

副本

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：黃宜靖

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3279

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國110年1月12日

發文字號：台期交字第1100200056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110年1月13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11條第5項及第11條之1第2項規定辦理。
- 二、自110年1月13日起，本公司推出旨揭契約履約價格一萬五千點以上時，近月契約間距，由現行二百點調整為一百點；季月契約間距，由現行四百點調整為二百點；週到期契約間距，同近月契約間距，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。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、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 黃炳鈞

### 臺指選擇權增掛履約價格契約範例

110年1月7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15,214.00點，1月8日「履約價格15,000點以上」比照交易規則第11條第2項第2款「履約價格3,000點以上，未達15,000點區間」增掛履約價格契約，亦即近月契約間距為100點；季月契約間距為200點；週到期契約間距比照近月契約為100點，並於基準指數上下3%以內依間距50點加掛履約價格契約。

履約價格	1/7 掛牌序列		1/8 增掛序列	
	202101W2	202101	202101W2	202101
14800 以下序列省略				
14800 (基準指數*0.97)	V	V		
14850	V			
14900	V	V		
14950	V			
15000	V	V		
15050			V	
15100	V			V
15150			V	
15200	V	V		
15250			V	
15300	V			V
15350			V	
15400	V	V		
15450			V	
15500			V	V
15550			V	
15600	V	V		
15650 (基準指數*1.03)			V	
15700			V	V
15800	V	V		
15900			V	V
16000	V	V		
16100			V	V
16200	V	V		
16300			V	V
16400	V	V		
16500			V	V

履約價格	1/7 掛牌序列		1/8 增掛序列	
	202101W2	202101	202101W2	202101
16600	V	V		
16700			V	V
16800 (基準指數*1.10)		V	V	
16900				V
17000		V		
17100				V
17200		V		
17300				V
17400		V		
17500 (基準指數*1.15)				V