

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：曾先生

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3256

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國113年7月31日

發文字號：台期企字第1130800498號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：

主旨：有關本公司臺股期貨(TX)、小型臺指期貨(MTX)及客製化小型臺指期貨(MXFFX)不適用美國商品期貨交易委員會(CFTC)交易許可(Commission Certification)規定，詳如說明，請查照。

說明：

- 一、依美國商品期貨交易委員會(CFTC) 113年7月30日(美國時間)通知辦理。
- 二、緣本公司臺股期貨(TX)、小型臺指期貨(MTX)及客製化小型臺指期貨(MXFFX)標的指數—臺灣證券交易所發行量加權股價指數(加權指數)中，單一成份股占指數權重超過30%天數，已不符合美國廣基指數(Broad-based security index)定義，113年4月29日業通知CFTC。
- 三、CFTC 於7月30日(美國時間)通知加權指數依規定轉變為窄基指數(Narrow-based security index)，本公司TX、MTX及MXFFX亦成為窄基指數期貨，不再適用CFTC交易許可規定。
- 四、依據美國規定，窄基指數期貨由CFTC與美國證券管理委員會(SEC)共同管轄，TX、MTX及MXFFX轉變為窄基指數期貨後，因前揭商品未符合SEC窄基指數期貨豁免規定，期貨商應遵循SEC相關規範如下：
 - (一)美國投資人，含合格機構投資人(QIB)在內，皆不可交易TX、MTX及MXFFX商品。

(二)相關規範請參閱SEC Release No. 34-60194、CFTC Advisory(<http://www.cftc.gov/idc/groups/public/@internationalaffairs/documents/ssproject/fsfpadvisor.y.pdf>)，以及本公司網站「期貨業專區」之「期貨商向美國投資人推廣本公司期貨商品應注意事項」。

正本：中華民國期貨業商業同業公會、各期貨商
副本：

總經理 周建隆