

發行人：糜以雍
總編輯：盧廷劼
創刊日：中華民國 91 年 11 月 5 日
出版日：中華民國 107 年 2 月 5 日
發行所：中華民國期貨業商業同業公會
發行地：台北市大安區安和路一段27號12樓
電話：(02)87737303
傳真：(02)27728378
網址：http://www.futures.org.tw
(中華郵政台北誌字第794號執照登記為雜誌交寄)

報

國內
郵資已付

台北郵局許可證
台北字第3324號
台北誌字 794 號

第 184 期

107年2月號



期貨公會會訊

焦點報導

歲末聯歡迎春 旺旺來福效豐年



左起：期貨公會理事長糜以雍、金管會主任委員顧立雄、期交所董事長劉連煜

本公會歲末聯歡晚會於107年1月31日晚間假國賓大飯店2樓國際廳舉行，席間除本公會理監事、各委員會委員外，蒞臨貴賓尚有金管會顧主任委員立雄、鄭副主任委員貞茂、證期局王局長詠心及多位週邊董總，大家齊聚一堂，揮別昂首雞年、迎接旺旺狗年，共祝期貨市場蓬勃發展，更上層樓。

2017是臺灣期貨市場亮麗的一年，臺灣期貨市場交易量破歷史新高來到2.65億口，整體期貨商稅前損益也成長至37.18億。糜理事長特別感謝主管機關的支持、業者的努力，尤其是期交所為滿足投資人需求，不斷推陳出新，每一步都是突破、突破、再突破，領導臺灣期貨市場更加多元與

國際化。

金管會於1月22日發布解釋令，同意本公會透過金總白皮書之建言，放寬保險業投資期貨基金及指數股票型期貨基金的投資限額，未來保險業投資單一檔期貨基金或期貨ETF基金，可達其發行受益憑證規模的10%，期貨業再添利多。

展望來年，期盼在主管機關的指導下，期交所、業者與期貨公會繼續攜手共同努力，擴大期貨市場交易規模與國際能見度，也祝福期貨市場能延續近年的動能，期貨業的業績及獲利能更創高峰。

(蕭謙信)

臺灣期交所-選擇權隱含波動率指數之運用

臺指選擇權波動率指數 (VIX, Volatility Index) 是臺灣期交所參考美國芝加哥選擇權交易所 (CBOE) 於2003年編制VIX指數方法, 所編制的臺灣選擇權波動率指數。現行VIX指數是對未來30天臺指期指數標準差的風險中性期望, 以年化標準差表示。例如, 假設VIX指數為15, 表示未來30天預期的年化波動率為15%, 因此可以推斷指數期權市場預期未來30天臺指期指數向上或向下波動 $15\% / \sqrt{12} = 4.33\%$ 。也就是, 指數期權的定價假設是: 臺指期指數未來30天的波動率在正負4.33%以內的機率為68%。

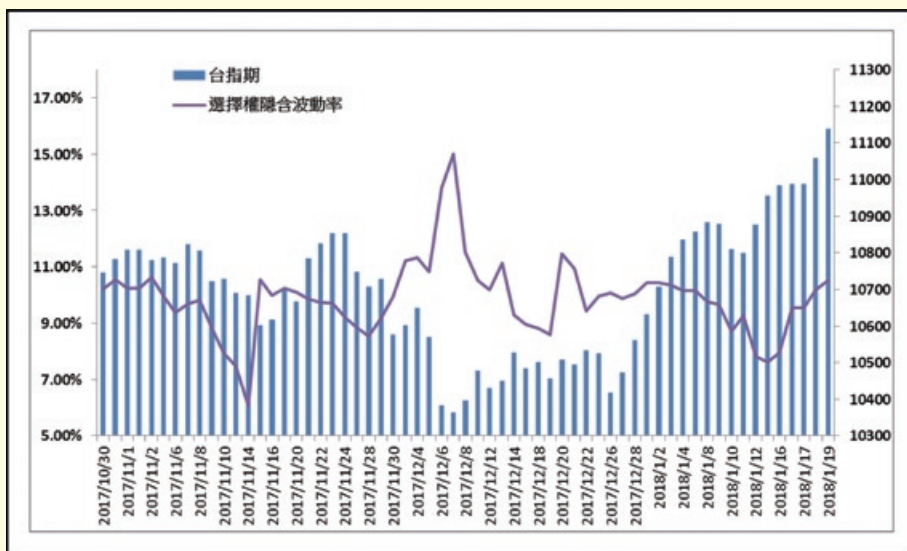
VIX常被用來作為判斷市場多空的逆勢指標, 該指標反映了市場參與者對於後市的看法: VIX上升, 反映市場參與者預期後市的價格波動程度將會更加激烈, 也同時反映其心理不安的狀況當VIX下跌, 反映市場參與者預期後市的價格波動應會趨於和緩, 而對市場的波動失去警戒心, 也因此VIX又被稱為投資人的恐慌指標 (The Investor Fear Gauge)。

