

臺灣期貨交易所股份有限公司 公告

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：鄭茵蔓

聯絡電話：(02)2369-5678分機381

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102年5月3日

發文字號：台期交字第10200013100號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：公告本公司「三十天期商業本票利率期貨契約」終止上市有關事項。

依據：金融監督管理委員會102年4月25日金管證期字第1020010483號函及本公司業務規則第32條。

公告事項：

- 一、本公司「三十天期商業本票利率期貨契約」（以下稱本契約）於102年6月20日終止上市，並自公告日起停止加掛新到期月份契約。
- 二、本契約所有未了結部位應於102年6月20日前了結；未了結者依本契約交易規則第17條第2項之規定辦理。
- 三、本公司「三十天期商業本票利率期貨契約交易規則」及「三十天期商業本票利率期貨契約規格」自102年6月20日起廢止。
- 四、另配合本契約終止上市，修正本公司「法人機構申請放寬部位限制作業要點」第2點、第3點及第5點；「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第陸點；「結算保證金收取方式及標準」第4條之3及第5條；「期貨契約價差部位組合保證金計收方式」第2點及第3點，各修正條文對照

表如附件，並自102年6月20日起實施。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商、本公司網站

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、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、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、法源資訊股份有限公司、博仲法律事務所、台北國際金融資訊協會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、記者室、本公司各部門

總經理 **王中愷**

裝

訂

線

臺灣期貨交易所股份有限公司「法人機構申請放寬 部位限制作業要點」修正條文對照表

修正條文	原條文	說 明
<p>二、法人機構申請放寬部位限制，應提供下列資料證明確有真實避險需求：</p> <p>(一)從事股價類期貨或選擇權契約交易者，應提供持有我國上市(櫃)公司股票、債券換股權利證書、轉換公司債及以我國上市(櫃)股票為標的之上市股票型基金、上市指數型基金及指數股票型基金受益憑證總市值，或其他相關資料。</p> <p>(二)從事利率期貨類契約交易者，應提供持有我國政府公債總額或其他相關資料。</p>	<p>二、法人機構申請放寬部位限制，應提供下列資料證明確有真實避險需求：</p> <p>(一)從事股價類期貨或選擇權契約交易者，應提供持有我國上市(櫃)公司股票、債券換股權利證書、轉換公司債及以我國上市(櫃)股票為標的之上市股票型基金、上市指數型基金及指數股票型基金受益憑證總市值，或其他相關資料。</p> <p>(二)從事利率期貨類契約交易者，應提供持有<u>商業本票</u>或我國政府公債總額或其他相關資料。</p>	<p>配合本公司 30 天期利率期貨契約終止上市，爰修正本作業要點第二點第二款，將從事利率期貨類契約交易者申請放寬部位限制應備資料中之商業本票刪除。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>三、法人機構因避險需求申請放寬交易規則之淨空方部位限制規定者，應向臺灣集中保管結算所股份有限公司（以下簡稱「集保結算所」）申請提供該法人機構持有現貨市場部位總市值及相關明細資料予本公司。</p> <p>法人機構因避險需求申請放寬交易規則之部位限制規定至法人部位限制之二倍或三倍者，應檢具「法人機構申請放寬臺灣期貨交易所各期貨交易契約部位限制申請書」（如附表，以下簡稱「申請書」），載明其應記載事項，連同本公司規定應檢具之文件，向本公司申請，俟本公司發給同意函後，始得放寬交易規則之部位限制規定至法人部位限制之二倍或三倍。</p>	<p>三、法人機構因避險需求申請放寬交易規則之淨空方部位限制規定者，應向臺灣集中保管結算所股份有限公司（以下簡稱「集保結算所」）申請提供該法人機構持有現貨市場部位總市值及相關明細資料予本公司。</p> <p>法人機構因避險需求申請放寬交易規則之部位限制規定至法人部位限制之二倍或三倍者，應檢具「法人機構申請放寬臺灣期貨交易所各期貨交易契約部位限制申請書」（如附表，以下簡稱「申請書」），載明其應記載事項，連同本公司規定應檢具之文件，向本公司申請，俟本公司發給同意函後，始得放寬交易規則之部位限制規定至法人部位限制之二倍或三倍。</p>	<p>配合本公司 30 天期利率期貨契約終止上市，爰修正本作業要點第三點第二項之附表「法人機構申請放寬臺灣期貨交易所各期貨交易契約部位限制申請書」，刪除 30 天期利率期貨之選項及有關商業本票之說明，如后附。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>五、法人機構依第三點第一項規定向集保結算所申請傳輸現貨資料至本公司，經集保結算所回覆並副知本公司完成相關申請手續者，自本公司接獲通知之次日起，該法人機構淨空方部位放寬之限制規定如下：</p> <p>(一)股價類期貨及選擇權：以下略。</p> <p>(二)股票期貨及選擇權：以下略。</p> <p>(三)利率類期貨：每營業日持有各交割月份未沖銷部位淨市值不得大於零，且其數額不得超過收盤後其持有我國政府公債總市值。</p> <p>以下略。</p>	<p>五、法人機構依第三點第一項規定向集保結算所申請傳輸現貨資料至本公司，經集保結算所回覆並副知本公司完成相關申請手續者，自本公司接獲通知之次日起，該法人機構淨空方部位放寬之限制規定如下：</p> <p>(一)股價類期貨及選擇權：以下略。</p> <p>(二)股票期貨及選擇權：以下略。</p> <p>(三)利率類期貨：每營業日持有各交割月份未沖銷部位淨市值不得大於零，且其數額不得超過收盤後其持有我國政府公債或商業本票總市值。</p> <p>以下略。</p>	<p>配合本公司 30 天期利率期貨契約終止上市，爰修正本作業要點第五點第一項第三款，將法人機構申請傳輸現貨資料中之商業本票刪除。</p>

