

ISSN 1015-0765

法規資源引介

第 119 輯

101 年 11 月

期貨交易法

立法院國會圖書館編印

東吳大學法律學系副教授洪秀芬審訂

法規資源引介係以某一法案為主題，將與此一主題相關的各種書目資料輯錄成篇，作一綜合簡介。其來源包括中外法規、圖書、期刊論文、博碩士論文、研究報告、報章以及相關之網站資源等。綜其目的，在於有系統地提供有關此一主題的各種資料檢閱，俾對某一法律之立法程序暨其學理背景有一深入瞭解，同時亦可作為今後在修訂或研究相關法律問題的參考。

編輯要點：

- (一) 輯錄之各種書目資料，大部分可在國家圖書館或本院國會圖書館網站查詢。
- (二) 輯錄之每一書目資料，均經初步分析，分以「非常適用」、「適用」、「論題廣泛」、「論題專精」、「相關可備參考」等簡語標示其與主題的相關程度，俾於參考時有所選擇。
- (三) 輯錄之各種資料及其分析，均經有關之學者專家審閱，尚祈宏達之士，隨時賜教指正。

刊名：法規資源引介
輯次：第 119 輯
出版機關：立法院國會圖書館
地址：臺北市中山南路 1 號
網址： http://npl.ly.gov.tw
編輯者：立法院國會圖書館
出版年月：中華民國 101 年 11 月
創刊年月：中華民國 75 年 10 月
工本費：20 元

簡 述

「期貨」顧名思義就是遠期交運貨品，它是由交易所所制定的標準定型化合約，在「期貨交易法」及交易所之規範與督導管理下，期貨交易具備十足法律契約的保障與約束，同時也規範交割及清算之權利與義務。

我國期貨市場之建置與發展，係從國外而至國內，先行開放國外期貨交易而後建立本國市場，相關法律之制定，係由「國外期貨交易法」逐步轉至「期貨交易法」規範，充分顯示我國期貨市場發展由國際化而國內化的經驗歷程。

民國 86 年 3 月 4 日「期貨交易法」制定通過後，主管機關即依其建構期貨交易體系，陸續訂定有關期貨事業之各項法令，逐步完備我國期貨市場之運作模式及典章制度，並致力推動國際交流與國際合作，期能為臺灣期貨市場注入新活力。

現行「期貨交易法」全文計有 9 章 125 條，各章節名稱如下：

第一章：總則（第 1~6 條）

第二章：期貨交易所

第一節：通則（第 7~20 條）

第二節：會員制期貨交易所（第 21~33 條）

第三節：公司制期貨交易所（第 34~44 條）

第三章：期貨結算機構（第 45~55 條）

第四章：期貨業

第一節：期貨商（第 56~79 條）

第二節：槓桿交易商（第 80~81 條）

第三節：期貨服務事業（第 82~88 條）

第五章：同業公會（第 89~94 條）

第六章：監督與管理

第一節：監督（第 95~103 條）

第二節：管理（第 104~108 條）

第七章：仲裁（第 109~111 條）

第八章：罰則（第 112~120 條）

第九章：附則（第 121~125 條）

本法於民國 86 年 3 月 4 日制定，期間歷經民國 91 年、99 年二次修正，其制定過程如下：

民 86.03.04 制定全文 125 條

民 86.03.26 總統公布

民 86.06.01 施行

民 91.05.14 修正第 119, 125 條
增訂第 97 之 1 條

民 91.06.12 總統公布

民 99.05.18 修正第 4 條

民 99.06.09 總統公布

一、中文法規

1.期貨交易法相關法令：

(1)證券投資人及期貨交易人保護法

(2)仲裁法

(3)期貨交易稅條例

(4)期貨交易所管理規則

(5)期貨結算機構管理規則

(6)期貨商管理規則

(7)期貨商負責人及業務員管理規則

(8)期貨信託基金管理辦法

(9)大陸地區投資人來臺從事證券投資及期貨交易管理辦法

(10)期貨交易所設立標準

(11)期貨結算機構設置標準

(12)期貨商設置標準

(13)證券業暨期貨業個人資料檔案安全維護計畫標準

(14)台灣期貨交易所股份有限公司業務規則

- (15)期貨交易所暨結算機構非股東
（會員）董事及監察人遴選辦法
- (16)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
- (17)檳榔交易商管理規則
- (18)期貨信託事業募集期貨信託基金
公開說明書應行記載事項準則
- (19)期貨業商業同業公會管理規則

2. < 香港 >

證券及期貨條例

來源：

<http://www.legislation.gov.hk/09/chi/pdf.htm>

二、 外文法規

< 美國 >

- 1.Futures Trading Practices Act of 1992
- 2.Commodity Future Modernization Act
of 2000
- 3.Commodity Exchange Act

