

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
承辦部門：結算部
聯絡人：吳小姐
聯絡電話：(02)2369-5678分機3173

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國108年1月31日
發文字號：台期結字第10803000641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：公告修正本公司「結算會員處理委託期貨商部位作業程序」、「期貨商辦理更換受託結算會員作業應行注意事項」、「期貨商辦理期貨交易人部位移轉作業應行注意事項」、「新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨作業要點」、「股價指數類期貨及選擇權契約最後結算價計算方式說明」及「期貨商媒體申報作業辦法」，暨廢止「印度 Nifty 50股價指數期貨契約保證金計收方式說明」及「印度 Nifty 50股價指數期貨契約整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數訂定方式」等結算制度相關規章條文，並自108年9月30日起實施

說明：

- 一、依金融監督管理委員會108年1月28日金管證期字第1070348173號函辦理。
- 二、配合本公司印度50期貨終止上市，爰修正旨揭規章如附件。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人、行情資訊廠商、保管銀行

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證券投資信託暨顧問商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、中央銀行國庫局、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、臺灣集中保管結算所股份有限公司、台北國際金融資訊協會、植根國際資訊股份有限公司、博仲法律事務所、本公司各部門、本公司網站、記者室

總經理 黃炳鈞

臺灣期貨交易所股份有限公司
結算會員處理委託期貨商部位作業程序
修正條文對照表

修正條文	現行條文	說明
<p>五、代為了結期貨契約作業程序</p> <p>((一)至(六),略)</p> <p>(七)結算會員於接獲委託期貨商傳真之申報書後,應於成交當日,依期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者,作業時間為下午二時三十分前;期貨交易契約為下午四時十五分收盤者,作業時間為下午四時三十分前,透過連線之結算系統執行「部位移轉」,將「部位處理專戶」之部位按數量分配到該委託期貨商所申報之自營或客戶帳戶。</p> <p>(以下略)</p>	<p>五、代為了結期貨契約作業程序</p> <p>((一)至(六),略)</p> <p>(七)結算會員於接獲委託期貨商傳真之申報書後,應於成交當日,依期貨交易契約為下午一時四十五分收盤者,作業時間為下午二時三十分前;期貨交易契約為下午四時十五分收盤者,作業時間為下午四時三十分前;期貨交易契約為下午六時十五分收盤者,作業時間為下午六時三十分前,透過連線之結算系統執行「部位移轉」,將「部位處理專戶」之部位按數量分配到該委託期貨商所申報之自營或客戶帳戶。</p> <p>(以下略)</p>	<p>配合印度 Nifty 50 股價指數期貨契約終止上市,爰刪除結算會員辦理下午 6 時 15 分收盤期貨交易契約部位移轉作業時間之規定。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司
期貨商辦理更換受託結算會員作業應行注意事項
修正條文對照表

