

衍生性金融商品交易系統 操作手冊

目 錄

檔案		第 1 頁
債券選擇權		第 6 頁
債券遠期		第 38 頁
利率交換		第 71 頁
輔助功能		第 82 頁

更新日期：2015.4

◎檔案

功能說明：

功能名稱	功能說明	頁次
系統登入/出	執行衍生性金融商品交易系統上線(登出)功能	1
FIX 參數設定	設定資訊伺服器網路位址。	3
顯示系統訊息	該債券系統使用過程之完整紀錄。	4
結束	離開衍生性金融商品交易系統	5

◎檔案—系統登入

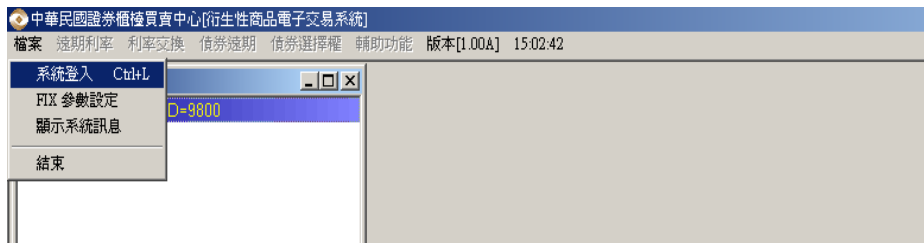
功能說明：

執行衍生性金融商品交易系統上線功能。本系統提供遠期利率、利率交換、債券遠期及債券選擇權等四項契約交易。

操作說明：

1. 將游標移至畫面左上方「檔案」字樣後，以滑鼠左鍵單點進入選單中。
2. 以滑鼠左鍵點選「系統登入」，即出現登入視窗。
3. 輸入使用者之帳號、密碼，確定登入系統請點選「上機」，即可開啟交易系統，若不登入系統則請執行「取消」。
4. 每日可登入時間：8：00~18:30

畫面說明：





登入畫面，標題為「衍生性商品」。包含以下欄位：

- 主機：OTC 主機
- 券商：9800
- 帳號：980010
- 密碼：(空白)

底部有兩個按鈕：「上機[L]」和「取消[C]」。

◎檔案－系統登出

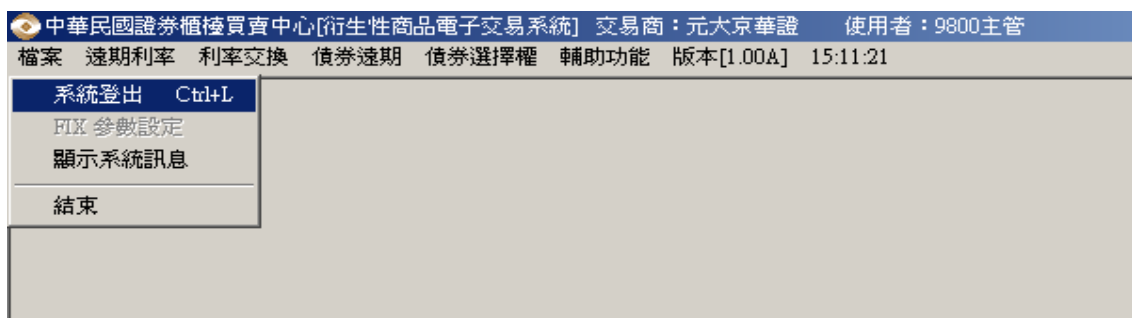
功能說明：

執行衍生性金融商品交易系統離線功能。

操作說明：

1. 將游標移至畫面左上方「檔案」字樣後，以滑鼠左鍵單點進入選單中。
2. 以滑鼠左鍵點選「系統登出」，即出現詢問訊息。
3. 確定登出交易系統請點選 ，即可離開系統，若不登出則請執行 。

畫面說明：



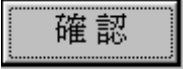
◎ 檔案 — FIX 參數設定

功能說明：

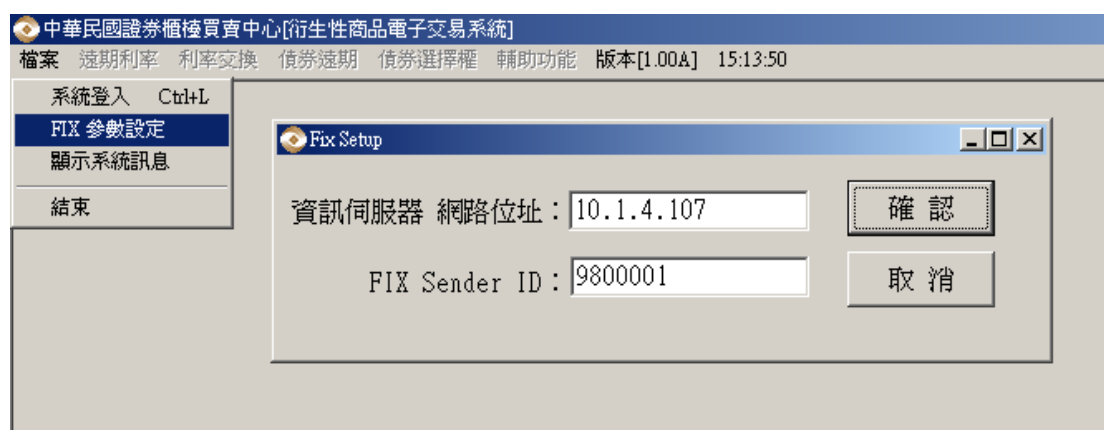
設定資訊伺服器網路位址，FIX 技術為國際公認之通訊協定，可利用本系統與國際金融商品系統接軌。

操作說明：

1. 點選「檔案」下的「FIX 參數設定」，開啟視窗。
2. 輸入 IP 位置及 Broker ID（請向貴公司資訊人員查詢）。

3. 按下  即設定完成。

畫面說明：



◎檔案－顯示系統訊息

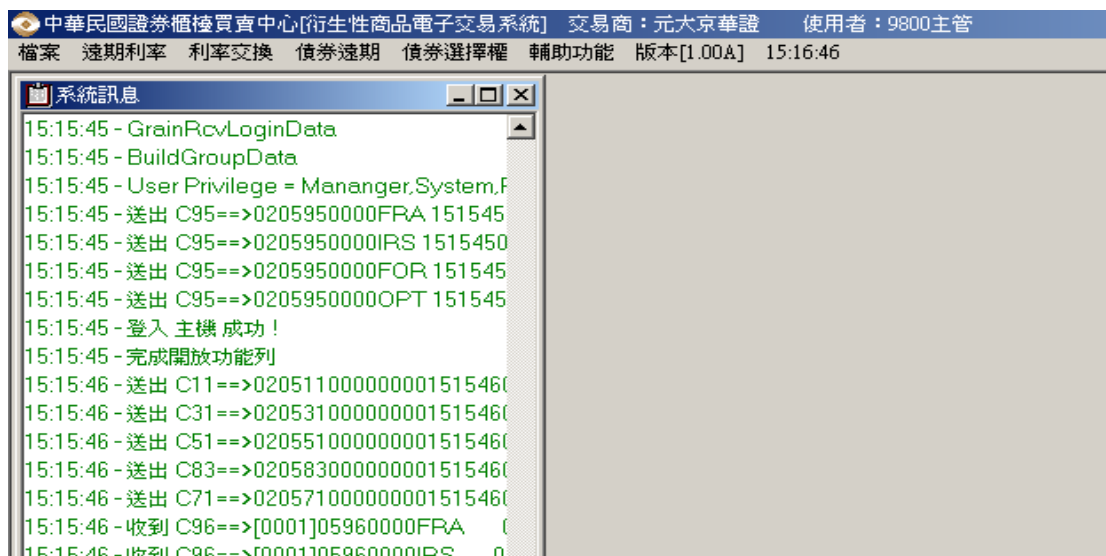
功能說明：

只要登入系統，即顯示本系統完整的使用過程紀錄，讓使用者了解系統之運作狀況。

操作說明：

只要登入系統，該訊息視窗即自動顯示。

畫面說明：



◎ 檔案－結束

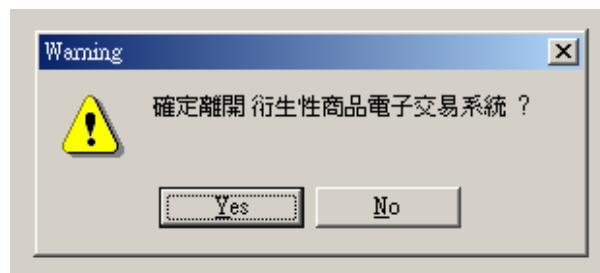
功能說明：

離開衍生性金融商品交易系統。

操作說明：

1. 於「檔案」選單下執行「結束」指令。
2. 出現「確定離開衍生性商品電子交易系統？」的訊息視窗，選擇 YES 則結束程式， NO 則程式繼續執行。
3. 「登出」表示系統程式仍在運作，重新登入系統時之速度較快；「結束」表示完全關閉系統程式，重新登入系統時必須重啟程式，所以速度較慢。

畫面說明：

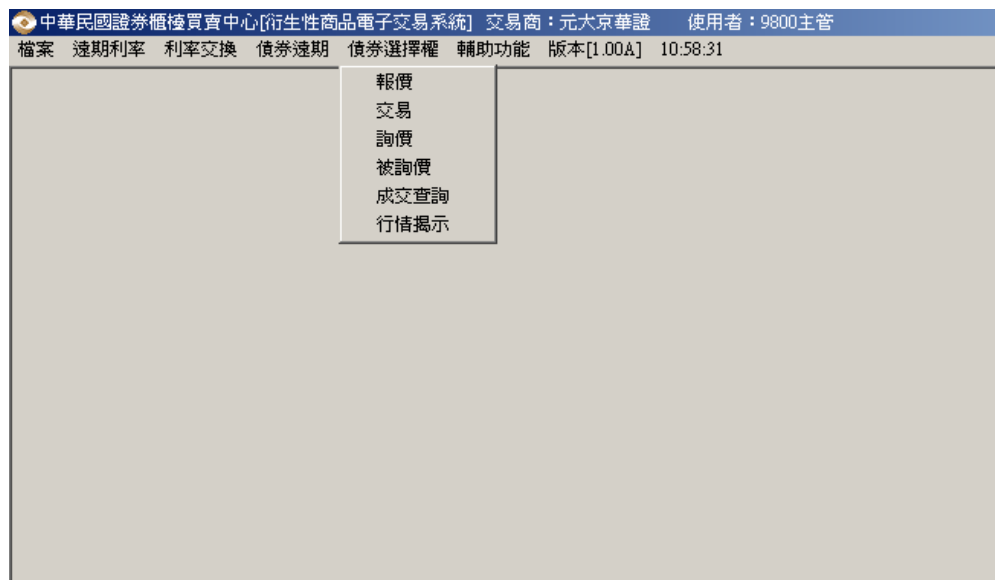


◎債券選擇權

功能說明：

功能名稱	功能說明	頁次
報價	提供使用者選擇報價對象、債券代號、履約利率，進行線上殖利率波動度即時報價	7
交易	使用者可查詢各期債券選擇權之報價狀況及進行成交	15
詢價	使用者可針對特定對象、特定契約規格進行詢價作業	21
被詢價	被詢價時報價回覆、不接受詢價作業	26
成交查詢	成交狀況查詢可依使用者的權限，即時查詢當日盤中的成交資料	32
行情揭示	即時揭露全市場最新的債券選擇權成交行情，做為使用者調整買賣決策的重要參考資訊	34

畫面說明：



◎債券選擇權—報價

功能說明：

提供使用者可選擇報價對象、債券代號及履約利率，進行線上即時殖利率波動度報價。開啟報價視窗時，報價視窗一律帶出交易員「最近一次報價的債券期別」，不問進行視窗儲存動作當時的報價視窗期別為何，但若該債券期別於開啟視窗時仍無法交易，將以空白開出。

報價規則：請參考本中心「店頭金融商品電腦交易系統作業辦法」

1. 現行債券選擇權系統之交易時間為上午 9:00 至下午 1:30，但各期債券能否報價仍應視各期債券於等值成交系統是否已成交，並產生 5 分鐘均價決定。
2. 報價輸入應以殖利率波動度為之，每一交易單位為新台幣一億元整。
3. 報價數量必須為 1 至 9 個交易單位。
4. 證券商之買賣申報，應依債券代號、履約利率、契約期限、報價對象、殖利率波動度、買賣數量、買賣別等事項逐一輸入，經本中心系統接受後，即透過傳輸系統依序回報之，其修改時亦同。
5. 證券商得自選對象提供報價，但同一證券商之總、分支機構間或分支機構相互間不得為成交對象。
6. 進行雙向報價時，買進殖利率波動度不得高於賣出殖利率波動度。
7. 使用者執行「系統登出」功能時，系統會自動將其在系統上的報價單全數抽回。
8. 報價輸入視窗只能開啟一個，當選擇視窗關閉時，如使用者尚有報價單未做刪除，則系統僅以最小化處理，俾提醒使用者報價單仍有被成交之可能；重新開啟視窗時建議由「視窗」下選單開啟較為方便。

操作說明：

請至下列頁次參考操作說明：

操作說明		頁次
新增報價		10
修改報價		12
刪除	刪除報價	13
	刪除全部報價	13
結束報價		14

畫面說明：

債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】

單位：1億元

債券代號	履約利率	契約期限	報價對象	CALL					PUT						
				隱名	量	買	賣	量	隱名	量	買	賣	量	隱名	
A95103	002.18	02週	全市場	☒	9	15.00	16.00	9	☒	☒	9	14.00	15.00	9	☒
A95103	002.17	02週	全市場	☒	1	14.00	15.00	1	☒	☒	1	13.00	14.00	1	☒
A94107	002.47	02週	全市場	☒	1	15.00	16.00	1	☒	☒	1	13.00	14.00	1	☒

如輸入之報價並未超出事先設定之報價範圍，則此時不會出現任何訊息，否則將出現警示視窗。

註 解：

1. 債券代號中，選單僅會出現在等值系統中已有當日最新 5 分鐘均價的債券期別，即該期債券第一個交易的 5 分鐘均價出現後，該期債券選擇權即可開始交易。
2. 每期債券每日皆會有 11 個履約利率供選擇，其中第 6 個履約利率稱為價平利率，由該期債券的第一個交易出的 5 分鐘均價來決定（四捨五入至小數點以下兩位），其餘履約利率由價平利率進行上下加碼（加碼幅度由本中心公告），履約利率決定後當日不再改變。
3. 契約期限分別為 1 週、2 週、3 週及 4 週
4. 名詞解釋：

債券代號	報價方選擇欲報價之債券期別
履約利率	該期債券選擇權的履約利率
契約期限	債券選擇權契約期間長度
報價對象	報價方可選擇對單一券商、券商組合或全市場（全部簽約對象）報價
隱 名	報價方可以選擇是否顯示券商名稱
CALL	債券買權
PUT	債券賣權
量	每一交易單位為面額一億元
買進	交易對象點選成交後，即行成交
賣出	交易對象點選成交後，即行成交

發行前交易特殊狀況說明：

1. reopen 的券別系統不得進行債券選擇權交易，僅開放目前已流通的舊券進行債券選擇權交易。
2. 發行前交易的債券，系統不提供契約期限為一週的契約交易，因此可交易契約期限為 2 週、3 週及 4 週。
3. 由於發行前交易無票面利率，因此該期債券的票面利率由第一日發行前交易的前 15 分鐘交易的成交量加權平均殖利率，作為該期債券的虛擬票面利率(虛擬票面利率以 0.125% 為一個跳動單位，找最接近且較低或等於的級距)，在虛擬票面利率產生前該期債券選擇權無法交易。
4. 前項規則，若前 15 分鐘無交易成交，再延長 15 分鐘，取成交均價，若再無再以此準則遞延，若第一日無成交，次交易日繼續依以上準則求算。
5. 發行前交易第 14 個及第 15 個營業日，該期債券票面利率已定，依正式票面利率計算權利金。

【報價 / 新增報價】

如不針對 CALL 或 PUT 報價，可按 C、P 鍵對 CALL 或 PUT 報價欄位作一次隱藏

				CALL				PUT							
債券代號	履約利率	契約期限	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A95103	002.18	02週年	全市場	☒	9	15.00	16.00	9	☒	☒	9	14.00	15.00	9	☒

左邊淺黃底表示買權報價
右邊淺藍底表示賣權報價

操作說明：

- 點選「債券選擇權」主選單並執行「報價」指令，進入「報價輸入」畫面。
- 在報價輸入畫面中，可以用 ENTER、上下左右鍵盤鍵或滑鼠直接點選的方式，切換欄位；欲新增報價時，按鍵盤上的向下「↓」鍵，即可新增一欄。
- 選擇欲報價之債券代號、履約利率、契約期限、報價對象，輸入報價數量及買賣報價並按 ENTER 鍵，即可完成報價。注意報價數量及買賣報價兩個欄位，須從斜體字轉變為正體字，才表示該筆報價訊息已經完整送出（已經完成報價）。
- 如果只進行 CALL 報價，可以點選畫面右上角的 P 鍵，選擇不顯示 PUT 報價的欄位；亦可以滑鼠右鍵逐項勾選的方式，自行選擇要揭示哪些欄位。
- 隱名報價或具名報價，係以滑鼠於隱名欄位點選兩次或按壓空間棒的方式進行切換。

畫面說明：

可直接輸入債券代號，或用滑鼠點選下拉式選單

每期債券可選擇 11 個履約利率

中華民國證券櫃檯買賣中心[衍生性商品電子交易系統] 交易商：元

檔案 遠期利率 利率交換 債券遠期 債券選擇權 輔助功能 版本2

債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】

單位：1億元

債券代號	履約利率	契約期限	報價對象	隱名	量	買
A95103	002.18	02年 03年 04年				

可直接輸入契約期限，或用滑鼠點選下拉式選單

中華民國證券櫃檯買賣中心[衍生性商品電子交易系統] 交易商：元大京華證

檔案 遠期利率 利率交換 債券遠期 債券選擇權 輔助功能 版本[1.00A]