法人機構申請放寬臺灣期貨交易所各期貨交易契約部位限制申請書

發文字號：

受文者：臺灣期貨交易所股份有限公司

主旨：為申請放寬 貴公司各期貨交易契約之交易規則部位限制規定，茲依 貴公司各契約交易規則、法人機構申請放寬部位限制作業要點及其他有關之規定，開具下列事項連同附件一份，向 貴公司申請放寬部位限制，請惠予核發同意函，請 查照。

一、申請人基本資料			
機構名稱	(中文) (英文)	(外國機構法人請加填英文名稱)	
營利事業 統一編號	(外國機構法人及大陸地區投資人請填原投資證券身分編號)		
聯絡人 (職稱)	(外國機構法人及大陸地區投資人請填國內代理人聯絡人)	聯絡 電話	
		傳真	
聯絡地址	(外國機構法人及大陸地區投資人請填國內代理人之聯絡地址)		
電子郵件 信箱			
申請日期	中華民國 年 月 日		

二、申請放寬部位限制之契約種類及額度			
契約類	約別	申請放寬部位限制契約名稱 (請於□中勾選)	申請額度 法人部位限制倍數 (請於□中勾選)
股指期	價數貨	<input type="checkbox"/> 臺股期貨 (TX, MTX)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 電子期貨 (TE)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 金融期貨 (TF)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 臺灣 50 期貨 (TSF)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 櫃買期貨(GTF)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 非金電期貨 (XIF)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
股指選	價數權	<input type="checkbox"/> 臺指選擇權 (TXO)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 電子選擇權 (TEO)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 金融選擇權 (TFO)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 櫃買選擇權(GTO)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
		<input type="checkbox"/> 非金電選擇權 (XIO)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
利率期	率貨	<input type="checkbox"/> 十年期公債期貨 (GBF)	<input type="checkbox"/> 2 <input type="checkbox"/> 3 倍
三、避險性交易策略說明			
<p>一、依據臺灣期貨交易所各契約交易規則規定，法人機構應基於避險需要始得申請放寬部位限制，茲提供下列資料證明申請人確有真實避險需求：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 從事股價類期貨或選擇權契約交易者，應提供持有我國上市（櫃）公司股票、債券換股權利證書、轉換公司債，及以我國上市（櫃）股票為標的之上市股票型基金、上市指數型基金及指數股票型基金受益憑證總市值，或其他相關資料。 2. 從事利率期貨類契約交易者，應提供申請人持有我國政府公債總額，或其他相關資料。 <p>二、申請人應於內部稽核與內部控制程序中規範期貨交易相關事項。</p>			

