

臺灣期貨交易所股份有限公司
黃金期貨契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=黃金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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

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=GD 商品組¹PSR×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)：不適用。

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

¹GD 商品組包括黃金期貨契約(GDF)，GD 商品組跨月價差風險值為 GD 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

臺灣期貨交易所股份有限公司
臺幣黃金期貨契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺幣黃金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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

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=TG 商品組²PSR×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)：不適用。

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

²TG 商品組包括臺幣黃金期貨契約(TGF)及黃金選擇權契約(TGO)，TG 商品組跨月價差風險值為 TG 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

臺灣期貨交易所股份有限公司
黃金選擇權契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺幣黃金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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)

股價指數類選擇權契約(代號)	波動度偵測全距
黃金選擇權(TGO)	7.4%

四、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)

跨月價差風險值= TG 商品組³PSR×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)：不適用。

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

股價指數類選擇權契約	訂定方式	空方選擇權最低風險值
黃金選擇權(TGO)	1 個最小升降單位	新臺幣 5 元

³TG 商品組包括臺幣黃金期貨契約(TGF)及黃金選擇權契約(TGO)，TG 商品組跨月價差風險值為 TG 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

臺灣期貨交易所股份有限公司
非金電期貨契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

生效日期：115 年 7 月 6 日

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=非金電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%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

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=XI 商品組⁴PSR×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)

非金電期貨契約屬 XI 商品組，跨商品價差折抵率及契約價值耗用比率參數數值如下：

⁴XI 商品組包括非金電期貨契約(XI)，XI 商品組跨月價差風險值為 XI 商品組之 PSR 乘上跨月價差比率 50%。

跨商品價差折抵契約	跨商品價差折抵率	契約價值耗用比率
TX vs XI	0.5	1 TX vs 30.2 XI
TE vs XI	0.5	1 TE vs 32.5 XI
TF vs XI	0.5	1 TF vs 15.0 XI
XI vs GT	0.5	1 XI vs 0.15 GT
XI vs G2	0.5	1 XI vs 0.09 G2
XI vs E4	0.5	1 XI vs 0.03 E4
XI vs SO	0.5	1 XI vs 0.12 SO
XI vs M1	0.5	1 XI vs 0.19 M1

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