

花旗(台灣)商業銀行股份有限公司

兼營證券業務延長外國債券自行買賣交易時間作業辦法

壹、主旨

為規範本行兼營證券商及其分支機構辦理外國債券自行買賣業務，考量外國債券可於不同時區交易，為與國際市場接軌，依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱「櫃買中心」)「證券商自行買賣外國債券交易辦法」第六條之規定，特訂定本行「兼營證券業務延長外國債券自行買賣交易時間作業辦法」(以下簡稱「本作業辦法」)。

貳、生效日期

本作業辦法於民國 107 年 6 月 8 日經企金法務中心法務長、企金法規遵循處主管、營運暨資訊管理中心負責人、金融市場暨證券服務事業群負責人、總經理及董事長核准後生效。

參、適用單位

本行兼營證券商及其分支機構(以下合稱「本行」)負責辦理外國債券自行買賣(包含買賣斷及附條件買賣)之前、後台員工，均受本作業辦法之規範。

肆、內容

一、業務需求及延長交易時間

依據證券商自行買賣外國債券交易辦法，如涉及本行自行買賣外國債券(包含買賣斷及附條件買賣)採營業處所議價時，則營業時間為上午九時至下午三時(以下稱「營業時間」)。然由於外國債券之流動性通常於倫敦與紐約之時區較為活絡，為增進本行外國債券自行買賣業務之效率，本行特訂定本作業辦法，於營業時間後延長交易時間至晚間十二時(以下稱「延長時間」)。

二、延長時間之交易作業規範

1. 應買應賣之原則及流程：本行辦理本業務均以留單之作業為前提，即本行之交易對手就其欲買入或賣出之特定標的，已設定目標價格，並以具拘束力之交易指示要求本行於市場價格達到該目標價格時即行成交。對於同樣價格之買賣留單，依時間先後依序成交。其餘交易原則及流程悉依本行「兼營證券自行買賣外國有價證券交易處理程序」及「兼營外幣有價證券之買賣業務程序」之相關規定辦理。
2. 價格檢核機制、核決權限、相關人員授權及超限時之處理方式：悉依本行「兼營證券自行買賣外國有價證券交易處理程序」及「兼營外幣有價證券之買賣業務程序」之相關規定辦理。就超限時之處理流程應留存書面紀錄備查。
3. 本行在營業處所自行與客戶議價買賣，應留存相關文件備查。
4. 向櫃買中心申報改帳作業之處理：本行應於確定成交後立即將成交資料

依櫃買中心規定之時間及格式，輸入櫃買中心之資訊系統。但交易於下午五時以後成交者，應於次一營業日下午五時前完成申報。

5. 成交資料比對之程序：本行係依現行流程，依成交後輸入本行系統之時間先後，由本行後台人員逐筆確認交易明細，並進行後續交割事宜。
6. 異常狀況之處理：
 - (1) 交易系統連線中斷之處理：本行外國債券交易會鍵入本行交易系統(即 eDealer FI 及 STN)中，無論於營業時間內或延長時間時，如有系統之問題，本行業務人員將立即通知營運暨資訊管理中心，由相關技術支援人員釐清原因，並依相關內部程序盡速修正問題並恢復連線。如因可歸責於本行之事由造成損害，依本行與客戶間簽訂之總交易合約、其附約及其後之修訂(如有)之相關規定處理。
 - (2) 比對資料錯誤之處理：本行後台人員會負責彙整交易明細，如有任何無法核對之處，本行後台人員會通知前台業務人員、主管及金融市場暨證券服務事業群負責人。
 - (3) 本行或客戶違約時之處理：悉依本行與客戶間簽訂之總交易合約、其附約及其後之修訂(如有)、其他相關交易文件(如有)以及適用法規之規定處理。
7. 業務主管及業務人員之配置及各單位分工方式，悉依本行「兼營證券自行買賣外國有價證券交易處理程序」及「兼營外幣有價證券之買賣業務程序」之相關規定辦理。

三、 其他延長時間交易應注意事項及相關控管

1. 所有延長時間之交易活動係依與營業時間內之交易活動相同之標準控管流程進行管理、監督，如由獨立控管單位(如市場風險、金融交易暨授信風險管理服務處)進行適當之控管，包括風險限額報告(risk limit reporting)、獨立之日損益報告(independent daily P&L reporting)、確認(confirmations)、及向上呈報超限或違反之情形(escalation of breaks)。所有業務人員及主管，於從事延長時間交易活動之控管要求如下：
 - (1) 所有營業時間後交易活動應遵守於營業時間內適用之花旗相關政策，包括遵守市場及信用風險限額等。
 - (2) 所有延長時間後交易活動應如同現行營業時間內之作業政策，僅使用本行提供、認可獲批准的通訊設備、系統和服務進行業務，行動電話不應使用於任何交易溝通或執行。
 - (3) 交易活動必須直接下單至交易系統。
 - (4) 對業務人員及主管來說，於營業時間內及延長時間均不得於營業處所外執行交易活動，如該人員或主管於營業處所外接獲留單指示，則必須聯絡在營業處所內的其他業務人員代為接單。各項交易指示、明細及確認，必須留存記錄(即錄音電話、路透社及/或彭博平台，

及電子郵件等)。

(5) 業務人員及/或主管於延長時間之交易活動，該等交易成交明細最遲應於次一營業日早上輸入於適當之交易及風險控管系統。

2. 如有任何例外情形發生或有交易指示與確認不一致之情事，亦應立即呈報予金融市場暨證券服務事業群負責人及部門法規遵循主管。
3. 錄音規定：所有業務人員之電話線路均應予以錄音，且交易行為應透過錄音之線路進行。

四、 本作業辦法修訂辦法

本作業辦法如有修訂須取得以下單位核可後實施：

1. 董事長
2. 總經理
3. 金融市場暨證券服務事業群負責人
4. 企金法務中心法務長
5. 法規遵循中心法遵長
6. 營運暨資訊管理中心負責人