



期貨公會會訊



台北郵局許可證
台北字第3324號
台北誌字 794 號

第 211 期
109年5月號

第 6 屆理監事第 5 次聯席會議報導

本次會議重要決議事項

※ 追認通過本公會109年度第1季業務計畫及預算執行情形案。

※ 追認通過建請證券櫃檯買賣中心調整槓桿交易商調整後淨資本額（ANC）相關規定案。

為因應此金融市場特殊緊急情況，並穩定槓桿交易者之運營，響應政府防疫紓困振興產業措施，爰提出以下建議：

(一) 建議刪除櫃買中心槓桿交易者經營槓桿保證金契約交易業務規則第49條「槓桿交易者調整後淨資本額占期貨交易者未沖銷部位所需之客戶保證金總額低於百分之三十時，槓桿交易者除辦理與槓桿保證金契約交易業務相關避險交易外，不得為新增交易，須俟前揭比率達百分之三十以上時，始得為之。」之規定。

(二) 建議櫃買中心參酌臺灣期貨交易所「期貨商申請緊急支應調整後淨資本額不足作業要點」，增訂槓桿交易者緊急支應ANC不足之相關規範。

※ 通過本公會召開109年度會員大會日期與場地案。

(一) 本公會第6屆第2次會員大會日期與場地，原訂於109年6月12日星期五下午4時30分，假國賓大飯店國際廳召開，並經109年2月21日第6屆理監事第4次聯席會議決議通過。因新冠肺炎疫情嚴重，中央流行疫情指揮中心日前發布大型集會防疫指引，建議室外500人、室內100人的集會要停辦，本公會擬延期至7月31日原場地辦理會員大會。

(二) 另因疫情之發展無法預期，為恐屆時仍無法舉行，擬參考其他公會之作法，由理監事聯席會議授權理事長視疫情狀況可另擇日辦理。

※ 通過修正本公會「新興科技資訊安全自律規範」暨增訂檢測實驗室APP檢測報告自我檢核表參考範例案。

期交所修正「建立期貨商資通安全檢查機制」及「期貨商內部控制制度標準規範」，明定於本（109）年度將現有之行動應用程式交付合格實驗室檢測並通過測試；主管機關指示本公會配合修正相關自律規範，並新增期貨商自我檢核範列表單，以要求期貨商對檢測實驗室所提交之行動應用程式檢測報告「品質」建立檢視機制。

※ 通過修正「期貨業防制洗錢及打擊資恐相關規定問答集」案。

為落實RBA（風險基礎方法）精神，簡化低風險客戶有權交易者身分之辨識及驗證，並參酌證券商公會相關內容，爰建議修正「期貨業防制洗錢及打擊資恐相關規定問答集」。

※ 通過取消期貨業業務員、期貨信託基金銷售人員及期貨輸單員工作證遺失須登報作廢之規定案。

依本公會相關自律規則期貨業業務員、期貨信託基金銷售人員及期貨輸單員之工作證遺失者，應先登報聲明作廢，並檢附職務申請、異動登記表及剪報，向本公會辦理補發。上述「登報作廢」之作法緣由應屬從前資訊流通以紙本報紙為主要方式，故為保障民眾，要求若有遺失證件須採登報作廢方式公告周知。惟今日資訊流通管道多元且快速，另經查證券做法，證券業務員如有工作證遺失之情事，係由證券商發函並附上「證券商（證券IB）業務人員及事務員登記證製作申請書」，逕向證交所申請補發即可，爰建議刪除本公會相關自律規則有關期貨業業務員、期貨信託基金銷售人員及期貨輸單員工作證遺失須登報作廢之規定。（杜月明）

期貨從業人員資格測驗次數調整 - 自民國110年開始實施

因應少子化、科技化與大環境的影響，證基會就「證券、投信投顧暨期貨從業人員資格測驗」筆試與電腦應試測驗之辦理次數進行調整，每年辦理4次（次/季）減少為3次（次/4個月），並輔以增加電腦應試測驗地區與場次之措施。

目前期貨公會委託證基會辦理「期貨業務員」、「期貨信託基金銷售機構銷售人員」及「期貨交易分析人員」三種資格測驗，針對證基會之規劃內容如下：

（一）「期貨業務員」及「期貨信託基金銷售機構銷售人員」資格測驗分為筆試及電腦應試，由於參加筆試測驗人數逐年遞減，證基會將筆試測驗次數由現行每年辦理4次（次/季）減少為3次（次/4個月），輔以增加電腦應試

