

櫃買中心 TR系統
衍生性金融商品
交易資料傳輸集中結算機構服務



簡報大綱

- 透過TR傳輸CCP的優點
- TR與CCP申報流程
- TR與CCP申報方式
- TR與CCP申報格式
- TR傳輸CCP測試作業

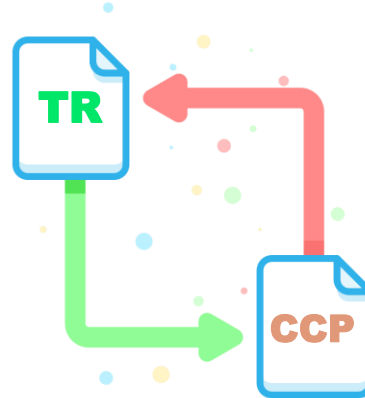


透過TR傳輸CCP的優點 (1/2)



不需轉換作業環境

與TR使用相同系統
不需切換不同作業環境



不需變更申報方式

與TR申報方式相近
不需適應新的申報方式



一站式作業

可同時完成TR交易申報與
CCP傳送作業



透過TR傳輸CCP的優點 (2/2)



網頁式作業平台

不限於單一主機
各電腦均可完成作業



安全性高

TR受主管機關及法令規管
採憑證與帳密方式登入
資訊安全性高

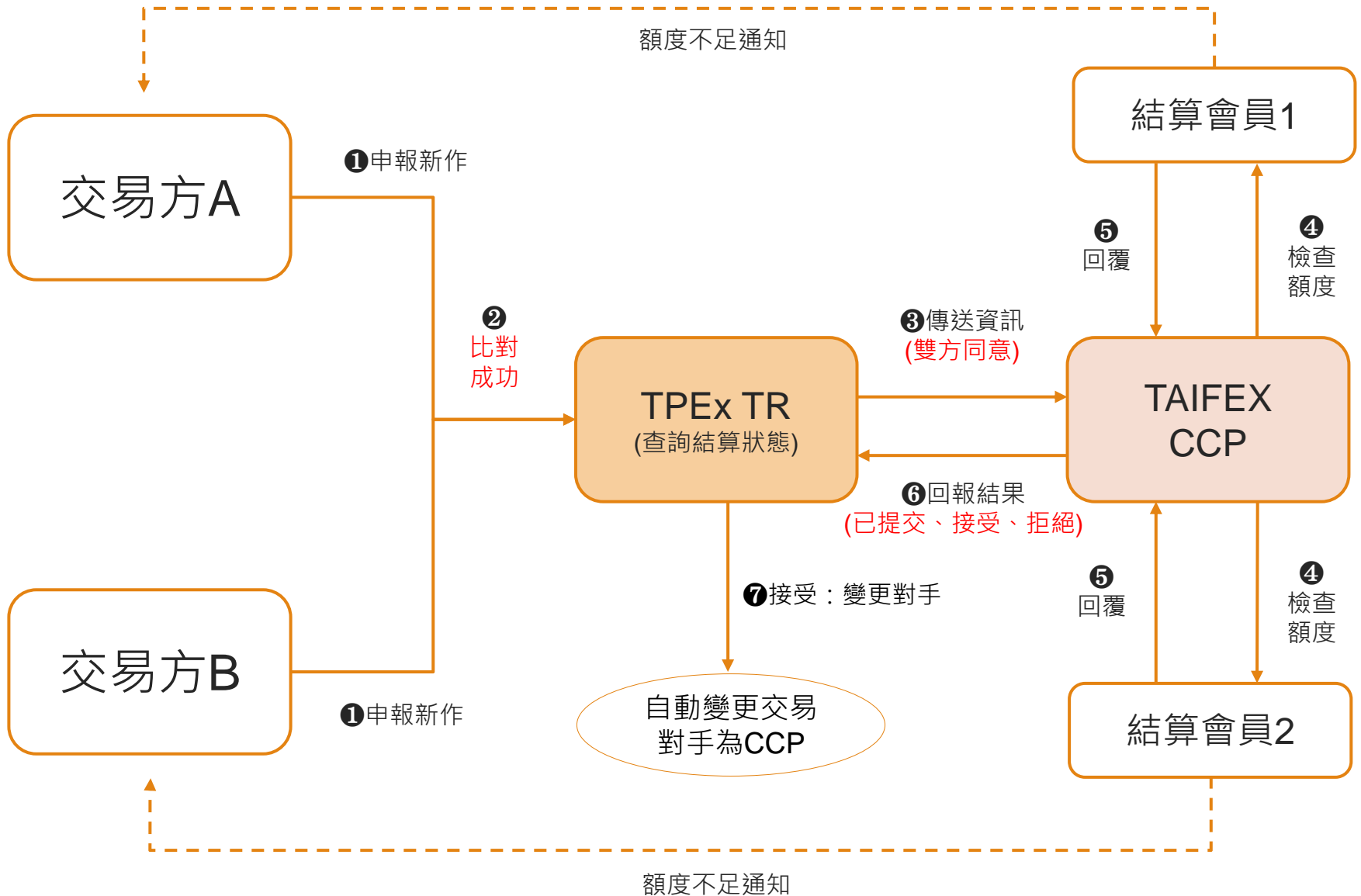


收費合理

以服務金融機構為出發
費用低廉合理



TR與CCP申報流程 (1/6)



➤ 新增IRS_CCP申報格式

IRS_CCP格式是依IRS格式作欄位增修，
增加欄位均置於原IRS格式欄位之後，以利申報機構
製作IRS_CCP申報傳輸檔案。

| 利率交換(IRS) |
|----------------------|
| 調整部分欄位內容 (欄位1~39) |

| 利率交換_集中結算(IRS_CCP) |
|-------------------------|
| 調整部分欄位內容 (欄位1~39) |
| 新增 CCP資訊欄位 (欄位40~57) |



