

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：謝珮芳
聯絡電話：(02)2369-5678分機380

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103年3月25日
發文字號：台期交字第10302003460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「股票期貨契約」暨「股票選擇權契約」交易規則及規格部分條文，並自即日起實施。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會103年2月20日金管證期字第1020054435號函及金管證期字第1030003460號函辦理。
- 二、配合股票期貨暨選擇權標的證券新增上櫃股票及調降契約停止加掛之週轉率與交易量標準，爰修正本公司「股票期貨契約」暨「股票選擇權契約」交易規則及規格，相關條文如附，並自即日起實施。

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 邱文昌

**臺灣期貨交易所股份有限公司「股票期貨契約」規格
修正條文對照表**

修正條文	原條文	說明
<p>交易標的</p> <p>■ 於臺灣證券交易所上市或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心上櫃之普通股股票</p>	<p>交易標的</p> <p>■ 於臺灣證券交易所上市之普通股股票</p>	<p>1. 現行股票期貨交易量已較上市初期大幅成長，且近年來上櫃股票市值規模及交易量能亦有增加趨勢，上櫃股票納為股票期貨標的後，股票期貨應可作為上櫃股票投資人交易、避險及策略性交易之工具，亦可提供交易人於現貨類股輪動時之另一種交易選擇。</p> <p>2. 參酌 ONEC、KRX 及 HKEx 交易所作法，將國內上櫃股票納為股票期貨遴選標的，故增列櫃買中心之上櫃普通股得作為股票期貨之標的。</p>
<p>交易時間</p> <p>■ 本契約之交易日與標的證券市場交易日相同</p> <p>■ 標的證券市場正常營業日上午 8:45 ~ 下午 1:45</p> <p>■ 到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8:45 ~ 下午 1:30</p>	<p>交易時間</p> <p>■ 本契約之交易日與臺灣證券交易所交易日相同</p> <p>■ 臺灣證券交易所正常營業日上午 8:45 ~ 下午 1:45</p> <p>■ 到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8:45 ~ 下午 1:30</p>	<p>配合前項增列櫃買中心上櫃股票得為交易標的，將交易時間內容涉及「臺灣證券交易所」修正為「標的證券市場」。</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>第四條 本公司股票期貨契約之標的證券或其發行公司應符合下列各款規定：</p> <p>一、於臺灣證券交易所股份有限公司（以下簡稱臺灣證券交易所）上市或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心（以下簡稱櫃買中心）上櫃之普通股股票。</p> <p>二、市值達新台幣一百億元以上。</p> <p>三、最近三個月份成交股數占已上市或上櫃股份總額之比例達百分之二十以上，或最近三個月份月平均交易量達一億股以上。</p> <p>四、最近期經會計師查核簽證或核閱之財務報告無虧損，或最近期雖有虧損但無累積虧損者。</p> <p>五、最近三年未有證券交易法第一百五十六條之情形，經主管機關命令停止其一部或全部之買賣者。</p> <p>六、最近一年未經臺灣證券交易所或櫃買</p>	<p>第四條 本公司股票期貨契約之標的證券或其發行公司應符合下列各款規定：</p> <p>一、於臺灣證券交易所股份有限公司（以下簡稱臺灣證券交易所）上市之普通股股票。</p> <p>二、市值達新台幣一百億元以上。</p> <p>三、最近三個月份成交股數占已上市股份總額之比例達百分之二十以上，或最近三個月份月平均交易量達一億股以上。</p> <p>四、最近期經會計師查核簽證或核閱之財務報告無虧損，或最近期雖有虧損但無累積虧損者。</p> <p>五、最近三年未有證券交易法第一百五十六條之情形，經主管機關命令停止其一部或全部之買賣者。</p> <p>六、最近一年未經臺灣證券交易所變更交</p>	<p>1. 現行股票期貨交易量已較上市初期大幅成長，且近年來上櫃股票市值規模及交易量能亦有增加趨勢，上櫃股票納為股票期貨標的後，股票期貨應可作為上櫃股票投資人交易、避險及策略性交易之工具，亦可提供交易人於現貨類股輪動時之另一種交易選擇。</p> <p>2. 目前 ONEC、KRX 及 HKEx 交易所股票期貨皆訂有類似國內次級股票之選股標準，且與主要股票遴選標準一致；參酌前揭交易所作法，將上櫃股票納為股票期貨遴選標的，與現行上市股票標準併同規範，爰修正第一項第一款規定；配合放寬櫃買中心之上櫃普通股得作為股票期貨之標的，並修正第一項第三、六、七、八款及第二項規定，增列櫃買中心上櫃股票之規範。另第一項第九款刪除臺灣證券交易所用語，以與相關法規用語一致。</p>

