

副本

## 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：張建民  
聯絡電話：(02)2369-5678分機253

100  
臺北市羅斯福路二段100號14樓

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國105年6月8日  
發文字號：台期結字第10503005490號  
速別：普通件  
密等及解密條件或保密期限：普通  
附件：增修訂條文對照表

主旨：公告本公司黃金類商品契約、「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」結算制度相關規章增修訂條文，詳如說明，請查照。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會105年5月19日金管證期字第1050015786號函及105年5月27日金管證期字第1050020848號函辦理。
- 二、配合本公司調整黃金類商品契約規格及推出「美元兌人民幣匯率選擇權契約」與「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰增訂「新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨作業要點」，以及修正「市場部位監視作業辦法」第5條與第6條、「新臺幣計價黃金期貨契約及黃金選擇權契約最後結算價決定作業要點」第2點、「結算服務費收費標準」第4條至第10條、「結算保證金收取方式及標準」第4條之4、第4條之8、第5條、第5條之1與第5條之2、「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第6點，相關增訂條文及修正條文對照表詳如附件，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、中華民國證券商業同業公會、中華民國期貨業商業同業公會、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、本公司網站、本公司各部門、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**  
**新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉為財團**  
**法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法**  
**所定之黃金現貨作業要點**

壹、訂定依據

本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第陸點。

貳、本公司新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨作業方式

一、預付現貨價款公布作業

(一)本公司預先於新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約最後交易日下午四時三十分前公布到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨之預付現貨價款。

(二)新臺幣計價黃金期貨契約依當日結算價為計算基礎，黃金選擇權契約依履約價為計算基礎。

二、期貨商、結算會員受理交易人申請契約到期轉黃金現貨作業

(一)作業時間為最後交易日下午四時三十分至五時三十分止。

(二)期貨商、結算會員應要求欲取得黃金現貨之買方交易人(新臺幣計價黃金期貨契約買方、黃金選擇權契約買權買方及賣權賣方)及欲出售預先持有登錄櫃檯買賣之黃金現貨之賣方交易人(新臺幣計價黃金期貨契約賣方、黃金選擇權契約買權賣方及賣權買方)於下午五時三十分前，向其辦理有關契約到期轉現貨之申請，並取得買方交易人應收登錄櫃檯買賣之黃金現貨交易帳戶明細資料及取得賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉明細。

(三)期貨商、結算會員應要求買方交易人依本公司公布之預付現貨價款，將價款撥入其客戶保證金專戶。

(四)期貨商、結算會員應要求賣方交易人將登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉至本公司開立於集保公司之專戶。

三、期貨商、結算會員申報交易人申請契約到期轉黃金現貨作業

(一)作業及查詢時間為最後交易日下午四時三十分至六時三十分止。

(二)期貨商、結算會員應於下午五時四十五分前，向本公司申報有關交易人契約到期轉黃金現貨之申請

1.期貨商、結算會員應向本公司申報買方交易人應收登錄櫃檯買賣之黃金現貨交易帳戶明細資料，以及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉明細。

2.期貨商、結算會員應將買方交易人於下午五時三十分前繳交之預付現貨價款撥入本公司指定之結算保證金專戶，倘價款未於下午五時四十五分前完成撥入及申報，買方交易人該契約到期轉黃金現貨申請無效。

3.期貨商、結算會員應要求賣方交易人將登錄櫃檯買賣之黃金現貨於下午五時三十分前撥轉至本公司開立於集保公司之專戶，倘未於下午五時四十五分前完成申報者，賣方交易人該契約到期轉黃金現貨申請無效。

(三)本公司於下午五時四十五分起，依期貨商、結算會員申報之交易人契約到期轉黃金現貨申請資料，產生買方交易人及賣方交易人契約到期轉黃金現貨申請無效名冊及申請成功名冊，並依買方交易人之預付價款及賣方交易人之撥轉黃金現貨資料，產生買方交易人預付現貨價款名冊及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉名冊。

(四)期貨商、結算會員應於買方交易人及賣方交易人契約到期轉黃金現貨申請無效名冊及申請成功名冊、買方交易人預付現貨價款名冊及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉名冊產生後，至下午六時三十分止，以電腦作

業方式查詢名冊並列印確認存檔。

#### 四、到期轉現貨名冊指派作業及計算到期轉現貨價款

(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時三十分至下午四時。

1.本公司於上午八時三十分起，依申請到期轉現貨部位較少之買方或賣方(倘申請到期轉現貨之買賣方部位相同，則依賣方)為主進行隨機指派作業，產生賣方交易人應付黃金現貨名冊、買方交易人應收黃金現貨名冊，並計算到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨之到期轉現貨價款(新臺幣計價黃金期貨契約依最後結算價為計算基礎，黃金選擇權契約依履約價為計算基礎)，產生買方交易人應付價款名冊、賣方交易人應收價款名冊。

