

## 主旨：臺灣期貨交易所 2020 下半年新制實施公告

說明：

自 2020 年 11 月 23 日起，臺灣期貨交易所推行新商品及美股指數期貨(UDF、UNF、SPF)到期契約最後交易時間調整

### 一、新商品上市

#### (一)商品規格

項目	內容
交易標的	英國富時 100 指數
中文簡稱	英國富時 100 期貨
英文代碼	F1F
交易時間	本契約之交易日同臺灣期貨交易所營業日 一般交易時段之交易時間為營業日上午 8:45~下午 1:45 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。 ※但到期月份契約最後交易日僅交易至下午 6:15，遇英國夏令期間(British Summer Time)，則為下午 5:15
契約價值	英國富時 100 期貨指數乘上新臺幣 50 元
契約到期 交割月份	三月、六月、九月、十二月，四個接續的季月 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「英國富時 100 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
最小升降單位	指數 1 點（相當於新臺幣 50 元）
最後交易日(註 1)	到期月份第三個星期五
最後結算日(註 2)	最後交易日之次一營業日
最後結算價	最後交易日富時國際有限公司(FTSE International Limited)計算之英國富時 100 指數最後結算價指標(Expiry Value)
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

備註：

1、最後交易日：到期月份第 3 個星期五(到期月份契約交易至 18:15，若遇英國夏令期間，則為 17:15)

(1) 預期國定假日：

※英國假日，標的證券市場休市 ⇨ 提前至前一標的證券市場營業日

※臺灣假日，期貨市場休市 ⇨ 不調整

(2) 非預期假日：如颱風 ⇨ 不調整

2、最後結算日：最後交易日之次一營業日，結算時間為後台收到期交所公布之結算價約上午 9:30 後。

例如：最後交易日為 2020/12/18(五)，則最後結算日為 2020/12/21(一)

(二)保證金計收方式

1、為本公司非強化風險控管措施商品

2、適用相同商品跨越價差部位組合

部位組合	計收方式	備註
買一口英國富時 100 股價指數期貨 賣一口英國富時 100 股價指數期貨	收取一口英國富時 100 股價指數期貨保證金	僅適用不同最後結算日之部位進行減收

(三) 部位限制

交易人類別	自然人	法人	自營商/造市者
部位限制數	1000	3000	9000

(四) 適用鉅額交易

本商品鉅額交易門檻訂為 200 口

(五) 適用動態價格穩定措施

比照其他國外股價指數期貨

	單式買賣申報	組合式買賣申報
退單百分比	2%	1%

(六) 英國富時 100 指數期貨為盤後交易時段非豁免代為沖銷商品

二、 美股指數期貨(UDF、UNF、SPF)到期契約最後交易時間調整

(一) 到期契約最後交易日：

新增夜盤交易，交易時間：15:00-22:30(夏令為 21:30)

(二) 到期契約部位申報錯帳時間：

最後結算日上午 8:00~9:00 止