

敬啟者：

鑒於中華民國期貨業商業同業公會將於本(102)年7月1日推出「期貨商交易及風險控管機制專案」(以下稱期貨交易新制)，攸關台端權益甚重，特此函知台端下列重要權益事項，敬請務必詳閱：

一、重要事項通知：

自102年7月1日起，為因應期貨交易新制，在未接獲台端指示前，本公司將以台端於原開戶文件中留存之「行動電話」、「電子郵件信箱」為以下期貨交易新制之「盤中高風險」及「盤後追繳」通知。倘若台端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，敬請台端儘速洽本公司各營業據點辦理或來電洽詢，以維自身權益。

二、(國內)盤中高風險通知：

變更項目	變更前	變更後
通知方式	當面、電話	當面、電話或簡訊、電子郵件
達通知條件	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維持保證金	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)

三、(國內)盤後追繳通知：

變更項目	變更前	變更後
通知方式	電話、書面	國內盤後追繳除以書面寄發外，另以簡訊、電子郵件或電話通知
盤後追繳之消除	1. 次一營業日收盤前10分鐘以前補足所追繳之金額，或 2. 次一營業日收盤前10分鐘至收盤之權益數維持率等於或大於未沖銷部位所需原始保證金。 3. 反向沖銷所釋放保證金等於或大於前日追繳金額	1. 交易人於次一營業日中午12點以前補足所追繳之金額，或 2. 次一營業日中午12點時，權益數等於或大於未沖銷部位所需原始保證金(即權益比率大於等於100%)，或 3. 次一營業日中午12點時，前一營業日之未沖銷部位已全數平倉者

四、國內代沖銷(強制破倉)作業：

變更項目	變更前	變更後
代沖銷原則	1. 盤中風險係數低於25%。 2. 盤後追繳未於次一營業日規定時間(收盤前10分鐘)內補足追繳款項，且下單風險比率(權益比率)未達100%以上者或盤中風險比率低於25%。  • 風險係數： 全帳戶風險比率(清算比率)或下單風險比率(或權益比率)二者孰低者 • 全帳戶風險比率(清算比率)： (權益數+未沖銷選擇權買方市值-未沖銷選擇權賣方市值)/未沖銷部位所需原始保證金 • 下單風險比率(或權益比率)： 權益數/未沖銷部位所需原始保證金	1. 盤中風險指標低於25%。 2. 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；或權益比率未達100%以上者或前一營業日之未沖銷部位未全數平倉者  • 風險指標： (權益數+未沖銷選擇權買方市值-未沖銷選擇權賣方市值)/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  • 權益比率： 權益數/未沖銷部位所需原始保證金
代沖銷執行方法	1. 盤中風險比率低於25%： 本公司或交易輔助人得以漲跌停限價、限價或停損單執行部份或全數未平倉部位強制代沖銷作業 2. 前一日盤後追繳未消除： 本公司或交易輔助人得以漲跌停限價、限價或停損單執行強制代沖銷作業至原始保證金以上	1. 盤中風險指標低於25%： 本公司得以市價、限價或其他依期貨交易所規定之委託單種類執行全數未平倉部位強制代沖銷作業 2. 前一日盤後追繳未消除： 本公司得以市價、限價或其他依期貨交易所規定之委託單種類執行強制代沖銷作業至原始保證金以上 3. 執行順序：依本公司規定辦理

五、專有名詞對照表

變更前	變更後
1. 專戶浮動餘額或權益數 2. 帳戶總市值或清算值 3. 全帳戶風險比率或足額維持率 4. 下單風險比率或維持率	1. 權益數 2. 權益總值 3. 風險指標 4. 權益比率

六、國內加收保證金作業：

變更前	變更後
需提具財力證明方可交易超過規定之部位限制	一、交易人分級(「加收保證金指標」標準) <ul style="list-style-type: none"> <li>• 國內外自然人及一般法人：20%</li> <li>• 國內外專業投資機構：50%</li> </ul> →當不同交易人的收盤後未沖銷部位口數超過「加收保證金指標」標準時，超過的部位需加收保證金。應加收之保證金不得低於期交所對該契約公告原始保證金之 20% 二、加收保證金對交易人之影響 <ul style="list-style-type: none"> <li>• 因帳戶原有之可動用餘額會被優先用於補足應加收之保證金額度，所以會減少可動用餘額，也會影響新部位的建立</li> <li>• 加收之保證金金額將於次一營業日被加入風險指標公式之分母項。當權益總值不變的情況下，盤中風險指標值可能因所加收之保證金計入分母項而加速下降，從而增加了被代為沖銷之可能性</li> <li>• 尚未補足加收之保證金前，當交易人權益數增加(含入金)，會優先用於補足加收之保證金金額，將會影響新部位的建立</li> <li>• 即使次一營業日盤中單一契約未沖銷部位已低於依「加收保證金指標」計算之部位，仍須待收盤後結算後始得釋放該契約已加收之保證金</li> </ul>