修正條文	現行條文	說 明
<p>四、期貨商應辦理下列事項：</p> <p>(一) 通知原任結算會員於更換生效日前一營業日下午<u>五</u>時三十分前向本公司提出部位及保證金移轉申請。</p> <p>(二) 於更換生效日一般交易時段開盤前，就其未<u>沖銷</u>部位，傳送部位資料及檔案予新任結算會員，檔案格式請參照（附件二）。</p> <p>(三) 於更換生效日當日一般交易時段開盤前，完成交易系統與結算系統之代碼變更設定。</p>	<p>四、期貨商應辦理下列事項：</p> <p>(一) 通知原任結算會員於更換生效日前一營業日下午<u>七</u>時三十分前向本公司提出部位及保證金移轉申請。</p> <p>(二) 於更換生效日一般交易時段開盤前，就其未<u>了結</u>部位，傳送部位資料及檔案予新任結算會員，檔案格式請參照（附件二）。</p> <p>(三) 於更換生效日當日一般交易時段開盤前，完成交易系統與結算系統之代碼變更設定。</p>	<p>一、配合印度 Nifty 50 股價指數期貨契約終止上市，爰修正期貨商應通知原任結算會員向本公司提出部位及保證金移轉申請作業截止時點，由下午 7 時 30 分調整為下午 5 時 30 分。</p> <p>二、參酌採期貨交易法用字，將「未了結」部位修正為「未沖銷」部位。</p>
<p>六、原任結算會員應於更換生效日前一營業日下午<u>五</u>時三十分前填妥「部位及保證金移轉申請書」（附件四）向本</p>	<p>六、原任結算會員應於更換生效日前一營業日下午<u>七</u>時三十分前填妥「部位及保證金移轉申請書」（附件四）向本</p>	<p>配合印度 Nifty 50 股價指數期貨契約終止上市，爰修正原任結算會員向本公司提出部位及保證金移轉申請作業時點，由下午 7</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>公司結算部提出部位移轉申請，另於更換生效日現金結算保證金提領作業截止前向本公司結算部提出現金保證金移轉申請。</p>	<p>公司結算部提出部位移轉申請，另於更換生效日現金結算保證金提領作業截止前向本公司結算部提出現金保證金移轉申請。</p>	<p>時30分調整為下午5時30分。</p>
<p>附件四 臺灣期貨交易所股份有限公司部位及保證金移轉申請書</p> <p>三、更換結算會員生效日 前一營業日(民國 年 月 日)盤後交易時段收盤後未沖銷部位數移轉至 _____ 期貨商。</p>	<p>附件四 臺灣期貨交易所股份有限公司部位及保證金移轉申請書</p> <p>三、更換結算會員生效日 前一營業日(民國 年 月 日)盤後交易時段收盤後未了結部位數移轉至 _____ 期貨商。</p>	<p>採期貨交易法用字，將「未了結」部位修正為「未沖銷」部位。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司
期貨商辦理期貨交易人部位移轉作業應行注意事項
修正條文對照表

修正條文	現行條文	說明
<p>第四條 期貨商應於移轉生效日前一個營業日下午<u>五</u>時三十分前，由其結算會員填具「部位及保證金移轉申請書」向本公司提出申請。</p> <p>(以下略)</p>	<p>第四條 期貨商應於移轉生效日前一個營業日下午<u>七</u>時三十分前，由其結算會員填具「部位及保證金移轉申請書」向本公司提出申請。</p> <p>(以下略)</p>	<p>配合印度 Nifty 50 股價指數期貨契約終止上市，爰修正期貨商向本公司提出交易人部位及保證金移轉申請作業截止時點，由下午 7 時 30 分調整為下午 5 時 30 分。</p>

臺灣期貨交易所股份有限公司

新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉為財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心黃金現貨登錄及買賣辦法所定之黃金現貨作業要點修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文	說 明
<p>貳、本公司新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨作業方式</p> <p>(一至二，略)</p> <p>三、期貨商、結算會員申報交易人申請契約到期轉黃金現貨作業</p> <p>(一)作業及查詢時間為最後交易日下午四時至六時三十分止。</p> <p>(二)期貨商、結算會員應於下午五時<u>三十分</u>前，向本公司申報有關交易人契約到期轉黃金現貨之申請</p> <p>1.期貨商、結算會員應向本公司申報買方交易人應收登錄櫃檯買賣之黃金現貨交易帳戶明細資料，以及賣方交易人登錄櫃檯買</p>	<p>貳、本公司新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨作業方式</p> <p>(一至二，略)</p> <p>三、期貨商、結算會員申報交易人申請契約到期轉黃金現貨作業</p> <p>(一)作業及查詢時間為最後交易日下午四時<u>三十分</u>至六時三十分止。</p> <p>(二)期貨商、結算會員應於下午五時<u>四十五分</u>前，向本公司申報有關交易人契約到期轉黃金現貨之申請</p> <p>1.期貨商、結算會員應向本公司申報買方交易人應收登錄櫃檯買賣之黃金現貨交易帳戶明細資料，以及賣方交易人登錄櫃檯買</p>	<p>一、配合結算會員與本公司結帳作業時點為下午 5 時 30 分，修正貳、三、(一)(二)及(三)期貨商、結算會員申報交易人申請契約到期轉黃金現貨之各項作業時點。</p> <p>二、使用「若」，作為表達條件性質用字。</p>

