

臺灣期貨交易所

「113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽」 活動辦法

壹、主辦單位

臺灣期貨交易所（以下簡稱期交所）。

經濟日報

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「總獲利金額」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：113 年 4 月 1 日至 5 月 5 日；
- 二、競賽期間：初賽 113 年 5 月 13 日至 7 月 17 日(共計 47 個交易日)；複賽 113 年 8 月 5 日至 10 月 16 日(共計 51 個交易日)。

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。開賽前以隊長填寫之主要 email 寄送系統發出的競賽邀請連結信，請依流程完成帳號註冊及認證，該帳號將作為該隊的交易帳號。

伍、報名方式

- 一、自 113 年 4 月 1 日起，參賽者即可至本活動網站專區，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(請盡量留存手機，辦公室電話請留存完整分機)、email，請注意須為參賽隊伍該校老師；

(三) 參賽隊員：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；或經後續查證報名資料不符者，將無法獲得本活動獎項(包含競賽獎及好學獎)。

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，經報名審核通過後無法再做修改。

六、期交所統一於 5 月 10 日前由系統發出競賽邀請連結信至隊長主要 email 予符合參賽資格隊伍，參賽隊伍需先自行完成交易帳號註冊及驗證，並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 10 月 7 日至 10 月 20 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)，心得報告經審核後無法再做修改及上傳。

八、參賽隊伍如需參賽證明，自 113 年 11 月 1 日起至 114 年 11 月 1 日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，初複賽四類商品均須有交易紀錄：

1. 臺股期貨(近月及次近月契約)；

2. 小型臺指期貨(週契約、近月及次近月契約)；
3. 臺指選擇權(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、緯創期貨、陽明期貨、鴻海期貨、廣達期貨、群創期貨、宏基期貨、光寶科期貨、英業達期貨等 12 檔。

二、成交天數須各達初複賽競賽期間交易日二分之一以上，亦即初賽 24 天以上，複賽 26 天以上，其中部位到期自動結算及系統強制平倉不列入成交天數計算。

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新一代虛擬交易所，採即時行情模式。

二、本活動下單方式如下：

1. 期交所虛擬交易所網頁(web)，網址 <https://sim2.taifex.com.tw/>
2. 期交所虛擬交易所手機 App；
3. 程式交易，支援 MultiCharts、Python、Excel VBA 等程式下單工具，操作說明請至競賽首頁新手教學下載「程式交易下載」。

捌、競賽方式

一、競賽獎

本活動分為初賽及複賽兩階段進行，初賽結束正報酬隊伍取得進入複賽資格(如未足 50 隊，將排除未交易隊伍後依報酬率依序補足進入複賽)，複賽結束正報酬隊伍取得最終成績結算隊伍資格。

最終成績於初複賽競賽期間結束，依各參賽隊伍之「總獲利金額³⁾」、「夏普比率⁴⁾」計算競賽成績。

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：112 年 8 月至 113 年 1 月日均量達 3,500 口且為期交所公告之 113 年第 1 季股票期貨連結 TXO 手續費折減之造市標的。

³⁾ 總獲利金額=初賽獲利金額+複賽獲利金額，其中初(複)賽獲利金額=初(複)賽期末帳戶總市值—初(複)賽期初帳戶總市值。

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。

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、有繳交心得報告並審核通過隊伍之「夏普比率」前 30 名，再依「總獲利金額」排序取前 20 名獲獎，若未滿足則從缺。