2.對於未受指派之交易人，本公司產生未受指派買方交易人及未受指派賣方交易人名冊，本公司並返還賣方交易人已撥轉之登錄櫃檯買賣之黃金現貨，並產生未受指派賣方交易人黃金現貨返還名冊。

(二)期貨商、結算會員應於賣方交易人應付黃金現貨名冊、買方交易人應收黃金現貨名冊、買方交易人應付價款名冊、賣方交易人應收價款名冊、未受指派買方交易人及未受指派賣方交易人名冊、未受指派賣方交易人黃金現貨返還名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。

#### 五、價款收付作業

(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時四十分至下午四時止。

(二)本公司於上午八時四十分起，就新臺幣計價黃金期貨契約到期轉現貨價款與預付現貨價款之差額進行撥付。

(三)本公司完成新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約買方交易人應付到期轉現貨價款及賣方交易人應收到期轉現貨價款之收付作業，併入結算會員結算保證金權益數計算。

(四)倘有買方交易人無法提出現金款項辦理到期轉現貨價款之情事，其不足款項由結算會員代為支付。

(五)結算會員應至下午四時止，以電腦作業方式查詢其結算保證金權益數，並列印確認存檔。

#### 六、買方交易人應收黃金現貨撥轉作業

(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時四十分至下午四時止。

(二)本公司於辦理完成價款收付作業後，於上午八時四十分起，產生買方交易人應收黃金現貨撥轉名冊，並通知集保公司將本公司專戶內之登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉至買方交易人指定之交易帳戶。

(三)倘買方交易人其到期轉現貨價款由結算會員代為支付，結算會員應申報其為處理黃金現貨之交易帳戶，本公司通知集保公司將本公司專戶內之黃金現貨撥轉至結算會員申報之交易帳戶。

(四)期貨商、結算會員應於買方交易人應收黃金現貨撥轉名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。

# 臺灣期貨交易所股份有限公司

## 市場部位監視作業辦法修正條文對照表

修正條文	現行條文	說明
<p>第五條 本公司於執行市場監視時，依結算會員財務或未沖銷部位狀況訂定下列警示標準：</p> <p>一、調整後淨資本額佔未沖銷部位所需之結算保證金總額之比例如下：</p> <p style="text-align: center;">(以下略)</p> <p>二、未沖銷部位總額佔其市場部位總額之比例如下：</p> <p>(一)各股價指數類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(二)各股價指數類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(三)各股票類選擇權契約買權</p>	<p>第五條 本公司於執行市場監視時，依結算會員財務或未沖銷部位狀況訂定下列警示標準：</p> <p>一、調整後淨資本額佔未沖銷部位所需之結算保證金總額之比例如下：</p> <p style="text-align: center;">(以下略)</p> <p>二、未沖銷部位總額佔其市場部位總額之比例如下：</p> <p>(一)各股價指數類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(二)各股價指數類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(三)各股票類選擇權契約買權或</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，增訂本公司對結算會員匯率類選擇權契約未沖銷部位狀況之警示標準，爰增訂本條第一項第二款第九目規定。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(四)各利率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約： 各契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(六)黃金選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達一千八百口者，不在此限。</p>	<p>賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(四)各利率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約： 各契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(六)黃金選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達一千八百口者，不在此限。</p>	



修正條文	現行條文	說明
<p>(七)各股票期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(八)各匯率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p><u>(九)各匯率類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之十五。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達一千八百口者，不在此限。</u></p> <p>(以下略)</p>	<p>(七)各股票期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(八)各匯率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之十五。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(以下略)</p>	
<p>第六條 本公司於執行市場監視時，依結算會員財務或未沖銷部位狀況訂定下列限制標準：</p> <p>一、調整後淨資本額佔未沖銷部位所需之結算保證金總額之比例如下：</p> <p>(以下略)</p> <p>二、未沖銷部位總額佔其市場</p>	<p>第六條 本公司於執行市場監視時，依結算會員財務或未沖銷部位狀況訂定下列限制標準：</p> <p>一、調整後淨資本額佔未沖銷部位所需之結算保證金總額之比例如下：</p> <p>(以下略)</p> <p>二、未沖銷部位總額佔其市場</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，增訂本公司對結算會員匯率類選擇權契約未沖銷部位狀況之限制標準，爰增訂本條第一項第二款第九目規定。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>部位總額之比例如下：</p> <p>(一)各股價指數類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(二)各股價指數類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(三)各股票類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(四)各利率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此</p>	<p>部位總額之比例如下：</p> <p>(一)各股價指數類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(二)各股價指數類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達三千六百口者，不在此限。</p> <p>(三)各股票類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(四)各利率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>限。</p> <p>(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約：</p> <p>各契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(六)黃金選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(七)各股票期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(八)各匯率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p>	<p>限。</p> <p>(五)黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約：</p> <p>各契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(六)黃金選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(七)各股票期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達二萬口者，不在此限。</p> <p>(八)各匯率類期貨契約之未沖銷部位總額達其市場總部位之百分之二十。但結算會員未沖銷之部位總額未達一千八百口者，不在此限。</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>(九)各匯率類選擇權契約買權或賣權之賣方未沖銷部位達其市場未沖銷部位之百分之二十。但結算會員買權或賣權之賣方未沖銷部位，未達一千八百口者，不在此限。</p> <p>(以下略)</p>	<p>(以下略)</p>	

