

檔 號：

保存年限：

中華民國期貨業商業同業公會 函

地址：10688台北市大安區安和路一段27號12樓

聯絡人：謝美惠

聯絡電話：02-8773-7303 分機816

電子郵件：bonnie@futures.org.tw

傳 真：02-2772-8378

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國107年5月16日

發文字號：中期商字第1070001993號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：附件1及附件2

主旨：本公會就「107年2月6日期貨市場大幅下跌期貨商代為沖銷與交易人間爭議事件」辦理之相關事項，針對第二階段實施之項目及日期，詳如說明，請 查照。

說明：

一、依據107年4月20日召開之第5屆理監事第11次聯席會議報告事項辦理。

二、茲就第二階段實施項目（共計五項）及實施日期，說明如下：

（一）未提供符合期貨商要求之徵信資料或財力證明之自然人或一般法人交易人，其使用之總保證金不得超過新台幣50萬元乙節，自8月1日起實施，既有客戶則自10月1日起實施。

（二）分類分級加收保證金比例限制之調整乙節，自8月1日起實施，既有客戶則自10月1日起實施。

（三）自然人及一般法人從事較不具流動性之商品加收保證金（附件1）乙節，自8月1日起實施。

（四）新增執行代為沖銷之相關作業乙節，自8月1日起實施。

(五)風險指標加入垂直價差交易註記功能(附件2)乙節,自10月1日起實施。

三、配合上開事項之實施,若涉及受託契約內容變更,請各公司依受託契約所記載之約定方式辦理。

四、為使交易人瞭解各項作業,請各公司儘速透過以下方式告知交易人,並留存告知紀錄:

(一)於買賣報告書或對帳單增列告知內容。

(二)於交易人登入下單網頁時告知。

(三)以書面方式告知。

(四)以電子郵件方式告知。

(五)以其他與交易人約定之方式告知。

正本:全體會員公司

副本:金融監督管理委員會證券期貨局、臺灣期貨交易所股份有限公司(均含附件)