來源：

<http://www.cftc.gov/LawRegulation/CommodityExchangeAct/index.htm>

< 日本 >

- 1.商品取引所法
- 2.證券取引法
- 3.金融先物取引法

來源：

<http://www.meti.go.jp/policy/commerce/b00/pdf/b0000008.pdf>
<http://www.fsa.go.jp/common/diet/164/i>

ndex.html

< 新加坡 >

- 1.Securities and Futures Act
- 2.Commodity Trading Act

來源：

<http://statutes.agc.gov.sg/aol/home.w3p>

三、 圖書

- 1. 臺灣期貨交易所 100 年度年報／
臺灣期貨交易所著。——臺北市：
臺灣期貨交易所, 2012.06
(適用)
- 2. 期貨與選擇權—策略型交易與套
利實務／廖四郎；王昭文著。——
臺北市：新陸書局, 2012
(相關可備參考)
- 3. 期貨與選擇權：衍生性金融商品
入門經典 3 版／黃昱程著。——臺
北市：華泰文化, 2012
(相關可備參考)
- 4. 期貨與選擇權辭典：適用台灣與
美國市場／盧飛山編著。——新北
市：盧飛山, 2011
(適用)
- 5. 期貨交易法規／嚴盛堂著。——臺
北市：高點, 2010.01
(非常適用)
- 6. 期貨商依法提列損失準備之研究
／李秀玲計畫主持。——臺北市：
中華民國期貨業商業同業公會,

- 2009
(非常適用)
7. 期貨商之資金運用效率與風險管理之研究／林蒼祥等主持。——臺北市：臺灣期貨交易所, 2008
(非常適用)
 8. 期貨商資本適足規範與經營風險管控之研究／陳樹計畫主持。——臺北市：臺灣期貨交易所, 2008
(非常適用)
 9. 應用衍生性金融商品：期貨、選擇權、與交換／Richard J. Rendleman, Jr. 著；陳雅琴譯。——臺北市：學富文化, 2007
(相關可備參考)
 10. 期貨商承作店頭衍生性商品之可行種類及配套措施研究報告／李存修主持。——臺北市：中華民國期貨商業同業公會, 2007
(適用)
 11. 期貨、選擇權與其他衍生性商品／林蒼祥等著。——臺北市：中華民國證券暨期貨市場發展基金會, 2006
(適用)
 12. 期貨市場遇系統性風險或缺乏流動性等狀況之處置措施／周行一等主持。——臺北市：臺灣期貨交易所, 2006
(適用)
 13. 期貨交易契約每日結算價決定方式與結算會員部位集中度管理作業之研究／李存修計畫主持。——臺北市：臺灣期貨交易所, 2005
(適用)
 14. 期貨商監理與風險管理／沈中華等主持。——臺北市：臺灣期貨交易所, 2005
(非常適用)
 15. 期貨市場風險管理的法律機制研究／李明良著。——北京市：北京大學出版社, 2005
(適用)
 16. 期貨市場交割結算基金總額計算方式之研究／陳威光計畫主持。——臺北市：臺灣期貨交易所, 2004
(適用)
 17. 選擇權交易之理論與實務／李存修著。——臺北市：新陸書局, 2002
(相關可備參考)
 18. Currency trading in the forex and futures markets / Carley Garner.-- New Jersey : FT Press, 2012
(相關可備參考)
 19. Trading futures for dummies / Joe Duarte, MD.-- Hoboken, New Jersey : Wiley Publishing, Inc., 2011
(相關可備參考)
 20. Accounting for investments, equities, futures and options / R. Venkata Subramani.-- Hoboken, New Jersey : John Wiley&Sons, Inc., 2011
(適用)

21. How buying and selling futures work / Susan Meyer.-- New York, N.Y. : The Rosen Publishing Group Inc., 2011
(相關可備參考)
22. High probability trading strategies : entry to exit tactics for the forex, futures, and stock markets / Miner, Robert C.-- Hoboken, New Jersey : John Wiley&Sons, Inc., 2009
(相關可備參考)
23. Commodity options : trading and hedging volatility in the world's most lucrative market / Carley Garner ; Paul Brittain.-- New Jersey : FT Press, 2009
(相關可備參考)
24. The complete guide to investing in commodity trading and futures : how to earn high rates of returns safely / Mary B. Holihan.-- Florida : Atlantic Publishing Group, Inc., 2008
(相關可備參考)
25. The Commodity Futures Trading Commission / Jason H. Burns.-- New York : Nova Publishers, Inc., 2008
(適用)
26. Commodity exchanges and futures trading-principles and operating methods / Julius B. Baer.-- Lightning Source Incorporated, 2008
(適用)
27. Timing techniques for commodity futures markets : effective strategy and tactics for short-term and long-term traders / Colin Alexander.-- New York : McGraw-Hill Prof Med/Tech, 2007
(相關可備參考)
28. The complete guide to futures trading : what you need to know about the risks and rewards / Lind-Waldock.-- Hoboken, New Jersey : John Wiley&Sons, Inc., 2006
(適用)
29. Trading stir futures: an introduction to short-term interest rate futures / Stephen Aikin.-- Hampshire : Harriman House Limited, 2006
(相關可備參考)
30. Stock index futures / Charles M. S. Sutcliffe.-- Burlington : Ashgate Publishing, Ltd, 2006
(相關可備參考)
31. CBOT handbook of futures and options / Cbot.-- New York : McGraw-Hill Prof Med/Tech, 2006
(適用)
32. Trading commodities and financial futures : a step-by-step guide to mastering the markets, third edition / Kleinman, George.-- New Jersey : FT Press, 2004
(相關可備參考)
33. Cybernetic analysis for stocks and futures : cutting-edge dsp technology to improve your trading / Ehlers, John F.-- New York : Wiley trading, 2004
(相關可備參考)
34. Mastering futures trading / Bo Yoder.-- New York : McGraw-Hill Prof Med/Tech, 2004