修正條文	原條文	說明
<p><u>中心變更交易方式，或依臺灣證券交易所營業細則第五十條或第五十條之三、櫃買中心證券商營業處所買賣有價證券業務規則第十二條之一公告</u>停止買賣者。</p> <p>七、最近三個月標的證券未因股價異常變動，並經臺灣證券交易所或櫃買中心依監視制度辦法處置者。</p> <p>八、未經臺灣證券交易所或櫃買中心依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券交易者。</p> <p>九、公開資訊觀測站之財務重點專區無警示標記者。</p> <p>十、未具其他因事業特性或特殊情形，可認對標的證券價格有不利影響者。</p> <p>本公司股票期貨契約標的證券發行公司因股份轉換為金融控股公司於臺灣證券交易所終止上市或櫃買中心終止上櫃，且臺灣證券交易所</p>	<p>易方式或依該公司營業細則第五十條或第五十條之三公</p> <p>告停止買賣者。</p> <p>七、最近三個月標的證券未因股價異常變動，並經臺灣證券交易所依監視制度辦法處置者。</p> <p>八、未經臺灣證券交易所依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券交易者。</p> <p>九、臺灣證券交易所公開資訊觀測站之財務重點專區無警示標記者。</p> <p>十、未具其他因事業特性或特殊情形，可認對標的證券價格有不利影響者。</p> <p>本公司股票期貨契約標的證券發行公司因股份轉換為金融控股公司於臺灣證券交易所終止上市，且臺灣證券交易所同意轉換之金融控股</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>或櫃買中心同意轉換之金融控股公司上市或上櫃買賣者，本公司得將轉換之金融控股公司評選為股票期貨契約標的證券，不受前項第二款至第四款規定之限制。</p>	<p>公司上市買賣者，本公司得將轉換之金融控股公司評選為股票期貨契約標的證券，不受前項第二款至第四款規定之限制。</p>	
<p>第十六條 交易人於任何時間持有同一標的證券期貨契約之同方向未了結部位合計數，除本公司另有規定外，應符合下列標的證券之分級部位限制數：</p> <p>一、第一級：自然人以八千個契約為限，法人機構以二萬四千個契約為限，造市者以六萬個契約為限。</p> <p>二、第二級：自然人以四千個契約為限，法人機構以一萬二千個契約為限，造市者以三萬個契約為限。</p> <p>三、第三級：自然人以二千個契約為限，法人機構以六千個契約為限，造市者以一萬五千個契約為限。</p> <p>前項造市者持有之未了結部位合計數，本公司得視市場狀況調整之。</p> <p>第一項所稱標的證</p>	<p>第十六條 交易人於任何時間持有同一標的證券期貨契約之同方向未了結部位合計數，除本公司另有規定外，應符合下列標的證券之分級部位限制數：</p> <p>一、第一級：自然人以八千個契約為限，法人機構以二萬四千個契約為限，造市者以六萬個契約為限。</p> <p>二、第二級：自然人以四千個契約為限，法人機構以一萬二千個契約為限，造市者以三萬個契約為限。</p> <p>三、第三級：自然人以二千個契約為限，法人機構以六千個契約為限，造市者以一萬五千個契約為限。</p> <p>前項造市者持有之未了結部位合計數，本公司得視市場狀況調整之。</p> <p>第一項所稱標的證</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得做為股票期貨標的證券，爰修正第四項第三、五款規定。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>券之分級規定如下：</p> <p>一、第一級：最近三個月份的總交易量達十六億股以上；或最近三個月份的總交易量達十二億股以上，且目前在外流通股數達三十二億股以上。</p> <p>二、第二級：最近三個月份總交易量達八億股以上；或最近三個月份總交易量達六億股以上，且目前在外流通股數達十六億股以上。</p> <p>三、第三級：未符合前二款規定者。</p> <p>前項及第十七條第一項所稱在外流通股數，係指該標的證券發行公司已發行股份總額扣除下列各款之股份：</p> <p>一、全體董事、監察人應持有之法定持股成數。</p> <p>二、已質押股數。