

# 「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 2 月

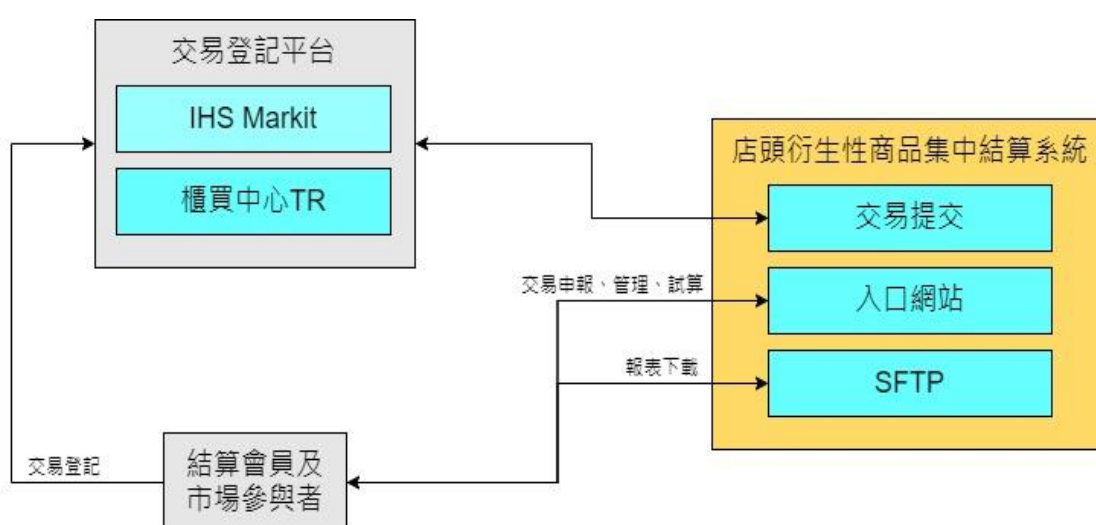
# 目錄

壹、前言.....	1
貳、測試日期、時間及內容.....	3
參、其它事項.....	5
附表 1：平日測試環境連線申請表單.....	7
附表 2：測試紀錄表.....	8
附表 3：功能項目.....	9

## 壹、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。

結算會員透過交易登記平台（櫃買中心 TR、IHS Markit MarkitWire 及 TradeServ）進行交易登記作業，交易登記平台將傳送交易提交至期交所店頭衍生性商品集中結算系統，結算會員即可透過期交所店頭衍生性商品集中結算系統之入口網站（Web Portal）進行相關申報、管理、試算及各式報表檢視及下載（SFTP）。



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）。

(一)、系統需求

1. 瀏覽器：Chrome、Edge。(建議使用 1920 x 1080 螢幕解析度)
2. 憑證簽章元件：安控中介元件
3. 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

有關平日測試，請先填寫平日測試環境連線申請表單(附表 1)，並 email 至 CCP@taifex.com.tw，或請洽資訊規劃部，電話：(02) 2369-5678 轉 3262 朱小姐。

若測試過程有任何問題，請於測試完畢後，將結果填寫於測試紀錄表(附表 2)，並 email 至 CCP@taifex.com.tw，如相關測試劇本有異動將以電子郵件方式周知市場。

## 貳、測試日期、時間及內容

### 一、測試日期

#### (一) 平日測試(週一至週五)

第一梯次：預計 112 年 3 月 13 日起

第二梯次：預計 112 年 4 月 24 日起

第三梯次：預計 112 年 6 月 5 日起

#### (二) 假日測試(週六)

預計 112 年 7 月起(將另行公告)

有關期交所連線收費方案、電腦連線契約及連線申請表單請洽資訊作業部，電話：(02) 8071-8034 劉小姐。結算會員與期交所簽訂「店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約」後，專屬店頭衍生性金融商品集中結算線路可選擇中華電信、遠傳電信或台灣固網之一路（或多路）電路申請連線。

## 二、測試時間

### 平日測試

臺灣時間	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)
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

