

20180122 新商品合約規格

項目	匯率期貨	匯率期貨
中文簡稱	<b>澳幣</b> 兌美元期貨(AUD/USD)	<b>英鎊</b> 兌美元期貨(GBP/USD)
英文代碼	<b>XAF</b>	<b>XBF</b>
交易標的	<b>澳幣</b> 兌美元匯率	<b>英鎊</b> 兌美元匯率
交易日	銀行營業日	銀行營業日
交易時間(註3)	一般時段(T日):上午08:45~下午4:15 盤後時段(T+1日):下午5:25~上午5:00 最後交易日08:00~ <b>下午2:00</b>	一般時段(T日):上午08:45~下午4:15 盤後時段(T+1日):下午5:25~上午5:00 最後交易日08:00~ <b>下午2:00</b>
契約價值/乘數	<b>25,000 澳幣</b>	<b>20,000 英鎊</b>
報價方式	每1 <b>澳幣</b> 兌美元→ <b>美元計價</b>	每1 <b>英鎊</b> 兌美元→ <b>美元計價</b>
升降單位/權利金報價單位(值)	0.0001 <b>USD/ AUD</b> ( <b>2.5 美元</b> )	0.0001 <b>USD/ GBP</b> ( <b>2 美元</b> )
到期月份	四個季月(3、6、9、12季月循環)	四個季月(3、6、9、12季月循環)
每日漲跌幅()	前一交易日結算價上下 <b>3%、5%、7%</b> 最後交易日 <b>3%、5%、12%</b>	前一交易日結算價上下 <b>3%、5%、7%</b> 最後交易日 <b>3%、5%、12%</b>
交割方式(註1)	<b>現金交割</b>	<b>現金交割</b>
每日結算價	收盤前一分鐘內所有交易之 <b>成交量加權平均價</b> ，若無成交價則由期交所訂之	收盤前一分鐘內所有交易之 <b>成交量加權平均價</b> ，若無成交價則由期交所訂之
最後交易日	到期月份第三個星期三	到期月份第三個星期三
最後結算日	同最後交易日	同最後交易日
最後結算價	最後交易日台北時間 <b>下午2時</b> WM/Reuters <b>澳幣</b> 兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數點後4位。(註2)	最後交易日台北時間 <b>下午2時</b> WM/Reuters <b>英鎊</b> 兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數點後第4位。(註2)
交易稅率	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至 <b>小數第2位</b>	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至 <b>小數第2位</b>
一定範圍增加價格	±前一日期貨最近月契約結算價×0.001 若前一日遇最後交易日，則採取前一日次近月 <b>澳幣</b> 兌美元期貨每日結算價	±前一日期貨最近月契約結算價×0.001 若前一日遇最後交易日，則採取前一日次近月 <b>英鎊</b> 兌美元期貨每日結算價
保證金	原始 USD 540,維持 USD 420	原始 USD 750,維持 USD 570
鉅額交易	每筆最低買賣申報數量 50 口	每筆最低買賣申報數量 50 口
部位限制	自然人 1,000 口、法人 3,000 口，自營商/造市 9,000 口	自然人 1,000 口、法人 3,000 口，自營商/造市 9,000 口
	註：(註1) 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。 (註2) 即期匯率中價因故未能於最後結算日期交所執行到期交割作業前產生，或最後結算價顯不合理時，由期交所參酌主要金融資訊系統(如湯森路透或彭博資訊等)揭露之英鎊兌美元及澳幣兌美元匯率市場價格決定之。 (註3) 一般時段於 08:30 開始接受委託[08:45 開盤前兩分鐘禁刪改]，盤後時段於 17:15 開始接受委託[17:25 開盤前兩分鐘禁刪改]。澳幣兌美元期與英鎊兌美元期為非豁免商品須完成盤後交易簽署書才能交易。 <b>[速記]交易稅率百萬分之一，一定範圍千分之一。</b>	

