|  |
| --- |
| **『112年度ETF競賽』活動辦法** |
| **主辦單位** | 臺灣證券交易所股份有限公司[中華民國證券商業同業公會](http://www.csa.org.tw/)[中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會](http://www.sitca.org.tw/)中華民國期貨業商業同業公會 |
| **競賽期間** | 自112年1月3日至112年12月29日止，為期12個月。 |
| **交易競賽** |
| **活動目的** | 為鼓勵全體證券商共同推廣指數股票型基金(Exchange Traded Fund, ETF)，增進投資人投資之意願，進而有效提升交易成長。 |
| **獎勵金額** | 總獎金新台幣90萬元。 |
| **參賽資格** | 1. 全體證券經紀商自動參賽，每一營業據點為一隊伍代表一參賽資格。
2. 證券經紀商營業據點如終止營業，終止營業日起取消參賽資格。
3. 證券經紀商營業據點因被合併或讓與，但為合併或受讓證券商留用而繼續營業者，該據點仍保有參賽資格（被合併或讓與前之交易併入競賽成績統計）。
4. 新成立之證券經紀商營業據點，自開始營業日起自動取得臺股ETF交易貢獻獎參賽資格，營業滿一完整年度自動取得臺股ETF交易進步獎參賽資格。
 |
| **成績計算基準** | 1. 臺股ETF交易金額=上市臺股ETF買進成交金額+上市臺股ETF賣出成交金額（包括零股、鉅額交易，臺股ETF係指追蹤臺股相關指數之ETF，包括槓桿型與反向型ETF）。
2. ETF交易帳戶數係採歸戶計算，即同一帳戶在同一交易日有數筆ETF交易或不同交易日均有ETF交易，均僅以1戶計算之。
3. 交易金額計算至以元為單位；交易占比計算至百分比小數點以下第3位，第4位四捨五入（例：1.56789%＝＞1.568%或1.34123%＝＞1.341%）。
 |
| **競賽方式** | 交易競賽設立臺股ETF交易貢獻獎、臺股ETF交易進步獎等2個獎項。**(一)臺股ETF交易貢獻獎**：就競賽期間之ETF交易帳戶數達2,200戶（含）以上者，取臺股ETF交易金額最高排名前3名，頒發獎金及獎座。**(二)臺股ETF交易進步獎：**1. 就競賽期間之ETF交易帳戶數達2,200戶（含）以上者，取臺股ETF交易金額占基準金額比例最高排名前3名，頒發獎金及獎座。
2. 基準金額係為每一營業據點111年1月至12月之臺股ETF交易金額。
 |
| **獎金內容** | **(一)臺股ETF交易貢獻獎**：**共計3名(共45萬)**第一名：新台幣20萬元第二名：新台幣15萬元第三名：新台幣10萬元**(二)臺股ETF交易進步獎**：**共計3名(共45萬)**第一名：新台幣20萬元第二名：新台幣15萬元第三名：新台幣10萬元 |
| **得獎特別規則** | 1. 如有任一獎項之所有參賽隊伍均未達得獎條件情形，則該獎項得獎者從缺。
2. 若臺股ETF交易貢獻獎最後競賽成績相同者，則再以競賽期間最後月份臺股ETF交易金額高低比序決定名次，如經比序成績相同，則再往前推一個月份繼續比序，依此類推。
3. 若參賽隊伍之臺股ETF交易金額未高於基準金額，則不具臺股ETF交易進步獎之得獎資格。
4. 若臺股ETF交易進步獎最後競賽成績相同者，則再以競賽期間最後月份臺股ETF交易金額高低比序決定名次，如經比序成績相同，則再往前推一個月份繼續比序，依此類推。
 |
| **發行競賽** |
| **活動目的** | 為鼓勵上市ETF之發行人持續發行優質商品，提供投資人多元投資選擇。 |
| **獎勵金額** | 總獎金新台幣90萬元起。 |
| **參賽資格** | 全體上市ETF之投信發行人自動參賽。 |
