

# 店頭衍生性商品集中 結算機制

第二階段資訊測試說明會



# 議程



1. 測試時程規劃及連線方式
2. 結算會員入口網站增修功能
3. 客戶入口網站
4. SFTP增修報表
5. OTC Client API連線方式說明

# 一、測試時程規劃及連線方式



# 平日測試時程規劃



- 3月13日~4月21日~第1階段平日測試
- 4月24日~6月2日~第2階段平日測試
- 6月5日~7月28日~第3階段平日測試

# 假日測試時程規劃



梯次	測試日期	假日測試內容
第1梯次	7/8(六)	模擬上線日7/31，及次營業日8/1 *業者得以①櫃買中心TR系統或②IHS Markit之MarkitWire系統或TradeServ系統 <b>UAT環境</b> 進行交易提交。
第2梯次	7/16(日)	延續前次測試8/1之資料，模擬8/2日遇颱風天臨時變更為非營業日，及颱風天次一營業日8/3 *業者得以①櫃買中心TR系統或②IHS Markit之MarkitWire系統或TradeServ系統進行交易提交，③透過元太外匯模擬協助業者提交交易之測試
第3梯次	7/30 (日)	模擬上線日7/31，及次營業日8/1 *業者得以①櫃買中心TR系統或②IHS Markit之MarkitWire系統或TradeServ系統進行交易提交，③透過元太外匯模擬協助業者提交交易之測試

# 連線方式



- 本案正式環境及假日測試皆須使用專屬店頭衍生性金融商品集中結算線路連線，平日測試使用網際網路連線。
  - 測試環境網址：<https://ccpwebportal.bq888.taifex.com.tw/T8/>。
  - TR測試環境提交網址：<https://trtest.tpex.org.tw>
  - IHS Markit MarkitWire測試環境提交網址：<https://mw.uat.markit.com>
  - IHS Markit TradeServ測試環境提交網址：<https://uat-tradeserv.connect.markitserv.com>
- 結算會員可開啟瀏覽器並使用「經濟部工商憑證」或「證券暨期貨相關單位共用憑證」登入期交所店頭衍生性商品集中結算系統之入口網站（Web Portal）。



## 二、結算會員入口網站增修功能



# 大綱



- 新增功能
- 增修功能



# 新增功能



- 交易提交管理
  - 客戶交易額度控管
- 銀行出入金
  - 自有資金墊繳申請查詢/維護
- 結算作業
  - 單一結算契約結算歷史統計表
  - 單一結算帳戶結算歷史統計表
  - 結算會員結算歷史統計表
- SDR專區
  - SDR申報作業

# 新增功能(續)



- 收費及財會帳務
  - 結算帳戶結算保證金利息清單查詢
  - 結算帳戶結算服務費月報表
  - 結算帳戶結算保證金利息明細表
- 使用者管理
  - AMQP申請
  - email/簡訊通知清單設定
- 違約管理與拍賣平台
  - 客戶違約申報
  - 非義務參與者參與拍賣作業資格申請

# 增修功能



- 因應NDF商品修改相關以下模組項下子功能
  - 交易提交管理
  - 部位管理
  - 風險管理
  - 結算作業
  - 結算會員及結算帳戶基本資料
- 因應提供客戶集中結算優化相關模組功能介面及報表
  - 風險管理
  - 結算作業