修正條文	現行條文	說明
<p>賣之黃金現貨撥轉明細。</p> <p>2.期貨商、結算會員應將買方交易人於下午五時三十分前繳交之預付現貨價款撥入本公司指定之結算保證金專戶，<u>若</u>價款未於下午五時<u>三十分</u>前完成撥入及申報，買方交易人該契約到期轉黃金現貨申請無效。</p> <p>3.期貨商、結算會員應要求賣方交易人將登錄櫃檯買賣之黃金現貨於下午<u>五時</u>前撥轉至本公司開立於集保公司之專戶，<u>若</u>未於下午五時<u>三十分</u>前完成申報者，賣方交易人該契約到期轉黃金現貨申請無效。</p> <p>(三)本公司於下午五時<u>三十分</u>起，依期貨商、結算會員申報之交易人契約到期轉黃金現貨申請資料，產生買方交易人及賣方交易人契約到期轉黃金現貨申請無效名冊及申請成功名冊，並依買</p>	<p>賣之黃金現貨撥轉明細。</p> <p>2.期貨商、結算會員應將買方交易人於下午五時三十分前繳交之預付現貨價款撥入本公司指定之結算保證金專戶，<u>倘</u>價款未於下午五時<u>四十五分</u>前完成撥入及申報，買方交易人該契約到期轉黃金現貨申請無效。</p> <p>3.期貨商、結算會員應要求賣方交易人將登錄櫃檯買賣之黃金現貨於下午<u>五時三十分</u>前撥轉至本公司開立於集保公司之專戶，<u>倘</u>未於下午五時<u>四十五分</u>前完成申報者，賣方交易人該契約到期轉黃金現貨申請無效。</p> <p>(三)本公司於下午五時<u>四十五分</u>起，依期貨商、結算會員申報之交易人契約到期轉黃金現貨申請資料，產生買方交易人及賣方交易人契約到期轉黃金現貨申請無效名冊及申請成功名冊，並</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>方交易人之預付價款及賣方交易人之撥轉黃金現貨資料，產生買方交易人預付現貨價款名冊及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉名冊。</p> <p>(四)期貨商、結算會員應於買方交易人及賣方交易人契約到期轉黃金現貨申請無效名冊及申請成功名冊、買方交易人預付現貨價款名冊及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉名冊產生後，至下午六時三十分止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。</p> <p>四、到期轉現貨名冊指派作業及計算到期轉現貨價款</p> <p>(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時三十分至下午四時。</p> <p>1.本公司於上午八時三</p>	<p>依買方交易人之預付價款及賣方交易人之撥轉黃金現貨資料，產生買方交易人預付現貨價款名冊及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉名冊。</p> <p>(四)期貨商、結算會員應於買方交易人及賣方交易人契約到期轉黃金現貨申請無效名冊及申請成功名冊、買方交易人預付現貨價款名冊及賣方交易人登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉名冊產生後，至下午六時三十分止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。</p> <p>四、到期轉現貨名冊指派作業及計算到期轉現貨價款</p> <p>(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時三十分至下午四時。</p> <p>1.本公司於上午八時三</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>十分起，依申請到期轉現貨部位較少之買方或賣方(若申請到期轉現貨之買賣方部位相同，則依賣方)為主進行隨機指派作業，產生賣方交易人應付黃金現貨名冊、買方交易人應收黃金現貨名冊，並計算到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨之到期轉現貨價款(新臺幣計價黃金期貨契約依最後結算價為計算基礎，黃金選擇權契約依履約價為計算基礎)，產生買方交易人應付價款名冊、賣方交易人應收價款名冊。</p> <p>2.