



交易結算部 通知

日期：109年11月 24日

主旨：臺灣期貨交易所修正「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」履約價格間距，自即日起實施

說明：

- 一、依金融監督管理委員會109年11月16日金管證期字第1090357073號函辦理。
- 二、為符合市場交易需求，調整為依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十。

<u>修正後</u>	現行
<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> <ol style="list-style-type: none">1.交易當週星期三加掛次一個星期三到期之契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下10%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>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：</p> <ol style="list-style-type: none">1.交易當週星期三加掛次一個星期三到期之契約，最高及最低履約價格涵蓋基準指數之上下<u>7%</u>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%