**財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心**

**指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台作業辦法總說明**

為發展指數股票型基金受益憑證市場，提升其鉅額交易效率與資訊透明度，爰建置指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台（以下簡稱本平台），透過公開詢價管道，以利市場參與者尋找鉅額交易對象，並訂定「指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台作業辦法」（以下簡稱本作業辦法）以茲遵循。

本作業辦法共十三條，條文要點臚列如下：

1. 揭櫫本作業辦法訂定之意旨。（第一條）
2. 明定參加人使用本平台應遵循之規定。（第二條）
3. 明定參加人之資格。（第三條）
4. 明定得於本平台上詢價之有價證券種類。（第四條）
5. 明定本平台之詢價及回應時間。（第五條）
6. 明定參加人詢價申報數量應符合本中心上櫃證券鉅額買賣辦法之規定。（第六條）
7. 明定本平台詢價申報買賣價格之規範。（第七條）
8. 明定本平台之詢價或回應價格方式。（第八條）
9. 明定參加人已合意之價格，得經雙方同意後，向本中心申請取消。（第九條）
10. 明定參加人雙方合意價格後，應通知證券經紀商將該合意價格及數量以配對交易方式申報鉅額交易。（第十條）
11. 明定本平台收取業務服務費之期日及計算方式。（第十一條）
12. 明定參加人有違規之情事者，本中心得視其情節重大程度，限制或停止該參加人參與本平台之權利。（第十二條）
13. 本作業辦法之實施及修正程序。（第十三條）

**財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心**

**指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台作業辦法**

**金融監督管理委員會112年12月29日金管證投字第1120356284號函同意照辦**

| 條 文 | 說 明 |
| --- | --- |
| 第一條  為發展指數股票型基金受益憑證市場，提升其鉅額交易效率與資訊透明度，特訂定本辦法。 | 揭櫫本作業辦法訂定之意旨。 |
| 第二條  使用財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心（以下簡稱本中心）指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台（以下簡稱本平台），除主管機關暨相關法令另有規定外，應依本辦法規定辦理。 | 明定參加人使用本平台應遵循之規定。 |
| 第三條  本辦法所稱參加人，係指已與本中心簽訂「參加指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台契約」之專業機構投資人。  前項專業機構投資人係指境外結構型商品管理規則第三條第三項第一款所稱之專業機構投資人。  第一項「參加指數股票型基金受益憑證鉅額詢價平台契約」由本中心另訂之。 | 明定參加人之資格。 |
| 第四條  得於本平台詢價之有價證券為櫃檯買賣之國內外債券成分指數股票型基金受益憑證。 | 明定得於本平台上詢價之有價證券種類。 |
| 第五條  本平台之詢價及回應時間為上午八時至下午四時。 | 明定本平台之詢價及回應時間。 |
| 第六條  本平台詢價申報買賣之數量應達五百申報單位以上，以一千受益權單位為一申報單位。但詢價申報買賣總金額達一千五百萬以上者，不受最低申報買賣數量限制。 | 考量建置本平台係為提升國內指數股票型基金受益憑證鉅額交易效率與資訊透明度，爰訂定參加人詢價申報數量應符合本中心上櫃證券鉅額買賣辦法之規定。 |
| 第七條  本平台之申報買賣價格，以每受益權單位為準；申報買賣價格之升降單位為一分。 | 考量本平台係提供鉅額交易詢價，爰參考本中心上櫃證券鉅額買賣辦法第三條之一第三項規定，訂定本平台詢價申報買賣價格之規範。 |
| 第八條  本平台之詢價買賣或回應價格申報，應依本平台指定項目輸入。  參加人使用本平台應依下列規定辦理詢價或回應價格：   1. 回價者得於收到詢價5分鐘內回應價格，超過5分鐘未回應或拒絕者，本平台逕行取消之。 2. 詢價者對回價者所提供之買賣價格於5分鐘內接受即為合意；詢價者超過5分鐘未接受或拒絕者，本平台逕行取消之。詢價者未接受或拒絕前，回價者得於首次回應價格5分鐘內取消或修改其回應之買賣價格。 | 明定本平台之詢價或回應價格作業及時效原則：   1. 詢價單5分鐘有效：超過5分鐘未獲回應或拒絕者，由平台逕行取消該詢價資料。 2. 回應價格單5分鐘有效：詢價者得於收到回應報價後5分鐘內接受或拒絕該回應報價，超過5分鐘未接受或拒絕者，由平台逕行取消該報價及詢價資料。惟詢價者尚未接受或拒絕該回應報價前，回價者得於前述5分鐘之效期內取消或持續修改其回應之買賣報價。 |
| 第九條  參加人依前條合意者，得經他方同意後，於申報鉅額交易前，向本中心申報取消合意 (以下簡稱改帳)。  前項改帳作業應由雙方出具書面證明文件為之。 | 明定參加人已合意之價格，得經雙方同意後，於申報鉅額交易前，向本中心申請取消。 |
| 第十條  參加人雙方依第八條合意，應各別通知其證券經紀商於約定日以配對交易方式申報鉅額交易，並悉依本中心上櫃證券鉅額買賣辦法辦理。但依第九條改帳者不在此限。 | 考量建置本平台係為提升國內指數股票型基金受益憑證鉅額交易效率與資訊透明度，爰訂定參加人雙方合意價格後，應通知證券經紀商將該合意價格及數量以配對交易方式申報鉅額買賣，且相關鉅額買賣申報應依本中心上櫃證券鉅額買賣辦法有關配對交易之規定辦理。另若參加人雙方合意後復依第九條同意取消合意，則無應申報鉅額買賣之交易，爰訂定本條但書。 |
| 第十一條  參加人使用本平台，應按其當月合意筆數，依本中心公告費率於次月十日前向本中心繳交業務服務費。  前項業務服務費之上限由本中心另訂之。 | 明定本平台收取業務服務費之期日及計算方式。本中心將於系統上線前及日後定期公告適用之業務服務費費率。 |
| 第十二條  參加人有下列情事之一者，本中心得視其情節重大程度，限制或停止該參加人參與本平台之權利：   1. 申報改帳有虛偽不實者。 2. 違反第十條者。 3. 違反第十一條者。 | 為強化對參加人之管理，爰訂定參加人有違規之情事，本中心得視其情節重大程度，限制或停止該參加人參與本平台之權利之處置。 |
| 第十三條  本辦法報請主管機關核定後公告施行，修正時亦同。 | 訂定本作業辦法之實施及修正程序。 |