

# 店頭衍生性商品集中結算系統測試計畫

臺灣期貨交易所  
中華民國 112 年 5 月

# 目錄

一、前言.....	3
二、測試日期、時間及內容：.....	3
(一)測試日期 .....	3
(二)測試時間 .....	3
(三)測試內容 .....	4
三、測試對象.....	4
四、測試設備.....	4
五、注意事項.....	5
1. 假日測試配合事項： .....	5
2. 聯絡方式： .....	6

## 一、前言

為配合「店頭衍生性商品集中結算機制」，本公司訂於 112 年 3 月 13 日起提供市場參與者進行系統連線測試作業。本計畫更新假日測試劇本及正式環境交易登記平台網址。

## 二、測試日期、時間及內容：

### (一)測試日期

#### 1.平日測試(週一至週五)

梯次	日期
1	112 年 3 月 13 日至 112 年 4 月 21 日
2	112 年 4 月 24 日至 112 年 6 月 2 日
3	112 年 6 月 5 日至 112 年 7 月 28 日

#### 2.假日測試(週六或週日)

梯次	日期
1	112 年 7 月 8 日
2	112 年 7 月 16 日
3	112 年 7 月 30 日

### (二)測試時間

#### 1.平日測試(112/3/13~112/7/28)

時間	作業事項
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
	前一營業日 EOD 保證金繳存通知
	前一營業日 Backloading 交易保證金繳存通知
09:00	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
10:00	查詢前一營業日未通過之 Backloading 交易保證金檢核結果(1)
11:00	前一營業日 EOD 保證金繳存時限截止
	查詢前一營業日未通過之 Backloading 交易保證金檢核結果(2)
	查詢匯率資料(日內)

時間	作業事項
12:00	查詢日內評價曲線
	日內保證金繳存通知
14:00	保證金提領申請截止
15:30	日內保證金繳存時限截止
16:00	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
17:00	查詢日終評價曲線
	查詢當日為 fixing date 之結算契約 fixing rate
17:30	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
18:00	系統停止對外服務

## 2. 假日測試

測試時間及測試劇本請參照附件 1。

### (三) 測試內容

1. 假日測試部位(颱風天)請參照附件 2。
2. 後續測試劇本如有異動將於各梯次測試作業開始前，以電子郵件方式週知市場。

## 三、測試對象

1. 平日測試：結算會員及市場參與者。
2. 假日測試：結算會員及市場參與者。

## 四、測試設備

### 1. 平日測試：

市場參與者使用測試環境與期交所測試環境進行測試。

(1) 測試環境網址：<https://ccpwebportal.bq888.taifex.com.tw/T8/>

(2) 交易登記平台 TR 測試環境提交網址：<https://trtest.tpex.org.tw>

(3) 交易登記平台 Ostra(原 IHS Markit) MarkitWire 測試環境提交網址：  
<https://mw.uat.markit.com>

(4) 交易登記平台 Osttra TradeServ 測試環境提交網址：

<https://uat-tradeserv.connect.markitserv.com>

(5) SFTP 連線網址：ccpsftp.bq888.taifex.com.tw:22999

## 2. 假日測試：

結算會員使用正式系統與期交所正式環境進行測試。

(1) 正式環境網址：<https://ccpwebportal.taifex.com.tw/>

(2) 交易登記平台 TR 提交網址：<https://tr.tpex.org.tw/Login.aspx>

(3) 交易登記平台 Osttra MarkitWire 提交網址：

112/7/8 請使用<https://mw.uat.markit.com>，市場參與者與外匯經紀商於 UAT 環境交易提交時不需收費。

112/7/16 及 112/7/30 請使用<https://mw.markit.com>，依 Osttra 使用者收費表所述，市場參與者所提交之契約，存續天期小於 370 天之利率交換契約每筆收取 4 英鎊，存續天期大於等於 370 天之利率交換契約每筆收取 23.25 英鎊，測試完成後進行部位移轉將當日測試部位了結每筆收取 2 英鎊。外匯經紀商所代為提交之契約，存續天期小於 370 天之利率交換契約每筆收取 2 美元，存續天期大於等於 370 天之利率交換契約每筆收取 5 美元。

