# 臺灣期貨交易所股份有限公司期貨商辦理期貨交易人部位移轉作業應行注意事項修正條文對照表

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 第四條　期貨商應於移轉生效日前一個營業日下午七時三十分前，由其結算會員填具「部位及保證金移轉申請書」向本公司提出申請。 | 第四條　期貨商應於移轉生效日前一個營業日下午六時三十分前，由其結算會員填具「結算會員部位及保證金移轉申請書」向本公司提出申請。 | 為提升本公司對期貨商服務，延長期貨商辦理部位移轉申請作業時限，將原於一般交易時段收盤後即須由結算會員提出申請之時限，延長至當日本公司現金保證金存入之截止時點(下午七時三十分)，爰修訂本條文。 |
| 第五條　本公司經審核申請資料內容無誤後辦理部位移轉作業，移出方之帳戶或綜合帳戶下個別交易人當日一般交易時段收盤結帳後之部位、有價證券及其他權益應全數移轉，並於次一營業日生效。 | 第五條　本公司經審核申請資料內容無誤後辦理部位移轉作業，移出方之帳戶或綜合帳戶下個別交易人之部位、有價證券及其他權益應全數移轉，並於次一營業日生效。 | 配合建置盤後交易平台，明訂期貨商辦理期貨交易人部位移轉，移轉內容係依據移轉生效日前一營業日一般交易時段收盤結帳之部位、有價證券及其他權益，爰修訂本條文。 |

# 臺灣期貨交易所股份有限公司期貨商辦理更換受託結算會員作業應行注意事項修正條文對照表

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 四、期貨商應辦理下列事項：<br>（一）通知原任結算會員於更換生效日前一營業日下午七時三十分前向本公司提出部位及保證金移轉申請。<br>（二）於更換生效日一般交易時段開盤前，就其未了結部位，傳送部位資料及檔案予新任結算會員，檔案格式請參照（附件二）。<br>（三）於更換生效日當日一般交易時段開盤前，完成交易系統與結算系統之代碼變更設定。 | 四、期貨商應於更換生效日前一營業日結帳後辦理左列事項：<br>（一）依據當日收盤結帳後之保證金權益數及未了結部位數，通知原任結算會員於下午七時三十分前向本公司提出部位及保證金移轉申請。<br>（二）傳送部位資料及檔案予新任結算會員，檔案格式請參照（附件二）。<br>（三）完成交易系統與結算系統之代碼變更設定。 | 配合建置盤後交易平台，每日交易時間將區分為一般交易時段及盤後交易時段，為避免原規定之時間及相關作業規定造成混淆，爰修訂第四點之規定。 |
| 五、新任結算會員應於更換生效日一般交易時段開盤前，辦理下列事項：<br>（一）填妥「結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書」（附件三），傳真並電話通知本公司結算部。<br>（二）完成交易系統與結算系統之代碼變更設定。 | 五、新任結算會員應於更換生效日前一營業日結帳後辦理左列事項：<br>（一）填妥「結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書」（附件三），傳真並電話通知本公司結算部。<br>（二）完成交易系統與結算系統之代碼變更設定。 | 配合建置盤後交易平台，每日交易時間將區分為一般交易時段及盤後交易時段，為避免原規定之時間造成混淆，爰修訂第五點之規定。 |
| 六、原任結算會員應於更換生效日前一營業日下午七時三十分前填妥「部位及保證金移轉申請書」（附件四）向本 | 六、原任結算會員應於更換生效日前一營業日下午七時三十分前填妥「結算會員部位及保證金移轉申請書」（附件 | 配合建置盤後交易平台，每日交易時間將區分為一般交易時段及盤後交易時段，為避免原規定之時間及相關作業規定造 |

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 公司結算部提出部位移轉申請，另於更換生效日現金結算保證金提領作業截止前向本公司結算部提出現金保證金移轉申請。 | 四）向本公司結算部提出移轉申請。 | 成混淆，爰修訂第六點之規定。 |

