

配合臺灣期貨交易所推出盤後交易制度之告知事項參考範本

※交易人請注意：

- 一、若您未簽署「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」（以下簡稱檢核表），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。
- 二、若您已從事歐元兌美元期貨、美元兌日圓期貨之交易而未簽署檢核表，自盤後交易制度實施日起，將不得建立新部位，您在盤後交易制度實施日前已建立之未平倉部位，在盤後交易制度實施日起，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為止；您持有未平倉部位期間，本公司於盤後交易時段將不執行高風險帳戶通知、不執行代為沖銷作業，且您可能會面臨於盤後交易時段無法因應價格波動進行平倉之相關風險。

項目	內容	
重要說明	<p>期貨結算制度中，代為沖銷作業之約定目的在於保護交易人，避免交易人帳戶因盤中權益數過低又不及處理未平倉之部位，因而產生超出個人財務承擔能力的損失。</p> <p>在一般交易時段據以做為代為沖銷標準的風險指標，係將交易人所有部位以市價計入，當風險指標值低於約定標準時即代為沖銷所有部位。而於盤後交易時段，臺灣期貨交易所為避免影響不參與盤後交易交易人的作息，臺灣期貨交易所指定部分商品(TX、TXO等)豁免代為沖銷，在此設計原則與邏輯下，理想的作法應將須代為沖銷商品(DJ、S&P等)之權益數與所需保證金獨立計算風險指標，達到約定標準時即代為沖銷該等商品部位，以排除豁免代為沖銷商品之影響。</p> <p>然實務上無法將帳戶之權益數以不同商品進行區分，爰於計算風險指標時，對豁免代為沖銷商品以其當日結算價計入，以固定豁免代為沖銷商品之價格，使其損益不會影響代為沖銷商品之沖銷標準，在未新增部位的前提下，當風險指標達到約定代為沖銷標準時，即為代為沖銷商品之虧損所造成，再輔以檢視權益數是否高於維持保證金後據以執行代為沖銷作業，當不致造成不參與盤後交易人之困擾，惟新增豁免代為沖銷商品部位，仍會因未平倉部位保證金增加而降低風險指標。</p>	
適用商品及交易時間	商品名稱	交易時間(一般/盤後)
	台股期貨契約、臺指選擇權、小型臺指期貨、美國道瓊期貨、美國標普500期貨	8:45~13:45 / 15:00~次日 5:00
	小型美元兌人民幣期貨、美元兌人民幣期貨、美元兌人民幣選擇權、小型美元兌人民幣選擇權、歐元兌美元期貨、美元兌日圓期貨	8:45~16:15 / 17:25~次日 5:00

盤後交易時段豁免代為沖銷商品	<p>臺灣期貨交易所指定在盤後交易時段本公司不必執行代為沖銷作業的商品。(包括：臺股期貨契約、臺指選擇權、小型臺指期貨、小型美元兌人民幣期貨、美元兌人民幣期貨、美元兌人民幣選擇權、小型美元兌人民幣選擇權及未來臺灣期貨交易所指定豁免執行代為沖銷作業之商品)</p> <p>※上述商品可能因臺灣期貨交易所之公告而有變動</p>
盤後交易時段非豁免代為沖銷商品	<p>一般交易時段及盤後交易時段本公司均須執行代為沖銷作業的商品。(考量交易標的於盤後交易時段正處於當地國市場之正常交易時間，包括：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)</p> <p>※上述商品可能因臺灣期貨交易所之公告而有變動</p>
未沖銷期貨浮動損益	<p>權益數中之『未沖銷期貨浮動損益』計算原則：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 一般交易時段與盤後交易時段，均以市價計入。 2. 盤後交易時段收盤後至一般交易時段開盤前，盤後交易時段豁免代為沖銷商品以結算價計入，其他盤後交易時段商品以收盤價計入。
委託所需保證金	<p>本公司接受委託單時檢核所需保證金，一般交易時段與盤後交易時段均相同：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 期貨契約：依臺灣期貨交易所公告保證金(盤後交易時段不適用當日沖銷減收保證金之規定)。 2. 選擇權契約：委託所需保證金中之選擇權市值計算，市價委託以最近一筆成交價計算，限價委託以限價計算。
高風險帳戶通知	<ol style="list-style-type: none"> 1. 盤後交易時段權益數低於未平倉部位所需維持保證金時，本公司將發出高風險帳戶通知，但未平倉部位只有豁免代為沖銷的商品時，本公司將不會發出高風險帳戶通知。 2. 一般交易時段結束後，已發盤後保證金追繳通知之帳戶，倘於盤後交易時段權益數低於維持保證金且留有盤後須執行代為沖銷商品之未平倉部位時，本公司仍將再次進行高風險帳戶通知，該通知有效期間至盤後交易時段收盤為止，至次一營業日一般交易時段開盤後，則依盤後保證金追繳作業程序辦理。
盤後保證金追繳	<p>盤後保證金追繳通知係指一般交易時段收盤後，交易人帳戶權益數低於未平倉部位所需維持保證金時，本公司所發出的通知，上述通知僅計算一般交易時段的部位，盤後交易時段成交之部位將計入次一營業日。故因盤後交易時段行情變化或期貨交易人自行沖銷部分或全部部位等因素，致期貨交易人權權益數不低於未平倉部位所需維持保證金時，本公司仍將對該交易帳戶發出當日之盤後保證金追繳通知，交易人接獲通知後須依盤後保證金追繳通知之消除條件處理。</p>
盤後保證金追繳之消除	<p>盤後保證金追繳消除之條件：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 依追繳金額補足。 2. 於約定時間權益數大於或等於未平倉部位所需原始保證金。 3. 約定時間前，交易人前一一般交易時段之未平倉部位已全部沖銷。