(相關可備參考)

35. The complete guide to single stock futures / Russell R Wasendorf ; Elizabeth Thompson.-- New York : McGraw-Hill Prof Med/Tech, 2003
(相關可備參考)
36. Fundamentals of trading energy futures & options / Steven Errera ; Stewart L. Brown.-- PennWell Books, 2002
(相關可備參考)
37. Options on futures : new trading strategies / John F. Summa ; Jonathan W. Lubow.-- Hoboken, New Jersey : John Wiley&Sons, Inc., 2002
(相關可備參考)
38. Single stock futures / Patrick Lafferty.-- New York : McGraw-Hill Prof Med/Tech, 2002
(相關可備參考)
39. Starting out in futures trading / Mark Powers.-- New York, N.Y. : McGraw-Hill Professional, 2001
(相關可備參考)
40. The guide to electronic futures trading / Scott Slutsky ; Darrell Jobman.-- New York : McGraw-Hill, 2000
(相關可備參考)
41. Day trade futures online / Larry Williams.-- Hoboken, New Jersey : John Wiley&Sons, Inc., 2000
(相關可備參考)

四、期刊論文

1. 論中國大陸期貨犯罪的立法完善／康均心；吳鳳 月旦財經法雜誌 29 2012.06 頁 5-25
(論題專精)
2. 「證券投資人及期貨交易人保護法」之發展及演變／殷若瑛 證券暨期貨月刊 29:12 2011.12 頁 24-34
(相關可備參考)
3. 臺灣發展溫室氣體排放權期貨交易之可行性研究／王京明；許志義；羅時芳；陳美源；柯郁琳 臺灣銀行季刊 62:4 2011.12 頁 37-69
(相關可備參考)
4. 我國期貨市場之建置／涂秋玲 證券暨期貨月刊 29:11 2011.11 頁 41-60
(適用)
5. 國安基金干預成效與期貨交易人過度反應／黃柏凱 財務金融學刊 19:3 2011.09 頁 41-80
(相關可備參考)
6. 營利事業最低稅負制之政策效果—兼論復徵證券期貨交易所得稅／林靖傑；郭明憲；簡清源；黃國芬 財稅研究 42:6 2010.11 頁 189-213
(論題廣泛)

7. 股票期貨上市後對信用交易可能之影響／李宏達 證交資料 580 2010.08 頁 56-76
(相關可備參考) 2009.08 頁 5-11 (適用)
8. 有價證券抵繳保證金制度下期貨保證金專戶運用之法律探討／武永生；袁義昕 臺灣期貨與衍生性商品學刊 10 2010.06 頁 135-171
(適用)
9. 證券投資人及期貨交易人保護法修正之分析／劉其昌 臺灣經濟金融月刊 46:3=542 2010.03 頁 54-76
(適用)
10. 全球股票期貨發展概況／廖進和 證券暨期貨月刊 28:3 2010.03 頁 5-11
(相關可備參考)
11. 我國期貨市場推出股票期貨契約之規劃與實施／裴高正 證券暨期貨月刊 28:3 2010.03 頁 12-21
(相關可備參考)
12. 開放槓桿交易商之研究／蔡朝安；賴宗羲 臺灣期貨與衍生性商品學刊 9 2009.12 頁 130-157
(非常適用)
13. 「證券投資人及期貨交易人保護法」最新修正介紹／林昌億 證券暨期貨月刊 27:8 2008.12 頁 165-189
(適用)
14. 期貨交易之市場資料揭露速度與關鍵因素研究／游張松；張耀鴻 臺灣期貨與衍生性商品學刊 8 2009.06 頁 112-136
(相關可備參考)
15. 我國期貨交易稅之探討／何依倫 財稅研究 41:3 2009.05 頁 129-158
(相關可備參考)
16. 我國期貨市場結算新制度簡介／林靜怡；裴高正 證券暨期貨月刊 27:4 2009.04 頁 5-14
(適用)
17. 證券商兼營期貨業務範圍、持有外幣存款額度及經營期貨交易輔助業務之業務範圍／敬業會計 337 2009.02 頁 23
(相關可備參考)
18. 推動調降期貨交易稅之必要性及成效／翁谷倫 證券暨期貨月刊 26:12 2008.12 頁 37-43
(相關可備參考)
19. 海峽兩岸期貨市場相互開放探討研究報告／胡俞越 臺灣期貨與衍生性商品學刊 7 2008.12 頁 165-189
(適用)