</p> <p>三、新上市或上櫃公司強制集保之股數。</p> <p>四、依「上市上櫃公司買回本公司股份辦法」規定已買回未註銷之股份。</p> <p>五、經主管機關限制上市或上櫃買賣之股份。</p>	<p>券之分級規定如下：</p> <p>一、第一級：最近三個月份的總交易量達十六億股以上；或最近三個月份的總交易量達十二億股以上，且目前在外流通股數達三十二億股以上。</p> <p>二、第二級：最近三個月份總交易量達八億股以上；或最近三個月份總交易量達六億股以上，且目前在外流通股數達十六億股以上。</p> <p>三、第三級：未符合前二款規定者。</p> <p>前項及第十七條第一項所稱在外流通股數，係指該標的證券發行公司已發行股份總額扣除下列各款之股份：</p> <p>一、全體董事、監察人應持有之法定持股成數。</p> <p>二、已質押股數。</p> <p>三、新上市公司強制集保之股數。</p> <p>四、依「上市上櫃公司買回本公司股份辦法」規定已買回未註銷之股份。</p> <p>五、經主管機關限制上市買賣之股份。</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>本公司每三個月或依市場狀況，依第二項規定審視標的證券所適用之級數。</p> <p>部位限制之提高，自本公司公告之日起生效，部位限制之降低，於公告日該期貨已上市之次近月份契約到期後生效。但本公司得視情況調整之。</p> <p>前項部位限制降低時，交易人於生效日前持有而逾越調降後限制標準之部位，得持有至契約到期日止，但尚未符合調降後之限制標準前，不得新增部位。</p> <p>交易人違反部位限制規定者，本公司得限制交易人新增部位，或命令期貨商在不影響市場價格的情況下了結交易人部位。</p> <p>法人機構基於避險需要，得向本公司申請放寬部位限制。</p> <p>綜合帳戶持有本契約之未了結部位合計數，不受第一項之限制。</p> <p>交易人持有股票期貨契約之未了結部位，除本條規定外，另應符合「臺灣期貨交易所股份</p>	<p>本公司每三個月或依市場狀況，依第二項規定審視標的證券所適用之級數。</p> <p>部位限制之提高，自本公司公告之日起生效，部位限制之降低，於公告日該期貨已上市之次近月份契約到期後生效。但本公司得視情況調整之。</p> <p>前項部位限制降低時，交易人於生效日前持有而逾越調降後限制標準之部位，得持有至契約到期日止，但尚未符合調降後之限制標準前，不得新增部位。</p> <p>交易人違反部位限制規定者，本公司得限制交易人新增部位，或命令期貨商在不影響市場價格的情況下了結交易人部位。</p> <p>法人機構基於避險需要，得向本公司申請放寬部位限制。</p> <p>綜合帳戶持有本契約之未了結部位合計數，不受第一項之限制。</p> <p>交易人持有股票期貨契約之未了結部位，除本條規定外，另應符合「臺灣期貨交易所股份</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>有限公司市場部位監視作業辦法」之規定。</p>	<p>有限公司市場部位監視作業辦法」之規定。</p>	
<p>第三十二條 股票期貨契約標的證券或其發行公司有下列情事之一者，本公司應對該契約停止加掛新月份契約：</p> <p>一、市值小於新台幣五十億元。</p> <p>二、最近三個月份成交股數占已上市或上櫃股份總額之比例小於百分之八，且最近三個月份月平均成交量小於四千萬股。</p> <p>三、經公告為合併後消滅公司。</p> <p>四、經主管機關命令停止其一部或全部之買賣。</p> <p>五、經臺灣證券交易所或櫃買中心公告變更交易方式。</p> <p>六、經臺灣證券交易所依該公司營業細則第五十條或第五十條之三，或櫃買中心依該中心證券商營業處所買賣有價證券業務規則第十二條之一公告停止買賣。</p> <p>七、經臺灣證券交易所或櫃買中心依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫</p>	<p>第三十二條 股票期貨契約標的證券或其發行公司有下列情事之一者，本公司應對該契約停止加掛新月份契約：</p> <p>一、市值小於新台幣五十億元。</p> <p>二、最近三個月份成交股數占已上市股份總額之比例小於百分之十二，且最近三個月份月平均成交量小於六千萬股。</p> <p>三、經公告為合併後消滅公司。</p> <p>四、經主管機關命令停止其一部或全部之買賣。</p> <p>五、經臺灣證券交易所公告變更交易方式。</p> <p>六、經臺灣證券交易所依該公司營業細則第五十條或第五十條之三公告停止買賣。</p> <p>七、經臺灣證券交易所依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券</p>	<p>1.