臺灣期貨交易所 TAIWAN FUTURES EXCHANGE

108年10月份法規異動彙整

壹、金融監督管理委員會

◆訂定「證券期貨業申請業務試辦作業要點」。

金融監督管理委員會(以下簡稱金管會)金管會 108 年 10 月 3 日金管證券字第 1080318593 號令，訂定「證券期貨業申請業務試辦作業要點」，並自即日生效。

◆依期貨商管理規則第二十二條第三項規定，發布專營國外期貨交易複委託業務之外國期貨商適用業主權益或調整後淨資本額比率之令。

金融監督管理委員會(以下簡稱金管會)金管會 108 年 10 月 30 日金管證期字第 10800360743 號令，依據期貨商管理規則第二十二條第三項規定辦理。一、依期貨商管理規則第二十二條第三項規定，調整專營國外期貨交易複委託業務之外國期貨商適用期貨商管理規則第二十二條第一項及第二項有關控管比率之規定如下：(一)期貨商管理規則第二十二條第一項規定「期貨商之業主權益低於最低實收資本額百分之六十…」，於專營國外期貨交易複委託業務之外國期貨商，其比率調整為百分之五十。(二)期貨商管理規則第二十二條第二項規定「期貨商之業主權益低於最低實收資本額百分之四十…」，於專營國外期貨交易複委託業務之外國期貨商，其比率調整為百分之三十。(三)如其母國總公司已依其當地國法令之規定計算淨資本額或比率，且將在臺分公司之經營風險列入計算，並符合標準者，得檢附相關資料報經本會核准後，免適用期貨商管理規則第二十二條第一項及第二項調整後淨資本額規定；嗣後除報經本會核准者外，每月應向本會與本會指定之機構申報其母國總公司符合當地國法令規定之淨資本額或比率等資訊。二、專營國外期貨交易複委託業務之外國期貨商，其母國總公司未持續符合當地國法令規定之淨資本額或比率標準者，除處理原有交易外，應即停止接受本國期貨商委託，並向本會提出改善計畫。三、本令自即日生效；前財政部證券暨期貨管理委員會中華民國八十六年六月二十七日（八六）台財證（五）字第〇三五三七號函，業經本會於一零八年十月三十日以金管證期字第一〇八〇三六〇七四三一號函停止適用。

貳、臺灣期貨交易所股份有限公司

◆公告修正本公司「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約」、「臺灣證券交易所電子類股價指數選擇權契約」、「臺灣證券交易所金融保險類股價指數選擇權契約」、「黃金選擇權契約」、「美元兌人民幣匯率選擇權契約」、「小型美元兌人民幣匯率選擇權契約」等 6 項商品契約交易規則，自 108 年 10 月 15 日實施。

臺灣期貨交易所股份有限公司(下簡稱本公司)108 年 10 月 15 日台期交字第

10800030630 號函，依金管會 108 年 10 月 8 日金管證期字第 1080135441 號函辦理。為使自然人部位限制數得依市場實際狀況予以調整，將自然人部位限制計算基準比例由現行百分之五調整為百分之三以上百分之五以下，爰修正本公司 6 項商品契約交易規則部分條文。

◆公告修正本公司「動態價格穩定措施作業辦法」第 4 條規定，自 108 年 10 月 9 日起實施。

臺灣期貨交易所股份有限公司(下簡稱本公司)108 年 10 月 8 日台期交字第 10802015680 號函，依金管會 108 年 10 月 7 日金管證期字第 1080135274 號辦理。為增進動態價格穩定措施運作成效，增加有效成交價及有效買賣中價偏離濾網，修正本公司「動態價格穩定措施作業辦法」部分條文。

叁、中華民國期貨業商業同業公會

◆公告修正期貨商開戶徵信作業管理自律規則。

期貨公會 108 年 10 月 14 日公告修正期貨商開戶徵信作業管理自律規則。該自律規則經中華民國期貨業商業公會第 6 屆理監事第 1 次聯席會決議通過，並經金管會 108 年 9 月 23 日金管證期字第 1080134243 號函准予備查。本次修正係考量高齡長者之風險承擔能力有限，從事高槓桿、高風險之期貨交易應具備一定資格條件，爰於第五條第一項增、修訂相關規定；另於附件二「七十歲以上交易人開戶聲明書」範本，增加交易人從事選擇權賣方交易之相關警語，並以紅色加粗體顯示，以提醒交易人注意相關風險。