20. 商品投資流量的真相與謬論—
解開期貨交易謎團／楊舒娟
臺灣期貨季刊 7 2008.10
頁 54-61
(相關可備參考)
21. 臺灣期貨交易者與市場報酬之
互動關係／林昭賢；許溪南；
李宏志 財務金融學刊 16:3
2008.09 頁 149-172
(相關可備參考)
22. 我國期貨市場的現況分析與未
來發展／婁天威 會計與財金
研究 1:1 2008.07 頁 9-21
(適用)
23. 期貨交易與波動間之動態關
係：避險與投機目的／李瑞
琳；杜沛穠 財金論文叢刊
8 2008.06 頁 122-141
(相關可備參考)
24. 幫助交易人研判市場動向—揭
露三大法人期貨交易資訊／吳
承康；許淑琇；簡美雲 臺灣
期貨季刊 5 2008.04 頁
28-35
(相關可備參考)
25. 期貨信託事業法規制對期貨信
託基金市場的影響—以日本與
臺灣的比較法分析為基礎／李
福隆 證券暨期貨月刊 26:3
2008.03 頁 28-35
(適用)
26. 臺灣期貨交易所「期貨商品造
市者制度」簡介／楊朝舜 證
券暨期貨月刊 26:2 2008.02
頁 6-10
(適用)
27. 臺灣期貨交易所「期貨商品跨
月價差委託機制」簡介／張書
瑜 證券暨期貨月刊 26:2
2008.02 頁 11-21
(適用)
28. 臺灣期貨交易所「非金電期貨
暨選擇權契約」及「櫃買期貨
暨選擇權契約」經濟效益與公
共利益之論述／謝侑樺 證券
暨期貨月刊 25:12 2007.12
頁 20-26
(論題廣泛)
29. 淺析期貨交易人處理交易糾紛
之方式／劉純斌 今日合庫
33:10=394 2007.10 頁 4-24
(非常適用)
30. 期貨交易人如何面對交易糾紛
以維護自身權益／劉純斌 臺
灣經濟金融月刊 43:9=512
2007.09 頁 57-72
(非常適用)
31. 我國期貨交易全權委託法制之
改革芻議—兼論全方位資產管
理法制之展望／蔡昌憲 全國
律師 11:9 2007.09 頁
72-82
(非常適用)
32. 邁向我國期貨市場發展新紀元

- 一法人機構參與期貨交易現況
與挑戰／林家瑋 臺灣經濟研
究月刊 30:7=355 2007.07
頁 46-51
(相關可備參考)
33. 論證券投資人及期貨交易人保
護法第 28 條團體訴訟之既判力
主觀範圍—新創特定給付訴訟
之判決不完全對世效，或擴張
爭點效使及於原告方當事人不
同之後訴／俞力華 律師雜誌
334 2007.07 頁 84-91
(適用)
34. 期貨交易人如何保護自身權益
／劉純斌 今日合庫
33:5=389 2007.05 頁 4-18
(非常適用)
35. 簡介主要國家對以期貨交易為
主之集合投資計畫之規範／古
坤榮 證券暨期貨月刊 25:2
2007.02 頁 13-36
(適用)
36. 美國期貨交易全權委託之規範
概論—以期貨交易顧問 (CTA)
為中心／蔡昌憲 律師雜誌
329 2007.02 頁 41-55
(相關可備參考)
37. 臺灣期貨市場如何提升國際競
爭力與創造市場交易量／何鴻
聖 臺灣期貨與衍生性商品學
刊 4 2006.12 頁 112-116
(適用)
38. 最低稅負制之證券及期貨交易
得／余文彬 稅務旬刊 1976
2006.08 頁 11-14
(相關可備參考)
39. 開放外資以非避險目的及以綜
合帳戶從事我國期貨交易暨美
元計價期貨商品簡介／詹佳婷
證券暨期貨月刊 24:6
2006.06 頁 40-45
(相關可備參考)
40. 臺灣地區期貨交易開放對漲跌
停板股票價格波動之影響／楊
踐為；劉淑琴 僑光學報 27
2006.06 頁 67-81
(相關可備參考)
41. 證券投資人及期貨交易人保護
基金制度之介紹／林俊宏 證
交資料 530 2006.06 頁
2-38
(適用)
42. 開放外資參與我國期貨交易對
我國金融市場之影響／周行
一；游智賢；林岳喬 臺灣期
貨與衍生性商品學刊 3
2005.12 頁 28-38
(適用)
43. 期貨交易的資金策略／陳泰全
國際投資月刊 41 2005.12
頁 8-9
(相關可備參考)
44. 期貨商監理與風險管理／沈中
華；張大成；柯瓊鳳 臺灣期

