

「期貨商交易及風險控管機制專案」各項議題彙整表之「壓力測試」及「加強服務事項」修正對照表

112.6

項目	修正後決議事項	修正前決議事項	修正說明
壓力測試	期貨商應每日進行壓力測試作業，並將測試結果依內控中所擬定之通知時機、通知對象與通知方式辦理。	期貨商應每日進行壓力測試作業，並將測試結果依內控中所擬定之通知時機、通知對象與通知方式辦理。	一、期貨商應將壓力測試結果通知之時機、通知對象與通知方式明訂於內控中。 二、 <u>為瞭解交易人於一般交易時段及盤後交易時段部位異動產生之風險變化，期貨商應分別於二時段收盤後進行壓力測試，並於壓力測試作業後，依前述內控之內容辦理。</u>
加強服務事項	<p><u>遇國際重大事件，提醒交易人注意之服務</u></p> <p>一、辦理時機： 遇國際主要市場出現重大事件導致當地證券市場價格巨幅波動時，會員公司得於次一營業日 8:30 前增加提醒交易人注意之服務。</p> <p>二、通知內容至少應有： 1、提醒交易人注意權益數的變化。 2、提醒交易人因市場價格波動可能產生鉅額損失之風險。</p>	<p>一、辦理時機： 遇國際主要市場出現重大事件導致當地證券市場價格巨幅波動時，會員公司得於次一營業日 8:30 前增加提醒交易人注意之服務。</p> <p>二、通知內容至少應有： 1、提醒交易人注意權益數的變化。 2、提醒交易人因市場價格波動可能產生鉅額損失之風險。</p>	<p>遇國際主要市場出現重大事件導致當地證券市場價格巨幅波動時，為提醒交易人次一營業日可能發生的行情變動及風險，會員公司得於次一營業日 8:30 前增加提醒交易人注意之服務。</p>
	<p><u>盤後交易時段，對交易人風險警示之服務</u></p> <p>一、<u>辦理時機：</u> <u>盤後交易時段除高風險帳戶通知外，會員公司應依交易人申請，於交易人帳戶權益</u></p>		<p><u>一、為使帳戶僅留有期交所指定豁免代為沖銷商品未沖銷部位之交易人，於盤後交易時段也可收到期貨商風險警示提醒，以</u></p>

項目	修正後決議事項	修正前決議事項	修正說明
	<p><u>數低於維持保證金且僅有期交所指定豁免代為沖銷之商品或其他與交易人約定警示條件時，增加提醒交易人注意風險之服務。</u></p> <p><u>二、通知方式：</u> <u>以電話、簡訊或其他交易人指定之方式通知交易人。</u></p> <p><u>三、通知內容：</u></p> <p><u>1、提醒交易人帳戶已達約定警示條件及注意權益數變化。</u></p> <p><u>2、風險警示服務通知內容，應與高風險帳戶通知有明顯區別。</u></p>		<p><u>注意其盤後交易時段帳戶損益風險變化及採取因應措施，會員公司應依交易人申請，於盤後交易時段提供風險警示之服務。</u></p> <p><u>二、盤後交易時段提供風險警示通知之服務，與期貨商辦理高風險帳戶通知，當帳戶風險指標達約定代為沖銷條件時，期貨商將開始執行代為沖銷程序，兩類通知應採行之措施不同，通知內容應有明顯區別。</u></p>
C	<p><u>一般交易時段開盤前，提供交易人查詢以盤後交易時段收盤價計算之模擬帳戶風險資訊</u></p> <p><u>一、辦理時機：</u> <u>期貨商於一般交易時段開盤前，應提供交易人查詢以盤後交易時段收盤價計算之模擬帳戶風險資訊。</u></p> <p><u>二、查詢內容：</u></p> <p><u>1、以盤後交易時段收盤價計算之模擬帳戶風險資訊應至少包括權益數、權益總值、原始保證金及維持保證金等資料。</u></p> <p><u>2、本項模擬帳戶風險資訊應與其他資訊明顯區隔，並說明各項資訊代表意涵。</u></p>		<p><u>為提醒交易人注意，倘一般交易時段開盤，延續盤後交易時段收盤行情時，其帳戶可能發生之風險變化，並預為採取因應措施，會員公司應提供以盤後交易時段收盤價計算之模擬風險資訊服務。</u></p>