對於未受指派之交易人，本公司產生未受指派買方交易人及未受指派賣方交易人名冊，本公司並返還賣方交易人已撥轉之登錄櫃檯買賣之黃金現貨，並產生未受指派賣方交易人黃金現貨返還名冊。</p> <p>(二)期貨商、結算會員應於賣方交易人應付黃</p>	<p>十分起，依申請到期轉現貨部位較少之買方或賣方(倘申請到期轉現貨之買賣方部位相同，則依賣方)為主進行隨機指派作業，產生賣方交易人應付黃金現貨名冊、買方交易人應收黃金現貨名冊，並計算到期轉登錄櫃檯買賣之黃金現貨之到期轉現貨價款(新臺幣計價黃金期貨契約依最後結算價為計算基礎，黃金選擇權契約依履約價為計算基礎)，產生買方交易人應付價款名冊、賣方交易人應收價款名冊。</p> <p>2.對於未受指派之交易人，本公司產生未受指派買方交易人及未受指派賣方交易人名冊，本公司並返還賣方交易人已撥轉之登錄櫃檯買賣之黃金現貨，並產生未受指派賣方交易人黃金現貨返還名冊。</p> <p>(二)期貨商、結算會員應於賣方交易人應付黃</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>金現貨名冊、買方交易人應收黃金現貨名冊、買方交易人應付價款名冊、賣方交易人應收價款名冊、未受指派買方交易人及未受指派賣方交易人名冊、未受指派賣方交易人黃金現貨返還名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。</p> <p>五、價款收付作業</p> <p>(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時四十分至下午四時止。</p> <p>(二)本公司於上午八時四十分起，就新臺幣計價黃金期貨契約到期轉現貨價款與預付現貨價款之差額進行撥付。</p> <p>(三)本公司完成新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約買方交易人應付到期轉現貨價款及賣方交易人應</p>	<p>金現貨名冊、買方交易人應收黃金現貨名冊、買方交易人應付價款名冊、賣方交易人應收價款名冊、未受指派買方交易人及未受指派賣方交易人名冊、未受指派賣方交易人黃金現貨返還名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。</p> <p>五、價款收付作業</p> <p>(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時四十分至下午四時止。</p> <p>(二)本公司於上午八時四十分起，就新臺幣計價黃金期貨契約到期轉現貨價款與預付現貨價款之差額進行撥付。</p> <p>(三)本公司完成新臺幣計價黃金期貨契約暨黃金選擇權契約買方交易人應付到期轉現貨價款及賣方交易人應</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>收到期轉現貨價款之收付作業，併入結算會員結算保證金權益數計算。</p> <p>(四)若有買方交易人無法提出現金款項辦理到期轉現貨價款之情事，其不足款項由結算會員代為支付。</p> <p>(五)結算會員應至下午四時止，以電腦作業方式查詢其結算保證金權益數，並列印確認存檔。</p> <p>六、買方交易人應收黃金現貨撥轉作業</p> <p>(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時四十分至下午四時止。</p> <p>(二)本公司於辦理完成價款收付作業後，於上午八時四十分起，產生買方交易人應收黃金現貨撥轉名冊，並通知集保公司將本公司專戶內之登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉</p>	<p>收到期轉現貨價款之收付作業，併入結算會員結算保證金權益數計算。</p> <p>(四)倘有買方交易人無法提出現金款項辦理到期轉現貨價款之情事，其不足款項由結算會員代為支付。</p> <p>(五)結算會員應至下午四時止，以電腦作業方式查詢其結算保證金權益數，並列印確認存檔。</p> <p>六、買方交易人應收黃金現貨撥轉作業</p> <p>(一)作業及查詢時間為新臺幣計價黃金期貨契約最後結算日暨黃金選擇權契約到期日上午八時四十分至下午四時止。</p> <p>(二)本公司於辦理完成價款收付作業後，於上午八時四十分起，產生買方交易人應收黃金現貨撥轉名冊，並通知集保公司將本公司專戶內之登錄櫃檯買賣之黃金現貨撥轉</p>	

