

親愛的顧客 您好：

非常感謝您對玉山證券的愛護與支持，謹致上最深的感激之忱！！！！
謹通知依中華民國期貨業商業同業公會中期商字第 1110003338 號函公告有關修正期貨商受託國內當日沖銷交易自律規則，於申請期貨當沖資格條件中，刪除當沖保證金額度逾 50 萬元者之相關資力證明提供，故本公司自 111 年 8 月 22 日(一)起實施。另將有效既有戶之當沖額度調為依顧客所屬之交易額度作為買賣額度之控管依據。

若顧客有申請當沖交易額度之需求或洽詢事項，歡迎致電本公司所屬營業員，我們將竭誠為您服務。

敬祝
投資順利

玉山證券 敬上

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

中華民國98年5月18日中華民國期貨業商業同業公會第2屆理監事第11次聯席會通過
中華民國98年9月7日行政院金融監督管理委員會金管證期字第09600533621號函洽悉
中華民國99年2月27日中華民國期貨業商業同業公會第2屆理監事第16次聯席會通過
中華民國99年5月27日行政院金融監督管理委員會金管證期字第0990020764號函洽悉
中華民國101年12月14日中華民國期貨業商業同業公會第3屆理監事第15次聯席會通過
中華民國102年2月8日行政院金融監督管理委員會金管證期字第1010059440號函准予備查
中華民國103年2月25日中華民國期貨業商業同業公會第4屆理監事第5次聯席會通過
中華民國103年3月19日金融監督管理委員會金管證期字第1030008034號函准予備查
中華民國104年7月1日金融監督管理委員會金管證期字第1040021361號函准予備查
中華民國106年2月17日中華民國期貨業商業同業公會第5屆理監事第4次聯席會通過
中華民國106年3月14日金融監督管理委員會金管證期字第1060006341號函准予備查
中華民國111年6月10日中華民國期貨業商業同業公會第6屆理監事第18次聯席會通過
中華民國111年7月18日金融監督管理委員會金管證期字第1110347330號函准予備查

條次	條文內容
第一條	本規則依據期貨業商業同業公會管理規則第五條規定訂定之。
第二條	本公會會員受託從事臺灣期貨交易所(以下簡稱期交所)期貨契約當日沖銷交易(以下簡稱當沖交易)之管理,除其他法令規章另有規定者外,應依本規則之規定辦理。
第三條	本公會會員受託從事期交所當沖交易前,應對期貨交易人(以下簡稱交易人)審查其資格條件,交易人應具備之資格條件如下: 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。
第四條	本公會會員受託從事當沖交易前,應先對交易人說明與預告當沖交易之各項權利義務、交易規則及相關風險,並應製作當日沖銷風險預告書(範本詳參

	附件1)，提供交易人簽名或蓋章，並加註日期存執。 交易人得使用憑證機構所簽發之電子簽章或自行以書面方式簽署國內當日沖銷交易風險預告同意書。惟對已填具委任授權書之交易人，本公會會員得依據公司管理政策，審慎評估後，自行決定開放或禁止其使用電子簽章辦理，如採開放政策，應於公司內部控制制度訂定適當之控管機制及查核程序。 本公會會員接受交易人以線上申請當沖交易，應於網頁提供含當沖交易之各項權利義務、交易規則及相關風險之當日沖銷風險預告書予交易人審閱，其簽署程序如下： 一、當日沖銷風險預告書之內容需逐條（段）勾選。 二、點選進入當日沖銷風險預告書內容後至同意簽署確認前，其畫面停留之時間以可以適當閱讀該當日沖銷風險預告書之完整內容為依據。 三、交易人確認以電子簽章簽署後，本公會會員可以電子郵件、網址、簡訊等方式傳送當日沖銷風險預告書副本予交易人，交易人應以同方式確認回傳後始生效。
第五條	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。 本公會會員受託從事當沖交易時，應依期交所公告之當沖交易保證金計收標準向交易人收足保證金，始得接受交易人之委託。
第六條	本公會會員應於一般交易時段當沖交易之委託成交後，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，應對該交易人發出高風險帳戶通知。 本公會會員於一般交易時段另應依整戶風險管理原則，以一般交易所需原始保證金計算交易人帳戶風險指標，當風險指標低於約定之比率時，應開始執行代為沖銷作業程序。
第七條	本公會會員除與交易人另有書面約定者外，應於一般交易時段收盤前15至45分鐘期間，通知交易人將當沖交易之未沖銷部位自行沖銷。 本公會會員另應於一般交易時段收盤前15分鐘產製檢核報表，對交易人當沖交易之未沖銷部位於該時點後，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）或一定範圍市價單等方式執行

	代為沖銷，但交易人之當沖部位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，不在此限。 本公會會員執行代為沖銷、取消委託、委託單改價之紀錄，均須留存備查，供主管機關、期交所及本公會查核。 本公會會員應於一般交易時段收盤前，對交易人之當沖部位執行代為沖銷至全數了結為止，但已依市價單、合理之限價單、一定範圍市價單或本條第二項所訂之漲停買進或跌停賣出之平倉委託單執行沖銷作業，卻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。
第八條	因前條第四項但書之情形，致交易人於當日一般交易時段收盤後尚有當沖交易之未沖銷部位，本公會會員應於次一一般交易時段對該部位繼續執行沖銷作業至全數了結為止，但有下列情形者，不在此限： 一、當日一般交易時段收盤後，交易人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，交易人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，惟計算當日沖銷交易未沖銷部位之權益數（即以期交所規定之當日沖銷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。
第九條	本規則經理監事聯席會議通過並陳報日的事業主管機關備查後公告施行，修正時亦同。

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

第三條條文修正對照表

修正後條文	原條文	說明
第三條 本公會會員受託從事期貨交易所當沖交易前，應對期貨交易人(以下簡稱交易人)審查其資格條件，交易人應具備之資格條件如下： 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。	第三條 本公會會員受託從事期貨交易所當沖交易前，應對期貨交易人(以下簡稱交易人)審查其資格條件，交易人應具備之資格條件如下： 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。 <u>三、除未沖銷部位所需保證金外，另應提供最近一年之財力證明，其價值總金額應不低於從事當日沖銷交易所需保證金額度之百分之三十，但申請適用於當沖交易之所需保證金額度未逾新台幣五十萬元者，不適用本款之規定。</u>	現行「期貨商開戶徵信作業管理及提供高齡客戶金融服務自律規則規」有關交易額度之核給已包含當沖交易部位，及為提升便利性與簡化業者行政作業成本，爰予以刪除。