<p>風險指標</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 交易人須瞭解，本公司計算風險指標內容時，盤後交易時段與一般交易時段不同，盤後交易時段豁免代為沖銷商品以結算價計入，且該類商品之未沖銷期貨浮動損益均不計算，非豁免代為沖銷商品則以市價計入，且須計算未沖銷期貨浮動損益。 2. 未平倉部位所需保證金與做為代為沖銷依據之風險指標計算有關，交易人須瞭解，盤後交易時段未平倉部位所需保證金之計算方式如下： <ol style="list-style-type: none"> (1)期貨契約：依台灣期貨交易所公告保證金。 (2)選擇權契約：所需保證金中計算選擇權市值與一般交易時段不同，豁免代為沖銷商品以結算價計算，盤後交易時段非豁免代為沖銷商品以市價計算。
<p>代為沖銷</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 任何交易時段風險指標低於本公司執行代為沖銷作業之標準時，本公司將執行代為沖銷作業，代為沖銷原則如下： <ol style="list-style-type: none"> (1) 將尚在交易中所有商品之未平倉部位全數沖銷，但已進入盤後交易時段之指定豁免代為沖銷商品除外。 (2) 如果帳戶之未平倉部位留有已進入盤後交易時段之指定豁免代為沖銷商品，且權益數未低於未平倉部位所需維持保證金，期貨商將不會執行代為沖銷作業。 2. 盤後交易時段豁免代為沖銷商品所產生之未沖銷期貨浮動獲利，無法用於支應其他商品之虧損，亦無法提高風險指標值，當其他商品部位虧損致達本公司約定的代為沖銷標準，其他商品將被全部沖銷。反之，豁免代為沖銷商品因市價波動造成之未沖銷期貨浮動虧損，亦不會影響其他商品。 3. 交易人需注意，盤後交易時段，如果因為新增或平倉部位，導致未平倉部位產生變化，無論該新增或平倉部位屬於豁免或非豁免代為沖銷商品，都可能使帳戶內未平倉部位所需原始保證金、維持保證金增加，並導致風險指標值下降。 4. 在一般交易時段建立盤後交易時段非豁免代為沖銷之商品（例如：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），本公司於一般交易時段或盤後交易時段執行代為沖銷作業時，均會將該時段帳戶內該商品之未平倉部位全數沖銷，交易人於各交易時段均須隨時注意權益數變化。

臺灣期貨交易所授權歐洲期貨交易所上市臺股期貨及臺指選擇權之一天期期貨契約預收保證金收取標準及風險控管措施建議

106/2/12

一、本國期貨商對交易人之保證金收取標準

(一) 臺股期貨一天期期貨（歐臺期）：

以臺灣期貨交易所公告當日沖銷交易之原始保證金收取。

(二) 臺指選擇權一天期期貨（歐臺選）：

1. 買進選擇權：依交易人所交易序列之臺灣期貨交易所當日結算價乘以契約乘數，加上變動保證金收取。變動保證金為委託價與結算價之差額乘以契約乘數，若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

2. 賣出選擇權：

市價委託時 = $(P_m - P_s) \times \text{契約乘數} + \text{Max}(A - \text{價外值}, B)$ 。

$(P_m - P_s)$ 為獲利時，只收取 $\text{Max}(A - \text{價外值}, B)$

限價委託時 = $(P_l - P_s) \times \text{契約乘數} + \text{Max}(A - \text{價外值}, B)$ 。

$(P_l - P_s)$ 為獲利時，只收取 $\text{Max}(A - \text{價外值}, B)$

※註： P_s ：臺灣期貨交易所同序列結算價

P_m ：市場最近一筆成交價

P_l ：限價單之委託價

A、B：以臺灣期貨交易所公告之臺指選擇權 A 值及 B 值計算

(三) 上述保證金之收取為最低標準，各公司得依交易人之信用狀況及交易性質，另加收保證金。

二、本國期貨商對具備臺灣期貨交易所交易會員資格之期貨自營商之保證金收取標準

(一) 臺股期貨一天期期貨（歐臺期）：

以不低於變動保證金收取，變動保證金為委託價與結算價之差額乘以契約乘數，若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

