

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>第二條本辦法適用本公司及期貨交易輔助人（以下簡稱期 IB）各業務分支點因處理交易人風險控管所需之各項交易保證金追繳、交易人風險部位逕行代為沖銷等風險控管事宜。期 IB 依臺灣期貨交易所之規定得代理期貨商辦理保證金追繳及代為沖銷作業，若委由期 IB 負責期貨及選擇權部位逕行代為沖銷作業之規定時，應悉以本風險控管辦法之規定為準據，各期 IB 所屬風險管理人員及業務員應遵循本作業辦法辦理交易保證金追繳及風險控管、逕行代為沖銷作業。<u>本公司得逕行代為沖銷之風險管理人員係指依中華民國期貨業商業同業公會規範可執行代為沖銷之人員，由受託買賣業務員以外之合格業務員執行代為沖銷作業程序，並得由受託買賣業務員依風控人員或風險控管系統之通知協助辦理。</u></p>	<p>第二條本辦法適用本公司及期貨交易輔助人（以下簡稱期 IB）各業務分支點因處理交易人風險控管所需之各項交易保證金追繳、交易人風險部位逕行代為沖銷等風險控管事宜。期 IB 依臺灣期貨交易所之規定得代理期貨商辦理保證金追繳及代為沖銷作業，若委由期 IB 負責期貨及選擇權部位逕行代為沖銷作業之規定時，應悉以本風險控管辦法之規定為準據，各期 IB 所屬風險管理人員及業務員應遵循本作業辦法辦理交易保證金追繳及風險控管、逕行代為沖銷作業。</p>	<p>配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」說明本公司得執行代為沖銷人員。</p>
<p>第三條以下定義國內期貨商品係指可在臺灣期貨交易所交易之國內期貨及選擇權等各項衍生性商品；國外期貨商品係指經臺灣期貨交易所公告本國期貨商可以複委託之方式經上手期貨商在國外各期貨交易所交易之國外期貨及選擇權等各項衍生性商品。<u>本辦法所述風險專有名詞解釋及公式計算，係依臺灣期貨交易所及中華民國期貨業商業同業公會之規定辦理。</u></p>	<p>第三條以下定義國內期貨商品係指可在臺灣期貨交易所交易之國內期貨及選擇權等各項衍生性商品；國外期貨商品係指經臺灣期貨交易所公告本國期貨商可以複委託之方式經上手期貨商在國外各期貨交易所交易之國外期貨及選擇權等各項衍生性商品。</p>	<p>配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」增訂本辦法對暨有專有名詞之解釋及公式計算修訂依據。</p>
<p>第五條依據期貨商管理規則第 46 條規定，本公司得依期貨交易人之信用狀況或考量其交易風險等情況加收交易人保證金，本公司得視交易風險及交易人信用情況公告調整</p>	<p>第五條依據期貨商管理規則第 46 條規定，本公司得依期貨交易人之信用狀況或考量其交易風險等情況加收交易人保證金，本公司得視交易風險及交易人信用情況公告調整</p>	<p>配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」修訂「盤中高風險帳戶」為「高</p>

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
各項期貨商品之保證金，並依調整後保證金之相關規定對交易人發出高風險帳戶通知或盤後保證金追繳通知。	各項期貨商品之保證金，並依調整後保證金之相關規定對交易人發出 <u>盤中</u> 高風險帳戶通知或盤後保證金追繳通知。	風險帳戶」。
第六條依據期貨商管理規則第 49 條規定，交易人之權益數若低於本公司所規定之維持保證金，本公司需即時通知交易人辦理催繳。遇前述狀況，除交易人自負受託契約第八條規定之相關義務外，交易人所屬之業務員須主動於 <u>交易時間</u> 以當面、電話、簡訊、電子郵件或其他期貨交易人指定方式即時通知交易人為 <u>高風險帳戶</u> ，請交易人隨時注意 <u>權益數</u> 之變化；若於 <u>一般交易時段</u> 收盤後交易人之權益數仍低於未沖銷部位所需之維持保證金，亦應以電話、簡訊、符合電子簽章功能之電子郵件或其他交易人指定方式對交易人發出盤後保證金追繳通知。如以不具電子簽章功能之電子郵件對交易人發出盤後保證金追繳通知者，交易人所屬之業務員應同時再以電話或簡訊通知交易人。	第六條依據期貨商管理規則第 49 條規定，交易人之權益數若低於本公司所規定之維持保證金，本公司需即時通知交易人辦理催繳。