

主旨：臺灣生技期貨不再適用美國商品期貨交易委員會(CFTC)交易許可規定

說明：

- 一、依美國商品期貨交易委員會(CFTC) 114 年 7 月 10 日通知辦理。
- 二、臺灣生技期貨標的指數－臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數(臺灣生技指數)最後 25% 權重成分股日均成交值合計持續低於 3 千萬美元，已不符合美國廣基指數(Broad-based security index)定義，經向 CFTC 申報後，CFTC 於 7 月 10 日通知，臺灣生技期貨不再適用 CFTC 交易許可規定。
- 三、依據美國規定，窄基指數期貨由 CFTC 與美國證券管理委員會(SEC)共同管轄：
 - (一)美國投資人不可交易臺灣生技期貨，惟臺灣生技期貨仍符合 SEC 窄基指數期貨豁免規定，合格機構投資人(QIB)不在此限。
 - (二)相關規範請參閱 SEC Release No. 34-60194、CFTC Advisory(<http://www.cftc.gov/idc/groups/public/@internationalaffairs/documents/ssproject/fsfpadvisory.pdf>)，以及臺灣期貨交易所網站「期貨業專區」之「期貨商向美國投資人推廣本公司期貨商品應注意事項」。

期貨交易結算部