【IRS_CCP】TR申報頁籤

TR 衍生性商品資料儲存庫

儲存庫申報(TR)

其他資訊申報

境外衍生性商品資訊諮詢服務

提前了結

資料維護

TR申報

傳輸CCP

【IRS_CCP】利率交換

- 交易申報
- [FXD] 外匯遠期、交換
- [FXO] 外匯選擇權
- [FXOZ] 非陽春外匯選擇權
- 【IRS_CCP】利率交換_集中結算**
- [IRS1] 利率交換
- [IRS2] 利率交換2
- [SP] 結構型商品
- [OSP] 境外結構型商品
- [TED] 台股股權衍生性商品
- [SWPT] 利率交換選擇權
- [IRO] 利率選擇權
- [CDS] 信用違約交換
- [FED] 國外股權衍生性商品
- [CMS] 商品交換
- [CMO] 商品選擇權
- 週/月資料申報
- 資料異動申報
- 實物交割申報
- 免比對交易確認
- 客訴申報
- [TRRD] TR報表下載
- [CBOQTA] CBASO交易額度查詢/預定

商品類別

1=利率交換(IRS)

交易對手名稱

臺灣土地銀行

期初收付幣別

AED

利息交割方式

1=Net Payment

固定利率

固定利率(%)

1.0000

浮動利率指標(1)

利率指標

1

利率指標天期

1M=1個月

付息周期

1M=1個月

利率指標重設周期

1M=1個月

利率加減碼(%)

2.0000

計息天數

1=Actual/365

浮動利率指標(2)

利率指標

2

利率指標天期

1M=1個月

付息周期

1M=1個月

利率指標重設周期

1M=1個月

利率加減碼(%)