### 三、客戶入口網站

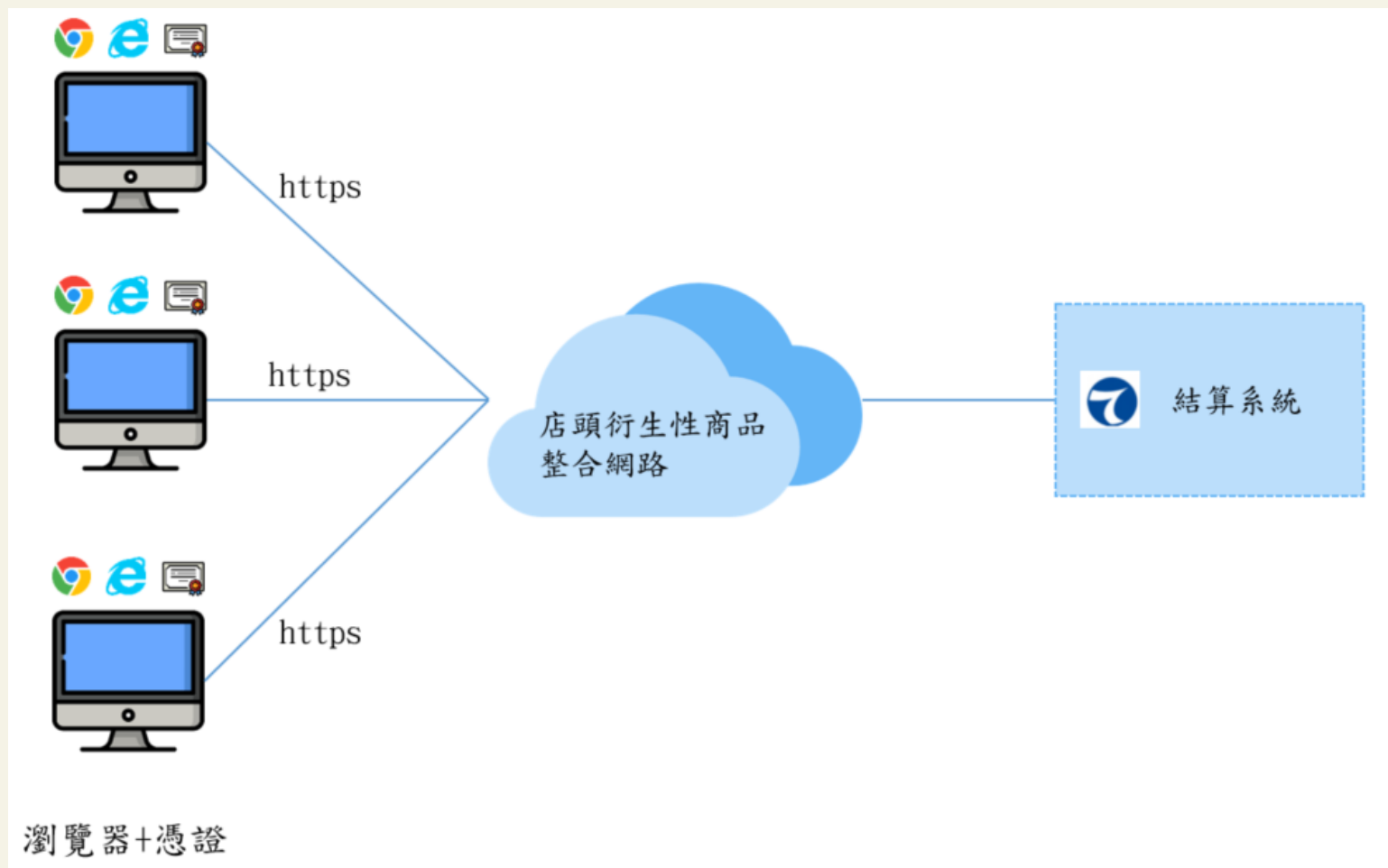


# 大綱



- 系統架構與連線方式
- 登入及功能說明
- 聯絡窗口

# 系統架構與連線方式



- 註:平日測試環境為internet，請先填寫平日測試環境連線申請表單

# 系統架構與連線方式



- 店頭衍生性商品整合網路
  - 為正式環境及假日測試使用
  - 平日測試環境使用internet
- 瀏覽器(Https)
  - Chrome、Firefox、Edge (1920 x 1080螢幕解析度)
- 憑證簽章元件
  - 安控中介元件.exe
- 憑證IC卡及讀卡機
  - 經濟部工商憑證
  - 證券暨期貨相關單位共用憑證



