

副本

臺灣期貨交易所股份有限公司 公告

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：謝珮芳

聯絡電話：(02)23695678分機250

100

臺北市羅斯福路二段100號14樓

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國101年8月13日

發文字號：台期交字第10102014260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」交易規則及規格部分條文，實施日期另行公告。

依據：金融監督管理委員會101年8月8日金管證期字第1010034876號函。

公告事項：

- 一、為臺灣證券交易所股價指數選擇權加掛一週到期之短天期契約，爰修正本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」交易規則及規格如附件。
- 二、前揭條文及規格之實施日期另行公告。

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、法源資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 **王中愷**

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	原條文	說明
<p>第九條 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，到期日之次一營業日為新到期月份契約之交易開始日。</p> <p>本公司得於交易當週之星期三加掛以當日為交易開始日且次一個星期三為最後交易日之契約，但每月第二個星期三除外；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，以其最近之次一營業日為最後交易日與交易開始日。</p>	<p>第九條 本契約之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；本契約之最後交易日為各該契約到期月份之第三個星期三，於最後交易日收盤時停止交易，最後交易日為該契約之到期日。</p> <p>前項最後交易日若為假日或因不可抗力因素未能進行交易時，以其最近之次一營業日為最後交易日。</p> <p>到期契約到期日之次一營業日，為新到期月份契約之交易開始日。</p>	<p>考量短天期指數選擇權已為全球期貨市場發展趨勢之一，為擴大市場參與者層面、滿足交易人需求，除現行五個到期月份契約外，本公司得於交易當週之星期三加掛以當日為交易開始日且次一個星期三為最後交易日之契約，但因第三個星期三為原最近月份契約之到期日，故第二個星期三不再推出以次一個星期三到期之契約，爰增訂本條第二項之規定並酌作文字修正。</p>
<p>第十條 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</p>	<p>第十條 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，依履約</p>	<p>考量各月份契約於到期日之前一個星期三起，其存續期間即形同每星期三掛牌次一個星期三到期之契約，故其履約價格間距之規</p>

稱基準指數)，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：

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。

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。

前項所稱之履約價格間距，依下列方式決定之：

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。

二、履約價格三千點以上，未達一萬點：近月契約間距為一百點，季月契約間距為二百點。

三、履約價格一萬點以上：近月契約間距為二百點，季月契約間距為四百點。

當季月契約成為近月契約時，即依近月契約履約價格間距補足未上市之履約價格契約。

各月份契約自到期日之前一個星期三起，得依第十條之一第二項規定加掛履約價格契約。

除依第一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。

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：

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。

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。

前項所稱之履約價格間距，依下列方式決定之：

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。

二、履約價格三千點以上，未達一萬點：近月契約間距為一百點，季月契約間距為二百點。

三、履約價格一萬點以上：近月契約間距為二百點，季月契約間距為四百點。

當季月契約成為近月契約時，即依近月契約履約價格間距補足未上市之履約價格契約。

除依第一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。

定應比照第十條之一第二項辦理，得加掛相關履約價格契約，爰增訂本條第四項規定並酌作文字修正。

<p>第十條之一 依第九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>一、本條新增。</p> <p>二、鑑於標的指數一週波動區間大多小於一個月，故訂定每星期三掛牌次一個星期三到期之契約，其最高及最低履約價格涵蓋範圍為基準指數之上下百分之七，履約價格間距則比照近月份契約之規定。另考量契約存續期間為一週時，交易量多集中於價平附近之序列，為更貼近交易人之需求、增加其交易彈性，故就基準指數上下百分之三範圍內之序列，調整履約價格間距為近月份契約之二分之一，爰增訂本條規定。</p>
<p>第十一條 本契約交易時間為本公司營業日上午八時四十五分至下午一時四十五分，到期契約最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至下午一時三十分。</p> <p>本契約交易日與臺灣證券交易所交易日相同。但臺灣證券交易所因故暫停交易時，本公司得依當時狀況宣布暫停交易。</p> <p>前二項交易時間及交易日，本公司得於報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>第十一條 本契約交易時間為本公司營業日上午八時四十五分至下午一時四十五分，到期<u>月份</u>契約最後交易日之交易時間為上午八時四十五分至下午一時三十分。</p> <p>本契約交易日與臺灣證券交易所交易日相同。但臺灣證券交易所因故暫停交易時，本公司得依當時狀況宣布暫停交易。</p> <p>前二項交易時間及交易日，本公司得於報請主管機關核准後變更之。</p>	<p>酌作文字修正。</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