遇前述狀況，除交易人自負受託契約第八條規定之相關義務外，交易人所屬之業務員須主動於 <u>盤中</u> 以當面、電話、簡訊、電子郵件或其他期貨交易人指定方式即時通知交易人為 <u>盤中高風險帳戶</u> ，請交易人隨時注意 <u>盤中權益數</u> 之變化；若 <u>所有商品</u> 收盤後交易人之權益數仍低於未沖銷部位所需之維持保證金，亦應以電話、簡訊、符合電子簽章功能之電子郵件或其他交易人指定方式對交易人發出盤後保證金追繳通知。如以不具電子簽章功能之電子郵件對交易人發出盤後保證金追繳通知者，交易人所屬之業務員應同時再以電話或簡訊通知交易人。	配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中及收盤後之說明文字，以避免交易人對盤中或收盤後之定義混淆。
第七條為控制交易人之部位風險，本公司及期 IB 業務單位之業務員 <u>交易時間</u> 及收盤後應主動監控交易人風險部位之情況，並負責主動通知交易人為高風險帳戶或盤後保證金追繳帳戶，若期貨及選擇權部位組合等各種特殊交易策略因市場風險情況變動致交易人帳戶權益數或權益總值成為負值，本公司風險控管單位有權隨時視風險狀況發出 <u>高風險帳戶</u> 通知或 <u>盤後保證金追繳</u> 通知，交易人須於規定時間內補足公司規定之足額追繳保證金，若交易	第七條為控制交易人之部位風險，本公司及期 IB 業務單位之業務員 <u>盤中</u> 及收盤後應主動監控交易人風險部位之情況，並負責主動通知交易人為盤中高風險帳戶或盤後保證金追繳帳戶，若期貨及選擇權部位組合等各種特殊交易策略因市場風險情況變動致交易人帳戶權益數或權益總值成為負值，本公司風險控管單位有權隨時視風險狀況於盤中發出 <u>高風險</u> 通知或 <u>收盤後發出追繳</u> 通知，交易人須於規定時間內補足公司規定之足額追繳保證金，若交	配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」修訂「盤中發出高風險帳戶通知」為「發出高風險帳戶通知」。配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中及收盤後之說明文字，以避免交易人對盤中或收

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
人無法及時補足，本公司及期貨交易輔助人所屬風險管理人員將依據內控辦法及受託契約第九條及第十條相關規定據以代為沖銷。	易人無法及時補足，本公司及期貨交易輔助人所屬風險管理人員將依據內控辦法及受託契約第九條及第十條相關規定據以代為沖銷。	盤後之定義混淆。
第九條依本公司與交易人簽訂之受託契約第十條規定， <u>交易時間</u> 交易人權益數或權益總值低於維持保證金時，本公司有權視交易人帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷。本公司及期 IB 業務員於上述情況發生時，須儘速向交易人發出 <u>高風險帳戶</u> 通知。	第九條依本公司與交易人簽訂之受託契約第十條規定， <u>盤中</u> 交易人權益數或權益總值低於維持保證金時，本公司有權視交易人帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷。本公司及期 IB 業務員於上述情況發生時，須儘速向交易人發出 <u>盤中高風險帳戶</u> 通知。	配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中及收盤後之說明文字，以避免交易人對盤中或收盤後之定義混淆。
