

第一屆 寶碩金融雲平台模擬投資競賽 競賽規則

一、競賽內容：

1. 競賽期間為 2017/12/4~2017/12/29，試玩期間為：2017/11/1~2017/12/1，試玩結束後，將於 2017/12/1 收盤後重設競賽，清除相關交易記錄並還原至初始金額；部位建立期為：2017/12/4~2017/12/8，部位建立期不進行違規懲處。
2. 投資標的及投資組合規定如下：

投資種類(標的)	持股方式	原始投資金額
股票、ETF、Reits、TDR、 權證、期貨、選擇權	投資上市、上櫃股票、ETF、Reits、 TDR，權證，指數期貨，指數選擇權	NT\$10,000,000

3. 競賽規則：

1. 選擇『10-20 檔』上市或上櫃之個股（包含不動產證券以及 ETF、TDR）、權證、指數期貨(台指、金指、電指、小台指、非金電、櫃買、50 期，不含債券期貨)、以及指數選擇權(本次交易競賽無期貨與選擇權盤後交易)，開放現貨市場信用交易(融資融券)；每日總持有檔數必須維持在此規定範圍內。
 2. 持有部位價值須達每日總資產價值『七成(含)』以上；
 3. 現貨(含融資融券)持有部位須達每日總資產價值『三成(含)』以上；
 4. 期貨持有部位須達每日總資產價值三成以上；
 5. 選擇權部位不得超過一成；
4. 相關交易成本，依照現行市場交易規定，各資產『交易成本』如下列：
- 股票：交易稅千分之 3；手續費千分之 1.425；
 - 權證：交易稅千分之 1；手續費千分之 1.425；
 - 期貨：交易稅十萬分之 2；手續費每口 120 元；
 - 選擇權：交易稅千分之 1；手續費每口 60 元；
 - ETF：交易稅千分之 1；手續費千分之 1.425；
 - 不動產證券：手續費千分之 1.425；
 - TDR：交易稅千分之 1；手續費千分之 1.425。
5. 競賽評比：交易名次佔 100%
1. 交易名次：以『總報酬率』排行。

6. 競賽獎勵：總獎金 110,000 元

1. 第一名：新台幣 \$50,000。
2. 第二名：新台幣 \$30,000。
3. 第三名：新台幣 \$10,000。

7. 額外獎項：

1. 從 12/4 起，每週以該週進步最多參賽者，前五名可得「最佳進步獎」，新台幣 \$1000。獎項計算時間為：12/8, 12/15, 12/22, 12/29。

二、違反規則：

1. 以下之規定於每日收盤後檢查，僅以實際持股計算，掛單部位不予計算。
2. 每日追蹤『投資種類(標的)』有無符合『競賽規則』規定。違反規定者，扣分方式如下：
 - (1) 原『總報酬率』為 12%，若違反一項規定扣減 1%，結算後之『總報酬率』為 11%；
 - (2) 違反規定扣減之報酬率採累計計算；
 - (3) 每天最多以懲處 5% 為上限。
3. 當日下單上限筆數 200 筆。
4. 違反規則，情節嚴重者，主辦單位得取消其參賽資格。
5. 部位建立期間，不進行違規懲處。

三. 虛擬交易所主要交易規定：

1. 交易日期：同台灣證券交易所公佈交易日。
2. 交易時間：
 - (1) 台灣證券交易所，每日交易日期之
 - I. 現貨交易時間為『上午 09：00 至下午 01：30』，
 - II. 期貨交易時間為『上午 08：45 至下午 01：45』。
3. 交易場所：透過網際網路進入『虛擬交易所』網頁，即為本次競賽之交易場所。
4. 交易方式：
 - (1) 於虛擬交易所內，透過『掛單買進』或『掛單賣出』下達掛單指令，如『掛單價格』與『掛單數量』。
 - (2) 前項須依市場實際成交行情於虛擬交易所內進行交易撮合，撮合成功才視為成交。
 - (3) 掛單價格種類，請見『掛單類別』。
5. 撮合次數：

- (1)系統自開盤時間，模擬當時市場實際行情可成交之價格與數量進行撮合；但競賽開始前幾日可能會因競賽成員大量建立部位而導致委託量大增，故撮合時間與間隔得視情況而有所調整，請參賽者特別注意。
- (2)『盤前掛單』：期貨一律以上午 8:45 開盤後之交易價為成交參考基礎；現貨一律以上午 9:00 開盤後之交易價為成交參考基礎。
- (3)『盤中掛單』：以每分鐘所記錄之價格為基準；當日委託單若未成交，則盤後則全部自動取消。
- (4)『盤後掛單』：股市收盤後亦可以下單，視為下一交易日之盤前掛單。(即可以預約下一交易日的委託下單)