配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得做為股票期貨標的證券，爰修正第一項第二、五、六、七款規定；另上櫃標的證券轉上市者，倘有經臺灣證券交易所公告不得為融資融券情事者，轉換之上市標的證券應停止加掛新月份契約，爰修正第一項第七款後段規定。</p> <p>2.上市期貨契約設有固定到期月份契約數之機制，近月契約到期後，新月份契約即上市交易。未若現貨市場之權證，契約到期即終止上市，新權證需由發行人申請上市交易，無頻繁停止加掛致影響交易連續性之情事。為避免已上市股票期貨契約標的證券之成交量與週轉率，因證券市場之市況因素，致許多尚具市場交易需求之契約，因標的證券未達應有之成交量與週轉率標準，而頻有實施停止加掛新月份契約並致終止上市之情事，影響契約交易之連續性，爰修正第一項第二款規定，將週轉率標準由百分之十二調降為百分之八，成交量標準由六千萬股調降為四千萬股。</p> <p>3.前揭週轉率及成交量標準調降後，已降低股票期貨停止加掛新月份契約數偏多</p>

修正條文	原條文	說明
<p><u>停融資融券交易者，或上櫃標的證券轉上市，且經臺灣證券交易所公告不得為融資融券者。</u></p> <p>依前項第一款及第二款所為停止加掛新月份契約，本公司應每季審定公告；其餘各款所為停止加掛新月份契約，於獲悉後公告。</p> <p>除依第一項規定外，本公司得因標的證券發行公司或市場狀況，停止加掛新月份契約。</p> <p>有第一項第一款及第二款情事，但本公司基於市場需要，得繼續加掛新月份契約。</p>	<p>交易者。</p> <p>依前項第一款及第二款所為停止加掛新月份契約，本公司應每季審定公告；其餘各款所為停止加掛新月份契約，於獲悉後公告。</p> <p>除依第一項規定外，本公司得因標的證券發行公司或市場狀況，停止加掛新月份契約。</p> <p>有第一項第一款及第二款情事，但本公司基於市場需要，<u>或標的證券或其發行公司同時符合下列各款者，得繼續加掛新月份契約：</u></p> <p><u>一、標的證券市值達四十億元。</u></p> <p><u>二、各月份契約未了結部位總和達一千個單位。</u></p> <p><u>三、標的證券最近三個月份成交股數占已上市股份總額之比例達百分之十，或最近三個月份月平均成交量達五千萬股。</u></p>	<p>之情況，爰刪除第四項第一至三款停止加掛新月份契約例外條件並酌作文字修正。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>第三十五條 股票期貨契約之標的證券經臺灣證券交易所或櫃買中心停止買賣時，該標的證券期貨契約應停止交易。</p> <p>本公司依據有關法令、本公司相關章則規定或基於其他足以影響市場秩序或交易人權益之原因而認為有必要時，得對上市之股票期貨契約予以暫停交易或於報請主管機關核准後停止其交易或終止上市，或先行公告停止其交易後，復報請主管機關備查。</p>	<p>第三十五條 股票期貨契約之標的證券經臺灣證券交易所停止買賣時，該標的證券期貨契約應停止交易。</p> <p>本公司依據有關法令、本公司相關章則規定或基於其他足以影響市場秩序或交易人權益之原因而認為有必要時，得對上市之股票期貨契約予以暫停交易或於報請主管機關核准後停止其交易或終止上市，或先行公告停止其交易後，復報請主管機關備查。</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得做為股票期貨標的證券，爰修正第一項規定。</p>
<p>第三十七條 股票期貨契約於停止交易期間內，臺灣證券交易所或櫃買中心恢復標的證券之買賣時，本公司應即恢復該標的證券期貨之交易。</p> <p>股票期貨契約恢復交易時，各月份契約之推出，準用第三十三條第二項之規定。</p>	<p>第三十七條 股票期貨契約於停止交易期間內，臺灣證券交易所恢復標的證券之買賣時，本公司應即恢復該標的證券期貨之交易。</p> <p>股票期貨契約恢復交易時，各月份契約之推出，準用第三十三條第二項之規定。</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得做為股票期貨標的證券，爰修正第一項規定。</p>
<p>第三十九條 股票期貨契約標的證券有下列情事之一者，本公司應對該契約終止上市：</p> <p>一、經主管機關命令停止其全部之買賣者。</p> <p>二、經臺灣證券交易所或櫃買中心報經主</p>	<p>第三十九條 股票期貨契約標的證券有下列情事之一者，本公司應對該契約終止上市：</p> <p>一、經主管機關命令停止其全部之買賣者。</p> <p>二、經臺灣證券交易所報經主管機關核准</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得做為股票期貨標的證券，爰修正第一項第二款至第四款及第二項規定。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>管機關核准後，終 止其上市或上櫃 者。