

寶來曼氏期貨股份有限公司受託國內當日沖銷交易自律規則

正

- 一、本規則依據中華民國期貨業商業同業公會期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則訂定
- 二、本公司受託從事臺灣期貨交易所期貨契約當日沖銷交易之管理，除其他法令規章另有規定者外，將依本規則之規定辦理。
- 三、本公司受託從事臺灣期貨交易所期貨契約當日沖銷交易前，將先對期貨交易人審查資格條件。

交易人資格應具備下列條件：

- 1、開立期貨受託契約滿三個月。
- 2、最近一年內期貨契約交易成交十筆以上(不含選擇權)，其開立期貨受託契約未滿一年者亦同。

除期貨交易應有保證金外，最近一年之所得及各種財產計達所從事當日沖銷交易所需保證金額度之百分之三十，惟所從事當日沖銷交易所需保證金額度未逾新台幣五十萬元者不適用之。

- 四、本公司受託執行臺灣期貨交易所期貨契約當日沖銷交易委託時，將依臺灣期貨交易所公告之期貨契約當日沖銷交易保證金計收標準向期貨交易人收取足額保證金，始可接受委託進行交易。

- 五、當日沖銷交易委託單成交之後，本公司將依據臺灣期貨交易所公告之期貨契約當日沖銷交易保證金計收標準，依保證金帳戶權益對期貨交易人執行盤中風險控管，期貨交易人保證金帳戶權益低於所規定之維持率時，將對期貨交易人進行保證金追繳。

當日沖銷交易因市價變動，致使保證金數額低於本公司依整戶風險管理原則所訂一般非當日沖銷交易原始保證金之強制平倉比例(但比例不得低於 25%)，本公司得立即對期貨交易人之部位逕行沖銷。

- 六、本公司與期貨交易人除另有書面約定外，應於收盤前45至15分鐘期間，通知並要求期貨交易人自行完成當日沖銷交易部位之平倉。

本公司應於期貨交易收盤前25至15分鐘期間，產製相關檢核報表，對期貨交易人當日所有當日沖銷未平倉部位於該時點後，開始取消尚未成交之當日沖銷交易新增部位委託單及當日沖銷交易平倉委託單，並以市價單或合理之限價單(最近成交價至其以下5個價格跳動點內之平倉賣單或最近成交價至其以上5個價格跳動點內之平倉買單)等方式執行強制平倉，或以委託單改價功能，以市價單或合理之限價單執行強制平倉，但對於期貨交易人當日沖銷已為漲停買進或跌停賣出之平倉委託單並已限制無法撤銷者，得不受應於收盤前15分鐘執行取消改掛或委託單改價之限制，以降低因取消原平倉委託單改掛新平倉委託單，致輸入時序延後而無法成交之風險。

本公司進行強制平倉或取消委託之紀錄，均須留存備查，以供主管機關、臺灣期貨交易所及本會查核。

本公司應於收盤前對期貨交易人當日沖銷部位執行沖銷至全數了結為止。已依市價單或合理之限價單或前項漲停買進或跌停賣出之平倉委託單執行沖銷卻因市場發生流動性不足等不可抗力情形而未成交者，不在此限。

- 七、倘因前條第四項但書之情形，期貨交易人於收盤後仍留有當日沖銷未平倉部位餘額，本公司應於次一營業日，對該部位繼續執行沖銷至全數了結為止。但如有下列情形者，不在此限：

- 1、以一般非當日沖銷交易原始保證金標準計算之整戶維持率不低於100% 者。
 - 2、以一般非當日沖銷交易原始保證金標準計算之整戶維持率低於100% ，但當日沖銷交易留倉部位維持率不低於100% ，或於當日下午3點30分前補足至一般非當日沖銷交易之原始保證金數額者。
- 八、上述自律規則僅作為交易人開戶時，本公司善意通知有關臺灣期貨交易所期貨契約當日沖銷交易之管理規範，並為開戶契約之一部份，日後若有相關法令、規範之異動，一律以臺灣期貨交易所或相關主管機關公告為主。
- 九、若有交易人日後符合從事臺灣期貨交易所期貨契約當日沖銷交易資格時，敬請交易人親臨原開戶分點親簽「寶來曼氏期貨(股)公司國內當日沖銷交易風險預告同意書」並將由專人詳細解說國內當日沖銷交易風險預告與各項相關規定後，使得從事臺灣期貨交易所期貨契約當日沖銷交易。
- 十、本人已確實詳細閱讀上開規則，並經寶來曼氏期貨股份有限公司暨其期貨交易輔助人詳實說明相關權利義務。

此致

寶來曼氏期貨股份有限公司暨其期貨交易輔助人

交易人帳號：_____

姓 名：_____ (同印鑑卡樣式)

身分證字號：_____

主 管： 經 辦： (寶來曼氏)

主 管： 經 辦： (輔助人)