附件一

# 臺灣期貨交易所股份有限公司
# 期貨商更換受託結算會員申報書

申報日期：民國　　年　　月　　日

| |
|---|
| 申報期貨商： |
| 原受託結算會員： |
| 壹、指定更換結算會員生效日：民國　　年　　月　　日。<br>自指定更換結算會員生效日上午五時起，本公司與原受託結算會員終止結算交割契約，同時委託　　期貨公司(代號:　　)辦理結算交割業務。<br>貳、自指定更換結算會員生效日前一營業日一般交易時段收盤結帳後，本公司將通知原受託結算會員向臺灣期貨交易所辦理部位及保證金移轉等相關事項。<br>申報期貨商簽章：<br>（請蓋原留印鑑）<br>原受託結算會員簽章：<br>（請蓋原留印鑑） |

註：申報書如有疑問請洽申報期貨商：(　　)

附件三

# 結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書

中華民國　　年　月　日

| | |
|---|---|
| ☐取消限制交易(取消限制新增部位) | ☐取消停止交易(取消限制新增及沖銷部位) |
| 結算會員代號： | 結算會員名稱： |
| 委託期貨商代號： | 委託期貨商名稱： |

申請取消限制/停止交易理由:

☐1.委託期貨商持有部位符合本公司規定額度

☐2.委託期貨商已在規定時間內補繳所需保證金

☐3.其他_____

_____期貨商之部位額度及保證金已符合本公司規範標準，本公司申請取消限制/停止該期貨商交易。

業務主管簽章：_____ 承辦人員簽章：_____

公司留存印鑑章：

(結算會員得以結算交割專用章替代)

註：1.結算會員於一般交易時段期間申請取消限制/取消停止委託期貨商交易，應填妥及傳真本申請書至本公司結算部。傳真號碼：(02)2364-5460。

2.本申請書正本應於次一營業日一般交易時段收盤前送交本公司結算部。

附件四

# 臺灣期貨交易所股份有限公司

## 部位及保證金移轉申請書

## （期貨商更換受託結算會員）

申請日期：民國　年　月　日

| 申請結算會員： | 結算會員代號： |
| --- | --- |

依據民國_____年____月____日**期貨商更換受託結算會員申報書**申請辦理下列事項：

一、更換結算會員生效日(民國　年　月　日)移轉現金保證金至_____期貨商。

移轉金額：新台幣（大寫）_____元整。

二、更換結算會員生效日前一營業日(民國　年　月　日)盤後交易時段收盤後之有價證券保證金移轉至_____期貨商。

三、更換結算會員生效日前一營業日(民國　年　月　日)盤後交易時段收盤後之未了結部位數移轉至_____期貨商。

結算會員：

_____（請蓋原留印鑑）

註：申請書如有任何疑問請洽(____)_____

# 臺灣期貨交易所股份有限公司結算會員處理委託期貨商部位作業程序修正條文對照表

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 二、申請限制委託期貨商交易作業程序<br>(一) 結算會員基於部位之風險管理，當委託期貨商發生下列情況之一時，得<u>於一般交易時段期間</u>向本公司申請限制委託期貨商交易：<br>1.委託期貨商持有之未沖銷部位數量逾結算會員規定之額度。<br>2.委託期貨商未於結算會員規定時限繳足所需保證金。<br>3.其他足以影響結算會員財務、業務狀況之情事。<br>(二)結算會員向本公司申請限制委託期貨商交易，應依下列程序辦理：<br>1.確認該委託期貨商未沖銷部位之總數。<br>2.以電話及書面文件通知委託期貨商，並保留足資證明之紀錄備查。<br>3.填妥『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』(附件一)傳真至本公司結算部，並以電話確認接收無誤。<br>4.將『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』 | 二、申請限制委託期貨商交易作業程序<br>(一)結算會員基於部位之風險管理，當委託期貨商發生下列情況之一時，得向本公司申請限制委託期貨商交易：<br>1.委託期貨商持有之未沖銷部位數量逾結算會員規定之額度。<br>2.委託期貨商未於結算會員規定時限繳足所需保證金。<br>3.其他足以影響結算會員財務、業務狀況之情事。<br>(二)結算會員向本公司申請限制委託期貨商交易，應依下列程序辦理：<br>1.確認該委託期貨商未沖銷部位之總數。<br>2.以電話及書面文件通知委託期貨商，並保留足資證明之紀錄備查。<br>3.填妥『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』(附件一)傳真至本公司結算部，並以電話確認接收無誤。<br>4.將『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』 | 配合建置盤後交易平台，每日交易時間將區分為一般交易時段及盤後交易時段，為明確定義原規定之收盤時間，爰修訂第二點之規定。 |

