

# 國內期貨當日沖銷交易風險預告同意書修訂公告

依據中華民國期貨業商業同業公會中期商字第 1060001973 號函文公告之「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」(範本)，爰修訂本公司「國內期貨當日沖銷交易風險預告同意書」，自 106 年 06 月 19 日起實施，相關異動內容如下：

修正條文	現行條文	說明
表單編號:TC-C01-67-3	表單編號:TC-C01-67-2	修訂表單編號
本風險預告書是依據期貨交易法第六十五條第二項規定。本風險預告同意書並不適用所有期貨交易所之商品，其適用之商品由主管機關規定及臺灣期貨交易所(以下簡稱期交所)公告之。	本風險預告書係依據期貨交易法第六十五條第二項規定訂定之。本風險預告同意書並不適用所有期貨交易所之商品，其適用之商品由主管機關規定及期交所公告之。	依據期貨業商業同業公會「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」範本修訂，酌修部份文字。
一、為保護期貨交易人權益與健全期貨商業發展，依據期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則之規定，訂定本風險預告同意書。遇有法令或依相關函令規定修訂或終止時，本公司得不經通知逕行適用新規定而修訂或終止本風險預告暨同意書之一部分或全部。	一、為保護期貨交易人權益與健全期貨商業發展，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」及期交所業務規則相關規定訂定本風險預告同意書。遇有法令或依相關函令規定修訂或終止時，本公司得不經通知逕行適用新規定而修訂或終止本風險預告暨同意書之一部分或全部。	依據期貨業商業同業公會「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」範本修訂，酌修部份文字。
二、台端了解期交所公告之期貨契約當日沖銷交易保證金計收標準適用於一般交易時段，盤後交易時段不適用，並了解在進行當日沖銷交易委託時，所繳交之保證金不得低於期交所公告之當日沖銷交易原始保證金數額。若因行情變動致使台端盤中之風險指標低於本公司與台端約定之比率(約定之比率不得	二、台端了解在進行當日沖銷期貨交易委託時，所繳交之保證金不得低於期交所公告之當日沖銷原始保證金。若因行情變動致使台端盤中之風險指標低於本公司與台端約定之比率 25% (保證金追繳方式、時間等，如有異動將於本公司網站公告。) 時，本公司將依整戶風險控管原則開始執行代為沖銷	依據期貨業商業同業公會「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」範本修訂，酌修部份文字。 配合臺灣期貨交易所推出期貨市場盤後交易，增訂有關期交所公告之期貨契約當

