

臺灣期貨交易所股份有限公司 公告

地址：台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：王奇木
聯絡方式：02-23695678 分機 174

受文者：如行文單位

發文日期：中華民國100年1月18日
發文字號：台期結字第10000002110號
速別：普通件
附件：如文

主旨：公告本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」修正條文，並自即日起實施。

依據：行政院金融監督管理委員會100年1月10日金管證期字第0990073232號函。

公告事項：

一、本公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」第陸點修正條文及對照表如附件。

二、本公司十年期公債期貨契約實物交割制度下以現金結算時，其款項由總額收付調整為淨額收付，爰修正前揭作業要點第陸點如下：

(一)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之賣方交易人交割債券撥轉及申報作業時間，由最後交易日次二營業日下午一時三十分前，調整為最後交易日次二營業日上午十一時前。本公司公告之現金結算價款，由總額調整為淨額。

(二)本公司應收交割債券指派及交割價款計算作業時間，由最後交易日次二營業日下午二時起，調整為最後交易日次二營業日上午十一時起。

(三)本公司交割債券不足之處理作業時間，由最後交易日次二營業日下午二時起，調整為最後交易日次二營業日上午十一時起。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人

副本：行政院金融監督管理委員會、行政院金融監督管理委員會證券期貨局、中央銀行、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、中華民國期貨商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、中華民國銀行商業同業公會全國聯合會、財團法人中華民國證券暨期貨市場發展基金會、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、臺灣銀行、華南商業銀行股份有限公司、兆豐國際商業銀行股份有限公司、國泰世華商業銀行、博仲法律事務所、法源資訊股份有限公司、本公司網站、各業務部門、記者室

總經理 王中愷

臺灣期貨交易所股份有限公司「期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點」修正條文對照表

修 正 條 文	現 行 條 文
<p>四、十年期公債期貨契約</p> <p>(一)結算會員登錄公債交割帳戶開立作業</p> <p>(以下略)</p> <p>(六)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之賣方交易人交割債券撥轉及申報作業</p> <p>1.作業時間為最後交易日次二營業日上午九時至下午一時三十分止。</p> <p>2.期貨商、結算會員應通知出具交割能力證明之賣方交易人於<u>上午十一時</u>前，將交割債券撥入本公司登錄公債交割帳戶，並向賣方交易人取得交割債券撥轉明細。倘賣方交易人未能完成撥轉者，期貨商、結算會員應要求其依本公司公告之現金結算淨價款，<u>於下午一時三十分前</u>，將價款撥入其客戶保證金專戶，其現金結算價決定方式依(十一)之規定辦理。</p> <p>3.期貨商、結算會員應於<u>上午十一時</u>前以電腦作業方式向本公司申報賣方交易人交割債券撥轉明細。</p> <p>(七)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之買方交易人交割價款交付作業</p> <p>1.作業時間為最後交易日之次二</p>	<p>四、十年期公債期貨契約</p> <p>(一)結算會員登錄公債交割帳戶開立作業</p> <p>(以下略)</p> <p>(六)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之賣方交易人交割債券撥轉及申報作業</p> <p>1.作業時間為最後 交易日次二營業日上午九時至下午一時三十分止。</p> <p>2.期貨商、結算會員應通知出具交割能力證明之賣方交易人於<u>下午一時三十分</u>前，將交割債券撥入本公司登錄公債交割帳戶，並向賣方交易人取得交割債券撥轉明細。倘賣方交易人未能完成撥轉者，期貨商、結算會員應要求其依本公司公告之現金結算價款，將價款撥入其客戶保證金專戶，其現金結算價決定方式依(十一)之規定辦理。</p> <p>3.期貨商、結算會員應於<u>下午一時三十分</u>前以電腦作業方式向本公司申報賣方交易人交割債券撥轉明細。</p> <p>(七)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之買方交易人交割價款交付作業</p> <p>1.作業時間為最後 交易日之次</p>