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 正本於次一營業日一般交易時段收盤前送交本公司結算部。 | 正本於次一營業日收盤前送交本公司結算部。 | |
| 三、申請停止委託期貨商交易作業程序<br>(一)結算會員基於部位之風險管理，當委託期貨商經限制交易後，仍未依雙方受託辦理結算交割契約辦理時，結算會員得於一般交易時段期間向本公司申請停止委託期貨商交易。<br>(二)結算會員向本公司申請停止委託期貨商交易，應依下列程序辦理：<br>1.確認該委託期貨商未沖銷部位之總數。<br>2.以電話及書面文件通知委託期貨商，並保留足資證明之紀錄備查。<br>3.填妥『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』傳真至本公司結算部，並以電話確認接收無誤。<br>4.將『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』正本於次一營業日一般交易時段收盤前送交本公司結算部。 | 三、申請停止委託期貨商交易作業程序<br>(一)結算會員基於部位之風險管理，當委託期貨商經限制交易後，仍未依雙方受託辦理結算交割契約辦理時，結算會員得向本公司申請停止委託期貨商交易。<br>(二)結算會員向本公司申請停止委託期貨商交易，應依下列程序辦理：<br>1.確認該委託期貨商未沖銷部位之總數。<br>2.以電話及書面文件通知委託期貨商，並保留足資證明之紀錄備查。<br>3.填妥『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』傳真至本公司結算部，並以電話確認接收無誤。<br>4.將『結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書』正本於次一營業日收盤前送交本公司結算部。 | 配合建置盤後交易平台，每日交易時間將區分為一般交易時段及盤後交易時段，為明確定義原規定之收盤時間，爰修訂第三點之規定。 |
| 四、申請取消限制或停止交易作業程序<br>結算會員於一般交易時段期 | 四、申請取消限制或停止交易作業程序<br>結算會員申請取消委託期貨 | 配合建置盤後交易平台，每日交易時間將區分為一般交易時段及盤後交易時段，為明確定 |

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 間申請取消委託期貨商限制交易或停止交易，應依下列程序辦理：<br>(一)確認該委託期貨商未沖銷部位之總數。<br>(二)填妥『結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書』(附件二) 傳真至本公司結算部，並以電話確認接收無誤。<br>(三)結算會員以電話及書面文件通知委託期貨商限制交易或停止交易已取銷。<br>(四)將『結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書』正本於次一營業日一般交易時段收盤前送交本公司結算部。 | 商限制交易或停止交易，應依下列程序辦理：<br>(一)確認該委託期貨商未沖銷部位之總數。<br>(二)填妥『結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書』(附件二) 傳真至本公司結算部，並以電話確認接收無誤。<br>(三)結算會員以電話及書面文件通知委託期貨商限制交易或停止交易已取銷。<br>(四)將『結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書』正本於次一營業日收盤前送交本公司結算部。 | 義原規定之收盤時間，爰修訂第四點之規定。 |
| 五、代為了結期貨契約作業程序<br>(一) （略）<br>(二) （略）<br>(三) （略）<br>(四) （略）<br>(五) （略）<br>(六) （略）<br>(七) （略）<br>(八) （略）<br>(九) （略）<br>(十) （略）<br>(十一) （略）<br>(十二)結算會員於部位處理完 | 五、代為了結期貨契約作業程序<br>(一) （略）<br>(二) （略）<br>(三) （略）<br>(四) （略）<br>(五) （略）<br>(六) （略）<br>(七) （略）<br>(八) （略）<br>(九) （略）<br>(十) （略）<br>(十一) （略）<br>(十二)結算會員於部位處理完 | 同上。 |

