

附件二

期貨商兼營槓桿交易商風險管理妥適性之案件審查表

一、申請人：

二、發文日期：

三、發文字號：

四、審核要點：

審 查 要 點	具 體 事 實 ¹	審 查 意 見 ²
一、主管機關許可函	資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
二、風險管理計畫書：		
(一) 風險管理組織架構 1. 風險管理之組織架構 2. 風險管理之執行單位 3. 是否有在董事會成員中組成風險管理委員會	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
(二) 風險管理之職責 1. 董事會的角色 2. 風險管理委員會的功能 3. 風險管理執行單位的功能 4. 風險管理執行單位主管的角色 5. 業務單位風險管理人員的角色 6. 業務單位主管的角色 7. 風險資本限額之訂定 8. 風險資本限額之管理 9. 風險管理政策 10. 風險管理執行效能之評估	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
(三) 風險管理之流程 1. 風險管理流程圖及流程說明 2. 風險的辨識 3. 風險的衡量	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：

¹申請人應註明所附文件之索引並摘錄重點。

²審查意見由本中心填寫。

審 查 要 點	具 體 事 實 ¹	審 查 意 見 ²
4. 風險的監控 5. 風險的報告 6. 風險的回應措施		
(四) 市場風險之管理機制 1. 市場風險之管理原則 2. 市場風險之量化衡量 3. 統計基礎衡量法 4. 敏感性分析 5. 模型驗證測試 6. 壓力測試 7. 市場風險限額與限額檢核程序	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
(五) 信用風險之管理機制 1. 信用風險之管理原則 2. 信用分級管理制度 3. 交易後之信用監控 4. 信用加強與信用風險抵減 5. 信用風險之量化衡量 6. 信用風險暴額 7. 當前與潛在暴險金額 8. 交易對手違約機率 9. 交易對手違約回收率 10. 信用風險限額與限額檢核程序	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
(六) 流動性風險之管理機制 1. 流動性風險管理原則 2. 市場流動性風險管理 3. 資金流動性風險管理 4. 資金調度 5. 資金需求策略	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
(七) 作業風險之管理機制 1. 作業風險管理原則 2. 授權標準 3. 決策支授 4. 交易對手經驗 5. 交易紀錄 6. 評價	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：

審 查 要 點	具 體 事 實 ¹	審 查 意 見 ²
7. 價格資訊確認 8. 損益報告 9. 交易之處理 10. 交易之確認 11. 結算與交割 12. 帳戶之驗證 13. 資產控制 14. 作業風險之量化衡量		
(八) 其他風險之管理機制 1. 其他風險控管 2. 法規遵循 3. 契約文件適法性之審查	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
(九) 風險管理資訊系統 1. 風險管理資訊系統架構圖 2. 風險管理資訊系統之功能 3. 資料庫之建置暨資料之完整性 4. 技術架構之建置暨系統之安全性	說明： 資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
三、申請書及附件所載事項無虛偽或隱匿之聲明書	資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
四、已支付審查費用之證明文件	資料索引：	☐ 尚符規定 ☐ 未符規定 說明：
審查結果：		