

期貨商內部控制制度標準規範——內部控制制度修訂對照表（期貨商經營自營業務從事期貨契約當日沖銷交易）

| 編號 | 作業項目 | 修訂後內容 | 修訂前內容 |
|----------|---------|--|-------------------------|
| CA-22110 | 買賣決策之訂定 | <p><u>依據資料：</u></p> <p>一、法令規章：</p> <p>...</p> <p><u>(生)期交所業務規則第七十二條之一及第七十二條之二。</u></p> <p><u>作業程序及控制重點：</u></p> <p>...</p> <p><u>十二、期貨商經營自營業務從事期貨契約當日沖銷交易者，應訂定下列作業規範及風險控管機制，並確實執行：</u></p> <p><u>(一)當日沖銷交易之下單控管作業方式。</u></p> <p><u>(二)當日沖銷交易盤中風險控管機制。</u></p> <p><u>(三)收盤後留有當日沖銷交易之未沖銷部位餘額之處理方式。</u></p> <p><u>十三、期貨商經營自營業務從事期貨契約當日沖銷交易之未沖銷部位，除因不可抗力之因素外，應於當日期貨交易收盤前沖銷。</u></p> <p><u>十四、經上述方式仍未於當日沖銷之部位，倘未能於當日下午 3 時 30 分前補足保證金至該期貨契約之原始保證金者，應於次一營業日執行沖銷，至部位全數了結。</u></p> | <p>新增法令依據</p> <p>新增</p> |