- 貨市場 7:6 2005.11 頁
3-14
(非常適用)
45. 關於常見之地下期貨違法類型
之研究—臺灣高等法院九十二
年度上訴字第六〇八號判決評
釋／莊深淵 證券暨期貨月刊
23:7 2005.07 頁 24-34
(非常適用)
46. 論期貨商保證金風險控管／李
惠華 證券暨期貨月刊 23:6
2005.06 頁 33-40
(適用)
47. 交易稅政策對臺灣期貨市場效
率績效之影響／李瑞琳；薛立
言 財金論文叢刊 2
2005.06 頁 117-131
(相關可備參考)
48. 期貨交易犯罪與偵查實務之研
究／洪漢周 警學叢刊
35:5=159 2005.03 頁
231-257
(適用)
49. 我國期貨市場交易撮合制度及
其對期貨交易者交易策略之影
響／周行一；李志宏；陳明憲
臺灣期貨市場 7:1 2005.01
頁 18-31
(相關可備參考)
50. 影響臺股股價指數期貨交易量
之決定因素／郭玟秀；康信
鴻；許溪南 朝陽商管評論
- 4:1 2005.01 頁 41-62
(相關可備參考)
51. 臺灣期貨交易所走向國際市場
從臺北到芝加哥／曾昭懿 期
貨人 13 2005 頁 54-57
(適用)
52. 邁向國際化提升市場成熟度與
效率性開放外資參與我國期貨
交易對國內金融市場的影響／
林蔚文 期貨人 15 2005
頁 72-76
(適用)
53. 大阪證券交易所日經 225 股價
指數期貨交易說明會讓投資人
擁有多元化的國際交易與避
險管道／詹時敏 期貨人 16
2005 頁 76-80
(相關可備參考)
54. 運用電腦程式交易系統於臺股
期貨交易策略之研究／謝雅
惠；錢來興 臺灣期貨與衍生
性商品學刊 2 2004.12 頁
74-87
(相關可備參考)
55. 指數期貨交易與股票市場波動
性—短期與長期分析／王毓敏
臺灣金融財務季刊 5:4
2004.12 頁 19-34
(相關可備參考)
56. 臺灣期貨交易所選擇權商品介
紹／顏榮邦 證券暨期貨月刊
22:10 2004.10 頁 11-19

- (適用)
57. 國內外期貨暨選擇權市場交易結構與趨勢分析／陳香君 證券暨期貨月刊 22:10 2004.10 頁 20-34
(相關可備參考)
58. 資本市場的正義使者—證券投資人及期貨交易人保護中心／杜佳儒 實用稅務 358 2004.10 頁 10-12
(適用)
59. 網路期貨交易所法制之研究／謝哲勝；李福隆 國立中正大學法學集刊 17 2004.10 頁 87-135
(適用)
60. 現行證券投資人及期貨交易人保護制度評析／張素文 證券暨期貨月刊 22:6 2004.06 頁 4-10
(適用)
61. 期貨交易人應如何在期貨市場確保自身權益／范加麟 證券暨期貨月刊 22:6 2004.06 頁 17-22
(非常適用)
62. 期貨及證券交易爭議仲裁機制可行性之研究／林繼恆；劉憶如；楊偉文等 臺灣期貨與衍生性商品學刊 1 2003.12 頁 62-72
(非常適用)
63. 上海期貨交易所風險控管機制簡介／李惠華 臺灣期貨市場 5:5 2003.09 頁 30-44
(相關可備參考)
64. 仲裁法制對證券期貨交易糾紛之重大功能／陳峰富 仲裁 69 2003.09 頁 32-43
(非常適用)
65. 中國大陸期貨交易違法行為與糾紛處理法規規範之評析／邱文昌；林文光 展望與探索 1:9 2003.09 頁 111-116
(相關可備參考)
66. 淺論「證券投資人及期貨交易人保護法」的保護主體與保護機構的調查權／張冀明；闕光威；林靖揚 律師雜誌 285 2003.06 頁 108-118
(適用)
67. 證券投資人及期貨交易人保護法的介紹及分析／李福隆 律師雜誌 278 2002.11 頁 143-148
(適用)
68. Cash trading and index futures price volatility / Li, Jinliang.-- *Journal of Futures Markets* 31.5 (2011): P.465-486
(相關可備參考)
69. Electronic versus open outcry trading in agricultural commodities futures markets /

