

臺灣期貨交易所股份有限公司  
英鎊兌美元匯率期貨契約及澳幣兌美元匯率期貨契約  
保證金計收方式說明

一、法源依據

本公司「英鎊兌美元匯率期貨契約交易規則」第 14 條、「澳幣兌美元匯率期貨契約交易規則」第 14 條，及「結算保證金收取方式及標準」第 4 條之 7、第 5 條及第 5 條之 2。

二、英鎊兌美元匯率期貨契約保證金計收方式

(一)保證金計算方式

依本公司「結算保證金收取方式及標準」第 4 條之 7 規定，結算保證金計算公式為

$$\text{結算保證金} = \text{英鎊兌美元匯率期貨價格} \times \text{契約規模} \times \text{風險價格係數}$$

風險價格係數：係參考一段期間內期貨契約之價格變動幅度及其他可能因素，估算至少可涵蓋一日價格變動幅度百分之九十九信賴區間之值。

(二)保證金收取標準

本契約結算保證金、維持保證金及原始保證金之收取標準，以拾元為整數，拾元以下部分無條件進位至拾元。

(三)保證金調整方式

本契約上市交易後，經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之五以上，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，調整後結算保證金、維持保證金及原始保證金收取標準，於公告日之次一一般交易時段結束後起實施。

(四)英鎊兌美元匯率期貨契約組合部位之保證金收取方式

本契約適用相同商品價差部位組合保證金

部位組合	保證金計收方式	備註
買一口英鎊兌美元匯率期貨 賣一口英鎊兌美元匯率期貨	收取一口英鎊兌美元匯率期貨保證金	適用於不同最後結算日之組合

### 三、澳幣兌美元匯率期貨契約保證金計收方式

#### (一)保證金計算方式

依本公司「結算保證金收取方式及標準」第4條之7規定，結算保證金計算公式為

$$\text{結算保證金} = \text{澳幣兌美元匯率期貨價格} \times \text{契約規模} \times \text{風險價格係數}$$

風險價格係數：係參考一段期間內期貨契約之價格變動幅度及其他可能因素，估算至少可涵蓋一日價格變動幅度百分之九十九信賴區間之值。

#### (二)保證金收取標準

本契約結算保證金、維持保證金及原始保證金之收取標準，以拾元為整數，拾元以下部分無條件進位至拾元。

#### (三)保證金調整方式

本契約上市交易後，經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之五以上，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，調整後結算保證金、維持保證金及原始保證金收取標準，於公告日之次一一般交易時段結束後起實施。

#### (四)澳幣兌美元匯率期貨契約組合部位之保證金收取方式

本契約適用相同商品價差部位組合保證金

部位組合	保證金計收方式	備註
買一口澳幣兌美元匯率期貨 賣一口澳幣兌美元匯率期貨	收取一口澳幣兌美元匯率期貨保證金	適用於不同最後結算日之組合