債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】

單位：1億元

債券代號	履約利率	契約期限	報價對象	隱名	量	買
A95103	002.18	02年	1 10 2 3 全市場 0500 - 中華開發銀 0520 - 台北國際銀 0540 - 台灣工業銀			

可選擇對單一券商、券商組合、或全市場報價

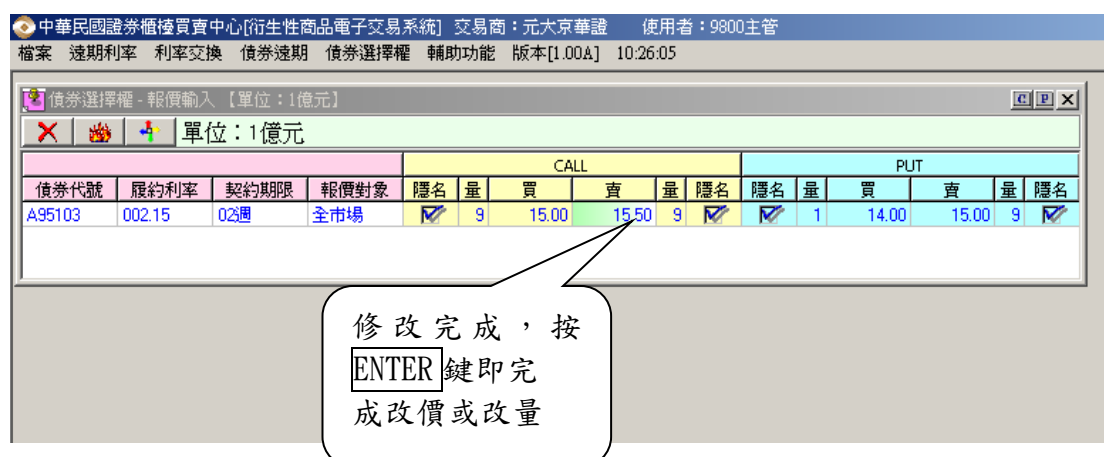
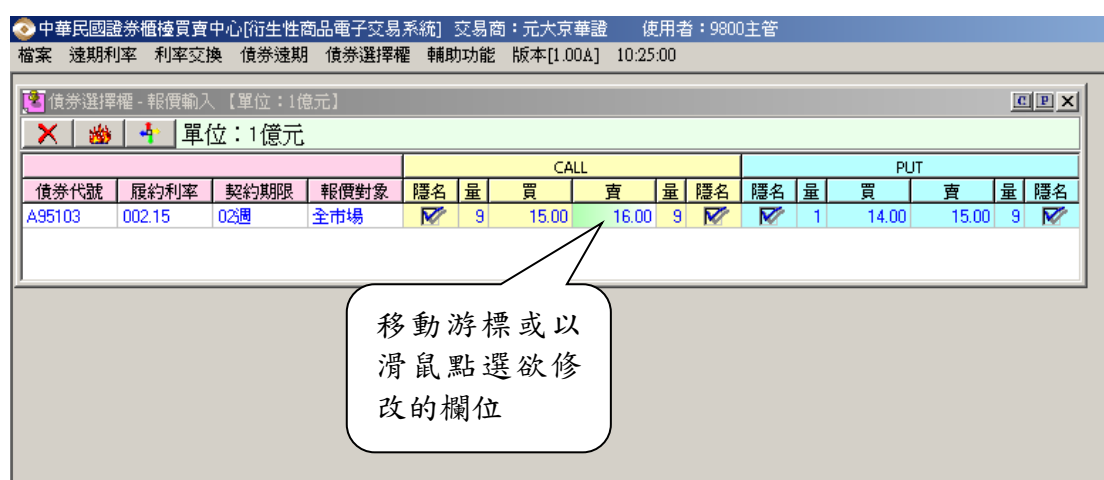
※ 如果要同時對一群交易對象報價，必須先在「輔助功能」下「系統維護」功能項下設定券商組合，可自行決定組合的內容，並可設定多個組合。

【報價 / 修改報價】

操作說明：

1. 以滑鼠左鍵單點欲修改的數量欄或報價欄（或以「↑、↓、←、→」鍵盤鍵的方式移動），進入修改狀態。
2. 輸入新的數量或殖利率波動度。
3. 按 ENTER 鍵，即完成報價或數量的修改。

畫面說明：



【報價 / 刪除報價】

操作說明：

將游標移到「報價輸入」視窗中欲刪除報價的欄位，或以滑鼠點選欲做刪除的報價後，點選左上角的  「刪除」，該筆報價即被刪除；亦可以按下鍵盤上的「Delete」鍵，進行報價刪除。

畫面說明：

1. 刪除單筆報價資料

債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】

單位：1億元

請先將游標移至欲做刪除的欄位

債券代號	展約利率	契約期限	報價對象	CALL					PUT					
				隱名	量	買	賣	量	隱名	量	買	賣	量	隱名
A95103	002.15	02週	全市場	☒	9	15.00	16.00	1	☒	1	14.00	15.00	9	☒
A95103	002.16	02週	全市場	☒	9	15.50	17.00	9	☒	1	13.50	15.00	1	☒
A94107														
A94107														

債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】

單位：1億元

按  或 Delete，即刪除該筆報價

債券代號	展約利率	契約期限	報價對象	CALL					PUT					
				隱名	量	買	賣	量	隱名	量	買	賣	量	隱名
A95103	002.15	02週	全市場	☒	9	15.00		1	☒	1	14.00	15.00	9	☒
A95103	002.16	02週	全市場	☒	9	15.50	17.00	9	☒	1	13.50	15.00	1	☒
A94107	002.15	02週	全市場	☒	1	13.50	15.00		☒	1			1	☒
A94107	002.19	02週	全市場	☒	5	13.00		1	☒	1		16.00	3	☒

2. 刪除全部報價資料：

當市場行情驟變，為免逐筆改價或抽單不及，可按視窗左上角的一團火 ，將所有報價單（數列多筆）一次刪除。

【報價 / 結束報價】

操作說明：

1. 若報價輸入視窗中仍有報價資料，按[X]之後，其視窗僅會以最小化處理。
2. 當報價輸入視窗中無任何報價資料時，按[X]之後，其視窗才可完全關閉。

畫面說明：

按[X]僅縮小視窗

債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】															
				CALL						PUT					
債券代號	履約利率	契約期限	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A95103	002.15	02週	全市場	☒	9	15.00	16.00	1	☒	☒	1	14.00	15.00	9	☒
A95103	002.16	02週	全市場	☒	9	15.50	17.00	9	☒	☒	1	13.50	15.00	1	☒
A94107	002.15	02週	全市場	☒	1	13.50	15.00	1	☒	☒	1			1	☒
A94107	002.19	02週	全市場	☒	5	13.00		1	☒	☒	1		16.00	3	☒



債券選擇權 - 報價輸入 【單位：1億元】															
				CALL						PUT					
債券代號	履約利率	契約期限	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A95103	002.15	02週	全市場	☒	1			1	☒	☒	1			1	☒
A95103	002.16	02週	全市場	☒	1			1	☒	☒	1			1	☒
A94107	002.15	02週	全市場	☒	1			1	☒	☒	1			1	☒
A94107	002.19	02週	全市場	☒	1			1	☒	☒	1			1	☒

完全沒有報價資料時，視窗才可完全關閉

◎債券選擇權—交易

功能說明：

查詢指定債券選擇權報價及進行成交。

交易規則：

請參考本中心「店頭金融商品電腦交易系統作業辦法」第二章規範。

操作說明：

1. 進入「債券選擇權」主選單下執行「交易」指令，即出現「債券選擇權交易」視窗。
2. 將游標移至「債券選擇權交易」視窗中，視窗上方具有債券代號、履約利率及契約期限三個下拉式選單，可選取欲查詢之債券選擇權契約。
 - (1) 查詢單一債券：選擇單一債券代號，將揭示該期債券的單一契約期限全部履約利率之選擇權契約最佳一筆報價。
 - (2) 查詢單一債券單一履約利率：選擇單一債券代號，選擇單一履約利率，將揭示該期債券的單一契約期限單一履約利率契約之最佳六筆報價，並以不同顏色區隔不同的利率（即相同的報價則以相同的顏色標記），如不足六筆則先以空白列顯示，當有新報價產生將即時補空。
 - (3) 查詢全部債券：揭示該契約期限下，全部債券期別、全部履約利率之選擇權契約最佳一筆報價。
3. 交易畫面依履約利率排序：按下「履約利率」欄位名稱，系統即自動依債券代號（近期發行券次排列在後）及履約利率（高利率排列在後）排序。
4. 建議先從滑鼠右鍵下拉式選單的「記憶密碼」項下，將密碼記憶住（亦即登入衍生性商品電子交易系統時之密碼），避免每次點選交易時需反覆輸入密碼的困擾。
5. 可同時開啟數十個交易視窗，滿足業者單一債券選擇權契約一個交易視窗揭示之需求。

請至以下頁次參考操作說明：

操作說明	頁次
點選報價	19
超過交易限額	20
暫停交易對象	21

畫面說明：

1. 單一債券

債券選擇權交易 [A95103]

債券代號: A95103 履約利率: 全部利率 契約期限: 2週 最佳一筆

債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A95103	002.12	****	6	13.00	14.00	3	****	****	2	14.50	15.00	4	****
A95103	002.13	****	1	12.85	13.15	5	****	****	3	13.00	15.00	5	****
A95103	002.14	****	9	12.50	15.00	1	****	****	6	12.56	13.15	4	****
A95103	002.15	****	1			1	****	****	1	14.00	15.00	6	****

選擇債券

- A95103
- 全部債券

記憶密碼

- ☒ 債券代號
- ☒ 履約利率
- ☒ Call 買商
- ☒ Call 買量
- ☒ Call 買價
- ☒ Call 賣價
- ☒ Call 賣量
- ☒ Call 賣商
- ☒ Put 買商
- ☒ Put 買量
- ☒ Put 買價
- ☒ Put 賣價
- ☒ Put 賣量
- ☒ Put 賣商

如果不交易買權，可以直接點選[C]，選擇不揭示買權報價欄位

各顯示最佳一筆報價

按滑鼠右鍵出現下拉式選單，可自行勾選要揭示哪些欄位，俾調整視窗大小

2. 單一債券單一履約利率

債券選擇權交易 [A95103]

債券代號: A95103 履約利率: 002.15 契約期限: 2週 最佳六筆

債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A95103	002.15	****	3	14.45	14.56	5	****	****	2	15.50	15.80	5	****
A95103	002.15	****	9	14.35	14.60	2	****	****	8	15.48	16.00	5	****
A95103	002.15	****	3	14.20	14.75	1	****	****	7	15.30	16.50	2	****
A95103	002.15	****	1	14.00	14.90	2	****	****	2	15.00	16.70	1	****
A95103	002.15	****	5	13.50	15.40	1	****	****	1	14.60	17.00	5	****
A95103	002.15	****	6	13.00	16.00	1	****	****	1	13.00	18.00	5	****

顯示最佳六筆報價

3. 全部債券

債券選擇權交易 [全部債券]

債券代號: 全部債券 履約利率: 全部利率 契約期限: 2週 最佳一筆

債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A84304	007.98	****	1	13.00	14.00	6	****	****	2	13.50	16.00	4	****
A86310	006.86	****	1	12.00	13.00	1	****	****	1	12.50	13.00	5	****
A91109	002.53	****	1	15.00	16.00	3	****	****	2	14.00	15.00	6	****
A95103	002.15	****	3	14.45	14.56	5	****	****	2	15.50	15.80	5	****

各顯示最佳一筆報價

排序：依履約利率排序

1. 全部債券交易畫面：依「債券代號」及「履約利率」排序

債券選擇權交易 [全部債券]

債券代號: 全部債券 履約利率: 全部利率 契約期限: 1週 最佳一筆

債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A95105	1.96							****	1	15.00			
A96101	1.94				16.00	1	****						
A96101	1.95	****	1	13.00									
A96103	1.87	****	1	20.00									
A96104	1.30	****	1	15.00									
A96104	1.33	****	1	12.00	15.00	1	****	****	1	15.00	18.00	1	****
A96103	1.86	****	1	20.00									

新增報價

按下「履約利率」即可排序

債券選擇權交易 [全部債券]

債券代號: 全部債券 履約利率: 全部利率 契約期限: 1週 最佳一筆

債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A95105	1.96							****	1	15.00			
A96101	1.94				16.00	1	****						
A96101	1.95	****	1	13.00									
A96103	1.86	****	1	20.00									
A96103	1.87	****	1	20.00									
A96104	1.30	****	1	15.00									
A96104	1.33	****	1	12.00	15.00	1	****	****	1	15.00	18.00	1	****

※關閉交易視窗後重新開啟，系統亦將自動排序。

債券選擇權交易 [全部債券]

債券代號: 全部債券 履約利率: 全部利率 契約期限: 1週 最佳一筆

債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A95105	1.94	商業儲蓄	2	3.12									
A96101	1.94	商業儲蓄	1	30.50	11.02	1	商業儲蓄	****	1	610.00	31.25	1	商業儲蓄
A96103	1.86	****	1	20.00									
A96103	1.90	****	1	25.00	30.00	1	****	****	1	20.00	25.00	1	****
A96105	1.08	****	1	25.00									
A96104	1.30	****	1	22.00									

關閉交易視窗重新開啟後

債券選擇權交易 [全部債券]													
債券代號:	全部債券	履約利率:	全部利率	契約期限:	1週	最佳一筆							
債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A95105	1.94	商業儲蓄	2	3.12									
A96101	1.94	商業儲蓄	1	30.50	11.02	1	商業儲蓄	****	1	610.00	31.25	1	商業儲蓄
A96103	1.86	****	1	20.00									
A96103	1.90	****	1	25.00	30.00	1	****	****	1	20.00	25.00	1	****
A96104	1.30	****	1	22.00									
A96105	1.08	****	1	25.00									

2. 單一債券交易畫面：依「履約利率」排序

債券選擇權交易 [A96103]													
債券代號:	A96103	履約利率:	全部利率	契約期限:	1週	最佳一筆							
債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A96103	1.86	****	1	20.00									
A96103	1.90	****	1	25.00	30.00	1	****	****	1	20.00	25.00	1	****
A96103	1.87	****	1	20.00									

↓ 關閉交易視窗重新開啟後

債券選擇權交易 [A96103]													
債券代號:	A96103	履約利率:	全部利率	契約期限:	1週	最佳一筆							
債券代號	履約利率	交易商	量	C買價	C賣價	量	交易商	交易商	量	P買價	P賣價	量	交易商
A96103	1.86	****	1	20.00									
A96103	1.87	****	1	20.00									
A96103	1.90	****	1	25.00	30.00	1	****	****	1	20.00	25.00	1	****

註 解：

名詞解釋

債券代號	以債券代碼來代表債券選擇權標的債券的名稱
履約利率	債券選擇權到期時執行履約利率
交易商	報價交易商名稱，如為隱名報價則以星號****顯示
量	該報價利率的交易單位，每一交易單位為萬元
C買價／C賣價	債券買權交易商之報價資料，報價為標的債券殖利率波動度
P買價／P賣價	債券賣權交易商之報價資料，報價為標的債券殖利率波動度

【交易 / 點選報價】

功能說明：

於「報價區」雙擊合意之報價，經執行交易確認，即行成交。

操作說明：

1. 將游標移至「債券選擇權交易」視窗中，透過債券代號、履約利率及契約期限選單，選擇想要之交易輸入組合。
2. 以滑鼠左鍵在合意的利率波動度點選兩下，系統即出現「債券選擇權交易確認」對話框，輸入密碼及點選「確定交易」指令（或按 Enter），即行成交。
3. 密碼可先行記憶（參考第 15 頁，操作說明 3），或勾選「債券選擇權交易確認」對話框左下角的儲存密碼，避免每次點選交易時需反覆輸入密碼的困擾。

畫面說明：

債券選擇權-交易確認

契約期限: 2週
 債券期別: A95103
 選擇權形式: 買權Call
 買賣別: 己方買進
 交易對象: ****
 成交利率: 12.00
 密碼: *****

確定交易
 關閉

☒ 儲存密碼

交易對象: **** 狀態: 使用者確認中

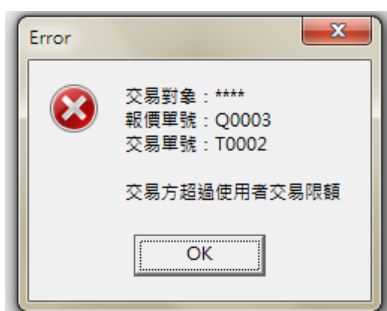
【交易 / 超過交易限額】

功能說明：

交易限額區分為四類：己方交易員額度超過限制、己方交易商額度超過限制，交易對手交易員額度超過限制、交易對手交易商額度超過限制。

畫面說明：

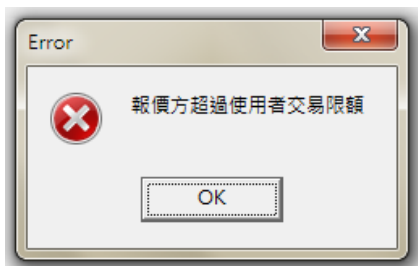
己方交易員額度限制超過



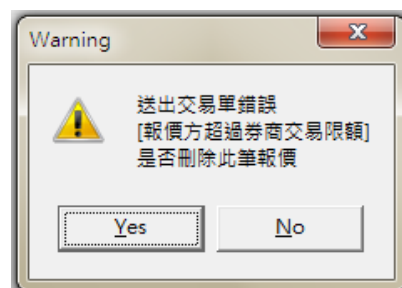
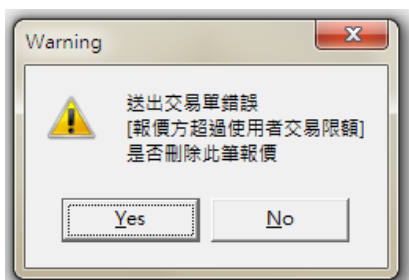
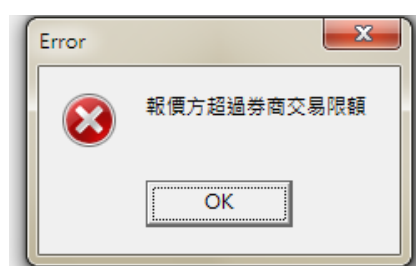
己方交易商額度限制超過