在應用上, 一般而言, 在行情下跌時, VIX會上升, 行

情上漲時, VIX 會下跌。但當VIX異常偏高時, 可能代表市場的參與者陷入極度恐慌而不計代價的買進賣權, 當VIX異常偏低時, 可能透露市場的參與者過度樂觀, 一味看多的心態。而這些現象往往都可能是行情反轉到來的時刻: 當市場情緒過度悲觀恐懼的時候, 往往伴隨而來的是行情的大反彈。當市場過度樂觀的時候, 往往伴隨而來的是行情的大回檔。投資人若想觀察VIX值變化, 可以到臺灣期交所網站統計資料項下查詢。

近兩個月隱含波動度始終維持在8-12%震盪 (如圖), 幅度並不大, 期間除了12月初臺股電子表現弱勢, 使隱含波動度一度飆高接近15%, 一時間造成投資人恐慌情緒蔓延, 不過爾後臺股破底翻, 至今 (截至1/22) 大漲近800點, 投資人明顯由悲觀轉為樂觀, 造成隱含波動度一路下滑。但有趣的是近一周臺股不斷創高而隱含波動度卻一反常態, 與指數呈現同向走勢, 此種現象相當少見, 顯然目前驚驚漲的格局讓多空交易者同樣戒慎恐懼, 這種走鋼絲行情能維持多久呢? 這沒有辦法從隱含波動度中發現, 不過, 它卻告訴我們未來的行情波動將會持續放大。

(凱基期貨 期貨分析師 陳双吉)



好康抢鲜報

本公會107年2月份在職訓練開班表

班別	開課地區	班數
初階	台北 (2/9-2/11)。	1
進階(三)	台北 (2/23-2/24)、高雄 (2/2-2/3)。	2
進階(四)	台北 (2/5-2/7)。	1
進階(五)	高雄 (2/24)。	1
資深班	台北 (2/3、2/5-2/6、2/22-2/23、2/26-2/27)、桃園 (2/8-2/9)、台中 (2/10)、台南 (2/3、2/24)、高雄 (2/10)。	9
期貨顧問	台北 (2/12-2/13)、高雄 (2/3)。	2
合 計		16

課程相關訊息, 請洽本公會推廣訓練組華先生(#865) / 許小姐(#860), 或上本公會官網查詢。

政令宣導

洗錢防制 刻不容緩

為持續宣導政府防制洗錢工作，洗錢防制辦公室為因應今年亞太洗錢防制組織相互評鑑，持續執行全國性防制洗錢宣導工作，目前已完成相關問答集、多項宣導海報及短片，如「洗錢防制層層把關」、「洗錢防制為哪樁」、「為何你的朋友都是檢察官」、「洗錢防制看守你我荷包」4款資訊圖表等，期以達到全面宣導防制洗錢工作之目的，使全民更加瞭解政府推動洗錢防制，保護國人財產安全之決心，以有效遏止不法洗錢活動之發生。

相關訊息請至行政院洗錢防制辦公室網站查詢（<http://www.amlo.moj.gov.tw>）。



懲處案例報導

違規類型：違反期貨商管理規則第2條第2項：「期貨商業務之經營，應依法令、章程及期貨商內部控制制度為之」；期貨商管理規則第43條第1項：「期貨商除本會另有規定者外，應依各期貨交易所規定之保證金或權利金數額先向期貨交易者收足，始得接受期貨交易之委託。」。

