中華民國期貨業商業同業公會

「期貨交易人採行整戶風險保證金計收方式自律規則」

| 條 次 | 條文內容 |
| --- | --- |
| 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 | 本公會會員受託從事期貨交易對期貨交易人採行整戶風險保證金計收方式(以下簡稱SPAN)之管理，除其他法令規章另有規定者外，應依本規則之規定辦理。  |
| 第三條 | 申請採行SPAN之期貨交易人，應具備下列資格條件之一：一、主管機關依金融消費者保護法第四條第二項函令所定之專業投資機構。二、法人具國外期貨交易所會員資格或造市資格，或為國外期貨交易所流動量提供者。前項第二款之國外期貨交易所，以主管機關依期貨交易法第五條公告期貨商得受託從事國外期貨交易之交易所為限。 |
| 第四條 | 本公會會員受託從事期貨交易對期貨交易人採行SPAN，應先與期貨交易人簽定約定書，載明「委託下單控管方式」、「保證金追繳」及相關權利義務等事項。 |
| 第五條 | 本公會會員受託從事期貨交易對交易人採行SPAN，應依臺灣期貨交易所(以下簡稱期交所)以策略基礎制度計算之原始保證金數額向期貨交易人收足，始得接受期貨交易之委託。對交易人收取之未沖銷部位所需保證金數額不得低於以SPAN計算之原始保證金數額。  |
| 第六條 | 本公會會員與期貨交易人簽定約定書，應提醒期貨交易人下列事項： 一、期貨交易人未沖銷部位所需之保證金數額不得低於以SPAN計算之原始保 證金數額。 二、在大部分情況下，以SPAN計算之保證金低於以策略基礎計算之保證金，惟仍有少部分情況，前者計算之保證金將略高於後者計算之保證金，此係合理反映部分風險所致。 三、期貨交易人之未沖銷部位可形成跨商品或跨月組合者，當一部分部位因了結或到期而不再形成組合部位，將可能發生所需保證金增加或追繳之情形。 四、期貨交易人之當日沖銷交易部位，應依期交所公告之期貨契約當日沖銷交易保證金計收標準計收保證金，其盤中當日沖銷交易之未沖銷部位，不併入一般非當日沖銷交易之未沖銷部位以SPAN計算保證金。 |
| 第七條 | 期貨交易人權益數低於以SPAN所計算之維持保證金數額者，本公會會員應依雙方簽定之受託契約、SPAN約定書及期交所有關保證金追繳之規定通知期貨交易人。 |
| 第八條 | 本規則經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。 |