

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡電話：(02)2369-5678

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國106年4月13日
發文字號：台期結字第10603002751號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：因應本公司建置盤後交易平台，有關本公司指定盤後交易時段豁免辦理代為沖銷商品，及期貨商應辦理風險告知事宜，請依說明事項辦理，請 查照。

說明：

- 一、依本公司106年4月13日台期結字第10603002750號函辦理。
- 二、依「臺灣證券交易所股價指數期貨契約」、「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約」交易規則第15條，「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」、「美元兌人民幣匯率選擇權契約」、「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」交易規則第13條，「美元兌人民幣匯率期貨契約」、「小型美元兌人民幣匯率期貨契約」交易規則第14條，此7項商品為本公司指定盤後交易時段豁免代為沖銷商品。
- 三、依「美元兌日圓匯率期貨契約」、「歐元兌美元匯率期貨契約」交易規則第14條，「美國道瓊工業平均股價指數期貨契約」、「美國S&P500股價指數期貨契約」交易規則第15條，此4項商品為本公司指定盤後交易時段非豁免代為沖銷商品。
- 四、期貨商於盤後交易時段開始，對持有本公司盤後交易商品交易人之保證金及未沖銷部位之風險控管，應依本公司106年4月13日台期結字第10603002750號函辦理。
- 五、配合盤後交易之施行，提供盤後交易時段交易委託之期貨商，

應辦理下列事項：

- (一) 期貨商應告知交易人盤後交易時段適用商品及交易時間、豁免代為沖銷商品、非豁免代為沖銷商品、未沖銷期貨浮動損益計算方式、委託所需保證金計算方式、高風險帳戶通知原則、盤後保證金追繳作業、風險指標計算方式，及代為沖銷原則等相關風險控管作業。
- (二) 為提醒交易人確實注意盤後交易時段非豁免代為沖銷商品之風險控管原則，期貨商應提供「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」（以下簡稱檢核表），交由交易人詳讀並簽署。未簽署檢核表之交易人，於一般交易時段及盤後交易時段均不可交易非豁免代為沖銷商品。檢核表範本如附件，期貨商應依範本內容制訂檢核表，並得依內部風險控管原則需要增加相關內容。
- (三) 「美元兌日圓匯率期貨契約」及「歐元兌美元匯率期貨契約」兩項期貨契約，倘交易人未簽署檢核表，自盤後交易制度實施日起，不得接受其委託交易，至盤後交易制度實施日前已建立之未平倉部位，該交易人僅得於一般交易時段進行平倉委託或持有該未平倉部位至到期結算止。期貨商並應告知該交易人，持有未平倉部位期間，就該兩項期貨契約於盤後交易時段不會執行高風險帳戶通知、不執行代為沖銷作業及無法因應價格波動進行平倉之相關風險。期貨商並應留存相關通知紀錄，並至少保存一年，但有爭議者，應保存至該爭議消除為止。

六、為避免引起期貨交易糾紛，未提供盤後交易時段交易委託之期貨商，應告知交易人不提供盤後交易時段交易委託，交易人於各商品之盤後交易時段無法新增或平倉部位。

七、期貨商告知方式包括於營業處所張貼公告，另有設置網站者，應於網站公告，並在買賣報告書與月對帳單中告知交易人，俾利交易人知悉，以避免產生交易糾紛及維護交易人下單權益。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、臺灣集中保管結算所股份有限公司、中華民國期貨商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、財團法人證券投資人及期貨交易人保護中心、台北國際金融資訊協會、博仲法律事務所、植根國際資訊股份有限公司、本公司網站、各業務部門。

總經理 邱文昌

裝



訂

線

○○期貨股份有限公司

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(範本)

※交易人請注意：

若您未簽署本檢核表，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。

圈 選	內 容
是 否	美國道瓊期貨、美國標普 500 期貨之盤後交易時段為 15:00~次日 5:00。
是 否	歐元兌美元期貨、美元兌日圓期貨等商品之盤後交易時段為 17:25~次日 5:00。
會 不會	台股期貨、臺指選擇權契約、美元兌人民幣期貨及選擇權契約等商品於盤後交易時段會不會被代沖銷。
會 不會	歐元兌美元期貨、美元兌日圓期貨、美國道瓊期貨、美國標普 500 期貨等商品於一般交易時段及盤後交易時段，達代沖銷標準時會不會被代沖銷。
是 否	帳戶中所有留倉部位商品一般交易時段收盤後權益數低於維持保證金，雖交易人在期貨商結算前於盤後交易時段平倉，使權益數高於維持保證金，交易人仍會在期貨商結算後收到盤後保證金追繳通知。
會 不會	盤後交易時段帳戶僅留有不會被代沖銷商品(如：台股期貨)部位，當該帳戶權益數低於維持保證金時，期貨商會不會發出高風險帳戶通知。
會 不會	盤後交易時段帳戶留有會被代沖銷商品(如：美國道瓊期貨)部位，當該帳戶權益數低於維持保證金時，會不會收到高風險帳戶通知。
是 否	15:00 以後交易時段，帳戶中除了留有會被代沖銷商品部位外，同時含有已進入盤後且不會被代沖銷之商品(如：盤後時段之台股期貨)，這時候代沖銷標準指的是風險指標低於約定比率且權益數低於維持保證金。
是 否	盤後交易時段帳戶中留有會被代沖銷的商品部位(如：美國道瓊期貨)，達代沖銷標準時，期貨商會將所有盤後時段會被代沖銷的商品全數沖銷(如：美國道瓊期貨)。
會 不會	盤後不會被代沖銷商品的留倉部位(如：台股期貨)，其盤後交易時段之未實現獲利或未實現損失，會不會改變風險指標值。
是 否	盤後只留有不會被代沖銷商品部位(如：台股期貨)，新增部位時會使留倉部位所需原始保證金增加，導致風險指標值下降。
會 不會	盤後交易時段期貨商計算風險指標，遇不會被代沖銷商品(如：台股期貨)之未平倉部位，不計算未沖銷期貨浮動損益，該部位於盤後交易時段之獲利或損失，會不會因此改變風險指標值。
是 否	一般交易時段留有會代為沖銷商品 (如：歐元兌美元期貨)，雖盤後交易時段未交易，但價格變化致交易人風險指標達代為沖銷作業標準，期貨商仍將執行代為沖銷作業，交易人於各交易時段均須隨時注意權益數變化。

交易帳號：_____ 日期：_____

姓名(公司名稱)：_____ (簽章) 電話：_____

代表人：_____ (簽章)