

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：溫先生
聯絡電話：(02)2369-5678 分機383

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國105年10月17日
發文字號：台期交字第10502015500號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：公告增修訂本公司「歐元兌美元匯率期貨契約」與「美元兌日圓匯率期貨契約」規格及交易規則、「交易經手費收費標準」、「結算服務費收費標準」、「結算保證金收取方式及標準」、「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」與「黃金期貨契約」規格及交易規則等條文，實施日期另行公告。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會105年10月7日金管證期字第1050040005號函辦理。
- 二、配合本公司推出歐元兌美元匯率期貨契約與美元兌日圓匯率期貨契約，爰增訂「歐元兌美元匯率期貨契約」規格、「歐元兌美元匯率期貨契約」交易規則、「美元兌日圓匯率期貨契約」規格、「美元兌日圓匯率期貨契約」交易規則，並修訂本公司「交易經手費收費標準」第2條、「結算服務費收費標準」第4條及第5條、「結算保證金收取方式及標準」第4條之7、「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第叁點、第肆點、第陸點及第柒點、「黃金期貨契約規格」保證金相關規定及「黃金期貨契約交易規則」第14條，相關增修訂條文對照表如附件，實施日期另行公告。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、財政部賦稅署、中華民國期貨商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中

華民國證券櫃檯買賣中心、臺灣集中保管結算所股份有限公司、台北國際金融資訊協會、植根國際資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 邱文昌

裝

訂

線

臺灣期貨交易所股份有限公司「歐元兌美元匯率期貨契約」規格

項目	內容
交易標的	歐元兌美元匯率
中文簡稱	歐元兌美元期貨
英文代碼	XEF
交易時間	<ul style="list-style-type: none"> • 本契約之交易日與銀行營業日相同 • 交易時間為營業日上午 8：45～下午 4：15 • 到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8：45～下午 2：00
契約規模	20,000 歐元
契約到期 交割月份	交易當月起接續之 4 個季月(3、6、9、12 季月循環)
每日結算價	每日結算價原則上採當日收盤前 1 分鐘內所有交易之成交量加權平均價，若無成交價時，則依本公司「歐元兌美元匯率期貨契約交易規則」訂定之
每日漲跌幅	最大漲跌幅限制為前一交易日結算價上下 7%
報價方式	每 1 歐元兌美元
最小升降單位	0.0001 美元/歐元(2 美元)
最後交易日	最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三，其次一營業日為新契約的開始交易日
最後結算日	最後結算日同最後交易日
最後結算價	最後交易日台北時間下午 2 時 WM/Reuters 歐元兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第 4 位
交割方式	現金交割，交易人於最後結算日依最後結算價之差額，以淨額進行美元現金之交付或收受
部位限制	<ul style="list-style-type: none"> • 交易人於任何時間持有本契約同一方之未了結部位總和，不得逾本公司公告之限制標準

	<ul style="list-style-type: none"> • 法人機構基於避險需求得向本公司申請放寬部位限制 • 綜合帳戶，除免主動揭露個別交易人者適用法人部位限制外，持有部位不受本公司公告之部位限制
保證金	<ul style="list-style-type: none"> • 期貨商向交易人收取之交易保證金及保證金追繳標準，不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金水準 • 本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數計算之 • 交易人應繳交之保證金得依其與期貨商之約定，以新臺幣或其他本公司公告之外幣收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理

臺灣期貨交易所股份有限公司「歐元兌美元匯率期貨契約」交易規則

條文	說明
第一條 為維護臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱本公司）「歐元兌美元匯率期貨契約」（以下簡稱本契約）之交易秩序，特制定本規則，俾保障本契約交易之安全與公平。	一、揭示訂定本交易規則之目的。 二、明定本契約之名稱。
第二條 期貨商從事本契約交易業務，除依期貨交易法暨相關法令外，應依本規則之規定辦理，本規則未規定者，依本公司章程、公告及函示等辦理。	明定本契約交易之業務執行，悉依有關法令、本公司章程及本規則之規定辦理。
第三條 本契約之中文簡稱為「歐元兌美元期貨」，英文代碼為 XEF。	明定本契約之類別與中英文簡稱。
第四條 本契約之標的為歐元兌美元匯率，每一契約價值為二萬歐元。	一、明定本契約之交易標的與契約價值。 二、為降低交易門檻，提高市場流動性，並與芝加哥商業交易所(CME)較大規格之匯率期貨有所市場區隔，故規劃契約價值為 2 萬歐元。
第五條 本契約之報價以一歐元為單位，採美元報價，最小升降單位為零點零零零一美元。每一升降單位之價值為二美元。	一、明定本契約之報價單位、報價幣別與最小升降單位。 二、配合外匯市場之交易習慣，歐元兌美元匯率報價方式為每 1 歐元兌多少美元（例如：1 歐元兌 1.1143 美元），且報價至小數點後第 4 位，故設定契約最小升降單位為 0.0001 美元。另因契約價值為 2 萬歐元，故期貨價格每跳動 1 個升降單位，相當於契約價值變動 2 美元。
第六條 交易人得於最後交易日收盤前，將原買進或賣出數量之一部或全部，於本公司	明定交易人之沖銷權利。

條文	說明
<p>集中交易市場賣出或買回，以了結契約之權利義務。</p>	
<p>第七條 本契約交易日與銀行業營業日相同。交易時間為上午八時四十五分至下午四時十五分，到期月份契約最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至下午二時。但銀行業因故暫停營業或有其他因素影響本契約交易之進行時，本公司得依當時狀況宣布暫停交易，並於次一營業日向主管機關申報備查。</p> <p>前項交易日及交易時間，本公司得於報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>明定本契約之交易時間。</p>
<p>第八條 本契約之交割月份分別為交易當月起之三月、六月、九月、十二月中四個接續之季月，同時掛牌交易；各交割月份契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，到期契約於最後交易日收盤時停止交易，最後交易日為該到期契約之最後結算日。</p> <p>前項最後交易日若為下列情形之一者，以其最近之次一營業日為最後交易日，但本公司得視情況調整之：</p> <p>一、國內假日或因不可抗力因素未能進行交易。</p> <p>二、WM/Reuters 因國際外匯市場休假，未提供台北時間下午二時歐元兌美元即期匯率中價。</p> <p>三、其他因素影響本契約之交易或結算。</p> <p>到期契約最後交易日之次一營業日，為新交割月份契約之交易開始日。</p> <p>前三項交割月份、交易開始日、最後交易日、最後結算日，本公司認為必要時</p>	<p>一、明定本契約之掛牌月份、交易開始日、最後交易日及最後結算日。</p> <p>二、觀察全球主要歐元匯率期貨，多僅掛牌季月契約，且交易量高度集中於最近季月，故將交割月份設計為自交易當月起之3、6、9、12月中4個連續季月。</p> <p>三、本契約之交易開始日、最後交易日及最後結算日則比照現行人民幣匯率期貨。</p> <p>四、由於本契約之最後結算價格係採WM/Reuters 即期匯率為基礎訂定之，惟依 WM/Reuters 相關文件，WM/Reuters 將考量美國、英國、德國及日本四個國際金融中心之休假日，事先公布未來5年未提供匯率指標服務之時間表，故到期契約最後交易日如遇前揭情形，或發生不可抗力因素未能交易或結算時，擬比照以往國內最後交易日遇假日之作法，以最</p>