# 系統架構與連線方式



- 平日測試環境連線申請表單

附表 1：客戶平日測試環境連線申請表單

客戶統編或 外國機構投資人代碼		客戶名稱	
聯絡人員		聯絡電話	
聯絡人員 mail			
申請連線類別	<input type="checkbox"/> 入口網站		
來源地址			

\*來源地址：配合本測試電腦對外 IP

※請填寫本表並 e-mail 至 [CCP@taifex.com.tw](mailto:CCP@taifex.com.tw)

※請填寫本表並 e-mail 至 [CCP@taifex.com.tw](mailto:CCP@taifex.com.tw)

- 測試網址

<http://ccpwebportal.bq888.taifex.com.tw/T8client/>

# 系統架構與連線方式-申請說明

- 申請連線至期交所店頭結算系統
- 與結算會員及期交所簽署電腦連線契約
  - 結算會員管理者建立客戶管理者
- 客戶管理者註冊憑證及建立一般使用者帳號及權限
- 客戶一般使用者查詢相關資料

# 登入

- 安裝安控中介元件
  - 可於登入頁下載，安裝完成畫面右下方會出現
- 登入步驟
  - 輸入統一編號或FINI ID、使用者帳號、密碼
  - 插入工商或證期憑證
  - 輸入憑證PIN碼



# 會員管理者功能



- 客戶管理
  - 客戶管理者帳戶管理
  - 客戶憑證註銷

# 客戶管理者功能



- 帳號管理
  - 帳號管理者：由結算會員管理者建立
  - 一般使用者：由客戶帳號管理者建立
- 群組管理
- 憑證管理
  - 初次登入須使用帳號管理者進行登入並註冊憑證。
  - 已註冊的憑證，該機構使用者均可使用。
  - 憑證註冊張數無上限。

# 客戶使用者功能



- 部位概況
- 保證金概況
  - 保證金餘額與款項收付
  - 有價證券
- 保證金試算

# 聯絡方式



- 登入及管理者相關功能
  - 資訊規劃部 (02)2369-5678#3262朱小姐
- 客戶使用者相關功能
  - 結算部(02)2369-5678#3292許先生
- CCP連線申請及收費相關
  - 資訊作業部(02)8071-8034劉小姐



## 四、SFTP增修報表



# 報表異動



- 交易提交相關報表
  - 精簡報表數量。針對單一商品種類，僅揭露「當日所有交易提交資料報表」、「當日所有Backloading交易提交資料報表」以及「前日所有Backloading交易提交資料報表」。
  - 故更新下列報表格式: F02\_001\_001、F02\_001\_002、F02\_002\_001、F02\_002\_002、F02\_002\_003、F02\_002\_004，刪除下列報表: F02\_001\_003、F02\_001\_004、F02\_003\_003、F02\_003\_004、F02\_003\_005及F02\_003\_007。

# 報表異動



- 交易提交相關報表
  - 因應客戶帳戶Request for Consent額度控管機制，提供「RFC額度控管報表」，針對各商品種類新增「單一帳戶庫存部位明細表」。
  - 故新增下列報表: F02\_004\_001、F02\_000\_001、F02\_000\_002。
- 部位管理相關報表
  - 針對各商品種類提供「隔日部位互抵建議報表」。
  - 新增下列報表: F14\_002\_002

# 報表異動



- 風險管理相關報表
  - 提供會員層級及帳戶層級不同時間點產製之「保證金繳存通知報表」。
  - 故新增下列報表: F07\_019\_002、F07\_020\_002、F07\_021\_002、F07\_024\_002、F07\_019\_001、F07\_020\_001、F07\_021\_001、F07\_024\_001、F07\_015、F07\_018\_001、F07\_018\_002
- 結算作業相關報表
  - 針對各商品種類提供「單一結算契約結算報表」，並針對結算帳戶及會員層級報表進行欄位調整。
  - 故新增下列報表: F08\_001\_002，更新下列報表: F08\_001\_001、F08\_002\_001、F08\_003\_001

