

櫃買中心TR系統 NDF交易提交CCP機制



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange

簡報大綱

- 一、TR提交CCP機制簡介
- 二、NDF提交CCP作業流程
- 三、FXD格式修正

一、TR提交CCP機制簡介

背景

配合期交所建立店頭衍生性金融商品集中結算(CCP)機制，為降低金融機構作業成本，協助金融機構參與CCP，本中心TR系統為期交所指定之《交易契約提交平臺》，提供TR資料傳送CCP之服務。

效益

- 不需轉換系統，可一站式完成TR申報及傳送CCP兩項作業。
- 可辦理回溯結算(Backloading)。

適用 範圍

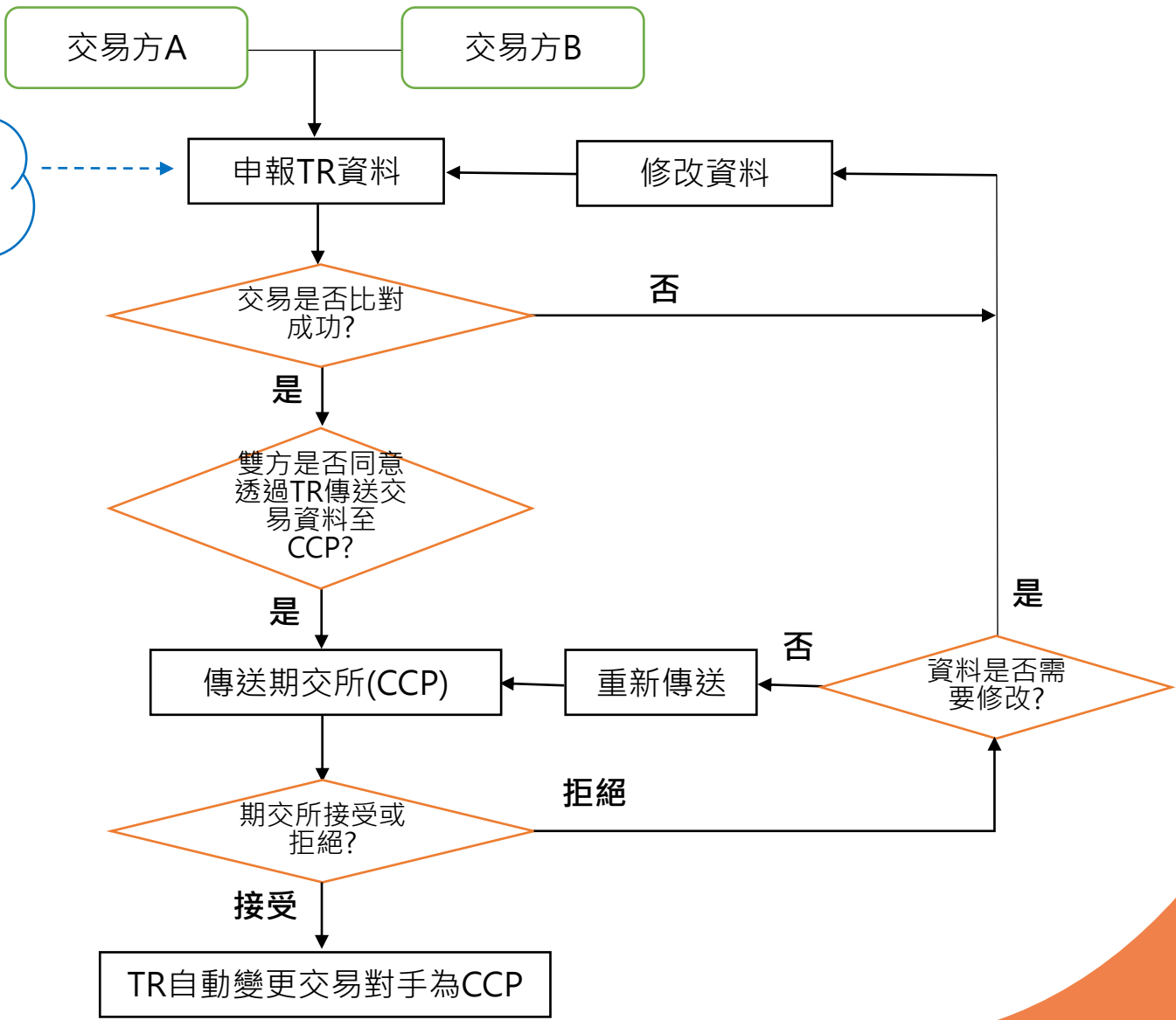
- 金融機構間新臺幣陽春型IRS交易
- 金融機構間新臺幣NDF交易

上線 時間

- 新臺幣陽春型IRS交易已於111年7月25日上線
- 新臺幣NDF交易(配合期交所時程規劃)預計112年6月上線

二、NDF提交CCP作業流程

如要傳送CCP，交易雙方申報TR時，填報透過TR傳送CCP及CCP相關欄位。



三、FXD格式修正

➤ TR格式修正公告：

請參考「111年9月14日證櫃債字第11104005111號公告」

路徑：櫃買市場業務宣導網站 > 證券商/金融機構/投信專區 > 衍生性商品交易資訊儲存庫專區 > 法令及相關公告

網址：<https://dsp.tpex.org.tw/web/tr/law.php>

➤ TR格式下載：

路徑：櫃買市場業務宣導網站 > 證券商/金融機構/投信專區 > 衍生性商品交易資訊儲存庫專區 > 文件下載 > TR傳檔格式(預計112.06上線)

