

元大期貨股份有限公司  
買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 1 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO

期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX

交易日 月/日/年	買入	賣出	商品明細	成交價格	金額	
					支出	存款

※存提款及調整明細

11/21/18 存款 806 買進 1 口 12 月 JZF 成交在 29 a 30,000.00TWD ← 入金

※本日成交明細

11/21/18	1	201812 TIMEX 嘉聯益期 JZF (網路)	29.0000			
**	1	平均價 29.0000	手續費 <span style="color: yellow;">c</span>	30.00TWD	← 手續費*成交口數 30*1=30	
**			交易稅 <span style="color: yellow;">d</span>	1.00TWD		
11/21/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9670.0000			
11/21/18	2	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9670.0000			
11/21/18	2	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9670.0000			
11/21/18	2	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9670.0000			
**	9	平均價 9738.0000	手續費 <span style="color: yellow;">c</span>	270.00TWD		
**			交易稅 <span style="color: yellow;">d</span>	90.00TWD		
11/21/18	2	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9658.0000			
11/21/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9650.0000			
11/21/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨 (網路)	9755.0000			
**	4	平均價 9680.2500	手續費 <span style="color: yellow;">c</span>	120.00TWD		
**			交易稅 <span style="color: yellow;">d</span>	40.00TWD		
11/21/18	1	201812 TIMEX 為升期貨 ODF (網路)	219.5000			
**	1	平均價 219.5000	手續費 <span style="color: yellow;">c</span>	30.00TWD		
**			交易稅 <span style="color: yellow;">d</span>	9.00TWD		
11/21/18	2	201811 TIMEX 台指選擇權 9,700.0 0CALL (網路)	9.6000			
**	2	平均價 9.6000	手續費 <span style="color: yellow;">c</span>	50.00TWD		
**			交易稅 <span style="color: yellow;">d</span>	0.00TWD		
11/21/18	2	201811 TIMEX 台指選擇權 9,700.00CALL (網路)	39.0000			
**	2	平均價 39.0000	手續費 <span style="color: yellow;">c</span>	50.00TWD		
**			交易稅 <span style="color: yellow;">d</span>	4.00TWD		
<div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: flex-start;"> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: 40%;"> <p>期貨每口: 成交價位*合約規格*交易稅 =29*2000*0.00002= 1 ※稅需先四捨五入後再乘口數</p> </div> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: 40%;"> <p>期貨每口: 成交價位*合約規格*交易稅 =9670*50*0.00002= 10 10+10*2+10*2+10*2+10*2=90 ※稅需先四捨五入後再乘口數</p> </div> </div>						
<div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: flex-start;"> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: 40%;"> <p>權利金支出: 成交價*合約規格*口數 =9.6*50*2=960</p> </div> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: 40%;"> <p>權利金收入: 成交價*合約規格*口數 =39*50*2=3,900</p> </div> </div>						
<div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: flex-start;"> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: 40%;"> <p>選擇權每口: 成交價*合約規格*交易稅 39*50*0.001=1.95= 2 2*2(口)=4 ※稅需先四捨五入後再乘口數</p> </div> </div>						
					<span style="color: yellow;">e</span>	3,900.00 TWD
※本日沖銷明細						
11/21/18	1	201812 嘉聯益期 JZF	29.0000			
			成本價值:58000.00			
11/20/18	1	201812 嘉聯益期 JZF	29.7500			<span style="color: yellow;">b</span> 1,500TWD
			成本價值:59500.00			
11/21/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨	9738.0000			
11/16/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨	9774.0000			<span style="color: yellow;">b</span> 1,800.00TWD
11/21/18	2	201811 TIMEX 小台指期貨	9747.0000			
11/21/18	2	201811 TIMEX 小台指期貨	9658.0000		<span style="color: yellow;">b</span>	8,900.00TWD
11/21/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨	9670.0000			
11/16/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨	9784.0000			<span style="color: yellow;">b</span> 5,700.00TWD
11/21/18	1	201811 TIMEX 小台指期貨	9750.0000			

元大期貨股份有限公司  
買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 2 of 9

期貨交易者姓名: 王 OO

期貨交易者帳號: OXX - 123XXXX

交易日 月/日/年	買入	賣出	商品明細	成交價格	金額	
					支出	存款

※本日沖銷明細

11/21/18		1	201811 TIMEX 小台指期貨	9755.0000		250.00TWD
11/16/18		1	201811 TIMEX 小台指期貨	9750.0000		
11/21/18		1	201811 TIMEX 小台指期貨	9650.0000	5,0000TWD	
11/21/18		1	201811 TIMEX 小台指期貨	9738.0000		
11/21/18		1	201811 TIMEX 小台指期貨	9739.0000		50.00TWD
		7	7			
11/21/18		1	201811 TIMEX 為升期貨 ODF 成本價值:439000.00	219.5000		
11/13/18		1	201811 TIMEX 為升期貨 ODF 成本價值:379000.00	189.5000	60,000.00TWD	
		1	1			
11/21/18		2	201811 TIMEX 台指選擇權 9,700.00CALL	9.6000		
11/20/18		2	201811 TIMEX 台指選擇權 9,700.00CALL	39.0000		
		2	2			
			選擇權平倉損益小計(TWD)		(損益僅供參考: 2,940.00TWD)	

