

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 111 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	5
三、測試對象.....	6
四、測試設備.....	6
五、注意事項.....	6
1. 假日測試配合事項：	6
2. 聯絡方式：	7

一、前言

為配合「店頭衍生性商品集中結算機制」，本公司訂於 111 年 1 月 17 日起提供市場參與者進行系統連線測試作業。本計畫主要依據「台期規字第 1100601449 號函」全市場測試計畫，補充平日測試劇本、假日測試計畫內容。

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	111 年 01 月 17 日至 111 年 02 月 11 日
2	111 年 02 月 14 日至 111 年 05 月 06 日
3	111 年 05 月 09 日至 111 年 05 月 31 日
4	111 年 06 月 01 日至 111 年 07 月 22 日

2.假日測試(週六)

梯次	日期
1	111 年 07 月 02 日
2	111 年 07 月 09 日
3	111 年 07 月 23 日

(二)測試時間

1.平日測試(111/1/17~111/7/22)

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
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)

時間	作業事項
	查詢匯率資料(日內)
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
	部位移轉申請截止
	部位互抵申請截止
	交易提交集中結算截止
	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

2.假日測試(111/7/2、111/7/9、111/7/23)

時間	營業日(T)作業事項	營業日(T+1)作業事項
08:30	<ul style="list-style-type: none"> ● 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 	
09:00	<ul style="list-style-type: none"> ● 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 	
09:30	查詢匯率資料(日內)	
10:00	<ul style="list-style-type: none"> ● 查詢日內評價曲線 ● 日內保證金繳存通知 	
10:20	<ul style="list-style-type: none"> ● 保證金提領申請截止 ● 日內保證金繳存時限截止 	
10:30	<ul style="list-style-type: none"> ● 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 ● 部位移轉申請截止 ● 部位互抵申請截止 ● 交易提交集中結算截止 ● 保證金存入申請截止 	
11:00	<ul style="list-style-type: none"> ● 查詢日終評價曲線 ● 查詢當日為 fixing date 之結算契約 fixing rate 	

時間	營業日(T)作業事項	營業日(T+1)作業事項
12:00	<ul style="list-style-type: none"> ● 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 	
12:00-14:30	批次及換日作業	
14:30		<ul style="list-style-type: none"> ● 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
14:50		<ul style="list-style-type: none"> ● 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
15:10		● 查詢前一營業日未通過之 Backloading 交易保證金檢核結果(1)
15:30		<ul style="list-style-type: none"> ● 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)
15:50		<ul style="list-style-type: none"> ● 查詢日內評價曲線 ● 日內保證金繳存通知
16:00		<ul style="list-style-type: none"> ● 保證金提領申請截止 ● 日內保證金繳存時限截止
16:10		<ul style="list-style-type: none"> ● 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 ● 部位移轉申請截止 ● 部位互抵申請截止 ● 交易提交集中結算截止 ● 保證金存入申請截止
16:30		<ul style="list-style-type: none"> ● 查詢日終評價曲線 ● 查詢當日為 fixing date 之結算契約 fixing rate
17:00		<ul style="list-style-type: none"> ● 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
17:30	系統停止對外服務	

(三)測試內容

1. 平日測試劇本、測試用費率表請參照附件 2 及附件 3

2. 平日測試變更營業日測試部位(颱風天)請參照附件 4
3. 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：市場參與者
2. 假日測試：結算會員。

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。

測試環境網址：<https://ccpwebportal.bq888.taifex.com.tw/T7>

SFTP 連線位址：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。

正式環境網址：<https://webportal.taifexccp>

SFTP 連線位址：sftp1.taifexccp:22999、sftp2.taifexccp:22999

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，**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 3105、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 3360
部位管理	資規部 02-2369-5678 分機 3363 結算部 02-2369-5678 分機 3294、3284
擔保品管理	資規部 02-2369-5678 分機 3395 結算部 02-2369-5678 分機 3174
風險管理	資規部 02-2369-5678 分機 3364、3126 結算部 02-2369-5678 分機 3152、3358、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 3365
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 3105、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 3395
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 8560~8654 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 **111 年 7 月 2 日、111 年 7 月 9 日、111 年 7 月 23 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 **(6/27、7/4、7/18)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"/> 111 年 7 月 2 日(六) <input type="checkbox"/> 111 年 7 月 9 日(六) <input type="checkbox"/> 111 年 7 月 23 日(六)	
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 111 年 7 月 2 日、111 年 7 月 9 日、111 年 7 月 23 日測試申請適用

簽名_____

中華民國 年 月 日