

主旨：「電子選擇權」、「金融選擇權」、「半導體 30 期貨」及「航運期貨」適用動態價格穩定措施，自 111 年 6 月 27 日起實施

說明：

- 一、依金融監督管理委員會 111 年 5 月 31 日金管證期字第 1110345591 號函及動態價格穩定措施作業辦法第 9 條第 2 項規定辦理，自 111 年 6 月 27 日起實施。
- 二、配合動態價格穩定措施擴大適用至「電子選擇權」、「金融選擇權」、「半導體 30 期貨」及「航運期貨」。
- 三、適用動態價格穩定措施商品退單點數基準值及退單百分比，如下：

商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比
電子選擇權 金融選擇權	最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2% x Delta絕對值 x 2 Delta絕對值未達0.25者，視為0.25； Delta絕對值逾0.5者，視為0.5
	次近月與第3近月	最近標的指數收盤價	2%

商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比	組合式買賣申報退單百分比
半導體 30 期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	3%	1.5%
航運期貨	所有到期月份	最近標的指數收盤價	3%	1.5%

期貨交易結算部