

副本

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：黃小姐
聯絡電話：(02)2369-5678分機3279

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國109年11月19日
發文字號：台期交字第10900035970號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：普通
附件：如文

主旨：公告修正本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」交易規則及規格，並自即日起實施。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會109年11月16日金管證期字第1090357073號函辦理。
- 二、為符合市場交易需求，旨揭契約依本商品交易規則第11條之1第1項規定掛牌者，調整為依近月契約之履約價格間距，向上及向下連續推出不同之履約價格契約至最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之十，修正條文對照表詳如附件。
- 三、本公司109年3月19日台期交字第10902003540號函，自即日起停止適用。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、臺灣集中保管結算所股份有限公司、台北國際金融資訊協會、植根國際資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 黃炳鈞

臺灣期貨交易所股份有限公司
 「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」
 交易規則修正條文對照表

修正條文	現行條文	說明
<p>第十一條之一 依第十條第二項掛牌之契約，應依前條第二項近月契約之履約價格間距，向上及向下連續推出不同之履約價格契約至最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之十。</p> <p>除依前項規定推出不同履約價格契約外，本公司並於基準指數上下百分之三間，接近月契約履約價格間距之二分之一，推出履約價格契約；本公司並得視市場狀況推出其他履約價格契約。</p>	<p>第十一條之一 依第十條第二項掛牌之契約，應依前條第二項近月契約之履約價格間距，向上及向下連續推出不同之履約價格契約至最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之七。</p> <p>除依前項規定推出不同履約價格契約外，本公司並於基準指數上下百分之三間，接近月契約履約價格間距之二分之一，推出履約價格契約；本公司並得視市場狀況推出其他履約價格契約。</p>	<p>近期市場波動度驟升，交易人透過臺指選擇權避險及交易需求大增，為使臺指選擇權有足夠序列供市場交易，增掛臺指選擇權週到期契約序列，將最高及最低履約價格涵蓋率由基準指數(前一營業日標的指數收盤價)之上下7%調高至10%，以符合市場避險及交易需求。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司
 「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」
 規格修正對照表

修正條文	現行條文	說明
<p>契約序列</p> <p>新契約掛牌時及契約存續期間，以前一營業日標的指數收盤價為基準，於一般交易時段依履約價格間距，向上及向下連續推出不同之履約價格契約至滿足下列條件為止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交易當週星期三加掛次一個星期三到期之契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 10% 2. 交易月份起之 3 個連續近月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 15% 3. 接續之 2 個季月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 20% 	<p>契約序列</p> <p>新契約掛牌時及契約存續期間，以前一營業日標的指數收盤價為基準，於一般交易時段依履約價格間距，向上及向下連續推出不同之履約價格契約至滿足下列條件為止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交易當週星期三加掛次一個星期三到期之契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 7% 2. 交易月份起之 3 個連續近月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 15% 3. 接續之 2 個季月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 20% 	<p>近期市場波動度驟升，交易人透過臺指選擇權避險及交易需求大增，為使臺指選擇權有足夠序列供市場交易，增掛臺指選擇權週到期契約序列，將最高及最低履約價格涵蓋率由基準指數(前一營業日標的指數收盤價)之上下 7%調高至 10%，以符合市場避險及交易需求。</p>