測驗地區與場次之措施。

（二）「期貨交易分析人員」資格測驗僅有筆試，測驗題型分為選擇題及申論題，採各科及格制，及格科目效力自測驗日起2年內有效。證基會將筆試測驗次數由現行每年辦理4次（次/季）酌予減少為3次（次/4個月），考量將筆試次數由4次減少為3次，於107年度已取得單科及格者原本預期在2年效期有8次應考機會，但因109年度起測驗次數減少，僅剩7次應考數，為免影響考生權益，故新規定將自民國110年起實施，俾利107年度考生仍保有108年及109年共8次之考試機會，以維其權益。（華辰）

金管會修正期貨信託基金終止期貨信託契約之規範

金管會於109年3月19日公告修正期貨信託基金清算標準規定，明定最近30個營業日之基金平均單位淨資產價值累積跌幅達一定比率須終止信託契約進行清算，並增訂豁免規定，亦即基金如因國內外經濟金融情勢變化，致基金淨資產價值發生重大波動，得報金管會核准於一定期間不受前揭規定限制。

金管會衡酌疫情影響國際金融市場發展情勢及投資人權益保護，同意期貨公會建議之暫時性豁免規定，亦即期貨信託基金若同時符合下列條件，期貨信託事業得向金管會申請於109年9月30日前豁免基金單位淨資產價值跌幅達一定比

率須清算之規定：

（一）申請日前一日基金單位淨資產價值高於0.5元。
（二）基金單位淨資產價值最近10個營業日（不含當日）曾發生6日或30日單位淨資產價值變動率超過其過去3年變動率2.33倍標準差。

目前元大標普高盛原油ER單日正向2倍及街口標普高盛布蘭特原油ER單日正向2倍等2檔指數股票型期貨信託基金達豁免適用標準，並已申請獲准在案。（郭仙娟）



兼具增益及避險效果的美元指數

大家都知道美元是全球的儲備貨幣，幾乎所有的貨幣價值都是跟美元相比較來計算出價值，例如1美元兌30.5新臺幣或是一美元兌107日圓…等等，然而我們要如何知道美元本身的價值呢？美元指數就是一個很好的觀察工具。

美元指數隸屬於紐約期貨交易所（NYBOT），指數成份包含歐元（EUR）57.6%、日元（JPY）13.6%、英鎊（GBP）11.9%、加元（CAD）9.1%、瑞典克朗（SEK）4.2%、瑞士法郎（CHF）3.6%這六種貨幣，對美元匯率變化的幾何平均加權值來計算的，以100為基準來衡量價值，簡單說美元指數是綜合反映美元在國際外匯市場的匯率情況的指標，如果美元指數下跌，表示美元對其他的主要貨幣貶值。

根據國際貨幣基金會（IMF）2019年Q3全球外匯存底資料，除美元占比超過60%外，歐元占20%，日圓則是5.6%，英鎊亦有4.43%，可見美元、歐元、日圓及英鎊為外匯市場之主要重心。或許大家心生疑惑，為何美元指數的組成中沒有世界最大貿易國，也是美國主要貿易夥伴—中國的人民幣？確實如果以購買力與貿易量來看，沒有納入人民幣的美元指數是有失真的狀態，但我認為是不用太在意這件事的，第一是人民幣具有外匯管制措施且波動性較低，其影響力並沒有想像中大；第二是美元指數有期貨商品可以交易，具備了即時反應市場價格與避險的功能，在實際市場中的用處相當廣泛。透過美元指數可以讓我們觀察到全球貨幣的強弱關係，在美元指數走強時，其他貨幣基本上都偏弱勢，所以在建立部位時應多加留意。

市場波動加劇 避險工具新選擇 - 美元指數ETF

外匯市場是全球最大的金融市場，單日交易額高達1.5兆美元。除了銀行、財團及財務經理人交易外，隨著金融工具推陳出新，一般投資人現在也能透過多元管道參與外匯交易市場。

在外匯市場中，美元為全球最常見主流貨幣，由於各國貨幣對美元強弱表現不同，因此要判斷美元的強弱勢表現，可由美元指數來觀察，美元指數是由美元兌六種貨幣加權平均組成，包含歐元、日元、英鎊、加元、瑞典克朗、瑞士法郎。美元指數不只與全球經濟動向緊密連結，並與股市、債市、原物料、商品的起伏也是息息相關。『美元指數』是外匯市場特別的標的，它是全世界投資者與各國央行緊盯的匯率觀察重點，每當美元指數走強，便讓人聯想到美股、商品原物料及美國利率政策之趨勢。

