

臺灣期貨交易所股份有限公司 公告

100
臺北市羅斯福路二段100號14樓
受文者：本公司網站

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：陳柏璋
聯絡電話：(02)2369-5678分機115

發文日期：中華民國102年3月22日
發文字號：台期交字第10202002210號
速別：最速件
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「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」交易規則及規格部分條文，暨「臺灣期貨交易所期貨契約價差部位組合保證金計收方式」，並自102年7月31日實施。

依據：金融監督管理委員會102年2月25日金管證期字第1020003724號函。

公告事項：為臺灣證券交易所股價指數小型期貨加掛一週到期契約，爰修正本公司「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」交易規則及規格，暨「臺灣期貨交易所期貨契約價差部位組合保證金計收方式」，相關條文如附，並自102年7月31日實施。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商

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、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

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>第八條 本契約交易時間為臺灣證券交易所正常營業日之上午八時四十五分至下午一時四十五分，到期契約最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至下午一時三十分。</p> <p>臺灣證券交易所如於開盤前因故宣布當日其交易市場暫停交易時，本契約得暫停交易；如臺灣證券交易所於交易時間內宣布暫停交易，則本契約之交易仍繼續進行。惟必要時，本公司仍得依當時狀況宣布暫停交易，並於次一營業日向主管機關申報備查。</p> <p>臺灣證券交易所更改交易時間，或有其他因素影響本契約交易之進行，或應期貨商業同業公會、全國期貨商業同業公會聯合會之建議，本公司得於報請主管機關核准後，變更交易時間。</p>	<p>第八條 本契約交易時間為臺灣證券交易所正常營業日之上午八時四十五分至下午一時四十五分，到期<u>月份</u>契約最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至下午一時三十分。</p> <p>臺灣證券交易所如於開盤前因故宣布當日其交易市場暫停交易時，本契約得暫停交易；如臺灣證券交易所於交易時間內宣布暫停交易，則本契約之交易仍繼續進行。惟必要時，本公司仍得依當時狀況宣布暫停交易，並於次一營業日向主管機關申報備查。</p> <p>臺灣證券交易所更改交易時間，或有其他因素影響本契約交易之進行，或應期貨商業同業公會、全國期貨商業同業公會聯合會之建議，本公司得於報請主管機關核准後，變更交易時間。</p>	因應本公司臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約(以下簡稱本契約)加掛一週到期契約，酌作文字修正。
<p>第九條 本契約<u>除另有規定外</u>，其交割月份分別為交易當月起連續之二個月份，以及三月、六月、九月、十二月中三個接續</p>	<p>第九條 本契約之交割月份分別為交易當月起連續之二個月份，以及三月、六月、九月、十二月中三個接續之季月，共五</p>	為滿足「一週到期臺指選擇權契約」交易人之避險交易需求，除現行五個到期月份契約外，本公司得於交易當週之星期三加掛以當日為

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p>之季月，共五期，同時各別掛牌交易。各交割月份契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，最後交易日為契約之最後結算日，<u>最後交易日之次一營業日為新交割月份契約之交易開始日。</u></p> <p><u>本公司得於交易當週之星期三加掛以當日為交易開始日且次一個星期三為最後交易日之契約，但每月第二個星期三除外；該契約之最後交易日為最後結算日。</u></p> <p><u>到期契約於最後交易日收盤時停止交易，最後交易日與交易開始日若為假日或因不可抗力因素未能進行交易時，以其最近之次一營業日為最後交易日與交易開始日。</u></p> <p>前三項交割月份、交易開始日、最後交易日、最後結算日，本公司認為必要時得報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>期，同時各別掛牌交易；各交割月份契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，<u>到期契約於最後交易日收盤時停止交易，最後交易日為該到期契約之最後結算日。</u></p> <p><u>前項最後交易日若為假日或因不可抗力因素未能進行交易時，以其最近之次一營業日為最後交易日。</u></p> <p><u>到期契約最後交易日之次一營業日，為新交割月份契約之交易開始日。</u></p> <p>前三項交割月份、交易開始日、最後交易日、最後結算日，本公司認為必要時得報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>交易開始日且次一個星期三為最後交易日之契約，但因第三個星期三為原最近月份契約之到期日，故第二個星期三不再推出次一個星期三到期之契約，爰增訂本條第二項之規定並酌作文字修正。</p>
<p>第十一條 本契約交易人持有部位，於每日收盤後，依本公司公布之每日結算價計算權益。</p> <p><u>依第九條第一項掛牌之契約，其每日結算價應與本公司臺灣證券交易所數期貨契約之每日結算</u></p>	<p>第十一條 本契約交易人持有部位，於每日收盤後，依本公司公布之每日結算價計算權益。</p> <p><u>前項每日結算價應與「臺灣證券交易所股價指數期貨契約」之每日結算</u></p>	<p>增訂本契約加掛一週到期契約之每日結算價訂定方式；另依循大小臺指期貨一對四互抵，僅限同一到期日之契約相互沖銷之規定，酌作文字修正。</p>