**臺灣期貨交易所股份有限公司新臺幣計價黃金期貨契約及  
黃金選擇權契約最後結算價決定作業要點修正條文對照表**

修正條文	現行條文	說 明
<p>壹、訂定依據</p> <p>本公司「新臺幣計價黃金期貨契約交易規則」第十二條及「黃金選擇權契約交易規則」第十六條。</p> <p>貳、本公司新臺幣計價黃金期貨契約及黃金選擇權契約之最後結算價決定方式</p> <p>一、以最後交易日 ICE Benchmark Administration Limited(IBA) 同一曆日所公布之 LBMA 黃金早盤價(LBMA Gold Price AM)，以及台北外匯經紀股份有限公司公布之上午十一時新臺幣對美元成交即期匯率為基礎，經過重量與成色之轉換後訂定之。其計算公式如下：</p> <p>(LBMA 黃金早盤價÷ 31.1035 × 3.75 × 0.9999 ÷ 0.995<sup>註</sup>) × <u>上午十一時新臺幣對美元成交即期</u></p>	<p>壹、訂定依據</p> <p>本公司「新臺幣計價黃金期貨契約交易規則」第十二條及「黃金選擇權契約交易規則」第十六條。</p> <p>貳、本公司新臺幣計價黃金期貨契約及黃金選擇權契約之最後結算價決定方式</p> <p>一、以最後交易日 ICE Benchmark Administration Limited(IBA) 同一曆日所公布之 LBMA 黃金早盤價(LBMA Gold Price AM)，以及台北外匯經紀股份有限公司公布之新臺幣對美元<u>銀行間成交之收盤匯率</u>為基礎，經過重量與成色之轉換後訂定之。其計算公式如下：</p> <p>(LBMA 黃金早盤價÷ 31.1035 × 3.75 × 0.9999 ÷ 0.995<sup>註</sup>) × <u>新臺幣對美元收盤匯率</u></p>	<p>一、為便利交易人進行美元匯率避險，參考金融機構以台北外匯經紀股份有限公司上午十一時新臺幣對美元之即期匯率為無本金交割遠期外匯(NDF, Non-Delivery Forward)清算匯率之作法，爰調整訂定最後結算價之換算匯率改以台北外匯經紀股份有限公司公布之上午十一時新臺幣對美元成交即期匯率為基礎。</p> <p>二、考量倘遇最後交易日，台北外匯經紀股份有限公司上午十一時新臺幣對美元成交即期匯率因故未公布時，為使最後結算價之計算可順利執行，爰增訂於該情況下將採同日上午十一時之後，最接近上午十一時之新臺幣對美元成交即期匯率為基礎計算之。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>匯率</p> <p><u>倘台北外匯經紀股份有限公司上午十一時新臺幣對美元成交即期匯率因故未公布，則採同日上午十一時之後，最接近上午十一時之新臺幣對美元成交即期匯率為基礎計算之。</u></p> <p><sup>11</sup> 1 金衡制盎司為 31.1035 公克，1 錢為 3.75 公克；LBMA 黃金價格(LBMA Gold Price)為成色千分之九九五之黃金價格，而本契約交易標的為千分之九九九點九之黃金。</p> <p>二、LBMA 黃金早盤價因故未能於本公司執行到期交割作業前產生時，以最後交易日收盤後 ICE Benchmark Administration Limited(IBA) 同一曆日所公布之 LBMA 黃金午盤價(LBMA Gold Price PM)為最後結算價。</p> <p>三、無法依前二款決定最後結算價或最後結算價顯</p>	<p><sup>11</sup> 1 金衡制盎司為 31.1035 公克，1 錢為 3.75 公克；LBMA 黃金價格(LBMA Gold Price)為成色千分之九九五之黃金價格，而本契約交易標的為千分之九九九點九之黃金。</p> <p>二、LBMA 黃金早盤價因故未能於本公司執行到期交割作業前產生時，以最後交易日收盤後 ICE Benchmark Administration Limited(IBA) 同一曆日所公布之 LBMA 黃金午盤價(LBMA Gold Price PM)為最後結算價。</p> <p>三、無法依前二款決定最後結算價或最後結算價顯</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>不合理時，本公司依序參酌紐約、芝加哥、東京及香港等主要黃金市場價格決定之。</p>	<p>不合理時，本公司依序參酌紐約、芝加哥、東京及香港等主要黃金市場價格決定之。</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
<p>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：</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</p>	<p>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：</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</p>	<p>一、配合黃金期貨縮小契約規模後，縮小後之規模與新臺幣計價黃金期貨契約相當，爰修訂第四條第一項第一款第五目規定，調整黃金期貨結算手續費與新臺幣計價黃金期貨相同，為新臺幣肆元整。</p> <p>二、配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第四條第一項第一款第七目規定。</p>



