

交易結算部 通知

日期：108 年 9 月 26 日
 主旨：臺灣期貨交易所 108 年下半年新制說明(三) -
 調整「賣出跨/勒式組合部位保證金計收方式」

說明：

臺灣期貨交易所自 108 年 9 月 30 日(星期一)一般交易時段結束後實施

一、調整賣出跨/勒式組合部位(賣出買權 Sell Call/賣出賣權 Sell Put)
 之保證金計收方式，新增加計「**混合部位風險保證金(C值)**」。

1、組合保證金計收方式說明

| 現行保證金計收方式 | 9/30起之新制保證金計收方式 |
|---|---|
| Max(賣出Call之保證金， 賣出Put之保證金) + 保證金較低方之權利金市值 | Max(賣出Call之保證金， 賣出Put之保證金) + 保證金較低方之權利金市值 + 混合部位風險保證金(C值) |

(1)選擇權商品(不含股票選擇權)

採定額計收保證金，直接加計收取風險保證金 C 值金額

(2)股票選擇權商品(標的證券為股票者)

採比例計收保證金，C 值=標的證券價值 × c% (元以下四捨五入至元)

2、混合部位風險保證金(C值)收取之適用對象

自然人及一般法人

3、混合部位風險保證金(C值)收取時點

(1)委託賣出跨/勒式組合部位

(2)辦理賣出跨/勒式組合指定部位組合

二、混合部位風險保證金(C值)

1、臺指選擇權(TX0)契約 (幣別：新台幣)

| 臺指選擇權(TX0) | 原始保證金 | 維持保證金 |
|-------------------|-------|-------|
| 混合部位風險保證金 (C值) | 1,200 | 900 |

2、除臺指選擇權(TX0)契約，其他採定額計收保證金之契約

| 採定額計收保證金之契約 | 原始保證金 | 維持保證金 |
|-------------------|-------|-------|
| 混合部位風險保證金 (C值) | 0 | 0 |

3、採比例計收保證金之契約

| 採比例計收保證金之契約 | 原始保證金 | 維持保證金 |
|----------------------|-------|-------|
| 混合部位風險保證金 (C值)之c% | 0% | 0% |