

## 2010 大葉財金巴菲特接班人PK賽

一、活動目的：為達金融知識普及之目標，希望透過虛擬交易所資訊系統的輔助，鼓勵同學實際參與操作，透過寓教於樂的方式，學習證券市場金融資產配置，並體驗金融世界運作可能面對的風險。藉由金融交易平台真實情境的模擬過程，加強同學金融知識的養成，提升財金決策能力及理財知識，因應未來財金專業的需求。

二、活動對象：財務金融學系、管理學院學士班學生。

三、活動期間

報名日期 99/03/15(一)~04/02(五)

試玩期間 99/04/08(四)~04/16(五)

競賽期間 98/04/19(一)~05/28(五)，六週

四、報名方式：請傳送(mailto:fm5190@mail.dyu.edu.tw)系/年/班、學號、姓名、電話及電子郵件信箱等資料至系上索取競賽帳號、密碼。財金系教師任課班級請見系網站公告使用帳號及密碼。

五、競賽獎勵：各組(A 基金、B 基金)前三名獎勵如下述示。

第一名 獎金 3,000 元 / 獎狀乙紙

第二名 獎金 2,000 元 / 獎狀乙紙

第三名 獎金 1,000 元 / 獎狀乙紙

優選五名 隨身碟 4G 一支 / 獎狀乙紙

管院學士班學生可認抵「管理服務實習」時數 20 小時

(同學於活動結束後，持交易紀錄等相關證明文件洽財金系辦理)

六、活動參與注意事項

### (一)參賽者注意事項

- 1.本活動 1 人 1 帳號，不得重覆報名。活動須由本人使用參賽帳戶進行競賽，不得利用他人名義或假他人之手為之，違反相關規定者，主辦單位有權撤銷其參賽及獲獎資格。
- 2.參賽者必須遵循活動辦法及交易規則進行模擬交易競賽。
- 3.如因不可抗拒因素致本活動無法進行，或電腦系統故障致比賽延後或終止，主辦單位得隨時修正、暫停或終止本活動之權利，並公告於主辦單位網站。
- 4.主辦單位保留核准參賽及獲獎之權利。

### (二)優勝者注意事項

- 1.得獎者於 99/06/04(五)前攜帶本人之學生證洽財金系辦領取，如身份不符或逾期者視同放棄獎項。
- 2.前三名須於規定日期(99/06/04)繳交『競賽心得報告』(含投資組合標的、操作策略、投資理念、風險管理方式及參賽心得等)，檔案利用電子郵件寄至 fm5190@mail.dyu.edu.tw。

七、活動內容及實施方式

(一)一人一帳號，進行投資組合競賽。

(二)競賽期間為期六週 98/04/19(一)~05/28(五)，試玩期間 98/04/08(四)~04/16(五)。

(三)各組參賽隊伍可同時管理「2 支」基金，分別為：

- 1.選股績效基金(A 基金)

## 2. 槓桿避險基金(B 基金)

(四)各組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	規則
A 基金	股票	投資上市、櫃股票	NT.10,000,000	1
B 基金	期貨	利用槓桿交易進行操作	NT.10,000,000	2

### 1. 選股績效基金(A 基金)

- (1)投資標的為上市、櫃股票。
- (2)競賽投資標的均須考慮交易成本，股票的交易稅千分之3，手續費千分之1.425。
- (3)可融資、融券。

### 2. 槓桿避險基金(B 基金)

- (1)投資標包含台指相關期貨(台指期、金融期、電子期、小臺指，不含債券期貨)。
- (2)競賽投資標的均須考慮交易成本，期貨的交易稅千分之0.1，手續費每口120元。

(五)違反規則：

- 1.違反規則，情節嚴重者，主辦單位得取消其參賽資格。
- 2.競賽期間至少1次交易紀錄，未符合者，不列入各基金競賽排名。

(六)競賽結果排名：競賽結果排名依據各基金比賽結束之「總報酬率」高低依序排名，總報酬率相同者以波動率較低者者勝出，結果排名公佈在活動網站。

(七)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：每日交易日期之現貨交易時間為上午9：00至下午1：30，期貨交易時間為上午8：45至下午1：45。
- 3.交易場所：透過網際網路進入「虛擬交易所」網頁，即為及文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)掛單數量大於市場實際成本數量者，請見「流動性限制」。
  - (4)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，依市場實際行情，每五分鐘撮合一次。
  - (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)台灣上市、上櫃公司股票；

(2)台指相關期貨(台指期、金融期、電子期、小臺指，不含債券期貨)

7.買賣方式：股票可以進行融資、融券買賣，不考慮公司目前是否有資券餘額。

8.掛單類別：可選擇「市價單」或「限價單」。

9.融資、融券的保證金：

(1)融資保證金成數上市、上櫃分別為『四成』與『五成』，融券保證金成數上市、上櫃皆為『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。

10.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：

A.融資買進之部位必須以融券賣出的方式沖銷。

B.融券賣出之部位必須以融資買進的方式沖銷。

(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。

11.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。

12.各持股成本計算：採平均成本法。

13.流動性限制：有五分鐘成交張數的限制，因此不限制蜜月期股票買賣，例如：10：00~10：05 中威盛(2388)於市場實際成交張數為 200 張，若掛單數量為在本系統掛威盛(2388)300 張的委買或委賣單，系統最多只會讓你成交 200 張，其餘 100 張等下次再進行撮合。

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：

A.台股期貨：原始保證金 77,000 元，維持保證金 59,000 元；

B.電子期貨：原始保證金 63,000 元，維持保證金 48,000 元；

C.金融期貨：原始保證金 64,000 元，維持保證金 49,000 元；

D.小型臺指期貨：原始保證金 19,250 元，維持保證金 14,750 元。

E.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.競賽成績公布：每日下午 4：00 之後。

(八)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，抑或狀況無法立即排除時，終止比賽。
- 2.如因不可抗拒因素致本活動無法進行，或電腦系統故障致比賽延後或終止，主辦單位得隨時修正、暫停或終止本活動之權利，並公告於主辦單位網站。
- 3.以上競賽未載明之事項，若有例外狀況，將以主辦單位反應為主。

