

## 衍生性商品餘額媒體資料格式

一、申報對象：證券商及槓桿交易商。

二、傳輸欄位：日期、申報機構代號、單號、信用評等、資本淨值、風險約當金額、商品代碼、契約剩餘年期、債券代號、選擇權別、買賣別、契約流通在外餘額。(申報機構應於每月最後一個營業日下午5點以前傳輸當月月底資料至本中心)

欄位	1-7	8-11	12-16	17-18	19-26	27-34	35-36	37-38	39-45	46	47	48-55
內容	<b>日期</b> (限填申報當月最後一個營業日)	申報 機構 代號	單號	信用 評等	合格自 有資本	風險約 當金額	商品代碼	契約剩餘 年期	標的債 券代號	選擇權別	買賣別	流通在外餘 額(萬元)
							a1 : FRA	1 : 1 年期	留空	留空	留空	
							a2 : IRS	2 : 2 年期	留空	留空	留空	
							a3 : IRO	3 : 3 年期	留空	留空	留空	
								4 : 4 年期	留空	留空	留空	
								5 : 5 年期	留空	留空	留空	
								6 : 6 年期	留空	留空	留空	
								7 : 7 年期	留空	留空	留空	
								10 : 10 年期	留空	留空	留空	
								99 : 其他	留空	留空	留空	
							b1 : bond forward	留空	A93104	留空	1 : 買入 2 : 賣出	
							b2 : bond option	留空	A93104	1 : 買權 2 : 賣權	1 : 買入 2 : 賣出	
							b3 : Bond Swap	留空	A93104	留空	1 : 買入(取得標的債券報酬) 2 : 賣出(支付標的債券報酬) 9 : 其他	
							c1 : 不保本型商品	留空	留空	留空	留空	
							c2 : 保本型商品	留空	留空	留空	留空	
							c3 : CLN	留空	留空	留空	留空	
							c4 : equity option	留空	留空	1 : 買權	1 : 買入	
						2 : 賣權				2 : 賣出		
						9 : 其他						
							c5: equity swap	留空	留空	留空	1 : 買入 2 : 賣出	



## 二、欄位輸入說明

欄位		格式	型態	附註
日期	年	9(3)	三位數字	民國年
	月	9(2)	二位數字	
	日	9(2)	二位數字	<b>限申報當月最後一個營業日</b>
申報機構代號		X(4)	四位文數字	證券商：總公司均以自營部代號表示 (EX. 980T:元大證券)。 槓桿交易商：元大:220T；群益:221T；凱基:B05T
單號		X(5)	五位文數字	<b>第一碼C，後四碼由0001開始依序編號，每月傳輸由0001號開始重編</b>
信用評等		9(2)	二位數字	<b>請參見信用評等代碼表(可免填)</b>
合格自有資本		9(8)	八位數字	以新台幣萬元為單位，請參見後合格自有資本說明
風險約當金額		9(8)	八位數字	以新台幣萬元為單位，請參見後風險約當金額說明
商品代碼		X(2)	二位文數字	<b>請參見後商品代號</b>
契約剩餘年限		9(2)	二位數字	1→1年期 2→2年期 3→3年期 4→4年期 5→5年期 6→6年期 7→7年期 10→10年期 99→其他 契約剩餘年限低於1年者，請輸入1 契約剩餘年限低於2年高於1年者，請輸入2，以此類推 (EX. 契約剩餘年限為8.5年輸入10，契約剩餘年限大於10年者輸入99)
債券代號		X(7)	七位文數字	前六碼以債券代號表示 (EX.A93101)，第七碼空白
選擇權別		X(1)	一位文數字	1→買權 2→賣權 9→其他
買賣別		X(1)	一位文數字	1→買入 2→賣出 3→收付股權報酬 9→其他 equity swap「1」為「支付利息」、「2」為「收取利息」、「3」為「收取且支付股權報酬」、非屬前三類者為「9」。 信用商品「買入」為「信用保護買方」、「賣出」為「信用保護賣方」 <b>bond swap「1」為取得標的債券報酬；「2」支付標的債券報酬，若為兩債券標的的交換契約則分開兩筆資料輸入，非屬前二類者為「9」。</b>
流通在外餘額		9(8)	八位數字	以新台幣萬元為單位

對應申報序號	9(5)	五位數字	一律補'0' (系統使用)
異動別	X(1)	一位文數字	一律補'A' (系統使用)