### 107 外匯商品比較 (P.1)

	非豁免商品	非豁免商品	非豁免商品	非豁免商品
項目	匯率期貨	匯率期貨	匯率期貨	匯率期貨
中文簡稱	澳幣兌美元期貨(AUD/USD)	英鎊兌美元期貨(GBP/USD)	歐元兌美元期貨(EUR/USD)	美元兌日圓期貨(USD/JPY)
英文代碼	<b>XAF</b> <b>New!!</b>	<b>XBFB</b> <b>New!!</b>	<b>XEF</b>	<b>XJF</b>
交易標的	美元兌日圓匯率	英鎊兌美元匯率	歐元兌美元匯率	美元兌日圓匯率
交易日	銀行營業日			
交易時間	一般時段(T日)：上午 08:45~下午 4:15；盤後時段(T+1日)：下午 5:25~次日上午 5:00，最後交易日 08:00~ <b>下午 2:00</b>			
契約價值/乘數	<b>25,000 澳幣</b>	<b>20,000 英鎊</b>	<b>20,000 歐元</b>	<b>20,000 美元</b>
報價方式	每 1 澳幣兌美元→ <b>美元計價</b>	每 1 英鎊兌美元→ <b>美元計價</b>	每 1 歐元兌美元→ <b>美元計價</b>	每 1 美元兌日圓→ <b>日圓計價</b>
升降單位/權利金報價單位(值)	0.0001 <b>USD/ AUD</b> <b>(2.5 美元)</b>	0.0001 <b>USD/ GBP</b> <b>(2 美元)</b>	0.0001 <b>USD/ EUR</b> <b>(2 美元)</b>	0.01 <b>JPY/ USD</b> <b>(日圓 200 元)</b>
到期月份	<b>四個季月(3、6、9、12 季月循環)</b>			
<b>每日漲跌幅</b> <b>New!!</b> <b>三階段</b>	前一交易日結算價±3%、±5%、±7%(最後交易日±12%)	前一交易日結算價±3%、±5%、±7%(最後交易日±12%)	前一交易日結算價±3%、±5%、±7%(最後交易日±12%)	前一交易日結算價±3%、±5%、±7%(最後交易日±12%)
交割方式(註 1)	<b>現金交割</b>			
每日結算價	收盤前一分鐘內所有交易之成交量加權平均價，若無成交價則由期交所決定			
最後交易日	到期月份第三個星期三			
最後結算日	同最後交易日			
最後結算價	最後交易日台北時間 <b>下午 2 時</b> WM/Reuters <b>澳幣兌美元</b> 即期匯率中價，四捨五入至小數點後 4 位。(註 2)	最後交易日台北時間 <b>下午 2 時</b> WM/Reuters <b>英鎊兌美元</b> 即期匯率中價，四捨五入至小數點後第 4 位。(註 2)	最後交易日台北時間 <b>下午 2 時</b> WM/Reuters <b>歐元兌美元</b> 即期匯率中價，四捨五入至小數點後第 4 位。(註 2)	最後交易日台北時間 <b>下午 2 時</b> WM/Reuters <b>美元兌日圓</b> 即期匯率中價，四捨五入至小數點後 <b>2 位</b> 。(註 2)
交易稅率	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至 <b>小數第 2 位</b>	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至 <b>小數第 2 位</b>	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至 <b>小數第 2 位</b>	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至 <b>整數位</b>
一定範圍增加價格	± 前一日期貨最近月契約結算價×0.001，若前一日遇最後交易日，則採取前一日次近月期貨每日結算價			
鉅額交易	每筆最低買賣申報數量 50 口			

107 外匯商品比較 (P.2)

	豁免商品	豁免商品	豁免商品	豁免商品
項目	匯率期貨	匯率期貨	匯率選擇權	匯率選擇權
中文簡稱	美元兌人民幣期貨	小型美元兌人民幣期貨	美元兌人民幣選擇權	小型美元兌人民幣選擇權
英文代碼	RHF	RTF	RHO	RTO
交易標的	美元兌人民幣匯率	小型美元兌人民幣匯率	美元兌人民幣匯率匯率	小型美元兌人民幣匯率匯率
交易日	銀行營業日			
交易時間	一般時段(T日)：上午 08:45~下午 4:15；盤後時段(T+1日)：下午 5:25~次日上午 5:00，最後交易日 08:00~ <b>上午 11:00</b>			
契約價值/乘數	<b>100,000 美元</b>	<b>20,000 美元</b>	<b>100,000 美元</b>	<b>20,000 美元</b>
報價方式	1 美元兌人民幣→ <b>人民幣計價</b>		1 美元兌人民幣→ <b>人民幣計價</b>	
升降單位/權利金報價單位(值)	0.0001 <b>CNY/ USD</b> (人民幣 10 元)	0.0001 <b>CNY/ USD</b> (人民幣 2 元)	0.0001 <b>CNY/ USD</b> (人民幣 10 元)	0.0001 <b>CNY/ USD</b> (人民幣 2 元)
到期月份	<b>兩個連續近月與四個季月(3、6、9、12 季月循環)</b>		<b>兩個連續近月與四個季月(3、6、9、12 季月循環)</b>	
每日漲跌幅	前一交易日結算價±3%、±5%、±7% <b>New!!</b> <b>三階段</b>	前一交易日結算價±3%、±5%、±7% <b>New!!</b> <b>三階段</b>	前一交易日一般交易時段同月份美元兌人民幣匯率期貨之每日結算價結算價±7%	前一交易日一般交易時段同月份小型美元兌人民幣匯率期貨之每日結算價結算價±7%
交割方式(註 1)	<b>現金交割</b>		<b>現金交割</b> [符合期交所公告範圍之未沖銷價內部位，於到期日當天自動履約，以現金交付或收受履約價格與最後結算價之差額]	
每日結算價	收盤前一分鐘內所有交易之成交量加權平均價，若無成交價則由期交所 <b>決定</b>		<b>當日之最後一筆撮合成交價無成交價，或前款之結算價顯不合理時，由期交所決定</b>	
最後交易日	到期月份第三個星期三			
最後結算日	同最後交易日			
最後結算價	最後交易日香港財資市場公會 11:30 公布之美元兌人民幣(香港)即期匯率	最後交易日財團法人台北外匯市場發展基金會 11:15 公布之臺灣離岸人民幣定盤匯率	最後交易日香港財資市場公會 11:30 公布之美元兌人民幣(香港)即期匯率	最後交易日財團法人台北外匯市場發展基金會 11:15 公布之臺灣離岸人民幣定盤匯率
交易稅率	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至小數 <b>第 2 位</b>	0.000001，每口契約價值×交易稅率(或到期交割稅率)，四捨五入至小數 <b>第 2 位</b>	0.001，每口契約價值×交易稅率(到期履約指派稅率 0.000001)，四捨五入至小數 <b>第 2 位</b>	0.000001，每口契約價值×交易稅率(到期履約指派稅率 0.000001)，四捨五入至小數 <b>第 2 位</b>
鉅額交易	每筆最低買賣申報數量 50 口		每筆最低買賣申報數量 100 口	