

正本

臺灣期貨交易所股份有限公司 公告

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：許淑琇

聯絡電話：(02)2369-5678分機118

100

臺北市羅斯福路二段100號14樓

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國102年6月6日

發文字號：台期監字第10200017140號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：A_1020605_修正條文對照表(公告版)

主旨：公告修正本公司「市場部位監視作業辦法」第4條，並自即日起實施。

依據：金融監督管理委員會102年6月3日金管證期字第1020022199號函。

公告事項：修正本公司「市場部位監視作業辦法」第4條，修正條文對照表詳如附件，並自即日起實施。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、保管機構、行情資訊廠商、本公司網站

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、臺灣集中保管結算所股份有限公司、法源資訊股份有限公司、博仲法律事務所、台北國際金融資訊協會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、記者室、本公司各部門

總經理 **王中愷**

臺灣期貨交易所股份有限公司
「市場部位監視作業辦法」修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第四條</p> <p><u>期貨交易人於單一期貨商持有之未沖銷部位逾越前條所訂標準者，本公司得採取下列措施：</u></p> <p>一、<u>通知期貨商限期補正或改善。</u></p> <p>二、<u>依逾越人次各課以違約金新台幣一萬元以上五萬元以下，經通知補正或改善，逾期未補正或改善者，按日依人次加罰違約金新台幣一萬元至補正或改善日止。</u></p> <p>三、<u>通知所屬結算會員。</u></p> <p>四、<u>通報主管機關期貨交易人部位逾越情形。</u></p> <p><u>期貨交易人未沖銷部位逾越前條所訂標準者，經通知期貨商停止新增部位，其仍受託新增部位或自行買賣新增部位者，本公司得採取前項各款措施。</u></p> <p>綜合帳戶下個別交易人未沖銷部位逾越前條所定標準者，本公司得採取下列措施：</p> <p>一、<u>通知期貨商限期補正或</u></p>	<p>第四條</p> <p>期貨交易人未沖銷部位逾越前條所訂標準者，本公司得採取下列措施：</p> <p>一、<u>單一期貨商受託成交或自行買賣逾越部位限制者，依逾越人次各課以違約金新台幣二萬元，並通知限期補正或改善，逾期未補正或改善者，按日依人次加罰一萬元至補正或改善日止。</u></p> <p>二、<u>通知期貨商停止新增部位，其仍受託新增部位或自行買賣新增部位者，依人次課以違約金新台幣二萬元，經通知補正或改善，逾期未補正或改善者，按日依人次加罰一萬元至補正或改善日止。</u></p> <p>三、<u>通知所屬結算會員。</u></p> <p>四、<u>通報主管機關期貨交易人部位逾越情形。</u></p> <p>綜合帳戶下個別交易人未沖銷部位逾越前條所定標準者，本公司得採取下列措施：</p> <p>一、<u>通知綜合帳戶所屬期貨</u></p>	<p>一、 考量現行法規未賦予本公司依情節輕重衡酌裁罰之空間，規定上較無彈性，不論情節輕重、逾越口數大小或是否為多次逾限，均裁罰新臺幣 2 萬元之作法，有未依期貨商違規情形加以研判，予以適切處置之裁量權。且本公司多數規章之處置方式多具彈性，使本公司得依情節輕重，衡酌處置措施。同時，參考國外交易所對於逾越部位限制另設立罰則者，其罰則亦多為依逾越次數或逾越口數分級裁處。故修正本公司相關規章之處置措施，使本公司得依期貨商逾越部位限制情節之輕重，適度酌予分級裁量處分之空間，以提升管理效能。</p> <p>二、 經瞭解市場實務狀況，遇有交易人於單一期貨商逾越部位限制案例時，究其原因，期貨商或因委託單下錯帳戶，或因期貨商後台系統上傳指定沖銷部位至本公</p>