# 報表異動



- 收費及財會帳務相關報表
  - 因應本階段可能新增之客戶帳戶以及新商品，增加相關「結算服務費」及「結算保證金利息」報表。
  - 故新增下列報表: F13\_002\_001、F13\_005\_001、F13\_012\_001、F13\_025\_001。
- 報表詳細規格請參考附件。

## 五、OTC Client API連線方式說明



# AMQP Broker訊息服務



- 訊息標準：AMQP 1.0
  - AMQP 1.0 是一種開放又可靠的訊息通訊協定，適用於建置跨平台溝通(可使用不同語言、架構及作業系統)的應用程式
  - AMQP 1.0是的一項OASIS標準(ISO 19464)
- AMQP Client參考工具:
  - [ActiveMQ Artemis](#)
  - [RabbitMQ](#)



# AMQP Broker連線說明(1/4)

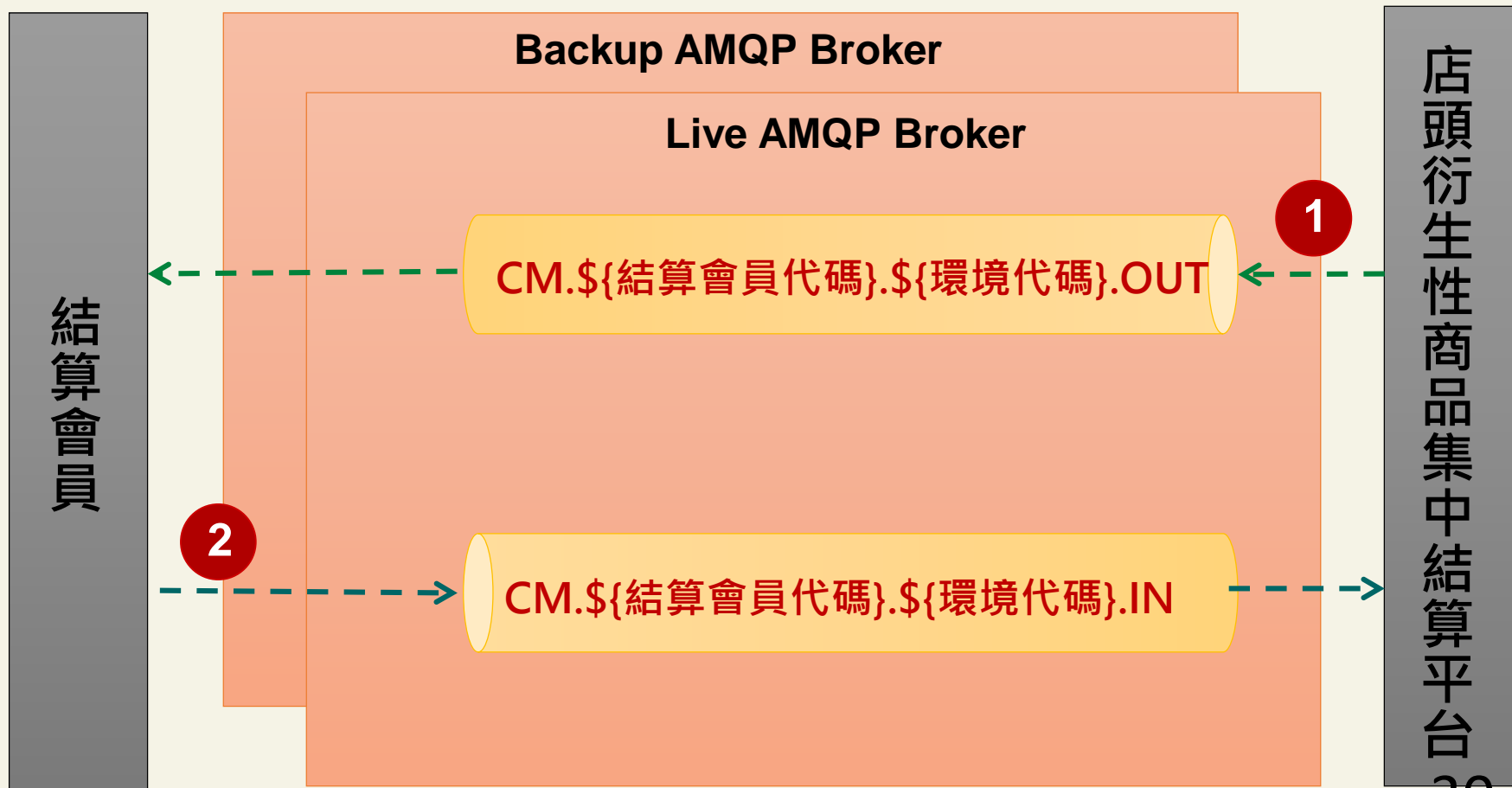
- 透過Domain Name詢問DNS後進行連線

	店頭衍生性商品集中結算系統AMQP Broker
AMQP Broker (主)	amqp1.taifexccp
AMQP Broker (備)	amqp2.taifexccp
AMQP Broker (測試)	ccpamqp.bq888.taifex.com.tw

- 連線Port: 5672
  - 請網管人員開通此防火牆埠號
- DNS IP :
  - 192.168.231.67(主)
  - 192.168.236.66(備)
  - 211.20.11.63(測試)

# AMQP Broker連線說明(2/4)

- 佇列(Message Queue)命名規則



# AMQP Broker連線說明(3/4)

- 登入驗證機制
  - 透過Web portal申請帳號(由管理者於web portal統一申請)

使用者管理 / AMQP申請

<p>• 結算會員代號</p> <input type="text" value="0980000"/>	<p>• 帳號</p> <input type="text" value="0980000_admin"/>
<p>• 密碼</p> <input type="password" value="*****"/>	<p>• 再次輸入密碼</p> <input type="password" value="*****"/>
<p>• IP1</p> <input type="text" value="192.168.2.175"/>	<p>IP2</p> <input type="text" value="192.168.2.110"/>