平倉損益=(賣出成交價格\*契約乘數)-(買入成交價格\*契約乘數)  
口數=(189.5\*2000)-(219.5\*2000)\*1=60,000(損失)

(參考損益: 2,940.00TWD)

※到期/履約明細

11/21/18		2	201811 TIMEX 小台指期貨 交割結算價 9,743.0000	9,751.0000	交割損益 手續費 期交稅	800.00TWD 60.00 TWD 20.00 TWD
----------	--	---	--	------------	--------------------	-------------------------------------

交割損益=(結算價-成交價)\*契約規格\*口數  
=(9743-9751)\*50\*2=-800

※本日未沖銷明細

11/16/18		1	201812 TIMEX 穩懋期貨 NAF	98.0000		
11/16/18		1	201812 TIMEX 穩懋期貨 NAF	98.4000		
		2	平均價 98.2000 2,000.0000 股/配息調整:0 結算價 106.0000 2,000.0000 股/配息調整:0 此商品契約最後交易日為—2018/12/19			31,200.00TWD

未沖銷損益=結算價\*契約乘數\*口數-賣出成交價\*契約乘數\*口數  
=(106\*2000\*2)-(98\*2000\*1+98.4\*2000\*1)=31,200(損失)

※帳戶財務摘要

	國內換算基幣(TWD)	國內台幣(TWD)
幣別		
匯率		1.000000
前日餘額	652,524.00	652,524.00
存提	30,000.00	30,000.00
本日期貨平倉損益淨額 (含期貨到期)	-65,400.00	-65,400.00
到期履約損益 (純選擇權到期)	0.00	0.00
權利金收入與支出	2940.00	2940.00
期交稅	164.00	164.00
手續費	610.00	610.00
營業稅額	0.00	0.00
本日餘額	619,290.00	619,290.00
未沖銷期貨浮動損益	-31,200.00	-31,200.00
有價證券抵繳總額	0.00	0.00
權益數	588,090.00	588,090.00
原始保證金	57,240.00	57,240.00
維持保證金	43,884.00	43,884.00
可動用(出金)保證金	530,850.00	530,850.00
超額/追繳保證金	530,850.00	530,850.00
期貨多空組合減收保證金	0.00	0.00
未沖銷買方選擇權市值	0.00	0.00
+未沖銷賣方選擇權市值		
權益總值	588,090.00	588,090.00
權益比率	1027.41%	1027.41%

1500+1800-8900+5700+250-5000+50-60000-800=-65,400

-960+3900=2,940

1+90+40+9+4+20=164

30+270+120+30+50+50+60=610

前日餘額+(a)+(b)+(c)-(d)

本日餘額+(f)

權益數-原始保證金

元大期貨股份有限公司  
買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 3 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO

風險指標  
加收保證金

\*\*\*\*\*

\*\*\*\*\*

1027.41%  
0.00

\*\*\*\*\*

1027.41%  
0.00

\*\*\*\*\*

期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX

$$\frac{(k+i)}{(h+i+o)} = \frac{(588090+0)}{(57240+0+0)} = 1027.41\%$$

\*\*\*\*\*

※期貨市場風險控管機制調整-第二階段實施項目

因應市場風險控管機制調整，依中華民國期貨業商業同業公會期貨商開戶徵信作業管理自律規則、中華民國期貨業商業同業公會中期商字第 1070001993 號及 1070002088 號函規定，針對自然人或一般法人第二階段實施項目及實施日期說明如下，相關異動事項，攸關交易人權益，敬請交易人詳閱：

一、第二階段-107 年 8 月 1 日實施：

1. 自然人、一般法人新開立帳戶交易總額(註 1)不得超過新台幣 50 萬元：

- (1) 自 107 年 8 月 1 日起，自然人及一般法人開戶時未提供符合期貨商要求之徵信資料或財力證明者，其國內期貨交易帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之交易總額不得逾新台幣 50 萬元(以同 ID 總歸戶計算)。
- (2) 交易人如欲放寬交易總額，請洽詢您所屬之營業員並提供本公司規定之總價值超過新台幣 51 萬元(含)之財力證明文件，經本公司審核符合後，國內期貨帳戶交易總額得逾新台幣 50 萬元。
- (3) 經由線上程序完成開戶之客戶，其帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之交易總額亦不得逾新台幣 50 萬元。如欲放寬交易總額，需親自臨櫃並提供符合本公司要求之徵信資料及財力證明。

