

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

機關地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：陳聖文

聯絡方式：(02)2369-5678分機159

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國105年10月20日

發文字號：台期結字第10503010850號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：公告增修訂本公司「有價證券抵繳保證金抵繳標的增刪作業程序」條文內容，並自即日起實施，請查照。

說明：

- 一、檢附本公司「有價證券抵繳保證金抵繳標的增刪作業程序」修正條文對照表一份。
- 二、本公司每日已於網站公告抵繳標的範圍及歷史增刪紀錄明細資訊，嗣後抵繳標的如有異動時，將不另行發函公告市場。惠請貴公司轉知期貨交易人可至本公司下列網址查詢相關資訊：
 - (一) 可抵繳標的之查詢：<http://www.taifex.com.tw/chinese/5/AcceptableCollateralInq.asp>
 - (二) 可抵繳標的歷史增刪紀錄查詢：<http://www.taifex.com.tw/chinese/5/AcceptableCollateralLogIn>

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、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、中華民國期貨業商業同業公會、財團法人證券投資人及期貨交易人保護中心、台北國際金融資訊協會、各業務部門、本公司網站、記者室

總經理 邱文昌

臺灣期貨交易所股份有限公司有價證券抵繳保證 金抵繳標的增刪作業程序修正條文對照表

修正條文	現行條文	說明
<p>一、本作業程序依據本公司結算保證金收取方式及標準第二條之一第二項規定訂定之。</p>		<p>一、<u>本點新增</u>。</p> <p>二、明定本作業程序之訂定依據。</p>
<p><u>二、本公司於下列情形時，辦理得抵繳保證金之有價證券新增或刪除作業，並於本公司網站公告之：</u></p> <p>(一)本公司公告股票期貨及選擇權契約上市交易、<u>非屬訊息面暫停交易、恢復交易、停止交易、終止上市，或其標的證券經變更交易方法時。</u></p> <p>(二)本公司接獲臺灣證券交易所股份有限公司（以下簡稱臺灣證券交易所）公告新增納入或刪除富時臺灣證券交易所臺灣五十指數成分股，或該成分股非屬訊息面暫停交易、恢復交易、停止買賣、終止上市，或其標的證券經變更交易方法時。</p> <p>(三)本公司接獲臺灣證</p>	<p>一、本公司股票期貨及選擇權契約，於該標的證券期貨及選擇權契約上市、停止交易或終止上市公告時，本公司即同時公告新增或刪除該標的證券為抵繳標的，<u>並副知主管機關，該標的證券之生效日與本公司股票期貨及選擇權契約之生效日相同。</u></p>	<p>一、現行本公司已於每日收盤後，將次一營業日得辦理抵繳保證金之有價證券基本資料檔案以電文方式傳送予各家期貨商，並同時於本公司網站公告揭露有價證券抵繳保證金之抵繳標的及歷史增刪紀錄明細資訊，爰刪除原應透過紙本逐案發函公告各期貨商程序，以簡化作業程序。</p> <p>二、本公司公告新增或刪除得抵繳保證金有價證券之時點，分散規範於現行條文第一點至第四點，為統一規範，爰變更本點條次，及移列現行條文第二點至第四點所定時點規定，並酌作文字修正，於本點明定本公司公告新增或刪除得抵繳保證金有價證券之各款情形。</p> <p>三、另有關於本公司辦理得</p>

<p><u>券交易所公告元大寶來台灣卓越五十證券投資信託基金受益憑證停止買賣或終止上市。</u></p> <p><u>(四)本公司接獲財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心(以下簡稱櫃買中心)公告中央登錄公債或國際債券於該中心等殖成交系統或國際債券交易系統開始買賣、停止買賣或終止買賣時。</u></p>		<p>抵繳保證金之有價證券新增或刪除作業之生效日，業已統一規範於修正條文第三點，爰刪除本點後段所定生效日規定。</p>
	<p>二、臺灣證券交易所股份有限公司(以下簡稱臺灣證券交易所)變更臺灣五十指數之成分股時，依下列程序辦理：</p> <p>(一)本公司自臺灣證券交易所網站查詢相關資訊或接獲臺灣證券交易所電話或公文通知時，將以最速件方式內部陳核。</p> <p>(二)經本公司首長核定後，即對市場辦理抵繳標的增刪異動公告，並同時副知主管機關，該抵繳標的增刪異動之生效日與臺灣證券交易所公告之生效日</p>	<p>一、<u>本點刪除。</u></p> <p>二、配合本公司公告新增或刪除得抵繳保證金有價證券之時點及生效日，已統一規範於修正條文第二點及第三點，爰刪除本點。</p>