| **競賽方式** | 發行競賽設立ETF發行貢獻獎、ESG發行獎勵2個獎項。**(一)ETF發行貢獻獎**：就競賽期間上市ETF發行檔數達2檔（含）以上者，取上市ETF發行檔數最高排名前3名，頒發獎金及獎座。**(二)ESG發行獎勵：**就競賽期間每發行1檔上市ESG ETF，頒發獎勵金10萬元。 |
| **獎金內容** | **(一)ETF發行貢獻獎**：**共計3名(共90萬)**第一名：新台幣40萬元第二名：新台幣30萬元第三名：新台幣20萬元**(二)ESG發行獎勵：每檔頒發獎勵金10萬元。** |
| **得獎特別規則** | 1. 如有任一獎項之所有參賽隊伍均未達得獎條件情形，則該獎項得獎者從缺。
2. 若ETF發行貢獻獎最後競賽成績相同者，則以競賽期間完成上市ETF標的指數資格認可之案件數高低比序決定名次，如經比序成績相同，再以競賽期間上市發行ETF之受益人數高低比序決定名次。
3. ESG ETF之定義為表列於基金資訊觀測站ESG基金專區中之ETF。
 |
| **造市競賽** |
| **活動目的** | 鑒於流動量提供者對於促進ETF流動性之貢獻不可或缺，臺股ETF之績效報酬極具投資優勢，特舉辦臺股ETF造市競賽，期能鼓勵流動量提供者持續有效報價，促進臺股ETF流動性。 |
| **獎勵金額** | 總獎金新台幣45萬元。 |
| **競賽標的** | 以111年1月至12月日均成交量不足三千張之所有臺股ETF為競賽標的，亦即排除「元大台灣50」、「元大高股息」、「富邦台50」、「元大台灣50正2」、「元大台灣50反1」、「國泰臺灣加權反1」、「富邦臺灣加權反1」、「國泰永續高股息」、「國泰台灣5G+」、「中信關鍵半導體」、「富邦台灣半導體」、「富邦特選高股息30」、「群益台灣精選高息」13檔ETF。 |
| **參賽資格** | 擔任競賽標的臺股ETF流動量提供者之證券自營商自動參賽。 |
| **參賽者應先符合之基本報價義務** | 1. 如ETF前一次成交價為50元（含）以上，流動量提供者買賣報價價差應於百分之二以內，且符合前述報價範圍之數量應達一百交易單位（含）以上。
2. 如ETF前一次成交價為50元以下，流動量提供者買賣報價價差應於百分之一以內，且符合前述報價範圍之數量應達一百交易單位（含）以上。
3. ETF流動量提供者競賽期間符合(ㄧ)、(二)標準之有效報價日數，應達競賽期間交易日數百分之八十（含）以上（百分之一以下無條件捨去）；除ETF前一次成交價達漲（跌）停價、開盤前（上午8:30至9:00或暫緩開盤前）、收盤前（下午13:25至收盤）及執行瞬間價格穩定措施期間外，流動量提供者買賣報價符合(ㄧ)、(二)標準之有效買賣報價存在委託簿時間間斷超過3分鐘，該日即排除有效報價日計算。
4. ETF流動量提供者競賽期間買賣成交數量（ETF流動量提供者同一成交時間有買進及賣出數量者剔除相同數量部分）應達該檔ETF競賽期間買賣總成交數量0.5%以上，且ETF流動量提供者競賽期間有成交日數需達競賽期間交易日數百分之八十（含）以上（百分之一以下無條件捨去）。
 |
| **成績計算基準** | 就符合上述基本報價義務之流動量提供者，以下列方式計算各檔ETF之造市分數：1. 有效報價之價差比率=(ETF流動量提供者符合報價範圍之最高賣出申報價格－符合報價範圍之最低買進申報價格)/符合報價範圍之最高賣出申報價格。
2. 有效報價日數占競賽期間交易日數比率=ETF流動量提供者符合有效報價之交易日數/競賽期間交易日數。
3. 買賣成交數量比率=ETF流動量提供者於競賽期間買賣成交數量/該檔ETF競賽期間買賣總成交數量；ETF流動量提供者同一成交時間有買進及賣出數量者，以買賣互抵後成交數量計算。
4. ETF日均量成長率=(該檔ETF於競賽期間之日均成交量/該檔ETF於111年1月至12月之日均成交量-1)。
5. 申購贖回張數占該檔ETF發行張數比率=(ETF流動量提供者於競賽期間申購張數+競賽期間贖回張數)/該檔ETF於111年12月份期末ETF發行張數。