註 1：交易總額=國內交易帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金

2. 自然人、一般法人分類分級加收保證金比例限制調整：

- (1) 為降低自然人及一般法人交易人個別契約部位過於集中所生之風險，將現行股票期貨及股票選擇權以外之期貨及選擇權契約加收保證金之門檻降低由個別契約未沖銷部位超過期交所對該契約公告之交易人部位限制數之 20% 降低至 5%，股票期貨及股票選擇權則維持不變(20%)。
- (2) 取消交易人得申請對所有契約均放寬加收保證金指標之規定，僅得依個別契約逐項申請。
- (3) 申請放寬加收保證金指標須提供之財力證明額度，由按交易人種類計算之部位限制數，依該個別契約計算所需原始保證金之 30% 調高為 200% (放寬加收保證金指標×個別契約部位限制數×該契約原始保證金×200%)。

3. 自然人、一般法人從事『較不具流動性商品加收保證金』：

加收原始保證金，執行方式說明如下：

(1) 期貨商品

台股期貨、電子期貨、金融期貨、小型台指期貨、台灣 50 期貨、櫃買期貨、非金電期貨，以到期交割月份為三個最近月份(以外)的契約委託及成交都加收保證金 20%。

上述以外的期貨契約，以到期交割月份為二個最近月份(以外)的契約委託及成交都加收保證金 20%。

(2) 選擇權商品

台指選擇權履約價格超過價外 500 點-999 點，委託及成交都加收保證金 20%

台指選擇權履約價格超過價外 1000 點以上，委託及成交都加收保證金 50%

原第一階段針對台指選擇權契約 A、B 值加收原始保證金 20% 之專案將停止適用並以上述專案取代；台指選擇權以外之其他選擇權契約委託及成交仍依第一階段規定，繼續對其 A、B 值加收原始保證金 20%。

4. 當風險指標低於與本公司約定比率時，執行代為沖銷相關作業規定：

- (1) 第一張委託單不得使用市價委託。
- (2) 第一張委託單倘無法成交應行詢價，並全程禁止使用漲跌停 ROD 委託單。

二、第二階段-107 年 10 月 1 日實施：

1. 自然人、一般法人既有帳戶交易總額(註 1)不得超過新台幣 50 萬元：

(1) 自然人及一般法人於 107 年 8 月 1 日前已開立之既有帳戶(以下稱既有帳戶，含多帳戶)，自 107 年 10 月 1 日起，未提供符合期貨商要求之財力證明者，其國內期貨交易帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之交易總額不得逾新台幣 50 萬元(以同 ID 總歸戶計算)。

(2) 原既有帳戶線上開戶客戶，若未親自臨櫃並提供符合本公司要求之徵信資料及財力證明之自然人，其帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之交易總額也將從原本之 100 萬降低至 50 萬元。

註 1：交易總額=國內交易帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金

元大期貨股份有限公司  
買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 4 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO

期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX

2.非 SPAN 戶風險指標加入垂直價差交易註記功能:

交易人如有垂直價差留倉部位, 風險指標依下列公式計算, 其結果依本公司風險控之規定辦理。

$$\frac{(\text{分子})\text{權益數}+(\text{非垂直價差未沖銷買方市值}+\text{垂直價差付權利金之組合部位淨市值})-(\text{非垂直價差未沖銷賣方市值}+\text{垂直價差收權利金之組合部位淨市值})}{(\text{分母})\text{原始保證金}+(\text{非垂直價差未沖銷買方市值}+\text{垂直價差付權利金之組合部位淨市值})-(\text{非垂直價差未沖銷賣方市值}+\text{垂直價差收權利金之組合部位淨市值})}+\text{應加收之保證金}$$
(註:當風險指標計算結果分母項小於 1, 風險指標註記為 100%)

※2018/8/1 受託契約條文異動

第十七條 受託人提供交易資訊及服務範圍(修改第六項)

(修改前)

六、甲方知悉乙方已盡力提供正確可靠之資訊, 報價相關資料內容僅供參考, 任何因資料之不正確、遲延或疏漏所衍生之損害或損失, 乙方不負責任。

(修改後)

六、甲方知悉乙方已盡力提供正確可靠之資訊, 報價相關資料內容僅供參考, 任何因資料之不正確、遲延或疏漏所衍生之損害或損失, 乙方不負責任。倘若使用交易所報價資料需付費時, 甲方同意依照乙方通知或網站公告之規定辦理 (包含有異議時之權利主張)

第十八條 契約之修訂、終止或解除及效力(修改第五項, 新增六~七項)

(修改前)