	相同。	
	<p>三、本公司股票期貨及選擇權契約之標的證券、富時臺灣證券交易所臺灣五十指數之成分股及經主管機關核定之指數股票型證券投資信託基金受益憑證，經臺灣證券交易所變更交易方法為全額交割或財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心（以下簡稱櫃買中心）變更交易方法為應先收足款券、停止買賣、恢復買賣、終止上市或上櫃時，依本程序第二點程序辦理，該股票及受益憑證之生效日與臺灣證券交易所及櫃買中心公告之生效日相同。</p>	<p>一、<u>本點刪除</u>。</p> <p>二、配合本公司公告新增或刪除得抵繳保證金有價證券之時點及生效日，已統一規範於修正條文第二點及第三點，爰刪除本點。</p>
	<p>四、中央登錄公債及櫃買中心外幣計價國際債券管理規則第三條規定之國際債券經櫃買中心開始買賣、停止買賣、恢復買賣或終止買賣時，依本程序第二點程序辦理，該債券之生效日與櫃買中心公告之生效日相同。</p>	<p>一、<u>本點刪除</u>。</p> <p>二、配合本公司公告新增或刪除得抵繳保證金有價證券之時點及生效日，已統一規範於修正條文第二點及第三點，爰刪除本點。</p>
<p>三、本公司辦理得抵繳保證金之有價證券新增</p>		<p>一、本點新增。</p> <p>二、本公司公告新增或刪</p>

<p>或刪除作業，其生效日與前點各款公告生效日相同。惟本公司於下列情形時，得調整該生效日：</p> <p>(一)本公司接獲臺灣證券交易所或櫃買中心公告時，已逾公告之生效日。</p> <p>(二)本公司無法自臺灣證券交易所或櫃買中心取得該有價證券之基本資料或價格資訊。</p> <p>(三)其他因素致使本公司無法計算該有價證券抵繳價值者。</p>		<p>除得抵繳保證金有價證券之生效日，分散規範於現行條文第一點至第四點，為統一規範，爰移列現行條文第一點至第四點所定生效日規定，並酌作文字修正，於本點明定本公司辦理得抵繳保證金之有價證券新增或刪除作業之生效日與前點各款公告生效日相同；並明定本公司於符合特定條件時，得彈性調整生效日。</p>
<p>四、依本作業程序公告得抵繳保證金之有價證券，如有發生流動性風險之虞時，本公司得停止該有價證券為得抵繳保證金之標的。</p>		<p>一、本點新增。</p> <p>二、考量有價證券抵繳保證金作業首重其安全性，爰增訂本公司如評估已得抵繳保證金之有價證券發生流動性風險之虞時，得停止該有價證券為得抵繳保證金標的之依據。</p>

有價證券抵繳保證金抵繳標的增刪作業程序

中華民國98年1月5日行政院金融監督管理委員會
金管證七字第0970071227號函洽悉
中華民國99年10月8日行政院金融監督管理委員會
金管證期字第09900475783號函准予備查
中華民國99年12月8日行政院金融監督管理委員會
金管證期字第0990067248號函准予備查
中華民國103年2月20日金融監督管理委員會
金管證期字第1030003460號函准予照辦
中華民國103年7月21日金融監督管理委員會
金管證期字第10300253893號准予照辦
中華民國105年10月20日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第10503010850號函自105年10月20日起實施

- 一、本作業程序依據本公司結算保證金收取方式及標準第二條之一第二項規定訂定之。
- 二、本公司於下列情形時，辦理得抵繳保證金之有價證券新增或刪除作業，並於本公司網站公告之：
 - (一)本公司公告股票期貨及選擇權契約上市交易、非屬訊息面暫停交易、恢復交易、停止交易、終止上市，或其標的證券經變更交易方法時。
 - (二)本公司接獲臺灣證券交易所股份有限公司（以下簡稱臺灣證券交易所）公告新增納入或刪除富時臺灣證券交易所臺灣五十指數成分股，或該成分股非屬訊息面暫停交易、恢復交易、停止買賣、終止上市，或其標的證券經變更交易方法時。
 - (三)本公司接獲臺灣證券交易所公告元大寶來台灣卓越五十證券投資信託基金受益憑證停止買賣或終止上市。
 - (四)本公司接獲財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心（以下簡稱櫃買中心）公告中央登錄公債或國際債券於該中心等殖成交系統或國際債券交易系統開始買賣、停止買賣或終止買賣時。
- 三、本公司辦理得抵繳保證金之有價證券新增或刪除作業，其生效日與前點各款公告生效日相同。惟本公司於下列情形時，得調整該生效日：

(一)本公司接獲臺灣證券交易所或櫃買中心公告時，已逾公告之生效日。

(二)本公司無法自臺灣證券交易所或櫃買中心取得該有價證券之基本資料或價格資訊。

(三)其他因素致使本公司無法計算該有價證券抵繳價值者。

四、依本作業程序公告得抵繳保證金之有價證券，如有發生流動性風險之虞時，本公司得停止該有價證券為得抵繳保證金之標的。