1. 第 1 名：團隊獎金新臺幣(以下同)8 萬元，指導老師 3 萬元獎金；
2. 第 2 名：團隊獎金 7 萬元，指導老師 2.5 萬元獎金；
3. 第 3 名：團隊獎金 6 萬元，指導老師 2 萬元獎金；
4. 第 4 名：團隊獎金 5 萬元，指導老師 1.75 萬元獎金；
5. 第 5 名：團隊獎金 4.5 萬元，指導老師 1.5 萬元獎金；
6. 第 6 名：團隊獎金 4 萬元，指導老師 1.25 萬元獎金；
7. 第 7 名：團隊獎金 3.5 萬元，指導老師 1 萬元獎金；
8. 第 8 名：團隊獎金 3 萬元，指導老師 7 千 5 百元獎金；
9. 第 9 名：團隊獎金 2.5 萬元，指導老師 5 千元獎金；
10. 第 10 名：團隊獎金 2 萬元，指導老師 4 千元獎金；
11. 第 11 名：團隊獎金 1 萬元，指導老師 3 千元獎金；
12. 第 12 名：團隊獎金 1 萬元，指導老師 3 千元獎金；
13. 第 13 名：團隊獎金 1 萬元，指導老師 3 千元獎金；
14. 第 14 名：團隊獎金 1 萬元，指導老師 3 千元獎金；
15. 第 15 名：團隊獎金 1 萬元，指導老師 3 千元獎金；
16. 第 16 名：團隊獎金 8 千元，指導老師 3 千元獎金；
17. 第 17 名：團隊獎金 8 千元，指導老師 3 千元獎金；
18. 第 18 名：團隊獎金 8 千元，指導老師 3 千元獎金；
19. 第 19 名：團隊獎金 8 千元，指導老師 3 千元獎金；
20. 第 20 名：團隊獎金 8 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，將自符合交易四大類商品且初賽交易天數達二分之一以上及有繳交心得報告並審核通過之參賽隊伍隊員(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(最後一週之週一不公告成績)，倘遇國定假日遞延至次一工作日，其中夏普比率初賽將於6月17日起，複賽將於9月9日起開始公布。競賽獎最終成績排名訂於113年10月31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、虛擬起始資金(期初帳戶總市值)：初賽及複賽競賽期間每競賽帳號虛擬起始資金為新臺幣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」，將虛擬銀行帳戶之新臺幣200萬元撥轉至新臺幣保證金帳戶，完成入金後始可交易。

三、保證金追繳與強制平倉(此與實務作業模式不同，請留意)⁵

(一)保證金追繳檢核-盤中損益試算

- 1、依下列四個時段檢查計算持有庫存保證金帳務金額：
09:30~09:40；11:00~11:10；12:30~12:40；15:00~15:10。
- 2、權益數+未平倉損益(選擇權)小於維持保證金時，即對該帳號發出盤中保證金追繳通知。
- 3、遭追繳帳號須於兩個小時內補足保證金至原始保證金金額。
- 4、發出保證金追繳兩個小時內未補足至原始保證金金額，將會執行斷頭平倉，強制沖銷所有庫存部位。
- 5、帳戶風險指標低於25%，將會執行強制沖銷所有庫存部位。
- 6、風 險 指 標 計 算 公 式

⁵ 例如實務上由期貨商執行交易人之保證金控管與結算作業，盤中隨時進行交易人持有部位之損益計算作為判斷高風險通知原則。每日收盤後依結算價計算交易人總持有部位損益，交易人帳戶權益數低於維持保證金額度，期貨商將發出保證金追繳通知。(此處列舉，其他不同處請於實務作業時多加留意。)

$$\frac{\text{權益數} + (\text{未沖銷買方選擇權市值} - \text{未沖銷賣方選擇權市值})}{\text{原始保證金} + (\text{未沖銷買方選擇權市值} - \text{未沖銷賣方選擇權市值})}$$

(二)保證金追繳檢核-盤後損益試算

- 1、結算作業後系統執行盤後損益試算，權益數+未平倉損益(選擇權)小於維持保證金時，即對該帳號發出盤後保證金追繳通知。
- 2、遭追繳帳號須於隔日 12:00 前補足至原始保證金金額。
- 3、若未於隔日 12:00 補足至原始保證金金額，將會執行斷頭平倉，強制沖銷所有庫存部位。

