

店頭集中結算機制 第二階段說明會

臺灣期貨交易所
2022年10月28日



大綱

報告事項-

壹、第二階段規畫說明

- 一、上線時程
- 二、CCP法律契約架構
- 三、參與集中結算主要工作事項
 - 1)資格申請
 - 2)系統開發及測試
 - 3)簽訂契約

貳、Client API連線方式說明

參、NDF交易登記平台-TradeServ

肆、NDF評價系統-Numerix

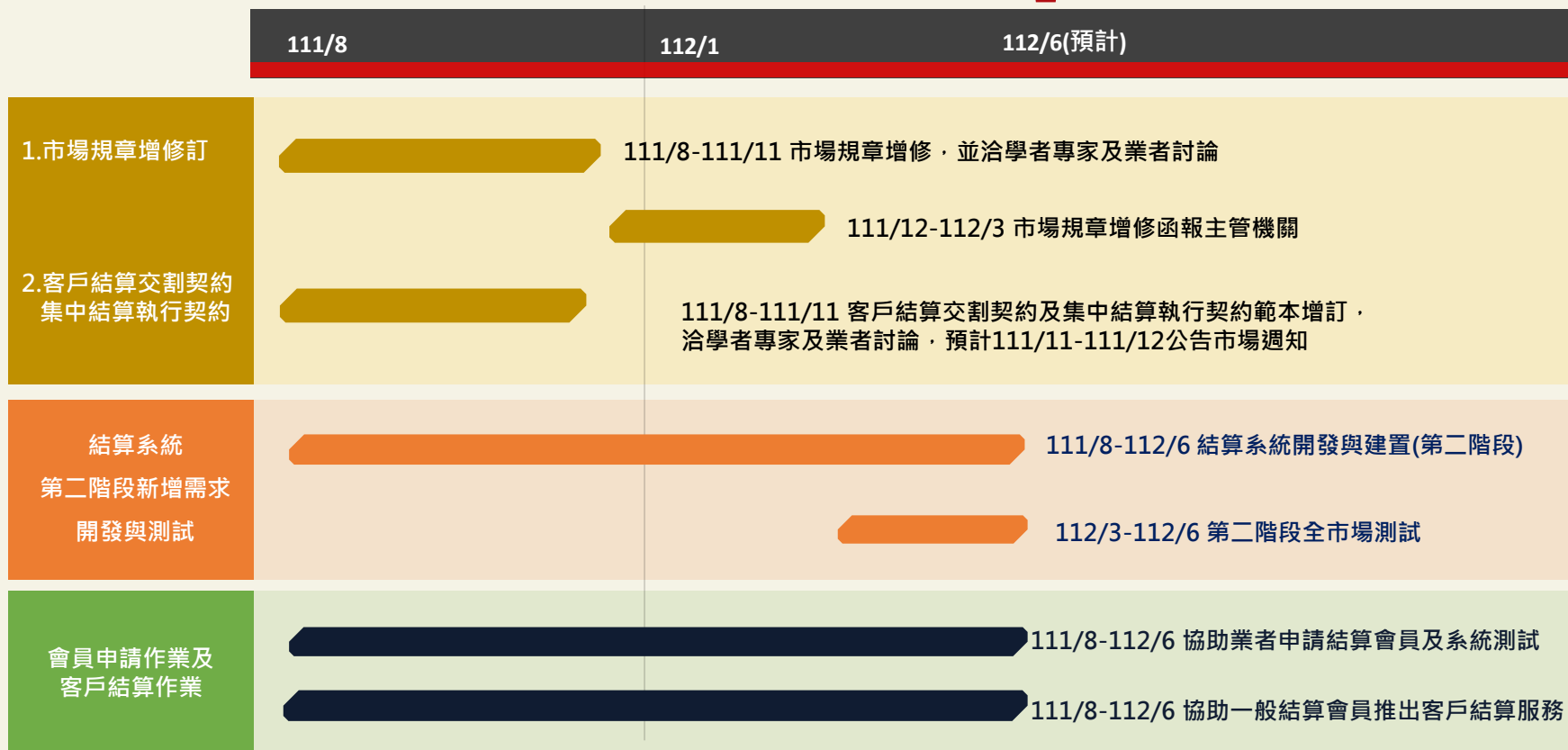
討論事項-

一、第二階段上線時程

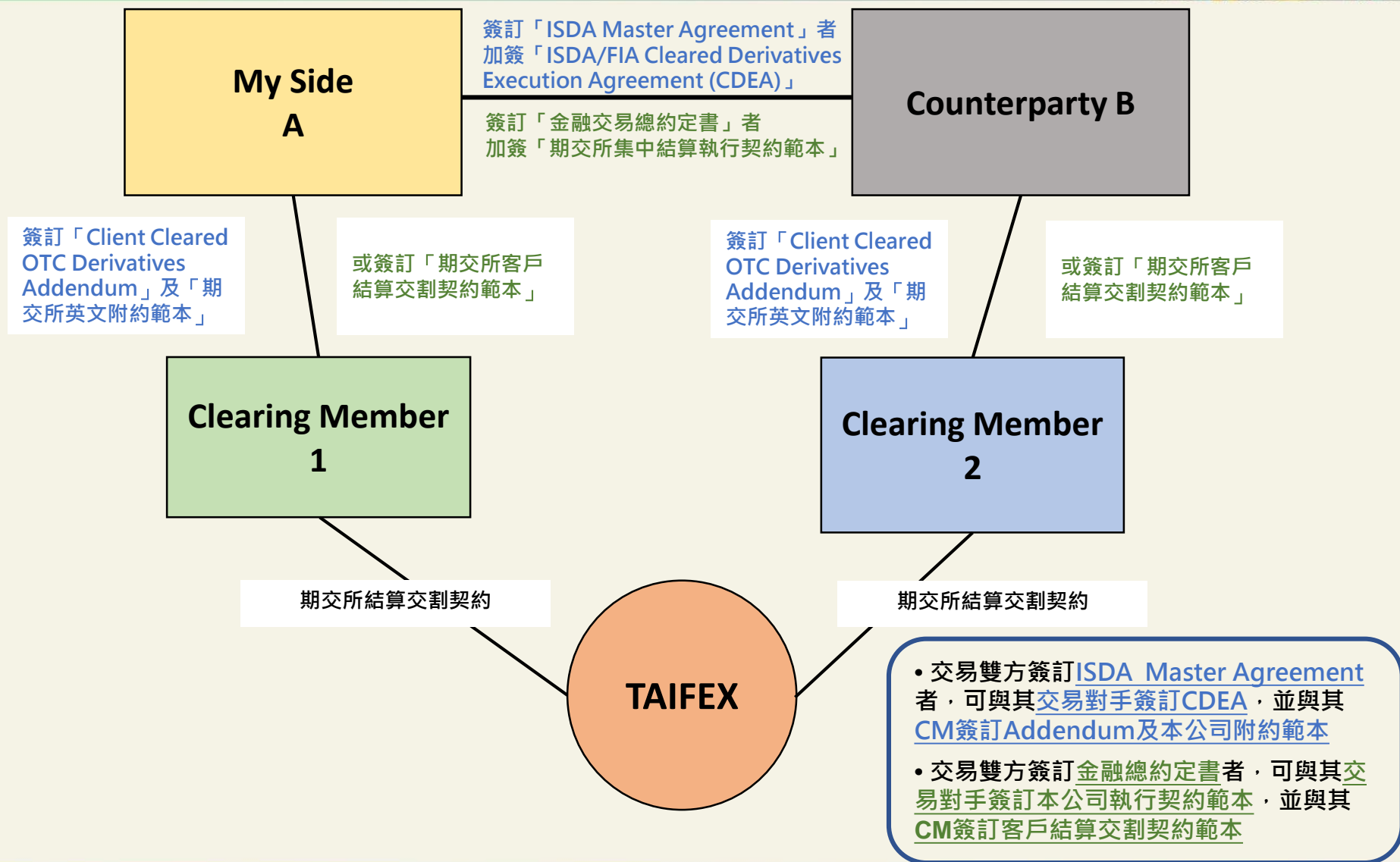


第二階段上線

- *新增客戶(Client)集中結算
- *新增新臺幣NDF自願性集中結算
- *規劃推出新臺幣 IRS強制集中結算
(視市場參與者準備狀況而定)



