

# 臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：黃小姐

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3279

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國112年11月21日

發文字號：台期交字第1120202296號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：公告本公司「美國費城半導體股價指數期貨契約」112年12月18日上市有關事項。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會112年10月2日金管證期字第1120355401號函、112年11月15日金管證期字第1120360447號函、本公司業務規則第29條及動態價格穩定措施作業辦法第9條第2項辦理。
- 二、本公司112年10月5日台期交字第1120201997號函、112年10月16日台期結字第1120301937號函及台期結字第11203019371號函實施日期為112年12月18日。
- 三、旨揭契約訂於112年12月18日上市，上市契約到期交割月份為113年3月、6月、9月及12月。
- 四、旨揭契約交易人部位限制數為：自然人1,000個契約，法人3,000個契約，期貨自營商/造市者9,000個契約。
- 五、旨揭契約一定範圍市價委託之一定點數計算方式詳附件1。
- 六、旨揭契約納入鉅額交易適用商品。
- 七、旨揭契約動態價格穩定措施之退單點數基準值及退單百分比詳附件2，倘交易人新進買賣申報因動態價格穩定措施被退回時，期貨商應告知交易人退單訊息及退單上限價格或下限價格，俾利交易人瞭解退單原因及即時掌握委託狀況。
- 八、保證金於上市前另行公告。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、保管銀行、行情資訊廠商、前後台資訊廠商

副本：金融監督管理委員會、金融監督管理委員會證券期貨局、財政部賦稅署、財團法人證券投資人及期貨交易人保護中心、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、中華民國銀行商業同業公會全國聯合會、中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會、中華民國人壽保險商業同業公會、中華民國產物保險商業同業公會、台北國際金融資訊協會、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、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(均含附件)

總經理 周建隆

# 臺灣期貨交易所

## 一般交易時段

### 「一定範圍市價委託」加減「一定點數」之計算方式

A

各商品、各委託種類加減一定點數之計算方式如下表<sup>註1</sup>：

類別	商品		一定點數之計算方式			
			單式委託	期貨時間價差委託		
指數期貨	TX	臺股期貨	± 前一日標的收盤指數 0.5%	± 前一日標的收盤指數 0.25%		
	MTX	小型臺指期貨				
	XIF	非金電期貨				
	TE	電子期貨				
	ZEF	小型電子期貨				
	TF	金融期貨				
	ZFF	小型金融期貨				
	GTF	櫃買期貨				
	G2F	富櫃 200 期貨				
	E4F	臺灣永續期貨				
	BTF	臺灣生技期貨				
	SOF	半導體 30 期貨				
	SHF	航運期貨				
	TJF	東證期貨			± 前一日期貨最近月契約結算價 0.5%	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.25%
	UDF	美國道瓊期貨				
	SPF	美國標普 500 期貨				
UNF	美國那斯達克 100 期貨					
SXF	美國費城半導體期貨					
F1F	英國富時 100 期貨					
黃金期貨	GDF	黃金期貨	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.5%	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.25%		
	TGF	臺幣黃金期貨				
原油期貨	BRF	布蘭特原油期貨	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.5%	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.25%		
匯率期貨	RHF	美元兌人民幣期貨	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.1% <sup>註2</sup>	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.05% <sup>註2</sup>		
	RTF	小型美元兌人民幣期貨				
	XEF	歐元兌美元期貨	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.5% <sup>註2</sup>	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.25% <sup>註2</sup>		
	XJF	美元兌日圓期貨				
	XBF	英鎊兌美元期貨				
	XAF	澳幣兌美元期貨				
指數選擇權	TXO	臺指選擇權	± 前一日標的收盤指數 0.2%			
	TEO	電子選擇權				
	TFO	金融選擇權				

類別	商品		一定點數之計算方式	
			單式委託	期貨時間價差委託
黃金 選擇權	TGO	黃金選擇權	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.2%	
股票類	STF	股票期貨	± 當日期貨最近月契約開盤參考價 1%	± 當日期貨最近月契約開盤參考價 0.5%
	STO	股票選擇權	± 當日標的證券開盤參考價 1%	

註1：倘若該等委託之買單(或賣單)於加上(或減去)一定範圍之點數後，不符合最小跳動點，則買單無條件進位(或賣單無條件捨去)至符合最小跳動點之單位。另若該等委託於加上(或減去)一定範圍之點數後，買單(或賣單)轉換後之價格超過漲停價(或低於跌停價)，則改以漲停價(或跌停價)作為該買單(或賣單)之限定價格。一定範圍市價委託之一定點數計算方式，得視市場狀況調整之。

