

# 案由四、有關本公司建置店頭衍生性 金融商品集中結算系統之資訊系統規 劃



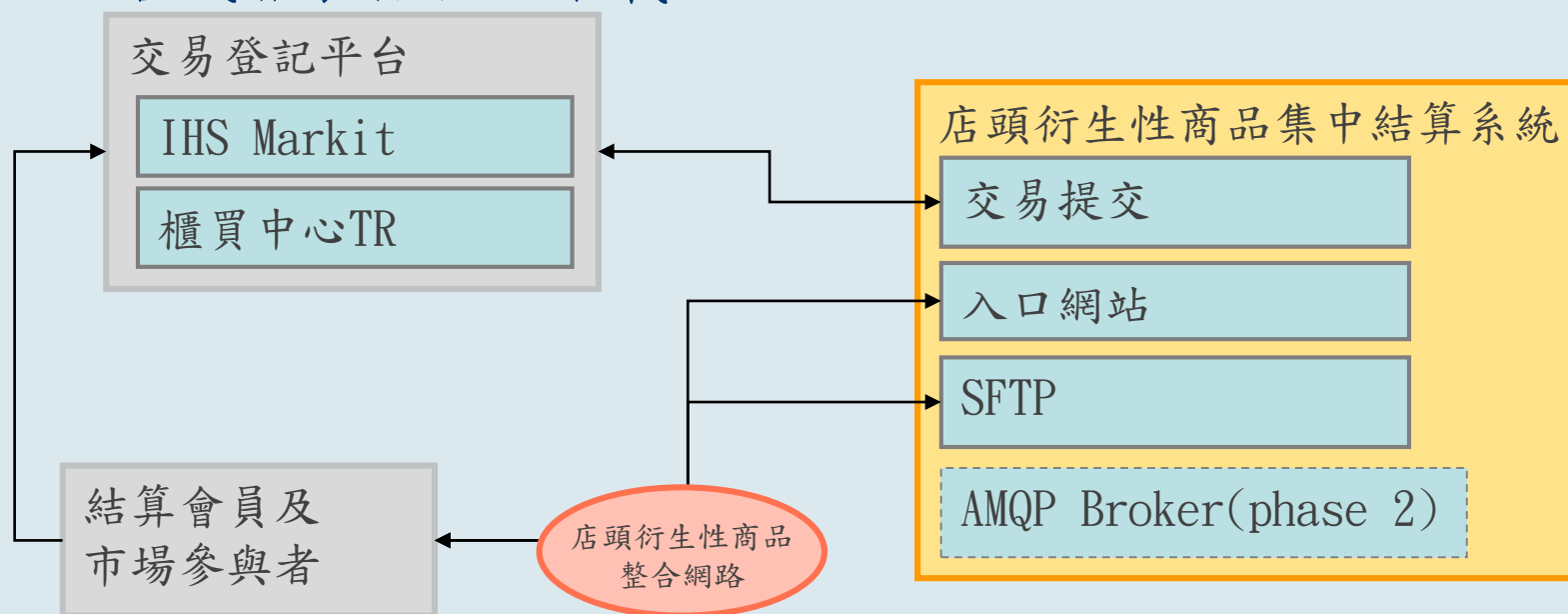


# 一、資訊系統架構規劃



# 資訊系統架構規劃

- 結算會員及市場參與者透過交易登記平台(IHS Markit 或櫃買中心TR)進行交易登記作業，交易登記平台傳送交易至本公司系統，可透過本公司入口網站進行相關申報、管理、試算及各式報表檢視及下載。







## 二、入口網站功能規劃



# 入口網站功能規劃-1

## ■ 入口網站提供結算會員下列功能：

- 結算會員及結算帳戶基本資料管理
- 交易提交管理
- 部位管理
- 擔保品管理
- 風險管理
- 銀行出入金管理
- 交割結算基金管理
- 違約管理
- 使用者管理
- 相關報表查詢及下載

