

■ 名詞解釋

1. 交易時間：兩種

- 盤內交易：08:45:00(開盤) ~ 13:45:00(收盤)
- 盤後交易：15:00:00 ~ 隔日 05:00:00

2. 到期日：

- 每個月的第三個星期三

3. 到期月份：五種，也就是五個不同的契約，可以把它們完全分開來看。每次交易都可以選擇要買哪一種契約。

- 最近一個月
- 最近第二個月
- 最近第一個季月(3 的倍數的月份)
- 最近第二個季月
- 最近第三個季月

不同的契約會有不同的 k 線圖。以 2018/10/08 為例，在鉅亨網搜尋「台指期」，就會出現許多選項，可以看到不同的 k 線圖：

Q	台指期	×
TXF	台指期	期貨
MXF	小台指期	期貨
TXFJ8	台指期1810	期貨
TXFL8	台指期1812	期貨
TXFF9	台指期1906	期貨
TXFK9	台指期1911	期貨

鉅亨網網址：<https://stock.cnyes.com/market/TFE:TXF:FUTURE>

■ 注意事項

1. OHLC 只需要看盤內交易的價格即可
2. 本次作業只要看最近一個月契約之價格即可

■ 範例(2018/10/01)

1. 篩選盤內的交易

不在盤內的交易就可以刪除。

成交日期	商品代號	到期月份	成交時間	成交價格	成交數量
20180929	TX	201810	045947	10946	2
20180929	TX	201810	045947	10948	2
20180929	TX	201810	045947	10948	2
20181001	TX	201810	084500	10968	1152
20181001	TX	201810	084500	10967	2
20181001	TX	201810	084500	10967	2

2. 推算最近的契約月份

從今天開始算，最近的到期日是 10/17，所以最近一個月的契約就是 201810。

3. 篩選契約月份

由於我們只需要計算最近月份的 OHLC，所以可以將不需要的契約刪掉，只保留 201810 的契約。

成交日期	商品代號	到期月份	成交時間	成交價格
20181001	TX	201810	11012	2
20181001	TX	201810	11012	2
20181001	TX	201811	10995	2
20181001	TX	201811	10993	2
20181001	TX	201812	10917	2
20181001	TX	201812	10917	2

4. 接下來就可以計算 OHLC 了！

■ 其他說明

1. 盤後交易的明細都會存在隔日的 **csv** 檔案中，所以一份檔案才會看到兩個以上不同的日期。（週末的都會存到週一的檔案裡。）
2. 每次買期貨的時候都可以選擇 5 種不同的契約，當你購買某月的契約之後，一旦到了該月的到期日，就會被強制賣出。
3. 到期日當天還可以買當天到期的契約，但到期日次日就不能買當月到期的契約了
4. 最近一個月的契約也是最多人交易的契約，越遠的契約越少人買賣，流通性也比較不高。
5. 計算出來的結果，若和鉅亨網的結果不同，請勿擔心。只要按照上述說明，應該就可以得到和評分系統同樣的結果。（我們目前測試的結果，評分系統所算出來的 **close** 價格可能會和鉅亨網的數值有差異，目前原因未明。）
6. 開盤時若有數筆交易，請抓第一筆來決定 **open** 的價格。
7. 收盤時若有數筆交易，請抓最後一筆來決定 **close** 的價格。