今年以來全球金融市場受新冠肺炎疫情影響波動加劇，以美股最具代表性的指數S&P500也因此出現大幅下跌，美國銀行間美元的流動性開始緊縮，銀行間拆借美元的利率飆升，美元荒再現，今年第一季（2020/Q1）S&P500跌幅約20.00%，同期間S&P美元指數期貨指數則上漲了3.30%，S&P美元指數期貨槓桿指數則上漲了6.40%。就避險的角度觀之，美元指數恰為最佳之避險工具，就過往市場波動暴增的環境，如金融海嘯、美國終止QE、美國總統大選，近兩年的貿易戰，或到最近的新冠肺炎疫情，從過去的歷史可以

另一方面FED的貨幣決策對美元指數的走勢也有關鍵性的影響力，因此每次聯準會的調息會議都會使美元指數產生波動。而近期新冠肺炎疫情蔓延，導致全球經濟停滯，各國經濟數據呈現急速下降，因此許多企業和金融機構開始大量購入美元，尋求流動性最強的貨幣與備償債和維持營運之需…等等，導致美元指數一口氣升破100大關，來到近三年的高點位置。

而臺灣期貨交易所於2016年11月推出「歐元兌美元匯率期貨」及「美元兌日圓匯率期貨」，2018年1月推出「英鎊兌美元匯率期貨」及「澳幣兌美元匯率期貨」，其中的「歐兌美、美兌日、英兌美」都是美元指數的前三大成分貨幣，提供了交易人多元化產品及避險管道，交易人可搭配運用。（元富期貨 李勁霖）

美元指數與Fed政策息息相關



觀察到，當投資人需要在金融動盪期間找到安全的地方存錢時，最後總會轉向美國，當金融危機最嚴重的時候，世界各地都吵著要更多的美元，在這不完美的世界裡，美元相對還是出色的保值工具。近年來投信業者發行的「美元指數ETF」已漸漸成為國人切入外匯交易的新選擇，投資人若想為風險性資產投資進行避險，可透過美元指數ETF這類的替代性產品來做避險，將是不錯的選擇之一。

近15年S&P500季跌幅 TOP10 V.S 美元指數

季度(季報酬)	S&P 500	S&P美元指數期貨指數	S&P美元指數期貨槓桿指數
2008.Q4	-22.56%	2.50%	4.28%
2020.Q1	-20.00%	3.30%	6.40%
2011.Q3	-14.33%	5.28%	10.52%
2018.Q4	-13.97%	1.59%	3.13%
2010.Q2	-11.86%	5.58%	11.25%
2009.Q1	-11.67%	3.95%	7.54%
2008.Q1	-9.92%	-6.42%	-12.60%
2008.Q3	-8.88%	8.32%	16.98%
2015.Q3	-6.94%	0.56%	0.92%
2007.Q4	-3.82%	-1.20%	-2.48%

資料來源：Bloomberg，2005/01～2020/03，元大投信整理

（元大投信 期貨信託部）

破天荒 紐約西德州原油期貨史上首見負值成交**跳水式崩盤**

國際原油期貨價跳水式崩盤，西德州原油期貨（WTI）5月合約4月20日單日重挫55.90美元，跌幅高達306%，每桶以-37.63美元作收，乃該產品自1983年在NYMEX掛牌以來，首次出現的負值結算。

MarketWatch 報導說，現貨市場相當疲軟，期貨價格崩盤前，美國和加拿大某些等級的原油現貨價格已經瀕臨每桶零元。言下之意，期貨出現零元交易其實並不意外。

但出現負值交易就顛覆絕大多數人的理論基礎與經驗值了，究竟這個結果是如何引發的呢？

原因分析**一、供需失衡：**

為了防堵新冠肺炎，各國政府紛紛採取封鎖措施，全球數十億人居家避疫，交通、運輸、生產活動相繼停擺，原油需求降至30年以來的最低點。

即便OPEC達成減產協議，5-6月每日減產970萬桶，7-12月日減800萬桶，但油價仍舊低迷。分析師認為，由於沙、俄兩國談判時間拖得太長，非但錯過最佳拉抬時機，減產力道也嫌太弱。