四、聲明事項

- 一、申請人提供之文件與內容完整且真實。
- 二、申請人將確實依據內部稽核與內部控制程序從事期貨交易。
- 三、申請人遵守期貨交易相關法令規定及臺灣期貨交易所相關規章規定從事期貨交易，絕不以不當手段干擾期貨與相關現貨市場運作，本人並瞭解臺灣期貨交易所於執行市場監視作業時，如發現有異常情事，得依據「期貨市場監視準則」及「臺灣期貨交易所業務規則」相關規定採行適當措施，以維護市場秩序。申請人之交易情形，將作為未來臺灣期貨交易所審核放寬部位限制之參考。
- 四、申請人同意臺灣期貨交易所於必要時，得要求申請人就有關事項限期提出書面說明或補正文件，申請人不得規避或拒絕。

五、申請人簽章

申請人簽章：

負責人或代表人簽章：

(外國機構法人及大陸地區投資人請由國內代理人之負責人或代表人簽章)

負責人或代表人身分證字號：

(外國機構法人及大陸地區投資人請填寫國內代理人之負責人或代表人身分證字號)

說明：

- 一、本申請書暨附件應以長 29.7 公分、寬 21 公分用紙 (即影印用紙 A4) 印製。
- 二、請於附件檢送齊備後再行申請。
- 三、機構法人申請放寬部位限制，應以不同契約分別提出申請 (可填寫於同一份申請書)。申請放寬之額度，以法人部位限制之整數倍數 (如 2 倍或 3 倍) 為原則，申請額度至多不得超過法人部位限制 3 倍。

- 四、臺灣期貨交易所審核機構法人放寬部位限制申請參考標準如下：
- 1.放寬額度為法人部位限制 2 倍者，申請人應符合以下二款條件：
 - (1)申請人最近 12 個月、最近 6 個月或最近 1 個月內有半數以上之營業日，持有未沖銷部位數量逾法人部位限制數 1/2。
 - (2)申請人最近 12 個月持有現貨總市值，不少於法人部位限制數契約價值之 1/2。
 - 2.放寬額度為法人部位限制 3 倍者，申請人應符合以下二款條件：
 - (1)申請人最近 12 個月、最近 6 個月或最近 1 個月內有半數以上之營業日，持有未沖銷部位數量超過法人部位限制數。
 - (2)申請人最近 12 個月持有現貨總市值，不少於法人部位限制數契約價值。
 - 3.除以上參考標準外，臺灣期貨交易所並得依據申請人過去於期貨或現貨市場之交易行為及其他相關資料，決定是否准予放寬部位限制，或決定放寬之額度與期間。
- 五、本申請書經臺灣期貨交易所核准後，有效期間為 2 年，但該法人機構最近 12 個月或最近 6 個月內未有半數以上之營業日持有未沖銷部位數量達該級距所需數量，其放寬部位限制期間以 6 個月為上限。申請人屆期如有繼續放寬部位限制之需要，應於放寬部位限制有效期間截止前重新提出申請，臺灣期貨交易所不負預先通知之責。申請人於放寬部位限制有效期間內認為原核准之放寬額度不敷需要時，亦得重新提出申請。(請注意：臺灣期貨交易所處理法人機構之放寬部位限制申請作業時間約需 3 至 5 個工作天，申請人應謹慎衡量放寬部位限制作業工作時間，儘早提出申請。)

