

中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會「證券投資顧問事業以自動化工具提供證券投資顧問服務審查小組之設置及作業要點」

金管會 113 年 11 月 12 日金管證投字第 1130355921 號函核定

- 第一條 依據 本作業要點依證券投資顧問事業管理規則第二十五條之三第二項之規定訂定之。
- 第二條 審查事項
- 一、證券投資顧問事業以自動化工具提供證券投資顧問服務審查小組(以下簡稱審查小組)係針對證券投資顧問(或兼營證券投資顧問)事業(以下簡稱投顧事業)申請以自動化工具提供證券投資顧問服務或變更提供自動化投資顧問服務所使用之演算法之案件,依相關審查規定及書件進行審查,並提供審查意見。
 - 二、審查小組之主要審查事項如下:
 - (一)清楚載明該申請案件之系統所使用演算法方法論,以歷史資料回測時能否達成預期成效,並理解演算法所使用財務理論模型,及對外揭露事項是否充分。
 - (二)瞭解客戶作業、演算法監管機制及專責單位運作。
 - (三)若相關審查規定修正時,審查小組將依規定調整主要審查事項。
 - (四)其他依主管機關交辦之必要審查事項。
- 第三條 審查委員之組成及出席
- 一、審查小組設審查委員九至二十五人,由本公會聘任之。原則上每次開會之審查委員不得低於三人。
 - 二、審查小組之審查委員,應遴選對財務管理、財務金融、財務工程、財務數學、金融科技、資訊科技、資訊管理、資訊工程、證券期貨、風險管理、精算、統計、會計審計、財務投資、法律等事項具有豐富經驗或特別研究之專業人士,該等人員應具有下列資格條件之一:
 - (一)曾於國內外大專院校講授財務管理、財務金融、財務工程、財務數學、金融科技、資訊科技、資訊管理、資訊工程、證券期貨與選擇權、投資學、經濟學、風險管理、精算、統計、會計審計、證券期貨法規等相關課程二年以上之教授、副教授或助理教授。
 - (二)曾任職證券投資信託事業、證券投資顧問事業、證券期貨業或其他資產管理產業工作經驗五年以上,並曾擔任主管職務者。
 - (三)曾簽證證券投資信託事業、證券投資顧問事業或證券期貨業財務報表之會計師。
 - (四)具有辦理證券投資信託事業、證券投資顧問事業或證券期貨案件經驗之律師。

(五) 有其他事實足資證明其具備相關豐富經驗或特別研究之專業人士。

三、審查小組之審查委員，由理事長提名，經理事會理事二分之一以上出席，出席理事二分之一以上通過後聘任之。有關審查委員之解任，應有理事會理事二分之一以上出席，出席理事二分之一以上通過後解任之。

四、審查委員之出席採輪值制，由本公會安排，輪值名單應予保密，不得將輪值情形洩露予會員公司，審查委員輪值及出席原則如下：

(一) 原則上每次安排審查委員至少三人擔任之，並由輪值審查委員於當次會議中互推一人擔任該次會議主席，並由該次審查之委員負責完成該次送審案件之審議並出具審查意見。

(二) 輪值審查委員應親自出席，不得委託他人代理出席，會議中亦不得委託他人代為行使職權，審查委員未親自出席或提前離席，致在場審查委員不足三人時，會議主席應宣布散會，擇期重行審議。

(三) 該次輪值審查委員因故無法出席時，最遲應於集會日十個營業日前通知本公會，由會務人員協調其他審查委員擔任之。

(四) 輪值審查委員如符合應行迴避之規定，應自行迴避，並由次一梯次之輪值審查委員擔任，依次遞補。

五、審查委員之任期原則為三年，期滿得續聘之，遇有缺額時，則依相同程序補足之，並以補足原定之任期為限。

第四條 審查委員之資格 違反證券投資信託及顧問法第六十八條第一項所列各款之情事者，不得擔任審查小組之審查委員。

第五條 共同遵守事項 為確保審查委員審議投顧事業申請以自動化工具提供證券投資顧問服務或變更提供自動化投資顧問服務所使用之演算法之案件公正客觀，另定「證券投資顧問事業以自動化工具提供證券投資顧問服務審查小組共同遵守事項」，由全體審查委員共同遵守之。

第六條 審查委員之迴避 一、審查小組每次會議出席之審查委員，遇當次審議之案件中有須迴避或自行迴避者，須於集會前先將應迴避之案件及事由以書面方式通知本公會，且就該案件不得參與討論及出具審查意見。如發現有審查委員應自行迴避而未迴避者，應由會議主席依職權裁示請其迴避；出具審查意見後始發現者，會議主席應裁示其審查意見不予列入。

二、審查委員應迴避之事由，於「證券投資顧問事業以自動化工具提供證券投資顧問服務審查小組共同遵守事項」明定之。

第七條 審查小組之集會 一、審查小組原則上每月集會一次，必要時得臨時召集之，若該月份無待審議案件得不進行集會。

二、申請公司依應檢附書件向本公會提出申請，申請公司於當月十五日（含）以前提出之案件，原則上，至遲應提報次月份審查小組會議審議之；當月十五日以後申請之案件，原則上，至遲提再次月份審查小

組會議審議。惟申請公司之書件若經本公會通知或申請公司自行請求補正者，提審查小組審議之月份應以其完成補正日期重新起算。

三、會議議程及相關資料由本公會於集會日十個營業日前發送本次輪值審查委員備供預先研閱。

- | | | |
|-----|-----------|--|
| 第八條 | 審查原則 | 審查小組以書面審查為原則，必要時得請申請公司書面說明或到場說明。 |
| 第九條 | 出席審查委員之酬金 | 審查小組之審查委員得酌領審查費用，該費用應由申請公司負擔，並依本公會「非商業團體法所定會費之種類及費率收費標準」辦理之。 |
| 第十條 | 本作業要點之施行 | 本作業要點經本公會理事會通過，並報請主管機關核備後施行；修正時亦同。 |