

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓
聯絡人：吳小姐
聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3191

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國114年4月30日
發文字號：台期交字第1140200768號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：
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」交易規則與規格，實施日期另行公告，請查照。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會114年4月28日金管證期字第1140337908號函辦理。
- 二、配合本公司加掛臺指選擇權週五到期之週契約，爰修正本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」交易規則與規格，相關修正條文對照表如附件，實施日期另行公告。

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(均含附件)

總經理 周建隆

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」
規格修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
到期契約 • <u>月到期契約</u> 1.自交易當月起連續3個月份(<u>近月契約</u>), <u>以及</u> 3月、6月、9月、12月中2個接續的季月(<u>季月契約</u>) 2.新到期月份契約於到期契約最後交易日之次一營業日一般交易時段起開始交易 • <u>週到期契約(週契約)</u> 1.<u>星期三到期契約：自交易當週之星期三一般交易時段加掛次二週之星期三到期之週契約。但每月第一個星期三除外</u> 2.<u>星期五到期契約：自交易當週之星期五一般交易時段加掛次二週之星期五到期之週契約</u>	到期契約 • 自交易當月起連續3個月份, <u>另加上</u> 3月、6月、9月、12月中2個接續的季月, <u>另除每月第1個星期三外,得於交易當週之星期三一般交易時段加掛次二週之星期三到期之契約</u> • 新到期月份契約於到期契約最後交易日之次一營業日一般交易時段起開始交易	1. 為提供交易人更多交易與避險選擇,滿足市場需求,除現行星期三到期之週契約外,得於交易當週之星期五一般交易時段加掛次二週之星期五到期之週契約。 2. 另配合加掛星期五到期之週契約,酌修文字,以臻明確。
履約價格間距 • 履約價格未達3,000點：<u>週契約及</u>近月契約為50點，季月契約為100點 • 履約價格3,000點以上：<u>週契約及</u>近月契約為	履約價格間距 • 履約價格未達3,000點：近月契約為50點，季月契約為100點 • 履約價格3,000點以上：近月契約為100點，季	1. 敘明週契約(包含星期三到期及星期五到期之週契約)履約價格間距同近月契約。 2. 敘明週契約自交易開始日起,近月契約自到期日前二週之星期三起,於前

100點，季月契約為200點 • <u>週契約自交易開始日起，近月</u>契約自到期日前二週之星期三起，於前一營業日標的指數收盤價上下3%間，履約價格間距為近月契約之二分之一	月契約為200點 • <u>交易當週星期三加掛次二週星期三到期之契約，其履約價格間距同近月契約</u> • <u>各</u>契約自到期日前二週之星期三起，於前一營業日標的指數收盤價上下3%間，履約價格間距為近月契約之二分之一	一營業日標的指數收盤價上下 3%間，接近月契約履約價格間距之二分之一，加掛履約價格契約。
契約序列 • 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： 1. <u>週契約</u>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	契約序列 • 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： 1. <u>交易當週星期三加掛次二週星期三到期之契約</u>，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	敘明週契約(包含星期三到期及星期五到期之週契約)最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下 10%。

數之上下20%	數之上下20%	
最後交易日 - 各月份契約的最後交易日為各該契約交割月份第3個星期三 - 交易當週<u>加掛之</u>星期三<u>到期與星期五到期之週</u>契約，其最後交易日為掛牌日次二週之星期三<u>與星期五</u>	最後交易日 各月份契約的最後交易日為各該契約交割月份第3個星期三；交易當週星期三<u>加掛</u>之契約，其最後交易日為掛牌日次二週之星期三	敘明星期五到期之週契約，其最後交易日為掛牌日次二週之星期五。

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
第十條 本契約除另有規定外，其到期月份分別為交易當月起連續之三個月份，以及三月、六月、九月、十二月中二個接續之季月，共五期，同時各別掛牌交易。各月份契約之最後交易日為到期月份之第三個星期三，最後交易日為契約到期日，新到期月份契約於到期月份契約最後交易日之次一營業日一般交易時段起開始交易。 本公司得於交易當週一般交易時段加掛<u>下列週到期契約(以下稱週契約)</u>： 一、以<u>星期三</u>為交易開始日，<u>次二週之星期三</u>為最後交易日，<u>最後交易日為契約到期日</u>。但每月第一個星期三<u>不加掛該週契約</u>。 二、以<u>星期五</u>為交易開始日，<u>次二週之星期五</u>為最後交易日，<u>最後交易日為契約到期日</u>。 本契約於最後交易	第十條 本契約除另有規定外，其到期月份分別為交易當月起連續之三個月份，以及三月、六月、九月、十二月中二個接續之季月，共五期，同時各別掛牌交易。各月份契約之最後交易日為到期月份之第三個星期三，最後交易日為契約到期日，新到期月份契約於到期月份契約最後交易日之次一營業日一般交易時段起開始交易。 本公司得於交易當週之<u>星期三</u>一般交易時段加掛以<u>當日</u>為交易開始日，<u>且</u>次二週之星期三為最後交易日之<u>契約</u>。但每月第一個星期三<u>除外</u>；<u>該契約之最後交易日為到期日</u>。 本契約於最後交易	為提供交易人更多交易與避險選擇，滿足市場需求，本公司得於交易當週之星期五一般交易時段加掛以當日為交易開始日，次二週之星期五為最後交易日之契約，且其最後交易日為契約到期日，爰修訂本條第二項規定。

日一般交易時段收盤時停止交易，最後交易日與交易開始日若為假日或因不可抗力因素未能進行交易時，或本公司另有規定者，以其最近之次一營業日為最後交易日與交易開始日。	日一般交易時段收盤時停止交易，最後交易日與交易開始日若為假日或因不可抗力因素未能進行交易時，或本公司另有規定者，以其最近之次一營業日為最後交易日與交易開始日。	
第十一條之一 依第十條第二項掛牌之<u>週</u>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。 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。	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。 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。	配合加掛星期五到期之週契約，酌修文字，以臻明確。