| 修　正　條　文 | 原　條　文 | 說　　明 |
| --- | --- | --- |
| 畢後，應於次一營業日一般交易時段收盤前檢附下列文件向本公司申報：<br>1.「結算會員代為了結部位申報書」正本。<br>2.對該委託期貨商追繳保證金通知書與代為了結部位通知書影本。<br>3.代為了結部位之買賣委託書及成交紀錄影本。<br>4.「部位移轉申報書」正本(附件五)。<br>5.該「部位處理專戶」代為了結當日買賣報告書影本。 | 畢後，應於次一營業日收盤前檢附下列文件向本公司申報：<br>1.「結算會員代為了結部位申報書」正本。<br>2.對該委託期貨商追繳保證金通知書與代為了結部位通知書影本。<br>3.代為了結部位之買賣委託書及成交紀錄影本。<br>4.「部位移轉申報書」正本(附件五)。<br>5.該「部位處理專戶」代為了結當日買賣報告書影本。 | |

附件一

# 結算會員限制／停止委託期貨商交易申請書

中華民國　　年　月　日

<table>
<tr><td colspan="5">☐限制交易(限制新增部位)　　☐停止交易(限制新增及沖銷部位)</td></tr>
<tr><td colspan="2">結算會員代號：</td><td colspan="3">結算會員名稱：</td></tr>
<tr><td colspan="2">委託期貨商代號：</td><td colspan="3">委託期貨商名稱：</td></tr>
<tr><td>項　　目</td><td>商　品　代　號</td><td>交　割　月　份</td><td>買</td><td>賣</td></tr>
<tr><td>期貨商部位狀況</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td colspan="5">本公司已於_____時_____分通知委託期貨商</td></tr>
<tr><td colspan="5">1.依本公司與委託期貨商受託辦理結算交割契約，委託期貨商<br>☐(1)持有部位超逾本公司規定之額度<br>☐(2)未在本公司規定時間內補繳所需保證金<br>☐(3)其他_____<br>基於上述理由，本公司申請限制/停止該期貨商交易。<br>2.本公司申請限制/停止_____期貨商交易，倘因此發生該期貨商之權益損失或其他糾紛，概與臺灣期貨交易所無涉。<br><br>業務主管簽章：_____ 承辦人員簽章：_____<br>公司留存印鑑章：<br>(結算會員得以結算交割專用章替代)</td></tr>
</table>

註：1.結算會員於一般交易時段期間申請限制/停止委託期貨商交易，應填妥及傳 真本申請書至本公司結算部。傳真號碼：(02)2364-5460。

2.本申請書正本應於次一營業日一般交易時段收盤前送交本公司結算部。

附件二

# 結算會員取消限制／停止委託期貨商交易申請書

中華民國　　年　月　日

| | |
|---|---|
| ☐取消限制交易(取消限制新增部位)　　☐取消停止交易(取消限制新增及沖銷部位) | |
| 結算會員代號： | 結算會員名稱： |
| 委託期貨商代號： | 委託期貨商名稱： |

申請取消限制/停止交易理由:

☐1.委託期貨商持有部位符合本公司規定額度

☐2.委託期貨商已在規定時間內補繳所需保證金

☐3.其他_____

_____期貨商之部位額度及保證金已符合本公司規範標準，本公司申請取消限制/停止該期貨商交易。

業務主管簽章：_____ 承辦人員簽章：_____

公司留存印鑑章：

(結算會員得以結算交割專用章替代)

註：1.結算會員於一般交易時段期間申請取消限制/取消停止委託期貨商交易，應填妥及傳真本申請書至本公司結算部。傳真號碼：(02)2364-5460。

2.本申請書正本應於次一營業日一般交易時段收盤前送交本公司結算部。

# 臺灣期貨交易所股份有限公司
# 期貨契約當日沖銷交易減收保證金作業說明

中華民國九十七年五月六日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第０九七０００四二二六０號函公告
中華民國九十七年八月七日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第０九七０００七一三五０號函公告
中華民國九十八年九月十四日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第０九八０００九六三二０號函公告
中華民國九十九年五月二十七日行政院金融監督管理委員會
金管證期字第０九九００二三九六五號函准予備查
中華民國九十九年六月一日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第０九九０００五四四六０號函公告
中華民國一百零二年四月三日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第一０二０００００九二０二號函公告
中華民國一百零三年三月二十八日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第一０三０００００七五二０號函公告
中華民國一百零六年三月十六日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第一０六０三００二０八０號函公告