對方交易員額度限制超過



對方交易商額度限制超過



註 解：

1. 當交易方點選交易，如果超出自己的交易限額時，則交易失敗（狀況一）。
2. 當交易方點選交易，如果超出交易商自己當日的交易限額時，則交易失敗（狀況二）。

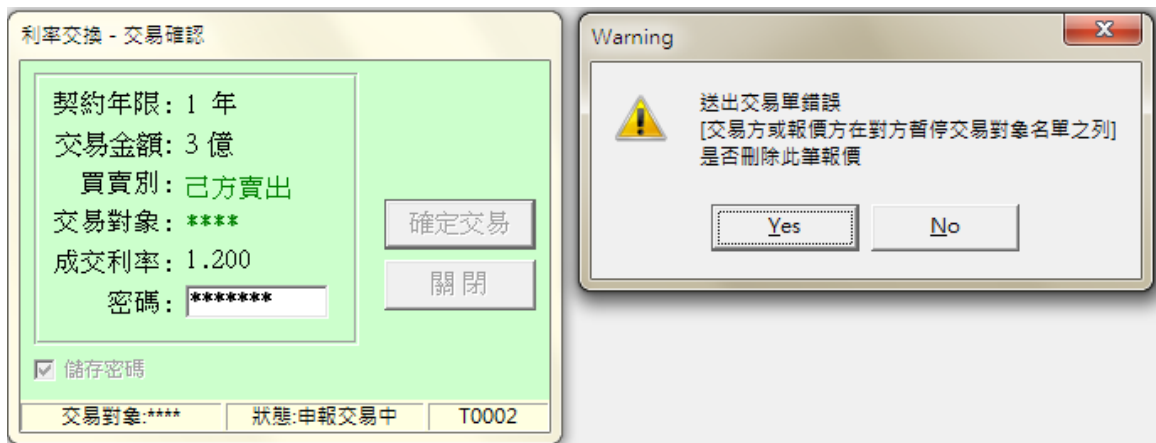
3. 當交易方點選交易，如果超出交易對手交易員的交易限額時，則交易失敗（狀況三）。交易方可自行決定是否自「自己的最佳六筆報價」中刪除(亦即不會自市場上刪除)，或等待報價方變更額度設定。
4. 當交易方點選交易，如果超出交易對手給予的交易商（己方）的交易限額時，則交易失敗（狀況四）。交易方可自行決定是否自「自己的最佳六筆報價」中刪除(亦即不會自市場上刪除)，或等待報價方變更額度設定。
5. 交易員的交易限額，由公司主管設定，可查詢「輔助功能」中的「系統維護」下之「交易額度設定」視窗中「交易員額度」。
6. 證券商的交易限額，由公司主管設定，可查詢「輔助功能」中的「系統維護」下之「交易額度設定」視窗中「交易商額度」。

【交易 / 暫停交易對象】

功能說明：

1. 若報價方以及交易方任一方，於報價方送出報價前，便設定對手為暫停交易對象，則雙方皆無法於交易視窗中取得對手之報價。例如：A 設定 B 為暫停交易對象，則 A、B 皆無法於交易視窗上，看見對方的報價。
2. 若報價方以及交易方任一方，於報價方送出報價後，方設定對手為暫停交易對象，則交易方點選該筆報價將無法成交，但交易方可自行決定是否自「自己的最佳六筆報價」中刪除(亦即不會自市場上刪除)，或等待暫停交易對象設定變更。報價一經刪除，交易方須待報價方重新報價(成交後再報或刪單後再報)，且雙方皆無設定對方為暫停報價對象後，方能再次取得該報價方之報價。

畫面說明：



註 解：

證券商暫停交易對象名單，可由公司主管設定，請查詢「輔助功能」中的「系統維護」下之「券商組合設定」視窗中「特殊組合」。

◎債券選擇權—詢價

功能說明：

開放交易商對市場詢價，請求一個或多個對手交易商提供報價，再決定是否成交。

詢價規則：

1. 得對單一交易商或交易商組合進行詢價，每一個詢價的交易商組合可設定一至六家券商。
2. 被詢價之交易商所回應之買賣申報，詢價之交易券商在 60 秒內確認成交後，即行成交。
3. 被詢價之交易商於詢價之交易商確認成交前，得取消其買賣報價。
4. 被詢價之交易商得自行輸入其回應報價所欲交易之金額。
5. 使用者使用系統登出功能時，系統會自動將該其在市場上的詢價單全數抽回。
6. 交易商欲詢價之對象，如已開啟「不接受詢價」狀態時，對手的詢價視窗會顯示「拒收」。

操作說明：

請至以下頁參考操作說明：

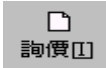
操作說明		頁次
詢價	詢價	24
	刪除	25
	交易	26
被詢價	報價申報	28
	追回申報	30
	不報價	31
	不接受詢價	32
	不顯示詢價	33

【詢價 / 詢價】

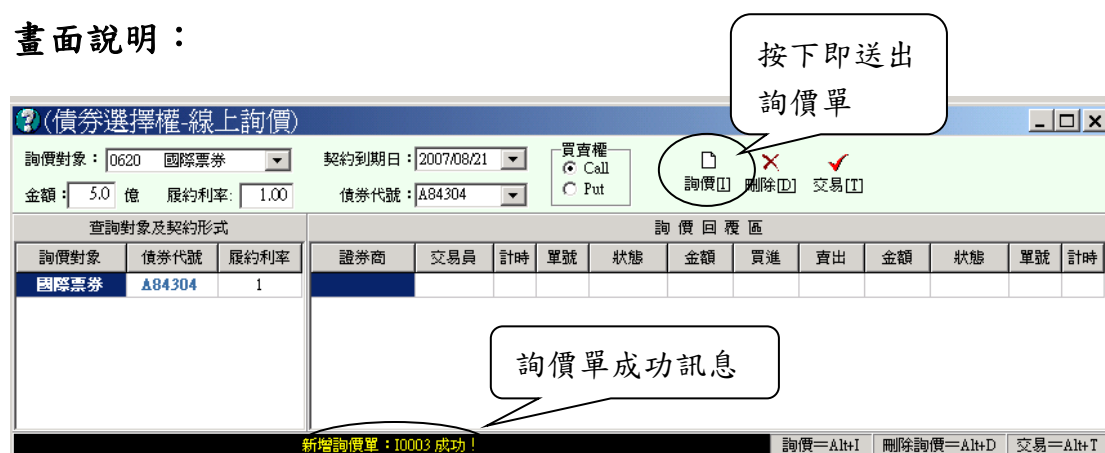
功能說明：

證券商得請單一交易商或一個交易商組合就特定債券期別提供報價。

操作說明：

1. 進入「債券選擇權」選單下執行「詢價」指令，即出現「線上詢價」視窗。
2. 選擇「詢價對象」（可以是單一交易商或是交易商組合）、「契約到期日」、「面額」、「履約利率」、「債券代號」及「買賣權」。
3. 點選  指令，詢價單即送出，等候被詢價方的回覆。

畫面說明：



畫面顯示「債券選擇權-線上詢價」視窗。上方有查詢條件：詢價對象（0620 國際票券）、契約到期日（2007/08/21）、金額（5.0 億）、履約利率（1.00）、債券代號（A84304）。右側有買賣權選擇（Call/Put）。中間有「詢價」、「刪除」、「交易」按鈕，其中「詢價」按鈕被圈出並標註「按下即送出詢價單」。下方有「查詢對象及契約形式」和「詢價回覆區」表格。底部有「新增詢價單：10003 成功！」的訊息。

查詢對象及契約形式			詢價回覆區											
詢價對象	債券代號	履約利率	證券商	交易員	計時	單號	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	單號	計時
國際票券	A84304	1												

註 解：

1. 名詞解釋

證 券 商	回覆詢價之被詢價交易商名稱
交 易 員	回覆詢價之被詢價交易員姓名
計 時	被詢價方回覆之買賣報價，有效時限為 60 秒鐘
單 號	被詢價方回覆之報價單號，由系統自動產生
金 額	被詢價方回覆之可交易金額
狀 態	詢、報價的訊息回應
買 進	被詢價方欲作買進的殖利率波動度
賣 出	被詢價方欲作賣出的殖利率波動度

2. 詢價視窗只能開啟一筆詢價單，如需同時進行多筆詢價，可另開啟新的詢價視窗。

【詢價 / 刪除】

功能說明：

交易商（詢價方）可以刪除已送出的詢價單。

操作說明：

1. 交易商如欲抽回現有的詢價單，得於詢價視窗點選  指令。
2. 原先送出的詢價單抽回後，「查詢對象及契約形式」欄位下將無任何詢價資料。

畫面說明：



【詢價 / 交易】

功能說明：

交易對手如果回覆詢價方的詢價，詢價方可自行選擇是否與之交易。

操作說明：

1. 被詢價方回覆的報價將於「計時」欄位下計時 60 秒鐘，等候詢價方確認交易。
2. 詢價方可在 60 秒鐘之內逕於合意的報價（買進／賣出）欄位以

滑鼠雙擊，或點選  指令進行交易。

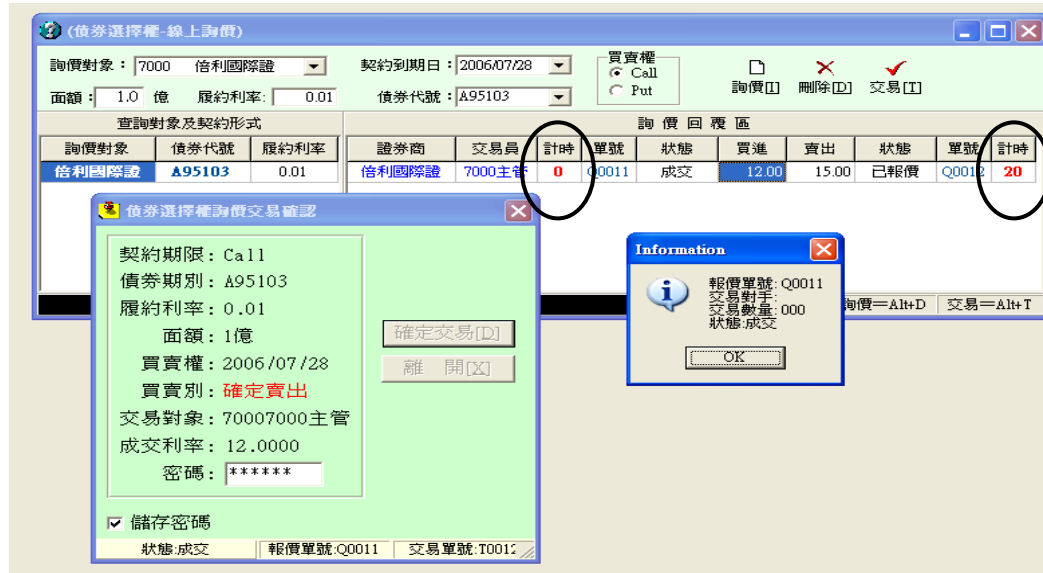
3. 「詢價交易確認」畫面出現後，請輸入密碼，並執行

 指令。

4. 成交後系統回覆成交訊息。

畫面說明：

1. 成交畫面



2. 報價逾時：

被詢價方回覆報價後，詢價方如於 60 秒內無交易指令時，被詢價方系統即自動顯示「報價逾時」，該筆報價逕予取消。

詢價方出現取消報價訊息

收到刪除報價單：Q0003

被詢價方出現報價逾時的訊息

3. 取消報價：

被詢價方回覆報價後，在詢價方無交易指令前，被詢價方在報價後 60 秒內可追回該筆報價，被詢價方系統即自動顯示「取消報價」，該筆報價准予取消。

詢價方出現取消報價訊息

收到刪除報價單：Q0003

被詢價方出現取消報價的訊息

4. 不報價訊息：

詢價方送出詢價單後，被詢價方如以「不報價」回應，詢價方的詢價視窗狀態欄將顯示不報價訊息。

收到詢價單：10005 [證券商：元大京華證 交易員：9800主管]

被詢價方出現不報價的訊息

註 解：

被詢價方如果回應不報價時，詢價方可將該詢價單刪除，或重新送出新的詢價單。

◎債券選擇權—被詢價

【被詢價 / 報價申報】

功能說明：

對於他人的詢價單，被詢價方可自行決定是否提供報價，如有回覆報價經詢價方點選後即行成交。

操作說明：

1. 詢價方發出詢價單後，被詢價方的螢幕會自動跳出詢價回覆視窗。
2. 在「買進」或「賣出」欄位以滑鼠左鍵單點進入後，輸入報價資料，點選 **申報** 鍵送出；或將游標移到「買進」或「賣出」欄位，輸入報價資料後按 Enter 鍵。
3. 被詢價方得依所欲交易金額，變更「金額」欄之金額。
4. 申報成功後，系統將於詢價方與被詢價方兩端同時計時60秒鐘，等候交易。

畫面說明：

時間	單號	證券商	交易員	債券期別	履約利率	契約到期日	Call/Put	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	追回	不報價
16:47:34	10003	國際票券	安惠泉	A96103	001.85	2007/08/21	Call	尚未報價	5			5	尚未報價	0	申報	申報	

收到詢價單：10003 [交易商：國際票券 交易員：安惠泉] 接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

註 解：

詢價回覆視窗之名詞解釋：

時 間	詢價單送出時間
單 號	報價單單號，由系統自動產生
證 券 商	詢價方之交易商名稱
交 易 員	詢價方之交易員姓名
債券期別	詢價之債券選擇權標的

履約利率	詢價之債券選擇權履約利率
契約到期日	債券選擇權的到期日期
面 額	債券選擇權標的債券的面額（契約名目本金）
Call/Put	詢價選擇權之形式，可區分為賣權及賣權
買 進	回覆詢價單－被詢價方欲作買進的殖利率波動度
賣 出	回覆詢價單－被詢價方欲作賣出的殖利率波動度
狀 態	報價回覆的訊息回應區
計 時	60 秒計時顯示器
報 價	送出報價單
追 回	追回報價單
不 報 價	被詢價方回覆詢價方，表示不提供報價

【被詢價 / 追回申報】

功能說明：

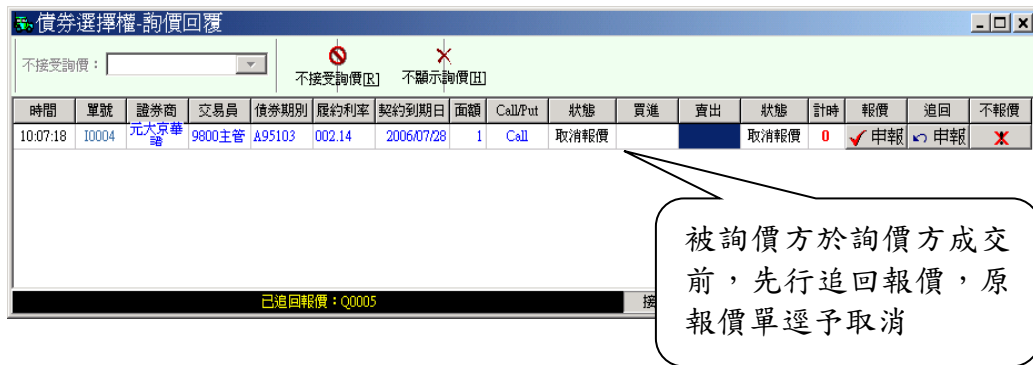
回覆他人詢價而提供的報價，得於詢價方點選成交前（60 秒內），隨時撤回。

操作說明：

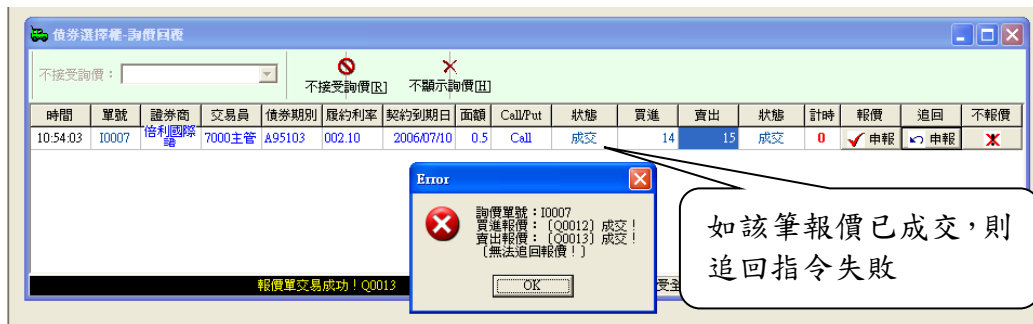
- 報價送出後若欲追回，請執行  申報 指令，追回報價。
- 報價追回成功的狀態顯示將出示於「狀態」欄中。