修正條文	原條文	說明
<p>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>(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。</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繳納新台幣肆元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣貳元整。</p> <p>(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。</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繳納新台幣玖點陸元</p>	<p>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>(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。</p> <p>(五)黃金期貨契約，<u>每一契約買賣雙方各繳納新臺幣玖點陸元整；</u>新臺幣計價黃金期貨契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣肆元整；黃金選擇權契約，每一契約買賣雙方各繳納新台幣貳元整。</p> <p>(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。</p> <p>(七)美元兌人民幣匯率期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣玖點陸元整；小型美元</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>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。</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繳納新台幣參點貳元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月成交契約數計算結算手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自各結算會員自有結算保證金專戶及客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>兌人民幣匯率期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣貳元整。</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繳納新台幣參點貳元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月成交契約數計算結算手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自各結算會員自有結算保證金專戶及客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	
<p>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：</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</p>	<p>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：</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</p>	<p>一、配合黃金期貨縮小契約規模後，縮小後之規模與新臺幣計價黃金期貨契約相當，爰修訂第五條第一項第一款第五目規定，調整黃金期貨交割手續費與新臺幣計價黃金期貨相同，為新臺幣肆元整。</p> <p>二、配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌</p>

修正條文	原條文	說明
<p>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。</p> <p>(二)臺灣證券交易所股價指數小型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>(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。</p> <p>(五)黃金期貨契約及新臺</p>	<p>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。</p> <p>(二)臺灣證券交易所股價指數小型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>(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。</p> <p>(五)黃金期貨契約，每一</p>	<p>人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第五條第一項第一款第七目規定。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>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。</p> <p>(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。</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。</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繳納新台幣參點貳元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月交割契約數計算交割手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自各結</p>	<p><u>契約買賣雙方各繳納新臺幣玖點陸元整；</u> 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。</p> <p>(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。</p> <p>(七)美元兌人民幣匯率期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣玖點陸元整；小型美元兌人民幣匯率期貨契約，每一契約買賣雙方各為新臺幣貳元整。</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繳納新台幣參點貳元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月交割契約數計算交割手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自各結</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>算會員自有結算保證金專戶及客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>算會員自有結算保證金專戶及客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	
<p>第六條 期貨商因錯帳而申請部位調整，其結算會員應依下列規定繳納部位調整手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨及選擇權契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆調整申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按部位調整契約總數計算部位調整手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>第六條 期貨商因錯帳而申請部位調整，其結算會員應依下列規定繳納部位調整手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆調整申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按部位調整契約總數計算部位調整手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第六條第一項第一款規定。</p>
<p>第七條 期貨商不具結算會員資格者，因變更</p>	<p>第七條 期貨商不具結算會員資格者，因變更</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小</p>

修正條文	原條文	說明
<p>結算會員而申請部位移轉，期貨商變更前之受託結算會員應依下列規定繳納部位移轉手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨及選擇權契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>結算會員而申請部位移轉，期貨商變更前之受託結算會員應依下列規定繳納部位移轉手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第七條第一項第一款規定。</p>
<p>第八條 期貨商不具結算會員資格者，遇有被結算會員了結部位，並受結算會員依相關規定所為之部位移轉時，期貨商之受託結</p>	<p>第八條 期貨商不具結算會員資格者，遇有被結算會員了結部位，並受結算會員依相關規定所為之部位移轉時，期貨商之受託結</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第八條第一項第一款規定。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>算會員應依下列規定繳納部位移轉手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨及選擇權契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>算會員應依下列規定繳納部位移轉手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	
<p>第九條 期貨商不具結算會員資格者，遇有破產、解散、停業或依法令應停止收受委託人訂單、並受本公司依相關規定所為之部位移轉時，期貨商之受託結算會員應依下列規定繳納部位移轉</p>	<p>第九條 期貨商不具結算會員資格者，遇有破產、解散、停業或依法令應停止收受委託人訂單、並受本公司依相關規定所為之部位移轉時，期貨商之受託結算會員應依下列規定繳納部位移轉</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第九條第一項第一款規定。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨及選擇權契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契約、匯率類期貨契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自受託結算會員客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	
<p>第十條 結算會員遇有破產、解散、停業、依法令應停止收受委託人訂單或不履行結算交割義務，並受本公司依相關規定所為之部位移轉時，應依下列規定繳納部位移轉手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契</p>	<p>第十條 結算會員遇有破產、解散、停業、依法令應停止收受委託人訂單或不履行結算交割義務，並受本公司依相關規定所為之部位移轉時，應依下列規定繳納部位移轉手續費：</p> <p>一、費率：股價指數期貨契約、利率類期貨契</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰修訂第十條第一項第一款規定。</p>