五、如甲方於乙方未從事期貨交易已達一年時, 乙方有權不待通知, 逕行終止本契約並註銷帳戶。

(修改後)

五、如甲方未從事期貨交易已達三年, 交易帳戶無未沖銷部位及無保證金、權利金餘額, 乙方有權逕列靜止戶(暫停交易)控管, 不待通知。甲方帳戶已列為靜止戶者, 乙方有權以雙掛號通知甲方後, 倘甲方未於一個月內函覆同意續約, 或通知送達甲方後未函覆同意續約時, 乙方有權逕行終止本契約並註銷帳戶。另, 倘甲方連續三年無交易且交易帳戶無未沖銷部位及無保證金、權利金餘額時, 乙方亦有權得逕行終止本契約並註銷帳戶。

六、防制洗錢及打擊資恐約定

乙方基於防制洗錢及打擊資恐之目的, 甲方同意乙方得依「期貨商暨槓桿交易者防制洗錢及打擊資恐注意事項」範本、相關法令及乙方內部控管措施等規定, 進行以下措施:

- 1.乙方於任何時間一旦發現甲方為資恐防制法指定制裁之個人、法人或團體, 以及外國政府或國際洗錢防制組織認定追查之恐怖分子或團體者時, 除法令另有規定外, 乙方有權得拒絕業務往來或逕行終止雙方業務關係。
- 2.倘甲方不配合乙方定期審視、拒絕提供實質受益人或對客戶行使控制權之人等資訊、對交易之性質與目的或資金來源不願配合說明等, 乙方有權得暫時停止交易, 或暫時停止或終止雙方業務關係。

七、甲方身分資訊(料)有欠缺或應進行之期貨交易通知等重要事項有無法確認之虞, 或其他因素, 乙方基於客戶身分確認及交易帳戶風險控管等因素考量, 經乙方合法通知, 甲方未於合理期間內補正或同意配合時, 乙方有權逕行終止本契約並終止業務往來關係。

第十九條 損害賠償責任歸屬(新增第五項)

(修改前)

無第五項

(修改後)

五、乙方因受託從事國內國外期貨交易之關係, 或因其他合法原因而占有、持有甲方之財產(含未平倉部位、權益數), 或交易計算上應支付甲方之款項, 視為與甲方間, 因甲方委託乙方代為進行期貨交易所生之債務具有牽連關係而留置, 直至甲方暨其所有交易帳戶清償全部到期債務前, 不予返還; 且如有符合民法抵銷之規定者, 乙方有權逕行主張抵銷, 不待通知。

第廿三條 其他約定事項(修改第一項)

(修改前)

一、交易限額: 乙方得隨時限制甲方可維持或經由乙方所取得之部位數額; 甲方同意不超過乙方或相關交易所設定之部位限額

# 元大期貨股份有限公司 買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 5 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO

期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX

。如需要向有關機關申報時, 甲方均同意全力配合。

(修改後)

一、交易限額: 乙方得隨時限制甲方可維持或經由乙方所取得之部位數額; 甲方同意不超過乙方或相關交易所設定之部位限額。如需要向有關機關申報時, 甲方均同意全力配合。且甲方瞭解乙方基於符合期貨商開戶徵信作業管理自律規則及風險控管之考量, 要求甲方提供相關財力證明文件, 甲方未提供符合乙方財力證明文件時, 甲方同意乙方得限制帳戶交易總額 (委託中及未沖銷部位所需保證金) 或拒絕委託交易。

重要通知:

親愛的客戶您好:

依 107 年 4 月 23 日中華民國期貨業商業同業公會中期商字第 1070001593 號函公告, 異動事項如下:

一、自 107 年 6 月 20 日起, 原自然人及一般法人將停用 SPAN(整戶風險保證金計收方式):

除主管機關依金融消費者保護法第四條第二項函令所定之專業投資機構外, 原自然人及一般法人已申請使用 SPAN (整戶風險保證金計收方式) 者, 自 107 年 6 月 20 日起停用。

二、自 107 年 6 月 20 日起, 全面終止保證金最佳化:

依規定本公司將於 107 年 6 月 19 日一般交易時段結束後, 終止使用保證金最佳化程式, 程式將於當日結帳前依程式組合之最佳化傳送組合部位至期貨交易所端, 交易人部位將依最佳化之組合方式留倉, 惟自次一營業日(107 年 6 月 20 日起)程式不再啟動, 請交易人自行注意留倉部位, 並於下單時依交易策略以單式或複式單進行委託, 成交後亦可自行於電子交易平台申請部位組合或拆解, 為維護您的權益, 敬請交易人注意帳戶之風險狀況, 倘有保證金追繳及代沖銷情形, 本公司將依受託契約之規定辦理。