條 文	說 明
得報請主管機關核准後變更之。	近之次一營業日為最後交易日。但為防止最後交易日因不可抗力因素而一直未能交易，故本公司保有視情況調整之權利，以方便交易人進行最後結算。
第九條 本契約之買賣申報，除另有規定外，以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。	一、明定本契約之撮合方式。 二、本契約適用鉅額交易制度，除電腦自動撮合外，可採議價申報鉅額交易，故明訂「除另有規定外」文字。
<p>第十條 交易人持有部位，於每日收盤後，依本公司公布之每日結算價計算損益。</p> <p>前項每日結算價依下列規定訂定之：</p> <p>一、採收盤前一分鐘內所有交易之成交量加權平均價。</p> <p>二、當日收盤前一分鐘內無成交價時，以收盤時未成交之買、賣報價中，申報買價最高者與申報賣價最低者之平均價位為當日結算價。</p> <p>三、無申報買價時，以申報賣價最低者為當日結算價；無申報賣價時，則以申報買價最高者為當日結算價。</p> <p>四、當遠月份期貨契約無申報買價及申報賣價時，則取前營業日現月份期貨契約之結算價與該期貨契約之結算價間差價為計算基礎，而當日現月份期貨契約之結算價加此差價之所得價格為該期貨契約當日結算價。</p> <p>五、一至四款皆無法決定當日結算價，或其結算價顯不合理時，由本公司決定之。</p>	一、明定本契約每日結算價之訂定標準。 二、每日結算價之決定，基本上以市場價格決定機能為前提，但考量每日所決定之結算價需合理反映當日市場行情變動，故針對無法決定當日結算價之情況，或所決定出之結算價顯不合理時，由本公司決定之。
第十一條 本契約交易每日漲跌幅度，以前一交易日結算價上下百分之七為限，本公司	一、明定本契約之每日漲跌幅度。 二、雖外匯市場無漲跌幅限制，惟鑑於國

條文	說明
<p>得視市場狀況調整契約交易之每日漲跌幅。</p>	<p>內市場參與者仍以散戶居多，為避免交易人 fat finger 錯單或市場價格異常波動，故規劃比照其他期貨商品採取適當的比例作為當日漲跌幅限制。考量歐元及日圓匯率之波幅，且參考人民幣匯率期貨作法，規劃以 7% 作為本契約之每日漲跌幅限制。</p> <p>三、另為完整反映外匯市場之匯率波動，擬參考人民幣匯率期貨作法，本公司得視市場狀況調整每日漲跌幅。</p>
<p>第十二條 本契約之最後結算價，以最後交易日台北時間下午二時 WM/Reuters 歐元兌美元即期匯率中價，並取四捨五入至小數第四位之數值訂之。</p> <p>前項即期匯率中價因故未能於最後結算日本公司執行到期交割作業前產生，或最後結算價顯不合理時，由本公司參酌主要金融資訊系統揭露之歐元兌美元匯率市場價格決定之。</p>	<p>一、明定本契約最後結算價之決定方式。</p> <p>二、WM/Reuters 為國際知名之金融指標編製機構(現為 Thomson Reuters 所有)，自 1994 年起揭露匯率指標，並受英國 Financial Conduct Authority (FCA)監管。WM/Reuters 即期匯率係基於 Thomson Reuters Matching、EBS 及 Currenex 等外匯電子交易平台的成交價，以每定價時點前後 2.5 分鐘(即共 5 分鐘)之每秒成交價計算，且同時揭露匯率指標之買價、賣價及中價。WM/Reuters 即期匯率於香港時間週一上午 6 時至英國時間週五下午 10 時(即台北時間週六上午 6 時)每小時(歐元、日圓等主要貨幣為每半小時)計算一次，於定價時點後 15 分鐘公布。</p> <p>三、考量外匯實務作法，亞洲銀行間匯率選擇權多於台北時間下午 2 時進行比價，故本契約宜採用台北時間下午 2 時之匯率指標為最後結算價。</p> <p>WM/Reuters 即期匯率以外匯電子交</p>

條文	說明
	<p>易平台之成交價為採樣基礎，編製方式嚴謹，具國際知名度，且新加坡交易所(SGX)及香港交易所(HKEX)的匯率期貨皆採其為最後結算價指標，故規劃本契約之最後結算價為，最後交易日台北時間下午 2 時 WM/Reuters 歐元兌美元即期匯率中價，並依期貨商品最小升降單位四捨五入，至小數第 4 位。</p> <p>四、考量金融市場行情變化快速，替代之最後結算價指標公布時點不宜與原指標差距過大，規劃倘台北時間下午 2 時 WM/Reuters 歐元兌美元即期匯率中價未能於最後結算日本公司執行到期交割作業前產生，或最後結算價顯不合理時，由本公司參酌湯森路透(Thomson Reuters) 及彭博資訊(Bloomberg)等主要金融資訊系統揭露之歐元兌美元匯率市場價格決定之。</p>
<p>第十三條 本契約採現金交割，交易人於最後 結算日依最後結算價之差額，以淨額方式 進行現金之交付或收受。</p>	明定本契約之到期交割方式。
<p>第十四條 期貨商受託買賣本契約，應於受託 前按受託買賣之合計數量預先收足交易保 證金，並自成交日起迄交割期限屆至前， 按每日結算價逐日計算每一委託人持有部 位之權益，合併計入委託人之保證金帳戶 餘額。</p> <p>委託人保證金帳戶餘額低於維持保證 金金額時，期貨商應即通知委託人於限期 內以現金補繳其保證金帳戶餘額與其未了 結部位所應繳交易保證金總額間之差額。</p>	<p>一、明定本契約應每日結算。</p> <p>二、明定期貨商得於客戶未補繳保證金時 對客戶之部位進行代為沖銷。</p>

條文	說明
<p>委託人未於期限內補繳保證金者，期貨商得代為沖銷委託人之部位。</p> <p>前二項之交易保證金及維持保證金不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金標準。</p> <p>本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數加成計算之。</p> <p>第一項及第二項之保證金，委託人得依其與期貨商之約定，以新臺幣或其他本公司公告之外幣收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理。</p>	
<p>第十五條 交易人於任何時間持有本契約買進或賣出同一方之未了結部位合計數，不得逾本公司公告之限制標準。</p> <p>前項限制標準，本公司每三個月或依市場狀況，依該期間本契約之每日平均交易量或未沖銷量孰高者，自然人以其百分之五、法人以其百分之十為基準，依下列級距，公告所適用之部位限制標準。但自然人最低部位限制數為一千個契約，法人為三千個契約：</p> <p>一、當基準為一千個契約數以上時，以下取最接近之二百個契約之整數倍為其部位限制數。</p> <p>二、當基準為二千個契約數以上時，以下取最接近之五百個契約之整數倍為其部位限制數。</p> <p>三、當基準為五千個契約數以上時，以下取最接近之一千個契約之整數倍為其部位限制數。</p>	<p>一、明定每一交易人之部位限制。</p> <p>二、考量本契約上市初期，現行市場上最低部位限制數標準之口數應足以滿足交易人需求，故擬採用該最低部位限制數標準，自然人為 1,000 個契約、法人機構 3,000 個契約，期貨自營商/造市者則為 9,000 個契約。</p> <p>三、參酌本公司人民幣匯率期貨契約皆訂有法人機構基於避險需求得向本公司申請放寬部位限制，本契約擬比照開放法人機構得基於避險需求向本公司申請放寬部位限制。</p>