</p> <p>三、經標的證券發行公 司申請終止上市或 上櫃並獲核准者。 但上櫃標的證券轉 上市者，不在此限。</p> <p>四、其他經主管機關核 定應予終止上市或 上櫃者。</p> <p>股票期貨契約之終 止上市日，為標的證券 於臺灣證券交易所或櫃 買中心之停止買賣或終 止上市或上櫃日。</p>	<p>後，終止其上市者。</p> <p>三、經標的證券發行公 司申請終止上市並 獲核准者。</p> <p>四、其他經主管機關核 定應予終止上市 者。</p> <p>股票期貨契約之終 止上市日，為標的證券 於臺灣證券交易所之停 止買賣或終止上市日。</p>	

**臺灣期貨交易所股份有限公司「股票選擇權契約」規格
修正條文對照表**

修正條文	原條文	說明
<p>交易標的</p> <p>■ <u>於臺灣證券交易所上市或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心上櫃之普通股股票</u></p>	<p>交易標的</p> <p>■ <u>於臺灣證券交易所上市之普通股股票</u></p>	<p>1. 近年來上櫃股票市值規模及交易量能增加趨勢，上櫃股票納為股票選擇權標的後，股票選擇權應可作為上櫃股票投資人交易、避險及策略性交易之工具，亦可提供交易人於現貨類股輪動時之另一種交易選擇。</p> <p>2. 參酌 CBOE、KRX 及 HKEx 交易所作法，將國內上櫃股票納為股票選擇權遴選標的，故增列櫃買中心之上櫃普通股得作為股票選擇權之標的。</p>
<p>交易時間</p> <p>■ <u>本契約之交易日與標的證券市場交易日相同</u></p> <p>■ <u>標的證券市場正常營業</u> 日上午 8:45 ~ 下午 1:45</p> <p>■ 到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8:45 ~ 下午 1:30</p>	<p>交易時間</p> <p>■ 本契約交易日同臺灣證券交易所標的證券交易日</p> <p>■ <u>交易時間為營業日上午 8:45~下午 1:45</u></p> <p>■ 到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8:45 ~ 下午 1:30</p>	<p>配合前項增列櫃買中心上櫃股票得為交易標的，將交易時間內容涉及「臺灣證券交易所」修正為「標的證券市場」。</p>

**臺灣期貨交易所股份有限公司「股票選擇權契約」交易規則
修正條文對照表**

修正條文	原條文	說明
<p>第四條 本公司股票選擇權契約之標的證券或其發行公司應符合下列各款規定：</p> <p>一、於臺灣證券交易所股份有限公司（以下簡稱臺灣證券交易所）上市或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心（以下簡稱櫃買中心）上櫃之普通股股票。</p> <p>二、市值達新台幣一百億元以上。</p> <p>三、最近三個月份成交股數占已上市或上櫃股份總額之比例達百分之二十以上，或最近三個月份月平均交易量達一億股以上。</p> <p>四、最近期經會計師查核簽證或核閱之財務報告無虧損，或最近期雖有虧損但無累積虧損者。</p> <p>五、最近三年未有證券交易法第一百五十六條之情形，經主管機關命令停止其一部或全部之買賣者。</p> <p>六、最近一年未經臺灣證券交易所或櫃買中心變更交易方式，或依臺灣證券交易所營業細則第五十條或第五</p>	<p>第四條 本公司股票選擇權契約之標的證券或其發行公司應符合下列各款規定：</p> <p>一、於臺灣證券交易所股份有限公司（以下簡稱臺灣證券交易所）上市之普通股股票。</p> <p>二、市值達新台幣一百億元以上。</p> <p>三、最近三個月份成交股數占已上市股份總額之比例達百分之二十以上，或最近三個月份月平均交易量達一億股以上。</p> <p>四、最近期經會計師查核簽證或核閱之財務報告無虧損，或最近期雖有虧損但無累積虧損者。</p> <p>五、最近三年未有證券交易法第一百五十六條之情形，經主管機關命令停止其一部或全部之買賣者。</p> <p>六、最近一年未經臺灣證券交易所變更交易方式或依該公司營業細則第五十條或第五十條之三公告停止買賣</p>	<p>1. 近年來上櫃股票市值規模及交易量能增加趨勢，上櫃股票納為股票選擇權標的後，股票選擇權應可作為上櫃股票投資人交易、避險及策略性交易之工具，亦可提供交易人於現貨類股輪動時之另一種交易選擇。</p> <p>2. 目前 CBOE、KRX 及 HKEx 交易所股票選擇權皆訂有類似國內次級股票之選股標準，且與主要股票遴選標準一致；參酌前揭交易所作法，將上櫃股票納為股票選擇權遴選標的，與現行上市股票標準併同規範，爰修正第一項第一款規定；配合放寬櫃買中心之上櫃普通股得作為股票選擇權之標的，並修正第一項第三、六、七、八款及第二項規定，增列櫃買中心上櫃股票之規範。另第一項第九款刪除臺灣證券交易所用語，以與相關法規用語一致。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>十條之三、<u>櫃買中心</u>證券商營業處所買賣有價證券業務規則第十二條之一公告停止買賣者。</p>	<p>者。</p>	
