

公 告

主 旨：調整國外期貨盤後交易(以下簡稱 T+1 盤)帳務，認列於次一營業日

說 明：

- 一、為使本公司交易結算作業與國外交易所制度一致，將調整國外期貨盤後交易(以下簡稱 T+1 盤)帳務，認列於次一營業日。
- 二、生效日：106 年 7 月 1 日。
- 三、因應交易所 T+1 盤交易帳務日調整，異動作業如下：

| 項目 | 修正後 | 修正前 |
|---|----------------------------------|-----------------|
| 開戶-手續費變更 | 結算時，追溯至前一營業日 T+1 盤成交部位 | 結算時，追溯至當日所有成交部位 |
| 風控-T+1 盤當沖代沖銷 | T 日及 T+1 收盤前分別處理 | T+1 收盤前處理 |
| 風控-盤後保證金追繳 例一：1/20 留倉一口 STW，原始保證金 USD1,000，權益數為 USD500 風險比例 50%，客戶於 T+1 盤平倉，客戶盤中無部位，無追繳金額。 | 客戶產生追繳，追繳金額 USD500 | 無追繳情事 |
| 例二：1/20 留倉一口 STW，原始保證金 USD1,000，權益數為 USD500 風險比例 50%，客戶於 T+1 盤平倉，再買入一口玉米原始保證金 USD500，權益數為 USD500 風險比例 100%，客戶盤中無追繳金額。 | 客戶產生追繳，追繳金額 USD1,000 | 無追繳情事 |
| 結算-買賣報告書 | 不計當日 T+1 資料 | 計入當日 T+1 資料 |
| 結算-指定平倉作業 | <u>T+1 盤時段不受理 T+1 盤之部位指定平倉作業</u> | 依客戶指示進行指定平倉作業 |

四、特別說明事項

(一) 結算作業

1. 若客戶 T+1 盤平倉釋放保證金後，申請出金、互轉作業或轉交易其他 T 盤商品，因國外財務為即時入帳且日結時會將 T+1 盤調整為次一營業日之交易，T 日買賣報告書可能會呈現超額出金或下單之情形。
2. 追繳次數計算及計扣息作業
 - (1) 連續 3 日追繳扣息。
 - (2) 計扣息金額將依日結後產生之 T 日買賣報告書所載明之「可動用保證金」辦理計扣息。
3. 例行性換匯：依日結後產生之 T 日買賣報告書所載明之「帳戶財務摘要」辦理換匯作業。
4. 國外出金及外轉內扣帳時點：同現行作業標準，國外帳列 T 日。

(二) 風控作業

1. 盤中高風險通知及代沖銷作業：同現行作業標準，即時洗價並進行通知及代沖銷處理。
2. 盤後保證金追繳作業
 - (1) 於執行日結後產生之帳務，倘有追繳情事，依規定發追繳通知予客戶。
 - (2) 追繳金額之認定：依日結後產生之 T 日買賣報告書所載明之「追繳保證金」為當日追繳金額。
3. 權益數或權益總值為負數之申報作業：若盤後保證金追繳發生客戶權益數或權益總值為負數但於 T+1 盤回復為正數之情況，仍需依 T 日買賣報告書所載之權益數或權益總值申報期交所。