


# 配合現貨市場調整股價類契約最後結 算價計算方式之價格取樣頻率



臺灣期貨交易所  
103年3月

# 緣由

- 證交所及櫃買中心自103年2月24日起，調整盤中撮合循環秒數及各類指數揭示頻率，由15秒調整為10秒
- 因應證交所及櫃買中心調整盤中撮合循環秒數及各類指數揭示頻率，期交所調整股價指數類及股票類契約最後結算價計算之價格取樣頻率為10秒，並自103年2月24日起實施

# 最後結算價計算方式之價格取樣頻率調整 -股價指數類契約

- 股價指數類契約：包含臺股期貨契約、電子期貨契約、金融期貨契約、小型臺指期貨契約、櫃買期貨契約、非金電期貨契約、臺灣50指數期貨契約、臺指選擇權契約、電子選擇權契約、金融選擇權契約、櫃買選擇權契約、非金電選擇權契約

	取樣頻率調整前(15秒)	取樣頻率調整後(10秒)
最後結算日	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ 月到期契約 各契約交割月份第三個星期三</li> <li>■ 週到期契約 掛牌日之次一個星期三</li> </ul>	同左
最後結算價取樣時段	證交所及櫃買中心當日交易時間收盤前30分鐘	同左
最後結算價取樣頻率	標的指數於交易時段13:00(不含)至13:25(含)每15秒揭示之指數，加計最後一筆收盤指數	標的指數於交易時段13:00(不含)至13:25(含)每 <u>次(10秒)</u> 揭示之指數，加計最後一筆收盤指數
最後結算價取樣筆數	101筆	<u>151筆</u>
最後結算價計算方式	簡單算術平均價並取至最接近各期貨契約報價最小升降單位整數倍之數值	同左

# 最後結算價計算方式之價格取樣頻率調整 -股票類契約

- 股票類契約：包含股票期貨契約(231檔)及股票選擇權契約(40檔)

	取樣頻率調整前(15秒)	取樣頻率調整後(10秒)
最後結算日	各契約交割月份第三個星期三	同左
最後結算價取樣時段	證券市場當日交易時間收盤前60分鐘	同左
最後結算價取樣頻率	證交所每15秒揭示發行量加權股價指數(交易時段12:30(不含)至13:25(含)，加計最後一筆收盤指數)，所納入成分股計算之標的證券價格	證交所或櫃買中心每次(10秒)揭示發行量加權股價指數(交易時段12:30(不含)至13:25(含)，加計最後一筆收盤指數)，所納入成分股計算之標的證券價格
最後結算價取樣筆數	221筆	331筆
最後結算價計算方式	採簡單算術平均計算，並取四捨五入至小數第二位之數值	同左



臺灣期貨交易所

TAIWAN FUTURES EXCHANGE

簡報完畢  
敬請指教

[www.taifex.com.tw](http://www.taifex.com.tw)