



臺灣期貨交易所

店頭衍生性金融商品結算會員營運手冊

目錄

前言	- 1 -
第一章 店頭集中結算服務內容與時程規劃	- 1 -
第一節 店頭集中結算服務內容	- 1 -
第二節 客戶交易提交審核(Request For Consent)	- 2 -
第三節 申請時程規劃	- 2 -
第二章 結算會員資格條件及申請流程	- 4 -
第一節 結算會員資格條件	- 4 -
第二節 結算會員申請流程	- 6 -
第三章 法律權利義務之契約簽訂	- 10 -
第四章 資訊規格建議與相關功能介紹	- 12 -
第一節 資訊系統架構	- 12 -
第二節 用戶端網路架構	- 13 -
第三節 電信公司電路方案與費率	- 14 -
第四節 結算會員連線申請程序	- 15 -
第五節 入口網站連線登入方式	- 16 -
第六節 入口網站功能	- 20 -
第七節 SFTP 連線設定	- 22 -
第八節 客戶交易額度控管設定	- 25 -
第九節 Client API AMQP 連線設定	- 26 -
第五章 附件	- 27 -
[附件 1]店頭結算會員資格申請書	- 28 -
[附件 2]營運計劃書格式範本	- 35 -
[附件 3]結算會員申請人未具消極資格聲明書	- 37 -
[附件 4]承諾書	- 39 -
[附件 5]保證函	- 41 -
[附件 6]店頭衍生性金融商品結算交割契約	- 43 -
[附件 7]店頭集中結算交割作業印鑑卡暨留存印鑑聲明書	- 51 -

[附件 8]店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約	- 53 -
[附件 9]結算會員與本公司店頭結算系統及認可之交易契約提交平台完 成連線測試聲明書	- 57 -
[附件 10]店頭衍生性金融商品集中結算業務會計處理範例	- 59 -

前言

臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱「期交所」）經主管機關於 108 年 6 月 24 日發布金管證期字第 1080315266 號令，指定為我國店頭衍生性金融商品結算機構。

為提供金融機構申請成為期交所店頭衍生性金融商品集中結算業務（以下簡稱「店頭集中結算業務」）結算會員之參考依據，特編訂本手冊，就期交所提供之店頭集中結算服務內容、客戶交易提交審核(Request For Consent, RFC)、申請時程規劃、結算會員資格條件、結算會員申請流程、法律契約、資訊系統架構、用戶端網路架構、電信公司電路方案與費率、結算會員連線申請程序、入口網站連線登入方式、入口網站功能簡介及 SFTP 連線申請作業進行說明。

第一章 店頭集中結算服務內容與時程規劃

第一節 店頭集中結算服務內容

期交所規劃分階段推出店頭集中結算服務內容，說明如下：

- (一)、 第一階段：111 年 7 月 25 日起提供結算會員新臺幣利率交換 (IRS) 自營交易之自願性結算服務 (Dealer to dealer clearing)。
- (二)、 第二階段：預計於 112 年 7 月提供結算會員新臺幣利率交換 (IRS) 客戶交易之結算服務 (Client clearing) 及新臺幣無本金交割遠期外匯 (NDF) 之結算服務。

第二節 客戶交易提交審核(Request For Consent)

因應第二階段新增客戶集中結算服務，系統新增一般結算會員審核客戶交易提交集中結算 (Request For Consent, RFC)等功能，以利一般結算會員檢視其客戶是否符合預繳保證金及客戶保證金水位等風險狀況。目前期交所預計提供三種 RFC 功能，一般結算會員可依其需求選擇使用何種功能：

(一)、 Client API：

一般結算會員可開發接收回覆 Client API 電文之程式，以系統自動化檢核客戶提交交易契約內容、客戶保證金及風險評估，並依檢核結果自動回覆期交所是否接受客戶提交交易契約。

(二)、 預先授權自動 RFC：

一般結算會員同意授權期交所採自動化 RFC，並透過店頭結算系統入口網站(web portal)預先設定可使用額度等風險參數，以作為新交易 RFC 之檢核。

(三)、 人工 RFC：

期交所收到客戶提交交易契約後，將通知該一般結算會員，會員可於 web portal 進行客戶保證金試算，並選擇接受或拒絕該契約提交。

第三節 申請時程規劃

擬申請期交所店頭結算會員之金融機構，得參考下圖評估申請時程，個別結算會員和一般結算會員的預估時程詳圖 1 及圖 2：

圖 1、個別結算會員主要工作及預估時程圖

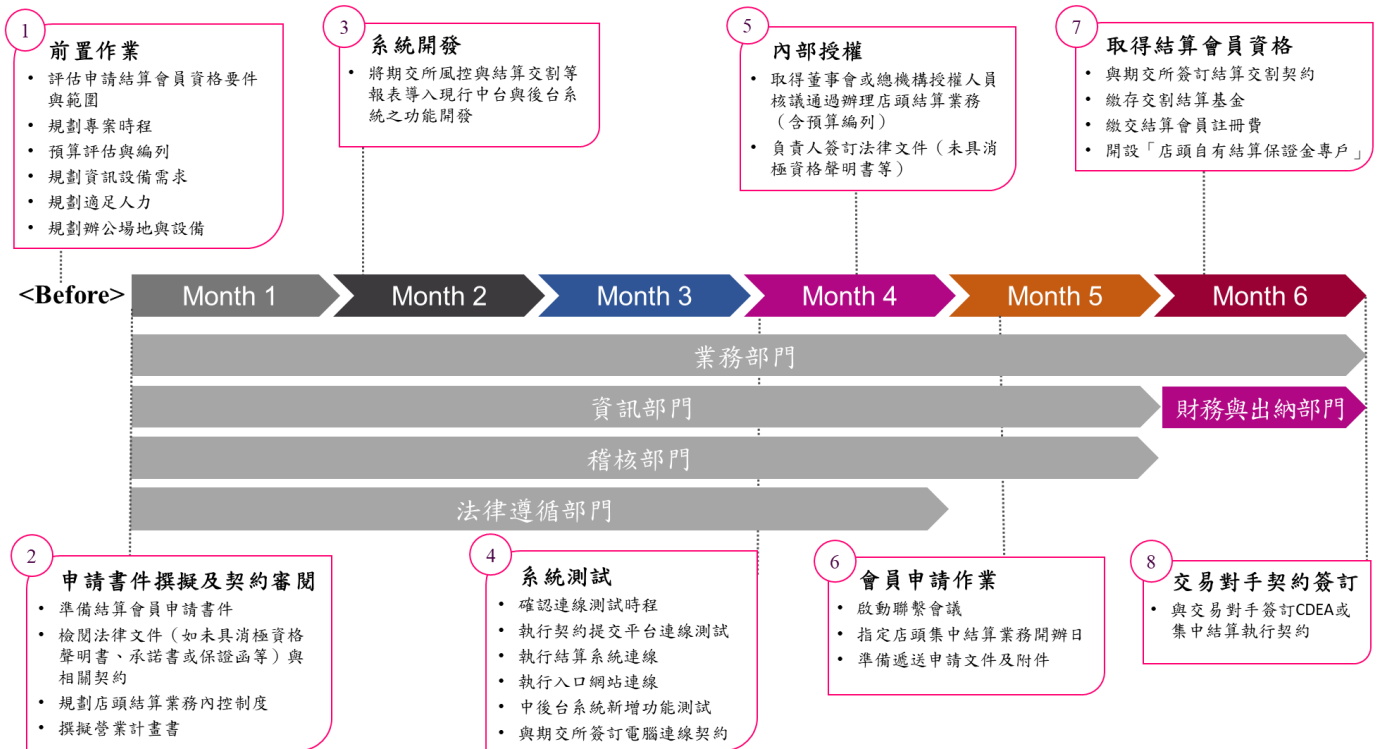
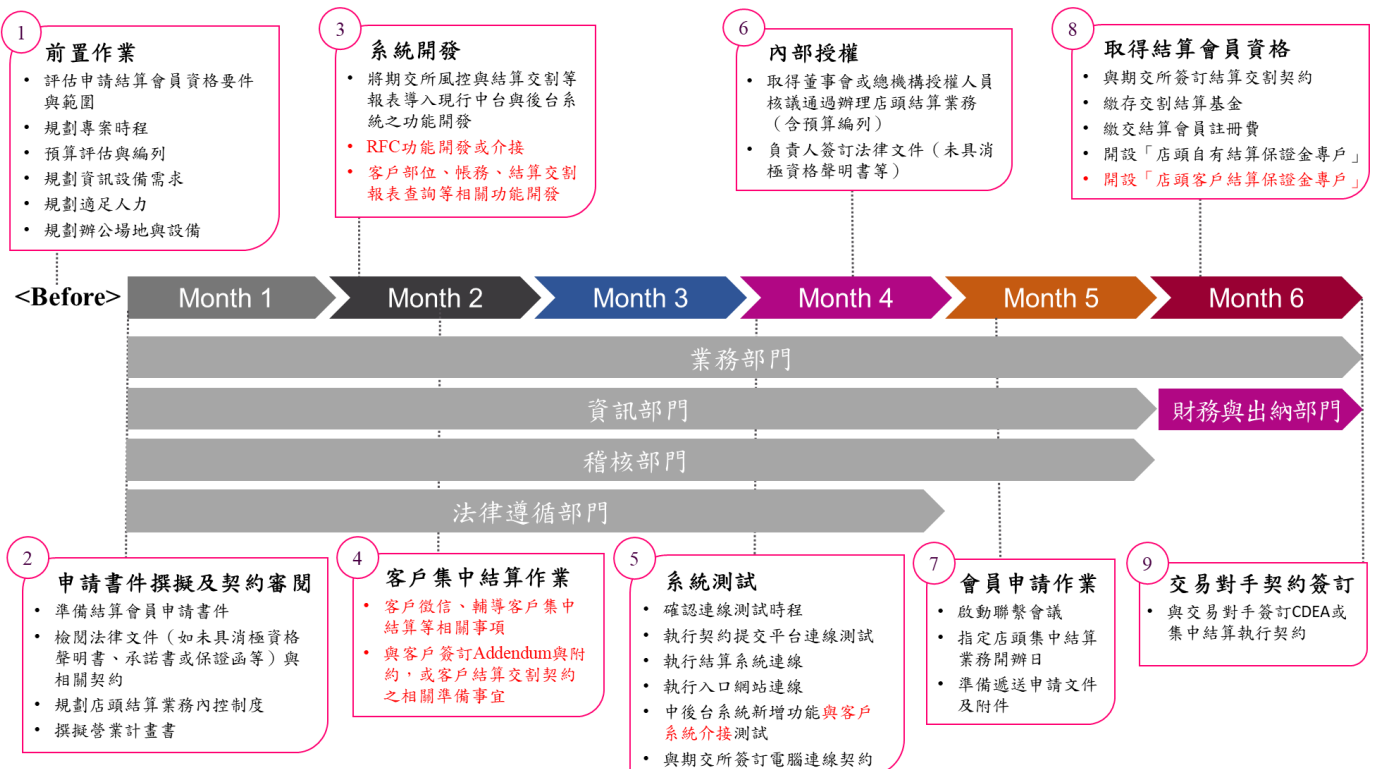