(二) 臺指選擇權一天期期貨（歐臺選）：

1. 買進選擇權：

依交易人所交易之序列收取變動保證金。變動保證金為委託價與結算價之差額乘以契約乘數，若委託價與結算價之差額為獲利，則不收變動保證金。

2. 賣出選擇權：

市價委託時 = $(P_m - P_s) \times \text{契約乘數}$ 。 $(P_m - P_s)$ 為獲利時則不收保證金。

限價委託時 = $(P_l - P_s) \times \text{契約乘數}$ 。 $(P_l - P_s)$ 為獲利時則不收保證金。

※註： P_s ：臺灣期貨交易所同序列結算價

P_m ：市場最近一筆成交價

P_l ：限價單之委託價

三、風險控管措施

- (一) 下單時保證金檢核方式：檢視交易人國外期貨帳戶可動用餘額。
- (二) 無需進行盤中風險控管，不列入國外期貨交易風險指標之計算，但須將成交後計算出之應收取保證金列為交易人國外期貨帳戶權益數減項。

**臺灣期貨交易所授權歐洲期貨交易所上市
臺股期貨及臺指選擇權之一天期期貨契約對交易人告知事項參考範本**

項目	內容	
契約規格 交易規則	商品名稱	臺股期貨一天期期貨
	交易標的	於臺灣期貨交易所掛牌的臺股期貨契約(TX)
	契約單位	1 口臺股期貨契約
	最小升降單位	指數 1 點 (相當於新台幣 200 元)
	每日漲跌幅	本商品無漲跌幅限制
	契約期間	1 個交易日
	交易日	歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日
	交易時間	歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間,夏令時間開盤、收盤均提早一小時)
	每日/最後結算價	每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺股期貨(TX)的每日結算價。
	交割方式	1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後,將到期未平倉部位進行實物交割成為臺股期貨(TX)部位,於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前,移轉回交易人之國內帳戶。
	商品名稱	臺指選擇權一天期期貨
	交易標的	於臺灣期貨交易所掛牌的臺指選擇權契約(TX0)序列(含一週到期的臺指選擇權契約,包括買(賣)權、各履約價及各到期月份的所有選擇權契約序列)
	契約單位	1 口臺指選擇權契約
	最小升降單位 /權利金報價單位	1. 報價未滿 10 點: 0.1 點(NT\$5 元); 2. 報價 10 點以上,未滿 50 點: 0.5 點(NT\$25 元) 3. 報價 50 點以上,未滿 500 點: 1 點(NT\$50 元) 4. 報價 500 點以上,未滿 1,000 點: 5 點(NT\$250 元) 5. 報價 1,000 點以上: 10 點(NT\$500 元)
每日漲跌幅	本商品無漲跌幅限制	

	<table border="1"> <tr> <td data-bbox="359 215 550 257">契約期間</td> <td data-bbox="550 215 1391 257">1 個交易日</td> </tr> <tr> <td data-bbox="359 257 550 300">交易日</td> <td data-bbox="550 257 1391 300">歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日</td> </tr> <tr> <td data-bbox="359 300 550 510">交易時間</td> <td data-bbox="550 300 1391 510">歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間, 夏令時間開盤、收盤均提早一小時)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="359 510 550 607">每日/最後結算價</td> <td data-bbox="550 510 1391 607">每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺指選擇權(TXO)各序列的每日結算價。</td> </tr> <tr> <td data-bbox="359 607 550 846">交割方式</td> <td data-bbox="550 607 1391 846">1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後, 將到期未平倉部位進行實物交割成為臺指選擇權(TXO)部位, 於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前, 移轉回交易人之國內帳戶。</td> </tr> </table> <p data-bbox="359 857 1391 896">※上述內容可能因各期貨交易所之公告而有變動</p>	契約期間	1 個交易日	交易日	歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日	交易時間	歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間, 夏令時間開盤、收盤均提早一小時)	每日/最後結算價	每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺指選擇權(TXO)各序列的每日結算價。	交割方式	1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後, 將到期未平倉部位進行實物交割成為臺指選擇權(TXO)部位, 於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前, 移轉回交易人之國內帳戶。
契約期間	1 個交易日										
交易日	歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日										
交易時間	歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間, 夏令時間開盤、收盤均提早一小時)										
每日/最後結算價	每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺指選擇權(TXO)各序列的每日結算價。										
交割方式	1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後, 將到期未平倉部位進行實物交割成為臺指選擇權(TXO)部位, 於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前, 移轉回交易人之國內帳戶。										
保證金收取標準	<p data-bbox="359 902 1391 985">1. 本商品以新臺幣計價, 採預收保證金制, 於交易人進行委託時, 檢核國外帳戶之可動用餘額是否有足額之保證金, 收取標準如下:</p> <p data-bbox="359 996 1391 1079">(1) 交易標的為台股期貨契約(TX) 依臺灣期貨交易所公告之當沖交易原始保證金。</p> <p data-bbox="359 1090 1391 1272">(2) 交易標的為臺指選擇權契約(TXO) 買方: 依交易人所交易序列之臺灣期貨交易所當日的結算價乘以契約乘數, 加上變動保證金收取。(變動保證金為委託價與結算價之差額乘以契約乘數, 若差額為獲利則不收) 賣方: 市價委託時 = (Pm - Ps) × 契約乘數 + Max (A - 價外值, B) (Pm - Ps) 為獲利時, 只收取 Max (A - 價外值, B) 限價委託時 = (Pl - Ps) × 契約乘數 + Max (A - 價外值, B) (Pl - Ps) 為獲利時, 只收取 Max (A - 價外值, B)</p> <p data-bbox="446 1478 1391 1825">※註: Ps = 臺灣期貨交易所同序列結算價 Pm = 市場最近一筆成交價 Pl = 限價單的委託價 A、B: 以臺灣期貨交易所公告臺指選擇權 A 值及 B 值計算 call 價外值: (價外選擇權履約價 - 臺灣證券交易所當日公布之發行量加權股價指數收盤價) × 契約乘數 Put 價外值: (臺灣證券交易所當日公布之發行量加權股價指數收盤價 - 價外選擇權履約價) × 契約乘數</p> <p data-bbox="359 1832 1391 1870">2. 本公司得依交易人之信用狀況及交易性質訂定不同之收取標準。</p>										
盤中風險控管方式	本公司得對本商品於盤中採單獨控管(得不進行盤中高風險帳戶通知及代為沖銷作業), 本商品將不會與其他國外期貨商品合併列入交易人國外期										

