

## 整戶風險保證金系統之調整事宜



### 印度Nifty 50指數期貨

- 因應印度Nifty 50指數期貨，SPAN參數檔內容調整如下：
  - 新增Nifty 50指數期貨商品群組、各項參數資訊與風險陣列內容
  - 保證金計算幣別同新臺幣計價商品
- 印度Nifty 50指數期貨之交易時間：
  - 開盤時間：上午8點45分
  - 收盤時間：下午6點15分

## 延長交易時間

- 參數檔發布時點增加18:30  
(Nifty 50指數期貨每日結算價產生後)
- 參數檔案名稱修正：
  - 於第二盤商品每日結算價公布後，該次發布之參數檔檔案名稱為E02.spn
  - 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稱為FS.spn

## 匯率期貨(草案)

- 新增歐元兌美元匯率期貨及美元兌日圓匯率期貨，SPAN參數檔內容調整如下：
  - 新增此兩種匯率期貨商品群組、各項參數資訊與風險陣列內容
  - 新增相關匯率資訊
  - 交易時間由上午8點45分至下午4點15分

## 匯率期貨(草案)

- 歐元兌美元匯率期貨保證金
  - 保證金計算幣別同美元計價商品
- 美元兌日圓匯率期貨保證金
  - 本國人及境內外資帳戶，以日圓計算保證金金額
  - 外資帳戶，以約當美元計算保證金金額
- 有價證券抵繳價值計算：同現行作法
  - 日圓可折抵金額計價小數位數到整數位

簡報完畢  
敬請指教