圖 2、一般結算會員主要工作及預估時程圖



第二章 結算會員資格條件及申請流程

第一節 結算會員資格條件

期交所店頭結算會員資格依其業務範圍，分為個別結算會員與一般結算會員。有關店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法（以下簡稱店頭施行辦法）所載結算會員之資格條件，包括結算會員財務條件、繳存交割結算基金、人力、場地設備等要件，彙總說明如下：

	個別結算會員	一般結算會員
身分資格	經主管機關核准從事衍生性金融商品交易或辦理衍生性金融商品業務之金融機構，取得期交所結算會員資格者為限。	
業務範圍	辦理自營交易集中結算業務	辦理自營交易及其客戶交易集中結算業務
最低實收資本額要求	新臺幣二十億元 但最低實收資本額未達新臺幣二十億元者，得由其外國總機構、金融控股公司或外國金融控股公司、控制公司出具保證函或承諾書履行結算交割義務及相關責任，向期交所申請會員資格	新臺幣八十億元
財務結構要求	(1) 銀行業： 其資本適足率不得低於百分之十點五。 (2) 保險業： 其資本適足率不得低於百分之二百、淨值比率不得低於百分之三。 (3) 證券商： 其自有資本適足比率不得低於百分之二百。 (4) 票券金融公司：	(1) 銀行業： 其資本適足率不得低於百分之十點五。 (2) 證券商： 其自有資本適足比率不得低於百分之二百。 (3) 期貨商兼營槓桿交易者： 其調整後淨資本額不得低於期貨交易

	個別結算會員	一般結算會員
	<p>其資本適足率不得低於百分之八。</p> <p>(5) 期貨商兼營槓桿交易商： 其調整後淨資本額不得低於期貨交易人未沖銷部位所需之客戶保證金總額之百分之三十。</p> <p>(6) 金融控股公司法所稱之子公司： 金融控股公司或外國金融控股公司計算及填報之集團資本適足率不得低於百分之一百。</p> <p>(7) 公司法所稱之從屬公司： 其控制公司之財務結構，應符合本款第一日至第五目所屬業別規定。</p> <p>(8) 外國金融機構依法在我國境內設立之分支機構： 其總機構之財務結構，應符合本款第一日至第五目所屬業別規定。</p>	<p>人未沖銷部位所需之客戶保證金總額之百分之三十。</p>
交割結算基金	<p>(1) 開業前繳存新臺幣二千萬元。</p> <p>(2) 開業後依所持有部位曝險按期交所計算之金額續繳。</p>	<p>(1) 開業前繳存新臺幣三千萬元。</p> <p>(2) 開業後依所持有部位曝險按期交所計算之金額續繳。</p>
監督辦理集中結算之主管與業務人員	<p>(1) 指派主管監督辦理集中結算業務。</p> <p>(2) 應有適足及適任之專業人員辦理集中結算業務。</p>	<p>(1) 指派主管監督辦理集中結算業務。</p> <p>(2) 應有適足及適任之專業人員辦理集中結算業務。</p>

	個別結算會員	一般結算會員
	(3) 辦理保證金及結算款項收付業務之人員、出納及會計人員不得相互兼任。	(3) 辦理保證金及結算款項收付業務之人員、出納及會計人員不得相互兼任。 (4) 指派適任辦理客戶集中結算業務之專業人員。
其他要件	(1) 出具結算會員申請人未具消極資格聲明書。 (2) 依主管機關及期交所規範集中結算業務規定，訂立店頭集中結算業務內部控制制度。 (3) 與期交所店頭結算系統及認可之交易契約提交平台完成連線測試。	

第二節 結算會員申請流程



一、 備妥相關書件提出申請

擬向期交所申請店頭結算會員資格者，於預計辦理店頭集中結算業務 20 個營業日前，備妥相關書件向期交所提出申請，並得指定開業日期，期交所於收到申請案後，將就下列書面文件進行審核：

申請書件

- (1) 店頭結算會員資格申請書（詳附件 1）
- (2) 公司登記證明文件
- (3) 經主管機關核准從事衍生性金融商品交易或辦理衍生性金融商品業務之證明文件

業務書件

- (1) 營業計畫書（撰擬大綱詳附件 2）
- (2) 公司內部控制制度
- (3) 董事名冊及董事會議事錄。結算會員為外國金融機構依法在我國境內設立之分支機構者，董事會議事錄得以總機構授權人員出具同意書代之
- (4) 結算業務主管及辦理集中結算業務人員之名冊

財務文件

- (1) 最近一年度或最近期經會計師查核簽證之財務報告
- (2) 最近期資本適足性揭露文件或同等文件

法律文件

- (1) 結算會員申請人未具消極資格聲明書（詳附件 3）
- (2) 承諾書¹（詳附件 4）或保證函（詳附件 5）²
- (3) 與期交所店頭結算系統及認可之交易契約提交平台完成連線測試聲明書（詳附件 9）

二、 申請書件審核

- (一)、 期交所受理店頭結算會員申請案後，就申請人檢送之申請書件內容進行審核，必要時並得通知申請人進一步提供相關資料。
- (二)、 申請人提出之申請書件不完備或記載事項不充分，經期交所限期補正，逾期不能完成補正者，期交所得退回其申請案件。

三、 通知審核結果

申請書件經期交所審核通過後，將函知並請申請人於開辦結算

¹ 結算會員申請人應提供承諾書：

(1) 辦理自有集中結算業務，於首次提交其總機構或總機構之其他分支機構之交易契約前，應由其總機構出具承諾書。

(2) 個別結算會員申請人最低實收資本額未達新台幣臺幣二十億元之要求，應由其總機構出具承諾書。

² 結算會員申請人應提供保證函：

個別結算會員申請人最低實收資本額未達新台幣臺幣二十億元之要求，應由其金融控股公司、外國金融控股公司或控制公司出具保證函。

業務前完成應須辦理事項。

四、取得結算會員資格

申請人於開辦店頭集中結算業務前，應完成下列事項：

- (一)、與期交所簽訂店頭衍生性金融商品結算交割契約（以下簡稱結算交割契約）並用印。
- (二)、繳存店頭交割結算基金。
- (三)、繳交結算會員註冊費³（新臺幣三十萬元整⁴）。
- (四)、至結算銀行開設「店頭自有結算保證金專戶」、「店頭客戶結算保證金專戶」，並取得契約正副本，及店頭結算保證金專戶申報表。

申請人完成前述事項，應將下列相關文件函送期交所。

法律文件

- (1) 經用印之結算交割契約（詳附件 6）

結算作業

- (1) 印鑑卡（詳附件 7）
- (2) 店頭交割結算基金之匯款證明
- (3) 繳交結算會員註冊費之匯款證明
- (4) 其他經期交所規定應提出之文件

申請人得逕洽下列結算銀行窗口，就開立之結算保證金專戶等事宜辦理相關業務。

編號	結算銀行名稱 (期交所開戶分行)	開立之結算保證金專戶類別	期交所開戶分行窗口	契約聯絡窗口
1	第一商業銀行 古亭分行	台幣 外幣(多幣別) 中央登錄公債	2369-5222#207 廖小姐	02-2348-1835 營運業務處 薛振昌
2	華南商業銀行 南門分行	台幣 外幣(多幣別) 中央登錄公債	2321-7111#123 方小姐	23217111#169 吳宜樺副理

³ 結算會員註冊費屬一次性費用。

⁴ 申請者於簽訂結算交割契約時為期交所股東者，費率為新臺幣二十萬元整。

3	彰化商業銀行 總部分行	台幣 美金 中央登錄公債	2551-4256 #1024 陳苡蕎(台外幣) #1652 劉小姐(公債)	2536-2951#2177 商品策畫處 施柏君
4	國泰世華商業銀行 行館前分行	台幣 外幣(多幣別) 中央登錄公債	2312-5555 #1013 紀小姐(台外幣) #1113 陳先生(公債)	2571-0168 #1655 詹其璋專員 #1658 林子予經理
5	兆豐國際商業銀行 行國外部	台幣 外幣(多幣別) 中央登錄公債	2563-3156 #2432 林小姐(台外幣) #2834 陳小姐(公債)	2563-3156 #2386 李秀霞科長

期交所審核結算會員申請案符合相關規定，將寄還申請人經期交所用印之結算交割契約，並函報主管機關有關申請人與期交所簽訂之結算交割契約、申請人開辦結算交割業務日期及相關資料。