## 壹、 前言

期貨商接受委託人從事期貨契約當日沖銷交易及期貨商經營自營業務從事期貨契約當日沖銷交易者，應依本作業說明辦理。

## 貳、 適用契約、保證金收取標準及適用交易時段

本公司期貨契約當日沖銷交易減收保證金作業適用契約、保證金收取標準及適用交易時段如下:

### 一、適用契約

本公司期貨契約當日沖銷交易保證金計收方式及標準，適用本公司臺灣證券交易所股價指數期貨契約(TX)、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約(TE)、臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約(TF)及臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約(MTX)等 4 種商品之最近 2 個到期月份契約。

二、保證金收取標準

本公司期貨契約當日沖銷交易之結算保證金、維持保證金、原始保證金，係依適用期貨契約公告之一般交易之保證金金額按本公司訂定成數(50%)減收後，取千元整數進位訂定之。依此方式之當日沖銷交易保證金收取標準舉例如下表。

當日沖銷交易保證金收取標準

單位:新臺幣元

| | 結算保證金 | | 維持保證金 | | 原始保證金 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 商品別 | 當日沖銷交易 | 一般交易 | 當日沖銷交易 | 一般交易 | 當日沖銷交易 | 一般交易 |
| 臺股期貨 | 31,000 | 61,000 | 32,000 | 64,000 | 42,000 | 83,000 |
| 電子期貨 | 25,000 | 50,000 | 26,000 | 52,000 | 34,000 | 68,000 |
| 金融期貨 | 23,000 | 45,000 | 24,000 | 47,000 | 31,000 | 61,000 |
| 小型台指期貨 | 8,000 | 15,250 | 8,000 | 16,000 | 11,000 | 20,750 |

期貨商接受委託執行本公司期貨契約當日沖銷交易委託時，應向交易人收取不得低於本公司公告之當日沖銷交易原始保證金及維持保證金標準之足額保證金，始可接受委託進行交易。期貨商經營自營業務從事本公司期貨契約當日沖銷交易，亦應依前述繳足不低於本公司公告之當日沖銷交易原始保證金及維持保證金標準之足額保證金，方可進行交易。另本公司向結算會員收取當日沖銷交易結算保證金。

本公司期貨契約當日沖銷交易保證金之調整，依本公司「結

算保證金收取方式及標準」辦理。一般交易之保證金金額調整時，當日沖銷交易保證金並依前揭方式調整之。

三、適用交易時段

本公司期貨契約當日沖銷交易減收保證金作業，適用一般交易時段，盤後交易時段不適用。

## 參、期貨商受託買賣相關作業

一、風險預告

期貨商應將當日沖銷交易可能之風險充分告知交易人，並要求交易人簽署風險預告書，風險預告書內容應依中華民國期貨業商業同業公會「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」之規定為之。

二、內部控制制度

期貨商應依中華民國期貨業商業同業公會「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」規定，於其內部控制制度訂定下列作業規範及風險控管機制，並確實執行：

(一)得進行當日沖銷交易之交易人資格條件。

(二)當日沖銷交易之委託單下單控管作業方式。

(三)當日沖銷交易盤中風險控管機制。

(四)當日沖銷交易部位之強制沖銷規範。

(五)收盤後交易人留有當日沖銷交易未沖銷部位餘額之處理方式。

三、交易人資格條件

依據中華民國期貨業商業同業公會「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」之規定，得進行當日沖銷交易之交易人資格條件如下：

(一)開立期貨受託契約滿三個月。

(二)最近一年內期貨契約交易成交十筆以上，其開立期貨受託契約未滿一年者亦同。

(三)除未沖銷部位所需保證金外，另應提供最近一年之財力證明，其價值總金額應不低於從事當日沖銷交易所需保證金額度之百分之三十，但申請適用於當日沖銷交易所需保證金額度未逾新臺幣五十萬元者不適用之。

四、一般交易時段盤中風控與收盤前代為沖銷作業

(一)盤中風控作業

依據中華民國期貨業商業同業公會「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」之規定:

