

公告

主旨：國外盤新增商品通知

說明：

2021 年 10 月 12 日起國外盤新增商品通知

芝加哥商品交易所(CME):

微型 E-MINI S&P 期權(美式)：

Options on Micro E-mini S&P 500 Futures (MES)

微型 E-MINI S&P 週期權(歐式):

Weekly Options on Micro E-mini S&P 500 Futures (EX1, EX2, EX3, EX4)

微型 E-MINI NASDAQ-100 週期權(歐式)：

OPTIONS ON MICRO E-MINI NASDAQ-100 INDEX FUTURES (MQ1, MQ2, MQ3, MQ4)

選擇權 商品名稱	代號	合約 規格	最小 跳動點	最小 跳動值	交易月份	交割 方式	台北 交易時間
							電子盤
微型 E-MINI S&P 期權 (美式)	MES	5 美元 ×指數	0.25 點=權利金>5 0.05 點=權利金≤5	1.25 美元 0.25 美元	2 個季月	轉為期貨 (再現金 結算)	06:00-05:00 LTD-21:30
微型 E-MINI S&P 週五期權 (歐式)	EX1/EX2/ EX3/EX4	5 美元 ×指數	0.25 點=權利金>5 0.05 點=權利金≤5	1.25 美元 0.25 美元	3 個第 1, 2, 4 週 +2 個第 3 週 (標的為季月期貨)	轉為期貨	06:00-05:00 LTD-04:00
微型 E-MINI NASDAQ-100 週五期權 (歐式)	MQ1/MQ2/ MQ3/MQ4	2 美元 ×指數	0.25 點=權利金>5 0.05 點=權利金≤5	0.5 美元 0.1 美元	3 個第 1, 2, 4 週 +2 個第 3 週 (標的為季月期貨)	轉為期貨	06:00-05:00 LTD-04:00

附註：

1. 美盤選擇權皆採實物交割，選擇權價內履約時所轉換之標的期貨月份，敬請參閱交易所官網連結。

<https://www.cmegroup.com/tools-information/quikstrike/options-calendar.html>

2. 國外選擇權賣方保證金 = 權利金市值 + MAX[(期貨原始保證金-價外值), 1/2*期貨原始保證金]