1.0000

計息天數

1=Actual/365

交易對手資訊

交易對手身分別

1=一般客戶

交易對手承作目的

1=避險

修改 刪除 匯入檔案 匯出 清畫面 申報

| 機構交易商類別 | 交易發生單位 | 交易對手類別 | 交易對手代號 |
|------------------|---------------|------------------|----------|
| 交易商 | 2=OBU/OSU/OIU | 1=國內金融機構 | 0050000 |
| 動機 | 交易日 | 生效日 | 到期日 |
| click-to-Back 避險 | 20201126 | 20201126 | 20201126 |
| 本金幣別 | 名目本金金額 | 利息收付方向 | 營業日原則 |
| | 50000.00 | 1=收浮動利率(1)·付固定利率 | 1=Actual |
| 付息周期 | | 計息天數 | |
| 2M=2個月 | | 2=Actual/Actual | |



【IRS_CCP】TR申報頁籤

| | | | |
|---------------------|---------------------------------|------------------------------|-------------------|
| CCP資訊 | | | |
| 已完交易加認並同意TR傳送交易至CCP | | 結算會員 | |
| -- 請選擇 -- | | | |
| 期初收付款日 | 浮動利率定價日 | 浮動利率端定價日之金融中心 | 浮動利率端支付日之金融中心 |
| 20201127 | -- 請選擇 -- | | |
| Roll Convention | Rolls on specific day | Broker | Break |
| | | -- 請選擇 -- | |
| 畸零天期位置(前端、後端) | First Regular Period Start Date | Last Regular Period End Date | Initial Stub Rate |
| -- 請選擇 -- | 20201127 | 20201127 | |
| Stub Index Tenor 1 | Stub Index Tenor 2 | Payment Lag (Days) | 結算帳戶ID |
| -- 請選擇 -- | -- 請選擇 -- | | |

| 申報狀態 | 比對狀態/錯誤說明 | 狀態代碼 | 商品類別 | 資料序號 | 申報機構代號 | 申報機構交易商類別 | 交易發生單位 | 交易對手類別 | 交易對手名稱 | 交易對手代號 | 交易對手LEI | 交易動機 | 交易日 | 生效日 |
|---|-----------|------|------|------|--------|-----------|--------|--------|--------|--------|---------|------|-----|-----|
| <div style="text-align: center;"> < ▶ </div> | | | | | | | | | | | | | | |

| 申報狀態 | 比對狀態/錯誤說明 | 狀態代碼 | 商品類別 | 資料序號 | 申報機構代號 | 申報機構交易商類別 | 交易發生單位 | 交易對手類別 | 交易對手名稱 | 交易對手代號 | 交易對手LEI | 交易動機 | 交易日 | 生效日 | 到期日 | 期初收付幣別 | 期初收付金額 | 名目本金幣別 |
|------|-----------|------|------|------|--------|-----------|--------|--------|--------|--------|---------|------|-----|-----|-----|--------|--------|--------|
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |



【IRS_CCP】 傳輸CCP頁籤

TR 衍生性商品資料儲存庫 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護

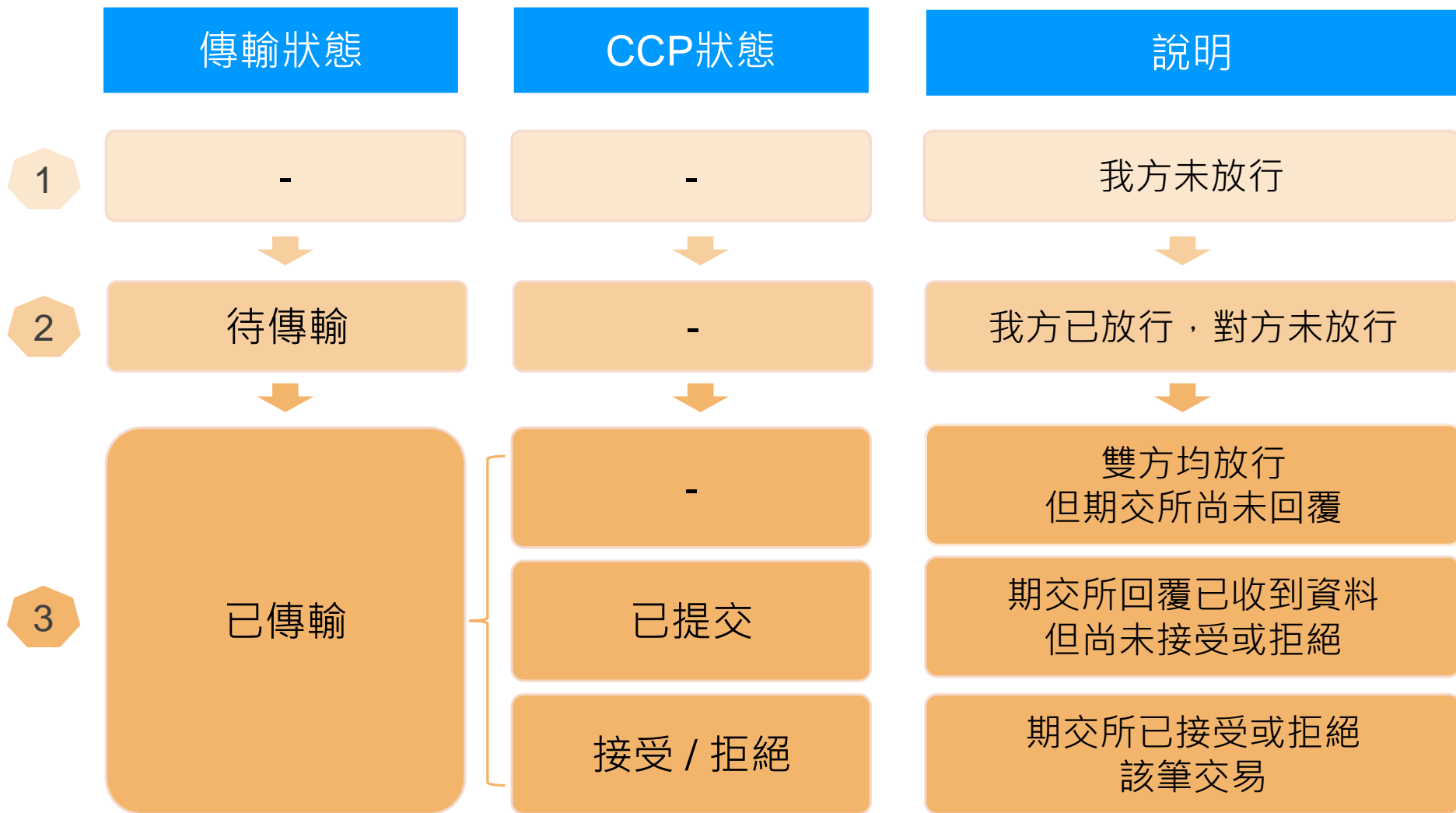
TR申報 傳輸CCP

放行 取消放行

| 全選 | 執行選項 | 資料序號 | TR資料狀態 | 傳輸狀態 | CCP序號 | CCP狀態 | CCP訊息 |
|--------------------------|---------|------------|--------|------|---------|-------|---------|
| <input type="checkbox"/> | 放行 取消放行 | IRS0000001 | 申報成功 | - | | - | |
| <input type="checkbox"/> | 放行 取消放行 | IRS0000002 | 申報成功 | 待傳輸 | | - | |
| <input type="checkbox"/> | 放行 取消放行 | IRS0000003 | 申報成功 | 已傳輸 | | - | |
| <input type="checkbox"/> | 放行 取消放行 | IRS0000004 | 申報成功 | 已傳輸 | | 已提交 | |
| <input type="checkbox"/> | 放行 取消放行 | IRS0000005 | 申報成功 | 已傳輸 | CCP0001 | 接受 | |
| <input type="checkbox"/> | 放行 取消放行 | IRS0000006 | 申報成功 | 已傳輸 | | 拒絕 | 保證金檢核不足 |



