

臺灣期貨交易所
元大台灣 50ETF 期貨、小型元大台灣 50ETF 期貨、
元大台灣 50ETF 選擇權契約調整及停止交易
暨期貨與選擇權組合部位保證金計收方式

一、契約調整及停止交易事項：

(一) 調整生效日及停止交易期間

調整生效日及恢復交易日：114 年 6 月 18 日

停止交易期間：

1. 元大台灣 50ETF 期貨、小型元大台灣 50ETF 期貨：

114 年 6 月 10 日 17 時 25 分至 114 年 6 月 18 日 5 時 0 分

2. 元大台灣 50ETF 選擇權：

114 年 6 月 11 日至 114 年 6 月 17 日

(二) 期貨調整(為盤後交易商品)：

114 年 6 月 18 日 8:45 開盤之一般交易時段生效

1. 元大台灣 50ETF 期貨契約

契約代號	NYF 調整為 NY1
調整契約月份	114 年 6 月、7 月、9 月、12 月及 115 年 3 月到期契約
約定標的物	NY1 約定標的物調整為 40,000 受益權單位標的證券
契約乘數	NY1 契約乘數調整為 40,000

2. 小型元大台灣 50ETF 期貨契約

契約代號	SRF 調整為 SR1
調整契約月份	114 年 6 月、7 月、9 月、12 月及 115 年 3 月到期契約
約定標的物	SR1 約定標的物調整為 4,000 受益權單位標的證券
契約乘數	SR1 契約乘數調整為 4,000

(三) 選擇權調整(非盤後交易商品)：

114 年 6 月 18 日 8:45 開盤之一般交易時段生效

契約代號	NYO 調整為 NYA
調整契約月份	114 年 6 月、7 月及 9 月到期契約
約定標的物	調整為 40,000 受益權單位標的證券
契約乘數	NYA 履約價格乘數不調整（仍為 10,000）

註 1：NY1、SR1 及 NYA 114 年 6 月到期契約因最後交易日同為 114 年 6 月 18 日，將於契約調整後當日到期。

二、加掛標準契約：

（一）期貨

上市日	114 年 6 月 18 日	
契約代號	NYF	SRF
約定標的物	10,000 受益權單位標的證券	1,000 受益權單位標的證券
到期月份	114 年 6 月、7 月、9 月、12 月及 115 年 3 月到期契約	

（二）選擇權

上市日	114 年 6 月 18 日
契約代號	NYO
約定標的物	10,000 受益權單位標的證券
到期月份	114 年 6 月、7 月及 9 月到期契約

三、部位限制：

（一）改按標的證券股數計算：

持有部位	NYF	NY1	SRF	SR1	NYO	NYA
每口折算股數	10,000	40,000	1,000	4,000	10,000	40,000

（二）部位合併計算： NYF、NY1、SRF 與 SR1 部位合併計算；NYO 與 NYA 同方向選擇權部位合併計算。

（三）部位限制數^{註2}：

適用期間 部位限制數	自 114.6.18 起至 114.7.16 (114 年 7 月契約到期日) 止	自 114.7.17 起至 NY1、 SR1、NYA 契約終止掛 牌前一營業日止
自然人	160,000,000 受益權單位	40,000,000 受益權單位
法人機構	480,000,000 受益權單位	120,000,000 受益權單位
造市者	1,200,000,000 受益權單位	300,000,000 受益權單位

註 2：部位限制數應依本契約最新適用部位限制級數計算。

四、期貨與選擇權之組合部位保證金計收方式

生效日：114年6月18日

部位組合	保證金計收方式	備註
買進 1 口 NYF ，賣出 1 口 NYO 買權(Call)	1 口 NYF 期貨保證金 + NYO 選擇權之權利金市值	
賣出 1 口 NYF ，賣出 1 口 NYO 賣權(Put)		
買進 1 口 NY1 ，賣出 1 口 NYA 買權(Call)	1 口 NY1 期貨保證金 + NYA 選擇權之權利金市值	
賣出 1 口 NY1 ，賣出 1 口 NYA 賣權(Put)		
買進 10 口 SRF，賣出 1 口 NYO 買權(Call)	10 口 SRF 期貨保證金 + NYO 選擇權之權利金市值	
賣出 10 口 SRF，賣出 1 口 NYO 賣權(Put)		
買進 10 口 SR1，賣出 1 口 NYA 買權(Call)	10 口 SR1 期貨保證金 + NYA 選擇權之權利金市值	
賣出 10 口 SR1，賣出 1 口 NYA 賣權(Put)		
買進 4 口 NYF，賣出 1 口 NYA 買權(Call)	4 口 NYF 期貨保證金+ NYA 選擇權之權利金市值	契約調整為 40,000 受益權單位 NYA 之各序列契約未沖銷部位數均為零時，停止適用此部位組合。
賣出 4 口 NYF，賣出 1 口 NYA 賣權(Put)		
買進 40 口 SRF，賣出 1 口 NYA 買權(Call)	40 口 SRF 期貨保證金 + NYA 選擇權之權利金市值	
賣出 40 口 SRF，賣出 1 口 NYA 賣權(Put)		
買進 1 口 NY1，賣出 1 至 4 口 NYO 買權(Call)	1 口 NY1 期貨保證金 + NYO 選擇權之權利金市值 (1 口 NY1 可與 1 至 4 口 NYO 形成組合部位)	契約調整為 40,000 受益權單位 NY1 之各月份契約未沖銷部位數均為零時，停止適用此部位組合。
賣出 1 口 NY1，賣出 1 至 4 口 NYO 賣權(Put)		