修正條文	原條文	說明
<p>約、匯率類期貨及選擇權契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自各繳費者自有結算保證金專戶及客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	<p>約、匯率類期貨契約、金屬商品類期貨及選擇權契約、股價指數期貨選擇權契約、股價指數選擇權契約、股票選擇權契約及股票期貨契約，每一筆移轉申請，收取新台幣貳拾伍元整。</p> <p>二、本公司每月底按當月移轉契約總數計算部位移轉手續費寄發帳單，於次月十日編製手續費款項劃撥轉帳資料交各結算銀行，並委託其將應繳款項自各繳費者自有結算保證金專戶及客戶結算保證金專戶撥轉入本公司銀行專戶。</p>	

**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>第四條之四 黃金期貨契約 結算保證金金額為黃金期貨價格乘以契約規模乘以風險價格係數。</p> <p>新臺幣計價黃金期貨契約 結算保證金金額為臺幣黃金期貨價格乘以契約規模乘以風險價格係數。</p> <p>前二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，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<u>拾元</u>為整數，<u>拾元</u>以下部分無條件進位至<u>拾元</u>；第二項收取標準以<u>千元</u>為整數，<u>千元</u>以下部分無條件進位至<u>千元</u>。</p>	<p>第四條之四 黃金期貨契約 結算保證金金額為黃金期貨價格乘以契約規模乘以風險價格係數。</p> <p>新臺幣計價黃金期貨契約 結算保證金金額為臺幣黃金期貨價格乘以契約規模乘以風險價格係數。</p> <p>前二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，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<u>百元</u>為整數，<u>百元</u>以下部分無條件進位至<u>百元</u>；第二項收取標準以<u>千元</u>為整數，<u>千元</u>以下部分無條件進位至<u>千元</u>。</p>	<p>配合黃金期貨契約規格由 100 盎司縮小為 10 盎司，考量契約規格縮小後，保證金收取金額相對降低，倘結算保證金收取標準維持現行進位至百元，將提高結算保證金占契約價值之比率，爰將黃金期貨之結算保證金收取標準由以百元為整數，調整為以拾元為整數，拾元以下部分無條件進位至拾元。</p>
<p><u>第四條之八 匯率類選擇權契約之結算保證金之計算，除權利金外，其風險價格係數係參考一段期間內標的匯率價格波動及其他可能因素，估算至少可涵蓋一日權利金變動幅度百分之九十九信賴區間之值。</u></p>	<p>新增條文</p>	<p>一、本條增訂 二、配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，增訂匯率類選擇權契約結算保證金計算方式之規範。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>其計算方式，由本公司另訂之。</p>		
<p>第五條 股價指數類期貨契約、利率類期貨契約、黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約依第四條、第四條之三及第四條之四規定經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之十以上者，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，並依第四條第三項、第四條之三第三項及第四條之四第四項規定進位。</p> <p>股價指數類選擇權契約依第四條之一規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的股價指數乘以指數每點價值乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，新臺幣報價之契約以千元為整數，千元以下部分無條件進位；美元報價之契約以百元為整數，百元以下部分無條件進位。</p>	<p>第五條 股價指數類期貨契約、利率類期貨契約、黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約依第四條、第四條之三及第四條之四規定經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之十以上者，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，並依第四條第三項、第四條之三第三項及第四條之四第四項規定進位。</p> <p>股價指數類選擇權契約依第四條之一規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的股價指數乘以指數每點價值乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，新臺幣報價之契約以千元為整數，千元以下部分無條件進位；美元報價之契約以百元為整數，百元以下部分無條件進位。</p>	<p>一、配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，爰增訂本條第八項有關匯率選擇權契約之結算保證金調整規定。</p> <p>二、考量人民幣波動度較為平緩，且匯率類期貨交易契約可能因貨幣政策、政經情勢或金融事件等因素影響匯率價格波動，有關人民幣匯率選擇權結算保證金之調整標準，規劃參照現行人民幣匯率期貨，於保證金變動幅度達百分之五以上時，其結算保證金之收取得調整之。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>小型臺指期貨契約之結算保證金，於臺股期貨契約之結算保證金調整時調整之，其調整收取金額，依第四條第四項之規定辦理，不適用第一項之規定。</p> <p>黃金選擇權契約依第四條之五規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的黃金價格乘以契約規模乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位。</p> <p>標的證券為受益憑證之股票期貨契約依第四條之六規定經每日計算之結算保證金金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位。</p> <p>標的證券為受益憑證之股票選擇權契約依第四條之二規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的證券價格乘</p>	<p>小型臺指期貨契約之結算保證金，於臺股期貨契約之結算保證金調整時調整之，其調整收取金額，依第四條第四項之規定辦理，不適用第一項之規定。</p> <p>黃金選擇權契約依第四條之五規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的黃金價格乘以契約規模乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位。</p> <p>標的證券為受益憑證之股票期貨契約依第四條之六規定經每日計算之結算保證金金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位。