五、 正式開業

結算會員申請人於其指定開業日期，取得期交所結算會員資格，正式運營店頭集中結算業務。

如於申請結算會員程序中有相關問題，請洽期交所結算部：

陳小姐

(02) 2366-3187

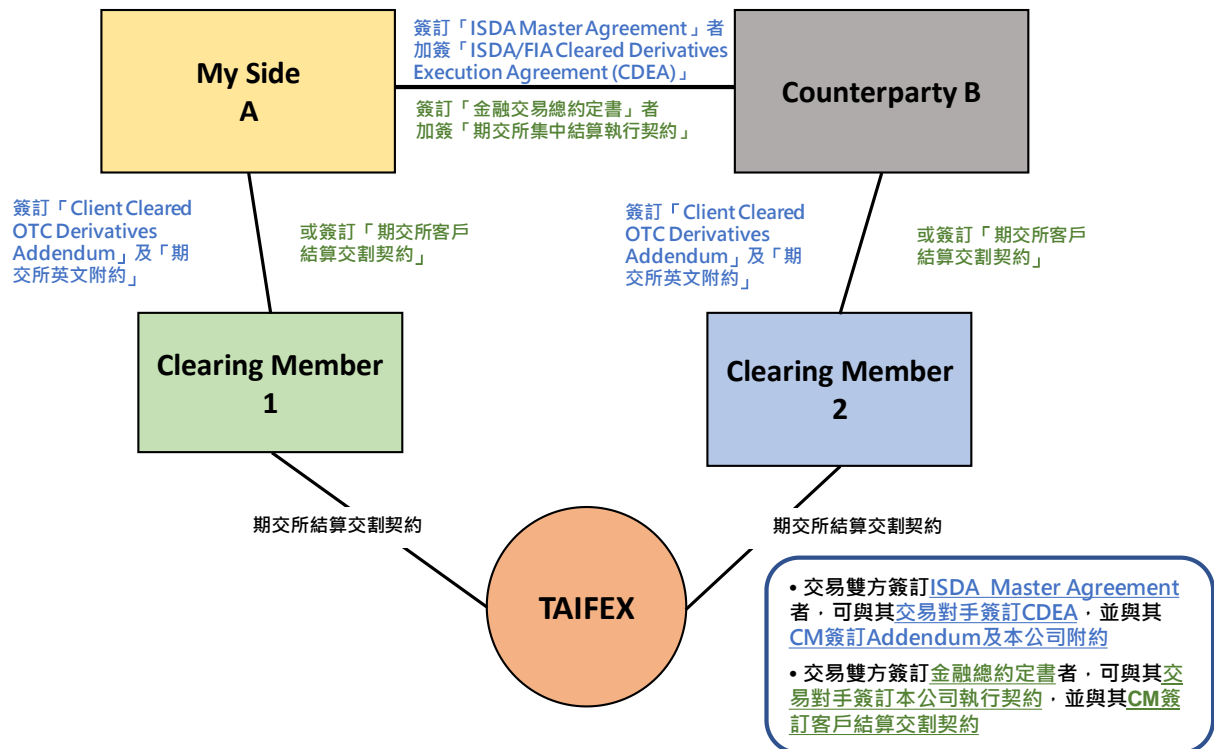
張小姐

(02) 2366-3102

王先生

(02) 2366-3174

第三章 法律權利義務之契約簽訂



結算會員於開辦店頭集中結算業務前，應與期交所簽訂結算交割契約，以辦理交易契約提交集中結算。期交所建議原店頭雙邊 (bilateral) 交易雙方與其結算會員簽訂相關法律文件，以明定相關權利、義務與規範。

(一)、 店頭雙邊交易雙方將交易提交集中結算：

1. 原交易雙方簽訂 ISDA Master Agreement (即 ISDA 主契約)者：
 - 與交易對手加簽「ISDA/FIA Cleared Derivatives Execution Agreement(簡稱 CDEA)」，以同意該契約提交集中結算，並明定相關權利、義務與規範。
2. 原交易雙方簽訂金融交易總約定書者：
 - 與交易對手加簽「集中結算執行契約」，以同意該契約提交集中結算，並明定相關權利、義務與規範。

(二)、結算會員辦理客戶集中結算：

1. 原交易雙方簽訂 ISDA Master Agreement (即 ISDA 主契約)者：

結算會員與其客戶應簽訂「ISDA/FIA Client Cleared OTC Derivatives Addendum (簡稱 Addendum)」及附約。期交所將擬具附約範本，以提供結算會員暨其客戶參考，俾確保契約內容涵蓋期交所規範之客戶結算交割契約應記載事項。

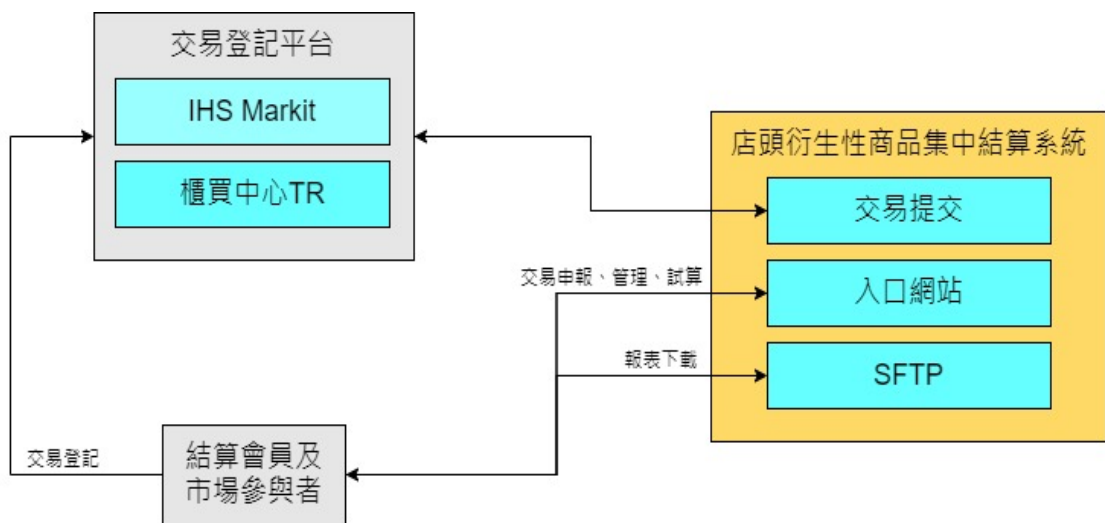
2. 原交易雙方簽訂金融交易總約定書者：

結算會員應與其客戶簽訂「客戶結算交割契約」。期交所提供前揭集中結算執行契約及客戶結算交割契約範本，供業者參酌。

第四章 資訊規格建議與相關功能介紹

第一節 資訊系統架構

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，接著交易登記平台會傳送交易提交至期交所店頭衍生性商品集中結算系統，另結算會員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）。



有關 IHS Markit 交易登記平台問題請洽：

Sharon Tang

+852 3742-1043

Sharon.tang@ihsmarkit.com

有關櫃買中心 TR 交易登記平台問題請洽：

吳先生

(02) 2366-6153

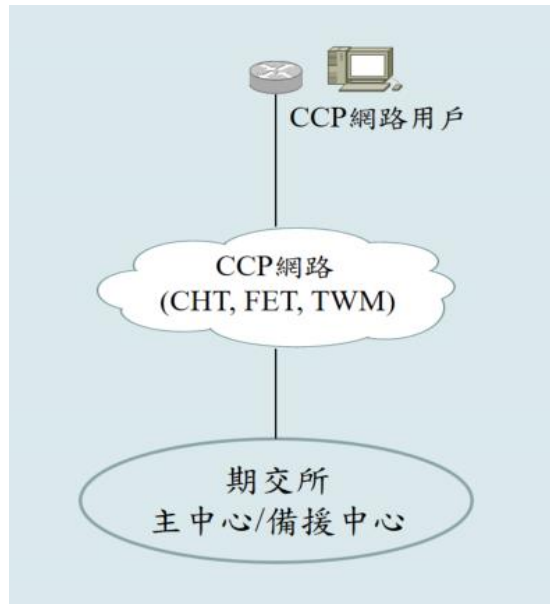
pjwu@tpex.org.tw

吳先生

(02) 2366-6149

williamwu@tpex.org.tw

第二節 用戶端網路架構



- Type 1 為基本方案，提供單一電信公司 WAN 電路。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)）。



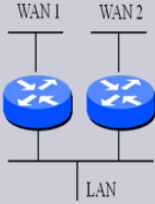
如對用戶端網路架構有任何疑問請洽期交所資訊作業部：

陳先生

(02) 8071-8025

陳先生

(02) 8071-8028

	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

第三節 電信公司電路方案與費率

各家電信公司電路方案與費率說明如下(僅供參考), 相關設定費與設備型號請向各電信公司業務人員洽詢

(一)、 中華電信方案

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 或同級以上 之設備)
1M	3,000 元	4,350 元	• 裝設費/次 2,650 元
2M	3,000 元	8,120 元	• 月租費/台 2,500 元

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(whale@cht.com.tw)

(二)、 遠傳電信方案

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

遠傳電信 專線頻寬相關業務

0955-566369 謝小姐

(三)、 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)
1M	0 元	5,250	每台月租費 1,630 元
2M	0 元	8,370	此優惠至 2022/12/31 止

*簽約兩年免收裝設費

台灣固網 專線頻寬相關業務

0922-441465 陳小姐

0928-662357 蘇小姐

第四節 結算會員連線申請程序

有意願申請成為期交所店頭結算會員之金融機構，參與正式環境及假日測試，須使用店頭衍生性金融商品集中結算專屬線路連線。請先與期交所簽訂「店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約」（詳附件 8）後，即可自由選擇中華電信、遠傳電信或台灣固網之一路（或多路）專線申請連線。

(一)、 電腦連線契約簽訂：

請洽期交所資訊作業部取得裝訂之「店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約」後，檢附如下文件，向期交所辦理簽約事宜。

1. 經用印之「店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約」1 式 2 份。
2. 經主管機關核准從事衍生性金融商品交易或辦理衍生性金融商品業務之證明文件。
3. 申請函。

(二)、 專屬線路申請：

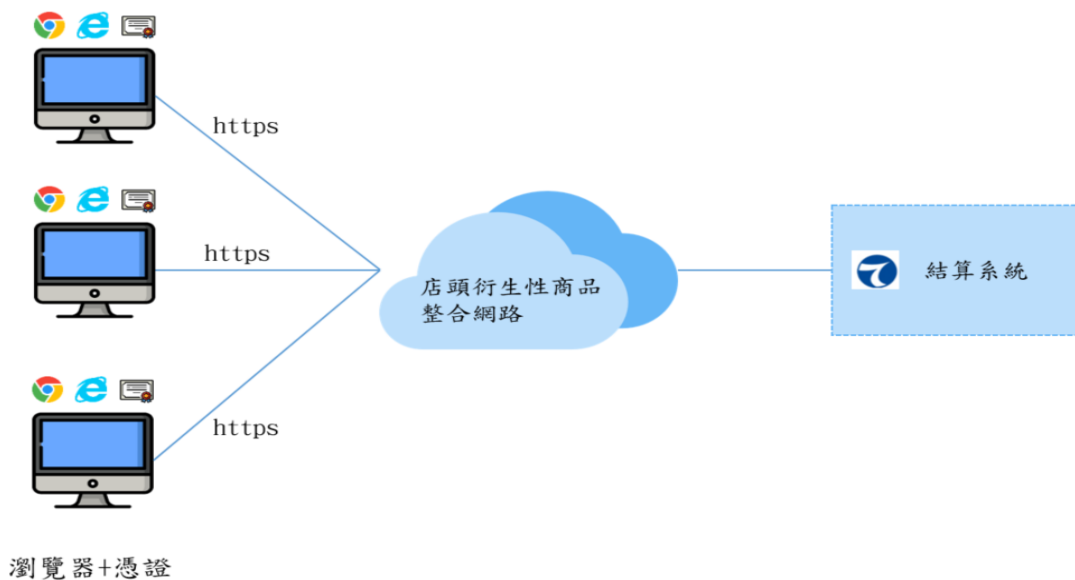
1. 請填寫「店頭衍生性金融商品集中結算線路申請表」及電信公司專案租用及異動申請書，來函向期交所提出申請。
2. 期交所將配發連線之 IP 位址，並轉送電信公司專案租用及異動申請書予電信公司。
3. 待電信公司完成電路供裝及 IP 位址相關設定後，即可連線至結算系統。

