

檔 號：

保存年限：

財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心 函

地址：台北市中正區羅斯福路二段100號
15樓

承辦人：曾先生

電話：(02)2366-8026

電子信箱：timmytseng@tpex.org.tw

受文者：如正副本

發文日期：中華民國113年8月19日

發文字號：證櫃債字第11300698271號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：

主旨：有關槓桿交易商經營槓桿保證金契約交易業務，應符合之期貨商調整後淨資本額占期貨交易人未沖銷部位所需之客戶保證金總額比率，請確實依相關規定辦理如說明，請查照。

說明：

- 一、依據金融監督管理委員會證券期貨局113年8月9日證期(期)字第1130383772號函辦理。
- 二、邇來部分槓桿交易商有持續發生調整後淨資本額少於期貨交易人未沖銷部位所需客戶保證金總額40%之情形，槓桿交易商應確實依槓桿交易商管理規則及本中心槓桿交易商經營槓桿保證金契約交易業務規則（以下簡稱業務規則）等相關規定辦理。
- 三、本中心業務規則第54條第1項第3款規定槓桿交易商之期貨商調整後淨資本額占期貨交易人未沖銷部位所需之客戶保證金總額比率（以下簡稱ANC比率）連續三個月未達主管機關規定（40%）者，本中心得報請主管機關予以停止或終止其經營槓桿保證金契約交易業務之處分，但已交易之契約其效力不受影響。倘貴公司遇有前開ANC比率連續三個月未達主管機關規定情事，應儘速改善，並提出改善計畫經董事會通過後函報本中心，並副知主管機關。改善計畫應至少包含以下內容：
 - (一)ANC比率連續三個月未達主管機關規定之原因。
 - (二)具體改善措施及預估對ANC比率之影響。
 - (三)詳細且明確之改善時程規劃。
 - (四)避免該情事再發生之控管機制。
 - (五)未來倘受停止或終止業務資格處分時，對於客戶權益之保障措施。

四、另為強化風險管理，建議槓桿交易商將業務規則第54條第1項第3款規範納入內控及內稽查核項目。

正本：群益期貨股份有限公司、元大期貨股份有限公司、國泰期貨股份有限公司、富邦期貨股份有限公司、凱基期貨股份有限公司

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、臺灣期貨交易所股份有限公司、中華民國期貨業商業同業公會