修正條文	現行條文
<p>營業日上午九時至下午一時三十分止。</p> <p>2.期貨商、結算會員應要求出具交割能力證明之買方交易人於下午一時三十分前，依本公司公告各期別交割債券之交割價款，將價款撥入其於期貨商、結算會員之客戶保證金專戶。</p> <p>(八)應收交割債券指派及交割價款計算作業</p> <p>1.作業時間為最後交易日次二營業日<u>上午十一</u>時至下午四時止。</p> <p>2.本公司於<u>上午十一</u>時起，依賣方交易人撥轉及申報自本公司抵繳專戶撥轉之交割債券數額，產生賣方交易人應付交割債券名冊後，採隨機方式產生買方交易人指派交割債券名冊，並計算交割價款，產生買方應付及賣方應收交割價款名冊。</p> <p>3.期貨商、結算會員應於賣方交易人應付交割債券名冊、買方交易人指派交割債券名冊、買方應付交割價款名冊及賣方應收交割價款名冊產生後，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>(九)交割價款收付作業 (以下略)</p> <p>(十)買方交易人應收交割債券撥轉作業</p>	<p>二營業日上午九時至下午一時三十分止。</p> <p>2.期貨商、結算會員應要求出具交割能力證明之買方交易人於下午一時三十分前，依本公司公告各期別交割債券之交割價款，將價款撥入其於期貨商、結算會員之客戶保證金專戶。</p> <p>(八)應收交割債券指派及交割價款計算作業</p> <p>1.作業時間為最後交易日次二營業日<u>下午二</u>時至下午四時止。</p> <p>2.本公司於<u>下午二</u>時起，依賣方交易人撥轉及申報自本公司抵繳專戶撥轉之交割債券數額，產生賣方交易人應付交割債券名冊後，採隨機方式產生買方交易人指派交割債券名冊，並計算交割價款，產生買方應付及賣方應收交割價款名冊。</p> <p>3.期貨商、結算會員應於賣方交易人應付交割債券名冊、買方交易人指派交割債券名冊、買方應付交割價款名冊及賣方應收交割價款名冊產生後，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>(九)交割價款收付作業 (以下略)</p> <p>(十)買方交易人應收交割債券撥轉作業</p>

修正條文	現行條文
<p>(以下略)</p> <p>(十一)交割債券不足之處理作業</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.作業時間為最後交易日之次日營業日<u>上午十一</u>時至下午四時止。 2.本公司遇有交割債券不足時，於<u>上午十一</u>時起依不足之數額計算現金結算<u>淨</u>價款，產生買方應收及賣方應付現金結算<u>淨</u>價款名冊。 3.期貨商、結算會員應於下午二時三十分前，將應付現金結算<u>淨</u>價款存入本公司指定之結算保證金專戶。 4.本公司於下午二時三十分起辦理結算會員現金結算<u>淨</u>價款收付作業，併入結算會員結算保證金權益數計算。 5.結算會員應於下午二時三十分起，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>(以下略)</p> <p>(十一)交割債券不足之處理作業</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.作業時間為最後交易日之次日營業日<u>下午二</u>時至下午四時止。 2.本公司遇有交割債券不足時，於<u>下午二</u>時起依不足之數額計算現金結算價款，產生買方應收及賣方應付現金結算價款名冊。 3.期貨商、結算會員應於下午二時三十分前，將應付現金結算價款存入本公司指定之結算保證金專戶。 4.本公司於下午二時三十分起辦理結算會員現金結算價款收付作業，併入結算會員結算保證金權益數計算。 5.結算會員應於下午二時三十分起，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>(以下略)</p> <p>(十二)期貨商申報交易人違約處理作業</p> <p>期貨商因交易人有下列情事之一者，應依本公司「期貨商申報委託人違約案件處理作業要點」向本公司申報：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.買方交易人未交付交割價款者； 2.賣方交易人未能完成交割債券交付，且未依規定交付現金結算<u>淨</u>價款者。 	<p>(以下略)</p> <p>(十二)期貨商申報交易人違約處理作業</p> <p>期貨商因交易人有下列情事之一者，應依本公司「期貨商申報委託人違約案件處理作業要點」向本公司申報：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.買方交易人未交付交割價款者； 2.賣方交易人未能完成交割債券交付，且未依規定交付現金結算價款者。