○○期貨公司○○分公司於106年○○月間辦理交易者選擇權市價委託之保證金檢核，有發生交易者帳戶不足支付所需權利金之情事，與該公司內部控制制度CA-21210「受

託買賣及成交作業」所訂「…本公司接受交易者市價委託，應依交易者信用狀況（包括保證金、權益數等金額）、交易性質、委託數量、當時市況及交易者部位最大可能損失等因素，評估市價委託之風險並採取必要措施，例如對交易者採取加收保證金、限制委託數量或停止接受委託等控管措施。」規定不符，有違反期貨商管理規則第2條第2項及第43條第1項規定。

主管機關依期貨交易法第119條第1項第2款規定，對該公司處新臺幣12萬元罰鍰。

（杜月明）

動態價格穩定措施107年1月22日上路

為降低因錯誤下單、胖手指及盤中交易流動性瞬間失衡造成價格異常波動之風險，除了行之有年的「一定範圍市價委託」之外，臺灣期貨交易所於107年1月22日推出「動態價格穩定措施」，依照每筆委託進入交易所時的價格進行動態判斷，將可能會造成市場價格瞬間異常波動的委託進行退單；該措施初期的適用商品僅為臺股期貨及小型臺指期貨，適用的契約月份則是最近交割月份以及次近交割月份。

適用商品	適用月份	退單點數計算公式
臺股期貨 小型臺指期貨	最近、次近交割月份	前一交易日的加權指數收盤價×2%

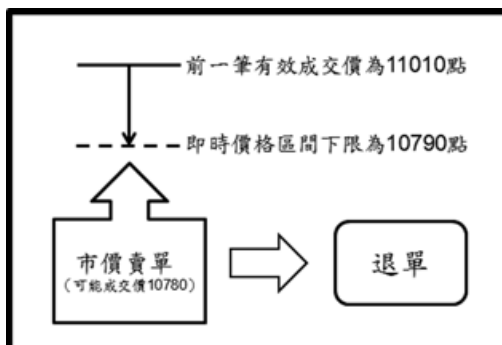
舉以一實例說明：假設前一交易日加權股價指數收盤價為11,000點，計算即時價格區間之前臺股期貨最近一筆有效成交價為11,010點，則即時價格區間上、下限分別為11,230點（11,010+（11,000×2%））及10,790點（11,010-

期交所也規劃出「即時價格區間」，並對每一新進委託試算其可能的成交價格，若買進委託的可能成交價格高於即時價格區間上限，或賣出委託的可能成交價格低於即時價格區間下限，就會進行退單。

- 即時價格區間上限=基準價+退單點數
 - 即時價格區間下限=基準價-退單點數
- 基準價原則上就是前一筆有效成交價。
退單點數=前一交易日的加權指數收盤價×2%

（11,000×2%））若以市價委託賣出1口，此時期交所的委託簿如下，該筆委託可能成交價格為10,780點，低於下限10,790點，則該筆委託將被退單。

買進	委託價	賣出
	11014	8
	11013	9
	11012	12
	11011	15
	11010	18
1	10780	
3	10779	
5	10778	
6	10777	
11	10776	



臺灣期貨交易所「動態價格穩定機制」與「一定範圍市價委託」二項措施均係為降低市場發生不合理價格風險所

定，以下就二項制度的差異比較提供讀者參考。

項目	動態價格穩定機制	一定範圍市價委託
實施日期	107/01/22	103/05/12
目的	防範錯誤交易、胖手指或盤中委託簿流動性瞬間失衡等事件發生，減緩價格異常波動保護交易人。	降低交易人下「市價委託」時，可能因契約流動性較為不足或市場買賣委託量瞬間失衡，而產生成交價格大幅偏離原預期價格之情況。
作法	規範「即時價格區間」，對每一新進委託試算其可能的成交價格，若買進委託的可能成交價格高於即時價格區間上限，或賣出委託的可能成交價格低於即時價格區間下限，就會進行退單。	系統接收「一定範圍市價委託」後，依當時市場上相同買賣方向之最佳限價申報價格為基準價，買單以基準價加上「一定點數」、賣單以基準價減去「一定點數」後，轉換成限價委託，再進行撮合。
成交範圍限制	退單點數=前一交易日的加權指數收盤價×2%	一定點數=前一交易日加權指數收盤價×0.5%