畫面說明：

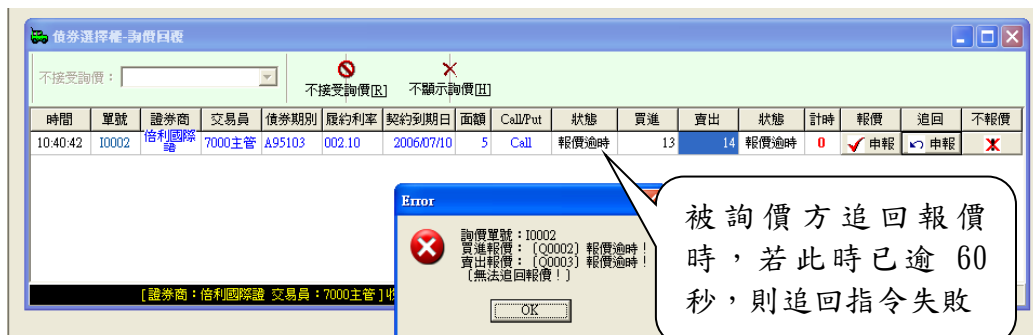
1. 未成交：取消報價



2. 已成交：無法追回報價



3. 報價逾時：無法追回報價



【被詢價 / 不報價】

功能說明：

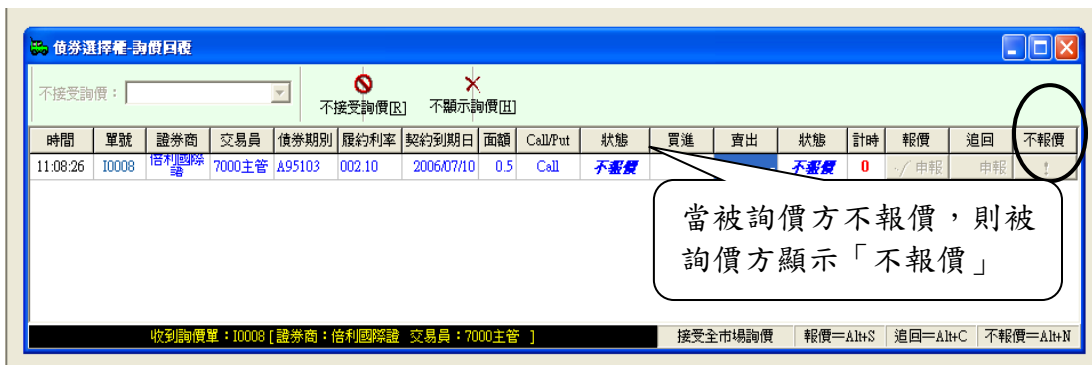
對詢價方的詢價單，被詢價方可自行決定是否提供報價。

操作說明：

若被詢價方不願提供報價，可按下  鍵。

畫面說明：

1. 被詢價方畫面



債券選擇權-詢價回覆

不接受詢價: [] 不顯示詢價 [X]

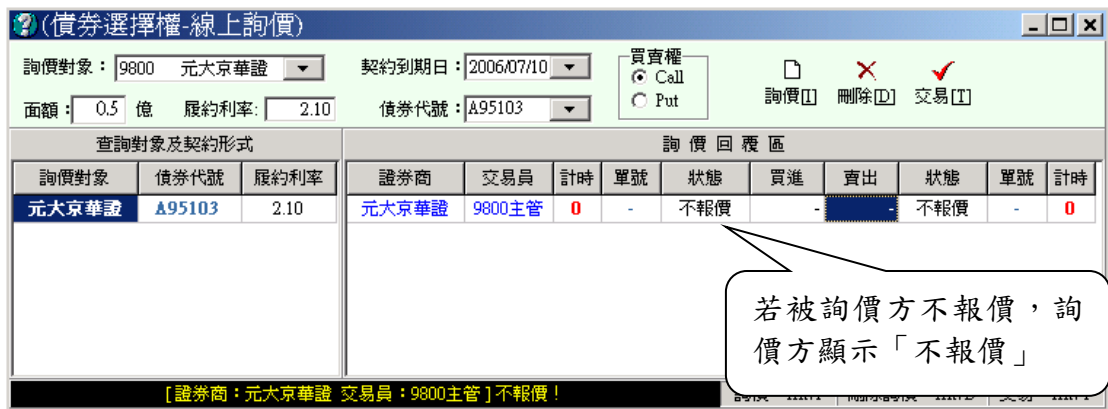
時間	單號	證券商	交易員	債券期別	履約利率	契約到期日	面額	Call/Put	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價	
11:08:26	I0008	倍利國際證	7000主管	A95103	002.10	2006/07/10	0.5	Call	不報價			不報價	0	0	申報	申報	!

收到詢價單: I0008 [證券商: 倍利國際證 交易員: 7000主管]

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

當被詢價方不報價，則被詢價方顯示「不報價」

2. 詢價方畫面



(債券選擇權-線上詢價)

詢價對象: 9800 元大京華證 契約到期日: 2006/07/10 買賣權: ☒ Call ☐ Put

面額: 0.5 億 履約利率: 2.10 債券代號: A95103 詢價 [X] 刪除 [X] 交易 [X]

查詢對象及契約形式			詢價回覆區										
詢價對象	債券代號	履約利率	證券商	交易員	計時	單號	狀態	買進	賣出	狀態	單號	計時	
元大京華證	A95103	2.10	元大京華證	9800主管	0	-	不報價			不報價	-	0	

[證券商: 元大京華證 交易員: 9800主管] 不報價!

若被詢價方不報價，詢價方顯示「不報價」

【被詢價 / 不接受詢價】

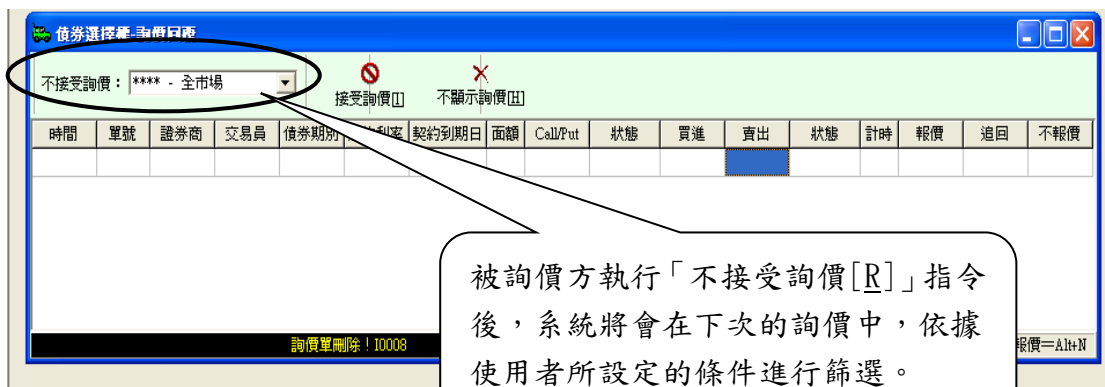
功能說明：

為避免他人干擾，被詢價方可自選拒絕交易的對象，開啟「不接受詢價」狀態。

操作說明：

1. 於詢價回覆視窗中點選 。
2. 在左側「不接受詢價」選單下，選擇拒絕接受詢價的證券商組合後，即可完成設定。

畫面說明：



註 解：

1. 衍生性商品電子交易系統的「輔助功能→系統維護→券商組合設定」功能項下的不接受詢價組合，其原始設定值為「全市場」。
2. 執行「不接受詢價」設定後，在下一次的詢價發生後才會生效。
3. 被詢價方如以不接受詢價回應時，詢價方可將該詢價單刪除，或重新送出新的詢價單。



【被詢價 / 不顯示詢價單】

功能說明：

提供被詢價方將送來的詢價單從畫面上移除。

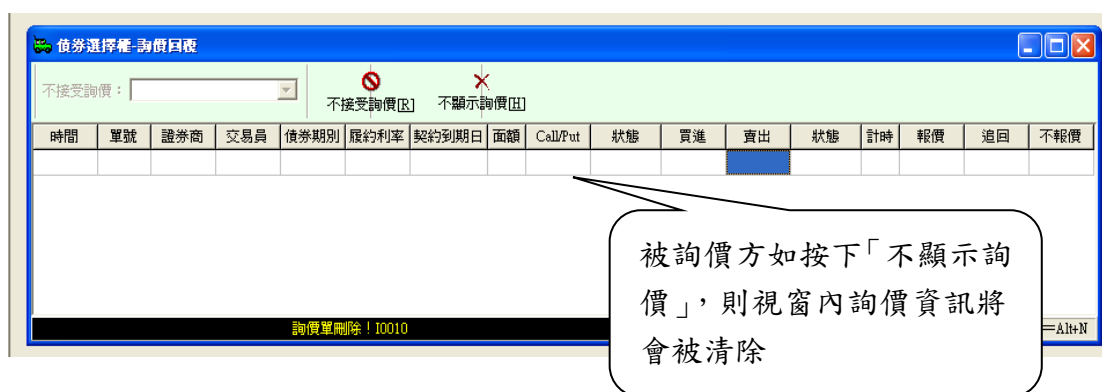
操作說明：

欲將視窗上的詢價單刪除，可直接點選此詢價單後，執行



指令，即可從詢價回覆視窗上移除該筆詢價單。

畫面說明：



註 解：

被詢價方執行



指令時，僅將送來的詢價單從畫面上移除，若關閉視窗再從新開啟，此詢價單仍然存在，且執行「不顯示詢價」指令時，並不會回應對方（詢價方）任何訊息。

◎債券選擇權－成交查詢

功能說明：

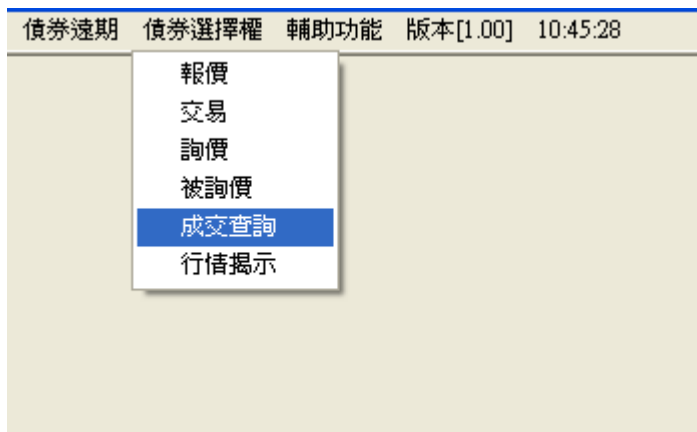
成交狀況查詢，可依使用者的權限，即時查詢當日成交資料。

操作說明：

點選「債券選擇權」，於出現的選單中點選「成交查詢」後，出現「債券選擇權－成交狀況查詢」畫面。

畫面說明：

1. 選擇債券選擇權「成交查詢」功能。



2. 成交狀況查詢：

主管權限者可查詢全部人員成交狀況，其餘使用者僅可查詢自己的成交狀況。

「Delta」欄位逐筆顯示成交交易之 Delta 值，並於「Delta 加總欄」揭示所查詢成交部位之總 Delta 值。

The screenshot shows the '債券選擇權-成交查詢' (Bond Option Transaction Query) window. It includes a search bar with '交易商: 0120 會北富邦銀' and '交易員: 杜宗恩'. Below the search bar are fields for '累計買進' (2.0 億元), '累計賣出' (2.0 億元), '累計成交' (4.0 億元), and '買賣差' (0.0 億元). A 'Delta加總' (Delta Total) field shows '-0.0017'. The '成交日' (Transaction Date) is '2007/08/14'. A table of transactions is displayed with columns: 序號 (Serial Number), 成交時間 (Transaction Time), 成交對象 (Counterparty), 交易員 (Trader), 己方單號 (Own Order Number), 對方單號 (Counterparty Order Number), 債券代號 (Bond Code), 履約利率 (Interest Rate), 標的利率 (Reference Rate), 到期日 (Maturity Date), 買賣權 (Option Type), 買賣別 (Buy/Sell), 波動率 (Volatility), 面額(億) (Notional Amount), 權利金(元) (Premium), 成交編號 (Transaction ID), and Delta. The Delta column is circled, and a callout points to it with the text '選擇欲查詢之交易人員' (Select the trader to query). Another callout points to the 'Delta加總' field with the text '按下即可更新顯示' (Click to refresh display). The bottom status bar says '成交狀況查詢成功!' (Transaction status query successful!).

序號	成交時間	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	債券代號	履約利率	標的利率	到期日	買賣權	買賣別	波動率	面額(億)	權利金(元)	成交編號	Delta
1	14:41:29	國際票券	杜宗恩	T0005	Q0003	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Call	買進	13.00	1.0	29,700	000043	0.184
2	14:41:24	國際票券	杜宗恩	T0004	Q0005	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Put	買進	12.00	1.0	291,300	000042	0.835
3	14:41:06	國際票券	杜宗恩	T0003	Q0004	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Put	賣出	11.00	1.0	285,900	000041	-0.8561
4	14:37:43	國際票券	杜宗恩	T0002	Q0002	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Call	賣出	12.00	1.0	23,900	000040	-0.1646

3. 成交狀況揭示排序：

系統預設為依「成交時間」遞減排序：成交時間在前者，序號排列在後

債券選擇權-成交狀況查詢

交易商：0120 台北富邦銀行 交易員：杜宗恩 查詢 排序 列印 複製

累計買進 2.0 億元 累計成交 4.0 億元 交易員淨額 5 億元 成交日 2007/08/14
 累計賣出 2.0 億元 買賣差 0.0 億元 Delta加權 -0.0017

序號	成交時間	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	債券代號	履約利率	標的利率	到期日	買賣權	買賣別	波動率	面額(億)	權利金(元)	成交編號	Delta
1	14:41:29	國際票券	杜宗恩	T0005	Q0003	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Call	買進	13.00	1.0	29,700	000043	0.184
2	14:41:24	國際票券	杜宗恩	T0004	Q0005	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Put	買進	12.00	1.0	291,300	000042	0.835
3	14:41:06	國際票券	杜宗恩	T0003	Q0004	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Put	賣出	11.00	1.0	285,900	000041	-0.8561
4	14:37:43	國際票券	杜宗恩	T0002	Q0002	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Call	賣出	12.00	1.0	23,900	000040	-0.1646

成交狀況查詢成功！

可利用「排序」功能，進行下列不同欄位排序：成交對象、交易員、債券代號、履約利率、標的利率、到期日、買賣權、買賣別、波動率、面額、權利金、成交時間、成交編號等。排序內容之選擇可分為「主要鍵」、「次要鍵」及「第三鍵」，遞增或遞減排序。

排序

主要鍵：
 ☐ 遞增 ☐ 遞減

次要鍵：
 ☐ 遞增 ☐ 遞減

第三鍵：
 ☐ 遞增 ☐ 遞減

排序

主要鍵：
 ☐ 遞減

次要鍵：
 ☐ 遞增 ☐ 遞減

第三鍵：
 ☐ 遞增 ☐ 遞減

選擇排序
依據

4. 複製：

選擇所要複製的欄位，按下複製，即可複製資料至其他文件（如 Excel）

債券選擇權-成交狀況查詢

交易商：0120 台北富邦銀行 交易員：杜宗恩 查詢 排序 列印 複製

累計買進 2.0 億元 累計成交 4.0 億元 交易員淨額 5 億元 成交日 2007/08/14
 累計賣出 2.0 億元 買賣差 0.0 億元 Delta加權 -0.0017

序號	成交時間	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	債券代號	履約利率	標的利率	到期日	買賣權	買賣別	波動率	面額(億)	權利金(元)	成交編號	Delta
1	14:41:29	國際票券	杜宗恩	T0005	Q0003	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Call	買進	13.00	1.0	29,700	000043	0.184
2	14:41:24	國際票券	杜宗恩	T0004	Q0005	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Put	買進	12.00	1.0	291,300	000042	0.835
3	14:41:06	國際票券	杜宗恩	T0003	Q0004	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Put	賣出	11.00	1.0	285,900	000041	-0.8561
4	14:37:43	國際票券	杜宗恩	T0002	Q0002	A96103	1.87	1.9000	2007/08/21	Call	賣出	12.00	1.0	23,900	000040	-0.1646

成交狀況查詢成功！

選取欄位將反白顯示

◎債券選擇權－行情揭示

功能說明：

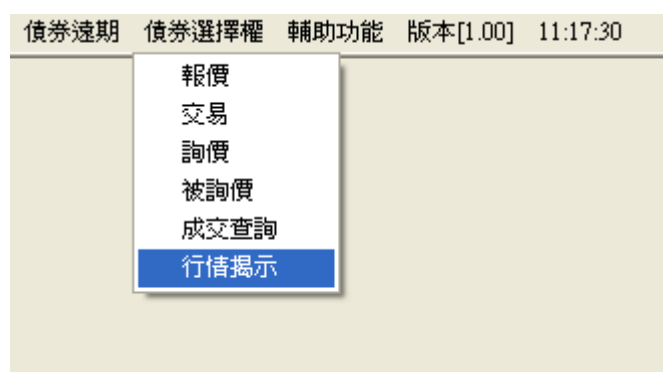
成交行情揭示，即時揭露系統上全市場成交行情。

操作說明：

點選「債券選擇權」，於出現的選單中點選「行情揭示」後，出現「債券選擇權－行情揭示」畫面。

畫面說明：

1. 選擇債券選擇權「行情揭示」功能。



2. 系統預設總覽全部債券市場成交行情

可輸入代號進行搜尋

按下可儲存為 Excel 畫面並設定列印

The screenshot shows the '債券選擇權-行情揭示【顯示全部】' window. It includes a search bar, buttons for '搜尋' (Search), '總覽' (Overview), and '自選' (Selected), and a '成交單位：億元' (Transaction Unit: 100 million Yuan) label. The table displays market data for CALL and PUT options.