</p> <p>標的證券為受益憑證之股票選擇權契約依第四條之二規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的證券價格乘</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>以履約價格乘數乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位。</p> <p>匯率類期貨契約依第四條之七規定經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之五以上者，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，並依第四條之七第三項規定進位。</p> <p><u>匯率類選擇權契約依第四條之八規定之結算保證金，除權利金外，所計算之標的匯率價格乘以契約規模乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之五以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以百元為整數，百元以下部分無條件進位。</u></p> <p>本公司依本條規定所為之結算保證金調整，於公告日之次一營業日交易時段結束後起實施。</p>	<p>以履約價格乘數乘以風險價格係數之金額，其變動幅度達百分之十以上或視市場狀況於必要時得調整之，其收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位。</p> <p>匯率類期貨契約依第四條之七規定經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之五以上者，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，並依第四條之七第三項規定進位。</p> <p>本公司依本條規定所為之結算保證金調整，於公告日之次一營業日交易時段結束後起實施。</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>第五條之一 各契約之結算保證金因契約規格修正而須調整時，本公司得依第四條至第四條之八規定重新訂定之，並於契約規格修正生效日起實施。</p>	<p>第五條之一 各契約之結算保證金因契約規格修正而須調整時，本公司得依第四條至第四條之七規定重新訂定之，並於契約規格修正生效日起實施。</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，增訂匯率類選擇權契約因契約規格修正而須結算保證金調整之規範，爰修正本條規定。</p>
<p>第五條之二 本公司對結算會員依整戶風險保證金計收方式收取應有保證金，其相關參數之訂定及調整依下列規定：</p> <p>一、價格偵測全距</p> <p>價格偵測全距係衡量各期貨及選擇權契約在一特定信賴區間內，次一交易日最大可能之價格變動風險。各契約之價格偵測全距訂定方式如下：</p> <p>(一)各期貨契約：</p> <p>各期貨契約之價格偵測全距依本標準各期貨契約結算保證金計算方式訂定之。</p> <p>(二)股價指數類選擇權契約：</p> <p>依其同標的指數之期貨契約價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。</p> <p>(三)股票選擇權契約：</p> <p>依其同標的證券之期貨契約</p>	<p>第五條之二 本公司對結算會員依整戶風險保證金計收方式收取應有保證金，其相關參數之訂定及調整依下列規定：</p> <p>一、價格偵測全距</p> <p>價格偵測全距係衡量各期貨及選擇權契約在一特定信賴區間內，次一交易日最大可能之價格變動風險。各契約之價格偵測全距訂定方式如下：</p> <p>(一)各期貨契約：</p> <p>各期貨契約之價格偵測全距依本標準各期貨契約結算保證金計算方式訂定之。</p> <p>(二)股價指數類選擇權契約：</p> <p>依其同標的指數之期貨契約價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。</p> <p>(三)股票選擇權契約：</p> <p>依其同標的證券之期貨契約</p>	<p>配合新增「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」，增訂整戶風險保證金計收方式相關參數之訂定及調整，爰修正本條規定。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。未有相同標的證券之期貨契約時，依其結算保證金之風險保證金(標的證券為股票者，A 值=標的證券價格×a%×標的證券之股數；標的證券為受益憑證者，A 值=標的證券價格×標的證券受益權單位數×風險價格係數)訂定之。</p> <p>各契約價格偵測全距之調整，準用各契約保證金調整方式。</p> <p>(四)黃金選擇權契約： 依其同標的黃金之期貨契約價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。</p> <p>(五) 匯率類選擇權契約： 依其同標的匯率之期貨契約價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。</p> <p>二、極端變動倍數及極端涵蓋百分比</p> <p>極端變動倍數係衡量在市場劇烈變動狀況下，各契約標的資產價格變動相對於價格偵測全距之倍數。</p>	<p>價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。未有相同標的證券之期貨契約時，依其結算保證金之風險保證金(標的證券為股票者，A 值=標的證券價格×a%×標的證券之股數；標的證券為受益憑證者，A 值=標的證券價格×標的證券受益權單位數×風險價格係數)訂定之。</p> <p>各契約價格偵測全距之調整，準用各契約保證金調整方式。</p> <p>(四)黃金選擇權契約： 依其同標的黃金之期貨契約價格偵測全距乘上契約價值比例訂定之。</p> <p>二、極端變動倍數及極端涵蓋百分比</p> <p>極端變動倍數係衡量在市場劇烈變動狀況下，各契約標的資產價格變動相對於價格偵測全距之倍數。</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>極端涵蓋百分比係衡量在市場劇烈變動狀況下，應有保證金可涵蓋之損失比例。</p> <p>(一)極端變動倍數：3</p> <p>(二)極端涵蓋百分比：32%</p> <p>    本二項參數之調整由本公司另訂之。</p> <p>三、波動度偵測全距</p> <p>依一段時間內各選擇權契約之標的(股價指數類選擇權為其標的指數，股票選擇權為其標的證券，黃金選擇權為其標的黃金，匯率類選擇權為其標的匯率)波動度變動幅度及其他相關因素，估算至少可涵蓋一日價格變動幅度百分之九十九點七信賴區間之值。其計算方式由本公司另訂之。</p> <p>本參數經本公司每日計算之數值相較於現行數值變動幅度達10%時，本公司得調整之。</p> <p>(以下略)</p>	<p>極端涵蓋百分比係衡量在市場劇烈變動狀況下，應有保證金可涵蓋之損失比例。</p> <p>(一)極端變動倍數：3</p> <p>(二)極端涵蓋百分比：32%</p> <p>    本二項參數之調整由本公司另訂之。</p> <p>三、波動度偵測全距</p> <p>依一段時間內各選擇權契約之標的(股價指數類選擇權為其標的指數，股票選擇權為其標的證券，黃金選擇權為其標的黃金)波動度變動幅度及其他相關因素，估算至少可涵蓋一日價格變動幅度百分之九十九點七信賴區間之值。其計算方式由本公司另訂之。</p> <p>本參數經本公司每日計算之數值相較於現行數值變動幅度達10%時，本公司得調整之。</p> <p>(以下略)</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  
交割作業要點修正草案條文對照表**