(三)其他解除保證金追繳之情形

因行情變化或自行沖銷部分部位等，致權益數等於或大於未沖銷部位所需原始保證金時；或補繳時限前，交易人前一日盤之未沖銷部位已全數沖銷，盤後保證金追繳得予解除。

四、交易稅與手續費

1. 期貨交易稅依各商品期交稅率，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。
4. 前 20 名獲獎隊伍之交易心得報告，期交所將擇優於活動網站專區、臺灣期貨雙月刊進行公開或刊登，供大專院校師生學習觀摩。請於接獲得獎通知 1 個月內，由隊長代表填具「著作權讓與同意書」(詳本辦法第 11-12 頁)，以 email 回覆 pdf 掃描檔，並隨收據一併寄回正本。
5. 前 20 名獲獎隊伍之參賽同學，有志從事期貨業者，請於接獲得獎通知 1 個月內，填具「就業媒合個人資料告知暨同意事項書」及「就業

媒合申請表」(詳本辦法第 13-14 頁)，以 email 回覆 pdf 掃描檔，並隨收據一併寄回正本，期交所將於賽後提供名單予期貨公會，由其轉發與其會員，做為就業媒合之參考。

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

- 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活動網站專區。

七、本比賽將統計各校報名成功隊伍數、實際參與交易隊伍數及前 20 名獲獎隊伍數，列入期貨市場貢獻鑽石獎評比之一。

八、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。

九、客服專線

1. 系統設定及模擬交易相關問題：(02)8792-8000；客服信箱：
vexch@mail.apex.com.tw。

2. 活動辦法相關問題：(02)2369-5678 期交所交易部王小姐(分機 3223)、
矯先生(分機 3121)、蘇先生(分機 3235)。

113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽

交易心得報告

二、心得事項

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。

三、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。

四、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

113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽
交易心得報告說明範例

隊名： 隊員： 指導老師：	
壹、參賽動機	(100-200 字)
貳、交易策略擬定說明	一、市場情勢分析（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。100-200 字） 二、交易策略選擇（分析比較初複賽交易策略異同處，提出訂定異同交易策略原因。100-200 字） 三、分別詳述初複賽交易策略（交易原則、進出場時機等。100-200 字） 四、風險管理（初複賽交易策略可能產生之風險評估，預計如何分散或預防。100-200 字）
參、交易策略檢討	一、交易策略結果（詳述初複賽交易結果。100-200 字） 二、結論與建議（可以單筆、多筆交易舉例說明初複賽交易策略優勢及需改進之處。100-200 字）
肆、交易心得	(100-200 字)

指導老師簽名：_____

中華民國 年 月 日

著作權讓與同意書

立書人 ○○○（以下稱乙方）願將其所有本同意書標的著作財產權讓與臺灣期貨交易所股份有限公司(受讓人，以下稱甲方)，並同意下列事項：

一、 讓與標的

乙方願將其所著作之大專院校模擬交易競賽交易心得報告（以下稱本著作，如附件）之著作財產權無償讓與給甲方。

二、 不利行為之禁止

乙方自本同意書成立後，不得將本著作全部或一部自行或委託他人發表，或另行變更本著作名稱而另行發表或編輯，及為其他不利於甲方之行為。

三、 權利瑕疵擔保及協助訴訟義務

乙方聲明並保證本著作之原創性，且無抄襲、誹謗、不法或侵害他人智慧財產權之情事，並擔保對本著作有讓與著作財產權之權利。乙方並擔保本著作之內容並無不法侵害他人權利或著作權之情事。若乙方違反本條之擔保事項而致甲方遭受損害時，甲方得隨時解除本同意書並向乙方請求損害賠償。

甲方如因本同意書標的遭致任何第三人控訴其侵害著作權及其他相關權利時，應立即以書面通知乙方，乙方有協助處理解決之義務。如最後經法院確定判決或經甲方認可之和解，甲方應賠償該第三人時，乙方應賠償甲方因此所遭致之一切損害（包括但不限於對第三人之賠償、律師費用等）。

四、 損害賠償

乙方若有違本同意書各條款之情事，應賠償甲方因此所遭受之損害。

五、 補充及解釋

本同意書若有未盡事宜或不明之處，依著作權法及其他相關法令定之。

六、 爭端之解決與管轄法院

乙方同意，對因本同意書所引發之一切糾紛，應本誠信原則解決之。如有訴訟之必要，以台北地方法院為第一審管轄法院。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

