

臺灣期貨交易所

「縱橫期海 Trader 就是你—大專院校模擬交易競賽 Part II」 活動辦法

壹、主辦單位

臺灣期貨交易所（以下簡稱期交所）。

貳、活動目的

- 一、期交所為使校園年輕人可透過模擬交易，增進期貨專業知識並瞭解期貨交易風險控管之重要性，及培育未來期貨操盤人才，爰以教育為出發點，舉辦本競賽活動。
- 二、校園年輕人學習期貨程式交易者逐年增加，本活動交易下單方式涵括一般介面、程式交易兩種。
- 三、本活動競賽成績以「累積報酬率」及「夏普比率」兩項指標計算，其中夏普比率代表「在承受 1% 的風險下，能得到多少報酬？」，亦即競賽成績同時考慮報酬及風險，期盼參賽者在可承受的風險下，追求長穩定獲利的交易模式。

參、活動期間

- 一、報名期間：111 年 9 月 12 日至 10 月 7 日；
- 二、競賽期間：111 年 10 月 17 日至 12 月 21 日。

肆、參賽資格

- 一、國內大專院校在學學生。
- 二、由大專院校老師推薦，學生組隊報名參加，每隊學生人數最少 3 人、最多 5 人，每位指導老師至多可推薦 8 隊，每位學生僅限參賽 1 隊；另每所學校報名隊伍上限為 25 隊。

伍、報名方式

- 一、自 111 年 9 月 12 日起，參賽者即可至本活動網站專區(期交所官網首頁)，填具相關資料完成報名作業。
- 二、應填具之報名欄位包含：
 - (一) 參賽隊伍：學校、系所、隊伍名稱；
 - (二) 指導老師：姓名、電話、email，請注意須為參賽隊伍該校老師；
 - (三) 參賽隊員：需指定 1 人為隊長，負責彙整並登錄所有隊員報名資

料，包含姓名、學號、手機、email，並須上傳學生證，請注意全部隊員須為同校同學；

(四) 本活動參賽者個人資料告知暨同意事項，詳參本活動報名網頁。

三、本活動接受報名組隊上限為 300 隊，額滿即截止報名，其中每所學校報名組隊上限為 25 隊，倘報名截止後尚有名額，則開放報名超過 25 隊 之學校，依報名時序進行遞補之。

四、期交所將審查所有組隊報名資料是否符合本辦法參賽資格規定，倘應填具或上傳檢附之報名資料不符規定者，將無法成功報名。

五、參賽隊伍完成報名後，可登入本活動網站專區查詢是否報名成功。

六、期交所統一於 10 月 14 日前 以 email 寄出「本活動競賽網址、虛擬交易帳號/密碼及程式交易介接軟體 TOUCHANCE 帳號/密碼」予符合參賽資格隊伍，參賽隊伍於競賽期間登入期交所虛擬交易所進行模擬交易。

七、參賽隊伍須於 12 月 1 日至 12 月 23 日期間，於本活動網站專區上傳交易心得報告.pdf 檔(格式詳附件)，如未繳交或經審核未通過(未依格式規範撰寫、指導老師未簽名、報告內容敷衍亂寫…等)，則無法獲得本活動獎項(包含競賽獎及好學獎)。

八、參賽證明：112 年 1 月 6 日起可逕自本活動網站專區下載。

陸、競賽商品及競賽天數

一、本活動競賽商品為期交所虛擬交易所之下述四類商品，四類商品均須有交易紀錄：

1. 臺股期貨(限近月及次近月契約)；
2. 小型臺指期貨(限週契約、近月及次近月契約)；
3. 臺指選擇權(限週契約之價平上下 10 檔序列、近月及次近月契約之價平上下 15 檔序列¹)；
4. 股票期貨(特定造市標的之近月契約²): 包含長榮航期貨、長榮期貨、聯電期貨、台積電期貨、友達期貨、群創期貨、華新期貨、台積電期

