

臺灣證券交易所股份有限公司
認購(售)權證買賣辦法部分修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第四條</p> <p>委託人初次買賣認購(售)權證時，除專業機構投資人外，應簽具風險預告書，證券經紀商始得接受其委託。</p> <p>(以下略)</p>	<p>第四條</p> <p>委託人初次買賣認購(售)權證時，除專業機構投資人外，應簽具風險預告書，證券經紀商始得接受其委託。<u>但專業機構投資人初次買賣以指數股票型期貨信託基金為標的之認購(售)權證時，應簽具風險預告書，證券經紀商始得接受其委託。</u></p> <p>(以下略)</p>	<p>本公司「受益憑證買賣辦法」第三條規範專業機構投資人於期貨ETF上市後買賣得免簽署風險預告書，爰配合刪除第一項所訂專業機構投資人初次買賣以期貨ETF為標的之權證時，應簽具風險預告書，證券經紀商始得接受其委託之規定。</p>
<p>第七條</p> <p>認購(售)權證每日之升降幅度，依其種類按下列方式計算之。</p> <p>一、以國內個股及經本公司公告之指數股票型證券投資信託基金或指數股票型期貨信託基金為標的之認購(售)權證，按下列公式計算：</p> <p>(一) 認購權證漲停價格＝當日開盤競價基準＋(標的證券當日漲停價格－標的證券當日開盤競價基準)×行使比例</p> <p>跌停價格＝當日開盤競價基準－(標的證券當日開盤競價基準－標的證券當日跌停價格)×行使比例</p> <p>(二) 認售權證漲停價格＝當日開盤競價基準＋(標的證券當日開盤競價基準－標的證券當日跌停價格)×行</p>	<p>第七條</p> <p>認購(售)權證每日之升降幅度，依其種類按下列方式計算之。</p> <p>一、以國內個股及經本公司公告之指數股票型證券投資信託基金或指數股票型期貨信託基金為標的之認購(售)權證，按下列公式計算：</p> <p>(一) 認購權證漲停價格＝當日開盤競價基準＋(標的證券當日漲停價格－標的證券當日開盤競價基準)×行使比例</p> <p>跌停價格＝當日開盤競價基準－(標的證券當日開盤競價基準－標的證券當日跌停價格)×行使比例</p> <p>(二) 認售權證漲停價格＝當日開盤競價基準＋(標的證券當日開盤競價基準－標的證券當日跌停價格)×行</p>	<p>配合前開買賣辦法第八條未限定期貨ETF僅得追蹤國外商品期貨指數，爰修正第一項第四款規定。</p>

<p>使比例 $\text{跌停價格} = \text{當日開盤競價基準} - (\text{標的證券當日漲停價格} - \text{標的證券當日開盤競價基準}) \times \text{行使比例}$</p> <p>二、證券組合之認購（售）權證，則以其組合中各證券分別計算「（標的證券當日漲停價格－標的證券當日開盤競價基準）×組合內各標的證券行使比例之合計」及「（標的證券當日開盤競價基準－標的證券當日跌停價格）×組合內各標的證券行使比例之合計」，取其最大者，比照前款公式計算漲跌停價格。</p> <p>三、以經本公司公告之發行量加權股價指數及產業分類指數為標的之指數型認購（售）權證，按下列公式計算：</p> <p>（一）認購（售）權證漲停價格＝當日開盤競價基準＋（前一日標的指數之收盤指數×每點對應金額×行使比例×10％）。</p> <p>（二）認購（售）權證跌停價格＝當日開盤競價基準－（前一日標的指數之收盤指數×每點對應金額×行使比例×10％）。</p> <p>四、以國外成分證券指數股票</p>	<p>使比例 $\text{跌停價格} = \text{當日開盤競價基準} - (\text{標的證券當日漲停價格} - \text{標的證券當日開盤競價基準}) \times \text{行使比例}$</p> <p>二、證券組合之認購（售）權證，則以其組合中各證券分別計算「（標的證券當日漲停價格－標的證券當日開盤競價基準）×組合內各標的證券行使比例之合計」及「（標的證券當日開盤競價基準－標的證券當日跌停價格）×組合內各標的證券行使比例之合計」，取其最大者，比照前款公式計算漲跌停價格。</p> <p>三、以經本公司公告之發行量加權股價指數及產業分類指數為標的之指數型認購（售）權證，按下列公式計算：</p> <p>（一）認購（售）權證漲停價格＝當日開盤競價基準＋（前一日標的指數之收盤指數×每點對應金額×行使比例×10％）。</p> <p>（二）認購（售）權證跌停價格＝當日開盤競價基準－（前一日標的指數之收盤指數×每點對應金額×行使比例×10％）。</p> <p>四、以國外成分證券指數股票</p>	
---	---	--

<p>型證券投資信託基金、追蹤國外期貨指數之指數股票型期貨信託基金、境外指數股票型基金及外國證券或指數為標的之認購（售）權證，均採無升降幅度限制。</p> <p>（以下略）</p>	<p>型證券投資信託基金、追蹤國外<u>商品</u>期貨指數之指數股票型期貨信託基金、境外指數股票型基金及外國證券或指數為標的之認購（售）權證，均採無升降幅度限制。</p> <p>（以下略）</p>	
--	---	--