

測試劇本				
項目	梯次	日期	測試內容	證券市場盤後資訊異常
第1梯	6/1 (一)		本梯次測試首日，使用5/29實際可交易商品，人民幣匯率期貨上市(201506、201507、201509、201512、201603、201606契約)；結算系統各商品前日部位餘額、權益數及存券資料以5/29結帳後正式作業資料為基準	
	6/2 (二)		結算系統日常作業測試: 第1盤部位異動截止作業(15:45)並於15:55第1盤開放部位異動，於16:00第1盤部位異動截止；第2盤部位異動截止作業(16:30)並於16:40第2盤開放部位異動，於16:45第2盤部位異動截止，於16:50結帳	
	6/3 (三)		6月TX1及MX1最後交易日，6月人民幣匯率期貨(RHF及RTF)最後交易日	16:00公布6月TX1及MX1最後結算價，到期交割作業順延30分鐘
	6/4 (四)		1.本日公告調整RHF及RTF保證金，並自6/5盤後生效(詳附件_測試用保證金資料)。 2.ETF權益數加減項名冊延至17:30開放查詢	
	6/5 (五)		測試結算系統日常作業測試: 第1盤部位異動截止作業(15:45)並於15:55開放部位異動，於16:00第1盤部位異動截止；第2盤部位異動截止作業(16:30)並於16:40第2盤開放部位異動，於16:45第2盤部位異動截止，於16:50結帳	
	6/8 (一)			
	6/9 (二)		6月TX2及MX2最後交易日	17:00電文通知6月TX2及MX2最後結算價延後至下一營業日
	6/10 (三)		6月股價指數期貨及選擇權最後交易日、6月股票期貨及選擇權最後交易日、6月公債期貨最後交易日、7月人民幣匯率期貨(RTF)最後交易日	1.9:15(盤前，正式8:00)公布6月TX2及MX2最後結算價，到期交割作業順延30分鐘 2.17:00(所有商品部位結帳後)公布6月OCF、NSF、GTF及GTO最後結算價，到期交割作業順延30分鐘
	6/11 (四)		6月黃金期貨及選擇權最後交易日 7月人民幣匯率期貨(RHF)最後交易日	
	6/12 (五)		6月黃金期貨及選擇權最後結算日 6月公債期貨交割日 6月TX4及MX4最後交易日 14:00期貨選擇權暫停交易，15:30恢復交易，15:45重新開盤	
第2梯	6/15 (一)		本梯次測試首日，使用6/12實際可交易商品，人民幣匯率期貨上市(201506、201507、201509、201512、201603、201606契約)；結算系統各商品前日部位餘額、權益數及存券資料以6/12結帳後正式作業資料為基準	
	6/16 (二)		本日公告調整TX、MTX及OBF保證金，並自6/17盤後生效(詳附件_測試用保證金資料)。	
	6/17 (三)		6月股價指數期貨及選擇權最後交易日、6月股票期貨及選擇權最後交易日、6月人民幣匯率期貨(RTF)最後交易日	1.15:30(第一盤結帳前)公布6月OCF、TE、TEO最後結算價，到期交割作業正常執行 2.16:10(第二盤結帳前)公布6月OBF、TF、TFO最後結算價，到期交割作業順延30分鐘 3.17:00(第二盤結帳後)公布6月T5F、CBF、CBO最後結算價，到期交割作業順延30分鐘 4.17:00電文通知6月XIF、XIO、CAF、CAO、TXF、MXF、TXO最後結算價延後至下一營業日公布
	6/18 (四)		6月TX4及MX4最後交易日	10:10(開盤後，正式8:55)公布6月XIF、XIO、CAF、CAO、TXF、MXF、TXO最後結算價，到期交割作業順延30分鐘
	6/19 (五)		端午節補假	
	6/22 (一)		9月公債期貨最後交易日 6月人民幣匯率期貨(RHF)最後交易日	
	6/23 (二)		模擬封關後次一營業日，僅交易人民幣匯率期貨(RHF及RTF)	
	6/24 (三)		1.模擬當日颱風假 2.原訂下列到期交割契約順延至次一營業日： 9月公債期貨交割日、7月TX1及MX1最後交易日、6月黃金期貨及選擇權最後交易日、7月人民幣匯率期貨(RHF及RTF)最後交易日	
	6/25 (四)		1.本日為香港財資市場公會休假日 2.9月公債期貨交割日、7月TX1及MX1最後交易日、6月黃金期貨及選擇權最後交易日、7月人民幣匯率期貨(RTF)最後交	
	6/26 (五)		1.6月黃金期貨及選擇權最後結算日 2.7月人民幣匯率期貨(RHF)最後交易日 3.14:00期貨選擇權暫停交易，15:30恢復交易，15:45重新開盤最後交易日	

