

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：鄭先生

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3360

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國112年12月8日

發文字號：台期結字第1120302335號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：公告本公司「美國費城半導體股價指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會112年11月15日金管證期字第1120360447號函、本公司業務規則第29條、「美國費城半導體股價指數期貨契約」交易規則第15條、「結算保證金收取方式及標準」第4條、第5條之2辦理。
- 二、本公司「美國費城半導體股價指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值，如附件1。
- 三、本公司「美國費城半導體股價指數期貨契約」保證金金額，如附件2。
- 四、公告「美國費城半導體股價指數期貨契約」整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值及保證金金額，自112年12月18日起實施。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、財政部賦稅署、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、臺灣集中保管結算所股份有限公司、台北國際金融資訊協會、植根國際資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室(均含附件)

總經理 周建隆

臺灣期貨交易所股份有限公司

「美國費城半導體股價指數期貨契約」整戶風險保證金計收
方式(SPAN)參數數值

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=美國費城半導體股價指數期貨契約結算保證金

二、極端變動倍數(Extreme Move Multiplier)及極端涵蓋百分比
(Extreme Move Covered Fraction)

(一) 極端變動倍數定為 3 倍

(二) 極端涵蓋比率定為 32%

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)：不適用。

四、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)

跨月價差風險值=美國費城半導體股價指數期貨結算保證金
×50%

五、跨商品價差折抵率(Inter-Commodity Spread Credit Rate)及契約價
值耗用比率(Delta Per Spread Ratio)

跨商品價差折抵契約	跨商品價差折抵率	契約價值耗用比率
SX vs UN	0.5	1 SX vs 0.37 UN

六、空方選擇權最低風險值(Short Option Minimum Charge)：不適用。

- Nasdaq®、PHLX®與 PHLX Semiconductor Sector™ Index 為 Nasdaq 集團之商標，經授權使用。

臺灣期貨交易所股份有限公司
「美國費城半導體股價指數期貨契約」保證金金額

生效日期：112 年 12 月 18 日

單位：新臺幣元

中文簡稱	契約代碼	結算保證金	維持保證金	原始保證金
美國費城半導體期貨	SXF	19,000	20,000	26,000

- Nasdaq®、PHLX®與 PHLX Semiconductor Sector™ Index 為 Nasdaq 集團之商標，經授權使用。