註：1.格式型態為9者，一律右靠左補0。

2.格式型態為X者，一律左靠右補空白。

**信用評等代碼表：**

資料 傳輸	中華信評(S&P)*	穆迪**	惠譽***
1	AAA+	Aaa1	AAA+
2	AAA	Aaa2	AAA
3	AAA-	Aaa3	AAA-
4	AA+	Aa1	AA+
5	AA	Aa2	AA
6	AA-	Aa3	AA-
7	A+	A+	A+
8	A	A	A
9	A-	A-	A-
10	BBB+	Baa1	BBB+
11	BBB	Baa2	BBB
12	BBB-	Baa3	BBB-
13	BB+	Ba1	BB+
14	BB	Ba2	BB
15	BB-	Ba3	BB-
16	BB-以下	Ba3 以下	BB-以下

註：\*：包含中華信評及 S&P 國際評等

\*\*：包含穆迪台灣評等及國際評等

\*\*\*：包含惠譽台灣分公司評等及國際評等

**合格自有資本說明：**

1. 證券商請以**最近一期**自有資本適足申報資料中合格自有資本金額進行申報，每月申報上月自有資本適足率時請同步更新資料。請輸入大於零資料。
2. 槓桿交易商請以**最近一期**調整後淨資本計算表之**調整後淨資本額**進行申報。請輸入大於零資料。

**風險約當金額說明：**

1. 證券商請以**最近一期**證券商營業處所經營衍生性金融商品額度控管檢查表，經風險管理主管覆核之市場風險約當金額”合計數”進行申報。請輸入大於零資料。
2. 槓桿交易商請以**最近一期**調整後淨資本計算表之**期貨交易人未沖銷部位及槓桿保證金契約設算所需之客戶保證金合計數**進行申報。請輸入大於零資料。

**商品代碼：**（2位數） X(2)

a1：遠期利率（FRA）

a2：利率交換（IRS）

a3：利率選擇權（IRO）

b1：債券遠期買賣斷（bond forward）

b2：債券選擇權（bond option）

**b3：債券交換（bond Swap）**

**c1：不保本型商品**

**c2：保本型商品**

c3：信用違約連結商品（CLN）

**c4：股權選擇權（equity option）**

**c5：股權交換（equity swap）**

**c6：股權遠期（equity forward）**

d1：資產交換-固定收益端（ASW）

d2：資產交換-選擇權端（ASO）

d3：信用遠期（credit forward）

**d4：信用交換（credit swap）**

**d5：信用選擇權（credit option）**

**e1：商品遠期契約（commodity forward）**

**e2：商品交換契約（commodity swap）**

**e3：商品選擇權契約（commodity option）**

**e4：其他遠期契約**

**e5：其他交換契約**

**e6：其他選擇權契約**

**契約流通在外餘額定義：**

a1：遠期利率（FRA）---將同年期流通之長部位及短部位名日本金相加總

a2：利率交換（IRS）---將同年期流通之長部位及短部位名日本金相加總

a3：利率選擇權（IRO）---將同年期流通之長部位及短部位名日本金相加總

b1：債券遠期買賣斷（bond forward）---該期債券之遠期交易名日本金

b2：債券選擇權（bond option）---將同一標的流通之長部位及短部位名日本金相加總

**b3：債券交換（bond Swap）---將同一標的流通之長部位及短部位名日本金相加總**

**c1~c6、d1~d5 及 e1~e6 契約流通在外餘額是指流通部位之名日本金總額**

### 三、資料內容

固定長度，資料長度為 61 位元組，每增加一筆資料以新單號傳輸。例：每月有 20 筆資料需傳輸，以 20 個連續單號傳輸。

### 四、檔案結構

傳輸必須為 RECORD SEQUENTIAL FILE (含 0x0d, 0x0a) 。

### 五、傳輸時間

星期一至星期五 09:00 ~ 17:00

### 六、檔案名稱 → D43

### 七、傳輸方式

1. 每月進行檔案傳輸前，須將資料存入規定之檔案名稱內，一次傳送完畢，若發現傳輸內容錯誤或資料不完整時，得重新傳輸。
2. 傳輸錯誤時請全部刪除後重傳。
3. 本中心以最後一次於系統中資料為主（申報機構可用查詢確認）。
4. 申報機構須於規定時間內將當月資料傳送至本中心。