條文	說明
<p>下取最接近之一千個契約之整數倍為其部位限制數。</p> <p>四、當基準為一萬個契約數以上時，以向下取最接近之二千個契約之整數倍為其部位限制數。</p>	
<p>期貨自營商及從事本契約造市業務者持有本契約之未了結部位合計數，以第二項法人部位限制之三倍為限。從事本契約造市業務者，本公司得視市場狀況調整之。</p>	
<p>本公司審視所適用之部位限制級距時，若該期間之每日平均交易量或未沖銷量與前次調整時相較，其增減未逾百分之二點五時，雖達調整級距，仍不調整。</p>	
<p>部位限制之提高，自本公司公告之日起生效。部位限制之降低，於公告日該契約已上市之次近月份契約到期後生效。但本公司得視情況調整之。</p>	
<p>前項部位限制降低時，交易人於生效日前持有而逾越調降後限制標準之部位，得持有至契約到期日止。但尚未符合調降後之限制標準前，不得新增部位。</p>	
<p>綜合帳戶，除免主動揭露個別交易人者適用法人部位限制外，持有本契約之未了結部位合計數，不受第二項限制。</p>	
<p>法人機構基於避險需要，得向本公司申請放寬部位限制。</p>	
<p>交易人所持有本契約之未了結部位限制，除本條規定外，另應符合「臺灣期貨交易所股份有限公司市場部位監視作業辦法」之規定。</p>	
第十六條 期貨商自行或受託買賣本契約，除	一、明定每筆買賣申報數量限制。

條文	說明
<p>另有規定外，每一筆買賣申報數量，以一百個契約為限。</p> <p>前項買賣申報數量限制，得由本公司視市場交易狀況調整之。</p>	<p>二、單一委託數量若過大，易造成市場價格因少數幾筆交易即產生巨幅波動，對市場有不良之影響，因此制定單筆委託之數量限制。</p> <p>三、配合本契約實施鉅額交易制度，達一定數量之買賣申報得為鉅額交易，不適用本條買賣申報數量限制，故明訂「除另有規定外」之文字。</p>
<p>第十七條 本契約有本公司業務規則第三十一條所列情事須停止交易或終止上市者，本公司應於實施日三十日前公告。</p> <p>所有未了結部位應於公告停止交易或終止上市之實施日前了結。實施日前未了結之部位，以實施日前一交易日之結算價進行結算。</p>	<p>一、明定本契約停止交易或終止上市之處理方式。</p> <p>二、本契約之停止交易或終止上市於實施日生效。</p>
<p>第十八條 本規則經報奉主管機關核定後實施，修訂時亦同。</p>	<p>明定本交易規則之核定施行程序。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司「美元兌日圓匯率期貨契約」規格

項目	內容
交易標的	美元兌日圓匯率
中文簡稱	美元兌日圓期貨
英文代碼	XJF
交易時間	<ul style="list-style-type: none"> • 本契約之交易日與銀行營業日相同 • 交易時間為營業日上午 8：45～下午 4：15 • 到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8：45～下午 2：00
契約規模	20,000 美元
契約到期	交易當月起接續之 4 個季月(3、6、9、12 季月循環)
交割月份	
每日結算價	每日結算價原則上採當日收盤前 1 分鐘內所有交易之成交量加權平均價，若無成交價時，則依本公司「美元兌日圓匯率期貨契約交易規則」訂定之
每日漲跌幅	最大漲跌幅限制為前一交易日結算價上下 7%
報價方式	每 1 美元兌日圓
最小升降單位	0.01 日圓/美元(200 日圓)
最後交易日	最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三，其次一營業日為新契約的開始交易日
最後結算日	最後結算日同最後交易日
最後結算價	最後交易日台北時間下午 2 時 WM/Reuters 美元兌日圓即期匯率中價，四捨五入至小數第 2 位
交割方式	現金交割，交易人於最後結算日依最後結算價之差額，以淨額進行日圓現金之交付或收受
部位限制	<ul style="list-style-type: none"> • 交易人於任何時間持有本契約同一方之未了結部位總和，不得逾本公司公告之限制標準

	<ul style="list-style-type: none"> • 法人機構基於避險需求得向本公司申請放寬部位限制 • 綜合帳戶，除免主動揭露個別交易人者適用法人部位限制外，持有部位不受本公司公告之部位限制
保證金	<ul style="list-style-type: none"> • 期貨商向交易人收取之交易保證金及保證金追繳標準，不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金水準 • 本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數計算之 • 交易人應繳交之保證金得依其與期貨商之約定，以新臺幣或其他本公司公告之外幣收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理

臺灣期貨交易所股份有限公司「美元兌日圓匯率期貨契約」交易規則

條 文	說 明
第一條 為維護臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱本公司）「美元兌日圓匯率期貨契約」（以下簡稱本契約）之交易秩序，特制定本規則，俾保障本契約交易之安全與公平。	一、揭示訂定本交易規則之目的。 二、明定本契約之名稱。
第二條 期貨商從事本契約交易業務，除依期貨交易法暨相關法令外，應依本規則之規定辦理，本規則未規定者，依本公司章程、公告及函示等辦理。	明定本契約交易之業務執行，悉依有關法令、本公司章程及本規則之規定辦理。
第三條 本契約之中文簡稱為「美元兌日圓期貨」，英文代碼為 XJF。	明定本契約之類別與中英文簡稱。
第四條 本契約之標的為美元兌日圓匯率，每一契約價值為二萬美元。	一、明定本契約之交易標的與契約價值。 二、為降低交易門檻，提高市場流動性，並與芝加哥商業交易所(CME)、新加坡交易所(SGX)較大規格之匯率期貨有所市場區隔，故規劃契約價值為 2 萬美元。
第五條 本契約之報價以一美元為單位，採日圓報價，最小升降單位為零點零一日圓。每一升降單位之價值為二百日圓。	一、明定本契約之報價單位、報價幣別與最小升降單位。 二、配合外匯市場之交易習慣，美元兌日圓匯率報價方式為每 1 美元兌多少日圓（例如：1 美元兌 101.12 日圓），且報價至小數點後第 2 位，故設定契約最小升降單位為 0.01 日圓。另因契約價值為 2 萬美元，故期貨價格每跳動 1 個升降單位，相當於契約價值變動 200 日圓。
第六條 交易人得於最後交易日收盤前，將原	明定交易人之沖銷權利。