(4) 交易登記平台 Osttra TradeServ 提交網址：

112/7/8 請使用<https://uat-tradeserv.connect.markitserv.com>，市場參與者與外匯經紀商於 UAT 環境交易提交時不需收費。

112/7/16 及 112/7/30 請使用<https://connect.markitserv.com>，依 Osttra 使用者收費表所述，市場參與者與外匯經紀商每筆皆收取 10 美元。

(5) SFTP 連線網址：ccpsftp1.taifex.com.tw:22999、ccpsftp2.taifex.com.tw:22999

(6) DNS 資訊：

主中心：192.168.231.66、192.168.231.67

備援中心：192.168.236.66

期交所正式環境需使用店頭衍生性金融商品集中結算專屬線路連線。有關專屬線路申請，請洽資訊作業部，電話：(02)8071-8034 劉小姐。

## 五、注意事項

### 1. 假日測試配合事項：

貴公司如欲參加假日系統測試<sub>5</sub>，**煩請務必填寫「店頭衍生性商品集中結**

**算系統測試申請表**」並註明欲測試總/分公司名稱及會員代號、當日測試聯絡人姓名、聯絡方式等相關資料並經單位主管核可後並 email 至 CCP@taifex.com.tw。

請 貴公司落實測試前之資料備份與測試結束後資料還原作業，以避免影響下一營業日之交易正常進行。

## 2. 聯絡方式：

項目	聯絡電話
結算會員及結算帳戶基本資料管理	資規部 02-2369-5678 分機 3262 結算部 02-2369-5678 分機 3187
交易提交管理	資規部 02-2369-5678 分機 3397、3135 結算部 02-2369-5678 分機 3284、3292
部位管理	資規部 02-2369-5678 分機 3363 結算部 02-2369-5678 分機 3102、3103
擔保品管理	資規部 02-2369-5678 分機 3397 結算部 02-2369-5678 分機 3365
風險管理	資規部 02-2369-5678 分機 3364、3126 結算部 02-2369-5678 分機 3152、3290
銀行出入金管理	資規部 02-2369-5678 分機 3363 結算部 02-2369-5678 分機 3174
交割結算基金管理	資規部 02-2369-5678 分機 3364 結算部 02-2369-5678 分機 3167
違約管理	資規部 02-2369-5678 分機 3363 結算部 02-2369-5678 分機 3112、3187
使用者管理	資規部 02-2369-5678 分機 3262
相關報表查詢及下載	資規部 02-2369-5678 分機 3135
期交所連線收費方案、電腦連線契約及 連線申請表單	資作部 02-8071-8000 分機 8034
假日測試當日問題	資規部 02-2369-5678 分機 3331 結算部 02-2369-5678 分機 8570 ~ 8575 板橋機房 02-8964-9300 分機 9331、9301、9302

## 店頭衍生性商品集中結算系統測試申請表

店頭衍生性商品集中結算系統於 **112 年 7 月 8 日、112 年 7 月 16 日、112 年 7 月 30 日 08:30 至 17:00**，將進行開盤作業，貴公司如需於該時段內配合進行測試，請於下表中填註資料，經權責主管簽核後，於測試前 5 個營業日 **(7/3、7/10、7/24)17:00 前** email 至 CCP@taifex.com.tw。

※ **測試當日 08:30 前**，貴公司需完成主機端開機作業，俾利測試之進行

參與測試日期	<input type="checkbox"/> 112 年 7 月 8 日(六) <input type="checkbox"/> 112 年 7 月 16 日(日) <input type="checkbox"/> 112 年 7 月 30 日(日)	
公司名稱		
會員代號		
測試相關事宜 聯絡人姓名	聯絡人 Email	連絡電話

承辦：

主管：

※ 本申請表需由 貴公司之負責單位主管簽認後，始具申請效力。  
本表單僅 112 年 7 月 8 日、112 年 7 月 16 日、112 年 7 月 30 日測試申請適用

簽名\_\_\_\_\_

中華民國 年 月 日