

檔 號：
保存年限：

中央銀行 函

地址：10066 台北市中正區羅斯福路1段2號
承辦人：陳建道
電話：02-23571199
傳真：02-23571959
電子信箱：

受文者：中華民國期貨業商業同業公會

發文日期：中華民國104年6月18日
發文字號：台央外伍字第1040022531號
速別：最速件
密等及解密條件或保密期限：
附件：

主旨：貴會為臺灣期貨交易所規劃推出「美元兌人民幣匯率期貨」，函請本行就主管外匯業務表示意見乙案，復如說明，請查照。

說明：

- 一、復貴會104年6月2日金管證期字第1040020561號函。
- 二、本行同意臺灣期貨交易所（下稱期交所）同時推出「小型美元兌人民幣匯率期貨」及「美元兌人民幣匯率期貨」2項匯率期貨商品，嗣後如擬開放其他人民幣計價期貨商品，請先洽會本行。本案相關結匯事宜應辦理如下：
 - （一）交易人從事本案商品交易所需之原始保證金，由交易人以自有人民幣繳交；交易人期貨部位建立後之人民幣保證金追繳及虧損，得以其他幣別繳交，經由期貨商客戶保證金專戶結匯為人民幣。
 - （二）交易人從事期貨交易如發生違約情事，得由期貨商將該交易人於期貨商客戶保證金專戶之資金餘額（含人民幣）結匯為違約應支付幣別，以支應違約應付之保證金。
- 三、同意增列人民幣為外資從事國內期貨交易之保證金繳存幣別，外資帳上自有人民幣超額保證金，比照其他外幣依「華僑及外國人從事期貨交易應行注意事項」相關規定辦理。



1040002611

四、期交所及期貨經紀商因辦理本案商品業務之需，向外匯指定銀行申請人民幣貸款，應依下列規定辦理：

(一)貸款用途限於：

1、時差或國外長假等外幣匯款延遲。

2、天災、暴動、戰亂、選舉或作業程序延宕等緊急狀況。

3、期貨經紀商或交易人違約事件等情形。

(二)憑辦文件：檢具本函影本及保證金追繳文件。

(三)兌換限制：人民幣貸款不得兌換為新臺幣。

五、基於市場管理，有關期交所與臺北外匯經紀股份有限公司之資訊交換，依據臺北外匯經紀股份有限公司訂定之「美元兌人民幣匯率市場監視及異常處理作業程序」及「美元兌人民幣匯率市場內部查核作業規範」辦理。

六、比照國內美元計價期貨商品前例，期貨經紀商、期貨自營商及期貨交易輔助人依法從事本案商品相關業務，無須逐案向本行申請許可，請貴會將得辦理上述業務之期貨經紀商、期貨自營商及期貨交易輔助人名冊函送本行備查，如有變動時亦請更新之。上開業者如有違反外匯法令與貨幣政策情事，本行得洽請貴會、期交所或相關自律機構，依相關法令或自律規範為適當之處置。

七、查案附規劃方案包括銀行業以法人機構身分依期交所「造市者作業辦法」擔任本案商品之造市商，銀行本身雖未從事期貨經紀業務，惟仍涉及外匯業務之經營，為應外匯業務管理需要並考量簡化作業程序，爰同意未取得兼營期貨商業許可之銀行業從事本案商品造市業務，無須逐案向本行申請許可，請期交所審查造市商資格同意後，於函復該等造市銀行時副知本行。

八、另請期交所按月編製人民幣計價期貨商品報表函送本行參

考。

正本：金融監督管理委員會

副本：臺灣期貨交易所股份有限公司、中華民國期貨業商業同業公會(請轉知所屬會員)

電學公版1度換微記

裝

訂

線

