

臺灣期貨交易所股份有限公司

中華民國十年期政府債券期貨契約規格

項 目	內 容
中文簡稱	■ 十年期公債期貨
英文代碼	■ GBF
交易標的	■ 面額五百萬元，票面利率 3%之十年期政府債券
可交割債券	■ 依本公司公告符合「到期日距交割日在八年六個月年以上十年以下，一年付息一次，到期一次還本，發行時償還期限為十年，或增額發行時原始公債償還期限為十年」之中華民國政府中央登錄公債
契約到期交割月份	■ 交易當月起接續之三個季月(三、六、九、十二季月循環)
報價方式	■ 百元報價
最小升降單位	■ 每百元 0.005 元(每一契約最小變動值為 250 元)
交易時間	■ 財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心債券等殖成交系統營業日上午八時四十五分至下午一時四十五分 ■ <u>到期月份契約於最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至中午十二時</u>
每日結算價	■ 每日結算價採收盤時段成交價 ■ 若當日收盤時段無成交價，則依「臺灣期貨交易所股份有限公司中華民國十年期政府債券期貨契約交易規則」訂定之
每日漲跌幅	■ 以前一交易日結算價上下各新臺幣三元為限
最後交易日	■ 交割月份第二個星期三
交割方式	■ 實物交割
交割日	■ 最後交易日後之第二個營業日
最後結算價	■ 以最後交易日收盤前十五分鐘內所有交易之成交量加權平均價訂之，但該時段內不足二十筆交易者，以當日最後二十筆交易剔除最高及最低各二筆交易後之成交量加權平均價替代之。當日交易不足二十筆者，以當日實際交易之成交量加權平均價替代之 ■ 當日交易時間內無成交價，或前項之最後結算價顯不合理時，由本公司決定之
部位限制	■ 單一月份不超過 1,000 口；各月份合計不超過 2,000 口
保證金	■ 期貨商向交易人收取之交易保證金及保證金追繳標準，不得低於本公司公告之原始保證金及維持保證金水準 ■ 本公司公告之原始保證金及維持保證金，以「臺灣期貨交易所股份有限公司結算保證金收取方式及標準」計算之結算保證金為基準，按本公司訂定之成數加成計算之