

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：溫先生
聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3383

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國111年10月4日
發文字號：台期交字第1110202044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」及「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」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111年9月30日金管證期字第1110355386號函辦理。
- 二、配合臺指選擇權及小型臺指期貨掛牌雙週到期契約，爰修正本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」及「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」交易規則與規格，相關修正條文對照表如附件。
- 三、本公司110年1月12日台期交字第1100200056號函，自實施日期起停止適用。

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(均含附件)

總經理 周建隆

「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」及「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」增修訂規章一覽表

項次	名稱	說明	頁數
1	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	修訂	2
2	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	修訂	5
3	臺灣期貨交易所股份有限公司 「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」規格修正	修訂	8
4	臺灣期貨交易所股份有限公司 「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」交易規則修正	修訂	9

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
<p>到期契約</p> <ul style="list-style-type: none"> • 自交易當月起連續3個月份，另加上3月、6月、9月、12月中2個接續的季月，另除每月第<u>1</u>個星期三外，得於交易當週之星期三一般交易時段加掛次<u>二週之星期三</u>到期之契約 • 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 	<p>到期契約</p> <ul style="list-style-type: none"> • 自交易當月起連續3個月份，另加上3月、6月、9月、12月中2個接續的季月，另除每月第<u>2</u>個星期三外，得於交易當週之星期三一般交易時段加掛次<u>一個星期三</u>到期之契約 • 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 	<p>為提供交易人更多交易選擇，滿足市場需求，本公司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，加掛後交易人於每個交易日得有1週及2週到期之契約進行交易。</p>
<p>履約價格間距</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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，季月契約為200點 <p>• 交易當週星期三加掛次<u>二週星期三</u>到期之契約，其履約價格間距同近月契約</p>	<p>履約價格間距</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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，<u>未達15,000點</u>：近月契約為100點，季月契約為200點 • <u>履約價格15,000點以上</u>：近月契約為200點，<u>季月契約為400點</u> <p>• 交易當週星期三加掛次<u>一個星期三</u>到期之契約，其履約價格間距同近月契約</p>	<p>1. 為滿足市場需求，原依本契約交易規則第十一條第五項以增掛方式調整履約價格間距，自110年1月13日起，履約價格15000點以上，近月契約間距，由200點調整為100點；季月契約間距，由400點調整為200點（詳見110年1月12日台期交字第1100200056號函），考量交易人多已相當熟悉，為臻明確，爰配合修正之。</p> <p>2. 交易當週星期三加掛次</p>

<ul style="list-style-type: none"> 各契約自到期日前<u>二週</u>之<u>星期三</u>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 	<ul style="list-style-type: none"> 各契約自到期日之<u>前一個</u>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 	<p>二週星期三到期之契約，其履約價格間距同近月契約。</p> <p>3. 各契約自到期日前二週之星期三起，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，加掛履約價格契約。</p>
<p>契約序列</p> <ul style="list-style-type: none"> 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： <ol style="list-style-type: none"> 交易當週星期三加掛次<u>二週</u>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% 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% 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> <ul style="list-style-type: none"> 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： <ol style="list-style-type: none"> 交易當週星期三加掛次<u>一個</u>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% 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% 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>交易當週星期三加掛次二週之星期三到期之契約，其最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下10%。</p>

<p>最後交易日</p> <ul style="list-style-type: none"> 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；交易當週星期三加掛之契約，其最後交易日為掛牌日次<u>二週之星期三</u> 	<p>最後交易日</p> <ul style="list-style-type: none"> 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；交易當週星期三加掛之契約，其最後交易日為掛牌日之<u>次一個星期三</u> 	<p>配合交易當週星期三加掛次二週之星期三到期之契約，爰酌作文字調整。</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」
交易規則修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第十條</p> <p>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。</p> <p>本公司得於交易當週之星期三一般交易時段加掛以當日為交易開始日且次<u>二週之星期三</u>為最後交易日之契約。但每月<u>第一個星期三</u>除外；該契約之最後交易日為到期日。</p> <p>本契約於最後交易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</p>	<p>第十條</p> <p>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。</p> <p>本公司得於交易當週之星期三一般交易時段加掛以當日為交易開始日且次<u>一個星期三</u>為最後交易日之契約。但每月<u>第二個星期三</u>除外；該契約之最後交易日為到期日。</p> <p>本契約於最後交易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</p>	<p>為提供交易人更多交易選擇，滿足市場需求，爰修訂本條第二項規定，本公司得於交易當週之星期三一般交易時段加掛以當日為交易開始日且次二週之星期三為最後交易日之契約，加掛後交易人於每個交易日得有1週及2週到期之契約進行交易。</p>

