

# 美道瓊期貨 採CME契約規格

涂憶君／台北報導

期交所5月15日將推出新臺幣計價美國道瓊期貨，為便利交易人進行跨市場套利及避險，期交所在契約規格設計上，包括最後交易日以及最後結算價，與母市場美國芝加哥商業交易所集團（CME Group）的美國道瓊指數期貨契約規格相同。

期交所表示，考量到我國期貨市場交易習慣及交易人結構，有部分規格設計採「在地」特色，包括計價幣別、交易日、交易時間、契約規模等。

計價幣別部分，採新台幣計價，契約乘數為每點新臺幣20元，若以2017年2月28日美國E-mini道瓊工業平均股價指

數期貨最近月份契約的收盤價20,807點換算，契約價值約為新臺幣41萬6,140元，最小升降單位為指數1點。

交易日與期交所的營業日相同，因於臺灣期貨市場交易日進行交易，因此，美國道瓊期貨可能會有在美國現貨市場休市日時交易，或在美國現貨市場交易日時休市的情形。

交易時間則為臺灣時間一般交易時段的上午8：45～下午1：45，以及盤後交易時段的下午3：00～次日上午5：00，完整涵蓋美國證券市場交易時段，方便交易人能掌握操作機會，並且進行風險控管與部位調整。

到期交割月份同美國CME

Group的E-mini道瓊期貨，為3月、6月、9月、12月共4個接續季月。每日結算價與現行其他國內指數期貨相同，採當日收盤前1分鐘所有交易的成交量加權平均價。

最後交易日則是與美國母市場相同到期月份契約的最後交易日相同，為到期月份第三個星期五。但最後交易日如遇我國假日或標的指數預定不發布日，則調整為前一個同時為標的指數預定發布日及期交所營業日。

交割方式以現金交割，交易人於最後結算日依最後結算價的差額，以淨額進行現金交付或收受。