

臺灣期貨交易所股份有限公司

店頭衍生性金融商品集中結算業務暨風險管理委員會組織細則

條文對照表

條 文	說 明
第一條（法源依據） 本組織細則依期貨交易法第五十五條準用第三十八條、期貨結算機構管理規則第二十六條及臺灣期貨交易所股份有限公司(以下簡稱本公司)章程第三十六條規定訂定之。	一、明定本組織細則之法源依據。 二、依據 EMIR 第 28 條規定，結算機構應成立風險管理委員會，提供結算機構關於風險管理之諮詢與建議，本公司章程第三十六條亦明定本公司經董事會之授權，應就店頭衍生性金融商品集中結算業務設置結算業務暨風險管理委員會，為業務政策釐訂之諮詢單位，爰參考本公司期貨集中交易市場之結算業務委員會組織細則，訂定本組織細則。
第二條（委員會職掌） 店頭衍生性金融商品集中結算業務暨風險管理委員會（以下簡稱委員會）職掌如下： 一、對下列本公司店頭衍生性金融商品集中結算業務（以下簡稱店頭集中結算業務）相關事項提出建議： （一）本公司店頭集中結算業務之市場風險、信用風險、流動性風險與作業風險等風險管理措施。 （二）本公司店頭集中結算業務相關制度與規章。 （三）結算會員資格標準。 （四）結算會員資格申請與註銷案。 （五）視結算會員財務、業務狀況，建議採行措施。 （六）新增、刪除結算商品與契約規格之訂定及變更。 （七）量化與風險管理模型之訂定及變更。 （八）保證金計算、壓力測試模型及參數之驗證。	一、明定委員會應向本公司提供之諮詢與建議。 二、依據 EMIR 第 28 條規定風險管理委員會應就有可能影響結算機構風險管理之事項，包含變更風險模型、違約處理程序、結算會員申請資格標準及新增結算商品等事項提出建議，並參考國際結算機構如澳洲 ASX Clear (Futures) 業務規則第 20 條、香港 OTC Clear 風險管理委員會組織細則第 4 條，規定委員會提供建議之事項。 三、依據本公司章程第三十六條，店頭衍生性金融商品集中結算業務設置結算業務暨風險管理委員會為本公司業務政策釐訂之諮詢單位，有關業務諮詢範圍參考日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 4 條與本公司期貨集中交易市場之結算業務委員會組織細則第二條，委員會應對店頭集中結算業務，包含結算會員申請資格、新增結算商品、結算保證金及交割

條 文	說 明
(九) 店頭交割結算基金總額估算與續繳分擔方式。 (十) 店頭交割結算基金增繳之金額。 (十一) 結算會員違約處置相關措施。 (十二) 違約處理演練計畫與結果等相關事項。 (十三) 危機與緊急情事之處理程序。 (十四) 其他有關店頭集中結算業務本公司認為必要之諮詢事項。 二、審閱店頭集中結算業務結算保證金運用情形。 三、審閱店頭交割結算基金之繳存、保管及運用情形。	結算基金之運用、違約處理演練計劃等事項提供建議，爰規定於本條文。
第三條 (委員選任方式) 委員會至多置委員九人，依下列方式提經本公司董事會通過後聘任之： 一、本公司店頭集中結算業務結算會員(以下簡稱結算會員)代表至多六人、候補人員若干人，由各結算會員指派該公司人員一人代表，互選後提名。 二、代表公益之專家學者至多二人及本公司人員一人，由總經理荐請董事長提名。 前項第一款互選後提名之代表，不得改派他人擔任。	一、明定委員會之組織員額與指派方式。 二、國際結算機構如澳洲 ASX Clear (Futures) 作業辦法第 20 條、日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 5 條、香港 OTC Clear 風險管理委員會組織細則第 3 條，皆規定委員會應有結算會員代表參與。依本公司章程第三十七條，委員會成員至少應有三分之二為本公司之結算會員，考量本公司店頭集中結算業務成立初期，參考期貨集中交易市場結算業務委員會組織細則第三條，規定委員會至多置委員九人之委員，包含結算會員代表至多六人、專家學者至多二人與本公司人員一人。
第四條 (結算會員代表所屬公司及結算會員代表之資格) 結算會員代表所屬公司最近一年內不得有下列情事之一：	一、明定結算會員代表所屬公司之資格及結算會員代表之資格。 二、參考國際結算機構如澳洲 ASX、日本 JSCC 與本公司期貨集中交易市場之結

條 文	說 明
一、受主管機關依銀行法第六十一條之一第一項第二款及第五款至第七款、保險法第一百四十九條第一項第一款、第二款、第四款及六款、證券交易法第六十六條第二款至第四款、期貨交易法第一百條第二款至第四款或票券金融管理法第五十一條準用銀行法第六十一條之一第一項第二款及第五款至第七款規定所為之處分。 二、經本公司依章則所為暫停或停止店頭集中結算業務，或有未能持續符合結算會員資格標準之情形。 結算會員代表除不得有受主管機關依銀行法、保險法、證券交易法、期貨交易法及票券金融管理法所為之處分及期貨交易法第二十八條第一項所定各款情事外，並應具備下列資格之一： 一、曾任金融行政管理工作經驗五年以上，並曾任薦任職以上或相當職務者。 二、曾任金融機構工作經驗五年以上，並曾擔任經理以上職務者。 三、曾任金融機構工作經驗三年以上，並曾擔任副總經理以上職務者。 四、曾任金融機構工作經驗二年以上，並曾擔任總經理以上職務者。 五、期貨機構工作經驗二年以上，並曾擔任期貨機構經理以上或同等職務者。 六、具備國內外專科以上學校畢業或同等學歷，並具有事實足資證明其具備衍生性金融商品相關專業知識，可健全有效經營衍生性金融商品業務者。	算業務委員會組織細則，明定結算會員代表所屬公司與結算會員代表不得有受主管機關處分之情形，且結算會員代表須具備合適之專業與經驗。 三、本組織細則所稱金融機構，係指本公司店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法所稱經主管機關核准從事衍生性金融商品交易或辦理衍生性金融商品業務之金融機構。
第五條（學者專家公益代表資格） 本公司聘任代表公益之專家學者，係指具有會計審計、財務金融、企業管理、法律、證券或期貨等任一專長之社會公正人士，該等人士應具有下列資格之一：	一、明定委員會之學者專家公益代表資格。 二、參考本公司集中市場現行之結算業務委員會組織細則，委員會聘任代表公益之專家學者須具備合適之專業與經驗。

