

國內市場存提

異動日期	異動序號	類別	異動類別	匯出入銀行	作業說明	手續費用	匯出入金額
107/05/16	1234 56789	存		國泰世華	20180516,110706,0000		500,000(NTT) ← 入金---①
107/05/16	_12345	提	網路出金	台新銀行	2018/05/16 13:49:49		100,000(NTT) ← 出金---②

國內市場交易

成交日期	委託書號	交易所	商品名稱	交割月份	履約價格	權別	買賣	口數	成交价格	期交稅	手續費	權利金/平倉損益
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;">買進 1 口 5 月小型臺指 成交價 10,898</div>												
107/05/16	M0031	TAIMEX	5月小型臺指	201805			買	1	10,898.000	11	22(NTT)	0
								1	11	22	0	
商品小計：												
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;">手續費*成交口數---③</div>												
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;">成交价格*合約規格*交易稅*成交口數---④ ※稅須先四捨五入後再乘口數</div>												
<div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 0 auto;">結算交割損益= (到期結算價-成交價)*合約規格 = (10872-10898)*50---⑤</div>												
107/05/16	A0003	TAIMEX	5月小型臺指	201805			到期	1	10,872.000	11	22(NTT)	-1,300(NTT)
平倉-> 107/05/16 M0031								買	1	10,898.000		
商品小計：								1		11	22	-1,300
107/05/16	A0023	TAIMEX	5月小型大立	201805			到期	1	4,069.190	8	17(NTT)	-10,081(NTT)
平倉-> 107/05/15 M0005								買	1	4,170.000		
商品小計：								1		8	17	-10,081
107/05/16	M0021	TAIMEX	6月小型大立	201806			買	1	4,080.000	8	17(NTT)	
商品小計：								1		8	17	0
107/05/16	H0021	TAIMEX	6月美國道瓊	201806			買	1	24,660.000	10	22(NTT)	
107/05/16	H0022	TAIMEX	6月美國道瓊	201806			賣	1	24,710.000	10	22(NTT)	1,000(NTT)
平倉-> 107/05/16 H0021								買	1	24,660.000		
商品小計：								2		20	44	1,000
總計：								6		58	122	-10,381

到期未履約明細

成交日期	委託書號	交易所	商品名稱	交割月份	履約價格	權別	交易	口數	成交价格	
107/05/16	A0036	TAIMEX	8月10900賣權	201808	10900.000	PUT	到期	5	11,085.000	
平倉-> 107/05/13 M0174								買	5	3.700
總計：								5		

* 股票期貨契約調整權益數加/減項 *

成交日期	商品名稱	交割月份	口數	契約調整權益數加/減項
107/05/16	FIOLF 6月小型大立	201806	調整 1	2,500(NTT) ← ⑥

* 國內市場留倉彙總 *

成交日期	商品名稱	交割月份	履約價格	權別	買賣	進場價格	結算價	部位	原始保證金	權利金市值	浮動損益	
107/05/11	6月富邦上証 E	201806			買	31.850	32.100	1	15,000.00		2,500(NTT)	
商品小計：6月富邦上証 EFIOAF											1	2,500
107/05/16	6月小型大立	201806			買	4080.000	4055.000	1	54,743.00		-2,500(NTT)	
商品小計：6月小型大立 FIOLF											1	-2,500
107/05/15	6月臺股期貨	201806			買	10882.000	10882.000	1	83,000.00		0(NTT)	
商品小計：6月臺股期貨 FITX											1	

浮動損益 = (每日結算價 - 成交價) * 合約規格 * 口數
= (10882 - 10882) * 200 * 1 --- **⑦**

總計：								3	152,743.00		
調整前原始保證金								3	152,743.00		
組合節省保證金									0.00		
組合合計									152,743.00		
原始保證金(Ax-Cx)								3	152,743.00		
選擇權浮動損益											
未沖銷買方選擇權市值											
未沖銷賣方選擇權市值											
選擇權市場價值											

* 國內市場權益帳 *

幣別	本日餘額	權益數	權益總值	原始保證金	維持保證金	可動用保證金	追繳保證金	加收保證金
TWD	818,143	818,143	818,143	152,743	117,969	665,400		

