

整戶風險保證金系統調整事宜(草案)

資規部
104年5月

匯率期貨

- 因應美元兌人民幣匯率期貨，SPAN參數檔內容調整如下：
 - 新增匯率類商品群組、美元兌人民幣商品組合及美元兌人民幣期貨各項參數資訊與風險陣列內容
 - 除現行美元匯率資訊外，新增人民幣匯率資訊
- 美元兌人民幣匯率期貨保證金以人民幣計收，倘交易人持有該商品部位，須計算人民幣保證金金額。
- 有價證券抵繳價值計算：同現行作法

延長交易時間

- 參數檔發布時點增加15:15、15:45、16:15、16:30
- 參數檔案名稱修正：
 - 盤中同現行每次發布參數檔之檔案名為HHMM.spn
 - 於第一盤商品每日結算價公布後，該次發布之參數檔檔案名為1430.spn及E01.spn(內容均相同)
 - 於所有商品每日結算價均產生後，該次發布之參數檔檔案名為FS.spn

延長交易時間(續)

- E01.spn之參數檔中<setlQualifier>標示為Early Settlement
 - <setlQualifier>early</setlQualifier>
- FS.spn之參數檔中<setlQualifier>標示為Final Settlement
 - <setlQualifier>final</setlQualifier>
- 部位檔
 - 第一盤商品收盤後部位檔Type 1 Record byte 12 File Identifier，填'E' for early settlement
 - 所有商品收盤後部位檔Type 1 Record byte 12 File Identifier，填'S' for final settlement

延長交易時間(續)

■ SPAN部位檔之提供(S21/SC1)

- 於第一盤之部位處理作業截止後，提供第一盤商品之部位檔
- 於所有商品部位處理作業均已截止後，提供所有商品之部位檔

遇證券市場資訊異常之因應措施

- 倘遇標的現貨異常，到期商品未能產生結算價，致交割作業延後，仍須計算該商品部位所需之保證金：
 - SPAN參數檔配合提供該到期商品之參數及風險陣列資訊
 - SPAN部位檔仍保留於該當天到期之商品部位，供期貨商驗核

簡報完畢
敬請指教