立書人：○○○

身分證字號：

住址：

中 華 民 國 ○ ○ 年 ○ ○ 月 ○ ○ 日

113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽

就業媒合個人資料告知暨同意事項書

期交所辦理「113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽」就業媒合活動，必須蒐集、處理及利用參與者的個人資料，期交所依中華民國個人資料保護法及主管機關相關法令規定，將告知參與者以下事項：

- (一) 蒐集個人資料公司：期交所。
- (二) 蒐集之目的：期交所為辦理「113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽」就業媒合活動。
- (三) 蒐集之個人資料項目：參加者之姓名(c001)、電子郵件地址(c001)、連絡電話(c001)、學校科系與年級(c051)、證照(c052)。
- (四) 個人資料利用之期間：自參加者參與本活動起至就業媒合活動等後續相關程序執行完畢。
- (五) 個人資料利用之地區：臺灣。
- (六) 個人資料利用之單位：期交所、期貨公會、期貨公會之會員及其他依法必須提供資料之單位。
- (七) 個人資料利用之方式：期交所於辦理本活動之特定目的必要範圍內，以書面或電子之形式處理或利用。
- (八) 依個人資料保護法第三條規定得行使之權利及方式：參與者得向期交所承辦本業務單位提出申請，以查詢、閱覽、製給複製本；或補充、更正、請求停止蒐集、處理、利用或刪除個人資料內容之一部或全部。惟若參與者不願意提供資料予期交所，則無法參與就業媒合活動，期交所則不提供名單予期貨公會及其會員參考。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

姓名：_____ (簽名)

姓名：_____ (簽名)

姓名：_____ (簽名)

姓名：_____ (簽名)

姓名：_____ (簽名)

中 華 民 國 年 月 日

113 年縱橫期海 Trade Like a Pro—大專院校模擬交易競賽 就業媒合申請表

學校:

日期: 年 月 日

申請人 1	姓名		聯絡/行動電話	
	系/級		EMAIL	
	證照:			
	簽名:	欲從事期貨職 務類別(可複選)	<input type="checkbox"/> 業務 <input type="checkbox"/> 交易 <input type="checkbox"/> 結算 <input type="checkbox"/> 分析 <input type="checkbox"/> 內勤 <input type="checkbox"/> 資訊 <input type="checkbox"/> 永續 <input type="checkbox"/> 其他:	
申請人 2	姓名		聯絡/行動電話	
	系/級		EMAIL	
	證照:			
	簽名:	欲從事期貨職 務類別(可複選)	<input type="checkbox"/> 業務 <input type="checkbox"/> 交易 <input type="checkbox"/> 結算 <input type="checkbox"/> 分析 <input type="checkbox"/> 內勤 <input type="checkbox"/> 資訊 <input type="checkbox"/> 永續 <input type="checkbox"/> 其他:	
申請人 3	姓名		聯絡/行動電話	
	系/級		EMAIL	
	證照:			
	簽名:	欲從事期貨職 務類別(可複選)	<input type="checkbox"/> 業務 <input type="checkbox"/> 交易 <input type="checkbox"/> 結算 <input type="checkbox"/> 分析 <input type="checkbox"/> 內勤 <input type="checkbox"/> 資訊 <input type="checkbox"/> 永續 <input type="checkbox"/> 其他:	
申請人 4	姓名		聯絡/行動電話	
	系/級		EMAIL	
	證照:			
	簽名:	欲從事期貨職 務類別(可複選)	<input type="checkbox"/> 業務 <input type="checkbox"/> 交易 <input type="checkbox"/> 結算 <input type="checkbox"/> 分析 <input type="checkbox"/> 內勤 <input type="checkbox"/> 資訊 <input type="checkbox"/> 永續 <input type="checkbox"/> 其他:	
申請人 5	姓名		聯絡/行動電話	
	系/級		EMAIL	
	證照:			
	簽名:	欲從事期貨職 務類別(可複選)	<input type="checkbox"/> 業務 <input type="checkbox"/> 交易 <input type="checkbox"/> 結算 <input type="checkbox"/> 分析 <input type="checkbox"/> 內勤 <input type="checkbox"/> 資訊 <input type="checkbox"/> 永續 <input type="checkbox"/> 其他:	