

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：李先生

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3147

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國114年5月20日

發文字號：台期交字第1140001383號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：公告元大台灣50ETF期貨（代號NYF）、小型元大台灣50ETF期貨（代號SRF）及元大台灣50ETF選擇權（代號NYO）契約調整及停止交易事宜。

說明：

- 一、依本公司股票期貨契約交易規則第21條之1、第22條、第35條及股票選擇權契約交易規則第22條之1、第23條、第37條規定辦理。
- 二、臺灣證券交易所114年5月14日臺證上二字第11400084011號函及臺證上二字第1140008401號公告元大台灣卓越50證券投資信託基金（證券代號：0050）受益憑證分割相關事項，受益憑證單位數分割比率：4（即分割後受益權單位數：分割前受益權單位數=4:1）。
- 三、旨揭契約調整生效日及交易時段、停止交易期間、恢復交易日、調整契約月份、調整內容、加掛標準契約、部位限制及期貨與選擇權之組合部位保證金計收方式等，詳列如附件。
- 四、有關旨揭商品之調整型契約（包含NY1、SR1及NYA）之114年6月到期契約，因最後交易日與契約調整生效日相同，將於契約調整後當日到期，另契約調整生效日將加掛旨揭商品之標準契約上市。
- 五、本公司於旨揭契約停止交易日3個營業日前，公告調整生效日後適用之保證金金額。

六、依本公司有價證券抵繳保證金抵繳標的增刪作業程序，元大台灣卓越50證券投資信託基金受益憑證於停止交易期間非得抵繳保證金之有價證券，期貨商、結算會員應改以現金或其他有價證券繳交保證金。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商、結算部、本公司網站

副本：中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、台北國際金融資訊協會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、記者室、企劃部、資訊規劃部、資訊作業部、監視部(均含附件)

總經理 周建隆

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)			