¹ 有關臺指選擇權未平倉部位，如有履約價已非當日依本辦法所規定價平上下一定檔數序列時，該部位僅能平倉，無法再建立新倉。

² 特定造市標的之近月契約：111 年 1-6 月日均量達 5,000 口且為期交所公告之 111 年 8 月股票期貨連結 TXO 手續費折減之造市標的。

貨(小)、智原期貨、宏達電期貨、鴻海期貨、欣興期貨等 12 檔。

二、交易天數須達競賽期間交易日三分之一以上，亦即 16 天 以上。

三、以上規定均須於競賽期間完成，未能完成者，不列入成績排名。

柒、模擬交易平台

一、本活動模擬交易平台使用期交所虛擬交易所，採即時行情模式。

二、本活動下單方式如下：

1. 可使用網頁(web)下單，競賽網址請詳參本辦法伍、六；或使用智慧型手機下載「期交所虛擬交易所」App，競賽模式請點選「縱橫期海 Trader 就是你」。
2. 本活動委託下單方式有二：(一)一般下單：於虛擬交易所本競賽活動操作介面下單；(二)程式交易下單：使用 MultiCharts、Python API、Excel VBA 下單，需另下載安裝程式交易介接軟體(TOUCHANCE)，操作說明請至本活動競賽首頁下載「操作手冊」。

捌、競賽方式

一、競賽獎

本活動於競賽期間結束，依各參賽隊伍之「累積報酬率³」、「夏普比率⁴」計算競賽成績。競賽成績將自符合本辦法第陸點「競賽商品及競賽天數」規定、有繳交心得報告且正報酬隊伍之「夏普比率」前 60 名，再依「累積報酬率」排序取前 20 名獲獎。

1. 第 1 名：團隊獎金新臺幣(以下同)6 萬元，指導老師 3 萬元獎金；
2. 第 2 名：團隊獎金 5 萬元，指導老師 2.5 萬元獎金；
3. 第 3 名：團隊獎金 4 萬元，指導老師 2 萬元獎金；
4. 第 4 名：團隊獎金 3.5 萬元，指導老師 1.75 萬元獎金；
5. 第 5 名：團隊獎金 3 萬元，指導老師 1.5 萬元獎金；
6. 第 6 名：團隊獎金 2.5 萬元，指導老師 1.25 萬元獎金；
7. 第 7 名：團隊獎金 2 萬元，指導老師 1 萬元獎金；
8. 第 8 名：團隊獎金 1.5 萬元，指導老師 7 千 5 百元獎金；
9. 第 9 名：團隊獎金 1 萬元，指導老師 5 千元獎金；

³ 累積報酬率=(期末帳戶總市值-期初帳戶總市值)/期初帳戶總市值。

⁴ 夏普比率=每日報酬率平均值/每日報酬率標準差，其中每日報酬率=(當日帳戶總市值-前日帳戶總市值)/前日帳戶總市值。

10. 第 10 名：團隊獎金 8 千元，指導老師 4 千元獎金；
11. 第 11 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
12. 第 12 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
13. 第 13 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
14. 第 14 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
15. 第 15 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
16. 第 16 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
17. 第 17 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
18. 第 18 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
19. 第 19 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金；
20. 第 20 名：團隊獎金 6 千元，指導老師 3 千元獎金。

二、好學獎

為鼓勵參賽同學積極參與交易，學習期貨交易技能，競賽活動結束後，將自有參與交易及有繳交心得報告之參賽隊伍隊員(學生)中隨機抽出 50 名，每名獲頒 7-ELEVEN 購物金 500 元。

三、成績公布

1. 競賽獎：活動網站專區將於競賽期間每週一公布截至上週五的競賽成績，其中夏普比率將於 11 月 21 日起開始公布。競賽獎最終成績排名訂於 112 年 1 月 6 日前公布。
2. 好學獎：競賽結束後由律師見證辦理抽獎，並於期交所網站公布得獎者姓名、學號與參賽隊伍名稱(個資將部分隱匿處理)。

