

劇本情境性質	功能模組	劇本情境	功能代號	劇本測試期間	帳戶相關說明	保證金相關說明	部位相關說明	備註
個別會員單獨	使用者管理	使用者管理/帳戶管理 使用者管理 / 群組管理 使用者管理 / 憑證管理 使用者管理 / SFTP申請	F15_001 F15_005 F15_010 F15_011	5/9~5/31				請先設定使用者權限，以利webportal 各項申請查詢作業
	會員及帳戶管理	結算會員基本資料查詢	F01_001	5/9~5/31	會員資料由本公司預先設定			請查詢內容是否正確
		結算帳戶資料查詢	F004_001	5/9~5/31	首戶帳戶由本公司預先設定			請查詢內容是否正確
		結算帳戶新增申請	F004_001	5/9~5/31	1.申請開立第二戶帳戶(可用於測試帳戶註銷，及部位移轉測試之用) 2.次一營業日生效			
		結算帳戶註銷申請	F004_001	5/9~5/31	請先完成保證金提領		如有部位請於前日完成部位及保證金移轉	帳戶註銷生效請設為5/31，可配合颱風天測試，遞延生效
		結算帳戶變更每日結算類型申請	F004_006	5/9~5/31	預先開立CTM帳戶			
	銀行出入金	現金存入申請	F09_002	5/9~5/31	請繳存首戶帳戶	1.繳存結算保證金(台幣、美金) 2.請於首筆交易提交前繳存		
		有價證券存入申請	F09_006	5/9~5/31		建議至少繳存A05107、A01202、A00201等三種債券，以利後續測試公債付息		
		公債付息名冊查詢	F06_003	5/20(A05107) 5/24(A01202) 5/26(A00201)		於付息日前至少繳存下述任一檔公債A05107、A01202、A00201		
		現金及有價證券提領申請	F09_010	5/9~5/31		提領結算保證金(台幣、美金、有價證券)		
	交易提交	新交易提交	F02_001	5/9~5/31		首筆提交前，應先繳存保證金	建議提交可互抵之部位，以利後續部位互抵	
		new trade提交保證金檢核查詢	F07_010	5/9~5/31		請模擬交易雙方保證金足夠及保證金不足之狀況	提交部位請包含: IRS with stub, 及without stub	
		backloading trade提交	F02_002	5/9~5/31			1.建議提交於5/13收付利息之部位(週六補上班測試用) 2.建議提交於5/16、5/31收付利息之部位(颱風天測試)	
		backloading trade提交保證金檢核查詢	F07_011 F07_024	5/9~5/31		請模擬交易雙方保證金足夠及保證金不足之狀況	提交部位請包含: IRS with stub, 及without stub	
	部位管理	部位互抵申請	F05_001	5/9~5/31			預先提交可互抵之部位，以利申請	
		部位及保證金移轉申請	F05_005	5/9~5/31	1.有兩個相同統編的自有帳/或是移轉給其他會員 2.移出方帳戶，清空部位及保證金後，後續可配合進行帳戶註銷測試	1.預先存入保證金，以利移轉 2.保證金充足	預先提交部位，以利移轉	部位移轉申請後，須雙方帳戶保證金足夠才可生效，故申請完成後請點選保證金試算確認保證金是否足夠
	風險管理及保證金計算	日內評價曲線查詢	F07_008	5/9~5/31				
		日內整戶保證金追繳	F07_019	5/9~5/31		預先將超額保證金全數提領，以利產生洗價後之保證金追繳情境	1. 預先建立部位，以利計算部位應有保證金 2. 部位結構請包含: 付固定利率及收固定利率之契約，以利產生洗價後之保證金追繳情境	
		日終評價曲線查詢	F07_008	5/9~5/31				

劇本情境性質	功能模組	劇本情境	功能代號	劇本測試期間	帳戶相關說明	保證金相關說明	部位相關說明	備註
		日終現金、整戶保證金追繳	F07_020	5/9~5/31		預先將超額保證金全數提領，以利產生洗價後之保證金追繳情境	1. 預先建立部位，以利計算部位應有保證金 2. 部位結構請包含: 付固定利率及收固定利率之契約，以利產生洗價後之保證金追繳情境	
		部位集中度查詢	F07_023	5/9~5/31			請建立IRS中長天期單一方向之大量部位, 以利模擬部位集中度超限之加收額外保證金情境	
		訂價作業(fixing)	F07_017 F07_018	5/9~5/31			請預先建立於5/9~5/31需要fixing之部位, 部位應包含IRS with stub, 及without stub	
		保證金模擬試算	F07_022	5/9~5/31			上傳模擬部位CSV檔, 以利檢視模擬部位之保證金計算結果	
		Trade level, Account level淨現值及保證金計算結果查詢	F07_014 F07_015	5/9~5/31				
		結算作業與帳務核對	結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額	F06_005	5/9~5/31	執行有價證券存入/提領後進行查詢	預先提交部位，以利計算實際抵繳金額	
		結算報表查詢下載及核對	F08_001 F08_002 F08_003	5/9~5/31			1.預先提交於測試期間有產生IRS利息收付之部位，以利對帳 2.預先提交於測試期間有產生upfront fee收付之部位，以利對帳	
		結算服務費收費對帳	F13_001 F13_002 F13_007	5/9~5/31			預先提交部位(新成交、回溯結算)、部位移轉、部位互抵及有價證券存入，以利產生帳務報表	費率如附件
	市場統一	交割結算基金管理	繳存交割結算基金(開業)	F09_002	5/9			1.第一天繳存 2.個別結算會員：2,000萬 3.一般結算會員：3,000萬
			交割結算基金餘額查詢	F09_020	5/9~5/31	配合完成開業之交割結算基金繳存後查詢		
			交割結算基金續繳繳存通知	F11_002	(1)基準日5/16遇颱風天：5/17發送通知 (2)基準日5/20：5/23發送通知 (3)基準日5/30：5/30發送通知			
			交割結算基金(續繳)-領回	F09_010	5/17、5/23、5/30			
			交割結算基金(續繳)-存入	F09_002	5/17、5/23、5/30			
		風險管理及保證金計算	長假調高保證金	F07_015	5/13~5/16模擬農曆春節放假		5/13之前預先建立部位，以利計算部位應有保證金	
			會員報價	F07_001 F07_003	5/11, 5/17, 5/24 11:00~12:00 日內評價曲線建構發出報價通知			
			AD-HOC 追繳	F07_021	5/12, 5/19	預先將超額保證金全數提領，以利產生洗價後之保證金追繳情境	1. 預先建立部位，以利計算部位應有保證金 2. 部位結構請包含: 付固定利率及收固定利率之契約，以利產生洗價後之保證金追繳情境 3. 5/12: adhoc 評價曲線以前一日日終評價曲線上移30bp 5/19: adhoc 評價曲線以前一日日終評價曲線下移30bp	
		變更營業日	週六補行上班		5/13	1.進行保證金出入金 2.結算款項核對	預先提交部位，以利產生帳務報表	

劇本情境性質	功能模組	劇本情境	功能代號	劇本測試期間	帳戶相關說明	保證金相關說明	部位相關說明	備註
	變更營業日	颱風天		5/16 5/31	1.可於5/12及5/26申請變更 結算帳戶資料預計生效日為 5/15及5/31・測試遞延生效		1. fixing date測試: 請會員於5/13及5/26前, 預先建立 5/16及5/31 fixing之契約 2. Payment date測試: 請會員於5/13及5/26前, 預先建立 5/16及5/31 payment之契約 3. Backloading測試: 請會員於5/16及5/31前一營業日, 提交Backloading交易	部位建議如附表範例