<p>IP3</p> <input type="text" value="180.217.242.133"/>	<p>IP4</p> <input type="text" value="192.168.2.134"/>
<p>IP5</p> <input type="text" value="127.0.0.1"/>	<p>• 聯絡人姓名</p> <input type="text" value="terryyu"/>
<p>• 聯絡人電話</p> <input type="text" value="3397"/>	<p>• 聯絡人電子郵件</p> <input type="text" value="test1@taifex.com.tw"/>
<p><input type="button" value="修改"/> <input type="button" value="刪除"/></p>	

# AMQP Broker連線說明(4/4)



- 注意事項
  - 密碼變更預計生效時間
    - 次一交易日開盤前
  - 實際生效時間仍須依當日作業完成時間決定
  - 服務有鎖定機制，一段時間內登入錯誤三次會鎖定該 IP 15 分鐘。
- AMQP Broker佇列資料僅保留至當天交易結束
  - 交易日當天未接收訊息於隔日自動刪除



臺灣期貨交易所

TAIWAN FUTURES EXCHANGE

謝謝指教

TWD-TAIBOR-1W

TWD-TAIBOR-2W

TWD-TAIBOR-1M

TWD-TAIBOR-2M

TWD-TAIBOR-3M

10:30:30

11:30:11

11:30:30

11:30:12

10:30:30

11:30:11

10:30:30

11:30:12

10:30:30

11:30:12

10:30:31

Refinitiv

0.38244

0.38244

0.49678

0.49678

0.63989

0.63989

0.69122

0.69122

0.73000

0.73000

0.82122

0.82122

抓取時間

11:41:42

15:31:18

11:41:42

15:31:18

11:41:42

15:31:18

11:41:42

15:31:18

11:41:42

15:31:18

11:41:42

15:31:18

資料來源2

銀行

0

0

0

0

0

0

0

0

0

0

0

0

0