玖、其他競賽規則

一、競賽時段僅限一般交易時段(日盤)，不包含盤後交易時段(夜盤)。

1. 盤前(8:30~8:45)下單：依期貨市場 8:45 集合競價開盤價格與數量，模擬見價、見量成交。
2. 盤中(8:45~13:45)下單：依期貨市場逐筆成交價量，及委買、委賣價量，模擬見價、見量成交。

二、起始資金(期初帳戶總市值)：競賽期間每競賽帳號起始資金為新臺幣 200 萬元，由系統自動給定，所有交易成本、保證金及交易損失均由此支應。競賽初始需點選「帳戶出入金」，將銀行帳戶之新臺幣 200 萬

元撥轉至新臺幣保證金帳戶，完成入金後始可交易。

三、保證金追繳與平倉

1. 各商品保證金以期交所公告之保證金收取標準為主。
2. 低於維持保證金，將以 e-mail 發出追繳通知，且需於 2 小時內補足至原始保證金，或自行選擇部位進行砍倉。2 小時後，若持續低於維持保證金且仍於交易時間內，系統將以市價單將帳戶所有部位全數平倉；若交易時間已結束，系統將於次交易日開盤時，以市價單將帳戶所有部位全數平倉。
3. 若保證金低於原始保證金 25%，系統將以市價單將帳戶所有部位全數平倉。

四、競賽期間如遇股票期貨標的證券公司事件(如除權息)，就契約調整生效日前留有部位者，其股票期貨契約調整方式說明如下：(此與實務作業模式不同，請留意)

1. 除息：契約調整方式為調整買賣方的「競賽銀行帳戶餘額」，金額為 2000 股(標準型契約)或 100 股(小型契約)受配發之現金。惟若調整後競賽銀行帳戶餘額出現負值情形，參賽者應於 2 個營業日內辦理保證金出金，使該數值為零或正值；如超過該期限仍為負值者，將喪失獲獎資格。
2. 其他公司事件(如除權、現金增資、減資等)：不進行契約調整，並於契約調整生效日前一日收盤後，由系統自動將該部位以當日結算價強制平倉，不計收期交稅及手續費。
3. 股票期貨契約調整訊息可至「期交所網站\交易制度\股票期貨/選擇權契約相關資訊」查詢。

五、交易稅與手續費

1. 期貨交易稅由系統自動計算扣除。
2. 交易手續費：本活動預設台股期貨每口新臺幣 100 元，小型臺指期貨、股票期貨及臺指選擇權每口新臺幣 50 元。

壹拾、得獎注意事項

一、競賽獎

1. 期交所將以 email 方式通知得獎，如因報名資料填寫不實或未收信，

致期交所無法通知得獎隊伍或得獎人時，期交所不負任何責任。

2. 團體獎金由每隊指派 1 位代表具領。依所得稅法規定，獎金超過新臺幣 20,000 元者，扣繳百分之 10 所得稅。另依印花稅法規定，領獎人須負擔獎金金額千分之 4 印花稅。
3. 得獎人應於期交所通知指定日期填具收據並於通知日起 1 個月內寄回收據，逾期視同放棄領取。

二、好學獎

1. 贈品兌換序號將以簡訊寄送至得獎人登錄報名填寫之手機號碼，得獎者憑序號至 7-ELEVEN 兌換。如因填寫錯誤致無法順利發送簡訊予得獎人，不得要求事後更正或重新傳送，請注意冒用他人資訊登錄報名藉機獲取贈獎將負法律責任。
2. 本獎項兌換期限為永久無期限，惟建議儘早兌換。