	貨交易帳戶風險指標的計算，但會在本商品成交後計算出應收取的保證金，列為交易人國外帳戶權益數減項。
一次性指示撥轉的書面約定	<ol style="list-style-type: none"> 1. 交易人得事先與本公司辦理書面約定一次性指示(得以書面文件或電子憑證方式簽署)，授權本公司就以下情形，自行代交易人辦理國內或國外客戶保證金專戶款項撥轉，如有需要，並得代為換匯： <ol style="list-style-type: none"> (1) 支付本商品結算虧損； (2) 到期未平倉部位進行實物交割，在轉入交易人之國內期貨交易帳戶所需收取之保證金或權利金額度內撥轉。 2. 交易人如未事先與本公司辦理上述書面約定一次性指示，當發生需要撥轉國內或國外客戶保證金專戶款項的情形，必須逐次指示本公司辦理撥轉，並確認該次撥轉金額。
每日/最後結算價	<ol style="list-style-type: none"> 1. 每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所台股期貨(TX)及臺指選擇權(TX0)各序列的每日結算價。 2. 因技術問題，造成交易受到影響或其他因素導致結算價無法決定時，歐洲期貨交易所的結算機構可使用其他方式決定最後結算價。
交割方式	<ol style="list-style-type: none"> 1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)，於交易人的國外帳戶進行款項收付。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後，將到期未平倉部位進行實物交割成為台股期貨(TX)部位或臺指選擇權(TX0)部位，於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前，移轉回交易人之國內帳戶。
到期部位接受或拒絕轉入	<ol style="list-style-type: none"> 1. 本公司辦理本商品到期未平倉部位轉入前，將依臺灣期貨交易所保證金及權利金之相關規定，合併檢視交易人國內及國外帳戶是否足夠支應轉入部位後所需之保證金及權利金，如果足夠，本公司將接受該部位轉入，如果不足，本公司可將全部或部分部位拒絕轉入。 2. 上述臺灣期貨交易所保證金及權利金之相關規定係指： <ol style="list-style-type: none"> (1) 如交易人已與本公司簽立當日沖銷交易風險預告書，台股期貨(TX)最近二個月份契約的部位可依臺灣期貨交易所公告之當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)檢核，其餘月份契約則依臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金額度(全額保證金)檢核。以當日沖銷交易原始保證金檢核轉入交易人國內帳戶的部位應遵守臺灣期貨交易所及期貨公會所對於當日沖銷交易部位之相關規定。 如交易人未事先與本公司簽立當日沖銷交易風險預告書，台股期貨(TX)部位將依臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金額度(全額保證金)檢核，依一般交易之規定辦理。 (2) 在歐洲期貨交易所到期未平倉轉入交易人國內帳戶之台股期貨(TX)及臺指選擇權(TX0)的部位，得與國內現有的部位多空互抵