二、庫容爆滿：

知情人士預估，如果維持目前的速度，WTI期貨交割庫奧克拉荷馬州庫欣市（Cushing）的庫存將在兩週內創新紀錄，並在八到九週內爆滿。

兼具運油與儲油的大型油輪儲油亦達到1.6億桶的歷史新高，較2週前翻了一倍，油輪半年期的租金已漲至每日約10萬美元，遠高於一年前的3萬美元。

綜合以上，需求不振、產能過剩是主因，其次是5月合約將於4月21日到期並採取實物交割，屆時多方必須領取原油，但擔心儲油空間不足，因此趕在倒數交易日前爭相出清，導致價格不合理地暴跌，再加上NYMEX允許負值交易，在眾多因素糾結之下，終於締造原油期貨市場最慘烈的紀錄。

慘遭衝擊之行業**一、石油業：**

石油公司平時揹負過多債務，恐怕無法安渡難關。研究機構Rystad Energy預估，若油價跌到每桶20美元，2021年底美國將有533家探勘和生產公司聲請破產。若下探到每桶10美元，則有1,100家以上的石油公司將聲請破產。

在價格低迷及原油無處儲存情況下，Whiting Petroleum於4月2日成為第一家倒閉的美國頁岩油商，但應該不是最後一家。

新加坡石油巨擘興隆集團（Hin Leong Trading）因為近3個月的油價崩盤、銀行信貸緊縮，導致公司現金耗盡，積欠銀行債務，已向法院聲請破產，成為油價崩盤首批倒閉的企業。

二、ETF、ETN：

美國期貨基金（USCF）今年第一季就流入29億美元，其所發行的USO（United States Oil Fund）是全球最大的原油期貨ETF。光3月份，USO就跌掉55%，4月20日再跌10.93%，21日又重挫25.07%，以歷史最低點2.81美元作收。

受到近月份期貨合約跌破零元之衝擊，USO改變持倉部位之月份，40%買入6月合約、55%投入7月合約、5%持有8月合約，試圖為投資人降低劇烈波動的風險。但正價差擴大，意味著必須賣出低價的近月合約，轉買高價的遠月合約，轉倉成本驚人，屆時，持有USO的投資人可能叫苦連天。

全美第三大石油ETN則在近日決定下市。巴克萊銀行4月20日宣布，將在4月30日全面贖回標普高盛原油指數ETN

（代號為OIL.US）。OIL.US 4月21日暴跌40.21%，收在2.23美元；年初迄今已狂跌82.27%。

三、證券期貨業：

4月20日前所未有的油價走勢衝擊股市，S&P 500指數下跌1.8%、道瓊指數約收低2.5%，標普能源股急挫3.7%，今年以來，能源股累計下跌45%，在標普500指數11個板塊中表現最差。

NYMEX允許負值交易後，市場參與者尚未準備就緒，全球多數期貨商的交易系統還來不及建置負值交易功能，造成當天無法受理交易人的負值下單，產生客訴事件。

四、銀行業：

新加坡興隆集團破產造成23家銀行踩到地雷，債務共38.5億美元。接踵而來的是其他石油業也有可能倒閉，積欠的債務恐成為銀行無法回收的呆帳。

大陸的中國銀行向民眾發行的投資產品「原油寶」係以WTI原油期貨合約作為連結標的，該行身為造市商提供報價並進行風險管理，然因不及換月轉倉，被迫以每桶-37.63美元進行結算，導致投資人慘賠，引發爭議。

五、內線交易疑雲：

據說，美國商品期貨交易委員會（CFTC）在WTI原油期貨價格跌破零元時已展開調查；英國金融監理局（FCA）也對可疑之期貨交易展開調查。調查的重點在於交易員是否在沙、俄兩國談判時，提前掌握俄國立場的非公開資訊，從中非法獲利數億美元。

未來觀察

6月合約取代5月成為交投最熱的合約後，4月20日雖然連帶下挫，但收盤價仍撐在每桶20美元以上。未來幾週，WTI 6月合約價格是否會步5月合約之後塵？端看多空雙方的拉扯力道。

利多事項：

專家分析，各界對經濟復甦和儲油空間不足的疑慮，導致油價走跌，只要這些問題解決後，油價可望恢復正常。從正價差曲線的陡峭情形來看，WTI 12月合約報價仍高於每桶32美元，油價應會回升。

Bloomberg報導，美國能源部考慮補貼美國石油業者，暫緩開採3.65 億桶原油，以減緩供應過剩局面。另外，美國官員表示，課徵進口原油關稅也是抑制供過於求的選項之一。