條文	說明
<p>買進或賣出數量之一部或全部，於本公司集中交易市場賣出或買回，以了結契約之權利義務。</p>	
<p>第七條 本契約交易日與銀行業營業日相同。交易時間為上午八時四十五分至下午四時十五分，到期月份契約最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至下午二時。但銀行業因故暫停營業或有其他因素影響本契約交易之進行時，本公司得依當時狀況宣布暫停交易，並於次一營業日向主管機關申報備查。</p> <p>前項交易日及交易時間，本公司得於報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>明定本契約之交易時間。</p>
<p>第八條 本契約之交割月份分別為交易當月起之三月、六月、九月、十二月中四個接續之季月，同時掛牌交易；各交割月份契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，到期契約於最後交易日收盤時停止交易，最後交易日為該到期契約之最後結算日。</p> <p>前項最後交易日若為下列情形之一者，以其最近之次一營業日為最後交易日，但本公司得視情況調整之：</p> <ul style="list-style-type: none"> 一、國內假日或因不可抗力因素未能進行交易。 二、WM/Reuters 因國際外匯市場休假，未提供台北時間下午二時美元兌日圓即期匯率中價。 三、其他因素影響本契約之交易或結算。 <p>到期契約最後交易日之次一營業日，為新交割月份契約之交易開始日。</p> <p>前三項交割月份、交易開始日、最後</p>	<p>一、明定本契約之掛牌月份、交易開始日、最後交易日及最後結算日。</p> <p>二、觀察全球主要日圓匯率期貨，多僅掛牌季月契約，且交易量高度集中於最近季月，故將交割月份設計為自交易當月起之 3、6、9、12 月中 4 個連續季月。</p> <p>三、本契約之交易開始日、最後交易日及最後結算日則比照現行人民幣匯率期貨。</p> <p>四、由於本契約之最後結算價係採 WM/Reuters 即期匯率為基礎訂定之，惟依 WM/Reuters 相關文件，WM/Reuters 將考量美國、英國、德國及日本四個國際金融中心之休假日，事先公布未來 5 年未提供匯率指標服務之時間表，故到期契約最後交易日如遇前揭情形，或發生不可抗力因素未能交易或結算時，擬比照以往</p>

條文	說明
交易日、最後結算日，本公司認為必要時得報請主管機關核准後變更之。	國內最後交易日遇假日之作法，以最近之次一營業日為最後交易日。但為防止最後交易日因不可抗力因素而一直未能交易，故本公司保有視情況調整之權利，以方便交易人進行最後結算。
第九條 本契約之買賣申報，除另有規定外，以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。	一、明定本契約之撮合方式。 二、本契約適用鉅額交易制度，除電腦自動撮合外，可採議價申報鉅額交易，故明訂「除另有規定外」文字。
<p>第十條 交易人持有部位，於每日收盤後，依本公司公布之每日結算價計算損益。</p> <p>前項每日結算價依下列規定訂定之：</p> <p>一、採收盤前一分鐘內所有交易之成交量加權平均價。</p> <p>二、當日收盤前一分鐘內無成交價時，以收盤時未成交之買、賣報價中，申報買價最高者與申報賣價最低者之平均價位為當日結算價。</p> <p>三、無申報買價時，以申報賣價最低者為當日結算價；無申報賣價時，則以申報買價最高者為當日結算價。</p> <p>四、當遠月份期貨契約無申報買價及申報賣價時，則取前營業日現月份期貨契約之結算價與該期貨契約之結算價間差價為計算基礎，而當日現月份期貨契約之結算價加此差價之所得價格為該期貨契約當日結算價。</p> <p>五、一至四款皆無法決定當日結算價，或其結算價顯不合理時，由本公司決定之。</p>	<p>一、明定本契約每日結算價之訂定標準。</p> <p>二、每日結算價之決定，基本上以市場價格決定機能為前提，但考量每日所決定之結算價需合理反映當日市場行情變動，故針對無法決定當日結算價之情況，或所決定出之結算價顯不合理時，由本公司決定之。</p>
第十一條 本契約交易每日漲跌幅度，以前一	一、明定本契約之每日漲跌幅度。

條文	說明
<p>交易日結算價上下百分之七為限，本公司得視市場狀況調整契約交易之每日漲跌幅。</p>	<p>二、雖外匯市場無漲跌幅限制，惟鑑於國內市場參與者仍以散戶居多，為避免交易人 fat finger 錯單或市場價格異常波動，故規劃比照其他期貨商品採取適當的比例作為當日漲跌幅限制。考量歐元及日圓匯率之波幅，且參考人民幣匯率期貨作法，規劃以 7%作為本契約之每日漲跌幅限制。</p> <p>三、另為完整反映外匯市場之匯率波動，擬參考人民幣匯率期貨作法，本公司得視市場狀況調整每日漲跌幅。</p>
<p>第十二條 本契約之最後結算價，以最後交易日台北時間下午二時 WM/Reuters 美元兌日圓即期匯率中價，並取四捨五入至小數第二位之數值訂之。</p> <p>前項即期匯率中價因故未能於最後結算日本公司執行到期交割作業前產生，或最後結算價顯不合理時，由本公司參酌主要金融資訊系統揭露之美元兌日圓匯率市場價格決定之。</p>	<p>一、明定本契約最後結算價之決定方式。</p> <p>二、WM/Reuters 為國際知名之金融指標編製機構(現為 Thomson Reuters 所有)，自 1994 年起揭露匯率指標，並受英國 Financial Conduct Authority (FCA)監管。WM/Reuters 即期匯率係基於 Thomson Reuters Matching 、 EBS 及 Currenex 等外匯電子交易平台的成交價，以每定價時點前後 2.5 分鐘(即共 5 分鐘)之每秒成交價計算，且同時揭露匯率指標之買價、賣價及中價。WM/Reuters 即期匯率於香港時間週一上午 6 時至英國時間週五下午 10 時(即台北時間週六上午 6 時)每小時(歐元、日圓等主要貨幣為每半小時)計算一次，於定價時點後 15 分鐘公布。</p> <p>三、考量外匯實務作法，亞洲銀行間匯率選擇權多於台北時間下午 2 時進行比價，故本契約宜採用台北時間下午 2 時之匯率指標為最後結算價。</p>

條文	說明
	<p>WM/Reuters 即期匯率以外匯電子交易平台之成交價為採樣基礎，編製方式嚴謹，具國際知名度，且新加坡交易所(SGX)及香港交易所(HKEX)的匯率期貨皆採其為最後結算價指標，故規劃本契約之最後結算價為，最後交易日台北時間下午 2 時 WM/Reuters 美元兌日圓即期匯率中價，並依期貨商品最小升降單位四捨五入，至小數第 2 位。</p> <p>四、考量金融市場行情變化快速，替代之最後結算價指標公布時點不宜與原指標差距過大，規劃倘台北時間下午 2 時 WM/Reuters 美元兌日圓即期匯率中價未能於最後結算日本公司執行到期交割作業前產生，或最後結算價顯不合理時，由本公司參酌湯森路透(Thomson Reuters) 及 彭博資訊(Bloomberg)等主要金融資訊系統揭露之美元兌日圓匯率市場價格決定之。</p>
<p>第十三條 本契約採現金交割，交易人於最後 結算日依最後結算價之差額，以淨額方式 進行現金之交付或收受。</p>	明定本契約之到期交割方式。
<p>第十四條 期貨商受託買賣本契約，應於受託 前按受託買賣之合計數量預先收足交易保 證金，並自成交日起迄交割期限屆至前， 按每日結算價逐日計算每一委託人持有部 位之權益，合併計入委託人之保證金帳戶 餘額。</p> <p>委託人保證金帳戶餘額低於維持保證 金金額時，期貨商應即通知委託人於限期 內以現金補繳其保證金帳戶餘額與其未了</p>	<p>一、明定本契約應每日結算。</p> <p>二、明定期貨商得於客戶未補繳保證金時 對客戶之部位進行代為沖銷。</p>

