

本公司授權歐洲期貨交易所上市臺股期貨及臺指選擇權之一天期期貨契約代期貨商轉入到期交割部位備援機制作業說明

一、前言

有關期貨商辦理本商品到期交割部位轉入申報作業，係透過本公司交易網路將「EU2 期貨商所屬淨部位已確認檔」上傳至本公司以完成轉入作業。

為因應期貨商倘發生系統異常，無法透過本公司交易網路上傳 EU2 檔案辦理轉入申報作業，本公司業建置 (1)本公司媒體申報系統申報或(2)電子郵件傳送檔案等 2 項備援機制，供期貨商於其系統異常時可即時因應。前揭備援機制請期貨商確實進行測試外，相關注意事項，如下：

1. 本公司媒體申報系統申報(作業代號為 2-54-3)

(1) 該作業須以使用者帳號及密碼登入外，並須使用憑證申報。

期貨商須確認使用者帳號、密碼及憑證之有效性，並開放作業人員本項作業權限。

(2) 倘期貨商綜合帳戶及自營帳戶之 EU1 EurexAcctID 欄位與 EU2 AcctID 不同，請於「2-54-08 EU1 與 EU2 AcctID Mapping Table」建立對應關係(期貨商須開放作業人員本項作業權限)，俾加速期貨商使用本備援機制，倘未建 Mapping Table 者，期貨商需逐筆申報綜合帳戶總帳及子帳帳號資訊。

2. 電子郵件傳送檔案

(1) 期貨商可透過媒體申報系統 2-54-01 下載 EU1 電文(期貨商須開放作業人員本項作業權限)，本作業僅需以使用者帳號及密碼登入外，無須使用憑證。

(2) 期貨商於完成 EU2 檔案後 E-mail 至本公司信箱 taifexlink@taifex.com.tw，並於檔案寄送完成後以電話通知本公司值班人員，電話：33933788 轉 8544、8566。

二、代期貨商轉入到期交割部位備援機制

考量期貨商遇資訊系統異常，且亦無法透過本公司現有之備援機制完成申報作業時，為避免期貨商因未於時限內(上午 7:45)完成申報，致全數部位被視為拒絕部位，爰本公司規劃新增暫存帳戶備援機制。

(一)申請作業

期貨商須於上午 7 時 30 分以前，填具「期貨商申請代為轉入 Eurex 到期交割部位備援機制申請表」傳真向本公司提出申請，由本公司代期貨商轉入本商品到期交割部位。上述書面申請文件將於本案上線時置於本公司網站供期貨商下載使用（首頁 > 期貨業專區 > 交易結算申請作業各項表單 > 結算作業各項表單）。

(二)代期貨商轉入到期交割部位作業原則

期貨商申請轉入暫存帳號時，系統依 EU1 之期貨商代號及交易人帳號轉入，倘 EU1 之交易人帳號不符合本公司交易帳號檢查碼原則，該筆資料將轉入總、分公司所屬之暫存帳號(0000000)，期貨自營商則轉入其自營帳號(0000000)。

(三)代期貨商轉入到期交割部位作業

1. 本公司結算部作業人員接獲期貨商申請後，至媒體申報系統設定啟動代期貨商轉入到期交割部位。
2. 於代期貨商轉入到期交割部位生效後，倘有需申報拒絕部位，期貨商可至媒體申報系統輸入拒絕部位之相關資訊(作業代號規劃為 2-54-10，期貨商須開放作業人員本項作業權限，使用者帳號及密碼登入，並以憑證申報)，期貨商未於截止時點(上午 7 時 45 分)前輸入拒絕部位資訊，則視為接受所有到期交割部位。
3. 媒體申報系統將依轉入代期貨商轉入到期交割部位作業原則及期貨商提供之拒絕部位資料產生 EU2 檔案，並傳送予交易系統，再由交易系統將全市場之到期交割轉入部位資訊傳送至結算系統。

