

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：游大慶

聯絡電話：02-8773-7303 分機815

電子郵件：dachin@futures.org.tw

傳 真：02-2772-8378

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國106年6月7日

發文字號：中期商字第1060002423號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：來函及相關附件

主旨：轉知主管機關核定之「期貨顧問事業販售期貨顧問商品，使客戶得以具自動執行委託下單功能之期貨顧問軟體從事下單，應遵循之原則」，請 查照，遵照辦理。

說明：依金融監督管理委員會證券期貨局106年5月31日證期（期）字第1060017098號函（如附件）辦理。

正本：各期貨顧問事業

副本：金融監督管理委員會證券期貨局(含附件)

檔 號：
保存年限：

金融監督管理委員會證券期貨局 函

地址：台北市新生南路1段85號
聯 絡 人：巫小姐
聯絡電話：02-27747312
傳 真：02-87734158

受文者：中華民國期貨業商業同業公會

發文日期：中華民國106年5月31日
發文字號：證期(期)字第1060017098號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：普通
附件：如文(A45020000DORGUNIT106053100170980A0B17098.PDF)

主旨：有關貴公會所陳「期貨顧問事業販售期貨顧問商品，使客戶得以具自動執行委託下單功能之期貨顧問軟體從事下單，應遵循之原則」乙案，請依說明事項辦理，請查照。

說明：

- 一、復貴公會106年5月5日中期商字第1060001652號函。
- 二、為避免期貨顧問事業未經客戶同意任意更動自動下單程式之策略或參數，致衍生期貨顧問事業為客戶全權委託代操之疑慮，旨揭應遵循之原則，調整部分內容如附件，請轉請各期貨顧問事業共同遵循辦理。

正本：中華民國期貨業商業同業公會
副本：臺灣期貨交易所股份有限公司

電話公啟交換識記



1060002423

期貨顧問事業販售期貨顧問商品，使客戶得以具自動執行委託下單功

能之期貨顧問軟體從事下單，應遵循之原則

- 一、期貨顧問事業與客戶簽訂契約前，應充分瞭解客戶之相關資料，以確保提供之服務對客戶之適合度，並應向客戶告知其所提供商品之性質，例如策略內容及特性等；與客戶簽訂契約後，非踐行上開客戶告知程序並經客戶同意，不得變更原提供商品策略內容或參數。
- 二、期貨顧問事業提供上開商品之策略內容前應先作成交易分析報告（含參數），載明分析基礎及根據，變更時亦同；前開商品之策略內容及參數，及觸發下單之電腦運算結果與期貨顧問軟體發送訊號建議下單內容，彼此間可相互驗證，並應留存相關資料及電腦軌跡，以利事後勾稽及糾紛解決。
- 三、有關商品交易訊號觸發，轉為自動執行委託下單之功能，應由客戶自行設定啟閉，且自動執行下單委託不得由期貨顧問事業之IP 位置發出。
- 四、期貨顧問事業應對客戶說明使用軟體或自動執行委託下單可能產生之風險（例如：客戶可能面臨斷線、斷電、網路壅塞、個人電腦或裝置異常、啟用自動執行委託下單後，客戶若中斷自動執行將影響策略執行有效性進而可能產生交易損失的風險..等不確定因素或其他功能限制）。