

臺灣期貨交易所 新聞稿

新聞稿內容：期交所掛牌雙週到期契約，更多交易機會、策略更多元

為提供市場更多交易機會、策略更多元，期交所預計今(2022)年下半年推出臺指選擇權及小型臺指期貨雙週到期契約，相關規劃及增修訂規章業獲主管機關核准。

期交所一週到期選擇權推出以來，臺指選擇權整體日均量大幅成長至2021年之80.9萬口，其中一週到期選擇權日均量約占整體臺指選擇權8成，顯示短天期選擇權深受交易人青睞。近年國際期貨市場週到期選擇權亦蓬勃發展，大多數交易所同時推出多個不同週次到期契約，交易人得於任一交易日選擇多個週次到期之契約。期交所順應國際發展趨勢，推出雙週到期選擇權契約，提供交易人更多交易機會，滿足各式策略性交易需求，交易人在每一個交易日，除可繼續交易現有一週到期選擇權外，亦可交易雙週到期選擇權。另外，配合推出臺指選擇權雙週到期契約，同時推出小型臺指期貨雙週到期契約，提升臺指選擇權與小型臺指期貨價格發現功能與定價效率。

雙週到期臺指選擇權及小型臺指期貨，掛牌方式為「每週三掛牌2週後星期三到期之契約」，例如交易月份第2個星期三即上市同月份第4個星期三到期之新契約，交易月份第3個星期三上市同月份第5個星期三到期之新契約，以此類推。換言之，雙週到期契約係將現有一週到期契約之新契約提前1週掛牌，依此掛牌方式，每個交易日將同時有存續期間1週(即一週到期契約)、2週(即雙週契約)及月到期契約可交易，藉此提供市場參與者更多交易機會，可運用交易策略更為多元。