測試劇本				
項目	梯次	日期	測試內容	證券市場盤後資訊異常
第3梯		6/29 (一)	本梯次測試首日，使用6/26實際可交易商品，人民幣匯率期貨上市(201507、201508、201509、201512、201603、201606契約)；結算系統各商品前日部位餘額、權益數及存券資料以6/26結帳後正式作業資料為基準	
		6/30 (二)		
		7/1 (三)	7月TX1及MX1最後交易日	16:00公布7月TX1及MX1最後結算價，到期交割作業順延30
		7/2 (四)	模擬封關後次一營業日，僅交易人民幣匯率期貨(RHF及RTF) 7月人民幣匯率期貨(RHF及RTF)最後交易日	
		7/3 (五)		
		7/6 (一)		
		7/7 (二)	9月公債期貨最後交易日	
		7/8 (三)	7月TX2及MX2最後交易日，8月人民幣匯率期貨(RTF)最後交易日	17:00電文通知7月TX2及MX2最後結算價延後至下一營業日公布
		7/9 (四)	9月公債期貨交割日 8月人民幣匯率期貨(RHF)最後交易日 本日公告調整TEO保證金，並自7/10盤後生效(詳附件_測試用保證金資料)。	9:15(盤前，正式8:00)公布7月TX2及MX2最後結算價，到期交割作業順延30分鐘
		7/10 (五)	本日公告調整OCF保證金，並自7/13盤後生效(詳附件_測試用保證金資料)。	
		7/13 (一)		
		7/14 (二)	8月黃金期貨及選擇權最後交易日	
		7/15 (三)	8月黃金期貨及選擇權最後結算日 7月股價指數期貨及選擇權最後交易日、7月股票期貨及選擇權最後交易日、9月人民幣匯率期貨(RHF及RTF)最後交易日	1.15:30 公布7月TX、TXO、CAF、CAO最後結算價，到期交割作業正常執行 2.17:00公布7月OCF、NSF、GTF及GTO最後結算價，到期交割作業順延30分鐘
		7/16 (四)		
		7/17 (五)	14:00期貨選擇權暫停交易，15:30恢復交易，15:45重新開盤	
假日測試	第1梯	7/4 (六)	T日(7/6)：人民幣匯率期貨(201507、201508、201509、201512、201603、201606契約)、上證50ETF期貨與選擇權(OJF與OJO)(201507、201508、201509、201512、201603契約)上市，7月股價指數期貨及選擇權最後交易日、7月股票期貨及選擇權最後交易日、7月人民幣匯率期貨最後交易日、8月黃金期貨及選擇權最後交易日；股票期貨暨選擇權契約調整依7/6正式系統狀況為準；結算系統各商品前日部位餘額、權益數及存券資料以7/3結帳後正式作業資料為基準 T+1日(7/7)	10:30(除人民幣匯率期貨、陸股ETF期貨外所有商品部位異動截止後)公布7月OCF、CCF、CCO、TE及TEO最後結算價，到期交割作業順延30分鐘
	第2梯	7/18 (六)	模擬7/20(一)上線，人民幣匯率期貨上市(201508、201509、201512、201603、201606、201609契約)，所有商品皆不到期；股票期貨暨選擇權契約調整依7/20正式系統狀況為準；本日無結算作業	

備註：遇最後結算價延後公告(公告時點為T)，到期交割作業順延至T+30(買方履約參考名冊刪除作業至T+30止；T+30後可查詢賣方履約指派