

台灣期貨交易所111年「店頭衍生性商品集中結算系統」第一梯次假日測試時程(2022/07/02)

測試日期(7/2) 時間	測試事項: 模擬店頭集中結算開業日7/25(營業日)	測試事項: 模擬7/26(營業日)
08:30	*開放結算帳戶基本資料新增/刪除/異動申請作業 *開放保證金存入及提領申請	
08:45	*開放交易提交集中結算 *開放部位移轉申請 *開放部位互抵申請 *提交Backloading交易(註*)	
09:00	查詢匯率資料(日內)	
10:00	*查詢日內評價曲線 *日內保證金繳存通知	
10:15	*保證金提領申請截止 *日內保證金繳存時限截止	
10:30	*查詢匯率資料(日終) *結算帳戶基本資料檔新增/刪除/異動申請截止 *交易提交集中結算截止 *部位移轉申請截止 *部位互抵申請截止 *保證金存入申請截止	
10:35	*查詢日終評價曲線 *查詢當日為fixing date之結算契約fixing rate	
11:00	*查詢日終結算相關報表 *查詢Backloading交易保證金適足性檢核結果	
11:30~13:30	批次及換日作業	
13:30		*開放結算帳戶基本資料新增/刪除/異動申請作業 *開放保證金存入及提領申請 *前一營業日(7/25)EOD保證金繳存通知 *前一營業日(7/25)Backloading交易保證金繳存通知
13:45		*開放交易提交集中結算 *開放部位移轉申請 *開放部位互抵申請 *提交Backloading交易(註*)
14:00		*查詢匯率資料(日內) *查詢前一營業日(7/25)未通過之Backloading交易保證金檢核結果(1)
14:15		*前一營業日(7/25)EOD保證金繳存時限截止 *查詢前一營業日(7/25)未通過之Backloading交易保證金檢核結果(2)
15:00		*查詢日內評價曲線 *日內保證金繳存通知
15:15		*保證金提領申請截止 *日內保證金繳存時限截止
15:30		*查詢匯率資料(日終) *結算帳戶基本資料檔新增/刪除/異動申請截止 *交易提交集中結算截止 *部位移轉申請截止 *部位互抵申請截止 *保證金存入申請截止
15:35		*查詢日終評價曲線 *查詢當日為fixing date之結算契約fixing rate
16:00		*查詢日終結算相關報表 *查詢Backloading交易保證金適足性檢核結果
17:00	系統停止對外服務	

註1:請以Backloading提交交易，以利7/9第二梯次假日測試模擬遇颱風天，期交所調整颱風天後相關帳戶，建議部位內容，如附件2。

台灣期貨交易所111年「店頭衍生性商品集中結算系統」第二梯次假日測試時程(2022/07/09)

測試日期 (7/9) 時間	測試事項: 模擬7/27日(颱風天) 延續前次測試7/26之環境資料	測試事項: 模擬7/28(颱風天次一營業日)
08:30	*營業日臨時變更作業	
08:40	*颱風天還原作業	
09:30	*前一營業日(7/26)EOD評價曲線重建 *前一營業日(7/26)重新結帳	
10:30~12:30	*期交所執行批次及換日作業	
13:30		*開放結算帳戶基本資料新增/刪除/異動申請作業 *開放保證金存入及提領申請 *前一營業日(7/26)EOD保證金繳存通知 *前一營業日(7/26)Backloading交易保證金繳存通知 *會員核對颱風天後相關帳戶調整內容
13:45		*開放交易提交集中結算 *開放部位移轉申請 *開放部位互抵申請 *提交Backloading交易
14:00		*查詢匯率資料(日內) *查詢前一營業日(7/26)未通過之Backloading交易保證金檢核結果(1)
14:15		*前一營業日(7/26)EOD保證金繳存時限截止 *查詢前一營業日(7/26)未通過之Backloading交易保證金檢核結果(2)
15:00		*查詢日內評價曲線 *日內保證金繳存通知
15:15		*保證金提領申請截止 *日內保證金繳存時限截止
15:30		*查詢匯率資料(日終) *結算帳戶基本資料檔新增/刪除/異動申請截止 *交易提交集中結算截止 *部位移轉申請截止 *部位互抵申請截止 *保證金存入申請截止
15:35		*查詢日終評價曲線 *查詢當日為fixing date之結算契約fixing rate
16:00		*查詢日終結算相關報表 *查詢Backloading交易保證金適足性檢核結果
17:00		系統停止對外服務

台灣期貨交易所111年「店頭衍生性商品集中結算系統」第三梯次假日測試時程(2022/07/24)

測試日期 (7/24) 時間	測試事項: 模擬店頭集中結算開業日7/25(營業日)	測試事項: 模擬7/26(營業日)
08:30	*開放結算帳戶基本資料新增/刪除/異動申請作業 *開放保證金存入及提領申請	
08:45	*開放交易提交集中結算 *開放部位移轉申請 *開放部位互抵申請 *提交Backloading交易(註*)	
09:00	查詢匯率資料(日內)	
10:00	*查詢日內評價曲線 *日內保證金繳存通知	
10:15	*保證金提領申請截止 *日內保證金繳存時限截止	
10:30	*查詢匯率資料(日終) *結算帳戶基本資料檔新增/刪除/異動申請截止 *交易提交集中結算截止 *部位移轉申請截止 *部位互抵申請截止 *保證金存入申請截止	
10:35	*查詢日終評價曲線 *查詢當日為fixing date之結算契約fixing rate	
11:00	*查詢日終結算相關報表 *查詢Backloading交易保證金適足性檢核結果	
11:30-13:30	批次及換日作業	
13:30-14:00		*開放結算帳戶基本資料新增/刪除/異動申請作業 *開放保證金存入及提領申請 *前一營業日(7/25)EOD保證金繳存通知 *前一營業日(7/25)Backloading交易保證金繳存通知
14:00	本日假日測試結束	
14:00-16:00	期交所系統還原至7/22日之狀態	
16:00-16:30	會員查詢還原後之系統資料內容	
17:00	系統停止對外服務	