

# 中華民國期貨業商業同業公會 槓桿交易商自律規則

金融監督管理委員會 101 年 11 月 13 日

金管證期字第 1010044173 號函准予備查

- 第一條 本規則依據期貨業商業同業公會管理規則第五條規定訂定之。
- 第二條 為提昇槓桿交易商從事槓桿保證金契約交易品質，並確保交易相對人權益，特訂定本自律規則。
- 第三條 本自律規則所稱之交易相對人，係指除槓桿交易商管理規則（以下簡稱管理規則）第十四條所稱之專業機構投資人以外之客戶。
- 第四條 槓桿交易商與交易相對人從事槓桿保證金契約交易時，除確實遵循管理規則及財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心槓桿交易商經營槓桿保證金契約交易業務規則（以下簡稱業務規則）及其相關規定外，並應落實對交易相對人適格性之評估，其內容至少應包括交易相對人之風險承受度等級、商品之風險等級及業務人員專業資格要求等，以確保交易相對人之權益。
- 第五條 槓桿交易商與交易相對人從事槓桿保證金契約交易前，應訂定充分瞭解交易相對人之評估作業程序。其內容至少應包括下列事項：
- 一、交易相對人基本資料之建置：交易相對人身分與基本背景資料、從事行業與資產來源、及其他有關交易相對人信用之資料。
  - 二、交易相對人交易能力之評估：槓桿交易商與交易相對人交易時，除參考前款資料外，應綜合考量下列事項：
    - （一）交易相對人資金操作狀況及專業能力。
    - （二）交易相對人之交易屬性及其對風險之瞭解。
  - 三、交易相對人評估資料之更新：槓桿交易商於更新交易相對人評估資料時，應依下列事項辦理：
    - （一）槓桿交易商更新交易相對人資料，應注意交易相對人財務狀況之變動。
    - （二）槓桿交易商重新評估交易相對人交易能力，應配合交易相對人資料之變動及其他有關佐證資料。

四、大額交易核准程序之訂定：槓桿交易商得自行依據經營策略，訂定一定金額以上之大額交易核准程序。

第六條 槓桿交易商應依交易相對人風險承受度，提供適當風險等級之槓桿保證金契約。

槓桿交易商評訂前項風險等級，應考量個別槓桿保證金契約交易之風險特性、設計複雜度及期限等因素。

第七條 槓桿交易商應善盡風險預告之義務，充分提供槓桿保證金契約風險預告相關說明予交易相對人，並不得有誤導交易相對人之情事。

第八條 槓桿交易商從事結構型商品契約交易應進行下列作業程序：

- 一、評估交易相對人從事結構型商品契約交易之適當性。
- 二、評估結構型商品契約之交易假設及其風險報酬之合理性。
- 三、評估影響交易相對人報酬之市場或其他各種因素。
- 四、評估結構型商品契約成本之合理性與費用之透明度。
- 五、交易相關文件應描述商品特性及揭露其風險。
- 六、結構型商品契約之名稱應適當表達其商品特性與風險，避免使用可能誤導交易相對人之名稱。

槓桿交易商應就前項作業程序留存書面紀錄。

第九條 本公會於必要時，得請槓桿交易商於一定期間內，提供或提示所需相關資料或作必要之說明，槓桿交易商不得拒絕。

第十條 槓桿交易商違反本自律規則之規定者，依本公會章程及會員自律公約之規定辦理。

第十一條 本自律規則經本公會理監事聯席會議通過並陳報目的事業主管機關備查後，公告施行，修正時亦同。