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」修正條文對照表

修正條文	原條文	說明
陸、到期交割作業 一、指數期貨契約 (以下略) 二、指數選擇權契約 (以下略) 三、股票選擇權契約 (以下略) 四、十年期公債期貨契約 (以下略) 五、黃金期貨契約及新 臺幣計價黃金期貨 契約 (以下略) 六、黃金選擇權契約 (以下略) 七、股票期貨契約 (以下略)	陸、到期交割作業 一、指數期貨契約 (以下略) 二、指數選擇權契約 (以下略) 三、股票選擇權契約 (以下略) 四、十年期公債期貨契約 (以下略) 五、 <u>三十天利率期貨</u> <u>契約</u> (一) <u>作業時間為最後</u> <u>結算日中午十二</u> <u>時三十分。</u> (二) <u>結算會員於最後</u> <u>交易日收盤後，若</u> <u>有交割月份之未</u> <u>了結部位，本公司</u> <u>於最後結算日之</u> <u>作業時間內，以最</u> <u>後結算價進行到</u> <u>期部位交割作</u> <u>業，其間損益金額</u> <u>併入當日盤中結</u> <u>算保證金計算。</u> 六、黃金期貨契約及新 臺幣計價黃金期 貨契約 (以下略)	配合本公司三十天期利率期貨契約終止上市，爰刪除本作業要點第陸點有關該契約到期交割作業之規定並作項次調整。

修正條文	原條文	說明
	<p>七、黃金選擇權契約 (以下略)</p> <p>八、股票期貨契約 (以下略)</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	原條文	說 明
<p>第四條之三 十年期公債期貨契約結算保證金金額為其面額乘以百元報價乘以風險價格係數後，除以一十計算。</p> <p>前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>第一項收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位至千元。</p>	<p>第四條之三 十年期公債期貨契約結算保證金金額為其面額乘以百元報價乘以風險價格係數後，除以一十計算。</p> <p style="text-align: center;"><u>三十天期利率期貨契約結算保證金金額，</u></p> <p><u>除另有規定外，為其面額乘以三十除以三百六十五乘以風險價格係數。</u></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>第一項及第二項收取標準以千元為整數，千元以下部分無條件進位至千元。</p>	<p>一、配合本公司三十天期利率期貨契約終止上市，爰刪除有關該契約結算保證金計算方式之規定。</p> <p>二、項次調整</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，</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，</p>	<p>配合第四條之三項次調整，修正本條引用項次。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>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、第四條之第三項及第四條之四第四項規定進位。</p> <p>(以下略)</p>	<p>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、第四條之第三項及第四條之四第四項規定進位。</p> <p>(以下略)</p>	

臺灣期貨交易所期貨契約價差部位組合保證金 計收方式

中華民國一百零二年二月二十五日金融監督管理委員會
金管證期字第一〇二〇〇〇三七二四號函准予照辦
中華民國一百零二年三月二十二日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期交字第一〇二〇二〇〇二二一〇號公告修正第三點；並自
一百零二年七月三十一日起實施
中華民國一百零二年四月二十五日金融監督管理委員會
金管證期字第一〇二〇〇一〇四八三號函准予備查
中華民國一百零二年五月三日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期交字第一〇二〇〇〇一三一〇〇號公告修正第二及第三
點；並自一百零二年六月二十日起實施

一、法源依據

「臺灣期貨交易所股份有限公司業務規則」及「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」。

二、期貨契約價差部位組合保證金之適用契約

本公司期貨契約價差部位組合保證金計收方式及標準，適用本公司所有上市之期貨契約，包括臺灣證券交易所股價指數期貨契約(TX)、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約(TE)、臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約(TF)、臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約(MTX)、富時臺灣證券交易所臺灣 50 指數期貨契約(T5F)、中華民國十年期政府債券期貨契約(GBF)、黃金期貨契約(GDF)及其他期貨契約之價差部位組合。

