

主 旨：修正「美元兌人民幣匯率期貨契約」等 6 項匯率類期貨契約交易規則與契約規格，並自 114 年 6 月 18 日起實施

說 明：

- 一、依金融監督管理委員會 114 年 6 月 5 日金管證期字第 1140139286 號函辦理。
- 二、為提升匯率類期貨契約跨市場交易與避險之便利性，爰參照國際交易慣例，調整本公司「美元兌人民幣期貨」、「小型美元兌人民幣期貨」、「歐元兌美元期貨」、「美元兌日圓期貨」、「英鎊兌美元期貨」及「澳幣兌美元期貨」等契約最後交易日之相關規定，各契約交易規則與契約規格修正對照表，詳如附件。
- 三、自旨揭實施日起，各匯率類期貨契約最後交易日修正前與修正後適用情形如下：
 - (一)已掛牌及新掛牌契約交割月份為 115 年 6 月(含)以前者，最後交易日適用修正前條文；
 - (二)新掛牌契約交割月份為 115 年 7 月(含)以後者，最後交易日適用修正後條文。
- 四、各交割月份契約最後交易日詳情，請至臺灣期貨交易所網站行事曆(<https://www.taifex.com.tw/cht/4/calendar>) 查詢。

商品名稱	修正後	修正前
美元兌人民幣匯率期貨契約	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三之前二個營業日 最後交易日若為下列情形，其調整方式如下，但臺灣期貨交易所得視情況調整之： 一、遇香港財資市場公會休假日，最後交易日提前至前一同時為香港財資市場公會營業日及臺灣期貨交易所營業日之日。 二、因不可抗力因素未能進行交易，或因其他因素影響本契約之交易或結算，最後交易日則順延次一同時為香港財資市場公會營業日及臺灣期貨交易所營業日之日。	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三
小型美元兌人民幣匯率期貨契約	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三之前二個營業日 最後交易日若因不可抗力因素未能進行交易，或因其他因素影響本契約之交易或結算，最後交易日順延至次一營業日，但臺灣期貨交易所得視情況調整之。	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三
歐元兌美元匯率期貨契約	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三之前二個營業日 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時WMR 歐元兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第4位 最後交易日若為下列情形，其調整方式如下，但臺灣期貨交易所得視情況調整之： 一、遇 WMR 因國際外匯市場休假日，未提供台北時間下午二時歐元兌美元即期匯率中價，最後交易日提前至前一同時為 WMR 歐元兌美元即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。 二、因不可抗力因素未能進行交易，或因其他因素影響本契約之交易或結算，最後交易日則順延至次一同時為 WMR 歐元兌美元即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WM/Refinitiv 歐元兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第4位
美元兌日圓匯率期貨契約	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三之前二個營業日 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WMR 美元兌日圓即期匯率中價，四捨五入至小數第2位 最後交易日若為下列情形，其調整方式如下，但臺灣期貨交易所得視情況調整之： 一、遇 WMR 因國際外匯市場休假日，未提供台北時間下午二時美元兌日圓即期匯率中價，最後交易日提前至前一同時為 WMR 美元兌日圓即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。 二、因不可抗力因素未能進行交易，或因其他因素影響本契約之交易或結算，最後交易日則順延至次一同時為 WMR 美元兌日圓即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WM/Refinitiv 美元兌日圓即期匯率中價，四捨五入至小數第2位
英鎊兌美元匯率期貨契約	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三之前二個營業日 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WMR 英鎊兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第4位 最後交易日若為下列情形，其調整方式如下，但臺灣期貨交易所得視情況調整之： 一、遇 WMR 因國際外匯市場休假日，未提供台北時間下午二時英鎊兌美元即期匯率中價，最後交易日提前至前一同時為 WMR 英鎊兌美元即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。 二、因不可抗力因素未能進行交易，或因其他因素影響本契約之交易或結算，最後交易日則順延至次一同時為 WMR 英鎊兌美元即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WM/Refinitiv 英鎊兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第4位
澳幣兌美元匯率期貨契約	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三之前二個營業日 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WMR 澳幣兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第4位 最後交易日若為下列情形，其調整方式如下，但臺灣期貨交易所得視情況調整之： 一、遇 WMR 因國際外匯市場休假日，未提供台北時間下午二時澳幣兌美元即期匯率中價，最後交易日提前至前一同時為 WMR 澳幣兌美元即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。 二、因不可抗力因素未能進行交易，或因其他因素影響本契約之交易或結算，最後交易日則順延至次一同時為 WMR 澳幣兌美元即期匯率中價預定發布日及臺灣期貨交易所營業日之日。	最後交易日 ● 最後交易日為各該契約交割月份第三個星期三 最後結算價 ● 最後交易日台北時間下午2時 WM/Refinitiv 澳幣兌美元即期匯率中價，四捨五入至小數第4位

期貨交易結算部