第十條風險指標係指 <u>風險權益</u> + 未沖銷 <u>買方選擇權風險市值</u> - 未沖銷 <u>賣方選擇權風險市值</u> 除以 <u>未沖銷部位所需風險原始保證金</u> + 未沖銷 <u>買方選擇權風險市值</u> - 未沖銷 <u>賣方選擇權風險市值</u> + 依「加收保證金指標」所加收之保證金。 <u>交易時間交易人帳戶風險指標低於 25% 時，本公司應將交易人之全部未沖銷部位執行代為沖銷，惟帳戶之未沖銷部位留有已進入盤後交易時段之臺灣期貨交易所指定豁免代為沖銷商品，當風險指標低於 25% 時，需同時檢視權益數是否低於未沖銷部位所需維持保證金，若權益數未低於未沖銷部位所需維持保證金，無須執行代為沖銷作業，若權益數低於未沖銷部位所需維持保證金，則應將該豁免執行代為沖銷商品以外之部位全部沖銷。</u>	第十條風險指標係指 <u>權益數</u> + 未沖銷 <u>選擇權買方市值</u> - 未沖銷 <u>選擇權賣方市值</u> 除以 <u>原始保證金</u> + 未沖銷 <u>選擇權買方市值</u> - 未沖銷 <u>選擇權賣方市值</u> + 依「加收保證金指標」所加收之保證金。 <u>13:45 收盤前交易人風險指標低於 25% 時，本公司及期 IB 所屬風險管理人員依規定應將交易人之未沖銷部位全部代為沖銷；13:45 後因尚未收盤之商品行情變化、對已收盤之商品加收保證金或期交所對已收盤商品調整保證金等因素，造成交易人風險指標低於 25% 時，本公司及期 IB 所屬風險管理人員依規定應將交易人之尚未收盤商品之未沖銷部位全部代為沖銷。</u>	配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」修訂風險指標計算公式。配合盤後交易時段之增訂，刪除原 13:45 第一盤收盤後仍應執行代為沖銷事項，並增訂盤後交易時段代為沖銷標準，除原訂低於 25% 時，增加需同時檢視權益數是否低於未沖銷部位所需維持保證金。
第十一條因行情變動過劇，致交易人風險指標低於 25% 時，或本公司因市場風險情況及交易人個別部位風險及信用狀況考量，依據受託契	第十一條因 <u>盤中</u> 行情變動過劇，致交易人風險指標低於 25% 時，或本公司因市場風險情況及交易人個別部位風險及信用狀況考量，依據受	配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中之說明文字，以

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>約之規定，本公司及期 IB 所屬風險管理人員有權視帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之<u>全部未沖銷部位執行代為沖銷</u>，<u>惟於盤後交易時段，若交易人之未沖銷部位僅有臺灣期貨交易所指定豁免執行代為沖銷之商品</u>，則無須執行代為沖銷，交易人應負擔所有部位盈虧之完全責任。</p>	<p>託契約之規定，本公司及期 IB 所屬風險管理人員有權視帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之<u>部位全部</u>沖銷，交易人應負擔所有部位盈虧之完全責任。</p>	<p>避免交易人對盤中之定義混淆。配合盤後交易時段之增訂，增訂符合臺灣期貨交易所指定豁免部位無須執行代為沖銷。</p>
<p>第十二條依期貨商管理規則第 49 條規定，<u>一般交易時段收盤後</u>交易人權益數低於未沖銷部位所需之維持保證金，結算單位即發出盤後保證金追繳通知，業務員通知方式應以電話、簡訊、符合電子簽章功能之電子郵件或其他與交易人約定方式為之，本公司及期 IB 所屬風險管理人員通知業務員請交易人於追繳發生<u>次一營業日中午 12 時前</u>補繳足額之追繳保證金。交易人若未能於上述時限內補足追繳保證金，或交易人未能使次一營業日中午 12 時之權益數大於或等於未沖銷部位所需原始保證金者【約定時間內曾回復者仍不予以消除<u>盤後保證金追繳</u>。】，<u>或交易人未能於次一營業日中午 12 時前，將前一般交易時段之未沖銷部位全部沖銷</u>，本公司及期 IB 所屬風險管理人員應於國內期指<u>追繳發生之次一營業日</u>中午 12 時後，選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷。</p>	<p>第十二條依期貨商管理規則第 49 條規定，<u>收盤後</u>交易人權益數低於未沖銷部位所需之維持保證金，結算單位即發出盤後保證金追繳通知，業務員通知方式應以電話、簡訊、符合電子簽章功能之電子郵件或其他與交易人約定方式為之，本公司及期 IB 所屬風險管理人員通知業務員請交易人於追繳發生<u>次一營業日 (T+1 日) 中午 12:00 前</u>補繳足額之追繳保證金。交易人若未能於上述時限內補足追繳保證金，或交易人未能使次一營業日中午 12 時之權益數大於或等於未沖銷部位所需原始保證金者【約定時間內曾回復者仍不予以消除<u>T 日之保證金追繳</u>。】