TR與CCP申報流程 (6/6)



TR與CCP申報方式 (1/2)

- IRS_CCP與IRS格式將**並行(擇一)**使用。
- 全部交易均無需傳送CCP
 - 1) 依現行**利率交換(IRS)**格式及申報方式，完成TR申報。
 - 2) 應於T+1下午5:00前完成TR申報。



TR與CCP申報方式 (2/2)

□ 部分或全部交易需傳送CCP

- 1) 不需先行區分交易是否需傳送CCP，可一併使用IRS_CCP進行TR申報及傳輸CCP作業。
- 2) 應依期交所及本中心規定之時限申報TR及傳送CCP。

□ 舉例：

當天共計承作10筆IRS交易，其中有2筆要送CCP，另外8筆不需送CCP，則此10筆交易可以全部使用IRS_CCP格式申報，不需拆分不同格式申報。



IRS & IRS_CCP 調整部分欄位 (1/4)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|--------|------|---|--|----|
| 6 | 交易對手類別 | X(1) | 1：國內金融機構（限銀行、票 券、證券、保險、期貨） 2：國內政府機構(含政府基金) 3：國內其他法人 4：國內個人 5：國外金融機構 6：國外法人、個人 7：國內金融機構海外分公司 8：去識別化-對手未同意 9：去識別化-當地國法令 C：CCP | 1.交易對手為國內金融機構OBU請填報「國內金融機構」 2.交易對手為OBU客戶請填報「國外法人、個人」 3.交易對手為信託業請填報「國內其他法人」 4.交易對手為中央銀行請填報「國內政府機構(含政府基金)」 5.交易對手為FINI/Non FINI請填報「國外法人、個人」 6.若海外分行已盡力尋求交易對手出具書面同意書仍未獲交易對手同意，請填報8：去識別化-對手未同意 7.若海外分行依當地國法規於取得交易對手同意後仍不得申報者，請填報9：去識別化-當地國法令 8.若交易對手為CCP(集中交易對手)請填報C:CCP (原始交易對手為國內金融機構者，或CCP為臺灣期貨交易所者，不得直接申報交易對手為CCP，應先行申報原始交易對手後再變更為CCP) | Y |



IRS & IRS_CCP 調整部分欄位 (2/4)

交易對手為CCP之申報方式：

1) 原始交易對手為「國內金融機構」者

一律需先申報原始交易對手(類別1)，再透過EVENT異動交易對手為CCP(類別C)，透過TR傳送至CCP者，TR可自動變更交易對手為CCP。

2) 原始交易對手「非國內金融機構」者

- 若CCP為「臺灣期貨交易所」，應先申報原始交易對手，再透過EVENT異動交易對手為CCP(類別C)。
- 其他CCP，得直接申報交易對手類別為C。



IRS & IRS_CCP 調整部分欄位 (3/4)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|------|--------|-----------------------|----|----|
| 23 | 計息天數 | X(1) | 1 : Actual/365 | | Y |
| | | | 2 : Actual/Actual | | |
| | | | 3 : Actual/365(Fixed) | | |
| 29 | 計息天數 | | 4 : Actual/360 | | |
| | | | 5 : 30/360 | | |
| | | | 6 : 360/360 | | |
| | | | 7 : Bond Basis | | |
| 36 | 計息天數 | | 8 : 30E/360 | | |
| | | | 9 : 30E/360(ISDA) | | |
| | | Z : 其他 | | | |

30E/360 :

$$= \{[360*(Y2-Y1)]+[30*(M2-M1)]+(D2-D1)\}/360$$

- If D1 is 31, then change D1 to 30.
- If D2 is 31, then change D2 to 30.

