

依期貨商開戶徵信作業管理自律規則、中華民國期貨商業同業公會中期商字第 1070001993 號及 1070002088 號函規定，本公司自 107 年 8 月 1 日起實施第二階段風險控管新制度，相關內容請參閱下方說明：

### **第二階段-107 年 8 月 1 日實施：**

#### **一、自然人、一般法人新開立帳戶交易總額不得超過新臺幣 50 萬元:**

未提供符合本公司要求之徵信資料或財力證明之自然人或一般法人交易人，其使用之總保證金不得超過新台幣 50 萬元，自 8 月 1 日起實施。

#### **二、自然人、一般法人分類分級加收保證金比例限制調整:**

1.取消交易人得申請對所有契約均**放寬加收保證金指標之規定**，**僅得依個別契約逐項申請**。

2.為降低自然人及一般法人交易人個別契約部位過於集中所生之風險，將現行股票期貨及股票選擇權以外之期貨及選擇權契約加收保證金之門檻降低由個別契約未沖銷部位超過期交所對該契約公告之交易人部位限制數之 20%降低至 5%，股票期貨及股票選擇權則維持不變。

3.申請放寬加收保證金指標須提供之財力證明額度，由按交易人種類計算之部位限制數，依該個別契約計算所需原始保證金之 30%調高為 200%。

#### **三、自然人、一般法人『較不流動性商品加收保證金』:加收原始保證金，執行方式說明如下：**

1. 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），近三個月份『以外』之契約，加收原始保證金 20%。

2. 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，加收原始保證金 20%。

3. 臺指選擇權履約價格為價外 500 點以上未滿 1000 點者，A、B 值均加收原始保證金 20%；履約價格超過價外 1000 點者，A、B 值均加收原始保證金 50%。

4. 第一階段對臺指選擇權契約加收保證金，停止適用，惟其他選擇權契約仍依第一階段規定，繼續加收 A、B 值原始保證金 20%。

### **107 年 10 月 1 日實施：**

#### **一、自然人、一般法人既有帳戶交易總額不得超過新臺幣 50 萬元：**

自然人、一般法人既有帳戶(107 年 7 月 31 日(含)前開戶者)，如未於 107 年 10 月 1 日提供符合期貨商要求之徵信資料或財力證明，自 107 年 10 月 1 日起，國內期貨帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之交易總額不得超過新臺幣 50 萬元(依總歸戶控管)。

☆交易人逾放寬總保證金額度，請洽您的所屬營業員。

## 二、非 SPAN 帳戶風險指標加入垂直價差註記功能：

交易人留倉中之指定垂直價差交易部位，加入垂直價差註記功能：

風險指標：

權益數+(未沖銷非垂直價差選擇權買方市值+垂直價差選擇權付權利金之組合部位淨市值)-(未沖銷非垂直價差選擇權賣方市值+垂直價差選擇權收權利金之組合部位淨市值)

---

原始保證金+(未沖銷非垂直價差選擇權買方市值+垂直價差選擇權付權利金之組合部位淨市值)-(未沖銷非垂直價差選擇權賣方市值+垂直價差選擇權收權利金之組合部位淨市值)

註:1. 「垂直價差交易付/收權利金之組合部位淨市值」為垂直價差組合部位中買方權利金市價減去賣方權利金市價後乘以契約乘數再取絕對值；當淨市值大於履約價差乘以契約乘數時，以履約價差乘以契約乘數計算。

註 2. 倘經計算之風險指標分母項小於 1 時，風險指標註記為 100%。