

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：李承欣

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3139

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國114年7月11日

發文字號：台期企字第1140800429號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：無

主旨：有關本公司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(Commission Certification)規定，請查照。

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、本公司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日通知本公司，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，提醒期貨商應遵循SEC相關規範如下：
 - (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/fsfpadvisor.y.pdf>)，以及本公司網站「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」。

正本：中華民國期貨業商業同業公會、大昌期貨股份有限公司、美好證券股份有限公司、中國信託綜合證券股份有限公司、元大期貨股份有限公司、元大證券股份有限公司、元富期貨股份有限公司、元富證券股份有限公司、台灣摩根士丹利證券股份有限公司、永豐金證券股份有限公司、永豐期貨股份有限公司、玉山綜合證券股份有限公司、兆豐期貨股份有限公司、兆豐證券股份有限公司、合作金庫證券股份有限公司、宏遠證券股份有限公司、亞東證券股份有限公司、法銀巴黎證券股份有限公司、花旗環球證券股份有限公司、美林證券股份有限公司、國泰期貨股份有限公司、國泰綜合證券股份有限公司、國票期貨股份有限公司、國票綜合證券股份有限公司、康和期貨股份有限公司、第一金證券股份有限公司、統一期貨股份有限公司、統一綜合證券股份有限公司、凱基期貨股份有限公司、凱基證券股份有限公司、富邦期貨股份有限公司、富邦綜合證券股份有限公司、華南永昌綜合證券股份有限公司、華南期貨股份有限公司、新光證券股份有限公司、群益期貨股份有限公司、摩根大通證券股份有限公司、澳帝華期貨股份有限公司、台新期貨股份有限公司、群益金鼎證券股份有限公司

副本：

總經理 周建隆