

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：張先生
聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3265

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國113年7月8日
發文字號：台期交字第1130201393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「臺灣證券交易所股價指數微型期貨契約」113年7月29日上市有關事項。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會113年7月2日金管證期字第1130348444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113年6月25日台期交字第1130201142號、113年6月27日台期結字第1130301206號及台期結字第11303012061號函實施日期為113年7月29日。
- 三、旨揭契約訂於113年7月29日上市，上市契約到期交割月份為113年8月、9月、10月、12月、114年3月及6月。
- 四、旨揭契約之交易人部位限制數，依20口微型臺指期貨契約等於1口臺股期貨契約合併計算。
- 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、行情資訊廠商、保管銀行、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

各商品、各委託種類加減一定點數之計算方式如下表^{註1}：

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		
	TMF	微型臺指期貨		
	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		
	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% ^{註2}	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.05% ^{註2}
	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% ^{註2}	± 前一日期貨最近月契約結算價 0.25% ^{註2}
	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。

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^{註1}：

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		
	TMF	微型臺指期貨		
	TE	電子期貨		
	ZEF	小型電子期貨		
	SOF	半導體 30 期貨	± 前一一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5%	± 前一一般交易時段 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		
F1F	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	± 前一一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.1% ^{註2}	± 前一一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.05% ^{註2}
	RTF	小型美元兌人民幣期貨		
	XEF	歐元兌美元期貨	± 前一一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5% ^{註2}	± 前一一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.25% ^{註2}
	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	± 前一一般交易時段 期貨最近月契約 每日結算價 0.5%	± 前一一般交易時段 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

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%
	客製化小型臺指期貨	所有到期日	最近標的指數收盤價	2%	—
	微型臺指期貨	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%
	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	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
			算價		
	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%
	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% (本公司一般交易時段開盤起，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及盤後交易時段)	同左
	國內成分證券ETF期貨	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%	2%
	國外成分證券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%
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%

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
			算價		
	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%
	國內成分證券 ETF 選擇權	所有到期月份	期貨最近月契約開盤參考價	2%
	國外成分證券 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%