七、受託契約(含風險預告書)之修正對照表：

變更項目	變更前	變更後
第二條 委託方式及聯繫方法	一~五(略) 六、有關追加保證金之通知方式不受前二款限制，乙方[元大寶來期貨]得以口頭、書面、電子郵件或其他經主管機關核可之方式於任何時間、地點為之。若因甲方[台端]之事由致無法收受上開通知所生之一切損失，由甲方自行負責。	一~五(略) 六、有關 <u>盤中高風險</u> 、 <u>追繳保證金</u> 或 <u>加收保證金</u> 之通知方式不受前項限制，乙方[元大寶來期貨]得以口頭、 <u>電話</u> 、書面、 <u>簡訊</u> 、電子郵件或其他經主管機關核可之方式於任何時間、地點為之。若因甲方之事由致無法收受上開通知所生之一切損失，由甲方自行負責。
第八條 代為逕行沖銷之條件與相關事宜	一、有下列各款情形之一時，乙方得不通知甲方而自由選擇以市價、漲跌停限價、限價或停損單逕行沖銷甲方未平倉部位之部份或全部部位，乙方之代沖銷得逐時或逐日處理，不受時間之限制： <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 帳戶保證金比率或指標低於相關法令或乙方公告之控管原則(通常為低於原始保證金 25%)。</li> <li>2. 甲方經乙方或其期貨交易輔助人通知補繳保證金後，逾期末補足追繳款項。</li> </ol> 3. ~5. (略)	一、甲方有下列各款情形之一時，乙方得自由選擇以市價、限價或其他依國內、外期貨交易所規定之委託單種類，逕行沖銷甲方未平倉部位，乙方之代沖銷得逐時或逐日處理，不受時間之限制： <ol style="list-style-type: none"> <li>1. <u>國內盤中風險指標低於法令或乙方規定之控管原則(即風險指標低於 25%以下)</u>，乙方應將甲方未沖銷部位全部逕行沖銷。又國內盤中風險指標計算標準為(權益數+未沖銷選擇權買方市值-未沖銷選擇權賣方市值)/(未沖銷部位所需足額原始保證金+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)。</li> <li>2. 從事國內期貨交易所之商品者，甲方經乙方通知(T日)盤後追繳保證金時，甲方於次一營業日(T+1日)中午 12 時前，甲方未補足 T 日追繳保證金；或(T+1日)中午 12 時(含)，T 日之未沖銷部</li> </ol>

**重要權益通知,請務必詳閱**

變更項目	變更前	變更後
		<p><u>位未全數平倉</u>，而權益數小於原始保證金(即權益比率，權益數/足額原始保證金，低於100%以下)時，乙方應於(T+1日)中午12時起，開始逕行沖銷甲方未平倉部位至權益數大於或等於原始保證金(權益比率等於或大於100%以上)，逕行沖銷之順序依乙方規定辦理，而沖銷後所有損失(包括 over loss)均由甲方承受。</p> <p>3. 甲方違反法令或乙方規定之<u>國外盤中足額維持率控管原則</u>時，即甲方帳戶之<u>盤中風險指標或權益比率任一者低於25%以下</u>時，乙方應將甲方未沖銷部位全部逕行沖銷。又國外盤中風險指標計算標準為(權益數+未沖銷選擇權買方市值-未沖銷選擇權賣方市值)/未沖銷部位所需足額原始保證金；權益比率計算標準為(權益數/未沖銷部位所需足額原始保證金)。</p> <p>4. 從事<u>國外交易所之商品</u>者，甲方經乙方通知(T日)<u>盤後追繳保證金</u>時，甲方於次一國外交易日(T+1日)未補足T日追繳款項；或至(T+1日)<u>盤中未有成交任何足額新單</u>，而<u>收盤10分鐘前權益數小於原始保證金(即權益數/足額原始保證金低於100%以下)</u>時，乙方應於(T+1日)<u>收盤前10分鐘起</u>，開始逕行沖銷甲方未平倉部位至權益數大於或等於原始保證金，逕行沖銷之順序依乙方規定辦理，而沖銷後所有損失(包括 over loss)均由甲方承受。</p> <p>原 3.~5. 移列至 5.~7. (略)</p>
<p><b>第九條 通知追加保證金之方式及時間</b></p>	<p>一、~三、(略)</p>	<p>一、~三、(略)</p> <p>四、<u>甲方國內交易單日收盤後之未沖銷部位超過「加收保證金指標」</u>時，乙方得對甲方超過「加收保證金指標」之未沖銷口數加收保證金，應加收保證金依規定不得低於該契約公告之原始保證金之20%，所加收之保證金於次一營業日收盤後，若未沖銷口數低於「加收保證金指標」時，乙方始得釋放該保證金予甲方。</p> <p>五、<u>甲方國內交易如被乙方同時發出盤後保證金追繳及有前項加收保證金之情形</u>時，甲方於次一營業日補繳之保證金，應優先補足盤後追繳之金額，如有剩餘，再補繳加收保證金。</p> <p>六、<u>加收保證金對甲方之影響</u>：(1)可動用餘額減少；(2)加收之保證金列於次一營業日加入盤中風險指標公式之分母項，未補足者，將影響盤中風險指標，其風險由甲方自行承擔。</p>
<p><b>第十二條 違約客戶認定標準</b></p>	<p>一、甲方如無法依本受託契約書履行約定之交割事項，或乙方依約了結甲方之期貨交易契約後，其帳戶權益總值為負數，經通知後仍未於三個營業日內依通知之補繳金額全額給付者。</p> <p>二、<u>乙方如無法依甲方於開戶文件所留之通訊地址、電話等聯絡資料及時通知前款事項時，其責任概由甲方自行承擔。</u></p>	<p>甲方如無法依本受託契約書履行約定之交割事項，或乙方依約了結甲方之期貨交易契約後，其帳戶權益數為負數，經乙方通知後，甲方仍未於三個營業日內依通知之補繳金額全額給付者，<u>即屬違約</u>，乙方依規定申報違約，並得逕行終止本契約，清償前述款項，註銷帳戶。甲方除應清償前述款項外，應負擔乙方因處理違約相關事宜衍生之各項費用(含請求、保全、結算、保管所生費用)，並支付乙方相當於申報違約金總額之違約金。</p>
<p><b>第十八條 契約之修訂、終止或解除及效力</b></p>	<p>一、遇有法定或依相關函令規定修訂或終止本契約時，得不經通知逕行適用修訂後新規定或終止本契約之一部份或全部。</p>	<p>一、<u>遇有法律、函令、期交所或期貨商業同業公會等之規定</u>，所為之內容增訂、修訂或終止本契約時，<u>無待乙方通知</u>，<u>甲方同意逕行適用變更後之內容或終止本契約之一部份或全部。</u></p> <p>二、<u>雙方合意終止或甲方有開戶文件為不實之登載或有虛偽、隱匿、詐欺之情事者或交付偽造、變造之身分證件、授權書或其他相關文書者</u>，得隨時終止或解除本契約。</p>