上述申請函範例及線路申請表單，請至期交所網站下載：首頁

->OTC 集中結算資訊專區->六、公告->4.店頭衍生性商品集中結算電腦連線申請說明書、電信公司專線租用及異動申請書。有關期交所連線收費、電腦連線契約簽訂及線路申請問題，請洽資訊作業部作業管制組，電話：(02) 8071-8034 劉小姐。

第五節 入口網站連線登入方式

結算會員可透過店頭衍生性商品整合網路，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」登入結算會員入口網站。



(一)、系統需求

1. 店頭衍生性商品整合網路
2. 瀏覽器：Chrome、Edge。(建議使用 1920 x 1080 螢幕解析度)
3. 憑證簽章元件：安控中介元件.exe
4. 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

(二)、憑證 IC 卡申辦方式

1. 經濟部工商憑證

- 申辦方式：經濟部工商憑證管理中心
- 申辦身分：依公司法完成登記之公司、分公司；依有限合夥法完成登記之有限合夥、有限合夥分支機構及依商業登記法完成登記之商業。
- 正卡副卡申辦：首次申辦須申請 1 張正卡，再申辦副卡。
- 憑證費用

費用項目	價格	單位
憑證正卡（效期五年）	420 元	每張
憑證副卡（效期五年）	420 元	每張

2. 證券暨期貨相關單位共用憑證

- 申辦方式：臺灣網路認證公司
- 申辦身分：不限證券期貨業者，一般公司行號皆可申辦。
- 正卡副卡申辦：正副卡可同時申辦。
- 憑證費用

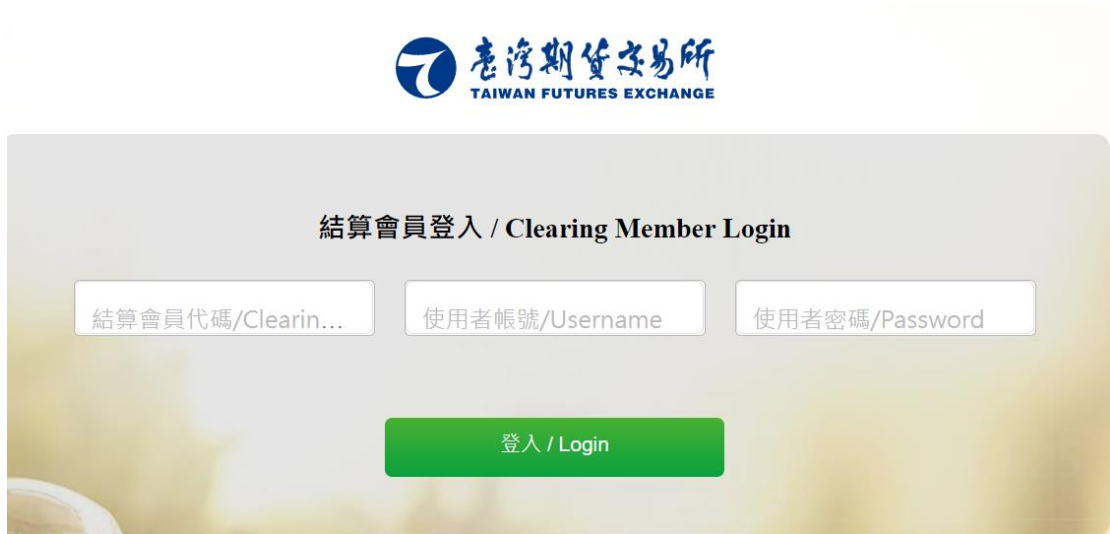
費用項目	價格	單位
憑證正卡（效期二年）	2500 元	每張
憑證副卡（效期二年）	2000 元	每張

(三)、雙因子登入與資料維護功能說明

1. 登入

(1) 開啟結算系統

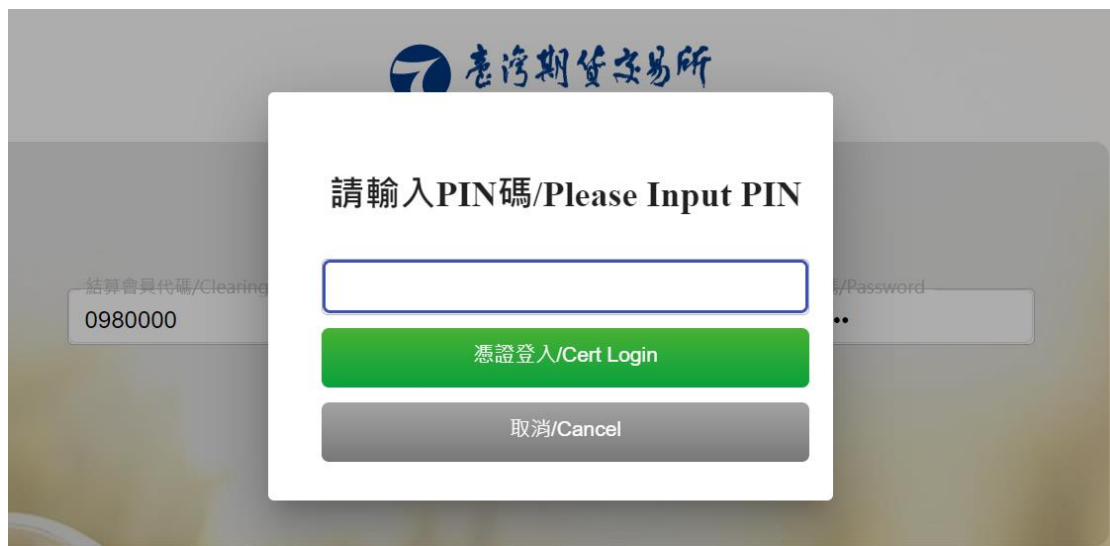
(2) 輸入結算會員代號、使用者帳號及密碼



The screenshot shows the login interface for clearing members. At the top center is the Taiwan Futures Exchange logo. Below it, the title "結算會員登入 / Clearing Member Login" is displayed. There are three input fields: "結算會員代碼/Clearin...", "使用者帳號/Username", and "使用者密碼/Password". A green "登入 / Login" button is positioned below the fields.

(3) 插入「經濟部工商憑證」或「證券暨期貨相關單位
共用憑證」。

(4) 輸入憑證 PIN Code



The screenshot shows a modal dialog box titled "請輸入PIN碼/Please Input PIN". It contains a text input field for the PIN code. Below the input field are two buttons: a green "憑證登入/Cert Login" button and a grey "取消/Cancel" button. In the background, the login form from the previous screenshot is visible, with the "結算會員代碼/Clearing Member Code" field containing the value "0980000".

(5) 成功登入⁵



2. 帳戶資料維護

分為帳號管理者、主管使用者、一般使用者，並可依使用者權限設定所屬群組。

使用者管理 / 帳戶管理

使用者帳號	使用者名稱
使用者部門	使用者組別
電子郵件	電話
狀態 啟用	身份別 結算會員
參與群組	<input type="checkbox"/> 承辦 <input type="checkbox"/> 審核

GROUP_USER
T

<- 加入
移出 ->

3. 憑證資料維護

- 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。

⁵ 首次登入須使用帳號管理者進行登入並註冊憑證資料。

- 新增/刪除憑證。

使用者管理 / 憑證管理

新增憑證注意事項：
* 每次新增一筆憑證資料時，請先將讀卡機插入電腦USB，再把憑證插入
* 按下讀取憑證序號按鈕，輸入PIN碼，檢查下方畫面資料是否為正確憑證
* 按下儲存按鈕即可完成新增憑證動作

結算會員

0980000 BAU測試CM—	讀取憑證序號
------------------	--------

憑證種類

	憑證序號
--	------

如對結算會員入口網站連線方式有任何疑問請洽期交所資訊
規劃部：

(02) 2366-3262 朱小姐

第六節 入口網站功能

結算會員入口網站功能說明如下：

(一)、 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及資料上傳。
- 結算帳戶資料管理：結算帳戶資料查詢、維護(含新增、修改、註銷)及覆核。
- 結算帳戶變更每日結算類型申請管理

(二)、 交易提交管理

- 當日提交交易狀態查詢
- 提交 Backloading 交易狀態查詢
- 單一結算帳戶庫存部位及部位明細查詢

(三)、 部位管理

- 部位互抵管理：部位互抵申請、註銷、覆核及查詢。
- 部位移轉管理：部位移轉申請、註銷、覆核及查詢。

(四)、 擔保品管理

- 有價證券基本檔查詢
- 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額
- 匯率查詢
- 公債付息名冊查詢

(五)、 風險管理

- 結算會員提供 IRS 報價管理
- 評價曲線查詢：歷史及本日評價曲線查詢。
- 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

(六)、 結算作業

- 單一結算契約結算明細資料
- 單一結算帳戶結算明細資料
- 結算會員結算明細資料

(七)、 銀行出入金管理

- 虛擬入金帳號查詢
- 現金存入作業：申請、註銷、覆核及查詢。
- 有價證券存入作業：申請、註銷、覆核及查詢。
- 現金及有價證券提領作業：申請、註銷、覆核及查詢。
- 現金代結匯作業：申請、註銷、覆核及查詢。
- 交割結算基金餘額查詢

(八)、 交割結算基金管理

- 交割結算基金繳存通知查詢
- (九)、拍賣平台
 - 拍賣清單
 - 已決標清單
- (十)、收費及財會帳務
 - 結算服務費日報表
 - 結算服務費月報表
 - 有價證券抵繳手續費月報表
 - 結算保證金利息清單
 - 結算保證金利息明細表
 - 交割結算基金利息明細表
 - 扣繳憑單明細表
- (十一)、KCCP 計算作業
 - KCCP 計算結果查詢
- (十二)、使用者管理
 - 帳戶管理
 - 群組管理
 - 憑證管理
 - SFTP 申請
 - 使用者帳戶密碼變更
- (十三)、相關報表查詢及下載
 - 相關業務報表下載

第七節 SFTP 連線設定

結算會員可透過結算會員入口網站進行 SFTP 帳號申請，相關說明如下：

- (一)、SFTP Server 帳號申請

申請帳號需先登入結算會員入口網站，並點選左下角的 SFTP 申請。

使用者管理 / SFTP申請

帳號	聯絡人姓名	聯絡人電話	聯絡人電子郵件	申請時間	處理狀態	異動類別	操作		
ftp_user	ftp_user	0227091111	ftp_user@taifex.com.tw	2022/02/08	完成	無	明細	修改	刪除
ftp_user2	ftp_user2	0227091111	ftp_user@taifex.com.tw	2022/02/08	完成	無	明細	修改	刪除
taifex_u1	謝佳昕	3395	connie@taifex.com.tw	2022/01/11	完成	無	明細	修改	刪除
user01	aa	1112	connie@taifex.com.tw	2022/04/12	完成	無	明細	修改	刪除
user02	aa	11	connie@taifex.com.tw	2022/04/12	完成	無	明細	修改	刪除
uu1	connie	3246	connie@taifex.com.tw	2022/08/19	完成	無	明細	修改	刪除
uu2	1	2	connie@taifex.com.tw	2022/08/19	完成	無	明細	修改	刪除