三、壓力測試結果: 本公司每日執行壓力測試, 即日起並就符合壓力測試警示結果對客戶進行通知, 客戶亦可主動透過業務員向本公司要求提供壓力測試報表以供參考。敬請客戶在接獲通知後, 針對自身交易部位與資金狀況等儘早備妥相關因應措施

※依主管機關之相關規範, 本公司自 107 年 4 月 30 日起實施, 所有自然人及一般法人從事國內期貨交易所之所有選擇權商品賣方之保證金將依期交所公告之 A、B 值加收 20%。

※自 107 年 4 月 30 日當日起之交易時段(含盤後交易時段)將依調高後之保證金, 進行即時風險控管與收盤後結算作業, 為維護您的權益, 敬請交易人注意帳戶之風險狀況。

※107/7/2 期交所新制度調整與新商品上線事宜:

一、國內股價指數期貨到期交割月份調整

(1) 適用商品: 大台、小台、電子、金融、櫃買、非金電及台灣 50 指數期貨。

(2) 規則: 將到期交割月份契約調整為 3 個近月份契約加上 3 個季月契約, 共 6 個到期交割月份契約。

二、黃金類契約納入盤後交易適用商品

(1) 除原交易時段(8:45~16:15)外, 另新增盤後交易時段: 17:25~次日 05:00。

(2) 列為「非豁免代為沖銷商品」, 交易人需簽署「期貨交易人參與臺灣期貨交易所盤後交易時段交易重點提要檢核表」。

若交易人未簽署檢核表, 自 107/7/2 起, 本公司不接受該交易人之新倉委託, 倘該交易人已持有黃金類契約未沖銷部位, 則只能在日盤進行平倉委託或持有該未沖銷部位至到期結算止。在黃金類契約納入盤後交易前已簽署檢核表者, 即無需再行簽署。

(3) 黃金期貨及臺幣黃金期貨之漲跌幅限制採前一日盤交易時段每日結算價±5%、±10%、±15%三階段漲跌幅度限制。

(4) 黃金選擇權之權利金最大漲跌點數採前一日盤交易時段最近月臺幣黃金期貨之每日結算價±5%、±10%、±15%三階段漲跌幅度限制。

三、新增「布蘭特原油期貨」商品

(1) 列為「非豁免代為沖銷商品」, 交易人需簽署「期貨交易人參與臺灣期貨交易所盤後交易時段交易重點提要檢核表」與「參與臺灣期貨交易所布蘭特原油期貨聲明書」方可交易。

(2) 最後結算價調整: 依 ICE Brent Index Restatement Policy 規定, 若洲際交易所於指數價格公布後得知所採用之資料或計

# 元大期貨股份有限公司

## 買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 6 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO 期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX  
算有誤, 致已公布之指數價格需更正, 最遲將於原始公布日後 3 個營業日重新更正指數價格。遇該交易所更正指數價格資訊時, 台灣期貨交易所將配合調整最後結算價計算基礎, 本公司將依規定進行調整, 交易人應依據調整後之最後結算價辦理到期結算, 履行結算交割義務, 絕不表任何異議。

※本公司將於 107 年 3 月 30 日收盤後終止語音下單服務, 爾後請 貴客戶改以電子平台交易(如行動點金靈、元大行動精靈、宜立贏、點金靈及財富 888 等)或電話委託交易, 本次服務調整造成不便之處, 敬請見諒。

※107 年 1 月 22 日臺灣期貨交易所動態價格穩定措施上線實施, 當交易人新進委託該措施適用商品會造成價格異常波動時, 臺灣期貨交易所將予以退單, 請交易人注意委託回報, 管理自身委託狀況, 以掌握委託是否有被退單情形。

(<http://www.yuantafutures.com.tw/>)

※國外盤後保證金追繳方式變更: 本公司將以電話、簡訊或具電子憑證功能之電子郵件方式, 對交易人發出盤後保證金追繳通知, 並將停止使用書面通知。

※因應大眾銀行於民國 107 年 1 月 1 日併入元大銀行, 原 台端與本公司約定出入金銀行為大眾銀行者, 其銀行分行碼與銀行帳號, 本公司將依大眾銀行通知之對照表與規則進行變更(帳號編碼原則為: 台幣帳戶由 12 碼改為 14 碼, 原存款帳號前面補「00」; 外幣帳戶由 12 碼改為 13 碼, 原存款帳號前面補「0」), 以利 台端於該行合併後之期貨存提款作業不受影響。

※配合臺灣期貨交易所 106 年 5 月 15 日推出盤後交易制度交易人應注意如下:

壹、若台端未簽署「期貨交易人參與臺灣期貨交易所盤後交易時段交易重點提要檢核表」, 在一般交易時段及盤後交易時段均無法從事臺灣期貨交易所指定非豁免代為沖銷商品交易。