，本公司及期 IB 所屬風險管理人員應於國內期指<u>(T+1 日) 中午 12 時後</u>，選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷。</p>	<p>配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及收盤後之說明文字，以避免交易人對收盤後之定義混淆。刪除原 T+1 日之備註，避免交易人對 T+1 日及 T+1 盤之混淆。配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」增訂次一營業日約定時間前，交易人前一般交易時段之未沖銷部位已全部沖銷。」為盤後保證金追繳通知之消除條件。</p>
<p>第十三條國內選擇權及期貨商品，須待交易所現金結算價公告確認後，後台系統作業完成釋放出交易</p>	<p>第十三條國內選擇權及期貨商品，須待交易所現金結算價公告確認後，後台系統作業完成釋放出交易</p>	

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>人保證金後方得視為可用保證金。交易人因單一商品部位所加收之保證金，不論<u>盤後交易時段或次一一般交易時段盤中</u>單一商品部位是否已減倉或全部平倉，均須待<u>次一一般交易時段收盤後</u>始得釋放該商品已加收之保證金。</p>	<p>人保證金後方得視為可用保證金。交易人因單一商品部位所加收之保證金，不論<u>盤中</u>單一商品部位是否已減倉或全部平倉，均須待<u>收盤後</u>始得釋放該商品已加收之保證金。</p>	<p>配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」修訂加收保證金檢核及釋放時機。</p>
<p>第十四條交易人進行期貨及選擇權策略組合交易、申請選擇權部位拆解、組合或<u>交易時間</u>針對組合部位做單隻腳之平倉或其他風險因素等情況，致造成帳戶權益數或權益總值成為負值或風險指標低於 25% 時，交易人需於事實發生當時三十分鐘或約定時限內以入金或平倉之方式自行處理部位，使交易人之風險指標回復至 25% 以上，交易人未於規定時間點內處理者，本公司及各期 IB 所屬風險管理人員有權隨時視帳戶風險管理之需要，於<u>一般交易時段收盤前</u>選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷。</p>	<p>第十四條交易人進行期貨及選擇權策略組合交易、申請選擇權部位拆解、組合或<u>盤中</u>針對組合部位做單隻腳之平倉或其他風險因素等情況，致造成帳戶權益數或權益總值成為負值或風險指標低於 25% 時，交易人需於事實發生當時三十分鐘或約定時限內以入金或平倉之方式自行處理部位，使交易人之風險指標回復至 25% 以上，交易人未於規定時間點內處理者，本公司及各期 IB 所屬風險管理人員有權隨時視帳戶風險管理之需要，於<u>當日盤中或最晚至當日收盤前</u>選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷。</p>	<p>配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中及收盤之說明文字，以避免交易人對盤中或收盤之定義混淆。</p>
<p>第十五條以前述第七條交易狀況造成<u>交易時間</u>交易人之部位權益數或權益總值成為負值，本公司及各期 IB 所屬風險管理人員有權視市場風險情況立即針對交易人留倉部位予以代為沖銷。欲申請緊急入金暫緩代為沖銷交易人部位者，需經本公司業務主管或期 IB 經理人、權責主管以書面報請總經理簽准，因時效處理問題未及於書面簽准之特殊風險處理情況需事先口頭報請總經理同意，並同時知會各風險控管單位，事後並應補齊相關書面報准程序。緊急入金時限以半小時為限，風險</p>	<p>第十五條以前述第七條交易狀況造成<u>盤中</u>交易人之部位權益數或權益總值成為負值，本公司及各期 IB 所屬風險管理人員有權視市場風險情況立即針對交易人留倉部位予以代為沖銷。欲申請緊急入金暫緩代為沖銷交易人部位者，需經本公司業務主管或期 IB 經理人、權責主管以書面報請總經理簽准，因時效處理問題未及於書面簽准之特殊風險處理情況需事先口頭報請總經理同意，並同時知會各風險控管單位，事後並應補齊相關書面報准程序。緊急入金時限以半小時為限，風險</p>	<p>配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中之說明文字，以避免交易人對盤中之定義混淆。</p>