修正條文	現行條文	說明
<p><u>低於 25%</u>)時,本公司將依整戶風險控管原則開始執行代為沖銷作業程序,因此而產生權益數為負數, 台端須依法補足超額損失(over loss)金額。</p>	<p>作業程序, 因此而產生權益數為負數, 台端須依法補足超額損失(over loss)金額。</p>	<p>沖保證金計收標準適用於一般交易時段, 盤後交易時段不適用。</p>
<p>三、台端所有當日沖銷交易未沖銷部位, 本公司於<u>一般交易時段</u>收盤前 15 分鐘後, 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, 再以市價單或合理之限價單(<u>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</u>) 或一定範圍市價單等方式執行代為沖銷, 權益數如為負數, 台端需依法補足超額損失(over loss)之金額。為避免 台端與本公司重複對當日沖銷交易未沖銷部位執行沖銷<u>損及 台端權益</u>, 台端於本公司規定之時點後, 請勿再對當日沖銷<u>交易</u>未沖銷部位進行沖銷。</p>	<p>三、台端<u>應明瞭並同意授權當天</u>所有當日沖銷交易未沖銷部位, 本公司將於收盤前 15 分鐘後, 開始將尚未成交之當沖交易新增部位委託單取消, 及將當沖交易平倉委託單取消或使用委託單改價功能, 再以市價單、合理之限價單或一定範圍市價單等方式執行代為沖銷, <u>但無法做合理成交價位之保證, 而 台端</u>權益數如為負數, 台端須依法補足超額損失(over loss)之金額。</p>	<p>依據期貨業商業同業公會「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」範本修訂。 配合臺灣期貨交易所推出期貨市場盤後交易, 修正有關盤中風控、收盤前代為沖銷及盤後風控相關作業明訂「一般交易時段」文字並酌修部份文字。</p>
<p>條文併入第三點。</p>	<p>四、為避免 台端與本公司重複對當日沖銷交易未沖銷部位執行沖銷<u>動作</u>, 台端於本公司規定之時點後, 請勿再對當日沖銷未沖銷部位進行沖銷<u>動作, 以避免造成重複委</u></p>	<p>依據期貨業商業同業公會「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」範本修訂酌修部份文字。 條文併入第三</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>四、 台端了解在進行當日沖銷交易時，已依市價單、合理之限價單或一定範圍市價單執行沖銷卻因市場發生流動性不足或不可抗力因素而未成交者，除有下列情形者，本公司將於次一<u>一般交易時段</u>開盤後，對當日沖銷交易部位執行沖銷直至部位全數了結。 權益數如為負數， 台端須依法補足超額損失(over loss)之金額。</p> <p>(一)當日<u>一般交易時段</u>收盤後，帳戶權益數不低於以期交所公告之一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需原始保證金者。</p> <p>(二)當日<u>一般交易時段</u>收盤後，帳戶權益數雖低於以期交所公告之一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需<u>原始</u>保證金，惟計算當日沖銷交易未沖銷部位之權益數(<u>即以期交所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</u>)，不低於一般交易所需原始保證金，或於當日下午3時30分前補足至一般交易所需之原始保證金<u>數額</u>者。</p>	<p><u>託而損及 台端的權益</u>。</p> <p><u>四</u>、 台端了解在進行當日沖銷交易時，<u>本公司</u>已依市價單、合理之限價單或一定範圍市價單執行<u>代為</u>沖銷，<u>若</u>因市場發生流動性不足或不可抗力因素而未成交者，除有下列情形者，本公司<u>亦</u>將於次一<u>營業日</u>開盤後，對<u>前一日</u>當日沖銷交易部位執行<u>代為</u>沖銷<u>作業</u>直至部位全數了結<u>為止</u>。 <u>台端</u>權益數如為負數， 台端須依法補足超額損失(over loss)之金額。</p> <p><u>1</u>、當日收盤後， <u>台端</u>帳戶權益數不低於以期交所公告之一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需原始保證金者。</p> <p><u>2</u>、當日收盤後， <u>台端</u>帳戶權益數雖低於以期交所公告之一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需保證金，惟計算當日沖銷交易未沖銷部位之權益數，不低於一般交易所需原始保證金，或於當日下午<u>3點30分</u>前補足至一般交易所需之原始保證金者。</p>	<p>點。</p> <p>條號調整。</p> <p>依據期貨業商業同業公會「期貨商國內當日沖銷交易風險預告同意書」範本修訂。</p> <p>配合臺灣期貨交易所推出期貨市場盤後交易，修正有關盤中風控、收盤前代為沖銷及盤後風控相關作業明訂「一般交易時段」文字並酌修部份文字。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p><u>七</u>、上述當日沖銷交易之各項作業流程、風控作業、相關法令規範、其他相關事項等若有所變動時，將統一於本公司網站中作變動更新說明，不再另行通知或重新簽訂契約。</p>	<p>八、上述當日沖銷交易之各項作業流程、風控作業、相關法令規範、其他相關事項等若有所變動時，將統一於本公司網站中作變動更新說明，不再另行通知或重新簽訂契約。</p>	<p>條號調整。</p>
<p><u>八</u>、台端負有主動查詢、隨時控管保證金風險指標高於本公司與台端約定之比率 25% 以上之義務。</p>	<p>九、台端負有主動查詢、隨時控管保證金風險指標高於本公司與台端約定之比率 25% 以上之義務。</p>	<p>條號調整。</p>
<p><u>九</u>、本份風險預告書之預告事項甚為簡要，對所有期貨風險及影響市場行情之因素無法一一詳述，台端於交易前除須對本風險預告書詳加研析外，亦必須了解主管機關制頒「期貨商接受期貨交易人委託辦理當日沖銷交易應行注意事項」之內容及適用商品。並對其他可能影響之因素亦須慎思明辨，並確實做好財務規劃及風險評估，以免因交易而遭到無法承受之損失。台端並同意在本公司所為之當日沖銷交易依本公司當日沖銷保證金之相關規定進行，本公司保有修改規定之一切權利。</p>	<p>本份風險預告書之預告事項甚為簡要，對所有期貨風險及影響市場行情之因素無法一一詳述，台端於交易前除須對本風險預告書詳加研析外，亦必須了解主管機關制頒「期貨商接受期貨交易人委託辦理當日沖銷交易應行注意事項」之內容及適用商品。並對其他可能影響之因素亦須慎思明辨，並確實做好財務規劃及風險評估，以免因交易而遭到無法承受之損失。台端並同意在本公司所為之當日沖銷交易<u>須依照</u>本公司當日沖銷保證金之相關規定進行，本公司保有修改規定之一切權利。</p>	<p>條號調整。</p>