（康和期貨副總經理王文浩）

國際期市動態

印度證監會可能要求交易所減收主機共置費用

印度證監會（The Securities and Exchange Board of India, SEBI）試圖讓規模大小不同之經紀商均有公平競爭環境，計畫直接要求證券交易所降低向經紀商收取主機共置（co-location）之費用，同時允許至少5家經紀商共享機櫃，主要目的為提供所有經紀商（包括小型經紀商）皆可使用演算法（algorithmic）進行交易之環境。

目前證券交易所未開放經紀商間能夠共享機櫃，孟買證券交易所（Bombay Stock Exchange, BSE）免費提供使用一些基本主機共置設備；另外，印度國家證券交易所（National Stock Exchange of India, NSE）單一機櫃之年租金收入約為350萬-400萬盧比間，由於昂貴之固定費用，僅有大型經紀商有足夠能力提供演算交易法予他們的客戶。

（沈素吟整理）

修正本公會「期貨經理事業經營全權委託期貨交易業務操作辦法」、「期貨交易全權委任契約範本」及「保管機構委任契約範本」

配合金融監督管理委員會106年12月6日（金管法字第10600555450號函令）發布，依「金融消費者保護法」於第4條第1項但書第2款規定符合一定財力或專業能力之自然人或法人排除適用金融消費者保護法之精神，爰修訂本公會「期貨經理事業經營全權委託期貨交易業務操作辦法」，故配合就期貨經理事業辦理全權委託投資業務，將「委任人」區分「專業客戶」及「非專業客戶」，專業客戶應符合之條件，應由期經公司盡合理調查之責任，並向客戶取得合理可信之佐證依據，客戶須配合提供之。期經公司對「專業客戶」具備充分金融商品專業知識、交易經驗之評估方式，應納入瞭解專業客戶作業程序，並報經董事會通過。

由於期貨經理事業為委託人資產配置時，亦有搭配買賣國外有價證券投資之需求，而期經公司如以委任人名義買賣國外有價證券時須於國外再尋找次保管機構，徒增委任人買賣成本，因此本公會參酌證券全委之規定，修正本公會「期貨經理事業經營全權委託期貨交易業務操作辦法」、「期貨交易全權委任契約範本」及「保管機構委任契約範本」，新

增期貨經理事業得委託國內證券商買賣外國有價證券，由保管機構代理簽訂開戶暨受託買賣契約及開立投資買賣帳戶，並依證券商受託買賣外國有價證券管理規則及其相關規定辦理。

另為落實節能減碳及推動期貨經理事業無紙化作業，爰將現行本公會「期貨經理事業經營全權委託期貨交易業務操作辦法」第25條有關「委任契約」、第32條「交易決定書」及第37條全權委託交易帳戶「會計制度」（如：會計科目、會計憑證、會計簿籍、會計報表、交易決策及款項收付）之保存方式，增定「其保存方式得以電子媒體形式為之」文字。

本公會修正後之「期貨經理事業經營全權委託期貨交易業務操作辦法」、「期貨交易全權委任契約範本」、「保管機構委任契約範本」、「修正總說明」及「修正對照表」請於本公會網站（http://www.futures.org.tw/q_law_4personal.asp）下載閱覽。
（湯志彬）

修正「期貨信託事業內部控制制度標準規範」

依金融消費者保護法第4條第1項但書第2款規定符合一定財力或專業能力之自然人或法人排除適用金融消費者保護法之精神，並配合主管機關依金融消費者保護法第4條第2項規定發布106年12月6日金管法字第1060055450號令第2點規定，訂定專業投資機構之定義，復參考境外結構型商品管理規則第三條規定，訂定專業投資人之自然人、法人或基金應具備之資格條件，且期貨信託事業須進行調查程序，並向

