

檔 號：
保存年限：

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：陳小姐

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3372

受文者：凱基期貨股份有限公司

發文日期：中華民國110年8月11日

發文字號：台期監字第1101001097號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：無

主旨：公告本公司股票期貨及股票選擇權契約之標的證券，經臺灣證券交易所股份有限公司或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心發布為處置之有價證券，股票期貨及股票選擇權契約保證金之處置調整措施修正如說明，並自110年8月27日起實施，請查照。

說明：

- 一、依本公司業務規則第 116條第1項第9款及同規則第117條第1款辦理。
- 二、本公司股票期貨及股票選擇權契約之標的證券，經臺灣證券交易所股份有限公司依「公布或通知注意交易資訊暨處置作業要點」及財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心依「櫃檯買賣公布或通知注意交易資訊暨處置作業要點」（以下簡稱處置作業要點）第6條規定發布為處置之有價證券或對其採取處置措施者，本公司將調整股票期貨及股票選擇權契約之保證金，原則自證券市場處置生效日之次一營業日期貨市場交易時段結束後，開始實施，其處置調整措施修正如下：

(一)依處置作業要點第6條第2項發布為處置之有價證券時，

以其為標的之股票期貨及股票選擇權契約之保證金，調整為當時所屬級距適用比例之1.5倍。

(二)依處置作業要點第6條第3項發布為處置之有價證券時，以其為標的之股票期貨及股票選擇權契約之保證金，調整為當時所屬級距適用比例之2倍。

(三)依處置作業要點第6條第5項採取處置措施之有價證券，除該有價證券經停止一定期間之買賣者外，原則上依最近三十個營業日內第一次、第二次或第三次(含)以上依處置作業要點第6條發布為處置或採取處置措施之有價證券，以其為標的之股票期貨及股票選擇權契約之保證金，分別調整為當時所屬級距適用比例或金額之1.5倍、2倍或3倍。但情節嚴重者，本公司得調整為當時所屬級距適用比例或金額之2倍或3倍。

三、股票期貨及股票選擇權契約之標的證券(包含指數股票型基金受益憑證)符合前揭標準者，本公司將對個別股票期貨及股票選擇權契約另行公告保證金調整情形及實施之起迄日期。

四、為使期貨交易人熟悉上開保證金處置調整措施，以維護期貨交易人權益，謹請貴公司將相關措施轉知期貨交易人。

五、本公司104年7月31日台期監字第10410007970號函自本公告實施日起廢止。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人

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、各業務部門、本公司網站、記者室

2021/08/13
15:49:45
章

總經理 黃炳鈞