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>控管單位有權於時限到達點立即平倉，本公司業務員或期 IB 之經理人、權責主管及交易人所屬業務員需針對該筆申請因故造成之特殊違約及錯帳狀況負擔完全連帶清償責任。</p>	<p>控管單位有權於時限到達點立即平倉，本公司業務員或期 IB 之經理人、權責主管及交易人所屬業務員需針對該筆申請因故造成之特殊違約及錯帳狀況負擔完全連帶清償責任。</p>	
<p>第十八條交易人欲進行國內期指之當日沖銷(以下簡稱當沖)委託，下單前應先存入本公司所規定之足額當沖保證金，方得進行當沖交易，惟當沖保證金計收適用於一般交易時段，盤後交易時段不適用。本公司於當沖交易之委託成交後，就當沖交易部位及一般交易部位分別依臺灣期貨交易所公告之當沖交易及一般交易保證金計收標準計算，對交易人進行整戶風險控管，當交易人帳戶權益數低於未沖銷部位所需維持保證金時，應對該交易人發出高風險帳戶通知。</p>	<p>第十八條交易人欲進行國內期指之當日沖銷委託，下單前應先存入本公司所規定之足額當日沖銷保證金，方得進行當日沖銷交易。本公司於當沖交易之委託成交後，就當沖交易部位及一般交易部位分別依期交所公告之當沖交易及一般交易保證金計收標準計算，對交易人進行整戶盤中風險控管，當交易人帳戶權益數低於未沖銷部位所需維持保證金時，應對該交易人發出盤中高風險帳戶通知。</p>	<p>修訂當日沖銷簡稱當沖。 盤後交易配合盤後交易及期貨公會國內當沖自律規則修訂，當沖適用於一般交易時段。 修訂期交所為臺灣期貨交易所。配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中之說明文字，以避免交易人對盤中之定義混淆。</p>
<p>第十九條依本公司與交易人簽訂之受託契約第十條規定，交易時間交易人權益數低於維持保證金時，本公司有權視交易人帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷，上述之規定亦適用於交易人進行當沖之部位。</p>	<p>第十九條依本公司與交易人簽訂之受託契約第十條規定，盤中交易人權益數低於維持保證金時，本公司有權視交易人帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷，上述之規定亦適用於交易人進行當日沖銷之部位。</p>	<p>配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中之說明文字，以避免交易人對盤中之定義混淆。 修訂當日沖銷簡稱當沖。</p>
<p>第二十條若因行情變動過大致交易人部位損失致交易人風險指標低於25%時，基於風險控管考量，本公司及期 IB 所屬風險管理人員，將有權以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷，並依據期貨受託契約之約定，交易人</p>	<p>第二十條若因盤中行情變動過大致交易人部位損失致交易人風險指標低於25%時，基於風險控管考量，本公司及期 IB 所屬風險管理人員，將有權以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部沖銷，並依據期貨受託契約之約定，</p>	<p>配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及盤中之說明文字，以避免交易人對盤中之定義混淆。</p>

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
應負所屬帳戶代為沖銷部位後盈虧之完全責任。	交易人應負所屬帳戶代為沖銷部位後盈虧之完全責任。	
