

## 期貨交易人以有價證券抵繳保證金制度

### 一、抵繳有價證券之種類範圍及內容

	說明內容
抵繳種類 (註1)	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 中央登錄公債</li> <li>● 外幣計價國際債券:簡稱國際債</li> <li>● 股票</li> </ul>
折扣比率 (註2)	<ul style="list-style-type: none"> <li>● <b>中央登錄公債</b>：以該期公債前一日市價之 <b>5%</b>折扣比率計算後價值。 (前一日市價：櫃買中心等殖成交系統前一日揭示之當日加權平均價)</li> </ul>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>● <b>國際債</b>：以該國際債前一日市價之 <b>10%</b>折扣比率計算後價值。 (前一日市價：櫃買中心等殖成交系統前一日揭示之當日平均價，前一日無市價，以最近成交日之市價為準)</li> </ul>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>● <b>股票</b>：以該股票收盤價之 <b>30%</b>折扣比率計算後價值。 (盤前、中以該股票開盤參考價計算；盤後以當日收盤價計算)</li> </ul>
注意事項	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 限<b>交易人本人</b>所有之有價證券，方可辦理抵繳。</li> <li>● 若抵繳之標的經主管機關公告更改為不適用抵繳標的時，該抵繳標的將於公告生效日起不再計算抵繳價值，交易人應盡速辦理領回及變更抵繳標的。</li> </ul>

註1：詳參期交所公告之可抵繳標的 <https://www.taifex.com.tw/cht/5/collaterallnq>

註2：詳參期交所公告之折扣比率 <https://www.taifex.com.tw/cht/5/acceptableCollateral>

### 二、匯撥及領回有價證券作業說明

匯撥作業	於證券商作業時間至證券商營業處所，辦理將股票、受益憑證及國際債券匯撥到臺灣集中保管結算所，戶名為「有價證券抵繳保證金專戶」之抵繳專戶， <b>期交所抵繳專戶帳號為「0050-8900001」</b> 。
領回作業	每一營業日下午二時前向本公司申請領取有價證券。 <b>(交易人之權益數逾其所需保證金或其權益數為負值時已以現金補足後方受理申請)</b>

### 三、抵繳有價證券說明

#### 1. 未沖銷部位抵繳有價證券：

##### (1) 抵繳比例：

有價證券抵繳金額占結算保證金金額之比例，以結算保證金金額之 50%為上限。

##### (2) 抵繳證券評價價值：

交易人所有的抵繳保證品扣除抵繳折扣率後之總合計金額，為抵繳證券評價價值。

##### (3) 實際抵繳金額之計算方式，取下列二者金額之較小值者：

■ 交易人繳交有價證券之評價價值

■ 該交易人未沖銷部位所需結算保證金按 50%抵繳比例計算之金額

#### 2. 抵繳新增委託所需保證金

(1) 交易人繳交之抵繳標的評價價值高於實際抵繳金額時，剩餘之評價價值可以抵充新增委託保證金使用，計算方式比照抵繳金額之計算方式辦理。

(2) 檢核新增委託保證金是否足夠時，係以新增委託部位所需之結算保證金之 50%與剩餘未抵繳評價價值比較，取較小值者作為委託抵繳保證金，將委託抵繳保證金加計可動用(出金)保證金若超過新增委託所需原始保證金時就可委託成功。

### 四、處分交易人抵繳保證金之有價證券

本公司了結交易人之全部期貨交易契約後，如其保證金專戶權益總值為負數，且該交易人未依本公司通知於三日內以現金補足時，有價證券繳存於期交所抵繳專戶者，本公司得向期交所申請領取後，始撥入本公司處分專戶「兆豐期貨(股)公司待處分專戶」，並予以處分賣出。