

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：方先生
聯絡電話：(02)2369-5678分機380

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國104年10月21日
發文字號：台期交字第10400032850號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：配合本公司建置期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業，公告修訂本公司「業務規則」第36條、第126條及新增「期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點」，並自104年12月21日起實施。

說明：

- 一、依期貨交易所管理規則第18條規定及金融監督管理委員會104年10月15日金管證期字第1040039842號函辦理。
- 二、為避免期貨自營商因系統異常或程式發生錯誤時，其所有未成交委託單無法及時刪除，可能產生鉅額虧損，甚或可能影響期貨市場交易秩序，本公司規劃建置期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業，爰修訂本公司「業務規則」第36條、第126條及新增「期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點」，增修訂條文對照表詳如附件。

正本：各期貨商、前後台資訊廠商

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、台北國際金融資訊協會、植根國際資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 邱文昌

**臺灣期貨交易所股份有限公司業務規則第三十六條、
第一百二十六條修正條文對照表**

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>第三十六條 期貨商申請撤銷或變更買賣申報及申報資料查詢，均以電腦為之。但交易時間開始前二分鐘內不得撤銷或變更買賣申報。</p> <p>申請變更買賣申報，除下列規定外，應先撤銷原買賣申報，再重新申報之：</p> <p>一、僅減少買賣申報之數量。</p> <p>二、僅就未聲明須立即成交否則取消或未聲明須立即全部成交否則取消之限價買賣申報變更其價格、變更為市價買賣申報或變更為一定範圍市價買賣申報。</p> <p>前項所指撤銷或變更買賣申報均以尚未成交者為限。前項第二款原買賣申報已有部分成交者，不得變更為聲明須立即全部成交否則取消之市價買賣申報，或聲明須立即全部成交否則取消之一定範圍市價買賣申報。</p> <p><u>期貨商申請同時撤銷多筆買賣申報，應依本公司「期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點」規定辦理，該要點由本公司另訂之。</u></p>	<p>第三十六條 期貨商申請撤銷或變更買賣申報及申報資料查詢，均以電腦為之。但交易時間開始前二分鐘內不得撤銷或變更買賣申報。</p> <p>申請變更買賣申報，除下列規定外，應先撤銷原買賣申報，再重新申報之：</p> <p>一、僅減少買賣申報之數量。</p> <p>二、僅就未聲明須立即成交否則取消或未聲明須立即全部成交否則取消之限價買賣申報變更其價格、變更為市價買賣申報或變更為一定範圍市價買賣申報。</p> <p>前項所指撤銷或變更買賣申報均以尚未成交者為限，<u>且</u>前項第二款原買賣申報已有部分成交者，不得變更為聲明須立即全部成交否則取消之市價買賣申報，或聲明須立即全部成交否則取消之一定範圍市價買賣申報。</p>	<p>一、第三項酌修文字。</p> <p>二、配合本公司新增期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點，增訂第四項。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>第一百二十六條 期貨商、結算會員有下列情事之一者，本公司得處以新台幣一萬元以上五萬元以下之違約金；經通知限期補正或改善，逾期仍未補正或改善者，按日加罰一萬元之違約金至補正或改善之日為止：</p> <p>一、期貨商違反第十九條之一、第二十條第一項、第三項、第二十一條第一項、第三項、第二十四條第一項、第二十五條、第二十六條、<u>第三十六條第四項、第四十四條、第四十四條之一、第四十四條之三第四項、第五項、第四十四條之五、第四十四條之六、第四十四條之九第六項、第四十四條之十二第二項、第四十五條、第四十六條、第四十六條之一、第四十六條之二、第四十七條、第四十七條之一、第四十八條、第四十八條之二、第四十九條之二、第五十四條第四項、第五十七條之一、第六十二條第一項、第七十二條之一之規定者。</u></p> <p>二、結算會員違反第八十二條準用第二十條第一項、第三項、第二十一條第一項、第二十六條之規定者。</p>	<p>第一百二十六條 期貨商、結算會員有下列情事之一者，本公司得處以新台幣一萬元以上五萬元以下之違約金；經通知限期補正或改善，逾期仍未補正或改善者，按日加罰一萬元之違約金至補正或改善之日為止：</p> <p>一、期貨商違反第十九條之一、第二十條第一項、第三項、第二十一條第一項、第三項、第二十四條第一項、第二十五條、第二十六條、第四十四條、第四十四條之一、第四十四條之三第四項、第五項、第四十四條之五、第四十四條之六、第四十四條之九第六項、第四十四條之十二第二項、第四十五條、第四十六條、第四十六條之一、第四十六條之二、第四十七條、第四十七條之一、第四十八條、第四十八條之二、第四十九條之二、第五十四條第四項、第五十七條之一、第六十二條第一項、第七十二條之一之規定者。</p> <p>二、結算會員違反第八十二條準用第二十條第一項、第三項、第二十一條第一項、第二十六條之規定者。</p>	<p>配合本公司新增期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點，爰修訂第一百二十六條之適用情事。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司
期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點