前日餘額 + **①** - **②** - **③** - **④** + **⑤** + **⑥**

本日餘額 + **⑦**

權益數 - 原始保證金

前日餘額	本日存	本日提	手續費	期交稅	契約調整權益數加/減項	平倉損益	浮動損益	權利金收入與支出
426,204	500,000 ①	100,000 ②	122	58	2,500 ⑥	-10,381	⑦ (0 不會顯示數字)	
		22+22+17+17+44 → ③		11+11+8+8+20 → ④		-1300-10081+1000 → ⑤		

* 國內市場權益帳 *

幣別	本日餘額	權益數	權益總值	原始保證金	維持保證金	擔保品金額	可動用保證金	追繳保證金
USD			0		0			
匯率	前日餘額	本日存	本日提	手續費	期交稅	平倉損益	浮動損益	權利金收入與支出

交易人請注意：

中華民國期貨業商業同業公會「期貨商交易及風險控管機制專案」各項議題修訂彙整表，請交易人詳閱以下事項或參閱本公司網站公告事項【<http://www.honsec.com.tw/HWweb/Content.Files/Securities.Files/Mainframe/index.aspx>】，以維自身權益，謝謝！

一、106年5月15日臺灣期貨交易所「盤後交易制度」實施後，相關風控、交易事宜及告知事項請洽所屬營業員，或於本公司網站上查詢。

二、名詞說明：

- (一) 本日餘額 = 前日餘額 + 帳戶存入 - 帳戶提出 - 手續費 - 期交稅 + (-) 期貨平倉損益淨額 [償還結算] + (-) 權利金收入與支出 + (-) 選擇權到期履約損益 + 契約調整權益數加/減項。
 - (二) 本日權益數 = 本日餘額 + (-) 未沖銷期貨浮動損益 [償還結算] + 有價証券抵繳總額。
 - (三) 權益總值 = 本日權益數 + 未沖銷買方選擇權市值 - 未沖銷賣方選擇權市值。
 - (四) 超額/追繳保證金 = 本日權益數 - 總原始保證金 (+超額/-追繳)。
 - (五) 可動用(出金)保證金 = 本日權益數 - 總原始保證金 - 未沖銷期貨未實現利得 - 委託保證金及權利金 - 加收保證金。
 - (六) 風險指標 = 權益總值 / (總原始保證金 + 未沖銷買方選擇權市值 - 未沖銷賣方選擇權市值 + 加收保證金)。
 - (七) 個股配息調整說明：留倉買方則為權益數加項/留倉賣方則為權益數減項。
 - (八) 當沖維持率 = (當沖當沖保證金 + (-) 當沖浮動) / 當沖原始保證金。
 - (九) 盤中高風險及盤後追繳帳戶通知 = 權益數小於總維持保證金。
- 三、接獲本公司盤中高風險帳戶通知或盤後保證金追繳後，屆盤後保證金追繳之補繳時限仍未解除盤後保證金追繳，或風險指標低於本公司規定時，〈T日盤後追繳保證金補繳期限於次一營業日中午12:00前補足；雖於所定期限內補繳保證金，仍會因人金時間差而產生被本公司代為沖銷之風險〉如逾期未蒙全額補繳，為維護台端之權益，避免虧損擴大，本公司將開始執行〈有權而非義務〉以市價或限價逕行代為沖銷台端所持未平倉之期貨交易部位，本公司之代沖銷得於前述時限後逐時或逐日處理，不受時間之限制，盈虧由交易人自負，交易人如有違約未結案紀錄，5年內不得在證券及期貨市場開戶或交易。
- 四、依據個人資料保護法（以下稱個資法）規定，本公司蒐集台端個人資料，茲依據個資法第八條規定，向台端提供告知書，連結網址 <http://www.honsec.com.tw/HWweb/Content.Files/Securities.Files/news/news.aspx?ReportClassCode=22&ReportId=272>
- 五、委託單新(平)倉之輸入方式處理原則：交易人委託單可勾選新、平倉或兩者皆不勾選，新、平倉兩者皆不勾選者即視為自動處理。
- (一) 期貨契約處理原則：買賣委託書可勾選新、平倉碼或皆不勾選；新、平倉碼兩者皆不勾選者即為自動處理。對於勾選新倉或平倉之委託單，其委託口數與實際反向留倉部位不符者，全部退單處理。對自動處理之委託單，交易系統對於有對應反向留倉部位之委託部份以「平倉」處理；無足夠反向留倉部位之委託部份以「新倉」處理。