網址：<https://dsp.tpex.org.tw/web/tr/download.php>

➤ 配合期交所CCP時程規劃，TR格式修正預計112年6月實施，系統測試日期及正式上線實施日期另案公告。

三、FXD格式修正

序號	欄位	格式	內容	說明	比對
1	商品類別	X(1)	1：無本金遠匯(NDF)	1.NDF、DF、FX Swap 共用此申報格式 (DF自第二階段開始申報) 。	Y
			2：外匯遠期(DF)		
			3：外匯交換(FX SWAP)		

- FXD 格式包含3種商品：NDF、DF、FX SWAP，
本次僅修正NDF商品申報內容，DF、FX SWAP商品申報內容無異動。
- FXD 3種商品之申報欄位及匯入檔案長度請參考p.10。

三、FXD格式修正

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.若交易涉及CCP(集中交易對手)者，交易對手相關欄位填報方式詳文件最下方說明六。	選"1"者須比對；選"7"且透過TR傳送CCP者須比對

- 交易對手類別、交易對手名稱、交易對手代號欄位：
如NDF交易欲提交期交所CCP，交易雙方需先申報原始交易對手相關資訊，(進行比對)，待CCP接受後，再變更交易對手為CCP(期交所)；交易雙方不可直接申報交易對手為CCP(期交所)。
- NDF交易(含海外分行交易)欲透過TR提交CCP(期交所)者，須先經TR系統比對成功，方可傳送至CCP(期交所)。

三、FXD格式修正

序號	欄位	格式	內容	說明	比對
23	NDF異動類別	X(1)	1：部位移轉 transfer	1. 限「NDF交易發生部位移轉，或經部位互抵、部位壓縮、違約處理後產生之新交易」者填報。 2. 一般正常新作NDF交易者，本欄免填。	Y
			2：部位互抵 netting		
			3：部位壓縮 compression		
			4：違約處理 default management		
			5：其他		
24	傳送交易至CCP	X(1)	2： 已透過其他方式完成交易確認； 同意透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所	NDF交易本欄必填。 1. 「NDF交易且同意透過TR傳送期交所CCP」者，本欄請填2，並續填第25~29欄位資訊。 2. 「NDF交易但不透過TR傳送期交所CCP」者，本欄請填4，免填第25~29欄位資訊。 【檢核】無本金遠匯交易須填報。本欄填2者第25~29欄必填。	Y
			4： 已透過其他方式完成交易確認； 不透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所		

1. 配合NDF CCP，FXD格式新增第23~29欄，限NDF商品填報。
2. NDF交易如為一般新作交易，第23欄免填。
3. NDF交易如欲透過TR傳送CCP，第24欄選2，並續填至第29欄。
4. NDF交易如不透過TR傳送CCP，第24欄選4，填至第24欄即可。

三、FXD格式修正

序號	欄位	格式	內容	說明	比對	
25	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。		
26	遠期匯率	9(8)V9(8)		定約匯率 (例如 : USD/TWD匯率)	Y	
27	契約定價日	年	9(4)	西元年	定價日 (the fixing date) 【檢核】契約定價日期必須小於契約到期日期。	Y
		月	9(2)	月		
		日	9(2)	日		
28	Broker	X(1)	0 : 無	經紀商	Y	
			1 : 台北外匯			
			2 : 元太外匯			
			3 : BGC			
			4 : GFI			
			5 : NITTAN CAPITAL			
			6 : Tradition			
			7 : TPICAP			
8 : 其他經紀商						
29	結算帳戶ID	X(20)	填寫申報機構於CCP之結算帳戶ID			

三、FXD格式修正

➤ 可以匯入TXT或CSV檔案方式申報FXD：

1. 匯入TXT檔：(固定長度)

- 1) DF、FX SWAP交易：188位元組，(填至22欄)。
- 2) NDF交易(不傳送CCP)：190位元組，(填至24欄)。
- 3) NDF交易(傳送CCP)：242位元組，(填至29欄)。

2. 匯入CSV檔：

(各欄位資料以逗號結尾區隔下一欄位；若該欄位無資料，則填一逗號；每筆資料最後一欄無論有無資料均不加逗號)

- 1) DF、FX SWAP交易：填至22欄。
 - 2) NDF交易(不傳送CCP)：填至24欄。
 - 3) NDF交易(傳送CCP)：填至29欄。
3. 同一檔案可包含不同商品、多筆交易，各筆交易(依上述規則填報)長度不同。

簡報結束 敬請指教

櫃買中心 債券部
李小姐 Tel: 02-2366-5966
Email: Kellie@tpex.org.tw



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange