

交易結算部 通知

日期：107年8月29日

主旨：107/9/3 開放 CME ES 週選擇權商品交易

說明：

自 107 年 9 月 3 日起，開放 CME ES 週選擇權交易：

一、商品合約規格：

商品名稱	CME ES 週選擇權 E-mini S&P 500 Weekly Options
商品代碼	第一週：ES10 第二週：ES20 第三週：ES30 第四週：ES40 (季月份無ES30)
合約規格	指數*50美元
最小跳動值	0.25點=12.5美元 權利金<5點 0.05點=2.5美元
履約價間距	5點
交易月份	4個第1, 2, 4週 + 3個非季月之第3週
交易時間(台灣夏令)	AM06:00~AM05:00 (AM04:15-AM04:30暫停15分鐘) 週五到期：AM06:00~AM04:00

二、交易注意事項

1. 到期日提醒

- (1)最後交易日為該週週五，如逢假期提前一天但提前時剛好為前月之最後交易日即不推該週週選。
- (2)第四週之最後交易日剛好是該月之最後交易日即不推該週週選。

2. 公司開放交易月份提醒

當週市場存在交易月份共有七個不同到期週，以 9/3 上線日來說：

ES10: 201809 / 201810

ES20: 201809 / 201810

ES30: 201810 / 201811 / 201812

但配合洗價行情源，公司只會開放最近月份的存續週數交易。

以 9/3 上線日來說：僅開放 201809 ES10、ES20 & 201810 ES30 等三週交易。

3. 到期履約方式

週五以 AM03:59.30 - AM04:00 交易所公告之 Fixing Price 來進行結算。
若為價內者將履約、指派為最近月份期貨(ES)部位。

4. 手續費群組

同國外指數選擇權，群組代碼為 0-USAi