

主 旨：修正「電子選擇權契約」交易規則及規格，自 114 年 12 月 8 日起實施

說 明：

- 一、依金融監督管理委員會 114 年 10 月 1 日金管證期字第 1140357461 號函辦理。
- 二、配合電子選擇權契約乘數，由每點 1,000 元調降至每點 250 元，及調整權利金報價最小升降單位與適用之級距範圍，依業務規則第 38 條第 3 項，12 月 8 日電子選擇權各序列契約之開盤參考價，依修正後權利金報價之最小升降單位訂定之。另配合契約乘數調降，12 月 8 日開盤前之電子選擇權未沖銷部位，按調降比例，1 口調整為 4 口。
- 三、「電子選擇權契約」調降契約乘數後之保證金金額如下：

電子選擇權(TEO)	計算賣出選擇權原始保證金之適用金額	計算賣出選擇權維持保證金之適用金額	計算賣出選擇權結算保證金之適用金額
風險保證金 (A 值)	30,000	23,000	22,000
風險保證金最低值 (B 值)	15,000	12,000	11,000
混合部位風險保證金 (C 值)	0	0	0

「臺灣證券交易所電子類股價指數選擇權契約」規格修正對照表

修正後	修正前
契約乘數 ■ 指數每點新臺幣 250 元	契約乘數 ■ 指數每點新臺幣 1000 元
權利金報價單位 ■ 報價未滿 2 點：0.02 點(5 元) ■ 報價 2 點以上，未滿 10 點：0.1 點(25 元) ■ 報價 10 點以上，未滿 100 點：0.2 點(50 元) ■ 報價 100 點以上，未滿 200 點：1 點(250 元) ■ 報價 200 點以上：2 點(500 元)	權利金報價單位 ■ 報價未滿 0.5 點：0.005 點(5 元) ■ 報價 0.5 點以上，未滿 2.5 點：0.025 點(25 元) ■ 報價 2.5 點以上，未滿 25 點：0.05 點(50 元) ■ 報價 25 點以上，未滿 50 點：0.25 點(250 元) ■ 報價 50 點以上：0.50 點(500 元)

- 四、選擇權契約到期履約結算之計算方式：以新臺幣計價之股價指數類選擇權契約到期履約之結算，依各契約最後結算價與履約價格之差額乘以契約乘數計算之，元以下無條件捨去。

期貨交易結算部