

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：林先生
聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3197

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國115年5月8日
發文字號：台期交字第1150200820號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：
附件：如文

主旨：公告元大美債20年ETF期貨（代號RZF）契約調整事宜。

說明：

- 一、依本公司股票期貨契約交易規則第21條之1規定辦理。
- 二、元大美國政府20年期（以上）債券證券投資信託基金（證券代號：00679B）115年5月4日公告分配收益，每受益權單位配發0.28元。
- 三、旨揭契約調整生效日及交易時段、調整契約月份、調整內容等，詳列如附件。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商、本公司網站、結算部

副本：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、台北國際金融資訊協會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、企劃部、資訊規劃部、資訊作業部、監視部(均含附件)

總經理 周建隆

依本公司分層負責規定授權督導主管決行

臺灣期貨交易所
元大美債 20 年 ETF 期貨契約調整

- 一、調整生效日：115 年 5 月 22 日
- 二、調整內容（為盤後交易商品）：

115 年 5 月 21 日 17:25 開盤之盤後交易時段生效^{註 1}

契約代號	不調整（仍為 RZF）
調整契約月份	115 年 6 月、7 月、9 月、12 月及 116 年 3 月到期契約
約定標的物	不調整（仍為 10,000 受益權單位標的證券）
契約乘數	不調整（仍為 10,000）
買方權益數加項	每口買方未沖銷部位調整買方權益數加項新臺幣 2,800 元
賣方權益數減項	每口賣方未沖銷部位調整賣方權益數減項新臺幣 2,800 元

註 1：若因不可抗力因素致 5 月 21 日集中交易市場休市，則契約調整於 5 月 22 日 8:45 開盤之一般交易時段生效，並以當日開盤前持有部位者進行契約調整。

註 2：本契約調整內容依元大投信公告為準，若元大投信於調整生效日前一日變更分配收益金額，有可能致元大美債 20 年 ETF 期貨之夜盤權益數調整金額以變更前每受益權單位配發金額*10,000 計算，日盤以變更後每受益權單位配發金額*10,000 計算；若元大投信於調整生效日後（含當日）變更分配收益金額，則本契約內容不再變更。