

臺灣期貨交易所股份有限公司

「英國富時 100 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=英國富時 100 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=英國富時 100 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)：無。

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