投資人取得合理可信之佐證依據，以及除專業投資機構外，針對其他專業投資人是否具備充分金融商品專業知識、交易經驗之評估方式，應納入瞭解專業投資人作業程序，並報經董事會通過等相關規範。另參考同規則第22條第1項第1款第2目規定，增列除專業投資機構外，其他專業投資人得變更為非專業投資人。

（郭仙娟）

修正「期貨顧問事業於傳播媒體從事營業活動自行審核與申報作業程序」附表格式

本次修訂「期貨顧問事業於傳播媒體從事營業活動自行審核與申報作業程序」（以下簡稱作業程序）附表「自行審核執行登記簿」與「審核檢討報告」格式。重點如次：

依前述作業程序規定，期貨顧問事業於傳播媒體節目從事期貨分析活動、對委任人以外之不特定人舉辦講習、座談會或說明會等活動，應指定「專責主管人員」審查督導活動之進行，以確保其內容無違反法令、公會自律規範及其他不當之情事。並應將各節目及活動依序登記於自行審核執行登

記簿，並由「專責主管人員」依據節目及活動內容確實檢視檢聽後，逐案作成審核檢討報告，遇臨時性受訪應向「專責主管人員」報備，並於事後補登。綜上所述，顯見實際負責審查節目及活動內容係期貨顧問事業之「專責主管人員」。故參酌證券投顧業之現行作法，刪除作業程序第三點之附表一「自行審核執行登記簿」與附表二「審核檢討報告」之「董事長或總經理：」簽核欄位，以使權責相符，並簡化行政作業程序。
（游大慶）

106年度7月至12月規章異動彙整

- ◆ 鑒於近5年臺指期貨平均日內振幅皆未超過100點，且平均日內振幅小於100點之年度天數高達202天，為使臺指選擇權之履約價格間距貼近臺股波動水準，並滿足市場交易需求，期交所修正「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約交易規則」第10條及其規格。（期交所106年7月18日台期交字第10600021140號函）
- ◆ 主管機關放寬期貨商營業範圍，依期貨商管理規則第38條第1項第4款規定，經許可之本國期貨商具有國外期貨

交易所交易會員資格並取得期貨結算機構之結算會員為其辦理結算交割之證明者，得接受其他期貨商委託從事國外期貨交易。（金管會106年7月27日金管證期字第1060023566號函令）

- ◆ 期交所考量我國期貨市場規模及處理違約事件之時效性，修訂「業務規則」第105條及「結算會員違約之分擔比例及處理程序」第2條，訂定我國期貨市場遇單一及多家結算會員違約時，其他結算會員之分擔限額。

(期交所106年8月21日台期結字第10600025280號函)

