

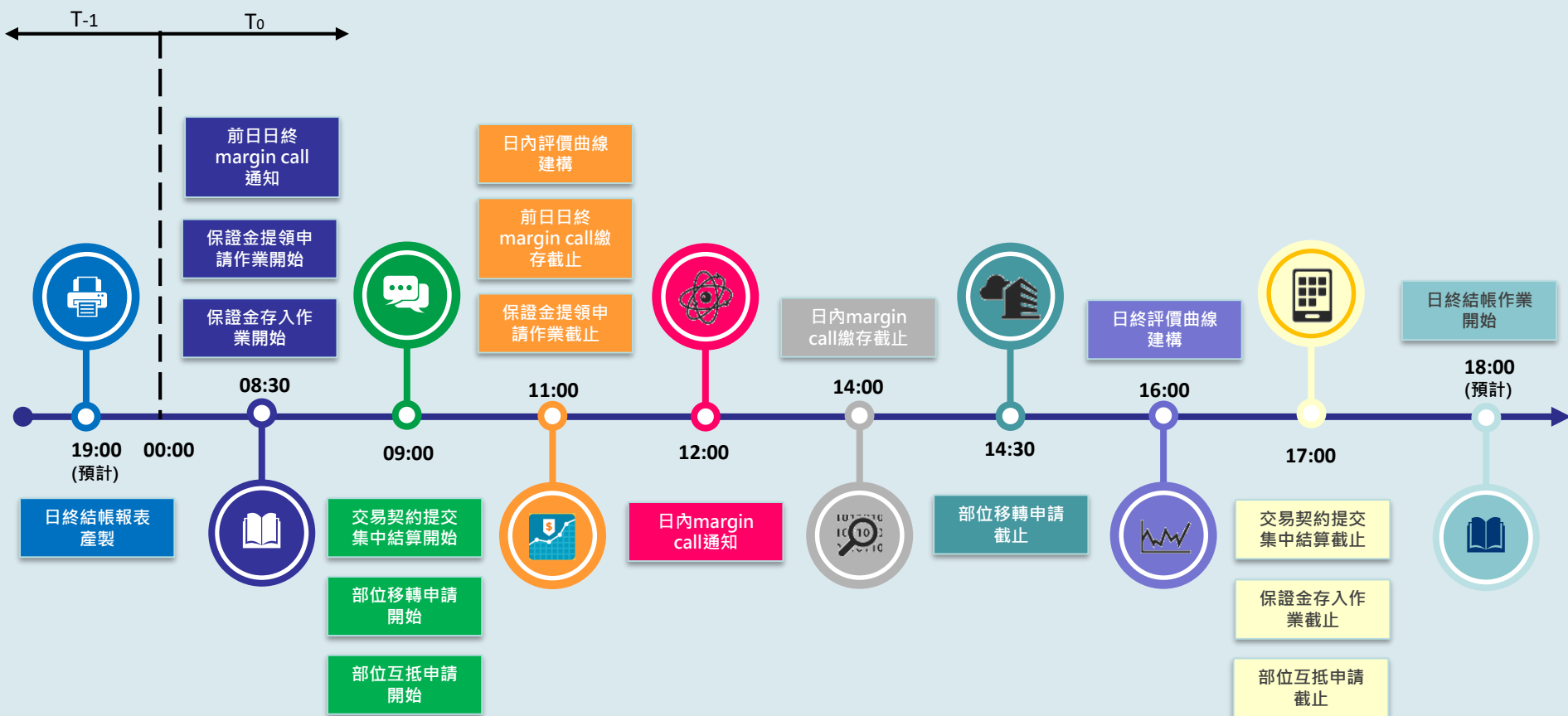


案由一、有關本公司建置店頭衍生性 金融商品集中結算系統之業務時程規 劃



一、有關本公司店頭衍生性商品集中 結算系統每日作業時程規劃

每日作業時程規劃



每日盤中作業及作業時點

作業時間	作業項目
08:30	結算帳戶基本資料檔新增/刪除/異動申請
	保證金存入及提領申請
	前一營業日日終保證金追繳通知
09:00	交易提交集中結算
	部位移轉申請
	部位互抵申請
11:00	保證金提領申請截止
	前一營業日日終保證金追繳繳存截止
10:00、11:00	前一營業日未通過檢核之Backloading交易保證金檢核作業
11:00~12:00	日內Yield Curve建置及日內洗價
12:00	日內保證金追繳通知
14:00	日內保證金追繳繳存截止
14:30	部位移轉申請截止
16:00~17:00	建置日終Yield Curve

每日盤後作業及作業時點

作業時間	作業項目
17:00	保證金存入截止
	結算帳戶基本資料檔新增/刪除/異動申請截止
	結算帳戶每日結算類型異動申請截止
	部位互抵申請截止
	更新可抵繳有價證券標的
	交易提交集中結算截止
結算帳戶每日結算類型異動申請截止後	結算帳戶每日結算類型異動確認及生效作業
交易提交處理作業完成後	盤後部位異動 (如：部位移轉、部位互抵等)
盤後部位異動作業完成後	部位異動截止
部位異動截止後	保證金及損益計算
保證金及損益計算完成後	部位及款項結帳
部位及款項結帳後	產製結算相關報表
	Backloading 交易檢核作業



二、有關本公司店頭衍生性商品集中 結算系統專案時程規劃

本案時程規劃