三、期貨契約價差部位組合保證金計收方式

本公司期貨契約價差部位組合之保證金計收方式，依期貨契約一口多(買)方和一口空(賣)方之委託及部位組合，收取標準如下：

(一)相同商品契約

委託及部位組合	保證金計收方式	備註
買一口 TX，賣一口 TX	收取一口 TX 保證金	1. 僅適用於不同最後結算日之組合。 2. MTX 保證金標準取 TX 保證金標準之四分之一訂定。 3. 配合期貨契約價差委託機制之建立，單一部位即時於盤中由系統自動辦理保證金最佳化計收作業。
買一口 TE，賣一口 TE	收取一口 TE 保證金	
買一口 TF，賣一口 TF	收取一口 TF 保證金	
買一口 MTX，賣一口 MTX	收取一口 MTX 保證金	
買一口 T5F，賣一口 T5F	收取一口 T5F 保證金	
買一口 GBF，賣一口 GBF	收取一口 GBF 保證金	
買一口 GDF，賣一口 GDF	收取一口 GDF 保證金	

說明：本公司所有上市之期貨契約，比照適用相同商品契約之價差部位組合保證金計收方式。

(二)不同商品契約

委託及部位組合	保證金計收方式	備註
買一口 TX，賣一口 TE	MAXIMUM (一口 TX 保證金，一口 TE 保證金)	1. TX、TE、TF 及 MTX 相同或不同最後結算日之組合均可適用。 2. MTX 保證金標準取 TX 保證金標準之四分之一訂定。 3. 不同計價幣別之保證金，本公司以每日公告之新臺幣匯率換算，做為比價基礎。
賣一口 TX，買一口 TE	MAXIMUM (一口 TX 保證金，一口 TE 保證金)	
買一口 TX，賣一口 TF	MAXIMUM (一口 TX 保證金，一口 TF 保證金)	
賣一口 TX，買一口 TF	MAXIMUM (一口 TX 保證金，一口 TF 保證金)	
買一口 TX，賣一口 MTX	一口 TX 保證金	
賣一口 TX，買一口 MTX	一口 TX 保證金	
買一口 TE，賣一口 TF	MAXIMUM (一口 TE 保證金，一口 TF 保證金)	
賣一口 TE，買一口 TF	MAXIMUM (一口 TE 保證金，一口 TF 保證金)	
買一口 TE，賣一口 MTX	MAXIMUM (一口 TE 保證金，一口 MTX 保證金)	

委託及部位組合	保證金計收方式	備註
賣一口 TE, 買一口 MTX	MAXIMUM (一口 TE 保證金, 一口 MTX 保證金)	
買一口 TF, 賣一口 MTX	MAXIMUM (一口 TF 保證金, 一口 MTX 保證金)	
賣一口 TF, 買一口 MTX	MAXIMUM (一口 TF 保證金, 一口 MTX 保證金)	

四、保證金標準及比例

本公司期貨契約價差部位組合之結算保證金、維持保證金、原始保證金標準，依各期貨契約規定之比例訂定之。

期貨商向交易人收取之交易保證金及維持保證金，不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金標準。本公司向結算會員收取結算保證金。

五、保證金調整方式

本公司期貨契約價差部位組合保證金之調整，依「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」辦理。

臺灣期貨交易所股份有限公司 公告

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：鄭茵蔓

聯絡電話：(02)2369-5678分機381

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102年5月3日

發文字號：台期交字第10200013101號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：無

主旨：公告修正本公司「造市者報價、手續費折減及其他相關規定」暨廢止本公司96年9月29日台期交字第09600083580號公告，並自102年6月20日起實施。

依據：本公司102年5月3日台期交字第10200013100號公告。

公告事項：配合本公司「三十天期商業本票利率期貨契約」自102年6月20日起終止上市，爰修正本公司「造市者報價、手續費折減及其他相關規定」，刪除其中有關利率期貨之造市規範。另廢止本公司96年9月29日台期交字第09600083580號公告(特定法人機構申請本公司三十天期利率期貨造市者資格標準)。

正本：各期貨商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、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、臺灣集中保管結算所股份有限公司、法源資訊股份有限公司、本公司各部門、本公司網站

總經理 **王中愷**