

交易結算部 通知

日期：108 年 5 月 20 日

主旨：臺灣期貨交易所 108 年上半年新制說明(二)

-- 「市價單委託口數控管」暨「鉅額交易制度調整」

說明：

一、依金融監督管理委員會 108 年 5 月 13 日金管證期字第 1080308676 號函及各商品交易規則辦理。

二、市價單委託口數控管

(一)為強化交易人市價委託單之風險管理，臺灣期貨交易所自 108 年 5 月 27 日(星期一)起實施「調降」每筆市價委託單數量上限，如下表說明：

交易時段	一般交易時段		盤後交易時段	
委託單種 商品類別	限價單 一定範圍市價單	市價單	限價單 一定範圍市價單	市價單
股票期貨及選擇權	499 □	10 □	499 □	5 □
期貨商品 (不含股票期貨)	100 □		100 □	
選擇權商品 (不含股票選擇權)	200 □		200 □	

※市價委託單：一般交易時段為 10 口上限、盤後交易時段為 5 口上限

※限價委託單及一定範圍市價委託單之每筆買賣委託單數量上限不變

(二)逐筆撮合時段委託處理優先順序為先到先撮合，一定範圍市價委託撮合順序同於市價委託，且交易人使用一定範圍市價委託單，不需指定委託價格，期交所將以買進(賣出)當時最佳一檔委買(委賣)價格加(減)一定範圍，作為該筆申報之轉換價格，可將成交價格限制於一定範圍內，降低因交易契約流動性較不足或買賣委託量瞬間失衡，產生成交價格大幅偏離原預期價格情況。

故請各業務同仁多提醒告知所屬客戶可利用一定範圍市價委託單取代市價委託單。

三、鉅額交易制度調整

臺灣期貨交易所自 108 年 5 月 27 日(星期一)起實施調整鉅額交易門檻

(一)台指期貨(TX)、小型台指期貨(MTX)、台指選擇權(TXO)商品

商 品	調整前 鉅額交易門檻	調整後 鉅額交易門檻
台指期貨(TX)	200口	100口
小型台指期貨(MTX)	200口	100口
台指選擇權(TXO)	400口	200口

(二)其餘商品

(1)匯率類期貨同一契約 50 口，非匯率類期貨同一契約為 200 口

(2)匯率類選擇權同一契約 100 口，非匯率類選擇權同一契約為 400 口

(三)鉅額交易之契約若為同標的之選擇權及期貨組合，組合中每個選擇權契約皆滿足最低買賣委託口數即可。

(四)台指選擇權(TXO)商品鉅額交易

-->最小買賣升降單位一律調整為 0.1。

※一般交易最小買賣升降單位不變