<p>七、最近三個月標的證券未因股價異常變動，並經臺灣證券交易所或<u>櫃買中心</u>依監視制度辦法處置者。</p> <p>八、未經臺灣證券交易所或<u>櫃買中心</u>依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券交易者。</p> <p>九、公開資訊觀測站之財務重點專區無警示標記者。</p> <p>十、未具其他因事業特性或特殊情形，可認對標的證券價格有不利影響者。</p> <p>本公司股票選擇權契約標的證券發行公司因股份轉換為金融控股公司於臺灣證券交易所終止上市或<u>櫃買中心</u>終止上櫃，且臺灣證券交易所或<u>櫃買中心</u>同意轉換之金融控股公司上市或上櫃買賣者，本公司得將轉換之金融控股公司評選為股票選擇權契約標的證券，不受前項第二款至第四款規定之限制。</p>	<p>七、最近三個月標的證券未因股價異常變動，並經臺灣證券交易所依監視制度辦法處置者。</p> <p>八、未經臺灣證券交易所依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券交易者。</p> <p>九、<u>臺灣證券交易所</u>公開資訊觀測站財務重點專區無警示標記者。</p> <p>十、未具其他因事業特性或特殊情形，可認對標的證券價格有不利影響者。</p> <p>本公司股票選擇權契約標的證券發行公司因股份轉換為金融控股公司於臺灣證券交易所終止上市，且臺灣證券交易所同意轉換之金融控股公司上市買賣者，本公司得將轉換之金融控股公司評選為股票選擇權契約標的證券，不受前項第二款至第四款規定之限制。</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>第十八條 交易人於任何時間持有同一標的證券選擇權契約之同方向未了結部位合計數，除本公司另有規定外，應符合下列標的證券之分級部位限制數：</p> <p>一、第一級：自然人以八千個契約為限，法人機構以二萬四千個契約為限，造市者以六萬個契約為限。</p> <p>二、第二級：自然人以四千個契約為限，法人機構以一萬二千個契約為限，造市者以三萬個契約為限。</p> <p>三、第三級：自然人以二千個契約為限，法人機構以六千個契約為限，造市者以一萬五千個契約為限。</p> <p>前項所稱同方向未了結部位合計數，係指買進買權與賣出賣權之部位合計數，或賣出買權與買進賣權之部位合計數。</p> <p>第一項造市者持有之未了結部位合計數，本公司得視市場狀況調整之。</p> <p>第一項所稱標的證券之分級規定如下：</p> <p>一、第一級：最近三個月份的總交易量達十六億股以上；或最近</p>	<p>第十八條 交易人於任何時間持有同一標的證券選擇權契約之同方向未了結部位合計數，除本公司另有規定外，應符合下列標的證券之分級部位限制數：</p> <p>一、第一級：自然人以八千個契約為限，法人機構以二萬四千個契約為限，造市者以六萬個契約為限。</p> <p>二、第二級：自然人以四千個契約為限，法人機構以一萬二千個契約為限，造市者以三萬個契約為限。</p> <p>三、第三級：自然人以二千個契約為限，法人機構以六千個契約為限，造市者以一萬五千個契約為限。</p> <p>前項所稱同方向未了結部位合計數，係指買進買權與賣出賣權之部位合計數，或賣出買權與買進賣權之部位合計數。</p> <p>第一項造市者持有之未了結部位合計數，本公司得視市場狀況調整之。</p> <p>第一項所稱標的證券之分級規定如下：</p> <p>一、第一級：最近三個月份的總交易量達十六億股以上；或最近</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得作為股票選擇權標的證券，爰修正第五項第三、五款規定。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>三個月份的總交易量達十二億股以上，且目前在外流通股數達三十二億股以上。</p>	<p>三個月份的總交易量達十二億股以上，且目前在外流通股數達三十二億股以上。</p>	