條文	說明
一、本要點依本公司業務規則第三十六條第四項規定訂定。	明定作業要點法源依據。
<p>二、期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業，應符合下列規定，並於權限生效五個營業日前填具申請書(如附件)及檢附相關文件，向本公司申請核准後，始得使用：</p> <p>(一)適用對象以期貨自營商為限。</p> <p>(二)期貨商使用買賣申報整批撤銷以其遇系統異常、程式錯誤或有影響市場秩序之虞者為限。</p> <p>(三)期貨商應依指定之連線或期貨商代號使用買賣申報整批撤銷。</p> <p>(四)期貨商應透過電文或網際網路輸入買賣申報整批撤銷至本公司電腦交易系統。</p>	明定期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業適用對象為期貨自營商，其遇系統異常、程式錯誤或有其他為防止影響市場秩序之虞情事發生時，可透過電文或網際網路方式輸入買賣申報整批撤銷至本公司電腦交易系統。
三、本公司電腦交易系統接受買賣申報整批撤銷後，其指定之連線或期貨商代號將停止接受新增、變更及撤銷買賣申報，並撤銷指定之連線或期貨商代號中尚未成交之買賣申報。但遇各期貨交易契約於本公司規定之不得撤銷買賣申報期間，不撤銷尚未成交之買賣申報。	明定本公司電腦交易系統接受買賣申報整批撤銷後，除遇各期貨交易契約不得撤銷買賣申報期間，不撤銷尚未成交之買賣申報外，其指定之連線或期貨商代號將停止接受新增、變更及撤銷買賣申報，並撤銷尚未成交之買賣申報，包含逐筆撮合之鉅額交易。
四、期貨商確認使用買賣申報整批撤銷之原因排除後，應輸入恢復買賣申報至本公司電腦交易系統，其指定之連線或期貨商代號始可恢復新增、變更及撤銷買賣申報。	明定期貨商使用買賣申報整批撤銷後，於確認使用之原因已消除時，應輸入恢復買賣申報至本公司電腦交易系統，其指定之連線或期貨商代號始可恢復新增、變更及撤銷買賣申報。

<p>五、期貨商應於使用買賣申報整批撤銷後五個營業日內，向本公司函報說明使用原因。</p>	<p>明定期貨商使用買賣申報整批撤銷，應向本公司函報說明使用原因。</p>
<p>六、期貨商違反本作業要點或其他與買賣申報整批撤銷作業相關之期貨管理法令者，本公司得依業務規則第一百二十六條進行處置；其情節重大者，併得取消使用買賣申報整批撤銷權限，一年內不得再申請恢復，或依業務規則第一百二十八條暫停其交易。</p>	<p>明定未依規定使用買賣申報整批撤銷之罰則。</p>
<p>七、本作業要點經主管機關核備後公告實施，修正時亦同。</p>	<p>明定本作業要點之核定施程序。</p>

附件

期貨商辦理買賣申報整批撤銷申請書

受文者：臺灣期貨交易所股份有限公司

主旨：茲依期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點第2點規定，申請買賣申報整批撤銷權限並檢具下列申請文件，請查照。

公司名稱			
期貨商代號 (7 碼)			
申請日期	中華民國 年 月 日	生效日期	中華民國 年 月 日
聯絡人 姓名		聯絡人 職稱	
聯絡人 電話		聯絡人 電子信箱	
附件	<input type="checkbox"/> 申請買賣申報整批撤銷(連線)權限，請檢附下列文件： 一、聲明書 二、連線資料	<input type="checkbox"/> 申請買賣申報整批撤銷(期貨商代號)權限，請檢附下列文件：聲明書	
	<input type="checkbox"/> 取消買賣申報整批撤銷(連線)權限，請檢附下列文件：連線資料	<input type="checkbox"/> 取消買賣申報整批撤銷(期貨商代號)權限	
期貨商：	股份有限公司		
代表人：	(簽名或蓋章)		

註1：依臺灣期貨交易所股份有限公司期貨商辦理買賣申報整批撤銷作業要點第2點規定，權限生效需於5個營業日前向本公司提出申請。

註2：請蓋公司大小章

期貨商辦理買賣申報整批撤銷聲明書

_____股份有限公司謹聲明如下：

本公司充分瞭解執行買賣申報整批撤銷指令可能存在的各種風險（包含，但不限於，買賣申報整批撤銷指令因通訊系統不正常而未能輸入 貴公司交易系統，貴公司因此未執行本公司買賣申報整批撤銷指令）。

在本公司買賣申報整批撤銷指令傳輸抵達 貴公司交易系統後， 貴公司執行上述買賣申報整批撤銷指令，刪除當時存在於 貴公司交易系統內的本公司委託單及/或報價單時，本公司深信 貴公司已盡一切努力執行上述買賣申報整批撤銷指令，刪除依本公司指令所應取消之委託單及/或報價單。但仍有可能發生依本公司指令應取消之委託單及/或報價單，其中部分，或全部，未能刪除成功，或其他 貴公司交易系統執行本公司買賣申報整批撤銷指令結果，與本公司預期不完全相符合的情事。

本公司聲明如發生上述情事， 貴公司不負損害賠償責任與其他責任。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

公司名稱：

(公司用印)

負責人：

(簽名蓋章)

中 華 民 國 年 月 日