

印度50指數期貨契約結算業務規劃

■ 保證金收付及保證金計算：同現行指數類期貨契約

- ✓ 為新臺幣計價商品，以新臺幣辦理保證金收付，及損益計算
- ✓ 結算保證金 = 印度50指數期貨價格 × 契約乘數 × 風險價格係數，保證金為固定金額，以千元為整數，千元以下無條件進位至千元
- ✓ 保證金收取標準同現行各期貨交易契約比例，結算：維持：原始 = 1：1.035：1.35
- ✓ 結算保證金變動幅度達10%以上時，結算保證金之收取得調整之

■ 部位處理及結帳作業：按各商品之收盤時點分13:45、16:15及18:15三盤結帳

- ✓ 現行13:45及16:15收盤商品之結算作業時程(包括損益及應有結算保證金計算)維持不變
- ✓ 本契約為18:15收盤商品，部位處理作業時限為18:30
- ✓ SPAN風險參數檔於本契約之每日結算價公布後，新增1次發布時點

■ 每日結算價：18:15收盤後訂定

- ✓ 計算方式同現行指數類期貨契約，原則採收盤前一分鐘內所有交易之成交量加權平均

■ 到期結算作業：採現金結算方式辦理

1. 最後結算日：最後交易日之次一營業日(T+1)
2. 最後結算價：以最後交易日印度指數編製公司計算之Nifty 50股價指數收盤價訂之
3. 到期結算作業時點：最後結算日上午9:30

印度50指數期貨契約結算業務規劃

■ 結算會員保證金提領作業：維持現行作業時限辦理

- ✓ 當日提領結算保證金作業：維持現行作法，每日共4次申請時點(9:00、11:00、14:00及14:45)
- ✓ 次日提領結算保證金作業：截止時點維持16:30

■ 本公司對結算會員結算保證金控管作業

- ✓ 委託量控管、盤中損益試算及盤中保證金追繳作業時間：由現行8:00~16:15延長為8:00~18:15
- ✓ 盤中洗價追繳：除現行4次固定時段(9:30~9:40、11:00~11:10、12:30~12:40及15:00~15:10)外，新增1次17:15~17:25之盤中洗價追繳時段
- ✓ 盤後保證金追繳作業截止時點：當日19:30前(現行13:45及16:15收盤商品之盤後保證金追繳作業時限維持不變)

■ 期貨商財務資料申報時限：維持現行19:30，並輔以配套措施

- ✓ 期貨商每日向本公司申報「調整後淨資本額(ANC)計算表」、「境外華僑及外國人與大陸地區投資人資金結匯情形及保證金專戶權益數概況」、「保證金專戶權益總值概況」及「保證金專戶存款餘額」，維持現行每日資料申報時限19:30，倘期貨商因交易本契約，無法於當日申報時限內19:30前完成每日資料申報，應先申報截至16:15收盤之財務資料，並應於次一營業日上午9:00前申報完整之日終資料。

印度50指數期貨契約結算業務規劃

■ 印度50指數期貨(N5F)上市後每日結算作業時程比較

結算作業項目	現行作業時點	N5F上市後
開盤前SPAN參數檔發布時點	7:45前	同現行
Eurex部位轉入作業截止時點	7:45	同現行
委託量控管	7:45～16:15	7:45～18:15
部位調整、部位互抵、指定部位組合、指定部位沖銷及期貨價差部位組合等作業	■ 13:45收盤商品:7:45～14:30 ■ 16:15收盤商品:7:45～16:30	■ 13:45收盤商品:7:45～14:30 ■ 16:15收盤商品:7:45～16:30 ■ 18:15收盤商品:7:45～18:30
保證金存入作業	7:45～17:30	7:45～19:30
盤中保證金追繳作業	8:00～16:15	8:00～18:15
結算會員盤中損益試算時點	9:30～9:40、11:00～11:10、12:30～12:40及15:00～15:10共4次	9:30～9:40、11:00～11:10、12:30～12:40、15:00～15:10及17:15～17:25共5次
保證金提領作業	8:45～16:30	同現行
印度50指數期貨每日結算價訂定作業	無	18:15起
確認有價證券實際抵繳金額	16:30	18:30
盤後保證金追繳作業時限	■ 13:45收盤商品:15:30 ■ 16:15收盤商品:17:30	■ 13:45收盤商品:15:30 ■ 16:15收盤商品:17:30 ■ 18:15收盤商品:19:30