修正條文	現行條文	說明
<p>陸、到期交割作業</p> <p>一、(略)</p> <p>二、(略)</p> <p>三、(略)</p> <p>四、(略)</p> <p>五、黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約</p> <p style="text-align: center;"><u>除另有規定得申請將期貨部位轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨外，本契約到期交割作業依下列方式辦理：</u></p> <p>(一)作業時間為最後結算日上午九時三十分。</p> <p>(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</p>	<p>陸、到期交割作業</p> <p>一、(略)</p> <p>二、(略)</p> <p>三、(略)</p> <p>四、(略)</p> <p>五、黃金期貨契約及新臺幣計價黃金期貨契約</p> <p>(一)作業時間為最後結算日上午九時三十分。</p> <p>(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</p>	<p>配合新臺幣計價黃金期貨契約得於到期申請轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨作業機制，爰修正本條文。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>價進行到期部位交割作業，其間損益金額併入當日盤中結算保證金計算。</p> <p>六、黃金選擇權契約</p> <p><u>除另有規定得申請將選擇權部位轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨外，本契約到期交割作業依下列方式辦理：</u></p> <p>(一)買方履約名冊查詢作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午九時三十分至下午四時止。</p> <p>2.本公司於上午九時三十分執行登錄最後結算價作業，產生買方履約參考名冊。</p> <p>3.期貨商得於買方履約參考名</p>	<p>價進行到期部位交割作業，其間損益金額併入當日盤中結算保證金計算。</p> <p>六、黃金選擇權契約</p> <p>(一)買方履約名冊查詢作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午九時三十分至下午四時止。</p> <p>2.本公司於上午九時三十分執行登錄最後結算價作業，產生買方履約參考名冊。</p> <p>3.期貨商得於買方履約參考名</p>	<p>配合黃金選擇權契約得於到期申請轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨作業機制，爰修正本條文。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>冊產生後，至上午十一時止，以電腦作業方式查詢其買方履約參考名冊。</p> <p>4.期貨商於上午十一時買方履約正式名冊產生後，至下午四時止，應以電腦作業方式查詢該名冊並列印確認存檔。</p> <p>(二)買方履約參考名冊登錄及刪除作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午九時三十分至十一時止。</p> <p>2.本公司於本作業時段，提供期貨商進行買方履約參考名冊交易人資料之增刪作業。</p> <p>3.期貨商得於本作業時間內，依交易人之指</p>	<p>冊產生後，至上午十一時止，以電腦作業方式查詢其買方履約參考名冊。</p> <p>4.期貨商於上午十一時買方履約正式名冊產生後，至下午四時止，應以電腦作業方式查詢該名冊並列印確認存檔。</p> <p>(二)買方履約參考名冊登錄及刪除作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午九時三十分至十一時止。</p> <p>2.本公司於本作業時段，提供期貨商進行買方履約參考名冊交易人資料之增刪作業。</p> <p>3.期貨商得於本作業時間內，依交易人之指</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>示，經由電腦作業方式增刪買方履約參考名冊。</p> <p>(三)賣方履約指派名冊查詢作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午十一時至下午四時止。</p> <p>2.本公司於上午十一時執行賣方履約指派作業，採隨機方式產生選擇權賣方履約指派名冊。</p> <p>3.期貨商於賣方履約指派名冊產生後，至下午四時止，應以電腦作業方式查詢該名冊並列印確認存檔。</p> <p>(四)到期履約交割作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午十一時至十一時三十分</p>	<p>示，經由電腦作業方式增刪買方履約參考名冊。</p> <p>(三)賣方履約指派名冊查詢作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午十一時至下午四時止。</p> <p>2.本公司於上午十一時執行賣方履約指派作業，採隨機方式產生選擇權賣方履約指派名冊。</p> <p>3.期貨商於賣方履約指派名冊產生後，至下午四時止，應以電腦作業方式查詢該名冊並列印確認存檔。</p> <p>(四)到期履約交割作業</p> <p>1.本公司作業時間為到期日上午十一時至十一時三十分</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>止。</p> <p>2.本公司於本作業時段，依據買方履約正式名冊，以最後結算價進行到期履約交割作業，選擇權履約損益金額併入結算會員當日盤中結算保證金計算。</p> <p>3.結算會員得於本公司部位結帳後，經由電腦作業方式查詢其結算保證金餘額。</p>	<p>止。</p> <p>2.本公司於本作業時段，依據買方履約正式名冊，以最後結算價進行到期履約交割作業，選擇權履約損益金額併入結算會員當日盤中結算保證金計算。</p> <p>3.結算會員得於本公司部位結帳後，經由電腦作業方式查詢其結算保證金餘額。</p>	
<p>七、(略)</p>	<p>七、(略)</p>	
<p>八、(略)</p>	<p>八、(略)</p>	
<p><u>九、匯率類選擇權契約</u></p> <p>(一) <u>買方履約名冊查詢作業</u></p> <p>1. <u>本公司作業時間為到期日上午十一時三十分至下午五時止。</u></p> <p>2. <u>本公司於上午十</u></p>		<p>配合「美元兌人民幣匯率選擇權契約」及「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」之到期交割時間為最後結算日上午十一時三十分至下午五時止，作業方式同指數選擇權契約，爰增訂本點第九款規定。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p><u>一時三十分執行登錄最後結算價作業，產生買方履約參考名冊。</u></p> <p>3. <u>期貨商得於買方履約參考名冊產生後，至中午十二時三十分止，以電腦作業方式查詢其買方履約參考名冊。</u></p> <p>4. <u>期貨商於中午十二時三十分買方履約正式名冊產生後，至下午五時止，應以電腦作業方式查詢該名冊並列印確認存檔。</u></p> <p>(二) <u>買方履約參考名冊登錄及刪除作業</u></p> <p>1. <u>本公司作業時間為到期日上午十一時三十分至中午十二時三十分止。</u></p>		