註2：若前一日(前一一般交易時段)遇最後交易日，則採取前一日(前一一般交易時段)次近月期貨每日結算價。

# 臺灣期貨交易所

## 盤後交易時段

### 「一定範圍市價委託」加減「一定點數」之計算方式

各商品、各委託種類加減一定點數之計算方式如下表<sup>註1</sup>：

類別	商品		一定點數之計算方式	
			單式委託	期貨時間價差委託
指數 期貨	TX	臺股期貨	± 最近之標的收盤指數 0.5%	±最近之標的收盤指數 0.25%
	MTX	小型臺指期貨		
	TE	電子期貨		
	ZEF	小型電子期貨		
	SOF	半導體 30 期貨	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5%	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.25%
	UDF	美國道瓊期貨		
	SPF	美國標普 500 期貨		
	UNF	美國那斯達克 100 期貨		
	SXF	美國費城半導體期貨		
FIF	英國富時 100 期貨			
指數 選擇權	TXO	臺指選擇權	± 最近之標的收盤指數 0.2%	
匯率 期貨	RHF	美元兌人民幣期貨	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.1% <sup>註2</sup>	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.05% <sup>註2</sup>
	RTF	小型美元兌人民幣期貨		
	XEF	歐元兌美元期貨	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5% <sup>註2</sup>	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.25% <sup>註2</sup>
	XJF	美元兌日圓期貨		
	XBF	英鎊兌美元期貨		
XAF	澳幣兌美元期貨			
黃金 期貨	GDF	黃金期貨	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5%	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.25%
	TGF	臺幣黃金期貨		
黃金 選擇權	TGO	黃金選擇權	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.2%	

類別	商品		一定點數之計算方式	
			單式委託	期貨時間價差委託
原油期貨	BRF	布蘭特原油期貨	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5%	± 前一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.25%
股票類	STF	股票期貨	± 當盤期貨最近月契約開盤參考價 1%	± 當盤期貨最近月契約開盤參考價 0.5%

註1：倘若該等委託之買單(或賣單)於加上(或減去)一定範圍之點數後，不符合最小跳動點，則買單無條件進位(或賣單無條件捨去)至符合最小跳動點之單位。另若該等委託於加上(或減去)一定範圍之點數後，買單(或賣單)轉換後之價格超過漲停價(或低於跌停價)，則改以漲停價(或跌停價)作為該買單(或賣單)之限定價格。一定範圍市價委託之一定點數計算方式，得視市場狀況調整之。

註2：若前一日(前一般交易時段)遇最後交易日，則採取前一日(前一般交易時段)次近月期貨每日結算價。

## 動態價格穩定措施適用商品退單點數基準值及退單百分比-期貨

A  
2

類別	商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比	組合式買賣申報退單百分比
國內股價指數期貨	臺股期貨	最近月、次近月	最近標的指數收盤價	1%	1%
		第3近月、第1季月、第2季月、第3季月	最近標的指數收盤價	2%	1%
	小型臺指期貨	最近月、次近月	最近標的指數收盤價	1%	1%
		週到期、第3近月、第1季月、第2季月、第3季月	最近標的指數收盤價	2%	1%
	電子期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	小型電子期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	金融期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	小型金融期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	非金電期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	櫃買期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	富櫃200期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	臺灣永續期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	2%	1%
	臺灣生技期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	3%	1.5%
	半導體30期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	3%	1.5%
	航運期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	3%	1.5%
國外股價指數期貨	美國道瓊期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	美國標普500期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	美國那斯達克100期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%

類別	商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比	組合式買賣申報退單百分比
	英國富時100期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	東證期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	美國費城半導體期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	3%	1.5%
股票期貨	個股期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	7% (本公司開盤起，至收到標的證券當市開盤揭示資料以前)  3.5% (本公司收到標的證券當市開盤揭示資料後)	同左
	元大台灣50ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%	2%
	元大高股息ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%	2%
	國泰永續高股息ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%	2%
	群益台ESG低碳50ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%	2%
	富邦上証ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%	3.5%
	元大上証50ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%	3.5%
	國泰中國A50ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%	3.5%
	富邦深100ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%	3.5%
	群益深証中小ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%	3.5%
	富邦越南ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%	3.5%



類別	商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比	組合式買賣申報退單百分比
匯率期貨	小型美元兌人民幣期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	美元兌人民幣期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	歐元兌美元期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	美元兌日圓期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	英鎊兌美元期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
	澳幣兌美元期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	1%
商品類期貨	黃金期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	2%
	臺幣黃金期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%	2%
	布蘭特原油期貨	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	3%	3%

## 動態價格穩定措施適用商品退單點數基準值及退單百分比-選擇權

類別	商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比
國內股價 指數選擇權	臺指選擇權	週到期與最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2%×Delta 絕對值×2。 Delta 絕對值未達0.25者，視為0.25；Delta 絕對值逾0.5者，視為0.5。
		次近月、第3近月、第1季月、第2季月	最近標的指數收盤價	2%
	電子選擇權	最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2%×Delta 絕對值×2。 Delta 絕對值未達0.25者，視為0.25；Delta 絕對值逾0.5者，視為0.5。
		次近月與第3近月	最近標的指數收盤價	2%
	金融選擇權	最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2%×Delta 絕對值×2。 Delta 絕對值未達0.25者，視為0.25；Delta 絕對值逾0.5者，視為0.5。
		次近月與第3近月	最近標的指數收盤價	2%

類別	商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比
股票選擇權	個股選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%
	元大台灣50ETF選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%
	富邦上證ETF選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%
	元大上證50ETF選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%
	國泰中國 A50ETF選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%
	富邦深100ETF選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%
	群益深証中小ETF選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	3.5%
商品選擇權	黃金選擇權	所有到期月份	期貨最近到期契約最近之每日結算價	2%