- Martinez, Valeria ; Gupta, Paramita.-- *Review of Financial Economics* 20.1 (2011): P.28-36
(相關可備參考)
70. Futures trading / Maynard, Nigel F.-- *Builder* 33.6 (June 2010): P.96
(適用)
71. Activity in futures: does underlying market size relate to futures trading volume? / Frino, Alex ; Jarnecic, Elvis ; Zheng, Hui.-- *Review of Quantitative Finance and Accounting* 34.3 (2010): P.313-325
(相關可備參考)
72. Trading futures : queer theory's anti-anti-relational turn / Daniel, Drew.-- *Criticism* 52.2 (2010): P.325-330
(相關可備參考)
73. Positive feedback trading in stock index futures: international evidence / Salm, Christian A ; Schuppli, Michael.-- *International Review of Financial Analysis* 19.5 (2010): P.313-322
(相關可備參考)
74. A bilevel stochastic programming approach for retailer futures market trading / Carrion, M ; Arroyo, J.M ; Conejo, A.J.-- *IEEE Transactions on Power Systems* 24.3 (2009): P.1446-1456
(相關可備參考)
75. Profit refiner of futures trading using clustering algorithm / Hsu, Yen-Tseng ; Hung, Hui-Fen.-- *Expert Systems With Applications* 36.3 (2009): P. 6192-6198
(相關可備參考)
76. After-hours trading in equity futures markets / Dungey, Mardi ; Fakhrutdinova, Luba ; Goodhart, Charles.-- *Journal of Futures Markets* 29.2 (2009): P.114 - 136
(相關可備參考)
77. Implications of futures trading volume : hedgers versus speculators / Yung, Kenneth ; Liu, Yen-Chih.-- *Journal of Asset Management* 10.5 (2009): P. 318-337
(相關可備參考)
78. Efficiency and futures trading-price nexus in Indian commodity futures markets / Kumar, Rajiv ; Sahoo, Pravakar.-- *Global Business Review* 10.2 (2009): P. 187-201
(相關可備參考)

79. Asymmetric volume-return relation and concentrated trading in LIFFE futures / Puri, Tribhuvan N ; Philippatos, George C.-- *European Financial Management* 14.3 (2008): P.528-563
(相關可備參考)
80. The impact of futures trading on volatility of the underlying asset in the Turkish stock market / Kasman, Adnan ; Kasman, Saadet.-- *Physica A: Statistical Mechanics and its Applications* 387.12 (2008): P.2837-2845
(相關可備參考)
81. Trading futures spreads : an application of correlation and threshold filters / Dunis, C. L ; Laws, Jason ; Evans, Ben.-- *Applied Financial Economics* 16.12 (2006): P.903-914
(相關可備參考)
82. The volatility effect of futures trading : evidence from LSE traded stocks listed as individual equity futures contracts on LIFFE / Mazouz, Khelifa ; Bowe, Michael.-- *International Review of Financial Analysis* 15.1 (2006): P.1-20
(相關可備參考)
83. Index futures trading and spot price volatility : evidence from an emerging market / Spyrou, Spyros I.-- *Journal of Emerging Market Finance* 4.2 (2005): P. 151-167
(相關可備參考)
84. Futures trading activity and commodity cash price volatility / Yang, Jian ; Balyeat, R. Brian ; Leatham, David J.-- *Journal of Business Finance & Accounting* 32.1-2 (2005): P. 297-323
(適用)
85. Interdealer trading in futures markets / Locke, Peter R ; Sarajoti, Pattarake.-- *Journal of Futures Markets* 24.10 (Oct 2004): P.923- 944
(適用)
86. Detecting manipulation in futures markets : the feruzzi soybean episode / Pirrong, Craig.-- *American Law and Economics Review* 6.1 (Spring 2004): P.28-71
(論題專精)
87. Futures trading activity and predictable foreign exchange market movements / Wang, Changyun.-- *Journal of Banking and Finance* 28.5 (2004): P. 1023-1041
(適用)

88. Information content of extended trading for index futures / Cheng, Louis T. W; Jiang, Li; Ng, Renne W. Y.-- *Journal of Futures Markets* 24.9 (2004): P. 861-886

(相關可備參考)

89. Information flows between the U.S. and China commodity futures trading / Fung, Hung-Gay ; Leung, Wai K ; Xu, Xiaoqing Eleanor.-- *Review of Quantitative Finance and Accounting* 21.3 (2003): P. 267-285

(適用)