選	債券代號	契約期限	履約利率	CALL					PUT				
				最近	變動(%)	最高	最低	累計成交	最近	變動(%)	最高	最低	累計成交
	A95107	01	002.07	10.00	10.00	10.00	10.00	1.0	14.00	14.00	14.00	14.00	1.0
	A95107	01	002.11	12.00	12.00	12.00	12.00	1.0	15.00	15.00	15.00	14.00	2.0
	A95107	01	002.17	12.00	12.00	12.00	12.00	1.0	13.00	13.00	13.00	13.00	1.0
	A95108	01	002.08	13.00	13.00	13.00	13.00	1.0	16.00	16.00	16.00	16.00	1.0

3. 自選行情揭示

可設定僅揭示「自選」債券市場成交行情

可選擇隱藏 Call、Put 行情揭示

點選所要設定揭示的債券

債券選擇權-行情揭示【顯示全部】								
債券:		搜尋	總覽	自選	存檔列印	Call明細	Put明細	
選	債券代號	契約期限	履約利率	最近	變動(%)	最高	最低	累計成交
	A95107	01	002.07	10.00	10.00	10.00	10.00	1.0
☒	A95107	01	002.11	12.00	12.00	12.00	12.00	1.0
☒	A95107	01	002.17	12.00	12.00	12.00	12.00	1.0
	A95108	01	002.08	13.00	13.00	13.00	13.00	1.0

按下「自選」揭示所點選之債券行情

債券選擇權-行情揭示【顯示全部】													
債券:		搜尋	總覽	自選	成交單位: 億元				存檔列印	Call明細	Put明細		
選	債券代號	契約期限	履約利率	最近	變動(%)	最高	最低	累計成交	最近	變動(%)	最高	最低	累計成交
☒	A95107	01	002.11	12.00	12.00	12.00	12.00	1.0	15.00	15.00	15.00	14.00	2.0
☒	A95107	01	002.17	12.00	12.00	12.00	12.00	1.0	13.00	13.00	13.00	13.00	1.0

4. 交易明細

可選擇「Call 明細」或「Put 明細」，查詢該指定債券、履約利率之每 5 分鐘市場成交行情明細

債券選擇權-行情揭示
【顯示全部】

C

P

債券:

搜尋

總覽

自選

成交單位: 億元

存檔列印

Call明細

Put明細

A95107 || 01 || 002.11 || CALL

今日成交資訊

最近成交: - 億元

累計成交: 1.0 億元

前日成交資訊

最高: - 億元 開盤: -

最低: - 平均: - 收盤: -

序號	時間	加權平均	變動(%)	成交面額
21	10:45	-	-	
22	10:50	-	-	
23	10:55	-	-	
24	11:00	12.00	12.00	1
25	11:05	-	-	
26	11:10	-	-	

◎債券遠期

選單說明：

選單項目	功能說明	頁次
報價	報價輸入，提供使用者選擇交易條件及報價對象，進行線上即時報價	39
交易	交易輸入，使用者可查詢各債券不同天期之報價狀況及進行成交	48
詢價	線上詢價，提供使用者送出詢價訊息，請求一個或多個交易對象提供報價，經回覆報價後，使用者可決定是否成交	53
被詢價	被詢價訊息，使用者可得知被詢價之訊息，並決定是否輸入報價以回覆詢價	62
成交查詢	成交狀況查詢，可依使用者的權限，即時查詢當日成交資料	66
行情揭示	成交行情揭示，即時揭露系統上全市場最新的債券遠期成交行情，做為使用者調整買賣決策的重要參考資訊	68

◎債券遠期－報價

功能說明：

提供使用者可選擇交易條件及報價對象，進行線上即時報價。開啟報價視窗時，報價視窗一律帶出交易員「最近一次報價的債券期別」。

報價規則：

1. 店頭衍生性金融商品電腦交易系統中債券遠期之交易時間為上午 9:00 至下午 1:30，且提前於上午 8:30 起開放輸入報價資料。
2. 報價輸入以殖利率為之，每一交易單位為新台幣 5,000 萬元整。
3. 報價數量必須為 1 至 9 交易單位。
4. 使用者之買賣申報，應依債券代號、報價對象、殖利率、買賣數量、買賣別、契約天期等事項逐一選擇或輸入，經系統接受後，即透過傳輸系統依序傳送至交易畫面，其修改時亦同。

5. 使用者得自選對象提供報價，但同一金融機構之總、分支機構間或分支機構相互間不得為成交對象。
6. 進行雙向報價時，買進殖利率不得低於賣出殖利率。
7. 「穿價」警示：使用者所報價格優於市場相對報價之最佳報價時，系統將提醒使用者，但經使用者確認，仍可傳輸該報價。
8. 報價輸入視窗只能開啟一個，當選擇視窗關閉時，如使用者尚有報價單未做刪除，則系統僅以最小化處理，俾提醒使用者報價單仍有效、有被成交之可能。
9. 使用者執行「系統登出」功能時，系統會自動將其在系統上的報價單全數抽回。

名詞說明：

名詞	說明
債券代號	報價方選擇欲報價之單一債券期別
報價對象	報價方選擇單一對象、特定對象組合或全市場報價
隱名	報價方選擇是否顯示公司名稱
量	報價方輸入報價數量
買	報價方輸入未來買入債券願支付之殖利率
賣	報價方輸入未來賣出債券欲收取之殖利率
1 週、2 週、3 週、4 週	報價方選擇欲報價之契約天期別

【報價 / 新增報價】

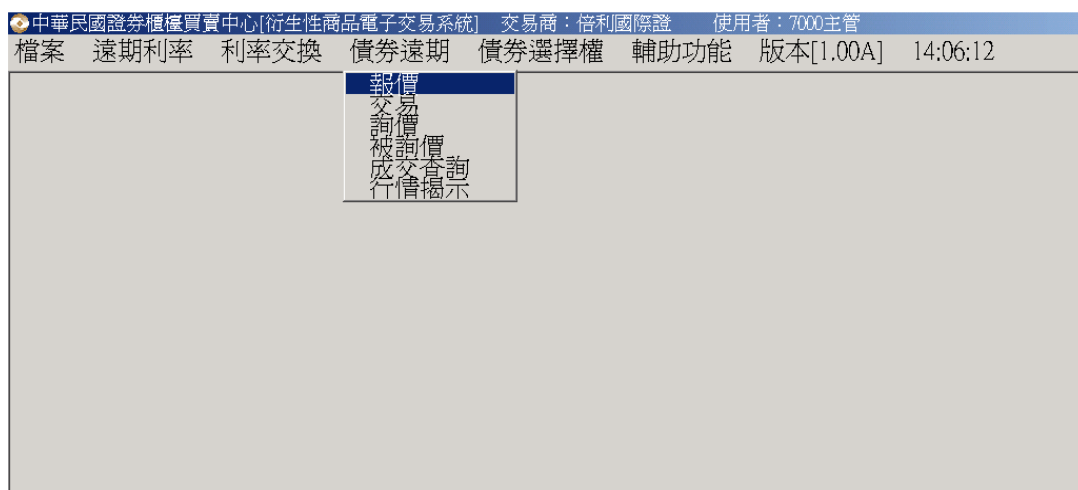
操作說明：

1. 點選「債券遠期」，於出現的選單中點選「報價」後，出現「報價輸入」畫面。
2. 在報價輸入畫面中，可以用 Enter 鍵、上下左右鍵盤鍵或滑鼠直接點選的方式，切換欄位；欲新增報價時，按鍵盤上的向下「↓」鍵，即可新增一行。
3. 選擇欲報價之債券代號、報價對象，於欲報價之契約天期下，輸入報價數量及買賣報價並按 Enter 鍵，即可完成報價。注意報價數量及買賣報價兩個欄位，須從斜體字轉變為正體字，才表示該筆報價訊息已經完整送出（已經完成報價）。
4. 點選畫面右上角 1 2 3 4，選擇不顯示之契約天期欄位；亦可按滑鼠右鍵出現下拉式選單，以逐項勾選的方式，自行選擇要揭示哪些欄位。
5. 如欲隱名報價，連點二下、勾選「隱名」欄之☐；如欲具名報價，

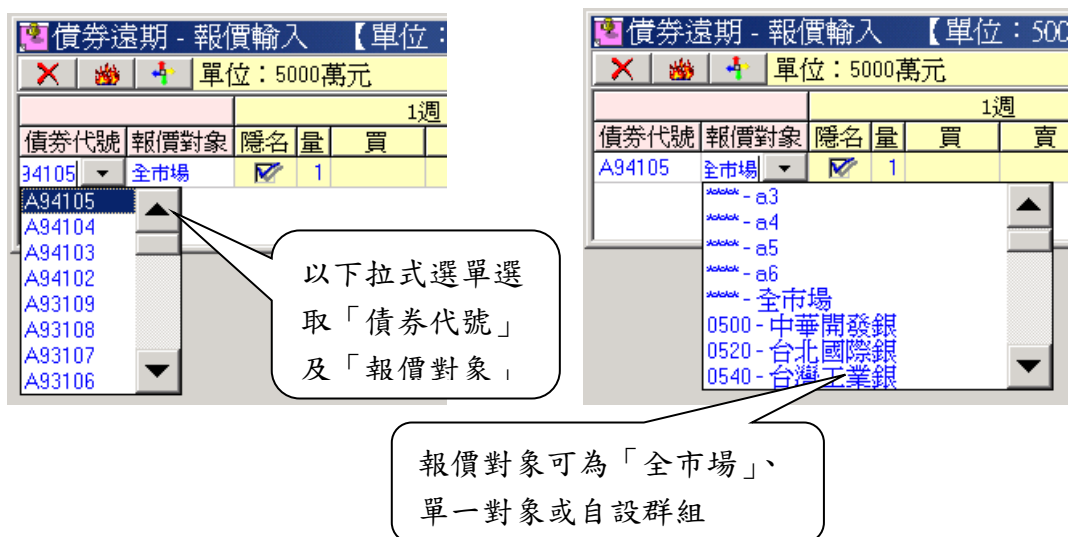
則連點二下、取消「隱名」欄之勾選。

畫面說明：

1. 選擇債券遠期「報價」功能



2. 選取「債券代號」及「報價對象」



※「全市場」：已簽訂契約之合格交易對象全體。

※ 自設群組：如要同時對一群交易對象報價，必須先在「系統維護」功能項下設定報價對象群組，且可設定多個群組。

3. 輸入報價

債券遠期 - 報價輸入 【單位：5000萬元】 1 2 3 4 x

單位：5000萬元

債券代號	報價對象	1週				2週				3週				4週				
		隱名	量	買	賣	隱名	量	買	賣	隱名	量	買	賣	隱名	量	買	賣	
A84304	全市場	☒	1	1.5000	1.4000	☒	1			☒	1			☒	1			☒
A94105	全	☒	1			☒	1			☒	1	1.4500	1.4300	☒	1			☒
A94104	德意志銀行	☒	1			☒	1	1.8550	1.7550	☒	1			☒	1			☒

可點選不欲顯示之天期欄位

【報價 / 修改報價】

操作說明：

1. 以滑鼠左鍵單點欲修改的數量欄或報價欄（或以「↑、↓、←、→」鍵盤鍵的方式移動），進入修改狀態。
2. 輸入新的數量或殖利率。
3. 按 Enter 鍵，即完成報價或數量的修改。

畫面說明：

債券遠期 - 報價輸入 【單位：5000萬元】 1 2 3 4 x

單位：5000萬元

		1週			
債券代號	報價對象	隱名	量	買	賣
A94105	全市場	☒	1	1.5200	1.5000

移至欲修改欄位，呈報價狀態（淺綠色）

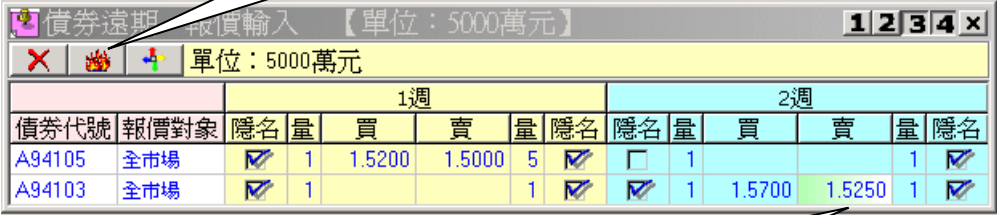
【報價 / 刪除報價】

操作說明：

1. 刪除買價或賣價：將游標移至「報價輸入」視窗中欲刪除報價的欄位，或以滑鼠點選欲刪除之報價後，點選左上角的  鍵，該筆報價即被刪除；亦可以按下鍵盤上的「Delete」鍵，進行報價刪除。
2. 刪除全部報價資料：點選視窗左上角的  鍵，將所有報價單（數列多筆）一次刪除。當市場行情驟變，為免逐筆改價或抽單不及，可利用此功能。

畫面說明：

刪除全部報價



移至欲刪除之欄位，點選  或「Delete」鍵，即可刪除該欄位內容

債券代號	報價對象	1週				2週							
		隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A94105	全市場	☒	1	1.5200	1.5000	5	☒	☐	1			1	☒
A94103	全市場	☒	1			1	☒	☒	1	1.5700	1.5250	1	☒

【報價 / 結束報價】

操作說明：

1. 若「報價輸入」視窗中仍有報價資料，按視窗右上角之後，其視窗僅會以最小化處理，以提醒使用者報價單仍存在。
2. 當報價輸入視窗中無任何報價資料時，按之後，其視窗才可完全關閉。

畫面說明：

債券遠期 - 報價輸入 【單位：5000萬元】 1 2 3 4 x													
單位：5000萬元													
		1週						2週					
債券代號	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A94105	全市場	☒	1	1.5200	1.5000	5	☒	☐	1			1	☒
A94103	全市場	☒	1			1	☒	☒	1	1.5700	1.5250	1	☒



仍有報價，按，僅將視窗最小化

無報價資料，按，關閉視窗

債券遠期 - 報價輸入 【單位：5000萬元】 1 2 3 4 x													
單位：5000萬元													
		1週						2週					
債券代號	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A94105	全市場	☒	1			1	☒	☐	1			1	☒
A94103	全市場	☒	1			1	☒	☒	1			1	☒

【報價 / 報價未成功之情形】

1. 買進利率低於賣出利率：須重新報價

債券遠期 - 報價輸入 【單位：5000萬元】

單位：5000萬元

債券代號	報價對象	隱名	1週				2週					
			量	買	賣	量	隱名	量	買	賣	量	隱名
A94105	全市場	☒	1	1.5000	1.5500	1	☒	1			1	☒
A94105	倍利國際證	☒	1			1	☒	1			1	☒

Error

利率不正確，
賣出利率須小於或等於買進利率！

OK

按 或 鍵，即可重新輸入正確報價

2. 報價超過所設定之漲跌幅限制：

(1) 報價超過「個人」漲跌幅限制，將出現警示訊息，可選擇修改或確定報出。

修改報價失敗,原因:報價超過自訂利率漲跌幅限制

單位：5000萬元

債券代號	報價對象	隱名	1週				2週					
			量	買	賣	量	隱名	量	買	賣	量	隱名
A94105	全市場	☒	1	2.5000		1	☒	1			1	☒
A94105	倍利國際證	☒	1			1	☒	1			1	☒

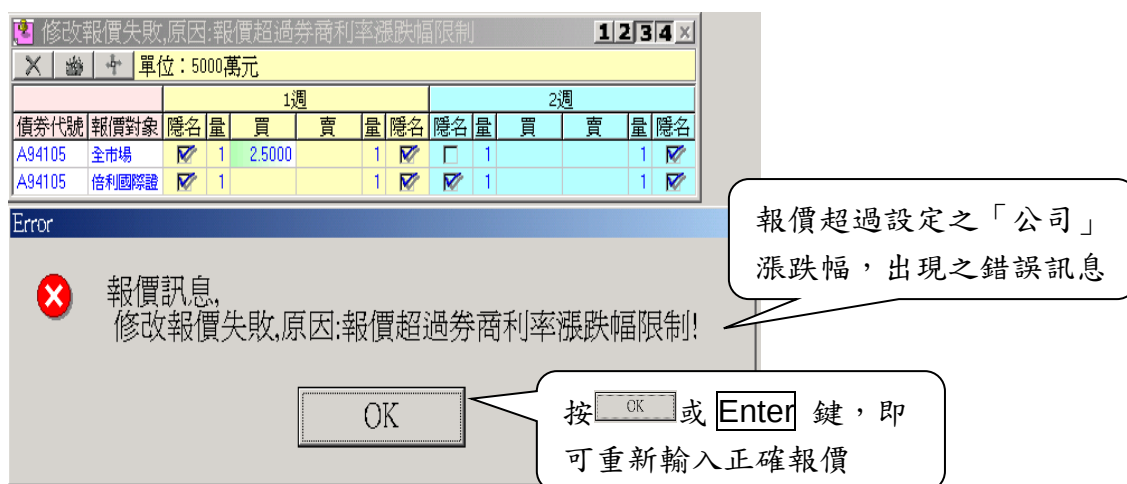
報價訊息

修改報價失敗,原因:報價超過自訂利率漲跌幅限制
確定以 2.5000 申報？

Yes No

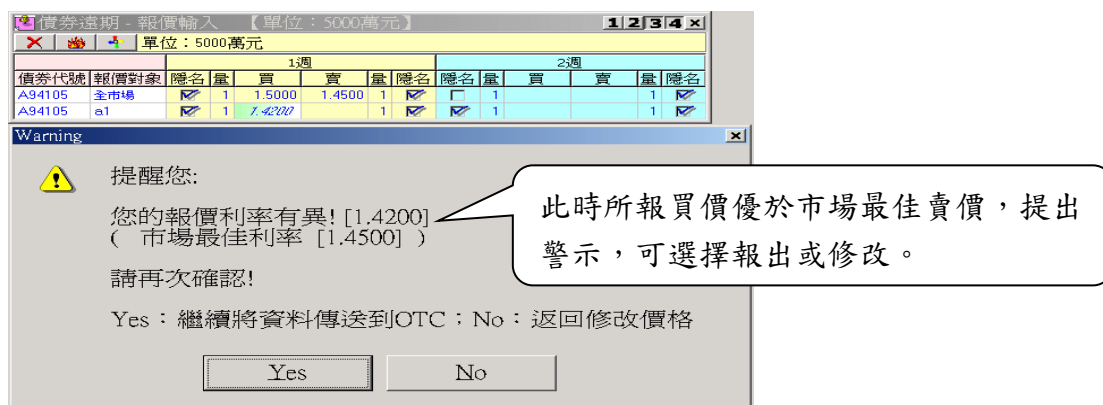
報價超過設定之「個人」漲跌幅警示

(2) 報價超過「公司」漲跌幅限制，將出現報價錯誤訊息，須重新報價。



※「報價範圍」由交易商自行於功能表「輔助功能」項下「系統維護」－「報價範圍設定」內設定各商品契約公司及個人報價漲跌幅範圍。

3. 「穿價」警示



◎債券遠期—交易

功能說明：

使用者可查詢各債券不同天期之報價狀況及進行成交。

交易規則：

1. 證券商得自選對象成交，但同一金融機構之總、分支機構間或分支機構相互間不得為成交對象。
2. 交易視窗之報價均為確定報價，經點選即行成交。

操作說明：

1. 點選「債券遠期」，於出現的選單中點選「交易」後，出現線上交易視窗。
2. 將游標移至「交易」視窗中，按滑鼠右鍵即出現下拉式選單，自選單中「選擇債券」項下，點選欲查詢之債券期別。
 - (1)查詢單一債券：選擇單一債券，交易畫面將揭示該期債券的最佳六筆報價，並以不同顏色區隔不同的利率（即相同的報價則以相同的顏色標記），如不足六筆則先以空白列顯示，當有新報價產生將即時補空。
 - (2)查詢全部債券：選擇全部債券，交易畫面僅揭示每一期債券的最佳一筆報價。
3. 建議先從滑鼠右鍵下拉式選單的「記憶密碼」項下，將密碼記憶住（亦即登入等殖系統時之密碼），避免每次點選交易時需反覆輸入密碼的困擾。
4. 可同時開啟數十個交易視窗，滿足業者一期債券使用一個交易視窗揭示之需求。

