000	23,000	30,000
美國那斯達克100期貨契約(UNF)	18,000	19,000	25,000	16,000	17,000	22,000
臺指選擇權契約(TXO)風險保證金(A值)	19,000	20,000	26,000	17,000	18,000	23,000
臺指選擇權契約(TXO)風險保證金最低值(B值)	10,000	10,000	13,000	9,000	9,000	12,000
臺指選擇權契約(TXO)混合部位風險保證金(C值)	2,000	2,000	2,600	1,800	1,800	2,400
電子選擇權契約(TEO)風險保證金(A值)	17,000	18,000	23,000	15,000	16,000	21,000
電子選擇權契約(TEO)風險保證金最低值(B值)	9,000	9,000	12,000	8,000	8,000	11,000
金融選擇權契約(TFO)風險保證金(A值)	10,000	11,000	14,000	9,000	10,000	13,000
金融選擇權契約(TFO)風險保證金最低值(B值)	5,000	6,000	7,000	5,000	5,000	7,000

※ 上揭股價指數類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金，除臺指選擇權契約，其餘調整前後適用金額為0。

匯率類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：人民幣、美元及日圓

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
小型美元兌人民幣期貨契約(RTF)	2,500	2,590	3,380	2,200	2,280	2,970
美元兌人民幣期貨契約(RHF)	12,000	12,420	16,200	10,900	11,290	14,720
澳幣兌美元期貨契約(XAF)	380	400	520	340	360	460
英鎊兌美元期貨契約(XBF)	730	760	990	660	690	900
歐元兌美元期貨契約(XEF)	510	530	690	460	480	630
美元兌日圓期貨契約(XJF)	50,000	52,000	68,000	45,000	47,000	61,000
小型美元兌人民幣選擇權契約(RTO)風險保證金(A值)	2,500	2,590	3,380	2,200	2,280	2,970
小型美元兌人民幣選擇權契約(RTO)風險保證金最低值(B值)	1,300	1,300	1,690	1,100	1,140	1,490
美元兌人民幣選擇權契約(RHO)風險保證金(A值)	11,600	12,010	15,660	10,500	10,870	14,180
美元兌人民幣選擇權契約(RHO)風險保證金最低值(B值)	5,800	6,010	7,830	5,300	5,440	7,090

※ 上揭契約保證金收取幣別，小型美元兌人民幣期貨契約、美元兌人民幣期貨契約、小型美元兌人民幣選擇權契約及美元兌人民幣選擇權契約為人民幣；澳幣兌美元期貨契約、英鎊兌美元期貨契約、歐元兌美元期貨契約為美元；美元兌日圓期貨契約為日圓。

※ 上揭匯率類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金調整前後適用金額為0。

商品類期貨及選擇權契約保證金調整前後金額

單位：黃金期貨為美元計價，其餘商品為新臺幣元

契約名稱	因應農曆春節調高保證金			現行收取標準		
	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額	結算保證金金額	維持保證金金額	原始保證金金額
黃金期貨契約(GDF)	760	790	1,030	690	720	940
臺幣黃金期貨契約(TGF)	30,000	32,000	41,000	27,000	28,000	37,000
布蘭特原油期貨契約(BRF)	29,000	31,000	40,000	26,000	27,000	36,000
黃金選擇權契約(TGO)風險保證金(A值)	15,000	16,000	21,000	13,000	14,000	18,000
黃金選擇權契約(TGO)風險保證金最低值(B值)	8,000	8,000	11,000	7,000	7,000	9,000

※ 上揭商品類選擇權契約混合部位風險保證金(C值)之原始、維持、結算保證金調整前後適用金額為0。