

主旨：加掛臺指選擇權週五到期之週契約，自 114 年 6 月 27 日起實施

說明：

一、依金融監督管理委員會 114 年 6 月 5 日金管證期字第 1140346443 號函及臺灣期貨交易所 114 年 4 月 30 日台期交字第 1140200768 號函辦理。

二、自 114 年 6 月 27 日起，每週五一般交易時段加掛次二週之星期五到期之臺指選擇權週契約。

項目	內容
到期契約	●月到期契約 1.自交易當月起連續3個月份(近月契約)，以及3月、6月、9月、12月中2個接續的季月(季月契約) 2.新到期月份契約於到期契約最後交易日之次一營業日一般交易時段起開始交易 ●週到期契約(週契約) 1.星期三到期契約：自交易當週之星期三一般交易時段加掛次二週之星期三到期之週契約。但每月第一個星期三除外 2.星期五到期契約：自交易當週之星期五一般交易時段加掛次二週之星期五到期之週契約
履約價格間距	●履約價格未達3,000點：週契約及近月契約為50點，季月契約為100點 ●履約價格3,000點以上：週契約及近月契約為100點，季月契約為200點 ●週契約自交易開始日起，近月契約自到期日前二週之星期三起，於前一營業日標的指數收盤價上下3%間，履約價格間距為近月契約之二分之一
契約序列	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： 1.週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%
最後交易日	●各月份契約的最後交易日為各該契約交割月份第3個星期三 ●交易當週加掛之星期三到期與星期五到期之週契約，其最後交易日為掛牌日次二週之星期三與星期五

三、為強化股價指數選擇權深價外契約之價格穩定效果，於退單點數規定中，增設深價外選擇權理論避險比率絕對值未達 0.01 之級距。

商品名稱	到期月份	退單點數基準值	單式買賣申報退單百分比
臺指選擇權	週到期與最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2%×Delta 絕對值×2。 Delta 絕對值未達0.01者，視為 0.1；Delta 絕對值0.01以上，未達0.25者，視為0.25；Delta 絕對值逾0.5者，視為0.5。
	次近月、第3近月、第1季月、第2季月	最近標的指數收盤價	2%
電子選擇權	最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2%×Delta 絕對值×2。 Delta 絕對值未達0.01者，視為 0.1；Delta 絕對值0.01以上，未達0.25者，視為0.25；Delta 絕對值逾0.5者，視為0.5。
	次近月與第3近月	最近標的指數收盤價	2%
金融選擇權	最近月到期	最近標的指數收盤價	取得當盤最新波動度參數前：2% 取得當盤最新波動度參數後：2%×Delta 絕對值×2。 Delta 絕對值未達0.01者，視為 0.1；Delta 絕對值0.01以上，未達0.25者，視為0.25；Delta 絕對值逾0.5者，視為0.5。
	次近月與第3近月	最近標的指數收盤價	2%

期貨交易結算部