

法規名稱：期貨市場監視準則

修正日期：民國 111 年 08 月 23 日

第 1 條

本準則依期貨交易法（以下簡稱本法）第九十五條規定訂定之。

第 2 條

期貨市場之監視，係為偵測任何不利市場之狀況或不法行為，並及時採行適當措施，以保障公益及維護市場之秩序。

第 3 條

期貨市場之監視範圍應包括下列事項：

- 一、期貨交易契約價格與期貨交易契約相關標的價格（包括不同交割月份契約、不同交易市場同一或相關契約及期貨交易契約之現貨標的價格等）及其變動。
- 二、期貨交易契約交易數量、未沖銷部位及其變動。
- 三、期貨交易人、期貨業及結算會員之期貨交易契約交易量、未沖銷部位、集中情形及其變動。
- 四、期貨交易契約實物交割之供需情形。
- 五、期貨市場不實資訊與流言。
- 六、期貨業及結算會員之財務、業務狀況。
- 七、直接或間接影響期貨交易或其相關現貨交易之不法行為。
- 八、其他有影響市場秩序或損害公益之虞者。

第 4 條

- 1 期貨交易所與期貨結算機構為進行不同交易市場間之監視，得與本國或外國相關交易所、機構，簽訂有關市場資訊交換、技術合作、協助調查等事項之合作協定。
- 2 前項協定之簽訂或修正，應先報經主管機關核准。
- 3 期貨交易所或期貨結算機構與本國或外國交易所、機構進行第一項市場資訊交換或協助調查，應先報經主管機關核准。

第 5 條

期貨交易所與期貨結算機構應訂定市場監視辦法報主管機關核定；其修正時亦同。

第 6 條

期貨交易所與期貨結算機構應設置專責單位執行市場監視，執行監視作業之人員應為專任。

第 7 條

- 1 期貨交易所與期貨結算機構於執行市場監視作業時，如發現有異常情事，除為必要之處置外，應即蒐集相關資料進行分析、調查、製作監視報告，於事實發生後五日內向主管機關申報。
- 2 期貨交易所與期貨結算機構於執行市場監視作業時，如發現有涉嫌不法之犯罪情事，應逕向司法單位告發並報主管機關備查。
- 3 期貨交易所與期貨結算機構應定期召開監視督導會報，並每月彙整執行市場監視分析檢討報告，於每月十日前報主管機關備查。

第 8 條

- 1 主管機關依前條監視報告發現有本法第九十六條各款情事之一時，得依本法之規定以命令調整保證金額度、限制期貨交易人交易數量或持有部位或採取其他必要措施；其情況特殊者，並得停止一部或全部之期貨交易。
- 2 期貨交易所、期貨結算機構、期貨業及其負責人或受雇人如有違反前項措施之情事者，主管機關得依本法第一百條及第一百零一條之規定予以處分。

第 9 條

期貨市場監視之相關資訊，除依法提供與司法單位或相關機構進行必要之調查外，應注意保密。

第 10 條

本準則自發布日施行。