

國泰期貨股份有限公司

國內期貨當日沖銷交易風險預告同意書

本風險預告書是依據期貨交易法第六十五條第二項規定。本風險預告書並不適用所有期貨交易所之商品，其適用之商品由主管機關規定及臺灣期貨交易所(以下簡稱期交所)公告之。

期貨當日沖銷交易(以下簡稱當沖交易)具極低保證金之高度財務槓桿特性，在可能產生極大利潤的同時也可能產生極大的損失，台端在申請當日沖銷少收保證金前應詳讀並研析下列各項事宜：

- 一、為保護期貨交易者權益與健全期貨商業發展，依據「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」之規定，訂定本風險預告同意書。
- 二、台端了解期交所公告之期貨契約當沖交易保證金計收標準適用於一般交易時段，盤後交易時段不適用，並了解在進行當日沖銷期貨交易委託時，所繳交之保證金不得低於期交所公告之當日沖銷原始保證金數額。若因行情變動致使台端盤中之風險指標低於本公司與台端約定之比率(約定之比例不得低於 25%)時，本公司將依整戶風險控管原則開始執行代為沖銷作業程序，因而產生權益數為負數，台端仍須依法補足超額損失(over loss)金額。
- 三、台端當天所有當沖交易未沖銷部位，本公司將於一般交易時段收盤前 15 分鐘後，開始將尚未成交之當沖交易新增部位委託單取消，及將當沖交易平倉委託單取消或使用委託單改價功能，再以市價單、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)或一定範圍市價單等方式執行強制沖銷，權益數如為負數，台端須依法補足超額損失(over loss)之金額。為避免台端與本公司重複對當沖交易未沖銷部位執行沖銷損及台端的權益，台端於本公司規定之時點後請勿再對當沖交易未沖銷部位進行沖銷。
- 四、台端了解在進行當沖交易時，已依市價單、合理之限價單或一定範圍市價單執行沖銷卻因市場發生流動性不足或不可抗力因素而未成交者，除有下列情形者，本公司將於次一一般交易時段開盤後，對當沖交易部位執行沖銷直至部位全數了結，權益數如為負數，台端須依法補足超額損失(over loss)之金額。
 - (一)當日一般交易時段收盤後，帳戶權益數不低於以期交所公告之一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需原始保證金者。
 - (二)當日一般交易時段收盤後，帳戶權益數雖低於以期交所公告之一般交易保證金標準計算之未沖銷部位所需原始保證金，惟計算當沖交易未沖銷部位之權益數(即以期交所規定之當沖交易所需原始保證金加計其當日損益金額)，不低於一般交易所需原始保證金，或於當日下午 3 時 30 分前補足至一般交易所需之原始保證金數額者。
- 五、台端了解本公司有權決定是否接受台端當沖交易之委託申請。
- 六、盤中當沖交易與其他非當沖交易之未沖銷部位之整戶保證金計算方式依期交所之規定辦理。
- 七、本份風險預告書之預告事項甚為簡要，對所有期貨風險及影響市場行情之因素無法一一詳述，台端於交易前除須對本風險預告書詳加研析外，亦必須對其他可能影響之因素亦須慎思明辨，並確實做好財務規劃及風險評估，以免因交易而遭到無法承受之損失。台端並同意在本公司所為之當沖交易依本公司當日沖銷保證金之相關規定進行。

國泰期貨股份有限公司

國內期貨當日沖銷交易規則說明書

- 一、現行適用國內期貨當日沖銷交易(以下簡稱當沖交易)減收保證金之契約為臺灣期貨交易所股份有限公司(以下簡稱期交所)之臺灣證券交易所股價指數期貨契約(TX)、臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約(TE)、臺灣證券交易所金融類股價指數契約(TF)及臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約(MTX)等四種商品最近二個到期月份契約。
- 二、期貨契約當沖交易減收保證金作業，適用一般交易時段，盤後交易時段不適用。
- 三、當沖交易之原始保證金及維持保證金係以期交所公告之一般交易保證金金額減收 50%後，並取千元整數進位計算之，但本公司有權視期貨交易人(以下簡稱交易人)之財務狀況及市場風險隨時調整保證金。
- 四、依據中華民國期貨業商業同業公會(以下簡稱期貨公會)「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」規定，得進行當沖交易之交易人資格如下：
 - (一)開立期貨受託契約滿三個月。
 - (二)最近一年內期貨契約交易成交十筆以上，開立期貨受託契約未滿一年者亦同。
- 五、本公司部位沖銷原則、保證金計算、盤中高風險帳戶通知及代為沖銷作業方式：
 - (一)交易人進行平倉委託時，其沖銷原則為先將當沖交易按成交時間先後順序依序平倉(即先成交先平倉)，如仍不足，始將一般交易按成交時間先後順序依序平倉。
 - (二)交易人當沖交易之委託單成交後，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，將對該交易人發出盤中高風險帳戶通知；整戶風險指標依一般交易所需原始保證金計算後低於25%時，本公司將執行代為沖銷作業。
- 六、配合期交所當沖交易須於一般交易時段收盤前沖銷之規定，本公司作業方式如下：
 - (一)PM 1:00~PM 1:30 本公司得通知持有當沖交易留倉部位之客戶自行平倉。
 - (二)PM 1:30 以後(期貨契約到期日當天，依期交所規定之一般交易時段收盤時間前十五分鐘)，除交易人已為漲停買進或跌停賣出之平倉委託單並已限制為無法撤銷者，本公司將以市價、合理之限價單或一定範圍市價單將當沖交易留倉部位執行強制沖銷至全數了結為止，但因市場發生流動性不足或不可抗力因素而未成交者，不在此限。期貨交易人應自行查詢留倉部位，以避免發生重複委託之情形，損及個人權益。
 - (三)前款因市場發生流動性不足或不可抗力因素而未成交，當日一般交易時段收盤後以期交所對一般交易計算原始保證金及維持保證金，執行保證金追繳及沖銷等作業。
- 七、本說明書之內容如因主管機關、期交所、期貨公會公布之法令或本公司之作業規定有所變動，本公司將另行以書面或於網站公告等方式通知交易人。

本人(委任人) 已符合「期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則」規定得進行當日沖銷交易之期貨交易人之資格，並經國泰期貨股份有限公司或其期貨交易輔助人指派_____解說，對於上述「國內期貨當日沖銷交易風險預告同意書」及「國內期貨當日沖銷交易規則說明書」所記載內容已完全明瞭，並承認期貨交易風險應由本人自行負責，特此聲明。

此 致

國泰期貨股份有限公司及期貨交易輔助人_____證券(股)公司_____分公司

期貨交易人：_____ (原留印鑑)

法人戶代表人：_____ (簽章)

期貨帳號：_____

身份證字號/營利事業統一編號：_____

中 華 民 國 _____ 年 _____ 月 _____ 日

(IB)經辦	(IB)主管	期貨建檔	期貨覆核