交易之實證研究／黃培琳／朝陽科技大學／財務金融系碩士班／99／碩士

5. 台灣期貨交易所股票期貨上市初期之價格行爲／方薇雅／國立高雄第一科技大學／金融研究所／99／碩士

6. 全球金融風暴事件對台股指數期貨及摩根台股指數期貨交易活動關聯性之探討—以多空頭期間之檢驗／蔡靜鴻／國立中正大學／財務金融研究所／99／碩士

7. 金融海嘯期間對期貨交易人下單資訊性之影響／劉士豪／淡江大學／財務金融學系碩士在職專班／99／碩士

8. 技術指標之獲利績效分析：以台灣股價指數期貨交易爲例／翁瑾蘋／輔仁大學／經濟學研究所／99／碩士

9. 股票期貨上市對現貨市場之影響—以臺灣期貨交易所股票期貨契約爲例／黃菡筠／國立中正大學／財務金融研究所／99／碩士

10. 機構法人期貨交易行爲與台灣股價指數變動之關聯性的實證研究：高頻資料的分析／梁雅琪／淡江大學／財務金融學系碩士在職專班／99／碩士

11. 從指數期貨交易制度之研究論科技法律與法律科技整合／謝易穎

五、博碩士論文

1. 人口、交易特性對期貨交易績效影響力—以國內期貨商爲例／吳聲譽／國立臺北大學／國際財務金融碩士在職專班／100／碩士

2. 小波分析法在高頻期貨交易之實證／李俊德／國立高雄第一科技大學／財務管理研究所／100／碩士

3. 談台灣資本市場之競爭力—以證券、期貨交易所、證券櫃檯買賣中心與集中保管結算所資訊整合爲例／吳靜娟／臺灣大學／資訊管理學研究所／99／碩士

4. 程式交易策略、期貨交易和法人

／雲林科技大學／科技法律研究所／98／碩士

12. 美國及兩岸期貨交易市場自律規範問題之研析：以紀律處分程序與救濟為中心／黃金貴／南台科技大學／財經法律研究所／98／碩士

13. 股價指數期貨轉倉方法實證—以台灣期貨交易所發行之四種契約為研究樣本／張文盈／國立交通大學／財務金融研究所／98／碩士

14. 在交易所整併趨勢下探討與研究我國新一代期貨交易系統之發展策略／陳淑敏／國立政治大學／資訊管理研究所／97／碩士

15. 以 ISO 27001 為基礎探討期貨交易系統資訊安全風險管理模式／廖康妙／華梵大學／資訊管理學系碩士班／97／碩士

16. 台指選擇權盒狀價差與跨期貨交易策略之實證分析／張志明／國立高雄第一科技大學／風險管理與保險所／97／碩士

17. 最低稅負制對企業證券期貨交易所得及投資抵減行為之影響／李婉萍／輔仁大學／會計學系碩士班／97／碩士

18. 期貨交易量對標的資產價格資訊效果對稱性之研究／吳秋汶／淡江大學／財務金融學系碩士在職

專班／97／碩士

19. 商品期貨市場投資策略及交易行為之研究—以美國商品期貨交易市場為例／盧芊如／中原大學／企業管理研究所／97／碩士

20. 臺灣期貨交易所未來發展策略之研究／蔡明樑／國立中山大學／高階經營碩士班／97／碩士

21. 期貨交易稅的調降與價格發現之實證研究—以台指期貨與新加坡摩台指期貨為例／羅新錡／淡江大學／財務金融學系碩士在職專班／96／碩士

22. 期貨交易行為對現貨價格波動率之影響—臺灣與國外實證研究／張韋苓／元智大學／財務金融學系／96／碩士

23. 指數期貨交易後對台灣股市星期效應之影響／李素詩／逢甲大學／國際貿易所／96／碩士

24. 調降期貨交易稅對市場品質的影響：以台灣市場為例／周鈞翔／朝陽科技大學／財務金融系碩士班／96／碩士

25. 應用委託買賣與市場價格資訊建構期貨交易系統之研究／巫昌翰／國立成功大學／財務金融研究所／95／碩士

26. 台灣期貨交易所選擇權投資人的交易行為／王銘駿／國立政治大

- 學／財務管理研究所／95／博士
27. 證券、期貨交易所暨周邊單位整合之法制與效率／陳金德／臺灣大學／商學組／95／碩士
 28. 期貨交易活動,波動,和每日到達資訊／李瑞琳／國立中正大學／財務金融所／95／博士
 29. 順勢策略之程式交易系統於台股指數期貨交易運用之研究／廖宏彬／中興大學／高階經理人碩士在職專班／94／碩士
 30. 台指期貨交易策略探討／索緒東／國立交通大學／管理學院高階主管管理碩士學程／94／碩士
 31. 我國期貨交易犯罪型態及偵查之研究／方淳安／中央警察大學／刑事警察研究所／94／碩士
 32. 台股期貨交易之修正評估研究／廖彥豪／國立臺灣科技大學／資訊工程系／94／碩士
 33. 台灣期貨交易所收費合理性之探討／林映辰／國立政治大學／經濟研究所／94／碩士
 34. 證券投資人及期貨交易人保護基金法制之研究／林俊宏／東吳大學／法律學系／93／碩士
 35. 指數期貨交易策略之應用／陳垣暉／國立中興大學／高階經理人碩士在職專班／93／碩士
 36. 期貨交易者與期貨價格行為關係的三個議題探討／林昭賢／國立成功大學／企業管理學系碩博士班／93／博士
 37. 從衍生性商品所據之理論探討政府「期貨交易法」政策—兼論加入WTO後對我國衍生性商品市場之衝擊／李珮珊／國立成功大學／政治經濟學研究所／92／碩士
 38. 論證券投資人及期貨交易人保護法之團體訴訟／劉彥廷／國立臺北大學／法學系／91／碩士