 - (二) 選擇權契約處理原則：買賣委託書可勾選新、平倉。若勾選平倉而反向留倉不足時，該委託全數退回。
 - (三) 網路下單交易亦適用前項處理原則。
- 六、市價委託係不限定價格之委託，其成交價格與委託當時揭示之市場成交價格或買賣申報價格間可能產生偏離情形，且偏離幅度可能超出交易人之預期，故交易人須了解市價委託之風險。
- 七、期貨交易人申請電子式交易時，請交易人妥善保管電子式交易密碼及電子交易憑證，勿將密碼或憑證交付他人，避免自身權益受損。
- 八、期貨商客戶保證金專戶與自有資金帳戶為分離帳戶，且客戶保證金專戶係受保護與管理。
- 九、本公司業務員於受理交易人委託買賣時得採「電子方式填具買賣委託書」作業。
- 十、如需辦理出金者，請撥至本公司出金專線：(02)6636-0208，將由專人為您服務。
- 十一、本公司自104年7月20日起以電話、簡訊及具電子憑證功能之電子郵件或其他交易人指定的方式，對交易人發出盤後保證金追繳通知，並將停止使用書面通知。如交易人指定使用不具電子憑證功能的電子郵件，本公司將同時再以電話或簡訊通知。
- 十二、本公司開始兼營期貨顧問事業。歡迎已開立期貨電子交易帳戶客戶至本公司網站電子簽署顧問委任契約，加入期顧會員。
立即簽署網址：http://trade.honsec.com.tw/TASP/TAMain.dll?TADummy&TAPage=FA_Main
- 十三、本公司可交易商品請參考商品合約網址 http://www.honsec.com.tw/HWweb/Content.Files/Futures.Files/FT03/FT03_2.aspx
- 十四、本公司自107年1月2日起，設置期貨業務之交易室-電話集中接單中心，提供辦理客戶以電話委託方式從事國內期貨交易的服務。
交易室-電話集中接單中心 服務專線：02-6636-0728
- 十五、臺灣期貨交易所「動態價格穩定措施」新制：
- (一)自107年1月22日起實施，第一階段適用商品為「臺股期貨」及「小型臺指期貨」，且限此兩項商品的最近月、次近月契約，及最近月與次近月的跨月價差交易。
 - (二)因應「動態價格穩定措施」上線實施，針對該措施之適用商品，臺灣期貨交易所會對造成價格異常波動之新進委託(例如新進買進委託之可能成交价格高於即時價格區間上限或新進賣出委託之可能成交价格低於即時價格區間下限)予以退單，請交易人注意委託回報，管理自身委託狀況，以掌握該委託是否有被退單情形。
- 十六、配合中華民國期貨業商業同業公會自107年5月2日起修正辦理之相關事項：
- (一)自然人及一般法人從事選擇權賣方交易前其A、B值均加20%保證金。
 - (二)自然人及一般法人停用SPAN及保證金最佳化，新戶自5月2日起及既有客戶則於6月20日「一般交易時段收盤後」停用。
 - (三)每日執行壓力測試通知作業，若客戶風險指標過低者，將依客戶指定之高風險通知方式，於每個交易日開盤前提供風險預告通知服務。
- 十七、為強化對一般投資人防制洗錢及打擊資恐觀念之宣導，期貨公會業於網站首頁設立「洗錢防制專區」，其中宣導事項統合期貨公會洗錢防制及打擊資恐相關活動報導、媒體報導、政令宣導、宣導海報、宣導警語...等內容，詳如以下連結。
- ◎防制洗錢範本 http://www.futures.org.tw/down.asp?cat_id=13&class_id=34
 - ◎宣導事項 http://www.futures.org.tw/down.asp?cat_id=13&class_id=35
 - ◎相關連結 http://www.futures.org.tw/AML_CTF.asp
- 十八、配合依期貨商開戶徵信作業管理自律規則、中華民國期貨商業同業公會中期商字第1070001993號及1070002088號函規定，期貨商自107年8月1日起實施第二階段風險控管新制度，相關內容請參閱下方說明：
- (一)第二階段-107年8月1日實施
- 1.自然人、一般法人新開立帳戶，其使用保證金總額不得超過新台幣50萬元：

