

*** 105年06月15日期權下單指示書 ***

程式名稱：TG9911

頁 數：2－1

總表

帳戶別	被避險 投資組合	商品名稱	合約 月份	市 值	相關 係數	前一日 避險口數	約當 契約價值	避險		平倉		避險 因子	今日合計 避險口數	約當 契約價值	避險 比重
								價格	口數	價格	口數				
備供出售-投 組(一)	備供出售	TX 臺股期 貨	201607	256,600,000	0.96	0	0	8,420.00 ~ 8,410.00	107			體系/系 統風險	107	180,188,000	70%
合計													107	180,188,000	70%

台股避險策略參考因子	相關值		是否達避險條件	已避險比重	是否超限
1. 台灣加權股價指數相對年線(250日)之乖離率% (台股指數高於年線位置20%以上，避險比例上限10%)	1.32		否	0%	否
2. 台指選擇權波動率指數VIX (VIX指數高於近三年平均值或低於近三年下限值端5%，避險比例上限10%)	17.13		是	0%	否
台指選擇權波動率指數VIX近三年平均值	13.79		-	-	-
台指選擇權波動率指數VIX近三年下限極端值5%	9.87		-	-	-
3. β 值 (台股指數高於年線位置20%以上，避險比例上限10%)	備供出售-投 組(一)	1.12	是	0%	否
4. 體系/系統風險(避險比例上限70%)				70%	否

Approved by：_____

Prepared by：_____

*** 105年06月15日期權下單指示書 ***

程式名稱：TG9911

頁 數：2－2

備供出售-投組(一)備供出售														
帳戶別	被避險 投資組合	商品名稱	合約 月份	市 值	前一日 避險口數	約當 契約價值	避險		平倉		避險 因子	今日合計 避險口數	約當 契約價值	避險 比重
							價格	口數	價格	口數				
備供出 售-投 組(一)	備供出售	TX 臺股期 貨	201607	256,600,000	0	0	8,420.00 ~ 8,410.00	107			體系/系 統風險	107	180,188,000	70.22%
合 計												107	180,188,000	70.22%

Approved by：_____

Prepared by：_____