貳、相關盤後交易制度之重要告知事項請參閱本公司網站公告(<http://www.yuantafutures.com.tw/>)以維護自身權益。

※106 年 5 月 15 日起, 本公司期貨交易「受託契約」部份重要修正如下, 修正條文對照及相關變更事項, 請台端參閱本公司網站公告(<http://www.yuantafutures.com.tw/>)。

※有關 102 年 7 月 1 日起實施「期貨商交易及風險控管機制專案」, 為維護台端權益, 請詳閱本公司網站相關告知事項(<http://www.yuantafutures.com.tw/>)。

※期貨交易人重要權益注意事項:

- (1) 本公司以開戶文件中留存之行動電話、電子郵件信箱、通訊地址等資料作為期貨交易高風險及盤後追繳通知、買賣報告書及對帳單寄送等重要通知方式, 台端基本資料有任何異動時, 應立即辦理變更, 若因資料有誤而無法與台端及時連絡或通知台端時, 其責任與結果概由台端自行承擔。
- (2) 市價委託係不限定價格之委託, 其成交價格與委託當時揭示之市場成交價格或買賣申報價格間可能產生偏離情形, 且偏離幅度可能超出交易人之預期, 故台端須了解市價委託之風險。
- (3) 台端需辦理出金者, 請撥至本公司出金專線: (02)2717-1760 或 0800-610-168(僅接受室內電話及行動電話)免付費專線, 將由專人為您服務。出金係台端指示交付贖餘保證金、權利金, 並不表示台端帳戶整體交易平倉或未平倉部位正處於獲利狀態。
- (4) 本公司依法委由期貨交易輔助人(IB)代為通知期貨交易人盤中高風險、盤後追繳、加收保證金及代為沖銷交易作業。惟期貨交易輔助人(IB) 如怠於辦理前開作業, 則本公司仍得逕行辦理之。
- (5) 台端申請電子式交易之密碼及電子交易憑證, 切勿將密碼或憑證交付他人, 避免自身權益受損。
- (6) 現因詐騙集團或非法不肖業者甚多, 藉以招攬期貨交易或非法代客操作為由收取報酬, 本公司聲明未與任何理財顧問、資訊等公司合作從事非法操作, 為保障客戶權益, 若對開戶、交易及帳戶權益有疑慮, 請電洽本公司客服專線 0800-333-338, 或各網路交易平台查詢權益餘額。



元大期貨股份有限公司  
買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 7 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO 期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX  
貴客戶如有符合下述期交所「期貨商寄送對帳單及註銷帳戶作業要點」之相關規定者,本公司得每年度僅寄送一次對帳單及暫免寄送對帳單予 貴客戶,另為維護 貴客戶之權益,並請符合下述規定之期貨交易人儘速向本公司辦理保證金、權利金餘額出清之事宜:

一、期貨商得於每年度最後一個營業日清查同時符合下列條件之期貨交易人,於次年度一月五日前以雙掛號寄送當年度十二月份對帳單予該期貨交易人,該次年度其餘月份期貨商得暫免寄送對帳單:

- (一) 期貨交易人所有交易帳戶最近一年度無交易且無未沖銷部位。
- (二) 期貨交易人所有交易帳戶最近一年度保證金、權利金未曾變動。
- (三) 期貨交易人所有交易帳戶保證金、權利金餘額合計數新臺幣一萬元以下。

二、期貨商應於每年度最後一個營業日清查同時符合下列條件之期貨交易人,於次年度一月五日前以雙掛號寄送當年度十二月份對帳單予該期貨交易人,嗣後期貨商得暫免寄送對帳單:

- (一) 期貨交易人所有交易帳戶最近三年度無交易且無未沖銷部位。
- (二) 期貨交易人所有交易帳戶最近三年度保證金、權利金未曾變動。
- (三) 期貨交易人所有交易帳戶保證金、權利金餘額合計數新臺幣一萬元以下。

\*\*\*\*\*  
\*\*\*\*\*

交易人請注意:自 102 年 7 月 1 日起,配合中華民國期貨業商業同業公會「期貨商交易及風險控管機制專案」新制實施,請交易人詳閱以下事項(或參閱本公司網站公告或活動快訊([http://www.yuantafutures.com.tw/ytf/news/F\\_1020701.pdf](http://www.yuantafutures.com.tw/ytf/news/F_1020701.pdf))),以維自身權益,謝謝!本公司以期貨交易人於原開戶文件中留存之「行動電話」、「電子郵件信箱」為期貨交易新制之「盤中高風險」及「盤後追繳」通知。若期貨交易人於本公司原留存之行動電話與電子郵件信箱已變更或欲修改或擬另行約定者,或其他任何基本資料欲修改者,敬請儘速洽本公司各營業據點辦理。

(1) 名詞說明:

- 1. 個配息調整說明:留倉買方則為權益數加項/留倉賣方則為權益數減項。
- 2. 本日餘額 = 前日餘額 + 存提 + 本日期貨平倉損益淨額(含期貨到期) + 到期履約損益(純選擇權到期) + 權利金收入與支出 - 期交稅 - 手續費。
- 3. 權益數 = 本日餘額 + 未沖銷期貨浮動損益。
- 4. 權益總值 = 權益數 + 未沖銷買方選擇權市值 - 未沖銷賣方選擇權市值。
- 5. 超額/追繳保證金 = 權益數 - 原始保證金

(2) 本公司盤中高風險通知及盤後保證金追繳原則:

1. 盤中高風險通知原則:

1. 盤中下列情形將進行高風險通知:

- (1) 盤中權益數低於未沖銷部位所需維持保證金;或
- (2) 盤中權益總值低於未沖銷部位所需保證金(維持保證金及加收保證金)。

2. 風險指標低於 25% 者,則將執行全數未平倉部位強制代沖銷作業。

2. 盤後追繳原則:

權益數低於維持保證金則發出追繳。T 日盤後追繳未於次一營業日規定時間內(中午 12 點)補足追繳款項且權益比率未達 100% 以上者;或權益比率未達 100% 以上且前一營業日之未沖銷部位未全數平倉者,則將強制代沖銷作業至原始保證金以上(權益比率達 100% 以上)

3. T 日盤後追繳保證金補繳期限於次一營業日中午 12:00 前補足;雖於所定期限內補繳保證金,仍會因入金時間差而產生被本公司代為沖銷之風險。如逾期未蒙全額補繳,為維護台端之權益,避免虧損擴大,本公司有權(而非義務)市價或限價逕行代沖銷台端所持未平倉之期貨交易部位,本公司之代沖銷得於前述時限後逐時或逐日處理,不受時間之限制,盈虧由交易人自負,交易人如有違約紀錄,5 年內不得在證券及期貨市場開戶或交易。

(3) 如遇行情波動大,選擇權風險相對劇烈,本公司採用含選擇權浮動損益之風險指標及權益比率二者孰低逕行通知客戶風險,請台端隨時注意行情波動及所持有期貨及選擇權部位的風險,以維護台端權益。

[註] 風險指標 = 權益總值 / 未沖銷部位所需原始保證金 + 未沖銷選擇權買方市值 - 未沖銷選擇權賣方市值 + 依「加收保證金指標」所加收之保證金。

[註] 權益比率 = 權益數 / 未沖銷部位所需原始保證金。

(4) 自 102 年 7 月 1 日起,自然人及一般法人單一商品當日收盤後未沖銷部位占期交所公告部位限制的比例超過「20%」時,超過的部分本公司將加收該商品原始保證金 20%;國內外專業投資機構單一商品當日收盤後未沖銷部位占期交所公告部位限制的比例超過「50%」時,超過的部分本公司將加收該商品原始保證金 20%。如交易人欲申請放寬加收保證金指標請事前向本公司提出申請。

(5) 自 95 年 9 月 1 日起,交易人利用轉帳入金之銀行帳號與所約定者或出金帳號不符時,資金將無法列入交易人期貨帳號權益數。

(6) 為保障期貨交易人資金安全 95 年 9 月 1 日起實施「約定入金帳號」措施,請交易人持本人存摺或銀行對帳單正本,親赴期貨商或期貨交易輔助人處辦理約定(每一種幣別至多可約定 3 個人金帳戶)不約定者將以其出金帳號作為約定