**重要權益通知,請務必詳閱**

變更項目	變 更 前	變 更 後
	二、如非因法定原因而修訂、終止或解除本契約時，甲方應於收到該修訂、終止或解除契約之通知日起三日內向乙方以書面提出異議，如逾期未提出異議，則該修訂、終止或解除自甲方收受當日起生效力。	<u>三、除前項約定外</u> ，如非因法定原因而修訂、終止或解除本契約時，甲方應於收到該修訂、終止或解除契約之通知日起三日內向乙方以書面提出異議，如逾期未提出異議，則該修訂、終止或解除自甲方收受當日起生效力。 原三、~五、移列至四、~六、(略)
第二十二條 契約有效期間	無	<u>本契約自甲方完成簽署，經乙方審核接受開戶之日起生效，有效期間一年，到期未經乙方書面通知終止者，即自動展期一年，爾後亦同。</u>
電子下單使用同意暨風險預告書	一、~三、(略) 無	一、~三、(略) <u>四、甲方充分了解，倘系統發生問題，乙方提供之交易輔助系統非為下單或報價參考之唯一管道，並應熟悉使用其他管道進行下單或取得報價參考。甲方知悉因交易輔助系統在傳輸資料時存在不可靠及不安全之因素，若乙方提供之交易輔助系統在任何時候無法使用或有所延遲，甲方同意主動使用乙方所提供之其他替代管道，例如以電話或親臨營業處所方式確認之。</u> 原四、~十二、移列至五、~十三、(略)

上述重要權益通知事宜，包括「一.重要事項通知」、「二.至六.期貨交易新制權益通知」及「七.受託契約(含風險預告書)等之修正對照表」，尚有疑義時，請逕洽各服務據點，將有專人為 台端作詳盡解說。又 台端對於「重要事項通知」及「受託契約(含風險預告書)之修正對照表」內容，於收到本通知書之日起三日內得以書面向本公司提出異議，逾期未提出者，變更後之內容自 台端收受當日起即生效力。

最後，再次感謝 台端的愛護與支持，元大寶來期貨將秉持一貫的服務熱忱與客戶權益至上的原則，提供 台端全方位的金融商品與誠摯貼心的專業服務，期盼 台端繼續支持、惠顧與指教。

敬祝

吉祥如意

元大寶來期貨股份有限公司 敬啟

中華民國 102 年 6 月

元大寶來期貨股份有限公司	地址：104 台北市南京東路三段 225 號 11、12 樓	電話：(02)27176000	客服專線：0800-333338
元大寶來期貨高雄分公司	地址：800 高雄市前金區中正四路 143 號 7 樓之 1	電話：(07)2157777	傳真：(07)2729345
元大寶來期貨台中分公司	地址：407 台中市府會園道 179 號 8 樓	電話：(04)22598383	傳真：(04)37002789
元大寶來期貨台南分公司	地址：704 台南市北區開元路 147 號 4 樓	電話：(06)2355999	傳真：(06)2356161
元大寶來期貨新竹分公司	地址：300 新竹市光復路一段 373 號 B1 之 1	電話：(03)6662558	傳真：(03)6667668