條文	說明
<p>結部位所應繳交易保證金總額間之差額。 委託人未於期限內補繳保證金者，期貨商得代為沖銷委託人之部位。</p>	
<p>前二項之交易保證金及維持保證金不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金標準。</p>	
<p>本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數加成計算之。</p>	
<p>第一項及第二項之保證金，委託人得依其與期貨商之約定，以新臺幣或其他本公司公告之外幣收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理。</p>	
<p>第十五條 交易人於任何時間持有本契約買進或賣出同一方之未了結部位合計數，不得逾本公司公告之限制標準。</p>	<p>一、明定每一交易人之部位限制。</p>
<p>前項限制標準，本公司每三個月或依市場狀況，依該期間本契約之每日平均交易量或未沖銷量孰高者，自然人以其百分之五、法人以其百分之十為基準，依下列級距，公告所適用之部位限制標準。但自然人最低部位限制數為一千個契約，法人為三千個契約：</p>	<p>二、考量本契約上市初期，現行市場上最低部位限制數標準之口數應足以滿足交易人需求，故擬採用該最低部位限制數標準，自然人為 1,000 個契約、法人機構 3,000 個契約，期貨自營商/造市者則為 9,000 個契約。</p>
<p>一、當基準為一千個契約數以上時，以下取最接近之二百個契約之整數倍為其部位限制數。</p> <p>二、當基準為二千個契約數以上時，以下取最接近之五百個契約之整數倍為其部位限制數。</p>	<p>三、參酌本公司人民幣匯率期貨契約皆訂有法人機構基於避險需求得向本公司申請放寬部位限制，本契約擬比照開放法人機構得基於避險需求向本公司申請放寬部位限制。</p>

條文	說明
<p>三、當基準為五千個契約數以上時，以向下取最接近之一千個契約之整數倍為其部位限制數。</p> <p>四、當基準為一萬個契約數以上時，以向下取最接近之二千個契約之整數倍為其部位限制數。</p> <p>期貨自營商及從事本契約造市業務者持有本契約之未了結部位合計數，以第二項法人部位限制之三倍為限。從事本契約造市業務者，本公司得視市場狀況調整之。</p> <p>本公司審視所適用之部位限制級距時，若該期間之每日平均交易量或未沖銷量與前次調整時相較，其增減未逾百分之二點五時，雖達調整級距，仍不調整。</p> <p>部位限制之提高，自本公司公告之日起生效。部位限制之降低，於公告日該契約已上市之次近月份契約到期後生效。但本公司得視情況調整之。</p> <p>前項部位限制降低時，交易人於生效日前持有而逾越調降後限制標準之部位，得持有至契約到期日止。但尚未符合調降後之限制標準前，不得新增部位。</p> <p>綜合帳戶，除免主動揭露個別交易人者適用法人部位限制外，持有本契約之未了結部位合計數，不受第二項限制。</p> <p>法人機構基於避險需要，得向本公司申請放寬部位限制。</p> <p>交易人所持有本契約之未了結部位限制，除本條規定外，另應符合「臺灣期貨交易所股份有限公司市場部位監視作業辦法」之規定。</p>	

條文	說明
<p>第十六條 期貨商自行或受託買賣本契約，除另有規定外，每一筆買賣申報數量，以一百個契約為限。</p> <p>前項買賣申報數量限制，得由本公司視市場交易狀況調整之。</p>	<p>一、明定每筆買賣申報數量限制。</p> <p>二、單一委託數量若過大，易造成市場價格因少數幾筆交易即產生巨幅波動，對市場有不良之影響，因此制定單筆委託之數量限制。</p> <p>三、配合本契約實施鉅額交易制度，達一定數量之買賣申報得為鉅額交易，不適用本條買賣申報數量限制，故明訂「除另有規定外」之文字。</p>
<p>第十七條 本契約有本公司業務規則第三十一條所列情事須停止交易或終止上市者，本公司應於實施日三十日前公告。</p> <p>所有未了結部位應於公告停止交易或終止上市之實施日前了結。實施日前未了結之部位，以實施日前一交易日之結算價進行結算。</p>	<p>一、明定本契約停止交易或終止上市之處理方式。</p> <p>二、本契約之停止交易或終止上市於實施日生效。</p>
<p>第十八條 本規則經報奉主管機關核定後實施，修訂時亦同。</p>	明定本交易規則之核定施行程序。

**臺灣期貨交易所股份有限公司交易經手費收費標準
修正條文對照表**

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p>第二條 期貨商與本公司簽訂市場使用契約，參加本公司市場期貨交易，除另有規定外，應依下列規定繳納交易經手費：</p> <p>一、費率</p> <p>(一) 臺灣證券交易所股價指數期貨契約、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約、臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約、臺灣 50 指數期貨契約、臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數期貨契約及中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣拾貳元整。</p> <p>(二) 臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約及以受益憑證為標的之股票期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣柒點伍元整。</p> <p>(三) 臺灣證券交易所股價指數選擇權契約、臺灣證券交易所電子類股價指數選擇權契約、臺灣證券交易所金融保險類股價指數選擇權契約、臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數選擇權契約、中華民國證券櫃檯買賣</p>	<p>第二條 期貨商與本公司簽訂市場使用契約，參加本公司市場期貨交易，除另有規定外，應依下列規定繳納交易經手費：</p> <p>一、費率</p> <p>(一) 臺灣證券交易所股價指數期貨契約、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約、臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約、臺灣 50 指數期貨契約、臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數期貨契約及中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣拾貳元整。</p> <p>(二) 臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約及以受益憑證為標的之股票期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣柒點伍元整。</p> <p>(三) 臺灣證券交易所股價指數選擇權契約、臺灣證券交易所電子類股價指數選擇權契約、臺灣證券交易所金融保險類股價指數選擇權契約、臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數選擇權契約、中華民國證券櫃檯買賣</p>	<p>配合新增「歐元兌美元匯率期貨契約」及「美元兌日圓匯率期貨契約」，爰修正本公司交易經手費收費標準。</p>

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p>中心股價指數選擇權契約及以受益憑證為標的之股票選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣陸元整。</p> <p>(四) 利率類期貨契約，每一契約買賣雙方各為新台幣陸元整。</p> <p>(五) 黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣陸元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整。</p> <p>(六) 以股票為標的之股票期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整；以股票為標的之股票選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整。</p> <p>(七) 美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣拾肆點肆元整；小型美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整。</p> <p>(八) 東京證券交易所股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣肆點捌元整。</p> <p>(九) 歐元兌美元匯率期貨契約及美元兌日圓匯率期貨契約，每一契約買賣雙方各為</p>	<p>中心股價指數選擇權契約及以受益憑證為標的之股票選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣陸元整。</p> <p>(四) 利率類期貨契約，每一契約買賣雙方各為新台幣陸元整。</p> <p>(五) 黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣陸元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整。</p> <p>(六) 以股票為標的之股票期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整；以股票為標的之股票選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整。</p> <p>(七) 美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣拾肆點肆元整；小型美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣參元整。</p> <p>(八) 東京證券交易所股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣肆點捌元整。</p>	