## 參、其它事項

一、執行本測試計畫前，請先準備下面事項

(一) 填寫平日測試環境連線申請表單(附表 1)。

(二) 工商憑證或證期憑證。

二、本測試計畫係為配合店頭衍生性商品集中結算業務之實施，故請於測試期間確實檢核各項資訊作業執行結果是否正確。

三、相關問題之聯絡方式

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
----------	--



**附表 1：平日測試環境連線申請表單**

會員代號		會員名稱	
聯絡人員		聯絡電話	
聯絡人員 mail			
申請連線類別	<input type="checkbox"/> SFTP <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

附表 2：測試紀錄表

臺灣期貨交易所

112 年店頭衍生性商品集中結算推行業務

測試紀錄表

會員代號		公司名稱	
聯絡人員		聯絡電話	
測試日期		測試結果	<input type="checkbox"/> 正常 <input type="checkbox"/> 異常
功能項目序號			
意見反應			

※請參照系統測試功能項目(附表 3)，於測試完畢後，填寫本表並 e-mail 至 CCP@taifex.com.tw

附表 3：功能項目

序號	結算會員入口網站功能項目	第一階段 (3/13~)	第二階段 (4/24~)	第三階段 (6/5~)
1	登入-憑證驗證	V	V	V
結算會員及結算帳戶基本資料管理				
2	結算會員及結算帳戶基本資料-結算會員(基本)資料管理-結算會員基本資料查詢	V	V	V
3	結算會員及結算帳戶基本資料-結算會員(基本)資料管理-結算會員基本資料上傳	V	V	V
4	結算會員及結算帳戶基本資料-結算帳戶資料管理-結算帳戶資料查詢/維護	V	V	V
5	結算會員及結算帳戶基本資料-結算帳戶變更每日結算類型申請管理-結算帳戶變更每日結算類型申請查詢/維護	V	V	V
交易提交管理				
6	交易提交管理-當日提交交易狀態查詢	V	V	V
7	交易提交管理-當日 Backloading 交易狀態查詢	V	V	V
8	交易提交管理-單一結算帳戶庫存部位及部位明細查詢	V	V	V
9	交易提交管理-客戶交易額度控管		V	V
部位管理				
10	部位管理-部位互抵管理-部位互抵申請查詢/維護	V	V	V
11	部位管理-部位互抵管理-當日部位互抵結果報表(CM)	V	V	V
12	部位管理-部位互抵管理-隔日部位互抵建議報表(CM)	V	V	V
13	部位管理-部位移轉管理-部位移轉申請查詢/維護	V	V	V
擔保品管理				
14	擔保品管理-有價證券基本檔查詢	V	V	V
15	擔保品管理-匯率查詢	V	V	V
16	擔保品管理-公債付息名冊查詢	V	V	V
17	擔保品管理-結算帳戶餘額查詢及實際抵繳金額	V	V	V
18	擔保品管理-客戶保證金專戶查詢/維護		V	V
風險管理				
19	風險管理-結算會員提供報價管理-歷史報價查詢	V	V	V
20	風險管理-結算會員提供報價管理-提供本日報價	V	V	V
21	風險管理-評價曲線查詢-歷史評價曲線查詢	V	V	V
22	風險管理-交易提交之保證金檢核查詢-new trade 提交查詢	V	V	V
23	風險管理-交易提交之保證金檢核查詢-backloading 提交	V	V	V
24	風險管理-交易提交之保證金檢核查詢-pending backloading 提交	V	V	V