每頁筆數: 10 第 1 - 7 筆, 共 7 筆 |< < > >| 前往: 1

(二)、新增帳號申請

使用者管理 / SFTP申請

結算會員代號

Client IP

密碼

Public Key

聯絡人姓名

聯絡人電子郵件

帳號

聯絡人電話

再次輸入密碼

(三)、待次一營業日系統生效

(四)、使用檔案傳輸軟體連線登入下載檔案（以 FileZilla 為例）⁶：



如對 SFTP 連線設定有任何疑問請洽期交所資訊規劃部：

(02) 2366-3135 羅先生

⁶ 1.Port 需使用 22999（請結算會員網管人員開通此 Port 號防火牆）
2.須透過 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	ccpsftp1.taifex
Server 2	ccpsftp2.taifex

3.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

第八節 客戶交易額度控管設定

第二階段預計開放結算會員可透過結算會員入口網站進行各客戶結算帳戶額度控管的新增及異動，並於客戶結算帳戶之額度使用率達到一定標準時進行警示。並提供應繳保證金加收參數設定及設定是否自動作為 RFC(Request for Consent)結果。相關說明如下：

(一)、 客戶結算帳戶額度查詢

結算會員可透過結算會員入口網站查詢所屬客戶目前之結算帳戶額度使用情形，查詢畫面及揭露欄位預計規劃如下。

序號	結算帳戶	帳戶基礎幣別	可使用額度	已使用額度	額度使用率	操作
1	TEST001	TWD	1200	840	70%	設定
2	TEST002	TWD	500	510	102%	設定
3	TEST003	TWD	800	760	95%	設定
4	TEST004	USD	2000	1650	82.5%	設定

(二)、 客戶結算帳戶額度新增/異動

結算會員可透過結算會員入口網站新增或異動所屬客戶額度控管資料。

(三)、 客戶結算帳戶應繳保證金加收參數

結算會員可透過結算會員入口網站設定客戶結算帳戶應繳保證金加收參數。目前規劃設定參數如下。

參數名稱	參數設定範圍
整戶加收百分比(%)	0~無限大
整戶加收數值(帳戶基礎)	0~無限大

(四)、 設定是否自動作為 RFC(Request for Consent)結果

結算會員可透過結算會員入口網站設定是否自動作為 RFC(Request for Consent)結果。若設定為是，客戶進行新交易提交時，通過契約適格性檢核後將會以保證金試算結果之「應繳保證金」與「客戶結算帳戶應繳保證金參數」以下列公式進行計算。

「應繳保證金 * (1+整戶加收百分比(%)) + 加收數值」

若上述計算結果小於等於該客戶結算帳戶之剩餘額度，則自動視為 RFC 回覆為同意，若大於則視為 RFC 回覆為拒絕。

(五)、 客戶帳戶額度警示機制

預計規劃警示標準級距如下，當有客戶結算帳戶之額度達到警示標準時以簡訊及 Email 通知所屬結算會員。

警示標準	警示觸發條件
注意	80% <= 額度使用率 <= 90%
警示	90% <= 額度使用率 <= 100%
超限	100% < 額度使用率

第九節 Client API AMQP 連線設定

結算會員若欲使用系統自動化進行客戶交易之 RFC 機制，需先透過結算會員入口網站進行 Client API AMQP 帳號申請，相關說明如下：

(一)、 Client API AMQP 帳號申請

申請帳號需先登入結算會員入口網站，並點選左下角的 AMQP 申請。

(二)、 新增帳號申請

預計規劃之方式為，結算會員可透過 AMQP 介面輸入帳號、密碼、密碼確認及至多 5 組 IP 資訊。

(三)、 待次一營業日生效

(四)、 連線測試

結算會員於次一營業日後使用依循 AMQP 之客戶端程式，使用以下連線設定，並設定登入之帳號密碼即可進行連線。

	AMQP Broker & DNS IP
AMQP Broker(主)	amqp1.taifexccp
AMQP Broker(備)	amqp2.taifexccp
DNS(主)	192.168.231.67
DNS(備)	192.168.236.66

如對 SFTP 連線設定有任何疑問請洽期交所資訊規劃部：
(02) 2366-3135 羅先生

第五章 附件

下列書件範本供店頭結算會員申請人參考，相關附件範本得適時依業務需求加以修正，屆時修正範本將替代原文件範本，期交所將審酌結算會員是否應依修正內容提供相關文件。

[附件 1]店頭結算會員資格申請書



店頭衍生性金融商品結算會員資格申請書
臺灣期貨交易所

聯繫窗口

若您對申請書有任何疑問，請聯繫我們

otcclearing@taifex.com.tw

店頭衍生性金融商品結算會員資格申請書

會員名稱		統一編號	
結算會員類別	<input type="checkbox"/> 個別結算會員 <input type="checkbox"/> 一般結算會員		
會員業別	<input type="checkbox"/> 銀行業 <input type="checkbox"/> 槓桿交易商 <input type="checkbox"/> 證券商 <input type="checkbox"/> 保險業 <input type="checkbox"/> 票券金融公司		
註冊日期		註冊國家	
註冊地址			
業務辦理地址			
官方網站			
負責人		負責人職稱	
聯絡電話		聯絡電子信箱	
資本適足率(%)		實收資本額	
外國機構投資人 代碼 FINI ID		全球金融通信 協會代碼	
全球法人機構 識別代碼 LEI			
交易契約提交平台資訊		MarkitWire ID	

		TradeSERV ID	
		TPEX Financial Institution Code	
<p>關聯企業為本公司現行結算會員(若有請逐家列示，全部填寫)</p>	<p>關聯企業：</p> <p>結算會員名稱：</p> <p>結算會員代碼：</p>		
<p>申請機構為外國金融機構依法在我國境內設立之分支機構者，是否代國外總/分支機構結算⁷</p>		<p><input type="checkbox"/> 代國外總機構提交結算</p> <p><input type="checkbox"/> 代國外分支機構提交結算</p> <p><input type="checkbox"/> 以上皆無</p>	

⁷ 依期交所店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法第 2.1.2 條，結算會員為外國金融機構依法在我國境內設立之分支機構，其辦理自有集中結算業務，於首次提交其總機構或總機構之其他分支機構之交易契約前，應由其總機構出具承諾書，共同履行結算交割義務。

檢附書件(已檢附於中打 V)：

申請書件：

1. 店頭衍生性金融商品結算會員資格申請書
2. 公司登記證明文件
3. 經主管機關核准從事衍生性金融商品交易或辦理衍生性金融商品業務之證明文件

業務書件：

1. 營業計畫書
2. 公司內部控制制度
3. 董事名冊
4. 董事會議事錄。為外國金融機構依法在我國境內設立之分支機構者，本項得以總機構授權人員出具同意書代之
5. 負責集中結算業務主管及辦理集中結算業務人員之名冊資料

財務文件及聲明書：

1. 最近一年度或最近期經會計師查核簽證之財務報告
2. 最近期資本適足性揭露文件或同等文件
3. 結算會員申請人未具消極資格聲明書
4. 與期交所店頭結算系統及認可之交易契約提交平台完成連線測試聲明書

適用特定資格之其他文件：

1. 承諾書⁸(結算會員之申請適用本公司店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法(以下簡稱施行辦法)第 2.1.2 條第 2 項、第 2.1.3 條第 1 項第 1 款第 3 目之情形者)
2. 保證函⁹(結算會員之申請適用施行辦法第 2.1.3 條第 1 項第 1 款第 1 目、2 目之情形者)
3. 出具承諾書或保證函之機構之最近一年度或最近期經會計師查核簽證之財務報告

⁸ 結算會員申請人應提供承諾書：

(1)辦理自有集中結算業務，於首次提交其總機構或總機構之其他分支機構之交易契約前，應由其總機構出具承諾書。
(2)個別結算會員申請人最低實收資本額未達新臺幣 20 億元之要求，應由其總機構出具承諾書。

⁹ 結算會員申請人應提供保證函：

個別結算會員申請人最低實收資本額未達新臺幣 20 億元之要求，應由其金融控股公司、外國金融控股公司或控制公司出具保證函。

本公司充分瞭解臺灣期貨交易所股份有限公司之店頭衍生性金融商品集中結算業務規則及施行辦法，茲依施行辦法第 2.2.1 條規定提交本申請書；本公司謹聲明以上提供之資訊均正確且完備。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

申請公司名稱

負責人

留存經濟部印鑑

_____年_____月_____日

集中結算業務主管及辦理集中結算業務人員之名冊資料

辦理結算作業人員				
姓名	職稱	連絡電話	聯絡電郵	申請作業
	集中結算業務主管			<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
	保證金及結算款項 收付業務人員			<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
	會計人員			<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
	出納人員			<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
	辦理客戶集中結算 業務人員	公司電話: _____ 手機號碼: _____		<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
				<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
				<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
				<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
				<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除

				<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
				<input type="checkbox"/> 新增 <input type="checkbox"/> 修改 <input type="checkbox"/> 刪除
<p>本公司指派上述主管監督辦理集中結算業務。茲聲明上列名單所載人員發生異動，本公司應於異動後五日內列冊向期交所辦理登記，在辦妥異動登記前，本公司對各該人員之行為仍應負責。</p>				

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

[印鑑卡留存印鑑]

中 華 民 國 年 月 日

[附件 2]營運計劃書格式範本

營運計劃書格式範本

一、 公司簡介

(一)、 公司組織架構簡介

- (1) 圖示內部組織架構及說明分工內容
- (2) 說明辦理店頭集中結算業務單位之授權執掌及業務內容

(二)、 公司總分支機構及關聯企業架構簡介(若無可省略)

- (1) 圖示說明總分支機構持股關係(重點說明擬代為提交結算服務之機構)
- (2) 圖示說明關聯機構持股關係(重點說明擬代為提交結算服務之機構)
- (3) 總分支機構風險控管之方式,例如提交結算服務額度設定與控管方式、帳戶及部位管理原則等要素。

(三)、 店頭集中結算業務範圍與經營原則

說明店頭集中結算業務範圍及經營原則,例如恪遵法令規章、提高店頭衍生性商品結算比例、提升客戶結算服務品質等要素。

二、 店頭集中結算業務管理架構

(一)、 人員配置與管理(結算作業委託他人辦理者,應說明委外對象及委外事項範圍)

