

國內期貨契約當日沖銷交易作業

一、適用當日沖銷交易之期貨契約：

臺指期貨(TX)、電子期貨(TE)、金融期貨(TF)與小型台指期貨(MTX)等4種商品之最近2個到期月份契約。

二、適用當日沖銷交易之時段：

一般交易時段。

三、當日沖銷交易之保證金減收：

交易人應依臺灣期貨交易所(下稱「期交所」)公告之當沖交易保證金數額(現行為一般交易之原始保證金50%，並取千元整數進位)為基準，繳交不低於上開數額之保證金。

四、當日沖銷交易之高風險帳戶通知：

本公司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。

五、當日沖銷交易之代為沖銷：

(一)「帳戶風險指標低於約定比率」之代為沖銷：

本公司於一般交易時段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25%時，應開始執行代為沖銷作業程序。

(二)「屆當日沖銷交易平倉時限仍有當沖交易之未沖銷部位」之代為沖銷：

本公司於一般交易時段收盤前15分鐘(即一般契約為13:30，到期契約為13:15)開始對當沖交易之未沖銷部位執行代為沖銷作業程序。

1、當沖交易之未沖銷部位應於當日一般交易時段收盤(即一般契約為13:45，到期契約為13:30)前15分鐘之前(即一般契約為13:30之前，到期契約為13:15之前)自行沖銷完畢，且依交易人所簽署之「國內當日沖銷風險預告暨同意書」第三條之約定，本公司不負通知義務。

2、本公司於一般交易時段收盤前15分鐘(即一般契約為13:30，到期契約為13:15)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。

3、本公司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、一定範圍市價單或前開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，仍應依循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」第八條處理之。