6.交易標的：

- (1)依據各基金所設定之可投資標的種類交易。

7.買賣方式：

- (1)股票進行融資、融券買賣時，不考慮公司目前是否有資券餘額。

8.掛單類別：可選擇『漲停價』、『跌停價』、『市價單』或『限價單』。

9.委託註記：

- (1)依期交所現行交易規定，台指選擇權委託單可加註 FOK(見(2)項說明)、IOC(見(3)項說明)註記或以無註記(見(4)項說明)之委託限定交易方式。
- (2)註記為 FOK(Fill-Or-Kill)之委託，需全部於該次撮合中立刻成交，否則系統將予以刪除。
- (3)註記為 IOC(Immediate-Or-Cancel)之委託，至少需部份於該次撮合中立刻成交，否則系統將予以刪除。
- (4)無註記委託則視為 Rest-Of-Day(當日有效)之委託，可於當日交易時間內等待撮合完成。

10. 融資、融券的保證金：

- (1)融資保證金自備款成數為『四成』，融券保證金自備款成數為『九成』；
- (2)融資、融券部位若全部回補後，保證金部位將全部回到現金。

11. 當日沖銷：

- (1)股票：虛擬交易所當日沖銷規定與市場不同，沖銷方式如下：

I. 融資買進之部位必須以融資賣出的方式沖銷。

II. 融券賣出之部位必須以融券回補的方式沖銷。

(2) 期貨：沖銷方式以指定反向部位進行平倉。若委託平倉口數多於未平倉之部位，則以未平倉之部位數量進行部位了結；剩餘無法平倉之委託口數則改以新倉處理；新倉之建立金需收取保證金，各期貨商品之保證金計算方式請參見『期貨保證金』之第(4)小項「每口可交易之期貨商品保證金」說明。

12. 除權息處理：

(1) 除權息由系統自動結算。

(2) 信用交易個股，於除權息日強迫贖回。

13. 各持股成本計算：採平均成本法。

14. 期貨保證金：

(1) 系統每十五分鐘檢查保證金，盈虧將直接反應到保證金帳戶；

(2) 保證金追繳通知發出後，兩小時內需繳款補足至原始保證金。兩小時之後，系統將強迫以各期貨部位當時價位賣出所有期貨持有部位；

(3) 追繳通知當中，若期貨保證金低於原始保證金之 25% 以下，系統將自動直接賣出期貨部位。

(4) 每口可交易之期貨商品保證金：

I. 台股期貨：原始保證金 83,000 元，維持保證金 64,000 元；

II. 電子期貨：原始保證金 68,000 元，維持保證金 52,000 元；

III. 金融期貨：原始保證金 53,000 元，維持保證金 41,000 元；

IV. 小型臺指期貨：原始保證金 20,750 元，維持保證金 16,000 元；

V. 台灣 50 期貨：原始保證金 30,000 元，維持保證金 23,000 元；

VI. 櫃買期貨：原始保證金 29,000 元，維持保證金 22,000 元；

VII. 非金電期貨：原始保證金 57,000 元，維持保證金 44,000 元；

VIII. 系統得視期交所公佈之保證金收取標準，於適當時機調整各商品之保證金。

15. 期貨到期：期貨到期日，系統將自動以現金結算到期部位，獲利或虧損之金額將會反應在期貨保證金帳戶。

16. 選擇權保證金：

(1) 系統每十五分鐘檢查賣出選擇權部位的保證金，盈虧將直接反應到保證金帳戶；

(2) 保證金追繳通知發出後，兩小時內需繳款補足至原始保證金。兩小時之後，系統將強迫以各選擇權部位當時價位平倉所有選擇權持有部位；

(3) 追繳通知當中，若選擇權保證金低於原始保證金之 25% 以下，系統將自動直接賣出選擇權部位。

(4) 每口選擇權保證金計算如右：應收保證金 = 權利金市值 + MAXIMUM(選擇權保證金 - 選擇權價外值, 選擇權最低保證金)

I. Call 的價外值：MAXIMUM((履約價 - 市價) x 50, 0)

II. Put 的價外值：MAXIMUM((市價 - 履約價) x 50, 0)

III. 選擇權保證金 (A 值)、選擇權最低保證金 (B 值) 以期交所公佈為主。選擇權保證金皆分為原始、維持及結算三種標準，依時機選擇其中一種保證金值來計算應收保證金。

17. 選擇權到期：選擇權到期日，系統將自動以現金結算到期並且獲利的部位，獲利或虧損之金額將會反應到選擇權保證金帳戶。

18. 競賽成績公布：每日下午 4:00 之後。

五. 例外狀況處理說明：

1. 如果系統因為任何因素，導致價格錯誤、延誤、撮合機制失效，主辦單位得視情形，宣布當天交易無效，並回到前一有效之交易結果。

2. 競賽開始日，開盤撮合時若遇有大量預約掛單，系統撮合間隔將隨掛單量增加而隨之增加。

3. 本活動因故無法進行時，主辦單位有權決定取消、終止、修改或暫停活動；另本活動辦法有未盡事宜，主辦單位保有隨時修訂之權利，並公告於主辦單位網站。