	<p>計算所需保證金及權利金。</p> <p>(3) 如交易人帳戶採策略保證金計算方式：比較轉入部位單獨計算之應有策略保證金與轉入部位併入既有部位之整戶保證金應增收之金額何者較低。</p> <p>(4) 如交易人帳戶採SPAN保證金計算方式：比較轉入部位單獨計算之應有SPAN保證金與轉入部位併入既有部位之整戶保證金應增收之金額何者較低。</p> <p>3. 在交易人之保證金、權利金足夠範圍內，本公司得選擇將一部份的部位轉入，若交易人未與本公司約定接受或拒絕部位之處理原則，將由本公司自行決定處理原則。</p> <p>4. 部位處理方式：</p> <p>(1) 從歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺股期貨(TX)為自動沖銷。</p> <p>(2) 從歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺指選擇權(TX0)部位</p> <p>如交易人未通知本公司指定沖銷，多空部位將保留，交易人如需指定沖銷，應通知本公司辦理。</p> <p>5. 從歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺股期貨(TX)及臺指選擇權(TX0)部位，在轉入時將立即適用臺灣期貨交易所部位限制之規定，但尚無須立即適用本公司對交易人分類分級、加收保證金之規定，僅在轉入的當日臺灣期貨交易所一般交易時段收盤後，必須適用本公司對交易人分類分級、加收保證金之規定。</p>
<p>部位拒絕轉入之後續處理</p>	<p>交易人部位被拒絕轉入國內帳戶時，將轉入歐洲期貨交易所之結算機構於期貨商開立之部位處理專戶，歐洲期貨交易所之結算機構將指示該期貨商於當日執行沖銷拒絕部位，至全部部位沖銷為止，如當日因市場流動性不足或其他不可抗力因素造成無法於收盤前沖銷完畢之部位，該期貨商將依相關規定，持續執行代為沖銷作業，至全部部位沖銷為止。部位處理後如有利得歸屬於歐洲期貨交易所，如有損失或處理部位之相關費用，則會向交易人進行追索。為避免因部位被拒絕轉入引發後續之糾紛與風險，請交易人斟酌於本公司國內、外保證金專戶存放足夠或超額之保證金。</p>

以上內容提供期貨商參考，如有需要仍可自行增列其他告知事項

重點概要：

- 一、本商品為國外期貨商品，採預收保證金制，故交易人在下單前，應先將保證金存至本公司之國外客戶保證金專戶。交易人於國外帳戶存放所需足額之保證金，可自行匯入或逐筆指示本公司將交易人存放於國內客戶保證金專戶之保證金轉入國外客戶保證金專戶。
- 二、交易人欲從事本商品交易，應先瞭解本公司可接受之下單方式(例如：電話、網路或其他電子方式…等)及下單時間。
- 三、本商品採盤中單獨控管，得不進行盤中高風險帳戶通知及代為沖銷作業，且不會與其他國外期貨商品合併列入交易人國外期貨交易帳戶風險指標的計算，但會在本商品成交後計算出應收取的保證金，列為交易人國外帳戶權益數減項，影響交易人可動用保證金餘額。
- 四、本商品於歐洲期貨交易所交易收盤後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)，將到期未平倉部位進行實物交割成為臺股期貨部位或臺指選擇權部位。本公司依臺灣期貨交易所之規定，檢視交易人保證金、權利金是否足夠，若有足夠之保證金、權利金，將於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前，將部位移轉回交易人之國內帳戶；若無足夠之保證金、權利金，本公司得將全部部位或保證金、權利金不足之部位加以拒絕。交易人部位被拒絕轉入國內帳戶時，將轉入歐洲期貨交易所之結算機構於期貨商開立之部位處理專戶，歐洲期貨交易所之結算機構將指示該期貨商於當日將被拒絕之部位執行反向沖銷。
- 五、(一)具備申請當日沖銷交易資格條件的交易人得與本公司簽立當日沖銷交易風險預告書(以書面文件簽署或電子憑證方式簽署)，臺股期貨(TX)部位可依臺灣期貨交易所公告之當日沖銷交易原始保證金檢核，但應注意依臺灣期貨交易所及期貨公會之下列規定辦理：
 1. 臺灣期交所目前當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)收取僅限最近 2 個到期月份契約，故其他月份之部位仍應以一般交易之原始保證金(全額保證金)檢核。
 2. 以當日沖銷交易原始保證金檢核轉入之部位，本公司將依當日沖銷交易盤中風險控管機制、強制沖銷之規定，及收盤後留有當日沖銷交易未沖銷部位餘額之處理方式辦理。
 3. 轉入的部位超過交易人申請適用於當日沖銷交易之所需保證金額度的部份，必須以一般交易之原始保證金(全額保證金)檢核。(二)如交易人未事先與本公司簽立當日沖銷交易風險預告書，臺股期貨(TX)部位則需依臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金(全額保證金)檢核，依一般交易之規定辦理。
- 六、因交易人委託下單時得以臺灣期貨交易所公告之當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)檢核，而到期未平倉部位轉入國內帳戶時可能全部或一部分部位採臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金(全額保證金)計收，將可能導致帳戶權益數不足而拒絕轉入並被沖銷，為避免此類之風險與糾紛，請交易人隨時掌握風險並存入足額或超額之保證金。