1. 當日沖銷交易委託單成交之後，期貨商應依據本公司公告之期貨契約當日沖銷交易及一般交易保證金收取標準，依帳戶權益數對期貨交易人執行盤中風險控管，期貨交易人帳戶權益數低於未沖銷部位所需維持保證金時，應對該期貨交易人發出盤中高風險帳戶通知。
2. 當日沖銷交易因市價變動，致使期貨商依整戶風險管理原則，以一般交易所需原始保證金計算之交易人帳戶盤中風險指標，低於期貨商約定之比率時(期貨商約定之比率不得低於 25%)，期貨商應開始執行代為沖銷作業程序。

(二) 一般交易時段收盤前代為沖銷作業

期貨商對交易人持有之期貨契約當日沖銷交易未沖銷部位，

除與交易人另有書面約定外，應通知並要求交易人於期貨商規定時限前自行沖銷；對於無法通知到達之交易人或未於前揭時限自行沖銷部位者，除因不可抗力之因素外，期貨商應於當日一般交易時段收盤前代為沖銷之。

為降低期貨商於一般交易時段收盤前代為沖銷之負擔及減少期貨商與交易人之爭端，期貨商應依下列規定執行：

1. 期貨商於下午 1 時至 1 時 30 分期間，除與交易人另有書面約定外，應通知並要求交易人自行沖銷當日沖銷交易之未沖銷部位，惟對無法通知到達之交易人，期貨商仍須執行代為沖銷。
2. 期貨商應於一般交易時段收盤前 15 分鐘，產製相關檢核報表，對交易人當日所有當日沖銷交易未沖銷部位於該時點後，開始將尚未成交之當日沖銷交易新增部位委託單取消，及將當日沖銷交易平倉委託單取消或使用委託單改價功能，再以市價單、合理之限價單(最近成交價至其以下 5 個價格跳動點內之平倉賣單或最近成交價至其以上 5 個價格跳動點內之平倉買單)或一定範圍市價單等方式執行代為沖銷。
3. 對於交易人已為漲停買進或跌停賣出之當日沖銷交易平倉委託單，並經期貨商限制無法撤銷者，得不受期貨商應於一般交易時段收盤前 15 分鐘執行取消改掛新委託單或委託單改價之限制，以降低因取消原委託單改掛新委託單，致輸入時序延後而無法成交之風險。

五、盤後風控作業

經前項一般交易時段收盤前代為沖銷作業方式仍未能於當日沖銷之部位，交易人倘未能於當日期貨商規定時限前補足保證金至該期貨契約之一般交易原始保證金者，期貨商應於次一一般交

易時段執行沖銷直至部位全數了結。

為降低期貨商一般交易時段收盤前代為沖銷之負擔及減少期貨商與交易人之爭端，期貨商應依下列規定執行：

(一)倘若一般交易時段收盤後，交易人帳戶權益數不低於以一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需原始保證金，則該當日沖銷交易未沖銷部位無須代為沖銷。

(二)倘若一般交易時段收盤後，交易人帳戶權益數低於以一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需原始保證金，應計算當日沖銷交易未沖銷部位餘額之權益數（即以本公司規定之當日沖銷交易所需原始保證金加計其當日損益金額），若低於一般交易所需原始保證金，則期貨商應通知交易人於下午3時30分前將當日沖銷交易未沖銷部位保證金補足至一般交易所需原始保證金數額，交易人於此時限前補足者，則無須代為沖銷。

(三)未符合前揭規定者，期貨商應於次一一般交易時段繼續執行強制代為沖銷，直至部位全數了結為止。

六、處理流程說明

當日沖銷交易一般交易時段收盤前代為沖銷方式及收盤後交易人留有當日沖銷交易未沖銷部位之處理流程圖說明如下：

**T 日**

13:00 至 13:30 →

期貨商除與交易人另有書面約定外，應通知並要求交易人自行完成沖銷，對於無法通知到之交易人，期貨商仍須執行代為沖

13:30 至 13:45 →

期貨商應於一般交易時段收盤前 15 分鐘，產製相關檢核報表，對交易人當日所有當日沖銷交易未沖銷部位，於該時點後，開始將尚未成交之當日沖銷交易新增部位委託單取消，及將當日沖銷交易平倉委託單取消或使用委託單改價功能，再以市價單、合理之限價單(最近成交價至其以下 5 個價格跳動點內之平倉賣單或最近成交價至其以上 5 個價格跳動點內之平倉買單)或一定範圍市價單等方式執行代為沖銷。