畫面說明：

1. 單一債券最佳 6 筆報價

債券代號	交易商	數量	1週買	1週賣	數量	交易商
A94105	****	1	1.3400	1.2500	1	****
A94105	****	1	1.3600	1.2300	1	****
A94105	****	1	1.3700	1.2100	1	****
A94105	****	1	1.3900	1.2000	1	****
A94105	****	1	1.4000			
A94105	****	1	1.5000			

以不同顏色區別不同報價

債券代號	交易商	數量	1週買	1週賣	數量	交易商
A84304	****	1	1.4500	1.2700	1	****
A84304	****	1	1.4800	1.2500	1	****
A84304	****	1	1.4800	1.2300	1	****
A84304	****	1	1.5000	1.2000	1	****
A84304						
A84304						

相同報價以相同顏色顯示，不足 6 筆者，保留空白列

2. 全部債券最佳 1 筆報價

債券遠期交易 [全部債券]																			
債券代號	交易商	數量	1週買	1週賣	數量	交易商	數量	2週買	2週賣	數量	交易商	數量	3週買	3週賣	數量	交易商	數量	4週買	4週賣
A84304	****	1	1.4500	1.2700	1	****													
A86310						利國際	1	1.3550	1.2550	1	****								
A94103						****	1	1.2650	1.2450	1	****						****	1	2.5000
A94104											利國際	1	2.1250	2.0000	1	利國際			
A94105	****	1	1.3400	1.2500	1	****													

交易商
「****」即為
報價方選擇
隱名，故不顯

【交易 / 點選報價】

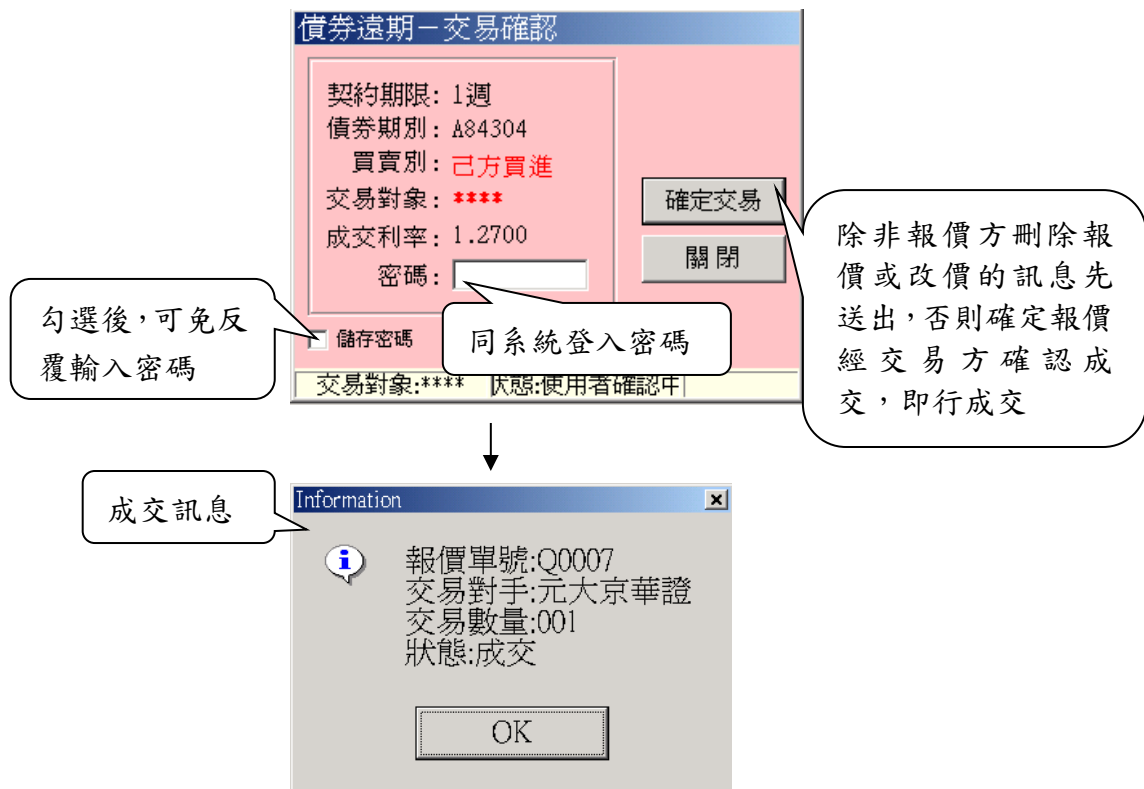
功能說明：

於交易畫面點選合意之報價，經檢核使用者密碼無誤後，系統執行交易額度比對，額度符合，即行成交。

操作說明：

1. 以滑鼠左鍵在合意的報價框連點兩下，系統即出現「交易確認」對話框，輸入密碼後，點選「確定交易」指令（或按 Enter），即行成交。
2. 記憶密碼：可依前述「記憶密碼」方式先行記憶，或勾選「交易確認」對話框中左下角的「儲存密碼」，可免每次點選交易時需反覆輸入密碼的手續。

畫面說明：

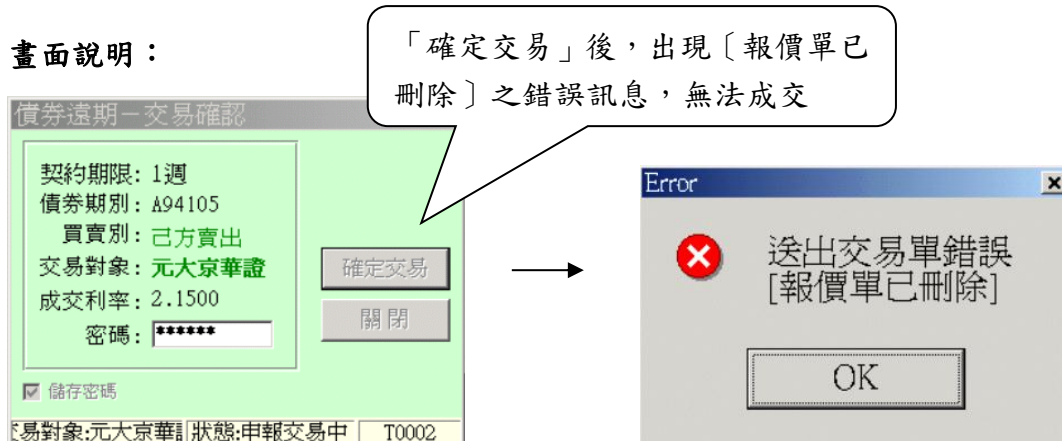


【交易 / 交易未成功之情形】

1. 成交前報價經刪除或修改

報價單於成交前，報價方得任意修改或刪除報價。報價方在交易方送出「交易確認」對話框之「確定交易」指令時，若已先行一步執行刪除報價或改價，系統將以「取消交易」方式處理，畫面會出現「報價單已刪除」或「報價單已修改」的訊息通知交易方，並抽回該筆報價。

畫面說明：



註解：

1. 於交易出現「報價單已刪除」或「報價單已修改」訊息時，須以滑鼠左鍵點選「OK」指令或按 Enter 鍵，關閉訊息畫面，回到交易輸入模式中。
2. 報價方如執行「系統登出」或發生線路中斷時，系統將抽回其所有的報價單。

2. 搶單失敗

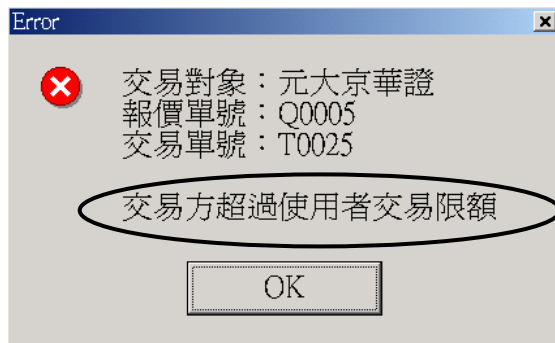
2 家以上交易商點選同一報價單，有一家居先確認交易成功，則其他交易商將接收到訊息，顯示交易失敗。

3. 超過交易限額

當報價方、交易方超出當日「交易商額度」或「交易員額度」時，系統將以取消交易方式處理，雙方交易失敗。

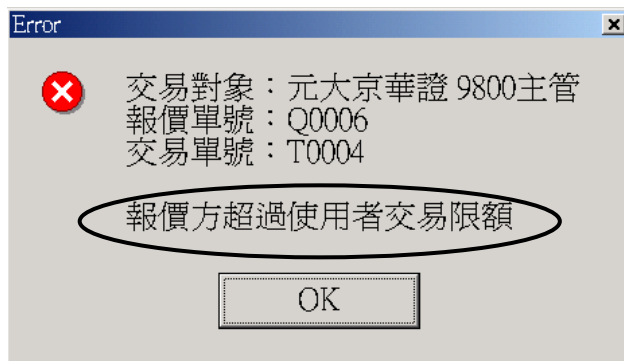
畫面說明：

超出交易方交易限額



超出報價方交易限額

債券遠期交易 [全部債券]											
債券代號	交易商	數量	1週買	1週賣	數量	交易商	交易商	數量	2週買	2週賣	數量
A90103				2.1450	9	元大京華					



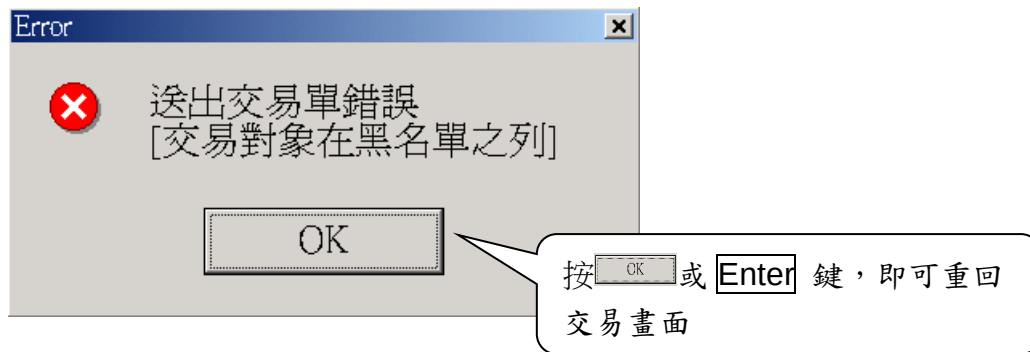
債券遠期交易 [全部債券]											
債券代號	交易商	數量	1週買	1週賣	數量	交易商	交易商	數量	2週買	2週賣	數量
A90103											

系統自動抽回報價

註解：

1. 當交易方點選交易時，如果超出己方當日「交易商額度」或「交易員額度」，則交易失敗。
2. 當交易方點選交易時，如果超出報價方「交易商額度」或「交易員額度」，則交易失敗，且系統自動抽回該筆報價。
3. 「交易商額度」及「交易員額度」，由各公司有權人員設定並維護，使用者可利用「系統維護」中的「交易額度設定」視窗查詢額度。

4. 點選「交易黑名單」之報價



5. 點選自家報價



◎債券遠期－詢價

功能說明：

線上詢價，提供使用者送出詢價訊息，請求一個或多個交易對象提供報價，經回覆報價後，使用者可決定是否成交。

詢價規則：

1. 得對單一對象或一群對象組合詢價，每一個詢價的對象組合可設定一至六家交易對象。
2. 債券遠期交易契約到期日不得超過一年。
3. 被詢價方所回應之買賣申報為確定報價，詢價方在 60 秒內確認成交後，即行成交。
4. 被詢價方於詢價方確認成交前，得取消其買賣報價。
5. 使用者使用系統登出功能時，系統會自動將該其在市場上的詢價單全數抽回。
6. 詢價方欲詢價之對象，如已開啟「不接受詢價」狀態時，詢價方的詢價視窗會顯示「拒收」。

名詞說明：

名詞	說明
交易商	回覆詢價之被詢價公司名稱
交 易 員	回覆詢價之被詢價公司交易員姓名
計 時	被詢價方回覆之買賣報價，有效時限為 60 秒鐘
單 號	被詢價方回覆之報價單號，由系統自動產生
狀 態	詢、報價的訊息回應
買 進	被詢價方所報買進的殖利率
賣 出	被詢價方所報賣出的殖利率

【詢價/詢價】

功能說明：

證券商得請單一交易商或一個交易商組合就特定債券期別提供報價。

操作說明：

1. 點選「債券遠期」，於出現的選單中點選「詢價」後，出現「線上詢價」視窗。
2. 選擇「詢價對象」（單一對象或是對象組合）、「契約到期日」及「債券代號」，並輸入「交易金額」。
3. 點選「詢價〔I〕」，詢價單即送出，等候被詢價方之回覆。
4. 詢價視窗只能傳輸一筆詢價單，如需同時進行多筆詢價，可另開啟新詢價視窗。

畫面說明：

?(債券遠期-線上詢價)

詢價對象：**** aal 契約到期日：2006/ 6/16

交易金額：0.5 億 債券代號：A94105

詢價[I] 刪除[D] 交易[T]

查詢對象及契約形式			詢 價 回 覆 區									
詢價對象	契約到期日	債券期別	證券商	交易員	計時	單號	狀態	買進	賣出	狀態	單號	計時
aal	2006/06/16	A94105										

新增詢價單：10002 成功！

詢價=Alt+I 刪除詢價=Alt+D 交易=Alt+T

【詢價/刪除】

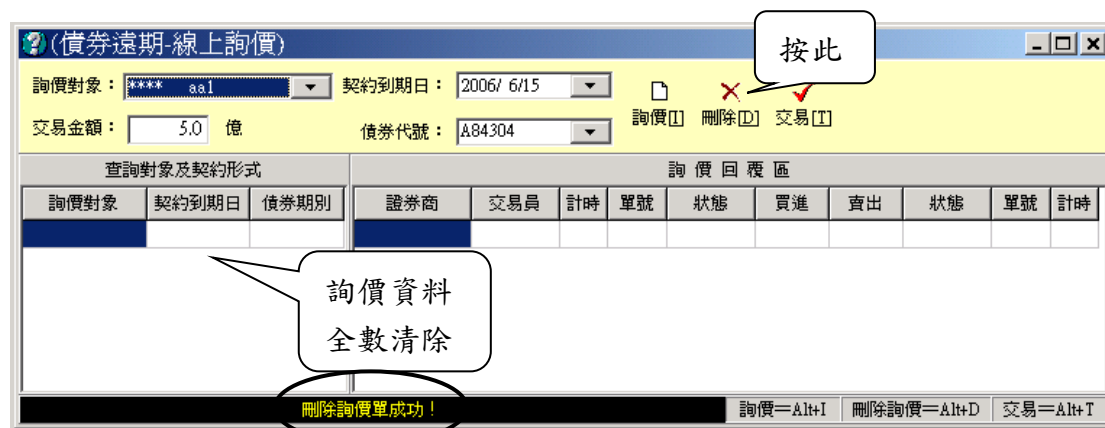
功能說明：

詢價方可以刪除已送出之詢價單。

操作說明：

1. 詢價方如欲抽回已新增成功之詢價單，得於詢價視窗點選 。
2. 詢價單抽回後，「查詢對象及債券代號」欄位下將無任何詢價資料。

畫面說明：



畫面顯示「債券遠期-線上詢價」系統介面。上方有查詢條件欄位，包括「詢價對象」(aaaa aal)、「契約到期日」(2006/ 6/15)、「交易金額」(5.0 億) 和「債券代號」(A84304)。右側有「詢價」(圖示)、 (刪除) 和「交易」(圖示) 按鈕。上方有一個叫話框指向刪除按鈕，標註「按此」。

查詢對象及契約形式			詢 價 回 覆 區									
詢價對象	契約到期日	債券期別	證券商	交易員	計時	單號	狀態	買進	賣出	狀態	單號	計時
詢價資料全數清除												