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p><u>新臺幣肆點捌元整。</u> (以下略)</p>	<p>(以下略)</p>	

**臺灣期貨交易所股份有限公司結算服務費收費標準
修正條文對照表**

修 正 條 文	原 條 文	說 明
第四條 結算會員從事期貨交易之結算交割業務，除另有規定外，應依下列規定繳納結算手續費：	第四條 結算會員從事期貨交易之結算交割業務，除另有規定外，應依下列規定繳納結算手續費：	配合新增「歐元兌美元匯率期貨契約」及「美元兌日圓匯率期貨契約」，爰新增第四條第一項第一款第九目規定。
一、費率：	一、費率：	
(一)臺灣證券交易所股價指數期貨契約、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約、臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約、臺灣 50 指數期貨契約、臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數期貨契約及中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣捌元整。	(一)臺灣證券交易所股價指數期貨契約、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約、臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約、臺灣 50 指數期貨契約、臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數期貨契約及中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣捌元整。	
(二)臺灣證券交易所股價指數小型期貨契	(二)臺灣證券交易所股價指數小型期貨契	

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p>約、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約 及以受益憑證為標 的之股票期貨契 約，每一契約買賣 雙方各繳納新台幣 伍元整。</p> <p>(三)臺灣證券交易所股 價指數選擇權契 約、臺灣證券交易 所電子類股價指數 選擇權契約、臺灣 證券交易所金融保 險類股價指數選擇 權契約、臺灣證券 交易所未含金融電 子類股價指數選擇 權契約、中華民國 證券櫃檯買賣中心 股價指數選擇權契 約及以受益憑證為 標的之股票選擇權 契約，每一契約買 賣雙方各繳納新台 幣肆元整。</p>	<p>約、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約 及以受益憑證為標 的之股票期貨契 約，每一契約買賣 雙方各繳納新台幣 伍元整。</p> <p>(三)臺灣證券交易所股 價指數選擇權契 約、臺灣證券交易 所電子類股價指數 選擇權契約、臺灣 證券交易所金融保 險類股價指數選擇 權契約、臺灣證券 交易所未含金融電 子類股價指數選擇 權契約、中華民國 證券櫃檯買賣中心 股價指數選擇權契 約及以受益憑證為 標的之股票選擇權 契約，每一契約買 賣雙方各繳納新台 幣肆元整。</p>	
(四)利率類期貨契約，	(四)利率類期貨契約，	

修 正 條 文	原 條 文	說 明
每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整。	每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整。	
(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣肆元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣肆元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	
(六)以股票為標的之股票選擇權契約及股票期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣貳元整。	(六)以股票為標的之股票選擇權契約及股票期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣貳元整。	
(七)美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣玖點陸元整；小型美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	(七)美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣玖點陸元整；小型美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	

修 正 條 文	原 條 文	說 明
(八)東京證券交易所股 價指數期貨契約， 每一契約買賣雙方 各繳納新台幣參點 貳元整。 (九) <u>歐元兌美元匯率期 貨及美元兌日圓匯 率期貨契約，每一 契約買賣雙方各繳 納新臺幣參點貳元 整。</u>	(八)東京證券交易所股 價指數期貨契約， 每一契約買賣雙方 各繳納新台幣參點 貳元整。	
二、(略)	二、(略)	
第五條 結算會員從事期 貨交易之結算交割業 務，除另有規定外， 應依下列規定繳納交 割手續費： 一、費率： (一)臺灣證券交易所股 價指數期貨契約、 臺灣證券交易所電 子類股價指數期貨 契約、臺灣證券交 易所金融保險類股 價指數期貨契約、 臺灣 50 指數期貨契	第五條 結算會員從事期 貨交易之結算交割業 務，除另有規定外， 應依下列規定繳納交 割手續費： 一、費率： (一)臺灣證券交易所股 價指數期貨契約、 臺灣證券交易所電 子類股價指數期貨 契約、臺灣證券交 易所金融保險類股 價指數期貨契約、 臺灣 50 指數期貨契	配合新增「歐元兌美元匯 率期貨契約」及「美元兌 日圓匯率期貨契約」，爰 新增第五條第一項第一款 第九目規定。

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p>約、臺灣證券交易 所未含金融電子類 股價指數期貨契約 及中華民國證券櫃 檯買賣中心股價指 數期貨契約，每一 契約買賣雙方各繳 納新台幣捌元整。</p> <p>(二) 臺灣證券交易所股 價指數小型期貨契 約、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約 及以受益憑證為標 的之股票期貨契 約，每一契約買賣 雙方各繳納新台幣 伍元整。</p> <p>(三)臺灣證券交易所股 價指數選擇權契 約、臺灣證券交易 所電子類股價指數 選擇權契約、臺灣 證券交易所金融保 險類股價指數選擇 權契約、臺灣證券 交易所未含金融電</p>	<p>約、臺灣證券交易 所未含金融電子類 股價指數期貨契約 及中華民國證券櫃 檯買賣中心股價指 數期貨契約，每一 契約買賣雙方各繳 納新台幣捌元整。</p> <p>(二) 臺灣證券交易所股 價指數小型期貨契 約、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約 及以受益憑證為標 的之股票期貨契 約，每一契約買賣 雙方各繳納新台幣 伍元整。</p> <p>(三)臺灣證券交易所股 價指數選擇權契 約、臺灣證券交易 所電子類股價指數 選擇權契約、臺灣 證券交易所金融保 險類股價指數選擇 權契約、臺灣證券 交易所未含金融電</p>	

修 正 條 文	原 條 文	說 明
子類股價指數選擇權契約、中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數選擇權契約及以受益憑證為標的之股票選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整。	子類股價指數選擇權契約、中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數選擇權契約及以受益憑證為標的之股票選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整。	
(四)利率類期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整。	(四)利率類期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整。	
(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣肆元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣肆元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	
(六)以股票為標的之股票選擇權契約及股票期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣貳元整。	(六)以股票為標的之股票選擇權契約及股票期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣貳元整。	

修 正 條 文	原 條 文	說 明
(七)美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣玖點陸元整；小型美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	(七)美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣玖點陸元整；小型美元兌人民幣匯率期貨及選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣貳元整。	
(八)東京證券交易所股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣參點貳元整。	(八)東京證券交易所股價指數期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣參點貳元整。	
(九) <u>歐元兌美元匯率期貨及美元兌日圓匯率期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新臺幣參點貳元整。</u>		
二、(略)	二、(略)	

**臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準
修正條文對照表**

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第四條之七 決率類期貨契約結算保證金金額為期貨價格乘以契約規模乘以風險價格係數。</p> <p>前項所稱風險價格係數，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。</p> <p><u>第一項收取標準，人民幣報價期貨契約以百元為整數，百元以下部分無條件進位至百元；美元報價期貨契約以拾元為整數，拾元以下部分無條件進位至拾元；日圓報價期貨契約以千元為整數，千元以下部分無條件進位至千元。</u></p> <p>第一項有關結算保證金之計算方式及調整作業規範，由本公司另訂之。</p>	<p>第四條之七 決率類期貨契約結算保證金金額為期貨價格乘以契約規模乘以風險價格係數。</p> <p>前項所稱風險價格係數，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。</p> <p>第一項收取標準以百元為整數，百元以下部分無條件進位至百元。</p> <p>第一項有關結算保證金之計算方式及調整作業規範，由本公司另訂之。</p>	<p>配合新增「歐元兌美元匯率期貨契約」及「美元兌日圓匯率期貨契約」，增訂以美元及日圓報價之匯率類期貨契約結算保證金收取標準之進位方式，爰修正第四條之七第三項之規定。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>參、現金結算保證金提領作業</p> <p>一、作業時間為上午八時四十五分至下午四時三十分。</p> <p>二、結算會員辦理當日提領現金結算保證金作業，應依規定時間申請，以電腦作業方式傳輸至本公司結算部，申請提領其超額現金保證金。本公司對結算會員可提領金額進行審核，當可提領金額超過其申請提領金額，本公司將款項撥轉入結算會員結算保證金專戶(自營或客戶)。當可提領金額不足其申請提領金額時，該申請視為無效。本公司受理結算會員之申請案件，依下列各款規定辦理：</p> <p>(略)</p> <p>三、結算會員辦理次日提領現金結算保證金作業，應於上午八時四十五分至下午四時三十分，以電腦作</p>	<p>參、現金結算保證金提領作業</p> <p>一、作業時間為上午八時四十五分至下午四時三十分。</p> <p>二、結算會員辦理當日提領現金結算保證金作業，應依規定時間申請，以電腦作業方式傳輸至本公司結算部，申請提領其超額現金保證金。本公司對結算會員可提領金額進行審核，當可提領金額超過其申請提領金額，本公司將款項撥轉入結算會員結算保證金專戶(自營或客戶)。當可提領金額不足其申請提領金額時，該申請視為無效。本公司受理結算會員之申請案件，依下列各款規定辦理：</p> <p>(略)</p> <p>三、結算會員辦理次日提領現金結算保證金作業，應於上午八時四十五分至下午四時三十分，以電腦作</p>	<p>配合「美元兌日圓匯率期貨契約」之保證金計價幣別為日圓，增訂結算會員提領日圓保證金上限金額之計算方式，並酌作文字修正，爰修正本點。</p>

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>業方式傳輸至本公司結算部，申請提領其超額現金保證金。本公司於當日部位結帳作業完成後，對結算會員可提領金額進行審核，當可提領金額超過其申請提領金額，本公司即通知結算銀行於次一營業日上午九時前將款項撥轉入結算會員結算保證金專戶(自營或客戶)。當結算會員之可提領金額不足其申請提領金額時，該申請視為無效。結算會員擬更改申請提領金額，需於本公司作業時間內以電腦作業方式重新申請。</p> <p>四、結算會員現金保證金權益數依新臺幣及本公司公告之外幣帳戶分別計算，並合計現金總權益數。合計現金總權益為正數，可申請提領現金總權益之超額保證金金額。各幣別帳戶可提領之現金保證金數額如下：</p>	<p>業方式傳輸至本公司結算部，申請提領其超額現金保證金。本公司於當日部位結帳作業完成後，對結算會員可提領金額進行審核，當可提領金額超過其申請提領金額，本公司即通知結算銀行於次一營業日上午九時前將款項撥轉入結算會員結算保證金專戶(自營或客戶)。當結算會員之可提領金額不足其申請提領金額時，該申請視為無效。結算會員擬更改申請提領金額，需於本公司作業時間內以電腦作業方式重新申請。</p> <p>四、結算會員現金保證金權益數依新臺幣及本公司公告之外幣帳戶分別計算，並合計現金總權益數。合計現金總權益為正數，可申請提領現金總權益之超額保證金金額。各幣別帳戶可提領之現金保證金數額如下：</p>	

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
(一)合計現金總權益數及新臺幣帳戶權益數皆為正時，始可申請提領新臺幣，其可提領金額為合計現金總權益數之超額保證金與新臺幣帳戶超額保證金較小者之金額為限。	(一)合計現金總權益數及新臺幣帳戶權益數皆為正時，始可申請提領新臺幣，其可提領金額為合計現金總權益數之超額保證金與新臺幣帳戶超額保證金較小者之金額為限。	
(二)合計現金總權益數及所欲提領之外幣帳戶權益數皆為正時，始可申請提領該外幣，其可提領金額以合計現金總權益數之超額保證金與該外幣帳戶權益數較小者之該外幣金額為限。	(二)合計現金總權益數及所欲提領之外幣帳戶權益數皆為正時，始可申請提領該外幣，其可提領金額以合計現金總權益數之超額保證金與該外幣帳戶權益數較小者之該外幣金額為限。	
(三)前款外幣帳戶可提領金額之上限，如其帳戶幣別為美元或日圓者，其可提領之金額上限須另扣減境外華僑及外國人與大陸地區投資人外之其他客戶從事美元或日圓計價商品所應繳交之該外幣保證金金額，其扣減後之金額為負值	(三)前款外幣帳戶可提領金額之上限，如其帳戶幣別為美元者，其可提領之金額上限須另扣減境外華僑及外國人與大陸地區投資人外之其他客戶從事美元計價商品所應繳交之美元保證金金額，其扣減後之金額為負值者，不得提領美	

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
者，不得提領該外幣；如其帳戶幣別為人民幣者，其可提領之金額上限須另扣減人民幣計價商品所應繳交之人民幣保證金金額，其扣減後之金額為負值者，不得提領人民幣。	元；如其帳戶幣別為人民幣者，其可提領之金額上限須另扣減人民幣計價商品所應繳交之人民幣保證金金額，其扣減後之金額為負值者，不得提領人民幣。	
五、(略)	五、(略)	
肆、盤中保證金追繳作業 一、作業時間為上午八時至下午六時十五分。 二、結算會員於本公司作業時間內由其電腦作業方式接收本公司盤中保證金追繳通知訊息時，應確認其被追繳金額，並於一小時內通知結算銀行，撥轉不少於該金額之現金結算保證金存入本公司結算保證金專戶。因逾結算銀行作業時間，結算會員無法於時限內繳交 <u>外幣</u> 保證金時，應以新臺幣或其他本公司公告之外幣繳交。	肆、盤中保證金追繳作業 一、作業時間為上午八時至下午六時十五分。 二、結算會員於本公司作業時間內由其電腦作業方式接收本公司盤中保證金追繳通知訊息時，應確認其被追繳金額，並於一小時內通知結算銀行，撥轉不少於該金額之現金結算保證金存入本公司結算保證金專戶。因逾結算銀行作業時間，結算會員無法於時限內繳交 <u>人民幣</u> 保證金時，應以新臺幣或其他本公司公告之外幣繳交。	配合「歐元兌美元匯率期貨契約」及「美元兌日圓匯率期貨契約」交易時間至下午四時十五分，因二契約之保證金幣別分別為美元及日圓，考量盤中保證金追繳，作業時點可能已逾銀行外幣匯款及結匯時限(下午三時三十分)，結算會員恐無法於時限內繳足美元或日圓保證金，結算會員應先以新臺幣或其他本公司公告之外幣繳交至本公司後，並於次一營業日上午十時前將美元或日圓追繳款項匯入本公司。爰修正本點，將人民幣修正為外幣，以包含美元及日圓之保證金追繳作法。
三、(略)	三、(略)	

