

交易結算部 通知

日期：108 年 9 月 26 日

主旨：臺灣期貨交易所 108 年下半年新制說明(一)-
「美國那斯達克 100 股價指數期貨」及「櫃買富櫃 200 指數期貨」
商品新上市通知

說明：

一、新上市期貨商品契約規格：

1、「美國那斯達克 100 股價指數期貨」

項目	內容
交易標的	美國那斯達克 100 股價指數
中文簡稱	美國那斯達克 100 期貨
英文代碼	UNF
交易時間	1、本契約之交易日同臺灣期貨交易所營業日 2、 <u>一般交易時段之交易時間為營業日上午 8:45~下午 1:45</u> 3、 <u>盤後交易時段之交易時間為營業日下午 3:00~次日 上午 5:00</u> 4、到期月份契約最後交易日無盤後交易時段
契約價值	本契約指數乘上新臺幣 50 元
最小升降單位	指數 1 點（新臺幣 50 元）
契約到期 交割月份	1、三月、六月、九月、十二月，五個接續的季月 2、新交割月份契約於到期月份契約最後交易日之次一營業日一般交易時段起開始交易
每日結算價	原則上採當日一般交易時段收盤前一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「美國那斯達克 100 股價指數期貨契約交易規則」訂定之
每日漲跌幅	採前一一般交易時段每日結算價 $\pm 7\%$ 、 $\pm 13\%$ 、 $\pm 20\%$ 三階段漲跌幅度限制
最後交易日	到期月份第三個星期五
最後結算日	最後交易日之次一營業日
最後結算價	最後交易日那斯達克交易所(Nasdaq)計算之美國那斯達克 100 股價指數特別開盤價(Special Opening Quotation, SOQ)
交割方式	以現金交割，交易人於最後結算日依最後結算價之差額，以淨額進行現金之交付或收受

2、「櫃買富櫃 200 指數期貨」

項目	內容
交易標的	櫃買富櫃 200 指數
中文簡稱	富櫃 200 期貨
英文代碼	G2F
交易時間	1、本契約之交易日與櫃買中心交易日相同 2、交易時間為營業日 <u>上午 8:45~下午 1:45</u> (※無盤後 T+1 交易時段) 3、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
契約價值	富櫃 200 期貨指數乘上新臺幣 50 元
最小升降單位	指數 1 點 (相當於新臺幣 50 元)
契約到期交割月份	自交易當月起連續三個月份，另加上三、六、九、十二月中三個接續季月，總共六個月份的契約在市場交易
每日結算價	每日結算價原則上採收盤前 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「櫃買富櫃 200 指數期貨契約交易規則」訂定之
每日漲跌幅	最大漲跌幅限制為前一交易日結算價上下百分之十
最後交易日	各契約的最後交易日為各該契約交割月份第 3 個星期三，其次一營業日為新契約的開始交易日
最後結算日	最後結算日同最後交易日
最後結算價	以最後結算日櫃買中心當日交易時間收盤前三十分鐘內所提供標的指數之簡單算術平均價訂之。其計算方式，由臺灣期貨交易所另訂之
交割方式	以現金交割，交易人於最後結算日依最後結算價之差額，以淨額進行現金之交付或收受

二、新商品上市日期：108年9月30日(星期一)

三、新上市商品交易時間

商品名稱	一般交易時段(T)	盤後交易時段(T+1)
美國那斯達克 100 期貨	8:45 ~ 13:45	15:00 ~ 次日 5:00
富櫃 200 期貨	8:45 ~ 13:45	(無)

※美國那斯達克100期貨(UNF)：於盤後T+1交易時段屬於「非豁免代沖銷」商品

四、新上市商品的交割月份：

商品名稱	上市交割月份
美國那斯達克 100 期貨	108 年 12 月、109 年 3、6、9 及 12 月
富櫃 200 期貨	108 年 10、11 及 12 月、109 年 3、6 及 9 月

五、手續費設定：

兩者新商品併同「台東證/道瓊/標普期貨商品」手續費群組收取

手續費申請單	交易所 群組	商品 群組	預設手續費(新台幣)	
			人工	電子
3-8台東證/富櫃200/美股指數	TIM	TJF	50元	50元

六、商品保證金

商品名稱	英文 代碼	幣別	原始保證金	維持保證金
美國那斯達克100期貨	UNF	新台幣(TWD)	22,000	17,000
富櫃200期貨	G2F	新台幣(TWD)	14,000	11,000

七、部位限制

身份別	部位限制口數	
	美國那斯達克 100 期貨	富櫃 200 期貨
自然人	1,000 口	1,000 口
法人	3,000 口	3,000 口

八、鉅額交易：適用鉅額交易。

九、期交稅

商品名稱	英文代碼	幣別	期交稅	備 註
美國那斯達克100期貨	UNF	新台幣(TWD)	十萬分之 2	四捨五入 計算至整數
富櫃200期貨	G2F	新台幣(TWD)	十萬分之 2	四捨五入 計算至整數

※ 期貨契約之期交稅係以契約金額*稅率。

十、當日沖銷作業

美國那斯達克 100 期貨(UNF)及富櫃 200 期貨(G2F)商品

--> **不適用** 當沖交易(保證金減收一半)。

十一、適用相同商品不同契約月份之跨月價差交易(spread order)。

十二、期貨多空留倉部位保證金計收方式(策略保證金計收方式)

1、相同商品價差部位組合保證金（僅適用不同最後結算日之組合）

委託及部位組合	保證金計收方式
買一口美國那斯達克 100 期貨 賣一口美國那斯達克 100 期貨	收取一口美國那斯達克 100 期貨保證金

委託及部位組合	保證金計收方式
買一口富櫃 200 期貨 賣一口富櫃 200 期貨	收取一口富櫃 200 期貨保證金

2、不同商品價差部位組合保證金（相同或不同最後結算日之組合均可適用）

部位組合	保證金計收方式
買一口富櫃 200 期貨 賣一口櫃買期貨	富櫃 200 期貨或櫃買期貨 ->保證金取其高者
賣一口富櫃 200 期貨 買一口櫃買期貨	

※美國那斯達克 100 期貨無適用不同商品價差部位組合方式

十三、新上市之商品合約規格表、一定範圍市價委託加減一定點數之計算方式，

-->請見附件(共計 2 個.pdf 檔案)說明。