

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：謝先生

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3221

受文者：

發文日期：中華民國115年1月7日

發文字號：台期結字第11503000601號

速別：最速件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：公告調整本公司群創期貨契約(DQF)、威剛期貨契約(NDF)、群聯期貨契約(NWF)、小型群聯期貨契約(QNF)及群創選擇權契約(DQ0)之期貨契約保證金及選擇權契約風險保證金(A值)、風險保證金最低值(B值)、混合部位風險保證金(C值)所有月份保證金適用比例，請查照。

說明：

- 一、依本公司111年6月20日台期監字第1111000782號函「臺灣期貨交易所股票期貨及股票選擇權契約之標的證券，經臺灣證券交易所股份有限公司或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心發布為處置之有價證券，股票期貨及股票選擇權契約保證金之處置調整措施」辦理。
- 二、本次保證金調整之商品為群創期貨契約(DQF)、威剛期貨契約(NDF)、群聯期貨契約(NWF)、小型群聯期貨契約(QNF)及群創選擇權契約(DQ0)，調整情形列表如附。
- 三、本次調整自115年1月8日(證券市場處置生效日次一營業日)一般交易時段結束後起實施，證券市場處置期間結束後，群創期貨及群創選擇權、群聯期貨及小型群聯期貨於115年1月20日一般交易時段結束後恢復為115年1月8日調整前之保證金，威剛期貨於115年1月22日一般交易時段結束後恢復為115年1月5日調整前之保證金，參照證券市場處置措施，調整期間如遇休市、有價證券停止買賣、全日暫停交易，則恢

復日順延執行。

四、本公司115年1月2日台期結字第11503000081號函自115年1月8日威剛期貨一般交易時段結束後停止適用。

正本：各期貨商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、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、各業務部門、本公司網站、臺灣指數股份有限公司(均含附件)

總經理 周建隆

本次保證金調整情形列表如下：

單位：比例(%)

DQF (群創期貨)	調整後保證金適用比例			調整前保證金適用比例		
	原始保證金	維持保證金	結算保證金	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	20.25%	15.53%	15.00%	13.50%	10.35%	10.00%

單位：比例(%)

NDF (威剛期貨)	調整後保證金適用比例			調整前保證金適用比例		
	原始保證金	維持保證金	結算保證金	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	40.50%	31.05%	30.00%	30.38%	23.29%	22.50%

單位：比例(%)

NWF (群聯期貨)	調整後保證金適用比例			調整前保證金適用比例		
	原始保證金	維持保證金	結算保證金	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	24.30%	18.63%	18.00%	16.20%	12.42%	12.00%

單位：比例(%)

QNF (小型群聯期貨)	調整後保證金適用比例			調整前保證金適用比例		
	原始保證金	維持保證金	結算保證金	原始保證金	維持保證金	結算保證金
保證金	24.30%	18.63%	18.00%	16.20%	12.42%	12.00%

單位：比例(%)

DQO (群創選擇權)	調整後保證金適用比例			調整前保證金適用比例		
	計算賣出選擇權原始保證金之適用比例	計算賣出選擇權維持保證金之適用比例	計算賣出選擇權結算保證金之適用比例	計算賣出選擇權原始保證金之適用比例	計算賣出選擇權維持保證金之適用比例	計算賣出選擇權結算保證金之適用比例
風險保證金 (A值)	20.25%	15.53%	15.00%	13.50%	10.35%	10.00%
風險保證金最低值 (B值)	10.125%	7.765%	7.500%	6.750%	5.175%	5.000%
混合部位風險保證金 (C值)	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%