川普總統將增加7,500萬桶戰略原油儲備，並考慮停止從沙國進口石油以拉抬油市¹。WTI 6月期貨受此激勵，價格反彈2%以上，道瓊期貨也上揚將近百點。

利空因素：

CNBC報導，儘管國際油價有所回升，但需求疲弱及儲存空間不足等問題仍未解決，專家警告油價仍有下挫可能。

美國能源資訊署（EIA）公布，美國原油日產量達1,500萬桶，創下新高，4月中旬進口量則創下新低，煉油廠產能利用率也降至2008年9月以來最低，反映原油需求持續萎縮。

國際能源署（IEA）執行董事Fatih Birol提出三項挽救油市之建議：首先產油國應進一步減產；二、金融機構應採取措施，防止市場失序；最後，有戰略儲備需求的國家，應擴大採買原油。

（資料來源：MoneyDJ新聞、鉅亨網、ET Today新聞雲、工商時報、自由時報、聯合報、蘋果日報、中時電子報范加麟整理）

¹ 美國戰略原油儲備地點位於美國德州和路易斯安那州的墨西哥灣沿岸等4個地下儲槽，容量為7億2700萬桶，授權上限為7.135億桶，現已達6.35億桶。

懲處案例報導

違規類型：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、章程及內部控制制度為之。」。

○○證券股份有限公司經營期貨經紀業務(以下稱該公司)辦理開戶作業及變更基本資料作業，未由登記開戶人員辦理，暨內部稽核人員辦理有關開戶及變更基本資料之查核時，有查核不實之情形，與該公司內部控制制度

「CW-21000人員聘僱作業」有關「負責人及業務員…」，非經登記不得執行職務。」及總則十七內部稽核人員應注意事項：「(七)內部稽核人員對查核結果應予合理判斷，此項判斷應有可靠之理論依據，獲得足夠而適切之證明。」之規定不符，核已違反期貨商管理規則第2條第2項之規定。

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

109年4月份董事長、總經理異動表

職稱	公司名稱	就任者
董事長	德信綜合證券股份有限公司	孟慶蒞
總經理	德信綜合證券股份有限公司	張清榮

職稱	公司名稱	就任者
總經理	臺灣中小企業銀行股份有限公司	張志堅
	街口證券投資信託股份有限公司	莊鈺富

會務訊息

宣傳資料及廣告物申報件數統計表

業別	109年3月件數	109年4月件數	109年4月比重	109年4月成長率
專營期貨經紀業務	73	65	65%	-11%
兼營期貨經紀業務	2	7	7%	250%
期貨交易輔助人	1	4	4%	300%
槓桿交易商	5	1	1%	-80%
期貨顧問事業	26	21	21%	-19%
期貨經理事業	-	-	0%	0%
期貨信託事業	8	2	2%	-75%
合計	115	100	100%	-13%

業務員人數統計表

業別	109年3月人數	109年4月人數	109年4月比重	109年4月成長率
專營期貨經紀業務	1,774	1,775	7.41%	0.06%
兼營期貨經紀業務	2,341	2,347	9.80%	0.26%
期貨交易輔助人	16,860	16,818	70.22%	-0.25%
期貨自營業務	1,094	1,092	4.56%	-0.18%
期貨顧問業務	1,123	1,114	4.65%	-0.80%
期貨經理業務	164	171	0.71%	4.27%
期貨信託業務	526	529	2.21%	0.57%
槓桿交易商	103	104	0.43%	0.97%
合計	23,985	23,950	100.00%	-0.15%

現有會員統計資料

業別	會員公司				營業據點			
	109年3月家數	109年4月家數	109年4月比重	109年4月成長率	109年3月點數	109年4月點數	109年4月比重	109年4月成長率
專營期貨經紀業務	15	15	9.55%	0.00%	109	109	6.30%	0.00%
兼營期貨經紀業務	15	15	9.55%	0.00%	328	328	18.96%	0.00%
期貨交易輔助人	46	45	28.66%	-2.17%	1,195	1,182	68.32%	-1.09%
期貨自營業務	32	32	20.38%	0.00%	32	32	1.85%	0.00%
期貨顧問業務	31	31	19.75%	0.00%	47	46	2.66%	-2.13%
期貨經理業務	6	6	3.82%	0.00%	11	11	0.64%	0.00%
期貨信託業務	8	8	5.10%	0.00%	20	19	1.10%	-5.00%
槓桿交易商	3	3	1.91%	0.00%	3	3	0.17%	0.00%
贊助會員	2	2	1.27%	0.00%	-	-	-	-
合計	158	157	100.00%	-0.63%	1,745	1,730	100.00%	-0.86%