30E/360 (ISDA) :

$$= \{[360*(Y2-Y1)]+[30*(M2-M1)]+(D2-D1)\}/360$$

- If D1 is the last day of the month, then change D1 to 30.
- If D2 is the last day of the month (unless Date2 is the maturity date and M2 is February), then change D2 to 30.



IRS & IRS_CCP 調整部分欄位 (4/4)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|------|-------|----------------------------|------------------------------|----|
| 24 | 利率指標 | X(12) | 請依本中心編製「標的資產明細」之貨幣市場利率代號填入 | 參照【表D】「標的資產明細代號表」，例如 TAIBOR。 | Y |

【表D】標的資產明細代號表

| | |
|--------|-----------|
| 貨幣市場利率 | TWCPBA |
| | TAIBOR |
| | TAIBIR |
| | USD LIBOR |
| | EUR LIBOR |
| | GBP LIBOR |
| | JPY LIBOR |
| | HIBOR |
| | BBSW |
| | SOFR |
| | SONIA |
| | ESTR |
| | SARON |
| | TONA |
| OTHERS | |

若為其他連結標的請依市場慣例填報（例如：ISIN CODE、Bloomberg代碼、Reuters代碼等）



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (1/9)



| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 | |
|----|--------------------------|------|--------------|---|-------------------------------|---|
| 40 | 已完成交易確認 並同意TR傳送交易至CCP | X(1) | 1：傳送至臺灣期貨交易所 | 表示已完成交易確認及同意透過TR傳送交易至CCP。 本欄填1者，請續填第41~57欄位資訊。 【檢核】僅「商品類別」為1者可填報本欄。 | Y | |
| | | | Z：不傳送 | | | |
| 41 | 結算會員 | X(7) | 依「結算會員代碼表」輸入 | 參考CCP所提供之結算會員代碼列表。 (待期交所提供相關資料，本次測試請先以「CM0000」代號輸入本欄位測試) | | |
| 42 | 期初收付款日 | 年 | 9(4) | 西元年 | 先期費(upfront fee)收付款日，如無，本欄免填。 | Y |
| | | 月 | 9(2) | 月 | | |
| | | 日 | 9(2) | 日 | | |



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (2/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|---------------|-------|---------------------------------------|--|----|
| 43 | 浮動利率定價日 | X(1) | 各計息週期開始前N個營業日 (N=0~5) 各計息週期開始當日請填0 | 依臺灣期貨交易所公告之集中結算商品規格，「浮動利率定價日」為「各計息週期開始前N個營業日」。 | Y |
| 44 | 浮動利率端定價日之金融中心 | X(10) | 依「金融中心代號一覽表」輸入 | 參照下方「金融中心代號一覽表」。 | Y |
| 45 | 浮動利率端支付日之金融中心 | X(10) | 依「金融中心代號一覽表」輸入 | 參照下方「金融中心代號一覽表」。 | Y |

| 「金融中心代號一覽表」 | |
|-------------|--------------------------|
| 金融中心代號 | 金融中心 |
| TWTA | Taipei, Taiwan |
| USNY | New York, United States |
| CNBE | Beijing, China |
| KRSE | Seoul, Republic of Korea |



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (3/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|-----------------------|------|------------|---|----|
| 46 | Roll Convention | X(1) | 1 : 1-30 | Roll convention determines the reset date of the swap. 1 : "1-30" - Rolls on the specific day of the month. 2 : "EOM" - The 'EOM' roll convention which adjusts the date to the end of the month . The input date will be adjusted ensure it is the last valid day of the month. The year and month of the result date will be the same as the input date. 3 : "IMM" - IMM always refers to the third Wednesday of the Mar, June, Sept, Dec months | Y |
| | | | 2 : EOM | | |
| | | | 3 : IMM | | |
| 47 | Rolls on specific day | X(2) | 填寫重設日為當月幾日 | Rolls on the specific day of the month. 【檢核】「Roll Convention」填1者，本欄必填。 | Y |