畫面底部有一條黃色訊息欄，顯示「刪除詢價單成功！」。右側有快捷鍵提示：「詢價=Alt+I」、「刪除詢價=Alt+D」、「交易=Alt+T」。

【詢價/交易】

功能說明：

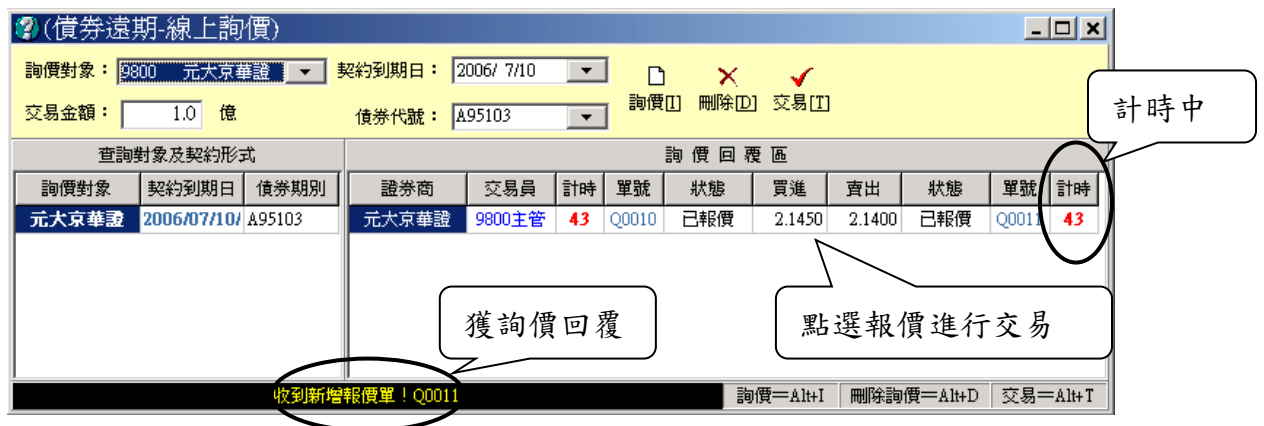
詢價方獲詢價回覆後，可自行選擇是否執行交易。

操作說明：

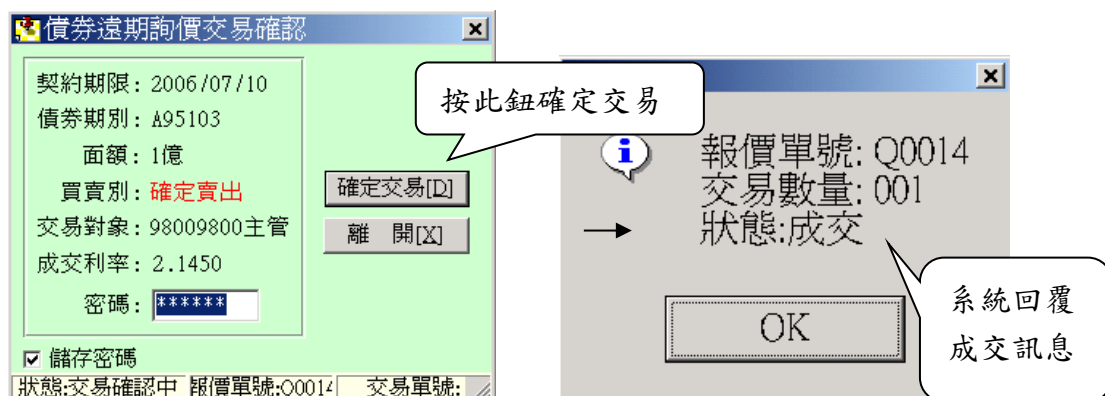
1. 被詢價方回覆的報價將於「計時」欄位下計時 60 秒鐘，等候詢價方確認交易。
2. 詢價方可在 60 秒鐘之內逕於合意的報價（買進／賣出）欄位以滑鼠點選，或點選  進行交易。
3. 「詢價交易確認」畫面出現後，請輸入密碼，並執行「確定交易」指令。
4. 成交後系統回覆成交訊息。

畫面說明：

1. 詢價獲回覆



2. 成交畫面



3. 報價逾時

被詢價方回覆報價後，詢價方如於 60 秒內無交易指令時，詢價方的詢價視窗「狀態」欄顯示「取消報價」；被詢價方系統即自動於被詢價視窗「狀態」欄顯示「報價逾時」，該筆報價逕予取消。

(債券遠期-線上詢價)

詢價對象: 9800 元大京華證 契約到期日: 2006/ 7/10
 交易金額: 1.0 億 債券代號: A95103

查詢對象及契約形式

詢價對象	契約到期日	債券期別
元大京華證	2006/07/10	A95103

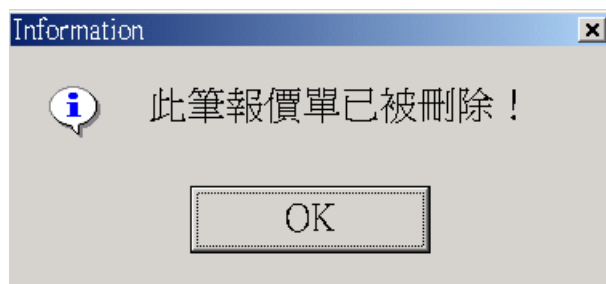
詢價回覆區

證券商	交易員	計時	單號	狀態	買進	賣出	狀態	單號	計時
元大京華證	9800主管	0	Q0013	取消報價	-	-	取消報價	Q0013	0

收到刪除報價單! Q0013

詢價=Alt+I 刪除詢價=Alt+D 交易=Alt+T

若詢價方於「詢價交易確認」畫面執行「確定交易」指令前，已達計時 60 秒，按下「確定交易」後，將接收到「此筆報價單已被刪除」之訊息。



4. 取消報價

詢價方確認成交前，被詢價方得抽回其報價。詢價方的詢價視窗「狀態」欄顯示「取消報價」。

5. 不報價訊息

詢價方送出詢價單後，被詢價方如以「不報價」回應，詢價方的詢價視窗「狀態」欄將顯示「不報價」訊息。

(債券遠期-線上詢價)

詢價對象：9800 元大京華證 契約到期日：2006/ 7/10 交易金額：1.0 億 債券代號：A95103 詢價 刪除 交易

查詢對象及契約形式			詢 價 回 覆 區									
詢價對象	契約到期日	債券期別	證券商	交易員	計時	單號	狀態	買進	賣出	狀態	單號	計時
元大京華證	2006/07/10/	A95103	元大京華證	9800主管	0	-	不報價		-	不報價	-	0

[證券商：元大京華證 交易員：9800主管] 不報價！ 詢價=Alt+I 刪除詢價=Alt+D 交易=Alt+T

※ 詢價方接收到不報價訊息後，可刪除該詢價單。若按下「詢價」鈕，將重送該報價單。

6. 超時未成交

債券遠期-詢價回覆

不接受詢價： 不接受詢價 不顯示詢價

時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
17:11:43	I0008	倍利國際證	7000主管	A95103	2006/07/10	1	成交失敗	2.145	2.14	成交失敗	0	✓ 申報	↶ 申報	✗

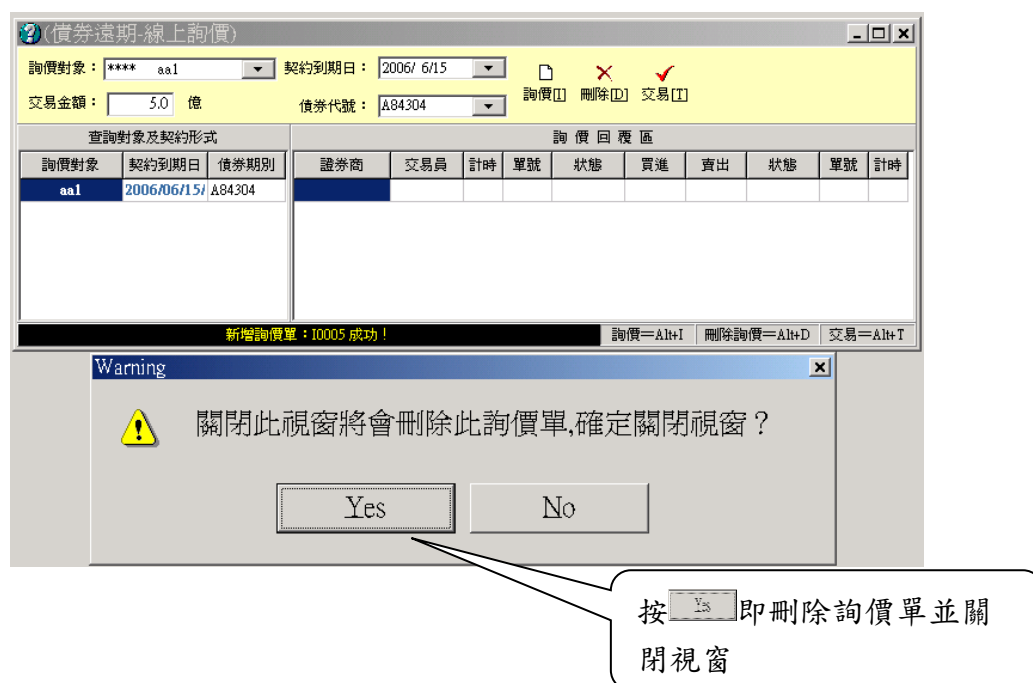
[證券商：倍利國際證 交易員：7000主管] 收到新增報價：Q0021 接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

【詢價/結束】

操作說明：

1. 若「線上詢價」視窗中仍有詢價資料，按視窗右上角之後，將出現提醒訊息「關閉此視窗將會刪除此詢價單，確定關閉視窗？」，選擇則刪除詢價單並關閉視窗。
2. 當「線上詢價」視窗中無任何報價資料時，按之後，視窗立即關閉。

畫面說明：



◎債券遠期—被詢價

【被詢價/報價申報】

功能說明：

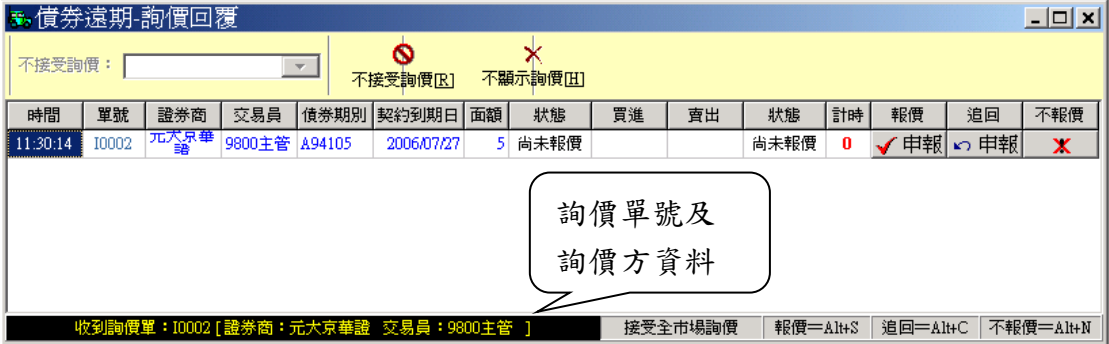
對於他人的詢價單，被詢價方可自行決定是否提供報價，如有回覆報價時，則視同確定報價，經詢價方點選後即行成交。

操作說明：

1. 詢價方發出詢價單後，被詢價方的螢幕會自動跳出「詢價回覆」視窗。
2. 在「買進」或「賣出」欄位以滑鼠左鍵單點進入後，輸入報價資料，點選報價  申報 鍵送出；或將游標移到「買進」或「賣出」欄位，輸入報價資料後按 Enter 鍵。
3. 申報成功後，系統將於詢價方與被詢價方兩端同時計時 60 秒鐘，等候交易。

畫面說明：

1. 「詢價回覆」視窗自動跳出



時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
11:30:14	I0002	元大京華	9800主管	A94105	2006/07/27	5	尚未報價			尚未報價	0	申報	申報	申報

詢價單號及
詢價方資料

收到詢價單：I0002 [證券商：元大京華 交易員：9800主管]

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

2. 報價輸入

債券遠期-詢價回覆

不接受詢價: [] 不接受詢價 [X] 不顯示詢價 [X]

時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
11:30:14	I0002	元大京華證	9800主管	A94105	2006/07/27	5	尚未報價	2.1		尚未報價	0	✓ 申報	↶ 申報	✗

藍底狀態即可輸入報價

收到詢價單: I0002 [證券商: 元大京華證 交易員: 9800主管]

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

3. 報價完成

債券遠期-詢價回覆

不接受詢價: [] 不接受詢價 [X] 不顯示詢價 [X]

時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
11:30:14	I0002	元大京華證	9800主管	A94105	2006/07/27	5	已報價	2.1	2	已報價	6	✓ 申報	↶ 申報	✗

[證券商: 元大京華證 交易員: 9800主管] 收到新增報價: Q0003

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

註解:

名詞	說明
時間	詢價單送出時間
單號	報價單單號, 由系統自動產生
交易商	詢價方之交易商名稱
交易員	詢價方之交易員姓名
債券期別	詢價之債券標的
契約到期日	詢價之交易到期日
面額	詢價之交易債券面額
狀態	報價回覆的訊息回應區
買進	回覆詢價單—被詢價方欲作買進的殖利率
賣出	回覆詢價單—被詢價方欲作賣出的殖利率
計時	60 秒計時顯示器

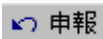
報價	送出報價單
追回	追回報價單
不報價	被詢價方回覆詢價方，表示不提供報價

【被詢價/追回申報】

功能說明：

回覆他人詢價而提供的報價，得於詢價方確認成交前（60 秒內），隨時撤回。

操作說明：

1. 報價送出後若欲追回，請執行  申報 指令，追回報價。
2. 報價追回成功的狀態將顯示於「狀態」欄中。

畫面說明：

1. 未成交：取消報價



債券遠期-詢價回覆

不接受詢價：

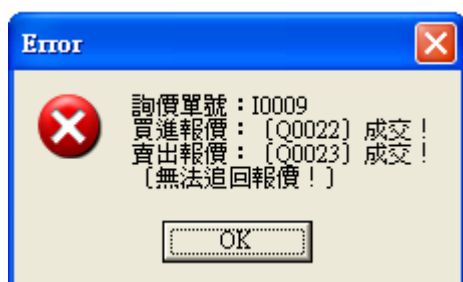
不接受詢價[Q] 不顯示詢價[D]

時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
11:30:14	I0002	元大京華 證券	9800主管	A94105	2006/07/27	5	取消報價			取消報價	0	✓申報	↶申報	✗

已追回報價：Q0003

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

2. 已成交：無法追回報價



Error

詢價單號：I0009
買進報價：[Q0022] 成交！
賣出報價：[Q0023] 成交！
[無法追回報價！]

OK

3. 報價逾時：無法追回報價

【被詢價/不報價】

功能說明：

對詢價方的詢價單，被詢價方有權決定是否提供報價。

操作說明：

若被詢價方不願提供報價，可按下  鍵。

畫面說明：

債券遠期-詢價回覆														
不接受詢價：		 不接受詢價 [F]  不顯示詢價 [H]												
時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
11:36:01	I0003	元大京華證	9800主管	A94105	2006/07/27	5	不報價	-	-	不報價	0	申報	申報	!

收到詢價單：I0003 [證券商：元大京華證 交易員：9800主管]

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

【被詢價/不接受詢價】

功能說明：

被詢價方可自選「不接受詢價」對象，開啟「不接受詢價」狀態。

操作說明：

1. 先於詢價回覆視窗中點選  **不接受詢價[R]**。
2. 再於視窗左側「不接受詢價」選單下，選擇拒絕接受詢價的對象後，即可完成設定。

畫面說明：



債券遠期-詢價回覆

不接受詢價：9800 - 元大京華證

接受詢價 ☐ 不顯示詢價 ☒

時間	單號	證券商	交易員	債券期別	契約到期日	面額	狀態	買進	賣出	狀態	計時	報價	追回	不報價
11:36:01	I0003	元大京華證	9800主管	A94105	2006/07/27	5	不報價	-	-	不報價	0	/ 申報	申報	!

收到詢價單：I0003 [證券商：元大京華證 交易員：9800主管]

不接受[9800]詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

不報價後，無法關掉此畫面，需先點選「不顯示詢價」後，再行關閉視窗。



(債券遠期-線上詢價)

詢價對象：7000 倍利國際證 契約到期日：2006/7/26

交易金額：3.0 億 債券代號：A94105

詢價 ☐ 刪除 ☒ 交易 ☒

查詢對象及契約形式			詢價目表區											
詢價對象	契約到期日	債券期別	證券商	交易員	計時	單號	狀態	買進	賣出	狀態	單號	計時		
倍利國際證	2006/07/26	A94105	倍利國際證	7000主管	0	-	不報價	-	-	不報價	-	0		

[證券商：倍利國際證 交易員：7000主管] 不報價！

詢價=Alt+I 刪除詢價=Alt+D 交易=Alt+T

註 解：

1. 執行「不接受詢價」設定後，於下次接獲詢價時才會生效。
2. 「不接受詢價」對象可為「全市場」、單一對象或使用者自行設定之對象組合；使用者可利用「輔助功能」項下「系統維護」→「券商組合設定」中設定「不接受詢價組合」。

【被詢價/不顯示詢價單】

功能說明：

提供被詢價方將送來的詢價單從畫面上移除。

操作說明：

欲將視窗上的詢價單刪除，可直接點選此詢價單後，執行指令，即可從詢價回覆視窗上移除該筆詢價單。



註 解：

被詢價方執行  指令時，僅將送來的詢價單從畫面上移除，若關閉視窗再從新開啟，此詢價單仍然存在，且執行「不顯示詢價」指令時，並不會回應對方（詢價方）任何訊息。

◎債券遠期－成交查詢

功能說明：

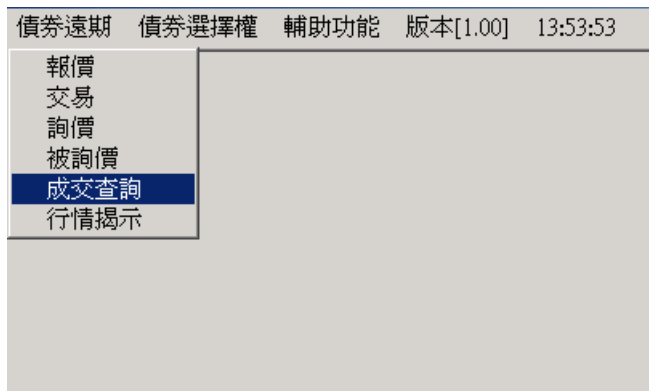
成交狀況查詢，可依使用者的權限，即時查詢當日成交資料。

操作說明：

點選「債券遠期」，於出現的選單中點選「成交查詢」後，出現「債券遠期－成交狀況查詢」畫面。

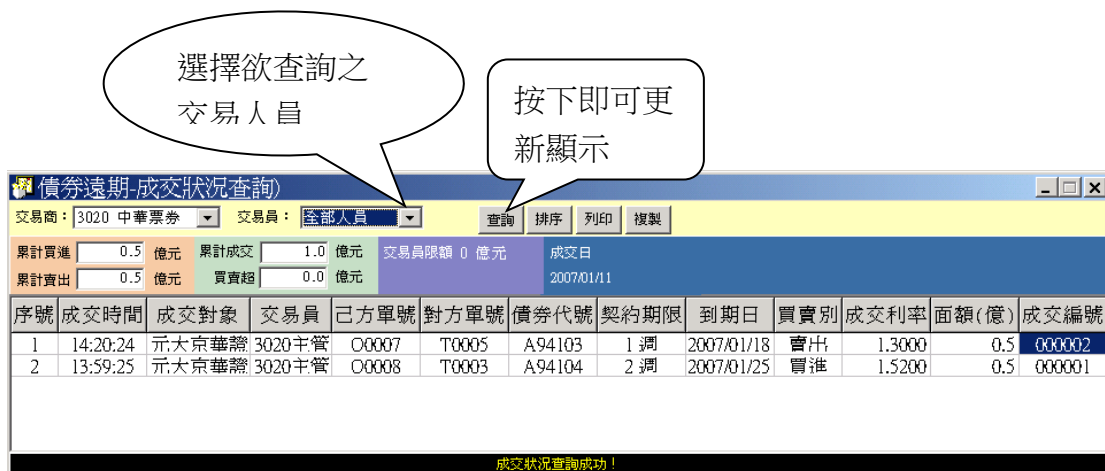
畫面說明：

5. 選擇債券遠期「成交查詢」功能。



6. 成交狀況查詢：

主管權限者可查詢全部人員成交狀況，其餘使用者僅可查詢自己的成交狀況。



7. 成交狀況揭示排序：

系統預設為依「成交時間」遞減排序：成交時間在前者，序號排列在後

債券遠期-成交狀況查詢

交易商：3020 中華票券 交易員：3020主管 查詢 排序 列印 複製

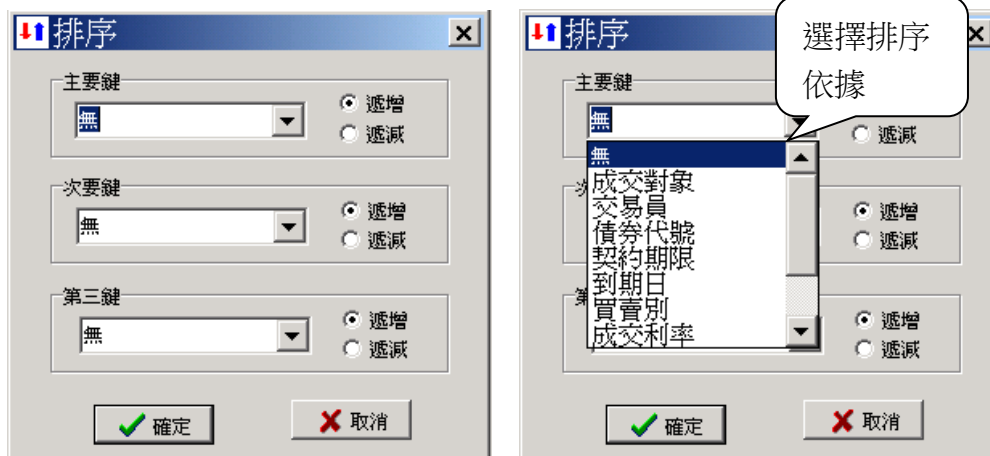
累計買進 0.5 億元 累計成交 1.0 億元 交易員限額 5 億元 成交日 2007/01/11