修正條文	現行條文	說明
<p>至買方交易人指定之交易帳戶。</p> <p>(三)若買方交易人其到期轉現貨價款由結算會員代為支付，結算會員應申報其為處理黃金現貨之交易帳戶，本公司通知集保公司將本公司專戶內之黃金現貨撥轉至結算會員申報之交易帳戶。</p> <p>(四)期貨商、結算會員應於買方交易人應收黃金現貨撥轉名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。</p>	<p>至買方交易人指定之交易帳戶。</p> <p>(三)倘買方交易人其到期轉現貨價款由結算會員代為支付，結算會員應申報其為處理黃金現貨之交易帳戶，本公司通知集保公司將本公司專戶內之黃金現貨撥轉至結算會員申報之交易帳戶。</p> <p>(四)期貨商、結算會員應於買方交易人應收黃金現貨撥轉名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。</p>	

臺灣期貨交易所

股價指數類期貨及選擇權契約最後結算價計算方式說明

壹、交易標的為國內股價指數類契約最後結算價計算方式

一、法源依據

本公司「臺灣證券交易所股價指數期貨契約交易規則」、「臺灣證券交易所電子類股價指數期貨契約交易規則」、「臺灣證券交易所金融保險類股價指數期貨契約交易規則」、「臺灣證券交易所股價指數小型期貨契約交易規則」、「富時臺灣證券交易所臺灣 50 指數期貨契約交易規則」、「中華民國證券櫃檯買賣中心股價指數期貨契約交易規則」、「臺灣證券交易所未含金融電子類股價指數期貨契約交易規則」第 13 條及「臺灣證券交易所股價指數選擇權契約交易規則」、「臺灣證券交易所電子類股價指數選擇權契約交易規則」、「臺灣證券交易所金融保險類股價指數選擇權契約交易規則」第 16 條。

二、最後結算價之計算方式

股價指數類期貨及選擇權契約之最後結算價，以最後結算日（到期日）臺灣證券交易所及中華民國證券櫃檯買賣中心當日交易時間收盤前 30 分鐘內所提供標的指數之算術平均價訂之。

前項標的指數之算術平均價，係以前項交易時間內臺灣證券交易所及中華民國證券櫃檯買賣中心每次揭示之標的指數(交易時段 13:00(不含)至 13:25(含)，加計最後一筆收盤指數)，採簡單算術平均計算，並取至最接近各期貨契約報價最小升降單位整數倍之數值訂之；若算術平均價為上下兩升降單位之中數，則向上取至最接近各期貨契約報價最小升降單位整數倍之數值訂之。若標的指數遇其成分股實施收市撮合延緩，則計算最後結算價之最後一筆收盤指

數，為收市撮合延緩時間終了後揭示之收盤指數。

上揭契約遇臺灣證券交易所或中華民國證券櫃檯買賣中心依其交易系統與交易傳輸系統發生故障或中斷之處理措施宣布暫停交易，且未能於當日交易時間收盤前三十分鐘內恢復正常，最後結算價以臺灣證券交易所或中華民國證券櫃檯買賣中心揭示最後一筆收盤指數之時點(含)，往前取三十分鐘實際交易時間內每次揭示之標的指數計算之；若臺灣證券交易所或中華民國證券櫃檯買賣中心全日合計交易時間不足三十分鐘，以實際交易時間取得之標的指數計算之。納入計算最後結算價之標的指數筆數，以不超過前項之取樣筆數為限。

貳、交易標的為國外股價指數類契約最後結算價計算方式

一、法源依據

本公司「東京證券交易所股價指數期貨契約交易規則」、「美國道瓊工業平均股價指數期貨契約交易規則」、「美國 S&P 500 股價指數期貨契約交易規則」第 13 條。

二、最後結算價之計算方式

(一) 東京證券交易所股價指數期貨契約

東京證券交易所股價指數期貨契約之最後結算價，以最後交易日之次一東京證券交易所營業日該交易所計算之標的指數特別報價(Special Quotation, SQ)訂之。