- ◆ 主管機關茲配合我國將於107年適用國際財務報導準則第9號「金融工具」及國際財務報導準則第15號「客戶合約之收入」等公報規定及檢討現行規定以提升財務報告透明度與維持適度監理，於9月修正「期貨商財務報告編製準則」部分條文並發布期貨商財務報告表格名稱及書表格式，並於12月修正「期貨商調整後淨資本額(ANC)計算方式、計算表及相關附註投資有價證券及貨幣市場工具」及「證券自營業務部位」計入調整後淨資本額計算表之項目，應以「強制透過損益按公允價值衡量之金融資產為限」。(金管會106年9月14日金管證券字第1060032840號及第10600328406號函令、106年12月8日金管證期字第1060047340號函令)
- ◆ 為簡化期貨商閒置資產出租作業之申報程序，期貨公會訂定「期貨商閒置資產出租注意事項」有關期貨商閒置資產出租範圍、年限、出租閒置資產時及租約變更或期滿續約時，應檢附之文件及申報作業程序等規範，並修訂「會員營業處所場地及設備標準」中「出租閒置資產」之適用對象。(期貨公會106年9月20日中期商字第1060004359號函)
- ◆ 為防止陸資透過外資帳戶來台投資，並提醒華僑及外國人投資我國有價證券或從事國內期貨交易應遵守相關法規，避免因誤解或不熟悉而違反規定，期交所修正「華僑及外國人與大陸地區投資人申請投資國內有價證券或從事國內期貨交易登記作業要點」部分申請登記表。(期交所106年9月22日台期結字第10600028880號函)
- ◆ 主管機關為使各服務事業重視其防制洗錢及打擊資恐、重大事件之處理及通報，以及檢查報告之處理等機制，並強化其法令遵循單位職能，爰修正「證券暨期貨市場各服務事業建立內部控制制度處理準則」。(金管會106年9月30日金管證審字第1060035864號函令)
- ◆ 期交所修正「期貨商內部控制制度標準規範」制度、內部稽核實施細則及內部稽核查核明細表相關作業規範，有關「國際合作商品相關作業」，明訂公司經營國際合作商品相關者，於接受委託之期貨商辦理開戶時，應按其經紀或自營交易簽訂受託契約，並分別設置保證金專戶。(期交所106年10月5日台期輔字第10600030090號函)
- ◆ 配合歐臺期及歐臺選授權合約之終止，期交所修正刪除原「結算服務費收費標準」第11條，暨廢止「期貨商辦理臺灣期貨交易所授權歐洲期貨交易所上市臺股期貨及臺指選擇權之一天期貨契約應行注意事項」。(期交所106年10月27日台期交字第10602015980號函)
- ◆ 配合臺灣期貨交易所之歐臺期及歐臺選商品於106年11月15日停止交易，期貨公會相關規範，如：預收保證金收取標準等風險控管措施、各公司應辦理事項同時停止適用。(期貨公會106年10月31日中期商字第1060004991號函)
- ◆ 期交所修正「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第3點及「期貨商代交易人辦理其交易臺灣期貨交易所外幣計價期貨交易契約之結匯說明」，有關境外外資得以期交所公告之外幣繳交人民幣計價商品原始保證

金，另成交買進人民幣計價選擇權所需支付之權利金，仍由境外外資以自有人民幣繳交，惟於委託買進時，得先以其他幣別繳存約當保證金，俟部位成交後，再由境外外資自結人民幣繳交。(期交所106年11月7日台期交字第10603009580號函)

- ◆ 期貨公會修正「期貨商暨槓桿交易商防制洗錢及打擊資恐注意事項範本」及其附件「期貨商暨槓桿交易商評估洗錢及資恐風險及訂定相關防制計畫指引」、附錄「期貨商暨槓桿交易商疑似洗錢或資恐交易態樣」。(期貨公會106年11月16日中期商字第1060005194號函)
 - ◆ 期貨公會修正「期貨信託事業暨期貨經理事業防制洗錢及打擊資恐注意事項範本」及其附件「期貨信託事業暨期貨經理事業評估洗錢及資恐風險及訂定相關防制計畫指引」、附錄「疑似洗錢或資恐交易態樣」。(期貨公會106年11月16日中期商字第1060005283號函)
 - ◆ 為推動無障礙環境提供身心障礙朋友更友善之服務，以保障身心障礙朋友使用金融服務之權益，期貨公會修正「期貨商開戶徵信作業管理自律規則」及「會員金融友善服務準則」，增訂對視障者辦理開戶或簽約作業時之規範。(期貨公會106年11月16日中期商字第106000517321、106000517322號函)
 - ◆ 主管機關放寬期貨商營業範圍，公告證券商、證券投資信託事業、證券投資顧問事業、期貨商、期貨服務事業、槓桿交易商及其他經本會核准之機構，在符合金管會法令規定得從事國外期貨交易相關規範下，期貨商得接受其委託從事經當地主管機關核准設立之國外期貨交易所期貨交易契約；期貨商得接受上述以外交易人委託從事國外期貨交易之交易所及種類如金管會公告，並應以臺灣期貨交易所公告之期貨交易契約為限。(金管會106年11月27日金管證期字第1060039078號函令)
 - ◆ 期交所為建置動態價格穩定措施，修正「業務規則」部分條文、增訂「動態價格穩定措施作業辦法」暨期貨商應辦理事項，及相關規範，以強化臺灣期貨市場價格穩定功能。(期交所106年11月29日台期交字第10602018050、106年12月6日台期交字第10602018360號函)
 - ◆ 主管機關為簡化期貨業提存營業保證金之作業，整併現行有關期貨業繳存設置保證金、營業保證金及開設客戶保證金專戶之保管機構應符合條件之相關規定，修正期貨商設置標準、期貨商管理規則、槓桿交易商管理規則、證券商經營期貨交易輔助業務管理規則、期貨顧問事業管理規則、期貨經理事業設置標準及期貨經理事業管理規則、期貨信託事業設置標準及期貨信託事業管理規則之相關規定。(金管會106年12月8日金管證期字第1060047163號函令)
 - ◆ 期交所為便利委託人辦理新增或約定存款帳戶變更，修訂「業務規則」第46條及「期貨經紀商受理期貨交易人存入保證金、權利金應行注意事項」第4點；為簡化結算會員申報作業，修訂「業務規則」第14條、「結算會員申請程序」第3條、第9條及「結算會員更換結算銀行作業應行注意事項」第1點。(期交所106年12月8日台期輔字第10600036190號函、期交所106年12月21日台期結字第10600037640號函)
- ※依修正時間排序。(莫璧君整理)