## ■ 入口網站未來將以憑證做為雙因子認證。



# 入口網站功能規劃-2

## ■ 結算會員及結算帳戶基本資料管理

- 結算會員基本資料上傳及查詢。
- 結算帳戶資料登錄、異動、查詢、註銷及覆核。
- 結算帳戶STM申請、異動及覆核。

## ■ 交易提交管理

- 當日提交交易(含Backloading交易)狀態查詢。



# 入口網站功能規劃-3

## ■ 部位管理

- 部位互抵申請、註銷、覆核及查詢。
- 部位移轉申請、註銷、覆核及查詢。
- 部位移轉資料確認及覆核。

## ■ 擔保品管理

- 有價證券基本檔、匯率及公債付息查詢。



# 入口網功能規劃-4

## ■ 風險管理

- 結算會員提供IRS報價管理。
- 歷史及本日評價曲線查詢。
- 部位移轉資料確認及覆核。
- 交易提交之保證金檢核查詢。
- 淨現值、保證金計算作業及查詢。
- IRS定價利率查詢。
- 保證金繳存通知及繳存通知查詢。
- 保證金模擬試算。
- 部位集中度查詢。



# 入口網功能規劃-5

## ■ 銀行出入金管理

- 虛擬入金帳號查詢。
- 現金及有價證券存入申請、註銷、覆核及查詢。
- 現金及有價證券提領申請、註銷、覆核及查詢。
- 現金結算保證金餘額查詢。
- 有價證券餘額查詢。
- 現金代結匯申請、註銷、覆核及查詢。

## ■ 交割結算基金管理

- 交割結算基金餘額查詢。
- 交割結算基金續繳金額查詢。



# 入口網功能規劃-6

## ■ 違約管理

- 違約拍賣清單

- 違約競標

## ■ 使用者管理

- 使用者帳戶查詢、新增、異動及刪除。

- 群組查詢、新增、異動及刪除。

- 使用者帳戶密碼變更。

## ■ 報表下載

- 相關業務報表下載

- SFTP報表下載功能申請





### 三、SFTP連線規劃及報表項目



# SFTP連線說明

## ■ 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SFTP
Server 1	sftp1.taifexccp
Server 2	sftp2.taifexccp

## ■ 連線Port：28999

- 請結算會員網管人員開通此Port號防火牆
  - 登入方式有輸入帳號密碼或是使用密鑰檔案進行登入兩種
- ## ■ 各結算會員及市場參與者可於入口網站申請SFTP服務。
- 每個IP最多可同時建立5條連線



# 目錄結構

## ■ 規劃SFTP之目錄結構

- 以結算會員代號 0040000 為例，登入SFTP後將可登入到CM\_0040000目錄，此目錄會存放結算會員相關之報表檔案。
- 結算會員須依據報表代號清單(詳附件)於特定時點後進行批次下載。
- 本系統清盤後，舊檔將移至各目錄之old目錄下，並保留7日。



# 聯絡窗口

## ■ SFTP系統開發及測試相關問題：

- 謝先生：(02)2366-3353

- 羅先生：(02)2366-3135

## ■ SFTP網路相關問題：

- 陳先生：(02)8071-8025

- 陳先生：(02)8071-8028



# 報表項目

## ■ 適用SFTP之報表項目(詳附錄)

- 當日所有交易提交資料報表
- 當日已接受交易提交資料報表
- 當日未完成交易提交資料報表(交易狀態非接受及拒絕)
- 當日已拒絕交易提交資料報表
- 隔日部位互抵建議報表
- 當日部位互抵結果報表



