

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：邱瑜明

聯絡電話：(02)2369-5678分機136

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9月2日

發文字號：台期交字第10200026300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：公告修正本公司「鉅額交易作業辦法」、「臺灣證券交易所股價指數期貨契約交易規則」、「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約交易規則」、「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約交易規則」及「股票期貨契約交易規則」部分條文，並自102年12月2日起實施。

依據：金融監督管理委員會102年8月27日金管證期字第1020035999號函。

公告事項：因應開放議價申報鉅額交易制度，以及放寬同一標的之期貨與選擇權組合式買賣申報數量規定，爰修正本公司「鉅額交易作業辦法」部分條文，並配合修正適用鉅額交易4項商品之交易規則，修正條文對照表詳如附件。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、前後台資訊廠商

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、台北國際金融資訊協會、精融網路科技股份有限公司、法源資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 **王中愷** 公出

副總經理 **邱文昌** 代行

臺灣期貨交易所股份有限公司「鉅額交易作業辦法」 修正條文對照表

修正條文	原條文	說明
<p>第二條 鉅額交易得以逐筆撮合或議價申報為之。</p>		<p>1.本條新增。</p> <p>2.鉅額交易除以現行電腦逐筆撮合方式進行外，另開放得以買賣雙方議價後向本公司申報方式進行，爰增訂本條規定。</p>
<p>第三條 鉅額交易買賣申報數量，除另有規定外，應符合下列規定：</p> <p>一、同一期貨契約每筆最低買賣申報數量達二百個契約以上。</p> <p>二、同一選擇權契約每筆最低買賣申報數量達四百個契約以上。</p> <p>前項適用之契約，由本公司報請主管機關核備後另行公告。</p> <p>鉅額交易之買賣申報價格升降單位及</p>	<p>第二條 鉅額交易買賣申報數量應符合下列規定：</p> <p>一、同一期貨契約每筆最低買賣申報數量達二百個契約以上。</p> <p>二、同一選擇權契約每筆最低買賣申報數量達四百個契約以上。</p> <p>前項適用之契約，由本公司報請主管機關核備後另行公告。</p> <p>鉅額交易之買賣申報價格升降單位及買賣價格範圍，同各</p>	<p>1.條次修正。</p> <p>2.鉅額交易之買賣申報數量以同一期貨契約200口以上；同一選擇權契約400口以上為原則，惟為因應適用鉅額交易契約之個別商品特性及策略性組合式交易態樣之多元發展，例外情形得由本公司另予規範，爰修正本條第一項。</p>

修正條文	原條文	說明
買賣價格範圍，同各該契約交易規則訂定之最小升降單位及每日漲跌幅度或最大漲跌點數。	該契約交易規則訂定之最小升降單位及每日漲跌幅度或最大漲跌點數。	
第四條 鉅額交易買賣申報應於各該契約交易規則所訂之交易時間內進行。	第三條 鉅額交易買賣申報應於各該契約交易規則所訂之交易時間內進行。	條次修正。
<p>第五條 鉅額交易之買賣申報分為單一契約之單式買賣申報及要求同時成交不同契約之組合式買賣申報。</p> <p>前項組合式買賣之價格申報應依各契約分別申報，且每一契約之買賣申報數量均須符合<u>第三條</u>第一項規定，但組合式買賣申報為相同標的之期貨契約與選擇權契約者，其期貨契約買賣申報數量不在此限。</p>	<p>第四條 鉅額交易之買賣申報分為單一契約之單式買賣申報及要求同時成交不同契約之組合式買賣申報。</p> <p>前項組合式買賣之價格申報應依各契約分別申報，且每一契約之買賣申報數量均須符合<u>第二條</u>第一項規定。</p>	<p>1.條次修正。</p> <p>2.考量同一標的之期貨與選擇權 Delta 或波動率等策略交易，因期貨與選擇權之價格敏感度不同，該組合中選擇權契約數量往往遠高於期貨契約數量，現行組合式買賣申報之每一契約數量皆須符合鉅額交易之門檻恐過高，爰增訂本條第二項但書，使從事該組合式買賣申報者，僅須選擇權部分符合最低買賣申報數量之規定。</p>
第六條 <u>逐筆撮合之鉅</u>	第五條 鉅額交易買賣	1.條次修正。