修正內容	原內容	說明
<p><u>到期契約</u></p> <p>■ 自交易當月起連續 3 個月月份，另加上 3 月、6 月、9 月、12 月中 2 個接續的季月，<u>另除每月第 2 個星期三外，得於交易當週之星期三加掛次一個星期三到期之契約</u></p>	<p><u>到期月份</u></p> <p>■ 自交易當月起連續 3 個月月份，另加上 3 月、6 月、9 月、12 月中 2 個接續的季月，<u>總共有 5 個月份的契約在市場交易</u></p>	<p>考量短天期指數選擇權已為全球期貨市場發展趨勢之一，為擴大市場參與者層面、滿足交易人需求，除現行五個到期月份契約外，本公司得於交易當週之星期三加掛次一個星期三到期之契約，但因第三個星期三為原最近月份契約之到期日，故第二個星期三不再推出以次一個星期三為到期日之契約。</p>
<p><u>履約價格間距</u></p> <p>■ 履約價格未達 3,000 點：近月契約為 50 點，季月契約為 100 點</p> <p>■ 履約價格 3,000 點以上，未達 10,000 點：近月契約為 100 點，季月契約為 200 點</p> <p>■ 履約價格 10,000 點以上：近月契約為 200 點，季月契約為 400 點</p> <p>■ <u>交易當週星期三加掛次一個星期三到期之契約，其履約價格間距同近月契約。</u></p> <p>■ <u>各契約自到期日之前一個星期三起，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。</u></p>	<p><u>履約價格間距</u></p> <p>■ 履約價格未達 3,000 點：近月契約為 50 點，季月契約為 100 點</p> <p>■ 履約價格 3,000 點以上，未達 10,000 點：近月契約為 100 點，季月契約為 200 點</p> <p>■ 履約價格 10,000 點以上：近月契約為 200 點，季月契約為 400 點</p>	<p>交易當週之星期三加掛次一個星期三到期之契約，其履約價格間距規定比照近月契約辦理。</p> <p>另考量本契約存續期間為一週時，交易量多集中於價平附近之序列，為更貼近交易人之需求、增加其交易彈性，故就基準指數上下百分之三範圍內，調整履約價格間距為近月份契約之二分之一。</p>

<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，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. <u>交易當週星期三加掛次一個星期三到期之契約</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>契約序列</p> <p>■<u>新到期月份</u>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，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%。 2. 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>鑑於標的指數一週波動區間大多小於一個月，故訂定交易當週之星期三加掛次一個星期三到期之契約，其最高及最低履約價格涵蓋範圍為基準指數上下百分之七，並酌作文字修正。</p>
<p>交易時間</p> <p>■ 本契約之交易日與臺灣證券交易所交易日相同</p> <p>■ 交易時間為營業日上午8:45~下午1:45</p> <p>■ 到期契約最後交易日之交易時間為上午8:45~下午1:30</p>	<p>交易時間</p> <p>■ 本契約之交易日與臺灣證券交易所交易日相同</p> <p>■ 交易時間為營業日上午8:45~下午1:45</p> <p>■ 到期<u>月份</u>契約最後交易日之交易時間為上午8:45~下午1:30</p>	<p>酌作文字修正</p>
<p>最後交易日</p> <p>■ 各<u>月份</u>契約的最後交易日為各該契約交割月份第3個星期三；<u>交易當週星期三加掛之契約</u>，其最後交易日為掛牌日之次一個星期三。</p>	<p>最後交易日</p> <p>■ 各契約的最後交易日為各該契約交割月份第3個星期三</p>	<p>配合交易當週之星期三加掛次一個星期三為最後交易日之契約，爰酌作文字調整。</p>