

主 旨：自 5 月 3 日起，實施期貨交易額度分級控管、
暨國內外期貨帳戶合併交易額度控管機制

說 明：

本公司自 110 年 5 月 3 日(星期一)起之新開戶，針對交易人從事期貨及選擇權商品的交易額度，進行分級控管機制說明如下：

一、交易人之所有國內及國外期貨新舊交易帳戶，均依總歸戶方式合併計算交易額度控管：

即同一交易人相同身分證 ID 者之國內及國外期貨所有交易帳戶中之「委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之總額」合計不得逾越所申請核准之交易額度。

二、新開戶帳戶

交易額度分級控管方式，評核分數區分為三級，說明如下：

1、採交易人所填寫的 KYC 項目及其他評估因子，作為評核分數之計算依據。

2、各分級交易額度：

| 級數 | 財力證明提供 | 交易額度上限 |
|-------------------|--------------------|------------------|
| 第一級 (承受風險波動較低) | 新台幣 0~25 萬元(不含)以下 | 新台幣 25 萬元(不含)以下 |
| | 新台幣 25~50 萬元(不含)以下 | 新台幣 50 萬元(不含)以下 |
| | 新台幣 50 萬元(含)以上 | 新台幣 100 萬元(不含)以下 |
| 第二級 (承受風險波動一般) | 新台幣 50 萬元(不含)以下 | 新台幣 50 萬元(不含)以下 |
| | 新台幣 50 萬元(含)以上 | 所提供財力證明金額的 2 倍額度 |
| 第三級 (承受風險波動較高) | 新台幣 50 萬元(不含)以下 | 新台幣 50 萬元(不含)以下 |
| | 新台幣 50 萬元(含)以上 | 所存入保證金金額為交易額度上限 |

3、交易人提供財力證明之種類(可合併計算)：

- (1)銀行存款 15 個日曆日內(含)最後一筆餘額。
- (2)金融機構所開立之最近一個月之存款餘額證明。
- (3)不動產證明文件。
- (4)股票庫存(160 庫存)及本公司資券餘額。
- (5)本公司或期貨同業15 個日曆日內(含)買賣報告書中之超額保證金金額。
- (6)其他最近一個月內之足資證明之財力證明文件。

三、針對舊戶之交易額度控管方式：

- 1、尚未申請交易額度分級控管新制度者，則適用現行之交易額度控管方式(即交易額度上限為新台幣 50 萬元以下，或交易額度為所存入保證金金額)。
- 2、舊戶可透過 1 年、3 年或 5 年期之 KYC 定期審查機制，或依客戶需求、公司針對客戶加強風險控管所需時，重新進行 KYC 評估及辦理交易額度申請。

四、若交易人所屬帳戶中，有採非當面開戶(如線上開戶、通信開戶等)者：

- 1、依上述方式進行評核其交易額度，惟非當面開戶帳戶交易額度合計上限仍為新台幣 100 萬元。
- 2、交易人已臨櫃辦理申請放寬交易額度限制者，該非當面開戶帳戶則不受新台幣 100 萬元上限之限制。

五、實施對象為自然人及一般法人，專業投資機構不適用此作業規範。