二、CCP法律契約架構



三、參與集中結算主要工作事項

個別結算會員



1

前置作業

- 評估申請結算會員資格要件與範圍
- 規劃專案時程
- 預算評估與編列
- 規劃資訊設備需求
- 規劃適足人力
- 規劃辦公場地與設備

3

系統開發

- 將期交所風控與結算交割等報表導入現行中台與後台系統之功能開發

5

內部授權

- 取得董事會或總機構授權人員核議通過辦理店頭結算業務（含預算編列）
- 負責人簽訂法律文件

7

帳戶開立

- 開設「店頭自有結算保證金專戶」

9

取得結算會員資格

- 繳存交割結算基金
- 繳交結算會員註冊費

Month 1

Month 2

Month 3

Month 4

Month 5

Month 6

業務部門

資訊部門

稽核部門

法律遵循部門

財務與出納部門

2

申請書件撰擬及契約審閱

- 準備結算會員申請書件
- 審閱法律文件(如未具消極資格聲明書、承諾書或保證函等)與相關契約(如CDEA或集中結算執行契約、電腦連線契約及結算交割契約)
- 規劃店頭結算業務內控制度
- 撰擬營業計劃書

4

系統測試

- 確認連線測試時程
- 執行契約提交平台連線
- 執行入口網站連線
- 中後台系統新增功能測試

6

會員資格申請

- 啟動聯繫會議
- 指定店頭集中結算業務開辦日
- 準備遞送申請文件及附件

8

契約簽訂

- 與交易對手簽訂CDEA或集中結算執行契約
- 與期交所簽訂電腦連線契約及結算交割契約

三、參與集中結算主要工作事項

一般結算會員



1

前置作業

- 評估申請結算會員資格要件與範圍
- 規劃專案時程
- 預算評估與編列
- 規劃資訊設備需求
- 規劃適足人力
- 規劃辦公場地與設備

3

系統開發

- 將期交所風控與結算交割等報表導入現行中台與後台系統之功能開發
- RFC功能開發或介接
- 客戶部位、帳務、結算交割報表查詢等相關功能開發

5

系統測試

- 確認連線測試時程
- 執行契約提交平台連線
- 執行入口網站連線
- 中後台系統新增功能與客戶系統介接測試

8

帳戶開立

- 開設與期交所往來帳戶
「店頭自有結算保證金專戶」
「店頭客戶結算保證金專戶」
- 開設與客戶往來帳戶
「店頭客戶保證金專戶」

10

取得結算會員資格

- 繳存交割結算基金
- 繳交結算會員註冊費

11

與客戶簽約

- 與客戶簽訂Addendum與附約，或客戶結算交割契約
- 取得客戶書面聲明，其已瞭解並遵守相關規定

Month 1

Month 2

Month 3

Month 4

Month 5

Month 6

業務部門

資訊部門

稽核部門

法律遵循部門

財務與出納部門

2

申請書件撰擬及契約審視

- 準備結算會員申請書件
- 檢閱法律文件（包含未具消極資格聲明書、承諾書或保證函等）與相關契約（電腦連線契約及結算交割契約）
- 規劃店頭結算業務內控制度
- 撰擬營業計劃書

4

客戶集中結算作業

- 客戶徵信、輔導客戶集中結算等相關事項
- 檢閱相關契約（如CDEA或集中結算執行契約、Addendum與附約或客戶結算交割契約）

6

內部授權

- 取得董事會或總機構授權人員核議通過辦理店頭結算業務（含預算編列）
- 負責人簽訂法律文件

7

會員資格申請

- 啟動聯繫會議
- 指定店頭集中結算業務開辦日
- 準備遞送申請文件及附件

9

契約簽訂

- 與交易對手簽訂CDEA或集中結算執行契約
- 與期交所簽訂電腦連線契約及結算交割契約

三、參與集中結算主要工作事項

客戶



1

前置作業

- 評估簽約之一般結算會員對象
- 規劃專案時程
- 預算評估與編列
- 確認資訊需求

3

系統開發

- 集中結算帳務、交割等相關功能開發

6

繳存保證金

- 提交集中結算前繳交保證金予一般結算會員

Month 1

Month 2

Month 3

Month 4

Month 5

Month 6

業務部門

資訊部門

稽核部門

法律遵循部門

財務與出納部門

2

法規文件審視

- 瞭解集中結算相關規定
- 審視相關契約(如CDEA或集中結算執行契約、Addendum與附約或客戶結算交割契約、客戶聲明書等)

4

系統測試

- 執行交易契約提交平台連線
- 與結算會員間核對帳務及部位等相關測試

5

契約簽訂

- 與交易對手簽訂CDEA或集中結算執行契約
- 與結算會員簽訂簽訂Addendum與附約，或客戶結算交割契約