(四)代期貨商轉入到期交割部位後續處理

1. 期貨商應於開盤前(上午 8 時 45 分)，透過 MTS 系統確認 Eurex 到期交割部位轉入狀況，確認 Eurex 到期交割部位轉入部位所屬期貨交易人之帳號之正確性，倘轉入暫存帳戶，則透過 MTS 系統「作業代號：0504 部位調整(互抵)申請」(如附件)將轉入總、分公司所屬暫存帳戶之到期交割部位分別調整予所屬之交易人帳戶(期貨自營商不適用)，倘期貨商未將暫存帳戶之部位全數轉出，本公司即將剩餘之部位轉入期貨商錯帳專戶，由該期貨商負責後續處理程序。

三、 暫存帳號(0000000)控管機制

1. 除期貨自營商外，期貨經紀商不得以 0000000 帳號開立交易人帳戶，且該暫存帳號限部位撥出，不可辦理部位撥入作業。
2. 期貨經紀商之暫存帳戶之部位不可撥入期貨自營商帳戶。
3. 期貨自營商之部位轉入自營帳號後(帳號：0000000)，無部位調整功能(部位無法撥出)。

四、 注意事項

1. 期貨商下單時須確保最終受益人 14 碼之期貨商代號(7 碼)之正確性，倘期貨商代號錯誤，則可能有拒絕部位或轉入期貨商代號錯誤之狀況發生，則由該期貨商負責後續處理程序。
2. 倘期貨商未將轉入暫存帳戶之部位全數轉出，由本公司將暫存帳戶之剩餘部位調整轉入該期貨商錯帳專戶之作業，比照現行因錯帳申請部位調整之收費標準辦理。
3. 期貨商向本公司申請轉入暫存帳號後，倘完成系統修復，並擬透過交易系統重新傳輸 EU2 電文或透過媒體申報系統「2-54-03 線上確認 EU1 即產生 EU2 電文」等方式確認轉入部位資訊，應立即通知本公司撤銷轉入暫存帳戶後，並於上午 7 時 45 前重新產生 EU2

電文確認轉入部位資訊，以避免產生本公司與期貨商二者重覆傳送檔案等狀況。

五、 上線時程

本案將併同「上市(櫃)ETF 納入本公司股票期貨暨選擇權標的證券案」進行市場測試後上線，請各期貨商配合相關測試作業，俾確保異常狀況發生時，可即時完成部位轉入作業。

六、 其他期貨商辦理本商品到期交割部位轉入申報作業注意事項

- (一)現行本公司於媒體申報系統建置 2-54-1 期貨商緊急聯絡人維護，供期貨商提供緊急聯絡人名單作為遇緊急事項聯繫、發送 Email 及傳遞簡訊用，本公司將於 10 月 6 日起於該功能增加聯絡順序欄位，請期貨商填入，倘遇緊急事件時，供本公司依聯繫順位與期貨商聯繫。
- (二)請期貨商依 EU2 電文規範申報，以避免因 EU2 電文內容不符合規範而產生拒絕部位，拒絕部位將轉入歐洲期貨交易所之結算機構於期貨商開立之部位處理專戶，歐洲期貨交易所之結算機構將指示該期貨商於當日執行沖銷拒絕部位，至全部部位沖銷為止，Eurex 將追索部位處理費用及沖銷拒絕部位之損失。
- (三)重申期貨商申報 EU2 截止時點為上午 7:45(重新上傳 EU2 檔案亦同)，倘期貨商因系統故障等特殊因素須延後申報，請於當日上午 7:45 前填具「期貨商延後傳輸『交易人淨未沖銷部位已確認檔(EU2)』時限申請表」，並向本公司確認完成後，該期貨商得申請延長至上午 8:05。倘期貨商未能於截止時點前完成檔案傳送，該期貨商之 Eurex 到期交割部位將視為拒絕部位。