序號	結算會員入口網站功能項目	第一階段 (3/13~)	第二階段 (4/24~)	第三階段 (6/5~)
25	風險管理-淨現值、保證金計算作業及查詢-Trade Level 查詢	V	V	V
26	風險管理-淨現值、保證金計算作業及查詢-Account Level 查詢	V	V	V
27	風險管理-定價價格(fixing rate)查詢-歷史定價價格查詢	V	V	V
28	風險管理-定價價格(fixing rate)查詢-訂價確認報表查詢	V	V	V
29	風險管理-保證金繳存通知查詢-日內例行	V	V	V
30	風險管理-保證金繳存通知查詢-日終例行	V	V	V
31	風險管理-保證金繳存通知查詢-日內-adhoc	V	V	V
32	風險管理-保證金模擬試算	V	V	V
33	風險管理-保證金繳存通知查詢-Backloading	V	V	V
部位集中度				
34	部位集中度-部位集中度查詢		V	V
結算作業				
35	結算作業-單一結算契約結算明細表	V	V	V
36	結算作業-單一結算帳戶結算明細表	V	V	V
37	結算作業-結算會員結算明細表	V	V	V
38	結算作業-單一結算契約歷史統計表	V	V	V
39	結算作業-單一結算帳戶歷史統計表	V	V	V
40	結算作業-結算會員歷史統計表	V	V	V
銀行出入金作業				
41	銀行出入金作業-虛擬入金帳號查詢	V	V	V
42	銀行出入金作業-現金存入作業-現金存入申請查詢/維護	V	V	V
43	銀行出入金作業-有價證券存入作業-有價證券存入申請查詢/維護	V	V	V
44	銀行出入金作業-現金及有價證券提領作業-現金及有價證券提領申請查詢/維護	V	V	V
45	銀行出入金作業-現金代結匯作業-代結匯申請查詢/維護	V	V	V
46	銀行出入金作業-交割結算基金餘額查詢	V	V	V
47	銀行出入金作業-自有資金墊繳申請查詢/維護	V	V	V
交割結算基金管理				
48	交割結算基金管理-交割結算基金繳存通知查詢	V	V	V
拍賣平台				
49	拍賣平台-拍賣清單	V	V	V
50	拍賣平台-決標清單-已決標清單	V	V	V
51	拍賣平台-非義務參與者參與拍賣作業/資格申請		V	V

序號	結算會員入口網站功能項目	第一階段 (3/13~)	第二階段 (4/24~)	第三階段 (6/5~)
52	拍賣平台-非義務參與者參與拍賣申請查詢		V	V
53	拍賣平台-客戶違約申報		V	V
收費及財會帳務				
54	收費及財會帳務-有價證券抵繳手續費月報表	V	V	V
55	收費及財會帳務-結算服務費月報表	V	V	V
56	收費及財會帳務-結算保證金利息清單	V	V	V
57	收費及財會帳務-結算保證金利息明細表	V	V	V
58	收費及財會帳務-交割結算基金利息明細表	V	V	V
59	收費及財會帳務-扣繳憑單明細表	V	V	V
60	收費及財會帳務-結算服務費日報表	V	V	V
61	收費及財會帳務-結算帳戶結算服務費月報表		V	V
62	收費及財會帳務-結算帳戶結算保證金利息清單查詢		V	V
63	收費及財會帳務-結算帳戶結算保證金利息明細表		V	V
報表下載				
64	報表下載-結算連線處理費明細表			V
使用者管理				
65	使用者管理-使用者帳戶管理-帳戶管理	V	V	V
66	使用者管理-群組管理	V	V	V
67	使用者管理-使用者帳戶密碼變更	V	V	V
68	使用者管理-憑證管理	V	V	V
69	使用者管理-SFTP 申請	V	V	V
70	使用者管理-AMQP 申請		V	V
71	公告管理-公告列表	V	V	V
客戶管理				
72	客戶管理-客戶管理者帳戶管理		V	V
73	客戶管理-客戶憑證註銷		V	V
KCCP 計算作業				
74	KCCP 計算作業-CCP 計算結果查詢	V	V	V
SDR 申報專區				
75	SDR 申報專區-SDR 申報作業		V	V

序號	客戶入口網站功能項目	第一階段 (3/13~)	第二階段 (4/24~)	第三階段 (6/5~)
1	登入-憑證驗證		V	V
使用者管理				
2	使用者管理-帳號管理		V	V
3	使用者管理-群組管理		V	V
4	使用者管理-使用者帳戶密碼變更		V	V
5	使用者管理-憑證管理		V	V
部位概況				
6	部位概況-部位概況			V
保證金概況				
7	保證金概況-保證金餘額與款項收付			V
8	保證金概況-有價證券			V
保證金試算				
9	保證金試算-保證金試算			V