交易量比較表

		106年11月交易量		106年12月交易量		106年12月成長率	
		國內	國外	國內	國外	國內	國外
月 交 易 量	期貨	15,492,396	3,030,698	16,044,256	2,831,636	3.56%	-6.57%
	選擇權	34,489,570	31,654	40,343,456	21,784	16.97%	-31.18%
	小計	49,981,966	3,062,352	56,387,712	2,853,420	12.82%	-6.82%
日 均 量	期貨	704,200	146,420	764,012	141,819	8.49%	-3.14%
	選擇權	1,567,708	1,534	1,921,117	1,096	22.54%	-28.57%
	小計	2,271,908	147,954	2,685,129	142,914	18.19%	-3.41%

106年12月國外市場交易量統計表

單位：口

		美國	新加坡	香港	日本	其他	英國	合計
		月 交 易 量	期貨	870,876	1,792,365	91,061	41,134	28,209
	選擇權	15,776	0	3,681	1,869	451	7	21,784
	小計	886,652	1,792,365	94,742	43,003	28,660	7,998	2,853,420
百 分 比	期貨	30.76%	63.30%	3.22%	1.45%	1.00%	0.28%	100.00%
	選擇權	72.42%	0.00%	16.90%	8.58%	2.07%	0.03%	100.00%
	小計	31.07%	62.81%	3.32%	1.51%	1.00%	0.28%	100.00%

107年1月份國內市場交易量統計表

單位：口；買+賣算2口

排名	商品別	106年12月交易量	107年1月交易量	107年1月百分比	107年1月成長率
1	TXO(臺指選擇權)	40,144,176	42,816,436	70.82%	6.66%
2	TX(臺股期貨)	6,948,018	7,297,388	12.07%	5.03%
3	MTX(小型臺指期貨)	4,521,358	4,798,370	7.94%	6.13%
4	STF(股票期貨)	3,708,844	4,315,734	7.14%	16.36%
5	ETF(ETF期貨)	229,106	300,028	0.50%	30.96%
6	TE(電子期貨)	203,794	215,726	0.36%	5.85%
7	UDF(美國道瓊期貨)	136,700	188,926	0.31%	38.20%
8	TF(金融期貨)	165,330	153,208	0.25%	-7.33%
9	STC(股票期貨選擇權)	38,462	49,708	0.08%	29.24%
10	TEO(電子選擇權)	57,220	45,576	0.08%	-20.35%
11	RTO(小型美元兌人民幣選擇權)	27,328	41,496	0.07%	51.84%
12	RTF(小型美元兌人民幣期貨)	36,430	37,952	0.06%	4.18%
13	ETC(ETF選擇權)	29,388	31,938	0.05%	8.68%
14	TFO(金融指數選擇權)	37,426	30,762	0.05%	-17.81%
15	XIF(非金電期貨)	15,532	18,942	0.03%	21.95%
16	TJF(東證期貨)	14,826	18,140	0.03%	22.35%
17	XEF(歐元兌美元期貨)	10,994	15,742	0.03%	43.19%
18	XJF(美元兌日圓期貨)	14,418	13,126	0.02%	-8.96%
19	TGF(臺幣黃金期貨)	11,130	12,826	0.02%	15.24%
20	SPF(美國標普500期貨)	9,572	12,024	0.02%	25.62%
21	I5F(印度50期貨)	9,140	10,184	0.02%	11.42%
22	XBF(英鎊兌美元期貨)	0	9,004	0.01%	-
23	RHF(美元兌人民幣期貨)	5,738	8,286	0.01%	44.41%
24	TGO(臺幣黃金期貨選擇權)	7,220	6,914	0.01%	-4.24%
25	XAF(澳幣兌美元期貨)	0	4,792	0.01%	-
26	RHO(美元兌人民幣選擇權)	2,236	2,850	0.00%	27.46%
27	GDF(黃金期貨)	1,510	1,658	0.00%	9.80%
28	GTF(櫃買期貨)	1,470	850	0.00%	-42.18%
29	T5F(臺灣50期貨)	346	464	0.00%	34.10%
30	XIO(非金電選擇權)	0	0	0.00%	0.00%
31	GTO(櫃買選擇權)	0	0	0.00%	0.00%
32	GBF(十年期公債期貨)	0	0	0.00%	0.00%
合	計	56,387,712	60,459,050	100.00%	7.22%

