

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  
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數訂定方式

- 一、法源依據：本公司結算保證金收取方式及標準第 5 條之 2。
- 二、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)
  - (一) 英鎊兌美元匯率期貨契約  $PSR = \text{英鎊兌美元匯率期貨契約結算保證金}$
  - (二) 澳幣兌美元匯率期貨契約  $PSR = \text{澳幣兌美元匯率期貨契約結算保證金}$
- 三、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%本二項參數之調整，由本公司另訂之。
- 四、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)：不適用。
- 五、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)
  - (一) 英鎊兌美元匯率期貨契約跨月價差風險值 = 英鎊兌美元匯率期貨契約結算保證金  $\times 50\%$
  - (二) 澳幣兌美元匯率期貨契約跨月價差風險值 = 澳幣兌美元匯率期貨契約結算保證金  $\times 50\%$本參數之調整，由本公司另訂之。
- 六、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。
- 七、空方選擇權最低風險值(Short Option Minimum Charge, SOM)：不適用。