**臺灣期貨交易所授權歐洲期貨交易所上市
臺股期貨及臺指選擇權之一天期期貨契約對交易人告知事項參考範本**

項目	內容	
契約規格 交易規則	商品名稱	臺股期貨一天期期貨
	交易標的	於臺灣期貨交易所掛牌的臺股期貨契約(TX)
	契約單位	1 口臺股期貨契約
	最小升降單位	指數 1 點 (相當於新台幣 200 元)
	每日漲跌幅	本商品無漲跌幅限制
	契約期間	1 個交易日
	交易日	歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日
	交易時間	歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間, 夏令時間開盤、收盤均提早一小時)
	每日/最後結算價	每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺股期貨(TX)的每日結算價。
	交割方式	1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後, 將到期未平倉部位進行實物交割成為臺股期貨(TX)部位, 於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前, 移轉回交易人之國內帳戶。
	商品名稱	臺指選擇權一天期期貨
	交易標的	於臺灣期貨交易所掛牌的臺指選擇權契約(TX0)序列 (含一週到期的臺指選擇權契約, 包括買(賣)權、各履約價及各到期月份的所有選擇權契約序列)
	契約單位	1 口臺指選擇權契約
	最小升降單位	1. 報價未滿 10 點: 0.1 點(NT\$5 元);
	/權利金報價單位	2. 報價 10 點以上, 未滿 50 點: 0.5 點(NT\$25 元) 3. 報價 50 點以上, 未滿 500 點: 1 點(NT\$50 元) 4. 報價 500 點以上, 未滿 1,000 點: 5 點(NT\$250 元) 5. 報價 1,000 點以上: 10 點(NT\$500 元)
	每日漲跌幅	本商品無漲跌幅限制

	<table border="1"> <tr> <td data-bbox="352 215 555 259">契約期間</td> <td data-bbox="555 215 1385 259">1 個交易日</td> </tr> <tr> <td data-bbox="352 259 555 304">交易日</td> <td data-bbox="555 259 1385 304">歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日</td> </tr> <tr> <td data-bbox="352 304 555 510">交易時間</td> <td data-bbox="555 304 1385 510">歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間，夏令時間開盤、收盤均提早一小時)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="352 510 555 607">每日/最後結算價</td> <td data-bbox="555 510 1385 607">每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺指選擇權(TX0)各序列的每日結算價。</td> </tr> <tr> <td data-bbox="352 607 555 846">交割方式</td> <td data-bbox="555 607 1385 846">1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後,將到期未平倉部位進行實物交割成為臺指選擇權(TX0)部位,於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前,移轉回交易人之國內帳戶。</td> </tr> </table> <p data-bbox="352 857 1385 902">※上述內容可能因各期貨交易所之公告而有變動</p>	契約期間	1 個交易日	交易日	歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日	交易時間	歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間，夏令時間開盤、收盤均提早一小時)	每日/最後結算價	每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺指選擇權(TX0)各序列的每日結算價。	交割方式	1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後,將到期未平倉部位進行實物交割成為臺指選擇權(TX0)部位,於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前,移轉回交易人之國內帳戶。
契約期間	1 個交易日										
交易日	歐洲期貨交易所及臺灣期貨交易所均有營業的交易日										
交易時間	歐洲中部時間 07:45 - 21:00 或 08:45* - 21:00 (台灣時間 14:45 - 04:00 或 14:45 - 03:00*) (*歐洲期貨市場實施日光節約時間，夏令時間開盤、收盤均提早一小時)										
每日/最後結算價	每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所臺指選擇權(TX0)各序列的每日結算價。										
交割方式	1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後,將到期未平倉部位進行實物交割成為臺指選擇權(TX0)部位,於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前,移轉回交易人之國內帳戶。										
保證金收取標準	<p data-bbox="352 927 1385 1010">3. 本商品以新臺幣計價，採預收保證金制，於交易人進行委託時，檢核國外帳戶之可動用餘額是否有足額之保證金，收取標準如下：</p> <p data-bbox="352 1021 1385 1104">(2) 交易標的為台股期貨契約(TX) 依臺灣期貨交易所公告之當沖交易保證金(全額保證金的一半)收取。</p> <p data-bbox="352 1115 1385 1301">(2) 交易標的為臺指選擇權契約(TX0) 買方：依交易人所交易序列之臺灣期貨交易所當日的結算價乘以契約乘數，加上變動保證金收取。(變動保證金為委託價與結算價之差額乘以契約乘數，若差額為獲利則不收) 賣方：市價委託時 = $(P_m - P_s) \times \text{契約乘數} + \text{Max}(A - \text{價外值}, B)$ ($P_m - P_s$) 為獲利時，只收取 $\text{Max}(A - \text{價外值}, B)$ 限價委託時 = $(P_l - P_s) \times \text{契約乘數} + \text{Max}(A - \text{價外值}, B)$ ($P_l - P_s$) 為獲利時，只收取 $\text{Max}(A - \text{價外值}, B)$</p> <p data-bbox="352 1312 1385 1798">※註： P_s = 臺灣期貨交易所同序列結算價 P_m = 市場最近一筆成交價 P_l = 限價單的委託價 A、B：以臺灣期貨交易所公告臺指選擇權 A 值及 B 值計算 call 價外值：(價外選擇權履約價 - 臺灣證券交易所當日公布之發行之加權股價指數收盤價) × 契約乘數 Put 價外值：(臺灣證券交易所當日公布之發行之加權股價指數收盤價 - 價外選擇權履約價) × 契約乘數</p> <p data-bbox="352 1809 1385 1854">4. 期貨商得依交易人之信用狀況及交易性質訂定不同之收取標準。</p>										
約定入金	交易人從事本商品交易，得使用原開戶時所約定之入金及出金銀行帳號，										

