

外期選擇權網路下單應注意事項

(1) 可網路交易外期選擇權商品及合約月份：

- 本公司目前開放可網路下單之選擇權商品共計 9 項，如下：

交易所	可網路下單的選擇權商品			
CME	歐元	日圓	澳幣	迷你 S&P500
CBOT	小型道瓊	黃豆	玉米	小麥
COMEX	黃金			

1. 詳細合約商品規格請參閱本公司網頁。
2. 目前僅提供最近二個月份合約可網路交易，合約到期日次日始加掛新月份合約。
3. 提供前一日價平合約上下各 10 檔履約價合約作為當日可網路交易商品。

(2) 可網路交易平台：

1. 本公司目前外期選擇權網路下單功能僅於「外期飆速交易平台」提供。
2. 「外期飆速交易平台」使用權限可透過所屬營業員申請。
3. 「外期飆速交易平台」之外期選擇權行情揭示僅提供一檔報價。
4. 外期選擇權網路下單之單筆最大委託口數為 100 口。
5. 外期選擇權網路下單僅提供限價委託，不提供市價、停損等其他委託。

(3) 交易實務與應注意事項：

1. CME Group 選擇權商品均為美式，可在到期前要求履約。
2. 選擇權到期時價內合約將轉為期貨標的部位。（僅小道瓊與迷你 S&P 採現金結算）
3. 最後交易日(到期日)收盤後為價內者，後檯端將採買方自動履約(當天期貨部位入帳戶)或賣方被指派(隔一營業日期貨部位入帳戶)，成一期貨部位。
Buy Call：履約成為標的期貨買方部位
Sell Call：被指派成為標的期貨賣方部位
Buy Put：履約成為標的期貨賣方部位
Sell Put：被指派成為標的期貨買方部位
4. 選擇權部位到期履約，指派為最近月份的期貨部位。
例如：外匯選擇權 7、8、9 月到期若屬履約指派者，則轉為 9 月份的期貨部位，以此類推。
5. 買方應注意事項：期貨選擇權到期日若屬價內將採自動履約，買方客戶需自行注意是否有足夠的超額保證金以支應履約後持有期貨部位所需，買方若沒有足夠保證金支應標的期貨部位之留倉保證金及期貨浮動損益時，將會面臨強制平倉。（到期交割採現金結算除外）
6. 賣方應注意事項：價內選擇權賣方會因買方提出履約要求而給交易所點名履約成期貨部位，而價外合約因買方無權提出履約，是可以放至最後等待消滅。
7. 賣方保證金 = 權利金市值 + MAX(期貨原始保證金 - 價外值/2, 原始保證金/2)。
8. 本公司目前不接受外期選擇權之互抵、組合等方式，即需各自以單一部位計算。
9. 部分外期選擇權合約之流動性不佳，最佳買價與最佳賣價之間有相當價差，下單前請審慎評估。