條 文	說 明
一、國內大專院校任教之學者，並擔任副教授以上職務者。 二、曾任金融機構工作經驗三年以上，並曾擔任副總經理以上職務者。 三、曾任金融機構工作經驗二年以上，並曾擔任總經理以上職務者。 四、於國內聯合事務所執業五年以上之會計師或律師。 五、具有事實足資證明其對衍生性金融商品、金融市場動態等事項有特別研究之專業人士。	
第六條 (委員任期) 委員任期為一年。但經本公司董事會同意變更，並報請主管機關備查者，不在此限。 委員出缺時，由原選之候補人員遞補，如原選無候補人員或候補人員不足時，得另行補選，其遴選方式依第三條規定辦理。補缺委員之遞補，其任期為前任委員賸餘任期。 委員任期屆滿時，應履行其職務至新任委員到任止。	參考本公司集中市場現行之結算業務委員會組織細則，明定委員任期、連任與補缺方式。
第七條 (委員會設置召集人) 委員會置召集人一人，由委員互選之。 召集人任期與委員任期同，不得連任。	一、明定委員會之召集人。 二、經查國際結算機構如澳洲 ASX Clear (Futures) 作業辦法第 20 條、日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 5 條，各結算機構委員會之主席由委員互選之，參考本公司期貨集中交易市場結算業務委員會組織細則，規定委員會置召集人一人，由委員互選之。
第八條 (委員會召開頻率) 委員會每月開會一次，由召集人召集之。但必要時召集人得隨時召集。 召集人及委員因故不能行使職權時，應指定委員一人代理職務，其指定並應書面為之。	一、明定委員會之開會義務。 二、國際結算機構如香港 OTC Clear 風險管理委員會組織細則第 3 條、日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 9 條，各結算機構之委員會至少每季開會一次，參考本

條 文	說 明
	公司期貨集中交易市場結算業務委員會之運作訂定每月應開會一次。
第九條（委員會之投票與決議） 委員會之決議，應有二分之一以上委員出席，出席委員過半數同意行使之。	一、明定委員會之投票與決議方式。 二、國際結算機構如日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 10 條、香港 OTC Clear 風險管理委員會組織細則第 3 條、澳洲 ASX Clear (Futures) 作業辦法第 20 條，皆有規定委員會之投票與決議方式，參考本公司期貨集中交易市場結算業務委員會之運作，訂定應有二分之一以上委員出席，其決議須有出席委員過半數同意之。
第十條（委員會議事錄應送董事會） 委員會之決議，應作成議事錄，由主席簽名或蓋章，並於會後十五日內，將議事錄分送各委員及本公司董事會，並按月彙報主管機關。 議事錄應記載會議之年、月、日、場所、主席姓名及出席委員姓名，並應記載議事經過之要領及其結果。	一、明定委員會之決議應送交董事會。 二、國外結算機構皆敘明委員會為結算所之諮詢單位，香港 OTC Clear 風險管理委員會組織細則第 3 條、日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 11 條、澳洲 ASX Clear (Futures) 作業辦法第 20 條，皆有規定委員會之決議應提報董事會，參考本公司期貨集中交易市場結算業務委員會之運作，訂定本條文。
第十一條（利益衝突迴避） 委員對於會議之事項，與其或所代表結算會員有利害關係者，應於當次委員會說明其利害關係之重要內容，不得加入表決，並不得代理其他委員行使其表決權。	一、明定委員之利益衝突迴避義務。 二、為免利益衝突之虞，國外結算機構如香港 OTC Clear 風險管理委員會組織細則第 3 條、日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 10 條皆訂定利益衝突迴避相關規範，參考本公司期貨集中交易市場結算業務委員會組織細則，訂定本條文。
第十二條（保密義務） 委員執行業務應秉持公正客觀之立場及超然獨立之精神。除依法令所為之查詢外，不得對外洩漏因執行業務過程中所知悉之內容。	一、明定委員之保密義務。 二、參考澳洲 ASX Clear (Futures) 作業辦法第 20 條、日本 JSCC IRS 業務委員會規則第 7 條、本公司期貨集中交易市場結算業務委員會組織細則，明定委員之保密義務。

條 文	說 明
第十三條（委員解任事由） 委員或所代表結算會員於該委員任期內，有下列情事之一，本公司應提報董事會解除其職務： 一、未能持續符合第四條規定或違反第十一條或前條規定者。 二、對於委員會職務上之行為，要求、期約或收受賄賂或不當利益者。 三、其他事實足認有不適任之情事者。	參照本公司集中市場現行之結算業務委員會組織細則，明定委員被解任之事由。
第十四條（附則） 本組織細則經本公司董事會核議通過，報請主管機關核定後實施；其修正時亦同。	參照本公司集中市場現行之結算業務委員會組織細則。