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (4/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|--------|------|------------------|-----------------------|----|
| 48 | Broker | X(1) | 0：無 | 經紀商 | |
| | | | 1：台北外匯 | | |
| | | | 2：元太外匯 | | |
| | | | 3：BGC | | |
| | | | 4：GFI | | |
| | | | 5：NITTAN CAPITAL | | |
| | | | 6：PY | | |
| | | | 7：TPICAP | | |
| 49 | Break | X(1) | 1：Y | 提前解約條款 (break clause) | Y |
| | | | 2：N | | |

依期交所目前之規畫，**Break=Y或N**之交易均可集中結算，
惟經集中結算後，該筆交易之提前解約條款即失效。
(參考期交所店頭衍生性金融商品集中結算業務規則§29)



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (5/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|-----------------------------|-------------------|------|-------------------------------|---|----|
| 50 | 畸零天期位置 (前端、後端) | X(1) | 0 : None | 1 : "ShortInitial" - If there is a non regular period remaining it is left shorter than the streams calculation period frequency and placed at the start of the stream 2 : "LongInitial" - If there is a non regular period remaining it is placed at the start of the stream and combined with the adjacent calculation period to give a long first calculation period 3 : "ShortFinal" - If there is a non regular period remaining it is left shorter than the streams calculation period frequency and placed at the end of the stream 4 : "LongFinal" - If there is a non regular period remaining it is placed at the end of the stream and combined with the adjacent calculation period to give a long last calculation period | Y |
| | | | 1 : ShortInitial | | |
| | | | 2 : LongInitial | | |
| | | | 3 : ShortFinal | | |
| | | | 4 : LongFinal | | |
| | | | 5 : ShortInitial & ShortFinal | | |
| | | | 6 : ShortInitial & LongFinal | | |
| | | | 7 : LongInitial & ShortFinal | | |
| 8 : LongInitial & LongFinal | | | | | |

依期交所目前之規畫，僅集中結算畸零天期位置=0、1、2、3、4之交易。



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (6/9)

畸零天期位置：

假設IRS交易契約期間共14個月(正常計息區間為3個月)，
依計息區間切分方式填報畸零天期位置：

| 計息區間切分方式 | 畸零天期位置 |
|-----------------------------|--------------|
| <u>2個月</u> +3個月+3個月+3個月+3個月 | ShortInitial |
| <u>5個月</u> +3個月+3個月+3個月 | LongInitial |
| 3個月+3個月+3個月+3個月+ <u>2個月</u> | ShortFinal |
| 3個月+3個月+3個月+ <u>5個月</u> | LongFinal |



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (7/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 | |
|----|---------------------------------|----|------|-----|---|---|
| 51 | First Regular Period Start Date | 年 | 9(4) | 西元年 | The start date of the regular part of the calculation period schedule. It must only be specified if there is an initial stub calculation period. This day may be subject to adjustment in accordance with any adjustments specified in calculationPeriodDatesAdjustments. | Y |
| | | 月 | 9(2) | 月 | | |
| | | 日 | 9(2) | 日 | | |
| 52 | Last Regular Period End Date | 年 | 9(4) | 西元年 | The end date of the regular part of the calculation period schedule. It must only be specified if there is a final stub calculation period. This day may be subject to adjustment in accordance with any adjustments specified in calculationPeriodDatesAdjustments. | Y |
| | | 月 | 9(2) | 月 | | |
| | | 日 | 9(2) | 日 | | |