臺灣期貨交易所股份有限公司期貨商、結算會員辦理結算交割作業要點修正條文

中華民國一〇〇年一月十日行政院金融監督管理委員會

金管證期字第〇九九〇〇七三二二三二號函准予備查

中華民國一〇〇年一月一十八日臺灣期貨交易所股份有限公司

台期結第一〇〇〇〇〇〇二一〇號函公告修正

陸、到期交割作業

四、十年期公債期貨契約

(一)結算會員登錄公債交割帳戶開立作業

(以下略)

(六)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之賣方交易人

交割債券撥轉及申報作業

- 1.作業時間為最後交易日次二營業日上午九時至下午一時三十分止。
- 2.期貨商、結算會員應通知出具交割能力證明之賣方交易人於上午十一時前，將交割債券撥入本公司登錄公債交割帳戶，並向賣方交易人取得交割債券撥轉明細。倘賣方交易人未能完成撥轉者，期貨商、結算會員應要求其依本公司公告之現金結算淨價款，於下午一時三十分前，將價款撥入其客戶保證金專戶，其現金結算價決定方式依(十一)之規定辦理。
- 3.期貨商、結算會員應於上午十一時前以電腦作業方式向本公司申報賣方交易人交割債券撥轉明細。

(七)期貨商、結算會員辦理出具交割能力證明之買方交易人

交割價款交付作業

- 1.作業時間為最後交易日之次二營業日上午九時至下午一時三十分止。
- 2.期貨商、結算會員應要求出具交割能力證明之買方交易人於下午一時三十分前，依本公司公告各期別交割債券之交割價款，將價款撥入其於期貨商、結算會員之客戶保證金專戶。

(八)應收交割債券指派及交割價款計算作業

- 1.作業時間為最後交易日次二營業日上午十一時至下午四時止。
- 2.本公司於上午十一時起，依賣方交易人撥轉及申報自本公司抵繳專戶撥轉之交割債券數額，產生賣方交易人應付交割債券名冊後，採隨機方式產生買方交易人指派交割債券名冊，並計算交割價款，產生買方應付及賣方應收交割價款名冊。
- 3.期貨商、結算會員應於賣方交易人應付交割債券名冊、買方交易人指派交割債券名冊、買方應付交割價款名冊及賣方應收交割價款名冊產生後，至下午四時止，以電腦作業方式查詢名冊並列印確認存檔。

(九)交割價款收付作業

(以下略)

(十)買方交易人應收交割債券撥轉作業

(以下略)

(十一)交割債券不足之處理作業

- 1.作業時間為最後交易日之次二營業日上午十一時至下午四時止。
- 2.本公司遇有交割債券不足時，於上午十一時起依不足之數額計算現金結算淨價款，產生買方應收及賣方應付現金結算淨價款名冊。
- 3.期貨商、結算會員應於下午二時三十分前，將應付現金結算淨價款存入本公司指定之結算保證金專戶。
- 4.本公司於下午二時三十分起辦理結算會員現金結算淨價款收付作業，併入結算會員結算保證金權益數計算。
- 5.結算會員應於下午二時三十分起，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。

(以下略)

(十二)期貨商申報交易人違約處理作業

期貨商因交易人有下列情事之一者，應依本公司「期貨商

申報委託人違約案件處理作業要點」向本公司申報：

- 1.買方交易人未交付交割價款者；
- 2.賣方交易人未能完成交割債券交付，且未依規定交付現金結算淨價款者。