第二十一條交易人未於 <u>一般交易時段</u> 收盤前 15 分鐘前自行取消 <u>當沖</u> 之未成交委託，本公司將一併自動代為取消或使用委託單改價功能。交易人進行 <u>當沖</u> 委託之留倉部位未於 <u>一般交易時段</u> 收盤前 15 分鐘自行平倉者，本公司將自動於 <u>一般交易時段</u> 收盤前 15 分鐘內取消或使用委託單改價功能，再以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人 <u>當沖</u> 部位 <u>執行</u> 代為沖銷。	第二十一條交易人未於 <u>交易當日</u> 收盤前 15 分鐘前自行取消 <u>當日沖銷</u> 之未成交委託，本公司將一併自動代為取消或使用委託單改價功能。交易人進行 <u>當日沖銷</u> 委託之留倉部位未於 <u>交易當日</u> 收盤前 15 分鐘自行平倉者，本公司將自動於收盤前 15 分鐘內取消或使用委託單改價功能，再以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人 <u>當日沖銷</u> 部位代為沖銷。	配合期貨公會國內當沖自律規則修訂交易當日為一般交易時段，餘酌作文字修訂。
第二十二條交易人若自行於 <u>一般交易時段收盤前</u> 15 分鐘內對於 <u>當沖</u> 部位自行委託平倉，致平倉部位與本公司重複者，該多餘部位之損益交易人應負完全責任。	第二十二條交易人若自行於交易當日 <u>收盤前</u> 15 分鐘內對於 <u>當日沖銷</u> 部位自行委託平倉，致平倉部位與本公司重複者，該多餘部位之損益交易人應負完全責任。	配合盤後交易時段之增訂，修訂本辦法涉及收盤之說明文字，以避免交易人對收盤之定義混淆。修訂當日沖銷簡稱當沖。
第二十三條本公司得視主管機關規定與市場風險情況調整 <u>當沖</u> 保證金收取之保證金數額，並得視本公司對於風險控管之需要隨時調整本公司接受 <u>當沖</u> 交易委託之起始與結束時限及調整原規定之代為沖銷時點。 <u>當沖</u> 委託單新倉單截止收單時間為收盤前 15 分鐘。	第二十三條本公司得視主管機關規定與市場風險情況調整 <u>當日沖銷</u> 保證金收取之保證金數額，並得視本公司對於風險控管之需要隨時調整本公司接受 <u>當日沖銷</u> 交易委託之起始與結束時限及調整原規定之代為沖銷時點。 <u>當日沖銷</u> 委託單新倉單截止收單時間為收盤前 15 分鐘。	修訂當日沖銷簡稱當沖。
第二十四條交易人下單前除依國外期貨交易所規定之 <u>當沖</u> 單得收取 <u>當沖</u> 保證金外，應先存入本公司所規定之足額保證金方得進行下單交易。	第二十四條交易人下單前除依國外期貨交易所規定之 <u>當日沖銷</u> 單得收取 <u>當日沖銷</u> 保證金外，應先存入本公司所規定之足額保證金方得進行下單交易。	修訂當日沖銷簡稱當沖。
第二十五條依本公司與交易人簽訂之受託契約第十條規定，交易人權	第二十五條依本公司與交易人簽訂之受託契約第十條規定， <u>盤中</u> 交易	修訂當日沖銷簡稱當沖。

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>益數低於維持保證金時，本公司得有權視交易人帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部或部分沖銷，並得要求交易人風險指標低於 50%時，應立即加掛風險指標 25% 時的反向平倉停損單 (StopOrder)，待交易人風險指標高於原始保證金時，始得取消前述反向平倉停損單，以上規定亦適用於進行當沖之交易人。</p>	<p>人權益數低於維持保證金時，本公司得有權視交易人帳戶風險管理之需要選擇以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位全部或部分沖銷，並得要求交易人盤中風險指標低於 50%時，應立即加掛風險指標 25%時的反向平倉停損單 (StopOrder)，待交易人盤中風險指標高於原始保證金時，始得取消前述反向平倉停損單，以上規定亦適用於進行當日沖銷之交易人。</p>	