一般交易時段收盤後，仍留有當日沖銷交易之未沖銷部位餘額者，依下列方式處理：

13:45 至 15:30 →

1. 交易人帳戶權益數不低於以一般交易保證金標準計算未沖銷部位所需原始保證金時，則當沖交易未沖銷部位無須代為沖銷。
2. 交易人帳戶權益數低於一般交易標準所需原始保證金，應計算當沖交易未沖銷部位餘額之權益數，若低於一般交易所需原始保證金，則期貨商應通知交易人於 15:30 前將當日沖銷交易未沖銷部位保證金補足至一般交易所需原始保證金數額，交易人於此時限前補足，則無須代為沖銷。

**T+1 日**

**一般交易時段開盤(8:45)** →

期貨商針對前一營業日，當日沖銷交易未沖銷部位保證金未補足至一般交易所需原始保證金數額之部位，於一般交易時段開盤後繼續執行代為沖銷，直至該部位全數了結。

## 肆、期貨商自行買賣相關作業

一、期貨商經營自營業務從事期貨契約當日沖銷交易，應於其內部控制制度訂定下列作業規範及風險控管機制，並確實執行：

(一)當日沖銷交易之下單控管作業方式。

(二)當日沖銷交易盤中風險控管機制。

(三)收盤後留有當日沖銷交易之未沖銷部位餘額之處理方式。

二、當日沖銷交易委託單成交後，應依本公司公告之期貨契約當日沖銷交易保證金計收標準，計算其保證金帳戶權益數並執行盤中風險控管。

三、期貨商經營自營業務從事期貨契約當日沖銷交易之未沖銷部位，除因不可抗力之因素外，應於當日一般交易時段收盤前沖銷之。經前項方式仍未於當日沖銷之部位，倘未能於當日下午 3 時 30 分時前補足保證金至該期貨契約之原始保證金者，應於次一一般交易時段執行沖銷直至部位全數了結。

## 伍、委託單管理

新增「期貨契約當日沖銷交易委託」委託選項。倘帳戶無相反方向未沖銷部位或帳戶存在相反方向未沖銷部位，且小於該筆委託單委託口數者，則屬新增部位交易。交易系統委託單新平倉碼欄位應為「2：期貨當日沖銷交易」。新增部位交易依期貨當日沖銷交易保證金計收標準收取保證金。

倘帳戶存在相反方向未沖銷部位，且大於或等於該筆委託單委託口數者，屬平倉交易，交易系統委託單新平倉碼欄位應為「1：平倉」。平倉交易不收取保證金。成交後優先沖銷當日沖銷交易部

位，全數沖銷後，再沖銷一般交易部位。

若未勾選委託單之選項，該筆交易以一般交易自動處理， 亦即自動處理後之新倉委託視為一般交易，交易系統委託單新平倉碼欄位應為「0：新倉單」，不適用當日沖銷交易減收保證金。

## 陸、 其他應注意事項

一、期貨商應於網頁加註警語或要求業務員接受委託進行當日沖銷交易時，提醒並告知交易人進行次近月份期貨契約當日沖銷交易時應注意流動性風險。

二、本公司期貨契約當日沖銷交易新增部位委託有效時間為正常營業日上午 8 時 45 分至下午 1 時 30 分(收盤前 15 分鐘)，本公司交易系統於 1 時 30 分起，停止接受期貨當日沖銷交易新增部位之買賣申報，惟交易系統已接受之委託單仍屬有效。

三、當日沖銷交易部位不適用本公司期貨契約價差交易保證金計收作業。

四、當日沖銷交易部位不得與選擇權進行指定部位組合。

五、當日沖銷交易部位經申請錯帳調整及大小台指部位互抵後，或經進行反向申請取消，該部位不再適用當日沖銷交易保證金。

六、期貨商執行代為沖銷時，應注意交易人是否另有當日沖銷交易平倉委託單，避免重複下單。

七、期貨商依其承受風險能力、風險管理政策與作業時間之考量，得提前執行代為沖銷。