(二)、 人員訓練

例如內部訓練、外部訓練,或依主管機關或法規要求之訓練內容。

(三)、 營業處所及設備概況

例如營業處所位置、連線設備、通訊設備、資訊設備、主

機及備援主機等要素。

(四)、 業務及系統備援政策

三、 店頭集中結算業務風險控管方式及法令遵循

(一)、 風險種類識別與控管

(二)、 部位管理方法

(三)、 結算帳戶管理原則

(四)、 結算交割作業程序

(五)、 結算保證金款項撥付管理

(六)、 核帳處理作業

(七)、 客戶開立結算帳戶之徵信手續 (Know-your-customer)

(八)、 因應洗錢防制與打擊資恐法規訂定之內部規範

四、 實收資本額與財務結構說明文件

(一)、 最近一年度或最近期經會計師查核簽證之財務報告

(二)、 最近期資本適足性揭露文件或同等文件

[附件 3]結算會員申請人未具消極資格聲明書

結算會員申請人未具消極資格聲明書

_____ (以下簡稱本公司) 充分瞭解臺灣期貨交易所股份有限公司(以下簡稱期交所)店頭衍生性金融商品集中結算業務規則及店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法(以下簡稱店頭施行辦法)等, 為向期交所申請成為結算會員, 以辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務(以下簡稱店頭集中結算業務), 茲聲明如下:

一、本公司未有下列情事:

- (一)、最近半年曾受目的事業主管機關依法撤換負責人或命令解除負責人職務之處分。
- (二)、最近一年曾受目的事業主管機關為全部或一部之停業處分。
- (三)、最近二年曾受目的事業主管機關為撤銷從事衍生性金融商品交易或辦理衍生性金融商品業務之營業許可處分。

二、本公司董事、監察人及依店頭施行辦法第2.1.5條指派監督店頭結算業務之主管未有下列情事;本公司董事、監察人為法人者,各該法人代表人或其所指定代表行使職務之人,亦同:

- (一)、有公司法第三十條各款情事之一。
- (二)、曾任法人宣告破產時之董事、監察人、經理人或與其地位相等之人,其破產終結未滿三年或調協未履行。
- (三)、最近三年內在金融機構使用票據有拒絕往來紀錄。
- (四)、受目的事業主管機關依銀行法第六十一條之一第一項第六款或第

七款、保險法第一百四十九條第一項第四款或第六款、證券交易法第五十六條或第六十六條第二款、期貨交易法第一百零一條第一項、票券金融管理法第五十一條準用銀行法第六十一條之一第一項第六款或第七款規定，為解除職務之處分，未滿五年。

(五)、因違反期貨交易法、公司法、證券交易法、銀行法、保險法、票券金融管理法等規定，經受罰金以上刑之宣告及執行完畢、緩刑期滿或赦免後未滿五年。

(六)、曾受期貨交易法第一百條第二款撤換職務處分，未滿五年。

三、本公司成為期交所結算會員後，將持續符合上述聲明，若有不符，本公司應即檢具相關書件向期交所申報。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

公司名稱：

統一編號：

註冊地址：

負責人：

[留存經濟部印鑑]

中 華 民 國 年 月 日

[附件 4]承諾書

承諾書

_____（以下簡稱本公司）充分瞭解臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱期交所）店頭衍生性金融商品集中結算業務規則（以下簡稱店頭業務規則）及店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法（以下簡稱店頭施行辦法）等，由本公司在台分支機構申請成為期交所之結算會員，以辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務（以下簡稱店頭集中結算業務），茲依店頭施行辦法第2.1.2條第2項或第2.1.3條第1項第1款第3目規定，出具本承諾書並向期交所承諾以下內容：

- 一、本公司為_____（下稱結算會員）之總機構。
- 二、本公司承諾履行結算會員於期交所辦理店頭集中結算業務所生之結算交割義務及相關責任；另依店頭施行辦法第2.1.2條第2項規定，附件所列機構之交易契約倘透過結算會員於期交所進行集中結算，本公司承諾負相同履行義務。
- 三、結算會員有未能於規定時間內繳交結算保證金、店頭交割結算基金或其他期交所規定款項之虞，本公司應即時提供資金，或依期交所指示辦理。
- 四、本公司提供結算會員資金之內部政策等相關事宜變更時，本公司應即通知期交所或指示結算會員申報。
- 五、本承諾書以中華民國法為準據法。
- 六、因本承諾書或店頭集中結算業務所生之爭議，本公司同意交付中華民國仲裁協會依仲裁法之規定，以仲裁方式解決之。如預期未能作成仲裁判斷逕行起訴時，同意以臺灣臺北地方法院為第一審管轄法院。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

[有權人簽章]

中 華 民 國 年 月 日

承諾書附件

總機構資訊			
公司名稱		註冊日期	
註冊地址		代表人	
全球法人機構識別代碼 LEI		全球金融通信協會代碼 Swift Code	
營業類型		註冊國家	
資本適足率 (%)		實收資本額	

分支機構資訊			
公司名稱		註冊日期	
註冊地址		代表人	
全球法人機構識別代碼 LEI		全球金融通信協會代碼 Swift Code	
營業類型		註冊國家	
資本適足率 (%)		實收資本額	

[附件 5]保證函

保證函

_____（以下簡稱本公司）充分瞭解臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱期交所）店頭衍生性金融商品集中結算業務規則（以下簡稱店頭業務規則）及店頭衍生性金融商品集中結算業務施行辦法（以下簡稱店頭施行辦法）等，由本公司之子公司或從屬公司申請成為期交所之結算會員，以辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務（以下簡稱店頭集中結算業務），茲依店頭施行辦法第2.1.3條第1項第1款第1目或第2目規定，出具本保證函並向期交所保證以下內容：

- 一、本公司為_____（下稱結算會員）之總機構。
- 二、本公司保證共同履行結算會員於期交所辦理店頭集中結算業務所生之結算交割義務及相關責任。
- 三、結算會員有未能於規定時間內繳交結算保證金、店頭交割結算基金或其他期交所規定款項之虞，本公司應即時提供資金，或依期交所指示辦理。
- 四、本公司提供結算會員資金之內部政策等相關事宜變更時，本公司應即通知期交所或指示結算會員申報。
- 五、本保證函以中華民國法為準據法。
- 六、因本保證函或店頭集中結算業務所生之爭議，本公司同意交付中華民國仲裁協會依仲裁法之規定，以仲裁方式解決之。如預期未能作成仲裁判斷逕行起訴時，同意以臺灣臺北地方法院為第一審管轄法院。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

公司名稱：
統一編號：
負責人：
註冊地址：

[留存經濟部印鑑]

中 華 民 國 年 月 日

外國金融控股公司資訊			
公司名稱		註冊日期	
註冊地址		代表人	
全球法人機構識別代碼 LEI		全球金融通信協會代碼 Swift Code	
營業類型		註冊國家	
資本適足率 (%)		實收資本額	

[附件 6]店頭衍生性金融商品結算交割契約

臺灣期貨交易所股份有限公司 店頭衍生性金融商品結算交割契約

中華民國一百一十一年二月二十五日金融監督管理委員會
金管證期字第一一一〇一三二四六六號函同意照辦
中華民國一百一十一年三月四日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第一一一〇三〇〇三一九號函公告

本店頭衍生性金融商品結算交割契約(下稱「本契約」)由臺灣期貨交易所股份有限公司(下稱「甲方」)與_____股份有限公司(下稱「乙方」)簽訂。

按：

- (1) 甲方為依中華民國期貨交易法經主管機關許可並發給許可證照之期貨結算機構，並依甲方店頭衍生性金融商品集中結算業務規則(下稱「店頭業務規則」)之規定辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務；
- (2) 乙方擬依甲方店頭業務規則及相關市場規章取得結算會員資格，辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務。

茲甲乙雙方同意簽署本契約，俾使乙方取得結算會員資格以辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務。

雙方當事人並同意遵守下列規定：

一、 生效日

本契約應經甲、乙雙方簽署及乙方繳存店頭交割結算基金後，始生效力。乙方並應俟甲方簽還本契約取得結算會員資格後，始得辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務。

二、 相關法令

乙方辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務，應遵守甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告。

甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告如有修訂，乙方亦有遵守之義務。

本契約用語之意義均與甲方店頭業務規則及相關市場規章用語之定義相同。

三、 聲明與擔保

乙方茲謹聲明並擔保如下：

- (1) 乙方係依中華民國法律設立登記並合法存續之公司，有合法權限得持有其資產及經營其各項業務。
- (2) 乙方業經依公司內部程序完成一切必要之授權，得簽署、交付及履行本契約及相關之其他各項文件。
- (3) 乙方簽署、交付及履行本契約並未違反法令、乙方公司章程或公司內部規章，亦不會影響乙方於本合約之義務或使其發生任何違約情事。
- (4) 本契約及與本契約相關之其他各項文件，對乙方均構成合法有效並有拘束力。
- (5) 乙方已依相關法令規定取得各項必要之核准及證照，且該等核准及證照均於本契約存續期間內持續有效，且乙方並無任何會使主管機關撤銷此等核准或證照之情事存在。
- (6) 乙方並未聲請（或遭聲請）進行任何停業、解散、清算、破產、公司重整、紓困或其他類似之法律程序。
- (7) 乙方就申請成為結算會員及辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務提供之資訊均正確無誤。

四、 承諾事項

乙方辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務，應遵守下列事項：

- (1) 對甲方負有履行結算與交割之義務及有關一切責任，不得主張係受第三人委託或任何其他原因而免責。
- (2) 遵守甲方有關每日結算、交割與部位限制之相關規定。

- (3) 依甲方之規定預先繳足結算保證金至甲方之結算保證金專戶，並於繳存之結算保證金低於甲方規定之標準時，於甲方規定之期限內補足差額。
- (4) 依甲方規定期限繳納結算服務費、店頭交割結算基金及其他費用。
- (5) 確實保存其自有及客戶所有店頭衍生性金融商品部位之每日結算交割紀錄，並按甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告編制財務報告或其他報表。
- (6) 於乙方發生第十五條第一項所列情事時立即以書面通知甲方。

乙方同意甲方得保存因乙方申請成為結算會員及辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務所提供之一切資訊。

五、 結算保證金

乙方同意責成其結算銀行及有價證券保管機構依甲方之要求，提供乙方結算保證金專戶之相關資料，並同意甲方得於乙方不履行集中結算業務之義務時，通知其結算銀行及有價證券保管機構停止乙方提領該專戶之款項及有價證券，並依甲方指示將該專戶款項及有價證券撥至甲方指定之帳戶。