<p>第二十六條若因行情變動過大致交易人部位損失致交易人風險指標低於 25%時，基於風險控管考量，本公司風險管理人員，將有權以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位選擇完全沖銷或部份沖銷，並依據期貨受託契約約定，交易人應負所屬帳戶代為沖銷部位後盈虧之完全責任。</p>	<p>第二十六條若因盤中行情變動過大致交易人部位損失致交易人風險指標低於 25%時，基於風險控管考量，本公司風險管理人員，將有權以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人之部位選擇完全沖銷或部份沖銷，並依據期貨受託契約約定，交易人應負所屬帳戶代為沖銷部位後盈虧之完全責任。</p>	
<p>第二十七條依國外各交易所之規定當沖單得減收下單保證金，交易人依規定須於當日收盤前將當沖部位反向平倉，若交易人未及時平倉，依據期貨受託契約約定，本公司風險管理人員，有權在當日收盤前三十分鐘內取消或使用委託單改價功能，再以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人當沖部位完全沖銷，交易人應負所屬帳戶沖銷部位後盈虧之完全責任。</p>	<p>第二十七條依國外各交易所之規定當日沖銷單得減收下單保證金，交易人依規定須於當日收盤前將當日沖銷部位反向平倉，若交易人未及時平倉，依據期貨受託契約約定，本公司風險管理人員，有權在當日收盤前三十分鐘內取消或使用委託單改價功能，再以市價、限價或交易所核准之委託單將交易人當日沖銷部位完全沖銷，交易人應負所屬帳戶沖銷部位後盈虧之完全責任。</p>	<p>修訂當日沖銷簡稱當沖。</p>
<p>第二十八條交易人進行國外期貨跨商品價差交易，本公司得依國外交易所之規定收取價差交易保證金，並得視交易風險之變動及交易人帳戶信用風險等考量隨時調整價差交易之應收保證金，並依據此規定對</p>	<p>第二十八條交易人進行國外期貨跨商品價差交易，本公司得依國外交易所之規定收取價差交易保證金，並得視交易風險之變動及交易人帳戶信用風險等考量隨時調整價差交易之應收保證金，並依據此規定對</p>	<p>配合期貨公會「期貨商交易及風險控管機制專案」修訂「盤中高風險帳戶」為「高風險帳戶」。</p>

修訂條文對照表

交易人風險控管辦法

修正條文	現行條文	說明
交易人發出 <u>高風險帳戶</u> 通知或盤後 <u>保證金</u> 追繳通知。	交易人發出 <u>盤中高風險帳戶</u> 通知或盤後追繳通知。	
第三十條交易人因國內保證金不足問題欲移轉國外部分之超額保證金至國內保證金帳戶時，國外可移轉之保證金以交易人國外商品留倉部位之超額保證金為限，交易人須遵守本公司風險控管相關規定提出申請，保證金之移轉時限需配合本公司作業所需，保證金移轉未完成前交易人不得以在途之申請及資金移轉要求本公司配合先行強制授權下單，因資金申請移轉所衍生之委託交易上成交價位之價差由交易人自行負責。	第三十條交易人 <u>盤中</u> 因國內保證金不足問題欲移轉國外部分之超額保證金至國內保證金帳戶時，國外可移轉之保證金以交易人國外商品留倉部位之超額保證金為限，交易人須遵守本公司風險控管相關規定提出申請，保證金之移轉時限需配合本公司作業所需，保證金移轉未完成前交易人不得以在途之申請及資金移轉要求本公司配合先行強制授權下單，因資金申請移轉所衍生之委託交易上成交價位之價差由交易人自行負責。	
第三十四條本辦法訂定於 93 年 08 月 31 日。 第二次修訂於 94 年 10 月 31 日。 第三次修訂於 98 年 09 月 25 日。 第四次修訂於 99 年 02 月 03 日。 第五次修訂於 101 年 02 月 13 日。 第六次修訂於 102 年 07 月 01 日。 第七次修訂於 104 年 07 月 16 日。 第八次修訂於 105 年 06 月 08 日。 第九次修訂於 105 年 11 月 02 日。 <u>第十次修訂於 106 年 05 月 15 日。</u>	第三十四條本辦法訂定於 93 年 08 月 31 日。 第二次修訂於 94 年 10 月 31 日。 第三次修訂於 98 年 09 月 25 日。 第四次修訂於 99 年 02 月 03 日。 第五次修訂於 101 年 02 月 13 日。 第六次修訂於 102 年 07 月 01 日。 第七次修訂於 104 年 07 月 16 日。 第八次修訂於 105 年 06 月 08 日。 第九次修訂於 105 年 11 月 02 日。	配合台期交字第 10600011620 號函公告盤後交易自 106 年 05 月 15 日起實施，增訂本次制訂日期及版次。