六、報章

1. 廣州南沙新區 華南金三角 為第六個國家級新區 將以航運金融發展為主 引進先進製造業 另爭設廣州期貨交易所／2012-09-13／聯合報／第 E1 版
2. 金管會：期貨交易 管道要合法／2012-08-15／中央社／國內財經
3. 期貨交易 紀律為要／2012-08-14／工商時報／第 A18 版
4. 印度 抑制小麥、糖漲勢要收期貨交易保證金／2012-08-04／經濟日報／第 A8 版
5. ICE 布侖特期貨交易量 上季首度超越西德州輕原油 倫敦取代紐約 躍石油交易重鎮／2012-08-03／經濟日報／第 A6 版

6. 陸再降 A 股及期貨交易手續費／2012-08-02／中央社／大陸財經
7. 海外期貨商品 交投熱絡 連 2 個月成交逾 88 萬口，較前 4 月平均 69.2 萬口大幅增長／2012-07-30／工商時報／第 B5 版
8. 黃豆期貨價格創新高／2012-07-21／中華日報／第 3 版
9. 美國期貨商 百利金融集團聲請破產／2012-07-12／蘋果日報／第 B2 版
10. 期交所三管齊下 拚佳績 去年交易量、獲利均創歷史新高；董事長范志強今年力拚再創巔峰／2012-06-22／工商時報／第 B5 版
11. 期權課程 開放報名 協助交易人建立正確期貨交易及避險觀念，全程免費／2012-06-20／工商時報／第 C4 版
12. 假投資期貨真詐財 女騙仔遭訴／2012-06-17／台灣時報／第 9 版
13. 期貨商兼槓桿交易商 擬開放／2012-06-14／中央社／國內財經
14. 提撥滿 10 年 券商期貨商明年停繳保護基金／2012-06-13／蘋果日報／第 B6 版
15. 群益期貨 CME 交易賽 啓動／2012-06-01／工商時報／第 B5 版
16. 期貨公會辦兩岸事務座談 業者建議合作初期先啓動複委託 兩岸期指 拚相互掛牌／2012-05-31／經濟日報／第 B4 版
17. 最快年底上交所 將推原油期貨／2012-05-29／工商時報／第 A12 版
18. 民眾檢舉地下期貨 期交所發 40 萬元獎勵／2012-05-17／聯合晚報／第 B6 版
19. 股票期貨 6 特色 方便精準超彈性／2012-05-08／工商時報／第 A18 版
20. 降期交稅 財部暫不討論／2012-05-02／自由時報／第 A03 版
21. 政院出面 期交稅率要降了 財部同意適度調整 金管會盼與證所稅脫鉤處理 建議稅率降到十萬分之一／2012-05-01／經濟日報／第 A3 版
22. 大利多 陸期交所降 30%手續費 6 月上路 有望帶動期現貨市場上漲 降低股票交易費方案也在審核 市場：牛市真的來了／2012-04-29／經濟日報／第 A10 版
23. 活牛期貨大跌 南韓美牛下架／2012-04-26／中華日報／第 2 版
24. 期貨公會：期所稅削弱競爭力／

- 2012-04-26／中央社／國內財經
25. 股票期貨可進行鉅額交易 5月14日實施／2012-04-25／自立晚報／財經證券
 26. 香港期貨正夯 康和致力推廣／2012-04-24／聯合報／第AA3版
 27. 刑事局破獲假白銀期貨交易真詐欺集團／2012-04-24／台灣時報／第9版
 28. 股票期貨 期交所第四大主力商品 低交易成本優勢創造獲利機會 100年交易量成長241.21% 今年首季成長173.46%／2012-04-23／經濟日報／第AA1版
 29. 期交所加入國際結算組織／2012-04-23／中華日報／第4版
 30. 港交所率先推出 人民幣期貨商品 Q3登場／2012-04-21／工商時報／第A8版
 31. 加入集中結算組織協會 提高國際能見度 期交所 成CCP12會員／2012-04-20／經濟日報／第B4版
2. 臺灣期貨交易所網站
<http://www.taifex.com.tw/chinese/index.asp>
 3. 財團法人證券投資人及期貨交易人保護中心網站
<http://www.sfipc.org.tw/>
 4. 中華民國期貨業商業同業公會網站
<http://www.futures.org.tw/>
 5. 財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會網站
<http://www.sfi.org.tw/newsfi/Default.asp>
 6. 美國商品期貨交易委員會網站
<http://www.cftc.gov/>
 7. 美國期貨協會網站
<http://www.nfa.futures.org/>
 8. 香港證券及期貨事務監察委員會網站
<http://www.sfc.hk/web/EN/index.html>
 9. 東京穀物商品取引所網站
<http://www.tge.or.jp/english/index.shtml>
 10. 新加坡商品交易所網站
<http://www.smx.com.sg/>

七、網站資源

1. 金融監督管理委員會證券期貨局網站
<http://www.sfb.gov.tw>

CODE RESOURCE PATHFINDER 119

November 2012

Futures Trading Act

PARLIAMENTARY LIBRARY

LEGISLATIVE YUAN, REPUBLIC OF CHINA