

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓

聯絡人：卓先生

聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3339

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國114年10月27日

發文字號：台期結字第1140002957號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

主旨：公告修正本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第拾、第拾壹、第拾貳及第拾伍點條文，實施日期另行公告，請查照。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會114年10月20日金管證期字第1140359482號函辦理。
- 二、配合本公司開放期貨商於盤後交易時段辦理部位互抵、指定部位組合及指定部位沖銷作業，爰修正旨揭作業要點第拾伍點，新增期貨商盤後交易時段辦理該3項部位處理作業之作業時間，並併同修正第拾點部位互抵作業、第拾壹點指定部位組合作業及第拾貳點指定部位沖銷作業，明定為一般交易時段之作業規範，以臻明確。
- 三、為強化盤後交易時段風險控管措施，期貨商盤後交易時段接受期貨交易人指示辦理指定部位組合作業，應辦理下列事項，並將相關作業程序納入內部控制制度及內部稽核作業確實執行：
 - (一)期貨交易人盤後交易時段部位組合拆解後，以單一部位保證金計收方式收取保證金，期貨商對帳戶權益數或風險指標低於期貨商所訂標準者，應提醒其注意未沖銷部位所需保證金及風險指標變化。
 - (二)盤後交易時段，經本公司指定豁免辦理代為沖銷之商品，

期貨商無須執行代為沖銷。為避免期貨交易人盤後交易時段拆解價差組合部位，僅了結選擇權買進部位，留倉選擇權賣出部位，致帳戶風險升高，期貨商應具備監控此類交易行為之機制。就收盤仍留有選擇權賣出部位且帳戶權益數或風險指標低於期貨商所訂標準者，期貨商應訂定限制其盤後交易時段拆解部位組合等控管原則，並讓期貨交易人確實瞭解。

四、檢附本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」修正條文對照表如附件，實施日期另行公告。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、臺灣集中保管結算所股份有限公司、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、台北國際金融資訊協會、博仲法律事務所、植根國際資訊股份有限公司、內部稽核、交易部、結算部、監視部、期貨商輔導部、資訊規劃部、資訊作業部、企劃部、管理部、本公司網站(均含附件)

總經理 周建隆

臺灣期貨交易所股份有限公司
期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點
修正條文對照表

修正條文	現行條文	說明
拾、<u>一般交易時段之</u>部位互抵作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午二時三十分；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午四時三十分。 二、期貨商辦理部位互抵時，應於本公司作業時間內依其電腦作業方式申請，其申請互抵部位即時生效，並得經由電腦作業方式查詢部位互抵結果。	拾、部位互抵作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午二時三十分；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午四時三十分。 二、期貨商辦理部位互抵時，應於本公司作業時間內依其電腦作業方式申請，其申請互抵部位即時生效，並得經由電腦作業方式查詢部位互抵結果。	配合本公司開放期貨商於盤後交易時段辦理部位互抵作業，為明確定義一般交易時段與盤後交易時段之作業時間，爰修訂本條文，明定本點之部位互抵作業係屬一般交易時段。
拾壹、<u>一般交易時段之</u>指定部位組合作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午二時三十分；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間	拾壹、指定部位組合作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午二時三十分；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間	配合本公司開放期貨商於盤後交易時段辦理指定部位組合作業，為明確定義一般交易時段與盤後交易時段之作業時間，爰修訂本條文，明定本點之指定部位組合作業係屬一般交易時段。

修正條文	現行條文	說明
為上午七時至下午四時三十分。 二、期貨商辦理指定部位組合時，應於作業時間內以電腦作業方式申請，其申請組合部位即時生效，並得經由電腦作業方式查詢指定部位組合結果。	為上午七時至下午四時三十分。 二、期貨商辦理指定部位組合時，應於作業時間內以電腦作業方式申請，其申請組合部位即時生效，並得經由電腦作業方式查詢指定部位組合結果。	
拾貳、<u>一般交易時段之指定部位沖銷作業</u> 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午二時三十分；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午四時三十分。 二、期貨商辦理指定部位沖銷時，應於作業時間內以電腦作業方式申請，其申請沖銷部位即時生效，並得經由電腦作業方式查詢指定部位沖銷結果。	拾貳、指定部位沖銷作業 一、期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午二時三十分；期貨交易契約為下午四時十五分收盤者，作業時間為上午七時至下午四時三十分。 二、期貨商辦理指定部位沖銷時，應於作業時間內以電腦作業方式申請，其申請沖銷部位即時生效，並得經由電腦作業方式查詢指定部位沖銷結果。	配合本公司開放期貨商於盤後交易時段辦理指定部位沖銷作業，為明確定義一般交易時段與盤後交易時段之作業時間，爰修訂本條文，明定本點之指定部位沖銷作業係屬一般交易時段。

修正條文	現行條文	說明
拾伍、盤後交易時段之部位處理作業 一、除另有規定外，期貨交易契約於盤後交易時段之成交部位於次一一般交易時段上午七時前併入一般交易時段之部位。 二、除另有規定外，期貨交易契約於盤後交易時段之部位互抵、指定部位組合及指定部位沖銷之<u>作業時間為下午五時三十分至次日上午五時；部位調整及期貨契約價差部位組合併於次一一般交易時段辦理。但最後交易日交易至盤後交易時段之到期契約，遇最後交易日之部位處理，於最後結算日到期交割作業前辦理。</u>	拾伍、盤後交易時段之部位處理作業 一、除另有規定外，期貨交易契約於盤後交易時段之成交部位於次一一般交易時段上午七時前併入一般交易時段之部位。 二、除另有規定外，期貨交易契約於盤後交易時段之<u>部位調整、部位互抵、指定部位組合、指定部位沖銷、期貨契約價差部位組合併於次一一般交易時段辦理。但最後交易日交易至盤後交易時段之到期契約，遇最後交易日之部位處理，於最後結算日到期交割作業前辦理。</u>	一、配合本公司開放期貨商於盤後交易時段辦理部位互抵、指定部位組合及指定部位沖銷作業，爰修正本點第二項，新增 3 項部位處理之作業時間。 二、本次開放期貨商於盤後交易時段辦理 3 項部位處理作業，涉及本公司結算系統及期貨商資訊系統修正，其中部位互抵作業之系統調整架構較為複雜，基於系統及作業安全考量，擬分二階段實施。 三、承上，於辦理本修正條文公告時，將併同公告指定部位組合及指定部位沖銷作業之實施日期，部位互抵作業仍適用修正前規定，於一般交易時段辦理。賡續俟部位互抵系統功能建置完成後，再另行公告部位互抵作業實施日期。

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路二段100號14樓
聯絡人：卓先生
聯絡電話：(02)2369-5678 分機：3339

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國114年11月19日
發文字號：台期結字第1140003156號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：
附件：

主旨：配合本公司調整盤後交易時段之部位處理作業規定，公告本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」相關修正條文實施日期，請查照。

說明：

- 一、依金融監督管理委員會114年11月7日金管證期字第1140362401號函及本公司114年10月27日台期結字第1140002957號函辦理。
- 二、本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第拾、第拾壹、第拾貳點及第拾伍點修正條文，除第拾伍點部位互抵作業之實施日期另行公告外，自114年12月8日起實施。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、臺灣集中保管結算所股份有限公司、臺灣證券交易所股份有限公司、財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心、台北國際金融資訊協會、博仲法律事務所、植根國際資訊股份有限公司、內部稽核、交易部、結算部、監視部、期貨商輔導部、資訊規劃部、資訊作業部、企劃部、管理部、本公司網站

總經理 周建隆