修正條文	現行條文	說明
<p><u>改善。</u></p> <p>二、通知綜合帳戶所屬期貨商轉知外國期貨商停止受託新增部位。</p> <p>三、<u>經轉知外國期貨商停止受託新增部位</u>，外國期貨商仍受託新增部位者，通知期貨商限制或終止外國期貨商一部或全部之期貨交易。期貨商未依本公司通知限制或終止者，依人次課以<u>違約金新台幣一萬元以上五萬元以下</u>，經通知限期補正或改善，逾期未補正或改善者，按日依人次加罰<u>違約金新台幣一萬元至補正或改善日止</u>。</p> <p>四、<u>通報主管機關個別交易人部位逾越情形</u>。</p> <p>期貨商調整後淨資本額占未沖銷部位所需客戶保證金總額低於前條第一項第二款所訂標準者，除處理原有交易外，應即停止收受期貨交易人新增部位，並同時向主管機關及本公司提出改善計畫。另由本公司通知受託結算會員加強風險控管。</p>	<p>商轉知外國期貨商停止受託新增部位，外國期貨商仍受託新增部位者，本公司得通知所屬期貨商限制或終止該外國期貨商一部或全部之期貨交易，所屬期貨商未依本公司通知限制或終止者，依人次課以<u>違約金新台幣二萬元</u>，經通知補正或改善，逾期未補正或改善者，按日依人次加罰一萬元至補正或改善日止。</p> <p>二、<u>通報主管機關個別交易人部位逾越情形</u>。</p> <p>期貨商調整後淨資本額占未沖銷部位所需客戶保證金總額低於前條第一項第二款所訂標準者，除處理原有交易外，應即停止收受期貨交易人新增部位，並同時向主管機關及本公司提出改善計畫。另由本公司通知受託結算會員加強風險控管。</p>	<p>司結算系統之時間差等，致交易人發生逾越部位限制情形。惟發生後，期貨商立即於盤中處理，交易人部位旋即於短時間內回復未逾部位限制，考量該等期貨商雖有執行上之缺失，然實質上尚無影響期貨市場秩序之虞，且於盤中交易人之部位已立即回復未逾越部位限制之情形，因此，倘依現行規定對期貨商逕課以違約金，則與實際交易人持有部位逾越部位限制之情節未予區分輕重，未符本作業辦法第2條維護期貨市場秩序與安全之意旨，故修正本條文，得依期貨商逾越部位限制情節之輕重，採行不同措施。未來就期貨商所屬交易人逾越部位限制案件，經提報本公司處置會議討論時，本公司得就逾越口數、改善情形及是否於近期內連續發生等情事，給予適當有效之處置。</p> <p>三、調整後本公司可運用之處置方式，則可依實際狀況分級裁處，情節最輕微者，可通知限期補</p>

修正條文	現行條文	說明
		<p>正或改善，情節較重者，則參酌現行規章可處二萬元違約金之處置規定(如：本公司業務規則第 126 條)，將違約金調整為一萬元以上五萬元以下，並通知限期補正或改善。違約金上限提高至五萬元，對情節重大之違規者，將可採行適切有效之處置。逾期末補正或改善者，則依原規定按日依人次加罰一萬元至補正或改善日止。</p> <p>四、依前述，原第一項第一款移列為第一項，第一項第二款，移列為第二項，原第二項規定，則順次移列為第三項。</p> <p>五、原第一項第一款前段移列至第一項，第一款後段調整為第二款，並將課以違約金之金額新台幣二萬元調整為新台幣一至五萬元；另增訂第一項第一款得通知期貨商限期補正或改善；原第一項第三款及第四款維持未調整。</p> <p>六、原第一項第二款前半段調整為第二項前半段，後半段比照前項規定，納入得採前項各款措施</p>

修正條文	現行條文	說明
		<p>之規定。</p> <p>七、原第二項調整為第三項，原該項第一款調整為第三項第二款及第三款，且第三款課以違約金之金額由原新台幣二萬元調整為新台幣一至五萬元，另新增第一款通知期貨商限期補正或改善。</p> <p>八、原第二項第二款移為第三項第四款。</p>