無論交易是否有畸零天期，此兩欄位必填。



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (8/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|--------------------|------------|--------|---|----|
| 53 | Initial Stub Rate | S9(3)V9(4) | 單位：% | 【檢核】填寫本欄者，無須填報「Stub Index Tenor 1」及「Stub Index Tenor 2」，未填寫本欄者，則須同時填寫「Stub Index Tenor 1」及「Stub Index Tenor 2」。 | Y |
| 54 | Stub Index Tenor 1 | X(2) | 1W：1週 | 1. 採線性內插法計算Stub Rate者，請填報本欄。 2. Stub Index Tenor 1代表 Initial Stub Rate Index 1 or Final Stub Rate Index 1；Stub Index Tenor 2代表 Initial Stub Rate Index 2 or Final Stub Rate Index 2 (視畸零天期位置為前端或後端而定)。 3. 利率依中華民國銀行公會金融業拆款中心台北金融業拆款定盤利率 TAIBOR 公布數據為準。 | Y |
| | | | 2W：2週 | | |
| | | | 1M：1個月 | | |
| | | | 2M：2個月 | | |
| 55 | Stub Index Tenor 2 | X(2) | 1W：1週 | 【檢核】填寫「Initial Stub Rate」即不需填寫本欄，未填寫「Initial Stub Rate」則須同時填寫「Stub Index Tenor 1」及「Stub Index Tenor 2」。 | Y |
| | | | 2W：2週 | | |
| | | | 1M：1個月 | | |
| | | | 2M：2個月 | | |
| | | | 3M：3個月 | | |

Stub Index Tenor 2 應大於或等於 Stub Index Tenor 1。

如畸零天期位置 = 0，即無畸零天期者，此三欄位免填。



IRS_CCP 新增CCP資訊欄位 (9/9)

| 序號 | 欄位 | 格式 | 內容 | 說明 | 比對 |
|----|--------------------|-------|-------------------|-------------------------|----|
| 56 | Payment Lag (Days) | X(3) | 單位：天 | 利息支付滯延天數 | Y |
| 57 | 結算帳戶ID | X(20) | 填寫申報機構於CCP之結算帳戶ID | (本次測試請先以虛擬之帳戶ID輸入本欄位測試) | |

依期交易所目前之規畫，僅集中結算Payment Lag = 0之交易。



TR系統交易資料傳輸CCP測試作業 (1/3)

- 櫃買中心109年11月10日證櫃債字第10904007731號公告
- 測試時間：
109年12月21日至12月25日，每日14時至17時。
(12月25日後測試系統仍會持續開放)
- 測試申報格式：
利率交換_集中結算 (IRS_CCP)

➤ 正式上線實施日期及申報格式將配合期交所時程規劃另行公告。



TR系統交易資料傳輸CCP測試作業 (2/3)

□ 網頁版軟體測試操作：

- 1) 登入測試網址：<https://trtest.tpex.org.tw>
- 2) 網頁瀏覽器：Internet Explorer 11.0或 Google Chrome 70.0版(含)以上。
- 3) 測試時須備妥工商憑證或證期共用憑證IC卡(可擇一)。

□ 請以系統預設帳號密碼登入測試系統：

- 1) 帳號一 (帳號tr001、密碼tr001abc)
- 2) 帳號二 (帳號tr002、密碼tr002abc)
- 3) 帳號三 (帳號tr003、密碼tr003abc)



TR系統交易資料傳輸CCP測試作業 (3/3)

□ 測試方式：

IRS_CCP路徑：儲存庫申報(TR) > 交易申報 > IRS_CCP

申報交易

- 直接在IRS_CCP畫面輸入各項欄位資訊後申報。
- 製作符合IRS_CCP傳檔格式之檔案，於IRS_CCP畫面匯入申報。

比對成功

- 需洽交易對手配合申報同一筆交易(相同交易條件)。
- 雙方申報完成後由TR系統執行比對作業。

傳送CCP

- 「交易雙方均同意透過TR傳送至CCP」且「比對成功」之交易才能點選放行(傳送至CCP)。
- 雙方均放行交易後，交易資料將傳送至CCP*。

*本次測試僅為TR系統測試，未與期交所系統連線測試。

感謝聆聽

Q&A

櫃買中心債券部

賴先生 Tel:02-2366-8003 Email: willLai@tpex.org.tw

李小姐 Tel:02-2366-5966 Email: Kellie@tpex.org.tw