修正條文	現行條文	說明
<p>2. <u>本公司於本作業時段，提供期貨商進行買方履約參考名冊交易人資料之增刪作業。</u></p> <p>3. <u>期貨商得於本作業時間內，依交易人之指示，經由電腦作業方式增刪買方履約參考名冊。</u></p>		
<p>(三) <u>賣方履約指派名冊查詢作業</u></p> <p>1. <u>本公司作業時間為到期日中午十二時三十分至下午五時止。</u></p> <p>2. <u>本公司於中午十二時三十分執行賣方履約指派作業，採隨機方式產生選擇權賣方履約指派名冊。</u></p> <p>3. <u>期貨商於賣方履約指派名冊產生</u></p>		

修正條文	現行條文	說明
<p>後，至下午五時止，應以電腦作業方式查詢該名冊並列印確認存檔。</p> <p>(四) <u>到期履約交割作業</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. <u>本公司作業時間為到期日中午十二時三十分至下午五時止。</u></li> <li>2. <u>本公司於本作業時段，依據買方履約正式名冊，以最後結算價進行到期履約交割作業，選擇權履約損益金額併入結算會員當日盤中結算保證金計算。</u></li> <li>3. <u>結算會員得於本公司部位結帳後，經由電腦作業方式查詢其結算保證金餘額。</u></li> </ol>		