<p>營業日為最後交易日與交易開始日。</p>	<p>營業日為最後交易日與交易開始日。</p>	
<p>第十一條</p> <p>新月份契約及存續期間新履約價格契約之上市，以臺灣證券交易所前一營業日標的指數收盤指數為基準（以下簡稱基準指數），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> <p>一、交易月份起之三個連續近月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之十五。</p> <p>二、接續之二個季月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之二十。</p> <p>前項所稱之履約價格間距，依下列方式決定之：</p> <p>一、履約價格未達三千點：近月契約間距為五十點，季月契約間距為一百點。</p> <p>二、履約價格三千點以上：近月契約間距為一百點，季月契約間距為二百點。</p>	<p>第十一條</p> <p>新月份契約及存續期間新履約價格契約之上市，以臺灣證券交易所前一營業日標的指數收盤指數為基準（以下簡稱基準指數），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> <p>一、交易月份起之三個連續近月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之十五。</p> <p>二、接續之二個季月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下百分之二十。</p> <p>前項所稱之履約價格間距，依下列方式決定之：</p> <p>一、履約價格未達三千點：近月契約間距為五十點，季月契約間距為一百點。</p> <p>二、履約價格三千點以上，<u>未達一萬五千點</u>：近月契約間距為一百點，季月契約間距為二百點。</p> <p><u>三、履約價格一萬五千點</u></p>	<p>1. 為滿足市場需求，本契約原依本條第五項以增掛方式調整履約價格間距，自 110 年 1 月 13 日起，履約價格 15000 點以上，近月契約間距，由 200 點調整為 100 點；季月契約間距，由 400 點調整為 200 點(詳見 110 年 1 月 12 日台期交字第 1100200056 號函)，考量交易人多已相當熟悉，為臻明確，爰併同修訂本條第二項規定。</p> <p>2. 各月份契約自到期日前二週之星期三一般交易時段起，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，加掛履約價格契約，爰修訂本條第四項規定。</p>

<p>當季月契約成為近月契約時，依近月契約履約價格間距，補足履約價格契約涵蓋基準指數之上下百分之十五。</p> <p>各月份契約自到期日前<u>二週之星期三</u>一般交易時段起，得依第十一條之一第二項規定加掛履約價格契約。</p> <p>除依第一項、第二項規定推出不同履約價格契約外，本公司得視市場狀況推出其他履約價格契約。</p>	<p><u>以上：近月契約間距為二百點，季月契約間距為四百點。</u></p> <p>當季月契約成為近月契約時，依近月契約履約價格間距，補足履約價格契約涵蓋基準指數之上下百分之十五。</p> <p>各月份契約自到期日<u>之前一個星期三</u>一般交易時段起，得依第十一條之一第二項規定加掛履約價格契約。</p> <p>除依第一項、第二項規定推出不同履約價格契約外，本公司得視市場狀況推出其他履約價格契約。</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小型期貨契約」
規格修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>到期契約</p> <ul style="list-style-type: none"> • 自交易當月起連續3個月份，另加上3、6、9、12月中3個接續季月，另除每月第<u>1</u>個星期三外，得於交易當週之星期三一般交易時段加掛次<u>二週之星期三</u>到期之契約 • 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 	<p>到期契約</p> <ul style="list-style-type: none"> • 自交易當月起連續3個月份，另加上3、6、9、12月中3個接續季月，另除每月第<u>2</u>個星期三外，得於交易當週之星期三一般交易時段加掛次<u>一個星期三</u>到期之契約 • 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 	<p>為提供交易人更多交易選擇，滿足市場需求，本公司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，加掛後交易人於每個交易日得有1週及2週到期之契約進行交易。</p>
<p>最後交易日</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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；交易當週星期三加掛之契約，其最後交易日為掛牌日次<u>二週之星期三</u> 	<p>最後交易日</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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；交易當週星期三加掛之契約，其最後交易日為掛牌日之<u>次一個星期三</u> 	<p>配合交易當週星期三加掛次二週之星期三為最後交易日之契約，爰酌作文字調整。</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小型期貨契約」
交易規則修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第九條</p> <p>本契約除另有規定外，其交割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、十二月中三個接續之季月，共六期，同時各別掛牌交易。各交割月份契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，最後交易日為契約之最後結算日，新交割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。</p> <p>本公司得於交易當週之星期三一般交易時段加掛以當日為交易開始日且次<u>二週</u>之星期三為最後交易日之契約，但每月第<u>一</u>個星期三除外；該契約之最後交易日為最後結算日。</p> <p>到期契約於最後交易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</p>	<p>第九條</p> <p>本契約除另有規定外，其交割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、十二月中三個接續之季月，共六期，同時各別掛牌交易。各交割月份契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，最後交易日為契約之最後結算日，新交割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。</p> <p>本公司得於交易當週之星期三一般交易時段加掛以當日為交易開始日且次<u>一個</u>星期三為最後交易日之契約，但每月第<u>二</u>個星期三除外；該契約之最後交易日為最後結算日。</p> <p>到期契約於最後交易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</p>	<p>為提供交易人更多交易選擇，滿足市場需求，爰修訂本條第二項規定，本公司得於交易當週之星期三一般交易時段加掛以當日為交易開始日且次二週之星期三為最後交易日之契約，加掛後交易人於每個交易日得有1週及2週到期之契約進行交易。</p>

<p>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。</p> <p>前三項交割月份、交易開始日、最後交易日、最後結算日，本公司認為必要時得報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>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。</p> <p>前三項交割月份、交易開始日、最後交易日、最後結算日，本公司認為必要時得報請主管機關核准後變更之。</p>	
---	---	--