六、 結算會員資格

乙方應持續符合甲方規定之結算會員資格條件，並於發生任何致乙方不再符合或可能不符合結算會員資格條件之情事時，即時以書面通知甲方。

七、 承受契約

乙方有與其他結算會員訂有承受契約者，應於簽訂後五個營業日內，將契約書影本提供甲方。

八、 承受集中結算業務

甲方於其他結算會員有破產、解散、停業或不履行集中結算業務之義務時，有權指定乙方承受該結算會員之集中結算業務，乙方不得拒絕。

九、分擔違約損失

甲方遇違約結算會員繳存之結算保證金不足時，得依期貨交易法、甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告所定支應順序及分擔比例，指定乙方應分擔之金額，乙方不得拒絕。

十、其他配合事項

甲方為辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務或依甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告而有必要時，得要求乙方提供相關資訊或簽署必要之文件，乙方不得拒絕。

十一、不可抗力

甲方對因市場緊急狀況、相關法規之變更、主管機關之命令、電腦系統或通訊傳輸設備中斷或故障、戰爭、罷工、天然災害或人為之事變等不可抗力情事造成乙方受有之損害或損失，不負賠償責任。

十二、受雇人行為

乙方就其受雇人執行店頭衍生性金融商品集中結算業務所為之一切行為，應負完全責任。變更或註銷受雇人時，於辦妥變更或註銷登記前，乙方仍應負完全責任。

十三、違約金

乙方有下列各款情事之一時，甲方得依店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告，對乙方課以違約金：

- (1) 違反法令或不遵行主管機關之行政處分或違反甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告。
- (2) 辦理集中結算業務違背誠實信用，足致他人受損害。
- (3) 於發生第八條所述之情形，而拒絕承受其他結算會員之集中結算業務。
- (4) 違反本契約之規定。

十四、乙方財務因素導致違約之處置

乙方若發生財務因素導致之違約情事，甲方除得依下述第十五條之規定行使權利外，並得依店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告規定進行處置，包含但不限於提前終止乙方帳戶所為之部位。

十五、契約之終止

乙方有下列各款情事之一時，甲方得依店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告，停止或限制乙方集中結算業務，並得對乙方發出終止本契約之書面通知（下稱「提前終止通知」）指定提前終止日（下稱「提前終止日」），終止本契約；甲方提前終止通知送達之日至提前終止日不得少於二十個營業日：

- (1) 經相關主管機關撤銷公司登記或予以解散。
- (2) 經主管機關撤銷營業許可之處分。
- (3) 經法院裁定宣告破產確定。
- (4) 不履行集中結算業務之義務。
- (5) 發生業務或財務狀況顯著惡化，不能支付其債務或有發生違約情事之虞。
- (6) 違反法令或經主管機關本於法令為行政處分仍不遵行者。
- (7) 違反甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告，經甲方認定情節重大者。
- (8) 集中結算業務之行為違背誠實信用，足致他人受損害。
- (9) 未能持續符合甲方結算會員資格條件，經甲方查明限期改善而未辦理或辦理後仍未達標準者。
- (10) 有歇業或停業之情事。
- (11) 違反本契約之規定且經甲方認定情節重大者。

甲方有下列各款情事之一時，乙方得對甲方發出終止本契約之提前終止通知並指定提前終止日，終止本契約；乙方之提前終止通知送達之日至提前終止日不得少於二十個營業日：

- (1) 經相關主管機關撤銷公司登記或予以解散。
- (2) 經主管機關撤銷營業許可之處分。
- (3) 經法院裁定宣告破產確定。
- (4) 有歇業或停業之情事。

除依前兩項終止本契約外，任一方當事人亦得隨時對他方發出終止本契約之提前終止通知並指定提前終止日，終止本契約；提前終止通知送達之日至提前終止日不得少於二十個營業日。

除法令另有規定外，本契約之終止不影響甲、乙各方於提前終止日前已發生或已取得之債權或債務。

十六、契約終止相關事宜

本契約經任一方當事人依前條規定終止者，乙方應於提前終止日前完成下列事項：

- (1) 就其自有結算帳戶部位辦理提前終止或移轉；
- (2) 就個別客戶帳戶之部位辦理提前終止或移轉，並終止與客戶簽訂之客戶結算交割契約；
- (3) 就各帳戶之保證金辦理提領或移轉；
- (4) 完全履行就上述事宜所生之一切交割或付款義務。

本契約經甲方依前條規定終止時，縱乙方未於提前終止日前履行前項規定之一切義務，亦不影響本契約於提前終止日終止之效力，且甲乙雙方依前項規定所生之權利與義務於本契約終止後繼續有效。

本契約經乙方依前條規定終止時，乙方未完成本條第一項所規定事項，不生終止之效力。

十七、通知

本契約項下之通知均應以書面(信件、傳真或電子郵件)，向他方於下列簽章處所載之地址、傳真號碼或電子郵件信箱送達。親送之通知以送交時視為已送達，以預付郵資掛號郵寄之通知於寄送五日後視為已送達，以傳真發送之通知於發送並收到確認訊息時視為已送達，以電子郵件發送之通知於發送並收到確認送達訊息時視為已送達。

任一方當事人變更地址、電話、傳真或電子郵件信箱時，應立即以書面通知他方當事人。如未依約為通知時，不得以其變更對抗他方當事人。

十八、揭露

乙方同意甲方得將乙方相關資訊依甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法或公告之規定，進行揭露。

十九、提供資料予財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心

乙方同意甲方得將其已提交集中結算之部位辦理部位移轉、部位互抵、部位壓縮、違約處理或其他符合甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法或公告使部位變更或提前終止之相關資料，依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心（下稱「櫃買中心」）要求，提供予櫃買中心衍生性金融商品交易資訊儲存庫系統。

二十、提供資料予美國商品期貨交易委員會

乙方提交之交易契約，依美國交換契約資訊申報規定，向美國交換契約資訊儲存機構(Swap Data Repository, SDR)申報者，乙方須告知甲方其所申報之機構，甲方於接受該交易契約提交後，向該機構申報新成立之結算契約及終止之原交易契約，乙方無須重覆申報。

二十一、契約之變更

本契約之變更，應經甲、乙雙方書面同意簽署後始生效力。

二十二、轉讓

本契約或因本契約所生之權利義務，非經甲、乙雙方之書面同意，不得轉讓第三人。

二十三、準據法與管轄

本契約以中華民國法為準據法。本契約如有未盡事宜，悉依中華民國期貨交易法、主管機關頒布之相關法令、及甲方店頭業務規則、相關市場規章及其他甲方規範集中結算業務相關規定、辦法、公告之相關規定辦理。

因本契約或店頭衍生性金融商品集中結算業務所生之爭議，甲乙雙方同意交付中華民國仲裁協會依仲裁法之規定，以仲裁方式解決之。如仲裁人未能作成仲裁判斷時，雙方亦同意以臺灣台北地方法院為第一審管轄法院。

二十四、契約之簽署

本契約乙式參份，由甲、乙雙方及主管機關各執乙份為憑。

立約人：

甲方：臺灣期貨交易所股份有限公司

統一編號：

負責人：

身分證字號：

地址：臺北市羅斯福路二段 100 號十四樓

傳真號碼：

電子郵件信箱：

乙方：_____股份有限公司

統一編號：

負責人：

身分證字號：

地址：

傳真號碼：

電子郵件信箱：

中 華 民 國 年 月 日

[附件 7]店頭集中結算交割作業印鑑卡暨留存印鑑聲明書

店頭集中結算交割作業印鑑卡

結算會員名稱		結算會員代號	
負責人姓名		統一編號	
負責人職務		印鑑啟用日期	
公司電話		印鑑停止使用日期	
業務辦理地址			

印 鑑 式 樣

本公司向貴公司申請辦理店頭集中結算業務，僅此印鑑式樣有效，請存查憑證。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

[留存經濟部印鑑]

中 華 民 國 年 月 日

留存印鑑聲明書

茲聲明本公司留存期交所結算交割作業印鑑卡之印鑑為本公司合法有效之印鑑，凡依貴公司要求須以留存印鑑辦理之事項，均以該印鑑為憑，並視為本公司所為之有效法律行為，本公司願負一切責任，絕無異議。

如本公司所留存之印鑑需註銷或更換時，本公司應立即向貴公司以書面申請，在未經貴公司同意並辦妥註銷或更換手續以前，仍繼續有效，並由本公司負一切責任。

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

公司名稱：

統一編號：

負責人：

註冊地址：

[留存經濟部印鑑]

中 華 民 國 年 月 日

[附件 8]店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約

臺灣期貨交易所股份有限公司
店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線契約

中華民國一百一十一年二月二十五日金融監督管理委員會
金管證期字第一一一〇一三二四六六號函同意照辦
中華民國一百一十一年三月四日臺灣期貨交易所股份有限公司
台期結字第一一一〇三〇〇三一九號函公告

臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱甲方）與_____股份有
限公司（以下簡稱乙方），茲就店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線事
宜，訂定本契約，約定條款如后：

第一條 本契約生效後，乙方得與甲方指定之店頭衍生性金融商品集
中結算系統連線，進行店頭衍生性金融商品集中結算作業。
乙方並應遵守主管機關有關店頭衍生性金融商品集中結算
法令及甲方店頭衍生性金融商品集中結算業務規則、辦法、
公告、通函之規定。

第二條 乙方與甲方電腦連線前，應完成下列準備：
一、應具備有效達成風險控管之電腦軟體或相關設施，並
做成書面內部控制及內部稽核制度。
二、應自行備置與電腦連線有關之作業人員及合格設備，
並依甲方指定之時間及方式完成電腦連線工程與連線
測試作業。

第三條 乙方與甲方電腦連線後，有依甲方連線處理費收費標準按期
繳付連線處理費予甲方之義務。

- 第四條** 乙方連線線路應連接於其店頭衍生性金融商品集中結算電腦主機，並僅供經營店頭衍生性金融商品集中結算業務之目的而使用，乙方不得為其他目的而使用之。
- 第五條** 乙方未經甲方書面同意，不得任意增加或減少電腦連線線路數量或轉讓電腦連線權利或連線線路。
- 第六條** 依本契約為電腦連線後，倘發生資訊傳輸中斷事故，或電腦連線設備因其他原因致無法正常作業者，甲乙雙方應共同查明原因，儘速完成修復。雙方因此所生之損失，彼此不負損害賠償責任。
- 第七條** 甲方為店頭衍生性金融商品集中結算電腦儲存資料之著作權人，對該資料，乙方未得甲方同意，不得出借、出租或出售該資料予第三人。
- 第八條** 乙方未經甲方書面同意，不得將店頭衍生性金融商品集中結算電腦儲存之資料加以修改、增添、擴充、刪減、毀損或為其他一切變更。
- 第九條** 若因天災、地變、罷工、怠工、不可抗力之事件或其他意外事故，致阻礙電腦連線之正常作業者，甲方不負損害賠償責任。
- 第十條** 乙方同意因本契約之履行而知悉甲方業務之資訊、情報或其他相關資料時，應謹守保密義務，不得洩漏予他人，或為其他不利於甲方之行為。
- 第十一條** 於本契約存續期間，乙方有停業情事發生時，乙方仍須依第三條規定繳付費用。否則乙方於復業後，無依本契約請求電腦連線之權利。