# 報表項目 - 續

## ■ 適用SFTP之報表項目(詳附錄)

- 單一結算契約結算報表
- 單一結算帳戶結算報表
- 結算會員結算報表
- 有價證券餘額明細

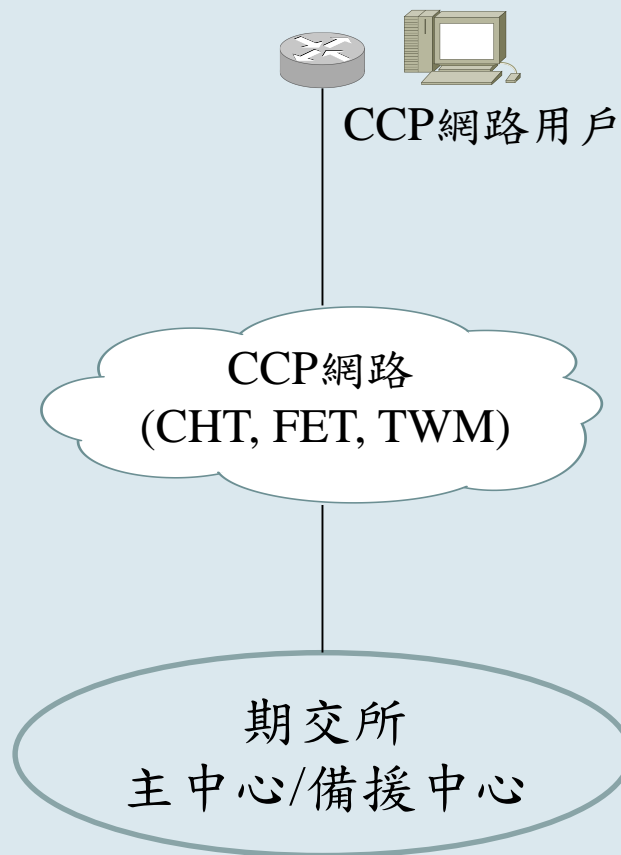




## 四、用戶端網路架構與連網方式



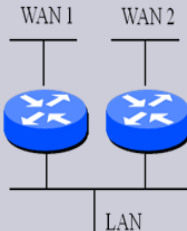


# 用戶端網路架構





# 用戶端連網方式

	Type 1	Type 2	Type 3
連網方式			
說明	1 WAN 1 LAN	單一電信公司 WAN電路備援	單一電信公司WAN 電路及路由器備援

- Type 1 為基本方案，用戶可選擇2家以上不同電信公司Type 1方案做備援
- Type 2 提供單一電信公司WAN電路備援
- Type 3 提供單一電信公司WAN電路及路由器備援，防止單點故障 (single point of failure (SPOF))



# 聯絡窗口-期交所

- 期交所CCP網路技術相關支援
  - 02-8071-8025 陳先生
  - 02-8071-8028 陳先生





## 五、有關本公司店頭衍生性商品集中 結算系統電信公司電路方案與費率



# 電信公司費率表-中華電信

## ■ 方案一

FTTB專業型電路	首次裝設費/次	月租費(電路+VPN頻寬)/路	加租Router費用另計 (Cisco 1941) 裝設費/次 2,650元 月租費/台 2,500元
1M	3,000	4,350	
2M	3,000	8,120	

## ■ 方案二

NGSDH固接專線	首次裝設費/次	月租費(電路+VPN頻寬+Router 1941)/路
2M	23,500元	14,880元

## ■ 中華電信 專線頻寬相關業務

■ 02-2344-5568 #727 李小姐

\* 以上費率僅提供參考，相關設定費與設備型號請向各電信公司業務人員洽詢



# 電信公司費率表-遠傳電信

## ■ 方案

MPLS VPN	首次裝設費/次	月租費(電路+VPN頻寬)/路
1M	20,000	6,400
2M	20,000	8,000

## ■ 遠傳電信 專線頻寬相關業務

■ 0955-566369 謝小姐

\*以上費率僅提供參考，相關設定費與設備型號請向各電信公司業務人員洽詢



# 電信公司費率表-台灣固網

## ■ 方案

乙太專線電路	首次裝設費/次	月租費(電路+VPN 頻寬)/路	加租Router 費用另計 (Juniper SRX 320) 每台月租費1,630元
1M	0	5,250	
2M	0	8,370	


\*簽約兩年免收裝設費

## ■ 台灣固網 專線頻寬相關業務

■ 0935-382035 林小姐

\*以上費率僅提供參考，相關設定費與設備型號請向各電信公司業務人員洽詢





## 六、有關本公司店頭衍生性商品集中 結算系統連線申請方案



# CCP連線申請規劃方案

## ■ 結算會員連線申請程序

- 與本公司簽訂CCP電腦連線契約
- 可自由選擇中華電信、遠傳電信或台灣固網之電路申請連線
- 向本公司提出CCP連線申請(含電信公司電路申請書)
  - 由本公司代為轉交電路申請書予電信公司
  - 由本公司辦理IP配發
- 完成電路供裝及IP設定後，即可連線至CCP結算系統
- 本公司刻規劃連線收費方案、電腦連線契約及連線申請表單
- 聯絡方式
  - 資訊作業部作業管制組，電話：(02)8071-8034劉小姐





### 三、資訊時程規劃



# 資訊時程規劃

作業項目	預定時程
1. 系統開發與建置	~110年12月
2. 電腦連線收費規劃	
1) 公告實施資訊收費標準及連線契約	110年11月
2) 與業者簽訂連線契約	110年12月~111年6月
3. 全市場連線測試	
1) 平日測試	111年1月~111年6月
2) 假日整體市場模擬測試	111年5月~111年6月
系統上線(實際上線日期以公告為準)	111年6月



# 聯絡窗口

- 謝先生：(02)2366-3353
- 羅先生：(02)2366-3135





臺灣期貨交易所

TAIWAN FUTURES EXCHANGE

敬請指教