107年1月份董事長、總經理異動表

職稱	公司名稱	就任者
董事長	永豐金證券股份有限公司	朱士廷
	華頓證券投資信託股份有限公司-信託	高武忠

職稱	公司名稱	就任者
總經理	國票綜合證券股份有限公司	王祥文
	摩根大通證券股份有限公司	馬捷

會務訊息

宣傳資料及廣告物申報件數統計表

業別	107年12月件數	107年1月件數	107年1月比重	107年1月成長率
專營期貨經紀業務	66	53	42%	-20%
兼營期貨經紀業務	1	1	1%	0%
期貨交易輔助人	-	1	1%	-
槓桿交易商	8	8	6%	0%
期貨顧問事業	52	48	38%	-8%
期貨經理事業	-	5	4%	-
期貨信託事業	5	10	8%	100%
合計	132	126	100%	-5%

業務員人數統計表

業別	106年12月人數	107年1月人數	107年1月比重	107年1月成長率
專營期貨經紀業務	1,745	1,751	7.04%	0.34%
兼營期貨經紀業務	2,474	2,479	9.96%	0.20%
期貨交易輔助人	17,548	17,545	70.52%	-0.02%
期貨自營業務	1,058	1,073	4.31%	1.42%
期貨顧問業務	1,015	1,025	4.12%	0.99%
期貨經理業務	200	200	0.80%	0.00%
期貨信託業務	691	721	2.90%	4.34%
槓桿交易商	87	85	0.34%	0.00%
合計	24,818	24,879	100.00%	0.25%

現有會員統計資料

業別	會員公司				營業據點			
	106年12月家數	107年1月家數	107年1月比重	107年1月成長率	106年12月點數	107年1月點數	107年1月比重	107年1月成長率
專營期貨經紀業務	16	16	9.36%	0.00%	120	119	6.54%	-0.83%
兼營期貨經紀業務	17	17	9.94%	0.00%	353	352	19.35%	-0.28%
期貨交易輔助人	48	48	28.07%	0.00%	1,224	1,222	67.18%	-0.16%
期貨自營業務	34	34	19.88%	0.00%	34	34	1.87%	0.00%
期貨顧問業務	32	32	18.71%	0.00%	51	51	2.80%	0.00%
期貨經理業務	9	9	5.26%	0.00%	14	14	0.77%	0.00%
期貨信託業務	10	10	5.85%	0.00%	21	24	1.32%	14.29%
槓桿交易商	3	3	1.75%	0.00%	3	3	0.16%	0.00%
贊助會員	2	2	1.17%	0.00%	-	-	-	-
合計	171	171	100.00%	0.00%	1,820	1,819	100.00%	-0.05%