<p>二、第二級：最近三個月份總交易量達八億股以上；或最近三個月份總交易量達六億股以上，且目前在外流通股數達十六億股以上。</p> <p>三、第三級：未符合前二款規定者。</p> <p>前項及第十八條之一第一項所稱在外流通股數，係指該標的證券發行公司已發行股份總額扣除下列各款之股份：</p> <p>一、全體董事、監察人應持有之法定持股成數。</p> <p>二、已質押股數。</p> <p>三、新上市或上櫃公司強制集保之股數。</p> <p>四、依「上市上櫃公司買回本公司股份辦法」規定已買回未註銷之股份。</p> <p>五、經主管機關限制上市或上櫃買賣之股份。</p> <p>本公司每三個月或依市場狀況，依第三項規定審視標的證券所適用之級數。</p>	<p>二、第二級：最近三個月份總交易量達八億股以上；或最近三個月份總交易量達六億股以上，且目前在外流通股數達十六億股以上。</p> <p>三、第三級：未符合前二款規定者。</p> <p>前項及第十八條之一第一項所稱在外流通股數，係指該標的證券發行公司已發行股份總額扣除下列各款之股份：</p> <p>一、全體董事、監察人應持有之法定持股成數。</p> <p>二、已質押股數。</p> <p>三、新上市公司強制集保之股數。</p> <p>四、依「上市上櫃公司買回本公司股份辦法」規定已買回未註銷之股份。</p> <p>五、經主管機關限制上市買賣之股份。</p> <p>本公司每三個月或依市場狀況，依第三項規定審視標的證券所適用之級數。</p>	

修正條文	原條文	說明
<p>部位限制之提高，自本公司公告之日起生效，部位限制之降低，於公告日該選擇權已上市之次近月份契約到期後生效。但本公司得視情況調整之。</p> <p>前項部位限制降低時，交易人於生效日前持有而逾越調降後限制標準之部位，得持有至契約到期日止，但尚未符合調降後之限制標準前，不得新增部位。</p> <p>交易人違反部位限制規者，本公司得限制交易人新增部位，或命令期貨商在不影響市場價格的情況下了結交易人部位。</p> <p>法人機構基於避險需要，得向本公司申請放寬部位限制。</p> <p>綜合帳戶持有本契約之未了結部位合計數，不受第一項之限制。</p> <p>交易人持有股票選擇權契約之未了結部位，除本條規定外，另應符合「臺灣期貨交易所股份有限公司市場部位監視作業辦法」之規定。</p>	<p>部位限制之提高，自本公司公告之日起生效，部位限制之降低，於公告日該選擇權已上市之次近月份契約到期後生效。但本公司得視情況調整之。</p> <p>前項部位限制降低時，交易人於生效日前持有而逾越調降後限制標準之部位，得持有至契約到期日止，但尚未符合調降後之限制標準前，不得新增部位。</p> <p>交易人違反部位限制規者，本公司得限制交易人新增部位，或命令期貨商在不影響市場價格的情況下了結交易人部位。</p> <p>法人機構基於避險需要，得向本公司申請放寬部位限制。</p> <p>綜合帳戶持有本契約之未了結部位合計數，不受第一項之限制。</p> <p>交易人持有股票選擇權契約之未了結部位，除本條規定外，另應符合「臺灣期貨交易所股份有限公司市場部位監視作業辦法」之規定。</p>	
<p>第三十四條 股票選擇權契約標的證券或其發行公司有下列情事之一者，本公司應對該契約停止加掛新序列：</p>	<p>第三十四條 股票選擇權契約標的證券或其發行公司有下列情事之一者，本公司應對該契約停止加掛新序列：</p>	<p>1. 配合第四條，新增櫃買中心上櫃之普通股股票得作為股票選擇權標的證券，爰修正第一項第二、五、六、七款規定；另上櫃標</p>

修正條文	原條文	說明
<p>一、市值小於新台幣五十億元。</p> <p>二、最近三個月月份成交股數占已上市或上櫃股份總額之比例小於百分之八，且最近三個月月份月平均成交量小於四千萬股。</p> <p>三、經公告為合併後消滅公司。</p> <p>四、經主管機關命令停止其一部或全部之買賣。</p> <p>五、經臺灣證券交易所或櫃買中心公告變更交易方式。</p> <p>六、經臺灣證券交易所依該公司營業細則第五十條或第五十條之三，或櫃買中心依該中心證券商營業處所買賣有價證券業務規則第十二條之一公告停止買賣。</p> <p>七、經臺灣證券交易所或櫃買中心依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券交易者，或上櫃標的證券轉上市，且經臺灣證券交易所公告不得為融資融券者。</p> <p>依前項第一款及第二款所為停止加掛新序列，本公司應每季審定公告；其餘各款所為停止加掛新序列，於獲悉後公告。</p>	<p>一、市值小於新台幣五十億元。</p> <p>二、最近三個月月份成交股數占已上市股份總額之比例小於百分之十二，且最近三個月月份月平均成交量小於六千萬股。</p> <p>三、經公告為合併後消滅公司。</p> <p>四、經主管機關命令停止其一部或全部之買賣。</p> <p>五、經臺灣證券交易所公告變更交易方式。</p> <p>六、經臺灣證券交易所依該公司營業細則第五十條或第五十條之三公告停止買賣。</p> <p>七、經臺灣證券交易所依有價證券得為融資融券標準第四條公告暫停融資融券交易者。