交易量比較表

		109年2月交易量		109年3月交易量		109年3月成長率	
		國內	國外	國內	國外	國內	國外
月 交 易 量	期貨	20,729,606	3,759,070	44,780,792	5,127,489	116.02%	36.40%
	選擇權	38,921,888	49,823	48,952,594	57,783	25.77%	15.98%
	小計	59,651,494	3,808,893	93,733,386	5,185,272	57.14%	36.14%
日 均 量	期貨	1,091,032	194,035	2,035,491	233,481	86.57%	20.33%
	選擇權	2,048,520	2,614	2,225,118	2,630	8.62%	0.63%
	小計	3,139,552	196,648	4,260,608	236,111	35.71%	20.07%

109年3月國外市場交易量統計表

單位：口

		美國	新加坡	香港	日本	英國	其他	合計
月 交 易 量	期貨	2,999,332	1,711,634	115,078	190,991	42,347	68,107	5,127,489
	選擇權	53,234	0	2,062	1,582	40	865	57,783
	小計	3,052,566	1,711,634	117,140	192,573	42,387	68,972	5,185,272
百 分 比	期貨	58.50%	33.38%	2.24%	3.72%	0.83%	1.33%	100.00%
	選擇權	92.13%	0.00%	3.57%	2.74%	0.07%	1.50%	100.00%
	小計	58.87%	33.01%	2.26%	3.71%	0.82%	1.33%	100.00%

109年4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	109年3月交易量	109年4月交易量	109年4月百分比	109年4月成長率
1	TXO(臺指選擇權)	48,841,790	29,999,270	56.88%	-38.58%
2	MTX(小型臺指期貨)	21,242,558	10,428,698	19.77%	-50.91%
3	TX(臺股期貨)	15,927,518	7,430,674	14.09%	-53.35%
4	STF(股票期貨)	5,078,306	3,604,190	6.83%	-29.03%
5	UDF(美國道瓊期貨)	1,402,106	532,252	1.01%	-62.04%
6	ETF(ETF期貨)	259,538	132,128	0.25%	-49.09%
7	TE(電子期貨)	235,154	131,328	0.25%	-44.15%
8	TF(金融期貨)	130,266	87,396	0.17%	-32.91%
9	UNF(美國那斯達克100期貨)	153,994	78,296	0.15%	-49.16%
10	SPF(美國標普500期貨)	105,348	55,058	0.10%	-47.74%
11	TGF(臺幣黃金期貨)	39,844	30,062	0.06%	-24.55%
12	STC(股票期貨選擇權)	33,442	26,146	0.05%	-21.82%
13	RTF(小型美元兌人民幣期貨)	52,248	21,038	0.04%	-59.73%
14	ETC(ETF選擇權)	30,484	19,714	0.04%	-35.33%
15	G2F(富櫃200期貨)	10,858	18,852	0.04%	73.62%
16	GDF(黃金期貨)	7,830	18,730	0.04%	139.21%
17	TEO(電子選擇權)	9,032	17,784	0.03%	96.90%
18	TFO(金融指數選擇權)	20,156	16,512	0.03%	-18.08%
19	XIF(非金電期貨)	19,080	14,996	0.03%	-21.40%
20	BRF(布蘭特原油期貨)	7,510	14,564	0.03%	93.93%
21	XBF(英鎊兌美元期貨)	14,116	13,254	0.03%	-6.11%
22	TJF(東證期貨)	22,730	10,078	0.02%	-55.66%
23	TGO(臺幣黃金期貨選擇權)	13,828	7,310	0.01%	-47.14%
24	T5F(臺灣50期貨)	6,528	6,204	0.01%	-4.96%
25	RTO(小型美元兌人民幣選擇權)	3,606	5,600	0.01%	55.30%
26	XAF(澳幣兌美元期貨)	21,292	4,858	0.01%	-77.18%
27	RHF(美元兌人民幣期貨)	12,862	4,504	0.01%	-64.98%
28	XJF(美元兌日圓期貨)	17,192	3,162	0.01%	-81.61%
29	GTF(櫃買期貨)	2,714	3,130	0.01%	15.33%
30	XEF(歐元兌美元期貨)	11,200	2,178	0.00%	-80.55%
31	RHO(美元兌人民幣選擇權)	256	324	0.00%	26.56%
合 計		93,733,386	52,738,290	100.00%	-43.74%