出金帳號	或另增加約定入金帳號(每一幣別不可超過三個約定入金帳號)或變更出金銀行帳號，辦理存入或提領保證金。
保證金專戶帳號	1. 從事本商品交易前應先存入保證金至本公司委任期貨商之國外客戶保證金專戶。 2. 交易人可將保證金從與期貨商約定之指定入金帳號，存入國外客戶保證金專戶，或通知本公司或期貨商從國內客戶保證金專戶交易人權益中之可動用餘額，撥入國外客戶保證金專戶。 本公司委任期貨商之國外客戶保證金專戶之帳號為：_____
出金申請	可透過本公司協助辦理，或直接向本公司委任期貨商○○期貨申請。 本公司辦理人工出金服務時段：○時~○時，出金專線：XX-XXXXXXX ○○期貨辦理人工期貨出金服務時段：○時~○時，出金專線：XX-XXXXXXX
委託及聯繫方式	1. 本商品得以電子或人工方式進行委託。 電子下單網頁：_____ 2. 本商品接受人工下單時段： 本公司：○時~○時 ○○期貨：○時~○時 3. 本商品相關問題詢問： 本公司服務時段：○時~○時，洽詢服務專線：XX-XXXXXXX ○○期貨服務時段：○時~○時，洽詢服務專線：XX-XXXXXXX
盤中風險控管方式	本商品得不進行盤中高風險帳戶通知及代為沖銷作業，但會將成交後計算出之應收取保證金列為交易人國外帳戶權益數減項，影響交易人可動用餘額。
一次性指示撥轉的書面約定	1 交易人得事先與本公司及委託期貨商辦理書面約定一次性指示(得以書面文件簽署或電子憑證方式簽署)，授權期貨商就以下情形，自行代交易人辦理國內或國外客戶保證金專戶款項撥轉，如有需要，並得代為換匯： (1) 支付本商品結算虧損； (2) 到期未平倉部位進行實物交割，在轉入交易人之國內期貨交易帳戶所需收取之保證金或權利金額度內撥轉。 2. 交易人如未事先與本公司及委託期貨商辦理上述書面約定一次性指示當發生需要撥轉國內或國外客戶保證金專戶款項的情形，必須逐次指示期貨商辦理撥轉，並確認該次撥轉金額。
每日/最後結算價	1. 每日/最後結算價為該交易日各臺灣期貨交易所台股期貨(TX)及臺指選擇權(TX0)各序列的每日結算價。 2. 因技術問題，造成交易受到影響或其他因素致結算價無法決定時，歐洲期貨交易所之結算機構可使用其他方式決定最後結算價。

交割方式	<ol style="list-style-type: none"> 1. 於歐洲期貨交易所交易時段結束後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)，於交易人的國外帳戶進行款項收付。 2. 並於歐洲期貨交易所收盤後,將到期未平倉部位進行實物交割成為臺股期貨(TX)部位或臺指選擇權(TXO)部位，於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前，移轉回交易人之國內帳戶。
到期部位接受或拒絕轉入	<ol style="list-style-type: none"> 3. 本公司之委任期貨商辦理本商品到期未平倉部位轉入前，將依臺灣期貨交易所保證金及權利金之相關規定，合併檢視交易人國內及國外帳戶是否足夠支應轉入部位後所需之保證金及權利金，如果足夠，將接受該部位轉入，如果不足，可將全部或部分部位拒絕轉入。 4. 上述臺灣期貨交易所保證金及權利金之相關規定係指： <ol style="list-style-type: none"> (1) 如交易人已與期貨商簽立當日沖銷交易風險預告書，臺股期貨(TX)最近二個月份契約的部位可依臺灣期貨交易所公告之當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)檢核，其餘月份契約則依臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金額度(全額保證金)檢核。以當日沖銷交易原始保證金檢核轉入交易人國內帳戶的部位應遵守臺灣期貨交易所及期貨公會所對於當日沖銷交易部位之相關規定。 如交易人未事先與期貨商簽立當日沖銷交易風險預告書，臺股期貨(TX)部位則需依臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金額度(全額保證金)檢核，依一般交易之規定辦理。 (2) 歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺股期貨(TX)及臺指選擇權(TXO)未平倉部位，得與國內現有的部位多空互抵計算所需保證金、權利金。 (3) 如交易人帳戶採策略保證金計算方式：比較轉入部位單獨計算之應有策略保證金與轉入部位併入既有部位之整戶保證金應增收之金額何者較低。 (4) 如交易人帳戶採SPAN保證金計算方式：比較轉入部位單獨計算之應有SPAN保證金與轉入部位併入既有部位之整戶保證金應增收之金額何者較低。 3. 在交易人之保證金、權利金足夠範圍內，期貨商得選擇將一部份的部位轉入，若交易人未與本公司或委任期貨商約定接受或拒絕部位之處理原則，將由期貨商自行決定處理原則。 4. 部位處理方式： <ol style="list-style-type: none"> (1) 從歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺股期貨(TX)為自動沖銷 (2) 從歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺指選擇權(TXO)部位，

