

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：吳小姐

聯絡電話：(02)2369-5678分機371

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國106年6月7日

發文字號：台期交字第10602008030號

速別：最速件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：公告本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」增掛履約價格契約，並自本(106)年6月12日起實施。

說明：

- 一、依本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約交易規則」第10條第5項規定及第10條之1第2項規定辦理。
- 二、自本年6月12日起，旨揭契約之履約價格10,000點以上，且未達11,200點，為近月契約或依本商品交易規則第10條之1第1項規定掛牌者，依間距100點增掛履約價格契約；為季月契約者，依間距200點增掛履約價格契約；為依本商品交易規則第10條之1第2項前段規定掛牌者，依間距50點增掛履約價格契約。相關增掛範例說明如附件。
- 三、請期貨商提醒交易人，臺指選擇權增掛履約價格契約後，將提供交易人更多契約選擇，交易人交易時應注意各契約之流動性。

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、台北國際金融資訊協會、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、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 邱文島

附件：臺指選擇權履約價格契約增掛範例

一、臺指選擇權履約價格間距表

臺指選擇權原最高級距10,000點之履約價格分界(如下表1)，
將於本年6月12日增掛後，向上推移至11,200點(如下表2)。

表 1、原臺指選擇權履約價格間距

到期契約	週契約		近月契約	季月契約
履約價格涵蓋範圍 履約價格 (K)	基準指數 ¹ +/- 3%內 ²	基準指數 + (3~7%) 基準指數 - (3~7%)	基準指數 +/- 15%	基準指數 +/- 20%
K < 3,000	25 點	50 點	50 點	100 點
3,000 ≤ K < 10,000	50 點	100 點	100 點	200 點
K ≥ 10,000	100 點	200 點	200 點	400 點

表 2、增掛後之臺指選擇權履約價格間距

到期契約	週契約		近月契約	季月契約
履約價格涵蓋範圍 履約價格 (K)	基準指數 +/- 3%內	基準指數 + (3~7%) 基準指數 - (3~7%)	基準指數 +/- 15%	基準指數 +/- 20%
K < 3,000	25 點	50 點	50 點	100 點
3,000 ≤ K < 11,200	50 點	100 點	100 點	200 點
K ≥ 11,200	100 點	200 點	200 點	400 點

二、臺指選擇權增掛範例

假設本年6月9日臺灣證券交易所發行量加權股價指數收盤
指數(即臺指選擇權之基準指數)為 10,206.18，原掛牌履約價格為
10,000 點至 11,200 點之序列以及增掛之序列如下表 3。

¹基準指數即增掛契約前一營業日臺灣證券交易所發行量加權股價指數收盤指數

²即依本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」交易規則第 10 條之 1 第 2 項規定掛牌者

表 3、臺指選擇權履約價格增掛範例

履約價格	週契約		近月契約		季月契約	
	原掛牌序列	增掛序列	原掛牌序列	增掛序列	原掛牌序列	增掛序列
11,200			11,200		11,200	
11,100				<u>11,100</u>		
11,000 (基準指數*1.07)	11,000		11,000			<u>11,000</u>
10,900		<u>10,900</u>		<u>10,900</u>		
10,800	10,800		10,800		10,800	
10,700		<u>10,700</u>		<u>10,700</u>		
10,600	10,600		10,600			<u>10,600</u>
10,500 (基準指數*1.03) ³	10,500			<u>10,500</u>		
10,450		<u>10,450</u>				
10,400	10,400		10,400		10,400	
10,350		<u>10,350</u>				
10,300	10,300			<u>10,300</u>		
10,250		<u>10,250</u>				
10,200	10,200		10,200			<u>10,200</u>
10,150		<u>10,150</u>				
10,100	10,100			<u>10,100</u>		
10,050		<u>10,050</u>				
10,000	10,000		10,000		10,000	

³ 週契約於基準指數上下 3%範圍內之序列，其履約價格間距為近月契約之 1/2，其餘序列之履約價格間距則比照近月契約；另近月契約自到期前一個星期三起，亦比照週契約，其基準指數上下 3%範圍內之序列，履約價格間距亦為原近月契約之 1/2。例如基準指數為 10,206.18，則週契約履約價格大於等於 9899.9946(=10,206.18*0.97)且小於等於 10,512.3654(=10,206.18*1.03)之序列，其履約價格間距為 50 點。