壹拾壹、 其他注意事項

- 一、如系統因為任何因素，導致價格錯誤、延誤、撮合機制失效，期交所得視情形，宣布某特定期間交易無效，並回到前一有效之交易結果，或宣布重新開賽或停止競賽，參賽者不得異議。
- 二、參賽者需瞭解期交所活動期間提供之虛擬交易所即時行情資訊，僅為模擬交易之用，不能做為使用者真實交易市場買賣的依據。模擬交易帳戶及交易成交情形等，均於模擬交易環境下所為，非真實交易市場，故倘須將模擬交易策略運用於真實交易，應審慎評估。
- 三、如有任何因電腦或不可歸責於期交所之事由，而使參賽者所登錄或傳輸之資料有遲延、遺失、錯誤、無法辨識或損毀之情況，致使參賽者無法參加本活動時，期交所不負任何責任，參賽者亦不得因此提出任何異議。
- 四、參賽者應遵守期貨市場相關法令及期交所規章。若參賽者涉有操縱期貨市場或有異常交易行為等不法情形，為保障競賽之公平，期交所除依相關規定辦理外，另將視情況取消參賽者競賽資格並剔除帳號，且追回已領取之獎項並保留求償權利。
- 五、期交所依據個人資料保護法向領獎人告知下列事項：領獎人提供予期交所所蒐集之姓名、身分證字號、電話、戶籍地址、金融機構帳號等

個人資料，期交所將於本活動及發送獎金之目的範圍內以書面或電子之形式處理或利用，至本活動結束且相關獎金發送等後續相關程序執行完畢及依法應保存之期間屆滿為止。就期交所所蒐集之上述個人資料，領獎人得向期交所要求查詢或請求閱覽、製給複本、補充或更正、停止蒐集、處理、利用或刪除之。惟領獎人若提出前述要求時，應自行承擔因此所生之損失或損害，包括但不限於期交所可能無法對領獎人提供獎金等相關服務。

六、參與本活動之得獎隊伍，同意期交所公布其隊伍名稱於期交所網站。

七、本活動辦法若有未盡事宜，期交所保有最終解釋權與增修權，以及取消、暫停、延長、修改、提前終止本活動之權利，並將最新消息公告於期交所網站。

八、客服專線

1. 系統設定及模擬交易相關問題：(02)2552-6004；客服信箱：sim-service@taifex.com.tw。
2. 活動辦法相關問題：(02)2369-5678 期交所交易部矯先生(分機 3121)、蘇先生(分機 3235)、王小姐(分機 3223)、楊先生(分機 3297)。

縱橫期海 Trader 就是你一大專院校模擬交易競賽 Part II

交易心得報告

一、心得注意事項

本交易競賽心得統一規範撰寫格式、項目、排版順序及各項字數要求，內文撰寫方向請詳見交易心得報告說明範例。

二、內文格式說明

內文:中文請用標楷體 12 號字體，英文請用 Times News Roman 12 號字體。

段落行距:請用固定行高 23 點，與前後段距離 0。

參考資料:均須附上資料來源(不列入字數計算)。

標題之層次編序為:「壹」、「一」、「(一)」、「1」、「(1)」，依此類推。

三、內容項目及次序

壹、參賽動機

貳、交易策略擬定

一、市場情勢分析

二、交易策略選擇

三、詳述交易策略

四、風險管理

參、交易策略檢討

一、交易策略結果

二、結論與建議

肆、交易心得

縱橫期海 Trader 就是你——大專院校模擬交易競賽 Part II
交易心得報告說明範例

隊名： 隊員： 指導老師：	
壹、參賽動機	<u>(100字)</u>
貳、交易策略擬定說明	一、 <u>市場情勢分析</u> （對市場最新資訊進行整體分析，以作為交易策略選定依據，請提供數值、圖表進行佐證，並附上資料來源。100字） 二、 <u>交易策略選擇</u> （分析比較各種交易策略，提出訂定本次交易策略原因。100字） 三、 <u>詳述交易策略</u> （交易原則、進出場時機等。100字） 四、 <u>風險管理</u> （該交易策略可能產生之風險評估，預計如何分散或預防。100字）
參、交易策略檢討	一、 <u>交易策略結果</u> （詳述本次交易結果。100字） 二、 <u>結論與建議</u> （可以單筆、多筆交易舉例說明此次交易策略優勢及需改進之處。100字）
肆、交易心得	<u>(100字)</u>

指導老師簽名：_____

中華民國 年 月 日