	<p>如交易人未通知本公司或期貨商指定沖銷，多空部位將保留，交易人如需指定沖銷，應通知本公司或期貨商辦理。</p> <p>5. 從歐洲期貨交易所轉入交易人國內帳戶之臺股期貨(TX)及臺指選擇權(TXO)部位，在轉入時將立即適用臺灣期貨交易所部位限制之規定，但尚無須立即適用期貨商對交易人分類分級、加收保證金之規定，僅在轉入的當日臺灣期貨交易所一般交易時段收盤後，必須適用期貨商對交易人分類分級、加收保證金之規定。</p>
部位拒絕轉入之後續處理	<p>交易人部位被拒絕轉入國內帳戶時，將轉入歐洲期貨交易所之結算機構於期貨商開立之部位處理專戶，歐洲期貨交易所之結算機構將指示該期貨商於當日執行沖銷拒絕部位，至全部部位沖銷為止，如當日因市場流動性不足或其他不可抗力因素造成無法於收盤前沖銷完畢之部位，該期貨商將依相關規定，持續執行代為沖銷作業，至全部部位沖銷為止。部位處理後如有利得歸屬於歐洲期貨交易所，如有損失或處理部位之相關費用，則會向交易人進行追索。為避免因部位被拒絕轉入引發後續之糾紛與風險，請交易人斟酌於本公司國內、外保證金專戶存放足夠或超額之保證金。</p>

**以上內容提供期貨商及期貨交易輔助人參考，如有需要仍可自行增列其他告知事項
重點概要：**

- 一、本商品為國外期貨商品，採預收保證金制，故交易人在下單前，應先將保證金存至本公司之國外客戶保證金專戶。交易人於國外帳戶存放所需足額之保證金，可自行匯入或逐筆指示本公司將交易人存放於國內客戶保證金專戶之保證金轉入國外客戶保證金專戶。
- 二、交易人欲從事本商品交易，應先瞭解本公司或委任期貨商可接受之下單方式(例如：電話、網路或其他電子方式…等)、下單時間(本公司或委任期貨商接單時間)及下單流程(由本公司接受下單委託或由委任期貨商直接接受委託)。
- 三、本商品採盤中單獨控管，得不進行盤中高風險帳戶通知及代為沖銷作業，且不會與其他國外期貨商品合併列入交易人國外期貨交易帳戶風險指標的計算，但會在本商品成交後計算出應收取的保證金，列為交易人國外帳戶權益數減項，影響交易人可動用保證金餘額。
- 四、本商品於歐洲期貨交易所交易收盤後計算到期損益(成交價與結算價之差額乘以契約乘數)，將到期未平倉部位進行實物交割成為臺股期貨部位或臺指選擇權部位。本公司依臺灣期貨交易所之規定，檢視交易人保證金、權利金是否足夠，若有足夠之保證金、權利金，將於臺灣期貨交易所次一營業日一般交易時段開盤前，將部位移轉回交易人之

國內帳戶；若無足夠之保證金、權利金，本公司得將全部部位或保證金、權利金不足之部位加以拒絕。交易人部位被拒絕轉入國內帳戶時，將轉入歐洲期貨交易所之結算機構於期貨商開立之部位處理專戶，歐洲期貨交易所之結算機構將指示該期貨商於當日將被拒絕之部位執行反向沖銷。

五、(一)具備申請當日沖銷交易資格條件的交易人得與本公司之委任期貨商簽立當日沖銷交易風險預告書(得以書面簽署或電子憑證方式簽署)，台股期貨(TX)部位可依臺灣期貨交易所公告之當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)檢核，但應注意依臺灣期貨交易所及期貨公會之下列規定辦理：

1. 臺灣期交所目前當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)收取僅限最近 2 個到期月份契約，故其他月份之部位仍應以一般交易之原始保證金(全額保證金)檢核。
2. 以當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)檢核轉入之部位，期貨商將依當日沖銷交易盤中風險控管機制、強制沖銷之規定，及收盤後留有當日沖銷交易未沖銷部位餘額之處理方式辦理。
3. 轉入的部位超過交易人申請適用於當日沖銷交易之所需保證金額度的部份，必須以一般交易之原始保證金(全額保證金)檢核。

(二)如交易人未事先與期貨商簽立當日沖銷交易風險預告書，台股期貨(TX)部位則需依臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金額度檢核，依一般交易之規定辦理。

六、因交易人委託下單時得以臺灣期貨交易所公告之當日沖銷交易原始保證金(全額保證金的一半)檢核，而到期未平倉部位轉入國內帳戶時可能全部或一部分部位採臺灣期貨交易所公告之一般交易原始保證金(全額保證金)計收，將可能導致帳戶權益數不足而發生部位被拒絕轉入並被代為沖銷，為避免此類之風險與糾紛，請交易人隨時掌握風險並存入足額或超額之保證金。