\*最大值：依上述各項指標分別計算各流動量提供者對各檔造市ETF之指標，取各項指標最大值\*最小值：依上述各項指標分別計算各流動量提供者對各檔造市ETF之指標，取各項指標最小值

|  |  |
| --- | --- |
| **計算因子** | **權重** |
| (1-有效報價之價差比率)/(1-有效報價之價差比率最小值)x100 | 25% |
| 有效報價日數占競賽期間交易日數比率/有效報價日數占競賽期間交易日數比率最大值x100 | 20% |
| 買賣成交數量比率/買賣成交數量比率最大值x100 | 40% |
| ETF日均量成長率/ETF日均量成長率最大值x100 | 5% |
| 申購贖回張數占該檔ETF發行張數比率/申購贖回張數占該檔ETF發行張數比率最大值x100 | 10% |

 |
| **競賽方式** | 造市競賽設立臺股ETF造市獎1個獎項。各檔臺股ETF之流動量提供者，依上述成績計算方式將各計算因子加權計算各檔ETF造市成績；取成績最高排名前3名證券自營商，頒發獎金及獎座。 |
| **獎金內容** | **臺股ETF造市獎**：**共計3名(共45萬)**第一名：新台幣20萬元第二名：新台幣15萬元第三名：新台幣10萬元 |
| **得獎特別規則** | 1. 如流動量提供者為多檔臺股ETF進行造市，以成績最佳之一檔評比。
2. 若該流動量提供者所造市之各檔臺股ETF造市成績之平均低於全體造市成績之平均，則不具得獎資格。
3. 若最後競賽成績相同者，則再以競賽期間最後月份買賣成交數量比率比序決定名次，如經比序成績相同，則再往前推一個月份繼續比序，依此類推。
 |
| **總貢獻獎** |
| **獎勵金額** | 總獎金新台幣90萬元。 |
| **參賽資格** | 全體證券商總公司自動參賽，每一總公司為一隊伍代表一參賽資格。 |
| **成績計算基準** | 1. 臺股ETF累計交易金額=證券商總公司所屬營業據點累計之臺股ETF交易金額。
2. 臺股ETF交易進步比率=證券商總公司所屬營業據點累計之臺股ETF交易金額/證券商總公司所屬營業據點111年1月至12月累計之臺股ETF交易金額。
3. 臺股ETF造市分數=證券商總公司所屬證券自營商之臺股ETF造市分數。
4. 最大值：依上述各項分別計算各證券商總公司之指標，取各項指標最大值。

|  |  |
| --- | --- |
| **臺股ETF總貢獻獎計算因子** | **權重** |
| 臺股ETF累計交易金額/臺股ETF累計交易金額最大值x100 | 40% |
| 臺股ETF交易進步比率/臺股ETF交易進步比率最大值x100 | 30% |
| 臺股ETF造市分數/臺股ETF造市分數最大值x100 | 30% |

 |
| **競賽方式** | 設立臺股ETF總貢獻獎1個獎項。就競賽期間所屬營業據點累計之ETF交易帳戶數達24,000戶（含）以上者，依上述成績計算方式將各計算因子加權計算成績，取成績最高排名前3名，頒發獎金及獎座。 |
| **獎金內容** | **臺股ETF總貢獻獎**：**共計3名(共90萬)**第一名：新台幣40萬元第二名：新台幣30萬元第三名：新台幣20萬元 |
| **得獎特別規則** | 1. 如有任一獎項之所有參賽隊伍均未達得獎條件情形，則該獎項得獎者從缺。
2. 若臺股ETF總貢獻獎最後競賽成績相同者，則再以競賽期間最後月份臺股ETF交易金額高低比序決定名次，如經比序成績相同，則再往前推一個月份繼續比序，依此類推。
 |
| **其他注意事項** |
| 1. 主辦單位於活動期間每營業日中午12時前，於證券商申報單一窗口(https://brk.twse.com.tw/)公布截至前一營業日各獎項之成績排名，另於每季之第三營業日於證交所臉書粉絲專頁(https://zh-tw.facebook.com/TaiwanStockExchangeCorp/)公布各獎項暫列名單。
2. 獎金超過2萬元者，由主辦單位按該參賽者所獲獎金之百分之十依法扣繳之。
3. 本活動參賽者應遵守證券市場相關法令及規章規定，如有違反，主辦單位有權取消參賽資格，並得依相關規定辦理。
4. 倘本活動辦法有未盡事宜，主辦單位保有最終解釋權與增修權，並得依實際狀況修改、增加或刪除其內容。
5. 本活動因故無法進行，主辦單位有決定取消、終止、修改或暫停活動之權利。
 |
| **活動服務專線** |
| 臺灣證券交易所企劃研究部(02)8101-3945 |