修 正 條 文	原 條 文	說 明
<p>股價指數期貨契約之每日 結算價相同。</p> <p><u>依第九條第二項掛牌 之契約，其每日結算價依 下列規定訂定之：</u></p> <p><u>一、採收盤前一分鐘內所 有交易之成交量加 權平均價。</u></p> <p><u>二、當日收盤前一分鐘內 無成交價時，以收盤 時未成交之買、賣報 價中，申報買價最高 者與申報賣價最低 者之平均價位為當 日結算價。</u></p> <p><u>三、無申報買價時，以申 報賣價最低者為當 日結算價；無申報賣 價時，則以申報買價 最高者為當日結算 價。</u></p> <p><u>四、一至三款皆無法決定 當日結算價，或其結 算價顯不合理時，由 本公司決定之。</u></p> <p><u>依第九條第一項掛牌 之契約，交易人持有該契 約各交割月份之未了結部 位數，每四個契約得沖銷 同一交割月份之本公司臺 灣證券交易所股價指數期 貨契約一個契約。</u></p>	<p>價相同。</p> <p>本契約交易人持有各 交割月份之未了結部位 數，每四個契約得沖銷同 一交割月份之「臺灣證券 交易所股價指數期貨契 約」一個契約。</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」
規格修正對照表

修 正 內 容	原 內 容	說 明
交易時間 ■ 本契約交易日同臺灣證券交易所交易日 ■ 交易時間為營業日上午 8:45~下午 1:45 ■ 到期契約最後交易日之交易時間為上午 8:45 ~下午 1:30	交易時間 ■ 本契約交易日同臺灣證券交易所交易日 ■ 交易時間為營業日上午 8:45~下午 1:45 ■ <u>到期月份</u> 契約最後交易日之交易時間為上午 8:45 ~下午 1:30	因應本公司臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約(以下簡稱本契約)加掛一週到期契約，酌作文字修正。
到期契約 ■ 自交易當月起連續二個月份，另加上三、六、九、十二月中三個接續季月， <u>另除每月第二個星期三外，得於交易當週之星期三加掛次一個星期三到期之契約</u>	<u>契約到期交割月份</u> ■ 自交易當月起連續二個月份，另加上三、六、九、十二月中三個接續季月， <u>總共五個月份的契約在市場交易</u>	為滿足一週到期臺指選擇權契約交易人之避險交易需求，除現行五個到期月份契約外，本公司得於交易當週之星期三加掛次一個星期三到期之契約，但因第三個星期三為原最近月份契約之到期日，故第二個星期三不再推出以次一個星期三為到期日之契約。
每日結算價 ■ <u>各月份契約每日結算價與本公司臺灣證券交易所股價指數期貨契約之每日結算價相同；交易當週星期三加掛之契約，其每日結算價原則上採當日收盤前1分鐘內所有交易之成交量加權平均價，若無成交價時，則依「臺灣期貨交易所股份有限公司臺灣證券交易</u>	每日結算價 ■ 每日結算價與「臺灣證券交易所股價指數期貨契約」之每日結算價相同	增訂本契約加掛一週到期契約之每日結算價訂定方式。

<u>所股價指數小型期貨契約交易規則，訂定之</u>		
<p>最後交易日</p> <p>■ 各月份契約的最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三，其次一營業日為<u>新交割月份</u>契約的開始交易日；<u>交易當週星期三加掛之契約</u>，其最後交易日為<u>挂牌日</u>之次一個星期三</p>	<p>最後交易日</p> <p>■ 契約的最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三，其次一營業日為新契約的開始交易日</p>	配合交易當週之星期三加掛次一個星期三為最後交易日之契約，爰酌作文字調整。

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1020002210號公告修正第三點；並自
一百零二年七月三十一日起實施

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)、三十天期商業本票利率期貨契約(CPF)、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 <u>最後結算日</u> 之組合。
買一口 TE，賣一口 TE	收取一口 TE 保證金	2. MTX 保證金標準取 TX 保證金標準之四分之一訂定。
買一口 TF，賣一口 TF	收取一口 TF 保證金	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 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 CPF，賣一口 CPF	收取一口 CPF 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 <u>最後結算日</u> 之組合均可適用。
賣一口 TX，買一口 TE	MAXIMUM (一口 TX 保證金，一口 TE 保證金)	2. MTX 保證金標準取 TX 保證金標準之四分之一訂定。
買一口 TX，賣一口 TF	MAXIMUM (一口 TX 保證金，一口 TF 保證金)	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 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。