修正條文	原條文	說明
<p><u>額交易，其買賣申報以限價申報為限，並限當日有效，另得聲明立即成交否則取消，或立即全部成交否則取消。</u></p>	<p>申報以限價申報為限，並限當日有效，另得聲明立即成交否則取消，或立即全部成交否則取消。</p>	<p>2.配合議價申報鉅額交易之開放，本條規定逐筆撮合方式之鉅額交易酌予文字調整，以茲明確。</p>
<p><u>第七條 逐筆撮合之鉅額交易，期貨商申請變更買賣申報時，應先撤銷原買賣申報後，重新申報之。</u></p> <p><u>議價申報之鉅額交易，其買賣申報於本公司確認成交前，得申請撤銷。</u></p>	<p>第六條 期貨商申請變更<u>鉅額交易</u>買賣申報時，應先撤銷原買賣申報後，重新申報之。</p>	<p>1.條次修正。 2.明定議價申報之鉅額交易，其買賣申報得於未獲本公司確認成交前，辦理撤銷。</p>
<p><u>第八條 逐筆撮合之鉅額交易，其買賣申報限與同為逐筆撮合之鉅額交易買賣申報撮合，且買賣申報之優先順序依下列原則決定：</u></p> <p>一、單式買賣申報，以限價之較高買進申報，優先於較低買進申報；</p>	<p><u>第七條 鉅額交易採逐筆撮合，並限與鉅額買賣申報撮合。</u></p> <p>單式買賣申報撮合方式，以限價之較高買進申報，優先於較低買進申報；較低賣出申報，優先於較高賣出申報。同價位之申報，依輸入時序決定優先順序。</p>	<p>1.條次修正。 2.配合議價申報鉅額交易之開放，爰就現行於獨立委託簿進行逐筆撮合之鉅額交易，以及其買賣申報優先順序之決定原則，酌予文字修正。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>較低賣出申報，優先於較高賣出申報。同價位之申報，依輸入時序決定優先順序。</p> <p>二、組合式買賣申報，成交之相對方所申報契約、價格、數量須完全相符，並依<u>輸入時序決定優先順序</u>。</p>	<p>組合式買賣申報<u>撮合方式</u>，成交之相對方所申報契約、價格、數量須完全相符，並依<u>申報時間最優先者成交</u>。</p>	
<p>第九條 議價申報之鉅額交易，買方與賣方議定價格後，應即依下列規定辦理買賣申報，並經本公司檢核確認後始成交：</p> <p>一、買方與賣方交易人同屬一期貨商者，該期貨商應先向本公司登錄申報代號、期貨商代號、期貨交易契約代號、價格、數量，後申</p>		<p>1.本條新增。</p> <p>2.明定以議價方式進行之鉅額交易，其買賣申報之辦理方式，以及成交確認。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>報個別交易人帳號、買賣委託書編號、期貨交易契約買賣別、買賣數量、買賣價格及其他應申報事項。</p> <p>二、買方與賣方交易人分屬不同期貨商者，應指定一代表期貨商先向本公司登錄申報代號、期貨商代號、期貨交易契約代號、價格、數量，後由各期貨商分別申報個別交易人帳號、買賣委託書編號、期貨交易契約買賣別、買賣數量、買賣價格及其他應申報事項。</p> <p>前項買賣申報未於登錄後十分鐘內完成者，該買賣申報即為無效。</p>		

修正條文	原條文	說明
delete		
<p>第十條 鉅額交易之成交資訊及逐筆撮合鉅額交易之買賣申報資訊即時於本公司網站揭示。</p> <p>鉅額交易買賣申報及成交價格不作為當日之開盤、收盤價格及每日結算價訂定之依據，亦不列為最高、最低行情之紀錄。</p>	<p>第八條 鉅額交易買賣申報及成交資訊即時於本公司網站公告之。</p> <p>鉅額交易買賣申報及成交價格不作為當日之開盤、收盤價格及每日結算價訂定之依據，亦不列為最高、最低行情之紀錄。</p>	<p>1.條次修正。</p> <p>2.鉅額交易以議價方式進行者，其買賣申報毋須揭示，爰酌予文字調整。</p>
<p>第十一條 期貨商接受委託人鉅額交易買賣委託，應預先收足期貨交易保證金，且不適用本公司規定之當日沖銷交易保證金計收方式。</p>	<p>第九條 期貨商接受委託人鉅額交易買賣委託，應預先收足期貨交易保證金，且不適用本公司規定之當日沖銷交易保證金計收方式。</p>	<p>條次修正。</p>
<p>第十二條 鉅額交易之成交部位，期貨商應依成交紀錄，按每一交易帳戶別，辦理合併計算部位結構、數額、保證金收付金額及保證金追繳等作</p>	<p>第十條 鉅額交易之成交部位，期貨商應依成交紀錄，按每一交易帳戶別，辦理合併計算部位結構、數額、保證金收付金額及保證金追繳等作</p>	<p>條次修正。</p>

修正條文	原條文	說明
業。	業。	
第十三條 本辦法未規定事項，準用本公司有關規定辦理。。	第十一條 本辦法未規定事項，準用本公司有關規定辦理。	條次修正。
第十四條 本辦法報請主管機關核備後公告實施，修正時亦同。	第十二條 本辦法報請主管機關核備後公告實施，修正時亦同。	條次修正。

臺灣期貨交易所股份有限公司「臺灣證券交易所股價指數期貨契約交易規則」修正條文對照表

修正條文	原條文	說明
<p>第十條 本契約之買賣申報，除另有規定外，以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>第十條 本契約之買賣申報以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>本契約適用鉅額交易制度，爰配合議價申報鉅額交易之開放，修正本條規定。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約交易規則」修正條文對照表

修正條文	原條文	說明
<p>第十條 本契約之買賣申報，除另有規定外，以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>第十條 本契約之買賣申報以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>本契約適用鉅額交易制度，爰配合議價申報鉅額交易之開放，修正本條規定。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約交易規則」修正條文對照表

修正條文	原條文	說明
<p>第十二條 本契約之買賣申報，除另有規定外，以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>第十二條 本契約買賣申報之撮合方式，於開盤時採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>本契約適用鉅額交易制度，爰配合議價申報鉅額交易之開放，修正本條規定，並酌予文字調整。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司「股票期貨契約交易規則」修正條文對照表

修正條文	原條文	說明
<p>第八條 股票期貨契約之買賣申報，除另有規定外，以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>第八條 股票期貨契約買賣申報以電腦自動撮合。撮合方式開盤採集合競價，開盤後採逐筆撮合。</p>	<p>本契約適用鉅額交易制度，爰配合議價申報鉅額交易之開放，修正本條規定。</p>