元大期貨股份有限公司  
買賣報告書

西元 2018 年 X 月 X 日

頁次: 8 of 9

期貨交易人姓名: 王 OO  
之入金帳號。

期貨交易人帳號: OXX - 123XXXX

- (7) 如需辦理出金者,請撥至本公司出金專線:(02)2717-1760 或 0800-610-168(僅接受室內電話及行動電話)之免付費專線,將由專人為您服務。
- (8) 由於期貨係採自動沖銷機制,一般交易人在期貨商端,買賣委託書可勾選新、平倉碼或兩者皆不勾選;新、平倉碼兩者皆不勾選者即視為『自動處理』。期貨商系統應比對委託單與實際留倉部位,對於勾選新倉或平倉之委託單,其委託口數與實際反向留倉部位不符者(勾選平倉而留倉部位不足,或勾選新倉而有對應之反向留倉部位者),全部退單。
- (9) 市價委託係不限定價格之委託,其成交價格與委託當時揭示之市場成交價格或買賣申報價格間可能產生偏離情形,且偏離幅度可能超出交易人之預期,故交易人須了解市價委託之風險。
- (10) 本公司依法委由期貨交易輔助人(IB)代為通知期貨交易人盤中高風險、盤後追繳、加收保證金及代為沖銷交易作業。惟期貨交易輔助人(IB)如怠於辦理前開作業,則本公司仍得逕行辦理之。
- (11) 本對帳單作業係委託中華郵政股份有限公司寄送,其寄送、格式、紀錄方式皆依主管機關所規定執行,若有特殊情形無法由中華郵政股份有限公司寄送時,本公司將依主管機關所核准之其他方式寄送。
- (12) 本公司業務員於受理交易人委託買賣時得採「電子方式填具買賣委託書」作業。
- (13) 期貨交易人申請電子式交易時,請交易人妥善保管電子式交易密碼及電子交易憑證,勿將密碼或憑證交付他人,避免自身權益受損。
- (14) 出金係期貨商依期貨交易人指示交付贖餘保證金、權利金,並不表示期貨交易人之總體交易已平倉或未平倉部位正處於獲利狀態。
- (15) 本公司後台所呈現匯率國內係依台北外匯經紀股份有限公司匯率計算,國外係依台灣銀行即期匯率收盤買賣均價匯率計算,僅供下單或風險計算之參考,交易人作各種幣別問結匯時,均依換匯時實際匯率結匯,交易人需承擔因匯率不同而產生之匯兌風險及費用。
- (16) 現因詐騙集團甚多,為保障客戶權益,若對帳戶權益有疑慮,請電洽本公司客服專線 0800-333-338,或各網路交易平台查詢權益餘額。
- (17) 期貨商客戶保證金專戶與自有資金帳戶為分離帳戶,且客戶保證金專戶係受保護與管理,其相關規範交易人得參閱本公司網站上資料。
- (18) 自民國 103 年 4 月 14 日起,交易人當日所有國內當沖未平倉部位,本公司於收盤前 15 分鐘起,將取消尚在委託當沖新單及取消平倉委託單,並以市價或限價或交易所核准之委託單沖銷所有國內當沖留倉部位。
- 台灣期貨交易所公告,自 104 年 3 月 2 日起,股票期貨及股票選擇權契約保證金之處置調整措施,如下說明:
- (一) 依處置作業要點第 6 條第 2 項發布為處置之有價證券時,以其為標的之股票期貨及股票選擇權契約之保證金,調整為當時所屬級距適用比例之 1.5 倍。
- (二) 依處置作業要點第 6 條第 3 項發布為處置之有價證券時,以其為標的之股票期貨及股票選擇權契約之保證金,調整為當時所屬級距適用比例之 2 倍。
- (三) 依處置作業要點第 6 條第 4 項採取處置措施之有價證券,除該有價證券經停止一定期間之買賣者外,以其為標的之股票期貨及股票選擇權契約之保證金,調整為當時所屬級距適用比例之 3 倍。

為提高期貨市場盤前資訊透明度及降低市價委託成交價格大幅偏離,期交所於 103 年 5 月 12 日起新增「盤前資訊揭露」及「一定範圍市價委託」新制度,主要規則說明如下: 一、「盤前資訊揭露」:開盤集合競價前 15 分鐘,各契約每 5 秒揭露 1 次模擬試撮之開盤價格、數量及模擬試撮後之最佳 5 檔買賣價格、數量。為避免交易人藉由先下單影響試撮開盤價格,開盤前 2 分鐘不接受刪除或更改委託,僅接受新增委託。 二、「一定範圍市價委託」:提供交易人另一種下單時不需指定價格,但又得將成交價格限制在一定範圍內之委託。 三、上述交易制度詳情,可至本公司網站(<http://www.yuantafutures.com.tw/>)市場資訊參閱,以維護自身權益。 臺灣期貨交易所授權歐洲期貨交易所(Eurex)於該交易所掛牌「台股期貨及臺指選擇權一天期貨契約」,於今 103 年 5 月 15 日上市。交易時間為期交所與 Eurex 均有營業之交易日臺灣時間下午 2:45 至隔日上午 4:00 (德國實施日光節約時間時,至隔日上午 3:00),提供交易人在臺灣期貨市場收盤後之交易及避險管道。每交易日到期淨未沖銷部位將交割為台股期貨及臺指選擇權,並移轉回臺灣期貨交易所,併入交易人之台股期貨及臺指選擇權部位。本國際合作商品之最後結算價為同一交易日臺灣期貨交易所台股期貨各月份契約及臺指選擇權各序列之每日結算價。交易人在歐洲期貨交易所交易時,遵循歐洲期貨交易所相關規範;部位移轉回臺灣期貨交易所後,遵循臺灣期貨交易所相關規範。欲了解更多資訊,歡迎至期交所網站 [www.taifex.com.tw](http://www.taifex.com.tw) 查詢,或洽詢您所屬之營業員。

\*\*\*\*\*  
\*\*\*\*\*