(二) 美國道瓊工業平均股價指數期貨契約及美國 S&P 500 股價指數期貨契約

美國道瓊工業平均股價指數期貨契約之最後結算價，以最

後交易日標準普爾道瓊指數編製公司(SPDJI)計算之美國道瓊工業股價指數特別開盤價訂之。

美國 S&P 500 股價指數期貨契約之最後結算價，以最後交易日標準普爾道瓊指數編製公司(SPDJI)計算之美國 S&P 500 股價指數特別開盤價訂之。

參、股價指數類期貨契約到期部位契約價值計算方式

以新臺幣計價之股價指數類期貨契約到期部位契約價值，為各契約之最後結算價乘以指數每點價值，元以下無條件捨去。

臺灣期貨交易所股份有限公司
期貨商媒體申報作業辦法修正條文對照表

修正條文	原條文	說 明
<p>第五條 期貨商以媒體申報資料之期限依下列規定辦理：</p> <p>一、期貨商基本資料應於開業或異動後三個營業日內申報。</p> <p>二、期貨商董事、監察人、經理人及持有公司股份超過百分之十之股東，應於開業後三個營業日內申報；持有股份變動者，應於次月十五日前彙總申報。</p> <p>三、財務資料屬按日或不定期申報者，應於應申報日下午七時三十分前申報。</p> <p>四、(略)</p>	<p>第五條 期貨商以媒體申報資料之期限依下列規定辦理：</p> <p>一、期貨商基本資料應於開業或異動後三個營業日內申報。</p> <p>二、期貨商董事、監察人、經理人及持有公司股份超過百分之十之股東，應於開業後三個營業日內申報；持有股份變動者，應於次月十五日前彙總申報。</p> <p>三、財務資料屬按日或不定期申報者，應於應申報日下午七時三十分前申報。 <u>倘未能於應申報日規定時限完成申報者，應先申報當日截至下午四時十五分止之財務資料，並於次一營業日上午九時前完成申報。</u></p> <p>四、(略)</p>	<p>一、配合本公司印度 Nifty 50 股價指數期貨契約終止上市及考量期貨商完成結帳作業時點，修正期貨商財務資料屬按日或不定期申報之作業時點為應申報日下午 7 時 30 分前，爰刪除第五條第一項第三款，倘期貨商未能於應申報日完成申報之規定。</p> <p>二、引述其他法規名稱，不使用引號，爰修正第五條第一項第六款及第七款文字。</p>

<p>五、(略)</p> <p>六、期貨商錯帳及更正帳號申報資料應按本公司期貨商錯帳及更正帳號申報處理作業要點規定之申報期限申報。</p> <p>七、委託人違約申報資料應按本公司期貨商申報委託人違約案件處理作業要點規定之申報期限申報。</p> <p>八、(略)</p>	<p>五、(略)</p> <p>六、期貨商錯帳及更正帳號申報資料應按本公司「期貨商錯帳及更正帳號申報處理作業要點」規定之申報期限申報。</p> <p>七、委託人違約申報資料應按本公司「期貨商申報委託人違約案件處理作業要點」規定之申報期限申報。</p> <p>八、(略)</p>	
--	--	--

臺灣期貨交易所股份有限公司
印度Nifty 50股價指數期貨契約
保證金計收方式說明(廢止)

一、法源依據

本公司「印度 Nifty 50 股價指數期貨契約交易規則」第 15 條及「結算保證金收取方式及標準」第 4 條、第 5 條及第 5 條之 2。

二、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約保證金計收方式

(一)保證金計算方式

依本公司「結算保證金收取方式及標準」第 4 條規定，結算保證金之計算公式為

$$\text{結算保證金} = \text{印度 Nifty 50 股價指數期貨價格} \times \text{契約乘數} \times \text{風險價格係數}$$

風險價格係數：係參考一段期間內期貨契約之股價指數變動幅度，估算至少可涵蓋一日股價指數變動幅度百分之九十九信賴區間之值。

(二)保證金收取標準

本契約結算保證金、維持保證金及原始保證金之收取標準，以千元為整數，千元以下部分無條件進位至千元。

(三)保證金調整方式

本契約上市交易後，經每日計算之結算保證金金額，相較於現行收取之結算保證金金額變動幅度達百分之十以上，或視市場狀況於必要時，結算保證金之收取得調整之，調整後結算保證金、維持保證金及原始保證金收取標準，於公告日之次一營業日交易時段結束後起實施。

二、印度 Nifty 50 股價指數期貨契約組合部位之保證金收取方式

本契約適用相同商品價差部位組合保證金

部位組合	保證金計收方式	備註
買一口印度 50 期貨 賣一口印度 50 期貨	收取一口印度 50 期貨保證金	適用於不同最後 結算日之組合

臺灣期貨交易所股份有限公司
印度Nifty 50股價指數期貨契約
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數訂定方式(廢止)

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=印度 Nifty 50 股價指數期貨契約結算保證金

二、極端變動倍數(Extreme Move Multiplier)及極端涵蓋百分比
(Extreme Move Covered Fraction)

(一)極端變動倍數定為 3 倍

(二)極端涵蓋比率定為 32%

本二項參數之調整，由本公司另訂之。

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range)：不適用。

四、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)

跨月價差風險值=印度 Nifty 50 股價指數期貨契約結算保證金×50%

本參數之調整，由本公司另訂之。

五、跨商品價差折抵率(Inter-Commodity Spread Credit Rate)及契約價
值耗用比率(Delta Per Spread Ratio)：無。

六、空方選擇權最低風險值(Short Option Minimum Charge)：不適用。

