

臺灣期貨交易所股份有限公司
「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」規格

項目	內容
交易標的	美元兌人民幣匯率
中文簡稱	小型美元兌人民幣選擇權
英文代碼	RTO
履約型態	歐式（僅能於到期日行使權利）
契約規模	20,000 美元
到期月份	<ul style="list-style-type: none"> ● 自交易當月起連續 2 個月份，另加上 3、6、9、12 月中 4 個接續季月契約在市場交易 ● 新到期月份契約於到期契約到期日之次一營業日一般交易時段起開始交易
履約價格間距	近月契約為人民幣 0.02 元，季月契約為人民幣 0.04 元
契約序列	<p>新契約掛牌時及契約存續期間，以前一一般交易時段同月份小型美元兌人民幣期貨契約之每日結算價為基準，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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交易月份起之 2 個連續近月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準價之上下 2% 2. 接續之 4 個季月契約，最高及最低履約價格涵蓋基準價之上下 4%
權利金報價單位	0.0001 點（人民幣 2 元）
漲跌幅限制	各交易時段權利金最大漲跌點數，以前一一般交易時段同月份小型美元兌人民幣匯率期貨契約之每日結算價之 7% 為限
部位限制	<ul style="list-style-type: none"> ● 交易人於任何時間持有本契約同一方之未了結部位總和，不得逾本公司公告之限制標準 ● 所謂同一方未了結部位，係指買進買權與賣出賣權之部位合計數，或賣出買權與買進賣權之部位合計數 ● 法人機構基於避險需求得向本公司申請放寬部位限制 ● 綜合帳戶，除免主動揭露個別交易人者適用法人部位限制外，持有部位不受本公司公告之部位限制
交易時間	<ul style="list-style-type: none"> ● 本契約之交易日與銀行營業日相同 ● 一般交易時段之交易時間為營業日上午 8：45～下午 4：15；到期月份契約最後交易日之交易時間為上午 8：45～上午 11：00 ● 盤後交易時段之交易時間為營業日下午 5:25~次日上午 5:00；到期月份契約最後交易日無盤後交易時段
最後交易日	各月份契約的最後交易日為各該契約到期月份第三個星期三
到期日	同最後交易日
最後結算價	財團法人台北外匯市場發展基金會在最後交易日上午 11:15 公布之臺灣離岸人民幣定盤匯率
交割方式	符合本公司公告範圍之未沖銷價內部位，於到期日當天自動履約，以現金交付或收受履約價格與最後結算價之差額