第十二條 乙方倘有以下情事之一，甲方得暫停乙方電腦連線之權利或終止本契約。

- 一、違反本契約情節重大者。
- 二、受主管機關撤銷營業許可或命令停業處分。
- 三、違反甲方業務規則、辦法、公告、通函之規定，受甲方停止集中結算業務或終止結算交割契約處分時。
- 四、有影響甲方系統運作之情事。

第十三條 甲方基於事實及法令需要有權修改及更換本契約，乙方不得拒絕。

第十四條 本契約存續期間，乙方得以一個月之前之書面通知甲方，終止本契約。乙方如有解散、終止營業、被合併、破產、重整或清算等情事發生時，甲方得終止本契約。

第十五條 甲乙雙方因本契約所生之爭議，同意依仲裁法之規定進行仲裁。如因仲裁判斷不成立而提起訴訟或撤銷仲裁判斷之訴，甲乙雙方同意以臺灣臺北地方法院為第一審管轄法院。

第十六條 本契約自簽訂日起，發生效力。

第十七條 本契約生效後，乙方向甲方申請店頭衍生性金融商品集中結算電腦連線，經甲方同意後，其相關申請資料均視為本契約之一部。

第十八條 本契約壹式貳份，雙方各執壹份為憑。

立約人

甲 方：臺灣期貨交易所股份有限公司

負責人：

地 址：臺北市羅斯福路二段 100 號十四樓

乙 方：

負 責 人：

地 址：

中 華 民 國 年 月 日

[附件 9]結算會員與本公司店頭結算系統及認可之交易契約提交平台完成連線測試聲明書

結算會員與本公司店頭結算系統及認可之 交易契約提交平台完成連線測試聲明書

_____（以下簡稱本公司）為向臺灣期貨交易所股份有限公司（以下簡稱期交所）申請成為結算會員，以辦理店頭衍生性金融商品集中結算業務，茲聲明如下：

一、本公司自 年 月 日至 年 月 日止與期交所完成店頭結算系統功能連線測試，各功能測試結果正常無誤。

功能項目	測試正常	備註
1. 結算會員及結算帳戶基本資料	<input type="checkbox"/>	
2. 交易提交管理	<input type="checkbox"/>	
3. 部位管理	<input type="checkbox"/>	
4. 擔保品管理	<input type="checkbox"/>	
5. 風險管理	<input type="checkbox"/>	
6. 結算作業	<input type="checkbox"/>	
7. 銀行出入金作業	<input type="checkbox"/>	
8. 交割結算基金管理	<input type="checkbox"/>	
9. 收費及財會帳務	<input type="checkbox"/>	
10. 使用者管理	<input type="checkbox"/>	
11. KCCP 計算作業	<input type="checkbox"/>	

二、本公司自 年 月 日至 年 月 日止與期交所指定交易契約提交平台完成連線測試，測試結果正常無誤。

交易契約提交平台名稱	測試正常	備註
財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心 衍生性金融商品交易資訊儲存庫系統	<input type="checkbox"/>	
MarkitSERV	<input type="checkbox"/>	

此致

臺灣期貨交易所股份有限公司

公司名稱：

統一編號：

負責人：

註冊地址：

測試負責人：

[留存經濟部印鑑]

中 華 民 國 年 月 日

[附件 10] 店頭衍生性金融商品集中結算業務會計處理範例

店頭衍生性金融商品集中結算建議會計處理			參考文件： 期貨自營商業務會計處理範本		參考文件： ISDA 範本	
交易事項	結算會員		交易事項	結算會員期貨商	CTM 帳戶	STM 帳戶
	CTM 帳戶	STM 帳戶				
1. 繳交交割結算基金 結算會員將交割結算基金交予結算機構	借：其他資產－店頭交割結算基金 貸：現金及約當現金(或)銀行存款		1. 期貨商繳交交割結算基金 將交割結算基金交予結算機構	借：交割結算基金 貸：銀行存款		
2. 繳存原始保證金或額外保證金 (1) 結算會員將原始保證金或額外保證金轉入結算銀行專戶	借：現金及約當現金(或)銀行存款(結算銀行店頭自有結算保證金專戶) 貸：現金及約當現金(或)銀行存款(其他自有資金－帳戶)	借：現金及約當現金(或)銀行存款(結算銀行店頭自有保證金專戶) 貸：現金及約當現金(或)銀行存款(其他自有資金－帳戶)	2. 買入期貨繳交交易保證金 (1) 結算會員：轉入自營保證金專戶	借：銀行存款(自營保證金) 貸：銀行存款(其他自有資金－帳戶)		
(2) 結算會員將原始保證金或額外保證金交予結算機構	借：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金 貸：現金及約當現金(或)銀行存款(結算銀行店頭自有結算保證金專戶)	借：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金 貸：現金及約當現金(或)銀行存款(結算銀行店頭自有保證金專戶)	(2) 保證金交予結算機構	借：期貨交易保證金－自有資金 貸：銀行存款(自營保證金)		

店頭衍生性金融商品集中結算建議會計處理			參考文件： 期貨自營商業務會計處理範本		參考文件： ISDA 範本	
交易事項	結算會員		交易事項	結算會員期貨商	CTM 帳戶	STM 帳戶
	CTM 帳戶	STM 帳戶				
3.認列每日變動保證金及洗價損益 (1)評價損益為利得	借：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債) 貸：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)評價損益 (本評價分錄於次月初迴轉)	借：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債) 貸：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)處分損益	3.認列當日未平倉損益—非避險目的 (1)利得：	借：期貨交易保證金—自有資金 貸：期貨契約利益—非避險未實現 (本評價分錄於次月初迴轉)	借： Derivative asset 貸： Trading P&L	借： Derivative asset 貸： Trading P&L
(2)每日洗價為利得，保證金權益增加	借：其他資產—存出保證金—店頭結算保證金—自有資金 貸：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)評價調整—集中交易對手保證金	借：其他資產—存出保證金—店頭結算保證金—自有資金 貸：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)			借： Cash 貸： Payable Due to CCP	借： Cash 貸： Derivative asset

店頭衍生性金融商品集中結算建議會計處理			參考文件： 期貨自營商業務會計處理範本		參考文件： ISDA 範本	
交易事項	結算會員		交易事項	結算會員期貨商	CTM 帳戶	STM 帳戶
	CTM 帳戶	STM 帳戶				
(3) 評價損益為損失	借：透過損益按公允價值衡量之金融負債(資產)評價損益 貸：透過損益按公允價值衡量之金融負債(資產) (本評價分錄於次月初迴轉)	借：透過損益按公允價值衡量之金融負債(資產)處分損益 貸：透過損益按公允價值衡量之金融負債(資產)	(2) 損失：	借：期貨契約損失—非避險未實現 貸：期貨交易保證金—自有資金 (本評價分錄於次月初迴轉)	註	註
(4) 每日洗價為損失，保證金權益減少	借：透過損益按公允價值衡量之金融負債(資產)評價調整—集中交易對手保證金 貸：其他資產—存出保證金—店頭結算保證金—自有資金	借：透過損益按公允價值衡量之金融負債(資產) 貸：其他資產—存出保證金—店頭結算保證金—自有資金				

註：ISDA 僅提供評價損益為利得時之範例。

店頭衍生性金融商品集中結算建議會計處理			參考文件： 期貨自營商業務會計處理範本		參考文件： ISDA 範本	
交易事項	結算會員		交易事項	結算會員期貨商	CTM 帳戶	STM 帳戶
	CTM 帳戶	STM 帳戶				
4. 認列處分損益－ IRS 為例 (1) 利息交換(若淨額交割為支付方) (2) 利息交換(若淨額交割為收取方)	借：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)處分損益 貸：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)評價調整－集中交易對手保證金	同第3項認列每日洗價損益會計處理。	4. 認列當日平倉損益－非避險目的 (1) 利得： (2) 損失：	借：期貨交易保證金－自有資金 貸：期貨契約利益－非避險已實現 借：期貨契約損失－非避險已實現 貸：期貨交易保證金－自有資金		

店頭衍生性金融商品集中結算建議會計處理			參考文件： 期貨自營商業務會計處理範本		參考文件： ISDA 範本	
交易事項	結算會員		交易事項	結算會員期貨商	CTM 帳戶	STM 帳戶
	CTM 帳戶	STM 帳戶				
5. PAI(價格校正利息) / PAA(價格校正金額) 金額入帳 (1) PAI/PAA(支付方)	借：利息費用 貸：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金	借：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)處分損益 貸：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金	/	/	借：Interest expense(PAI) 貸：Cash	借：Trading P&L 貸：Cash
(2) PAI/PAA(收取方)	借：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金 貸：利息收入	借：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金 貸：透過損益按公允價值衡量之金融資產(負債)處分損益				
6. 認列結算交割服務費	借：結算交割服務費支出 貸：現金及約當現金(或)銀行存款(或)應付帳款		5. 認列期貨交易之結算交割服務費	借：結算交割服務費支出－期貨 貸：銀行存款(自營保證金)(或)應付帳款		

店頭衍生性金融商品集中結算建議會計處理			參考文件： 期貨自營商業務會計處理範本		參考文件： ISDA 範本	
交易事項	結算會員		交易事項	結算會員期貨商	CTM 帳戶	STM 帳戶
	CTM 帳戶	STM 帳戶				
7.向結算機構申請提領超額保證金	借：現金及約當現金 (或)銀行存款 貸：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金	借：現金及約當現金 (或)銀行存款 貸：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金	6.向結算會員／期貨商結算機構申請提領超額保證金	借：銀行存款(自營保證金) 貸：期貨交易保證金－自有資金	/	
8.向結算機構補足保證金	借：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金 貸：現金及約當現金 (或)銀行存款	借：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金 貸：現金及約當現金 (或)銀行存款	7.向結算機構補足保證金	借：期貨交易保證金－自有資金 貸：銀行存款(自營保證金)		
9.超額保證金轉列銀行存款	借：現金及約當現金 (或)銀行存款 貸：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金	借：現金及約當現金 (或)銀行存款 貸：其他資產－存出保證金－店頭結算保證金－自有資金	8.期貨交易保證金中屬超額保證金轉列銀行存款	借：銀行存款 貸：期貨交易保證金－自有資金		