- (1)自 107 年 8 月 1 日起，自然人及一般法人開戶未提供符合本公司要求之徵信資料或財力證明者，其國內期貨帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之總額不得逾新台幣 50 萬元。
- (2)如欲放寬使用保證金總額，請洽詢您所屬之營業員並提供本公司要求之財力證明文件，經徵信人員評估符合放寬資格後，國內期貨帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之總額得逾新台幣 50 萬元(惟線上開戶者國內期貨帳戶之交易總額最高僅得放寬至新台幣 100 萬元。(本公司並保留調整額度權利)。
- 2.自然人、一般法人分類分級加收保證金比例限制調整:(敬請客戶務必留意帳戶風險指標，倘有保證金追繳及代沖銷情形，本公司依受託契約之約定辦理)
- (1)取消交易人得申請對所有契約均放寬加收保證金指標之規定，僅得依個別契約逐項申請。
- (2)自然人及一般法人依照本公司風險承受類型分類分級，超過期交所公告之交易人部位限制數者(一般(期/選)為 4%~5%一般(股票/股選)為 15~20%)，依規定加收保證金 20%。
- (3)申請放寬加收保證金指標須提供之財力證明額度，由按交易人種類計算之部位限制數，依該個別契約計算所需原始保證金之 30%調高為 200%。
- 3.自然人及一般法人「從事較不具流動性之商品加收保證金」:加收保證金之執行方式說明如下：
- (1)臺股指數期貨類近三個月份「以外」之契約加收原始保證金 20%。
- (2)除臺股指數期貨類契約，期貨商品近二個月份「以外」之契約，加收原始保證金 20%。
- (3)臺指選擇權履約價格為價外 500 點以上未滿 1000 點者，A、B 值均加收原始保證金 20%履約價格超過價外 1000 點者，A、B 值均加收原始保證金 50%。
- (4)第一階段對台指選擇權契約加收保證金，停止適用，惟其他選擇權契約仍依第一階段規定，繼續加收 A、B 值原始保證金 20%。
- 4.低於約定比率執行代沖銷作業規定
- (1)第一張委託單不得使用市價委託，均使用「一定範圍市價」委託。
- (2)第一張委託單倘無法成交應行詢價，並全程禁止使用漲跌停 ROD 委託單。
- (二)第二階段-107 年 10 月 1 日實施
- 1.自然人及一般法人既有帳戶，使用保證金總額不得超過新台幣 50 萬元
- (1)自然人及一般法人於 107 年 8 月 1 日前已開立之既有帳戶(以下稱既有帳戶)，自 107 年 10 月 1 日起，未提供符合本公司要求之徵信資料或財力證明者，其國內期貨帳戶委託中及未沖銷期貨、選擇權部位所需保證金之總額不得逾新台幣 50 萬元。
- (2)配合前項規定，本公司將於 107 年 9 月 28 日一般交易時段結帳後，依本公司調整既有帳戶交易人，開始適用本公司風險承受類型分類分級加收保證金比例調整規定(本公司保留調整額度權利)。
- 2.非 SPAN 帳戶風險指標加入垂直價差註記功能
- 交易人留倉部位中如有指定之垂直價差交易部位，風險指標計算加入垂直價差註記，且計算結果應依現行盤中風險控管之規定辦理。
- (分子) 權益數+未沖銷非垂直價差 B 方市值+未沖銷垂直價差 B 方市值-未沖銷非垂直價差 S 方市值+未沖銷垂直價差 S 方市值
-
- (分母) 原始保證金+未沖銷非垂直價差 B 方市值+未沖銷垂直價差 B 方市值-未沖銷非垂直價差 S 方市值+未沖銷垂直價差 S 方市值+應加收之保證金

注意：本回報訊息內容僅供投資人參考，正確內容仍以投資人實際交易情形為準!