</p> <p>依前項第一款及第二款所為停止加掛新序列，本公司應每季審定公告；其餘各款所為停止加掛新序列，於獲悉後公告。</p>	<p>的證券轉上市者，倘有經臺灣證券交易所公告不得為融資融券情事者，轉換之上市標的證券應停止加掛新序列契約，爰修正第一項第七款後段規定。</p> <p>2. 上市選擇權契約設有固定到期月份契約數之機制，近月契約到期後，新月份契約即上市交易。未若現貨市場之權證，契約到期即終止上市，新權證需由發行人申請上市交易，無頻繁停止加掛致影響交易連續性之情事。為避免已上市股票選擇權契約標的證券之成交量與週轉率，因證券市場之市況因素，致許多尚具市場交易需求之契約，因標的證券未達應有之成交量與週轉率標準，而頻有實施停止加掛新序列並致終止上市之情事，影響契約交易之連續性，爰修正第一項第二款規定，將週轉率標準由百分之十二調降為百分之八，成交量標準由六千萬股調降為四千萬股。</p> <p>3. 前揭週轉率及成交量標準調降後，已降低股票選擇權停止加掛新序列數偏多之情況，爰刪除第四項第一至三款停止加掛新序列例外條件並酌作文字修正。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>除依第一項規定外，本公司得因標的證券發行公司或市場狀況，停止加掛新序列。</p> <p>有第一項第一款及第二款情事，但本公司基於市場需要，得繼續加掛新序列。</p>	<p>除依第一項規定外，本公司得因標的證券發行公司或市場狀況，停止加掛新序列。</p> <p>有第一項第一款及第二款情事，但本公司基於市場需要，<u>或標的證券或其發行公司同時符合下列各款者</u>，得繼續加掛新序列：</p> <p><u>一、標的證券市值達四十億元。</u></p> <p><u>二、各序列未了結部位總和達一千個單位。</u></p> <p><u>三、標的證券最近三個月份成交股數占已上市股份總額之比例達百分之十，或最近三個月月平均成交量達五千萬股。</u></p>	
<p>第三十七條 股票選擇權契約之標的證券經臺灣證券交易所或櫃買中心停止買賣時，該標的證券選擇權契約應停止交易。</p> <p>本公司依據有關法令、本公司相關章則規定或基於其他足以影響市場秩序或交易人權益之原因而認為有必要時，得對上市之股票選擇權契約予以暫停交易或於報請主管機關核准後停止其交易或終止上市，或先行公告停止其交易後，復報請主管機關備查。</p>	<p>第三十七條 股票選擇權契約之標的證券經臺灣證券交易所停止買賣時，該標的證券選擇權契約應停止交易。</p> <p>本公司依據有關法令、本公司相關章則規定或基於其他足以影響市場秩序或交易人權益之原因而認為有必要時，得對上市之股票選擇權契約予以暫停交易或於報請主管機關核准後停止其交易或終止上市，或先行公告停止其交易後，復報請主管機關備查。</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得作為股票選擇權標的證券，爰修正第一項。</p>

修正條文	原條文	說明
<p>第三十九條 股票選擇權契約於停止交易期間內，臺灣證券交易所或櫃買中心恢復標的證券之買賣時，本公司應即恢復該標的證券選擇權之交易。</p> <p>股票選擇權契約恢復交易時，各序列之推出，準用第三十五條第二項之規定。</p>	<p>第三十九條 股票選擇權契約於停止交易期間內，臺灣證券交易所恢復標的證券之買賣時，本公司應即恢復該標的證券選擇權之交易。</p> <p>股票選擇權契約恢復交易時，各序列之推出，準用第三十五條第二項之規定。</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得作為股票選擇權標的證券，爰修正第一項。</p>
<p>第四十一條 股票選擇權契約標的證券有下列情事之一者，本公司應對該契約終止上市：</p> <p>一、經主管機關命令停止其全部之買賣者。</p> <p>二、經臺灣證券交易所或櫃買中心報經主管機關核准後，終止其上市或上櫃者。</p> <p>三、經標的證券發行公司申請終止上市或上櫃並獲核准者。但上櫃標的證券轉上市者，不在此限。</p> <p>四、其他經主管機關核定應予終止上市或上櫃者。</p> <p>股票選擇權契約之終止上市日，為標的證券於臺灣證券交易所或櫃買中心之停止買賣或終止上市或上櫃日。</p>	<p>第四十一條 股票選擇權契約標的證券有下列情事之一者，本公司應對該契約終止上市：</p> <p>一、經主管機關命令停止其全部之買賣者。</p> <p>二、經臺灣證券交易所報經主管機關核准後，終止其上市者。</p> <p>三、經標的證券發行公司申請終止上市並獲核准者。</p> <p>四、其他經主管機關核定應予終止上市者。</p> <p>股票選擇權契約之終止上市日，為標的證券於臺灣證券交易所之停止買賣或終止上市日。</p>	<p>配合第四條，新增櫃買中心上櫃普通股得作為股票選擇權標的證券，爰修正第一項第二款至第四款及第二項規定。</p>