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
陸、到期交割作業	陸、到期交割作業	配合「歐元兌美元匯率期貨契約」及「美元兌日圓匯率期貨契約」之最後結算價採最後交易日台北時間下午二時WM/Reuters之歐元兌美元及美元兌日圓之即期匯率中價，爰增訂二契約到期交割作業時間為最後結算日下午二時三十分至下午五時止，並區分美元兌人民幣匯率期貨契約及小型美元兌人民幣匯率期貨契約之到期交割作業時間，爰調整本點第八款之規定。
一、(略)	一、(略)	
二、(略)	二、(略)	
三、(略)	三、(略)	
四、(略)	四、(略)	
五、(略)	五、(略)	
六、(略)	六、(略)	
七、(略)	七、(略)	
八、匯率類期貨契約	八、匯率類期貨契約	
(一)作業時間為最後結算日 <u>下列時段：</u> 1. <u>美元兌人民幣匯率期貨契約及小型美元兌人民幣匯率期貨契約：上午十一時三十分至下午五時止。</u> 2. <u>歐元兌美元匯率期貨契約及美元兌日圓匯率期貨契約：下午二時三十分至下午五時止。</u>	(一)作業時間為最後結算日 上午十一時三十分至下午五時止。	
(二)結算會員於最後交易日收盤後，若有交割月份之未了結部位，本公司於最後結算日之作業時間內，以最後結算價進行到期部位交割作業，	(二)結算會員於最後交易日收盤後，若有交割月份之未了結部位，本公司於最後結算日之作業時間內，以最後結算價進行到期部位交割作業，	

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
其間損益金額併入當日盤中結算保證金計算。 九、(略)	其間損益金額併入當日盤中結算保證金計算。 九、(略)	
柒、盤後保證金追繳作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為下午三時三十分前；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間為下午五時三十分前；期貨交易契約為下午六時十五分收盤者，作業時間為下午七時三十分前。 二、結算會員於本公司完成部位結帳作業後，由其電腦作業方式查詢其於本公司之結算保證金權益，若其結算保證金權益低於應有之結算保證金，則應於本公司作業時間內，將差額存入結算會員於結算銀行之結算保證金專戶(自營或客戶)，由本公司結算部	柒、盤後保證金追繳作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為下午三時三十分前；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間為下午五時三十分前；期貨交易契約為下午六時十五分收盤者，作業時間為下午七時三十分前。 二、結算會員於本公司完成部位結帳作業後，由其電腦作業方式查詢其於本公司之結算保證金權益，若其結算保證金權益低於應有之結算保證金，則應於本公司作業時間內，將差額存入結算會員於結算銀行之結算保證金專戶(自營或客戶)，由本公司結算部	配合新增「歐元兌美元匯率期貨契約」及「美元兌日圓匯率期貨契約」，因二契約之保證金幣別分別為美元及日圓，考量盤後保證金追繳，作業時點已逾銀行外幣匯款及結匯時限(下午三時三十分)，結算會員恐無法於時限內繳足美元或日圓保證金，結算會員應先以新臺幣或其他本公司公告之外幣繳交至本公司後，並於次一營業日上午十時前將美元或日圓追繳款項匯入本公司。爰修正本點，將人民幣修正為外幣，以包含美元及日圓之保證金追繳作法。

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>通知結算銀行撥轉入本公司結算保證金專戶。因逾結算銀行作業時間，結算會員無法於時限內繳交<u>外幣</u>保證金時，應以新臺幣或其他本公司公告之外幣繳交，並於次一營業日上午十時前將<u>外幣</u>追繳款項存入本公司結算保證金專戶。</p>	<p>通知結算銀行撥轉入本公司結算保證金專戶。因逾結算銀行作業時間，結算會員無法於時限內繳交人<u>民幣</u>保證金時，應以新臺幣或其他本公司公告之外幣繳交，並於次一營業日上午十時前將<u>人民幣</u>追繳款項存入本公司結算保證金專戶。</p>	

**臺灣期貨交易所股份有限公司「黃金期貨契約」規格
修正對照表**

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>保證金</p> <ul style="list-style-type: none"> ■ 期貨商向交易人收取之交易保證金及保證金追繳標準，不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金水準 ■ 本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數計算之 ■ 交易人應繳交之保證金得依其與期貨商之約定，以新臺幣<u>或其他本公司公告之外幣收付</u>，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理 	<p>保證金</p> <ul style="list-style-type: none"> ■ 期貨商向交易人收取之交易保證金及保證金追繳標準，不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金水準 ■ 本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數計算之 ■ 交易人應繳交之保證金得依其與期貨商之約定，以新臺幣收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理 	<p>配合本公司新增「美元兌日圓匯率期貨契約」，交易人保證金帳戶將新增日圓幣別，考量黃金期貨為美元計價商品，故交易人從事黃金期貨契約，除以新臺幣支應外，亦可以其他幣別支應之需求，爰修正黃金期貨契約規格有關保證金之部分。</p>

**臺灣期貨交易所股份有限公司「黃金期貨契約」交易規則
修正條文對照表**

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第十四條 期貨商受託買賣本契約，應於受託前按受託買賣之合計數量預先收足交易保證金，並自成交日起迄交割期限屆至前，按每日結算價逐日計算每一委託人持有部位之權益，合併計入委託人之保證金帳戶餘額。</p> <p>委託人保證金帳戶餘額低於維持保證金金額時，期貨商應即通知委託人於限期內以現金補繳其保證金帳戶餘額與其未了結部位所應繳交易保證金總額間之差額。委託人未於期限內補繳保證金者，期貨商得代為沖銷委託人之部位。</p> <p>前二項之交易保證金及維持保證金不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金標準。</p> <p>本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂</p>	<p>第十四條 期貨商受託買賣本契約，應於受託前按受託買賣之合計數量預先收足交易保證金，並自成交日起迄交割期限屆至前，按每日結算價逐日計算每一委託人持有部位之權益，合併計入委託人之保證金帳戶餘額。</p> <p>委託人保證金帳戶餘額低於維持保證金金額時，期貨商應即通知委託人於限期內以現金補繳其保證金帳戶餘額與其未了結部位所應繳交易保證金總額間之差額。委託人未於期限內補繳保證金者，期貨商得代為沖銷委託人之部位。</p> <p>前二項之交易保證金及維持保證金不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金標準。</p> <p>本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂</p>	<p>配合本公司新增「美元兌日圓匯率期貨契約」，交易人保證金帳戶將新增日圓幣別，考量黃金期貨為美元計價商品，故交易人從事黃金期貨契約，除以新臺幣支應外，亦可以其他幣別支應之需求，爰修正本條第五項，交易人得依其與期貨商之約定，以新臺幣或本公司公告之外幣收付，並由期貨商依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理結匯事宜。</p>

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>定之成數加成計算之。</p> <p>第一項及第二項之保證金，委託人得依其與期貨商之約定，以新臺幣<u>或其他本公司公告之外幣</u>收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理。</p>	<p>定之成數加成計算之。</p> <p>第一項及第二項之保證金，委託人得依其與期貨商之約定，以新臺幣收付，並由期貨商代為結匯為之，其結匯作業應依中央銀行「外匯收支或交易申報辦法」相關規定辦理。</p>	