累計賣出 0.5 億元 買賣超 0.0 億元

序號	成交時間	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	債券代號	契約期限	到期日	買賣別	成交利率	面額(億)	成交編號
1	14:20:24	元大京華證券	3020主管	O0007	T0005	A94103	1 週	2007/01/18	賣出	1.3000	0.5	000002
2	13:59:25	元大京華證券	3020主管	O0008	T0003	A94104	2 週	2007/01/25	買進	1.5200	0.5	000001

成交狀況查詢成功！

可利用「排序」功能，進行下列不同欄位排序：成交對象、交易員、債券代號、契約期限、到期日、買賣別、成交利率、面額、成交時間、成交編號等。排序內容之選擇可分為「主要鍵」、「次要鍵」及「第三鍵」，遞增或遞減排序。



8. 複製：

選擇所要複製的欄位，按下複製，即可複製資料至其他文件（如 Excel）

債券遠期-成交狀況查詢

交易商：3020 中華票券 交易員：全部人員 查詢 排序 列印 複製

累計買進 0.5 億元 累計成交 0.5 億元 交易員限額 0 億元 成交日 2007/01/11

累計賣出 0.0 億元 買賣超 0.5 億元

序號	成交時間	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	債券代號	契約期限	到期日	買賣別	成交利率	面額(億)	成交編號
1	13:59:25	元大京華證券	3020主管	O0008	T0003	A94104	2 週	2007/01/25	買進	1.5200	0.5	000001

成交狀況查詢成功！

選取欄位將反白顯示

◎債券遠期－行情揭示

功能說明：

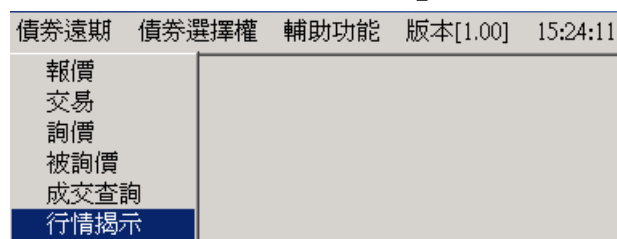
成交行情揭示，即時揭露系統上全市場成交行情。

操作說明：

點選「債券遠期」，於出現的選單中點選「行情揭示」後，出現「債券遠期－行情揭示」畫面。

畫面說明：

5. 選擇債券遠期「行情揭示」功能。



6. 系統預設總覽全部債券市場成交行情

可輸入代號進行搜尋

按下可儲存為 Excel 畫面並設定利印

The screenshot shows the '債券遠期行情揭示' (Bond Forward Market Price Disclosure) interface. It includes a search bar with a '搜尋' (Search) button and a '顯示全部' (Show All) button. Below the search bar is a table with columns for bond codes and various price metrics. The table is divided into three sections: '1週' (1 Week), '2週' (2 Weeks), and '3週' (3 Weeks). The table contains data for various bond codes, including A95108, A95107, A95106, A95105, A95104, A95103, A95102, A95101, A94108, A94107, A94106, A94105, A94104, and A94103. The table also includes columns for '最近' (Latest), '變動' (Change), '最高' (High), '最低' (Low), '累計成交' (Cumulative Volume), and '前日收盤' (Previous Day Close). The table is color-coded by section: yellow for 1 Week, light blue for 2 Weeks, and light green for 3 Weeks. The table is also sortable by clicking on the column headers.

選	債券代號	1週					2週					3週					最近	變動 (bp)	最	
		最近	變動 (bp)	最高	最低	累計成交	前日收盤	最近	變動 (bp)	最高	最低	累計成交	前日收盤	最近	變動 (bp)	最高				最低
	A95108	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95107	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95106	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95105	-	-	-	-	0.0990	-	-	-	-	-	0.0550	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95104	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95103	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95102	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95101	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94108	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94107	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94106	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94105	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94104	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94103	1.3000	130.00	1.3000	1.3000	0.5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7. 自選行情揭示

可設定僅揭示「自選」債券市場成交行情

隱藏 3 週、4 週行情揭示

點選所要設定揭示的債券

債券遠期交易行情揭示

顯示全部

債券:

搜尋

總覽

自選

成交單位：億元

存檔列印

1週明細

2週明細

3週明細

4週明細

		1週						2週					
選	債券代號	最近	變動 (bp)	最高	最低	累計 成交	前日 收盤	最近	變動 (bp)	最高	最低	累計 成交	前日 收盤
	A95108	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95107	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95106	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95105	-	-	-	-	-	0.0990	-	-	-	-	-	0.0550
	A95104	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95103	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95102	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A95101	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94108	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94107	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94106	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A94105	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
☒	A94104	-	-	-	-	-	-	1.5200	152.00	1.5200	1.5200	0.5	-
☒	A94103	1.3000	130.00	1.3000	1.3000	0.5	-	-	-	-	-	-	-
	A94102	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A93109	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A93108	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A93107	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A93106	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	A93104	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

按下「自選」揭示所點選之債券行情

債券遠期交易行情揭示【顯示全部】													1234-□×								
債券:		搜尋		總覽		自選		成交單位：億元		存檔列印		1週明細		2週明細		3週明細		4週明細			
		1週										2週									
選	債券代號	最近	變動 (bp)	最高	最低	累計 成交	前日 收盤	最近	變動 (bp)	最高	最低	累計 成交	前日 收盤								
☒	A94104	-	-	-	-	-	-	1.5200	152.00	1.5200	1.5200	0.5	-								
☒	A94103	1.3000	130.00	1.3000	1.3000	0.5	-	-	-	-	-	-	-								

8. 交易明細

以「明細」查詢每 5 分鐘市場成交行情明細

債券遠期交易-行情揭示

顯示全部

1

2

3

4

-

□

x

債券:

搜尋

總覽

自選

成交單位: 億元

存檔列印

1週明細

2週明細

3週明細

4週明細

A94103 契約期限: 01週

今日成交資訊

前日成交資訊

最近成交: - 億元

最高: -

成交面額: - 億元

開盤: 1.5000

累計成交: 0.5 億元

最低: -

平均: -

收盤: -

序號	時間	加權平均	變動 (bp)	
45	12:45	-	-	
46	12:50	-	-	
47	12:55	-	-	
48	13:00	-	-	
49	13:05	-	-	
50	13:10	-	-	
51	13:15	-	-	
52	13:20	-	-	
53	13:25	-	-	
54	13:30	-	-	
55	13:35	1.3000	130.00	
56	13:40	-	-	
57	13:45	-	-	
58	13:50	-	-	
59	13:55	-	-	
60	14:00	-	-	
61	14:05	-	-	

◎利率交換

功能說明：

功能名稱	功能說明	頁次
報價	提供使用者選擇報價對象、契約年期、契約名目本金、浮動利率指標等，進行線上即時報價	72
交易	使用者可查詢各年期之報價狀況及進行成交	74
詢價	使用者可針對特定對象、特定契約規格進行詢價作業	76
被詢價	被詢價時報價回覆、不接受詢價作業	78
成交查詢	成交狀況查詢可依使用者的權限，即時查詢當日盤中的成交資料	79
成交行情	即時揭露全市場最新的利率交換成交行情，做為使用者調整買賣決策的重要參考資訊	80
公開報價	揭示全市場所有公開報價行情，僅作為報價參考，不作為交易使用。	81

畫面說明：



◎利率交換—報價

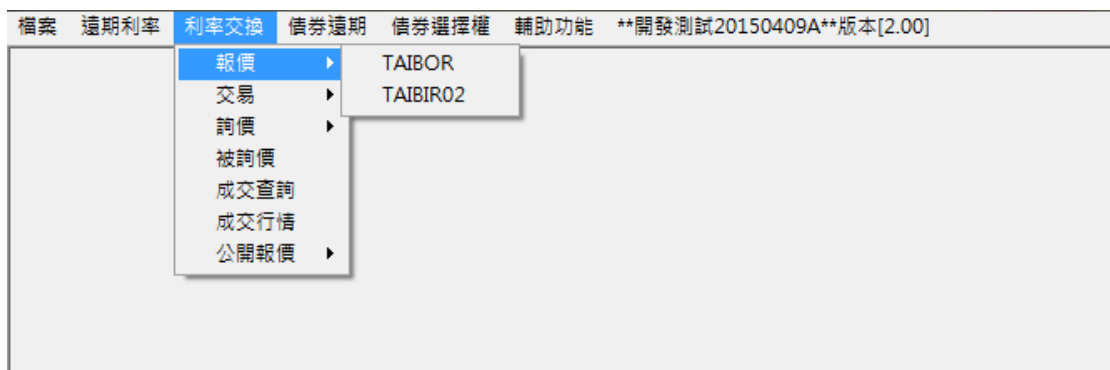
功能說明：

提供使用者可選擇浮動利率指標、契約年期、報價對象及名目本金，進行線上即時利率報價。

報價規則：請參考本中心「店頭金融商品電腦交易系統作業辦法」

1. 利率交換交易系統之交易時間為上午 9:00 至下午 4:00。
2. 報價輸入應以利率為之，每一交易單位視選擇為新台幣三億元或五億元而定。
3. 報價數量必須為 1 至 9 個交易單位。
4. 證券商之買賣申報，應依契約年期、報價對象、利率、買賣數量、買賣別等事項逐一輸入，經本中心系統接受後，即透過傳輸系統依序回報之，其修改時亦同。
5. 證券商得自選對象提供報價，但同一證券商之總、分支機構間或分支機構相互間不得為成交對象。
6. 進行雙向報價時，買進利率不得高於賣出利率。
7. 使用者執行「系統登出」功能時，系統會自動將其在系統上的報價單全數抽回。
8. 當選擇關閉報價輸入視窗時，如使用者尚有報價單未做刪除，則系統僅以最小化處理，俾提醒使用者報價單仍有被成交之可能；重新開啟視窗時建議由「視窗」下選單開啟較為方便。

畫面說明：



※ 依浮動利率指標「TAIBOR」及「TAIBIR02」，開啟不同報價視窗。

操作說明：

報價相關操作功能請參考前述債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明		頁次
新增報價		10
修改報價		12
刪除	刪除報價	13
	刪除全部報價	13
結束報價		14

◎利率交換－交易

功能說明：

查詢利率交換交易的報價及進行成交。

交易規則：

1. 證券商得自選對象成交，但同一金融機構之總、分支機構間或分支機構相互間不得為成交對象。
2. 交易視窗之報價均為確定報價，經點選即行成交。

畫面說明：

檔案 遠期利率 利率交換 債券遠期 債券選擇權 輔助功能 測試版本[1.90]

報價
交易
詢價
被詢價
成交查詢
行情揭示

利率交換交易(TAIBOR)** - 全部

契約年限	交易商	量	3億買	3億賣	量	交易商	交易商	量	5億買	5億賣	量	交易商
3 年	元大寶來證券	1	1.000									
4 年	****	1	6.000									
5 年	****	1	2.000	4.000	1	元大寶來證券						

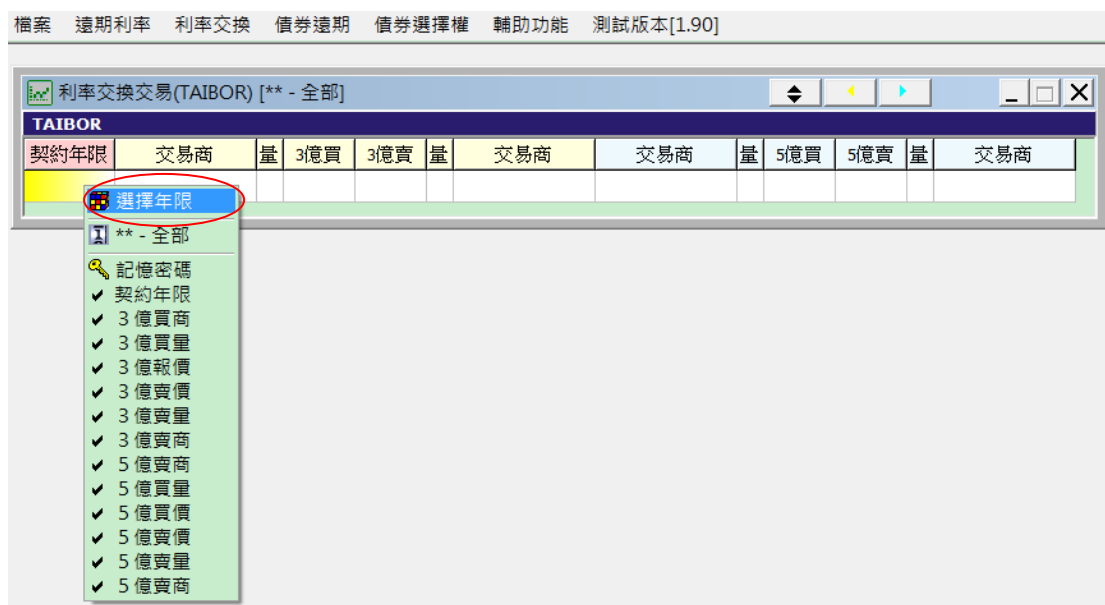
利率交換交易(TAIBIR02)** - 全部

契約年限	交易商	量	3億買	3億賣	量	交易商	交易商	量	5億買	5億賣	量	交易商

※ 依浮動利率指標「TAIBOR」及「TAIBIR02」，開啟不同交易視窗。

操作說明：

1. 點選「利率交換」，於出現的選單中點選「交易」後，出現線上交易視窗。
2. 將游標移至「交易」視窗中，按滑鼠右鍵即出現下拉式選單，自選單中「選擇年限」項下，點選欲查詢報價之契約年期。



交易相關操作功能請參考前述債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
點選報價	19
超過交易限額	20
暫停交易對象	21

◎利率交換—詢價

功能說明：

線上詢價，提供使用者送出詢價訊息，請求一個或多個交易對象提供報價，經回覆報價後，使用者可決定是否成交。

詢價規則：

1. 得對單一對象或一群對象組合詢價，每一個詢價的對象組合可設定一至六家交易對象。
2. 債券遠期交易契約到期日不得超過一年。
3. 被詢價方所回應之買賣申報為確定報價，詢價方在 60 秒內確認成交後，即行成交。
4. 被詢價方於詢價方確認成交前，得取消其買賣報價。
5. 使用者使用系統登出功能時，系統會自動將該其在市場上的詢價單全數抽回。
6. 詢價方欲詢價之對象，如已開啟「不接受詢價」狀態時，詢價方的詢價視窗會顯示「拒收」。

畫面說明：

※ 依浮動利率指標「TAIBOR」及「TAIBIR02」，開啟不同詢價視窗。

操作說明：

詢價相關操作功能請參考前述債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明		頁次
<u>詢價</u>	詢價	24
	刪除	25
	交易	26
<u>被詢價</u>	報價申報	28
	追回申報	30
	不報價	31
	不接受詢價	32
	不顯示詢價	33

◎利率交換—被詢價

檔案 遠期利率 利率交換 債券遠期 債券選擇權 輔助功能 測試版本[1.90]

報價
交易
詢價
被詢價
成交查詢
行情揭示

(利率交換-詢價回覆)

不接受詢價: []

不接受詢價 [X] 不顯示詢價 [X]

時間	單號	證券商	交易員	連結指標	契約年期	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	追回	不報價
18:11:15		元大實來證券	周文陸	TAIBOR	03年09月	尚未報價	1			1	尚未報價	0	✓ 申報	↺ 申報	✗
18:12:08		元大實來證券	周文陸	TAIBIR02	01年00月	尚未報價	2.5			2.5	尚未報價	0	✓ 申報	↺ 申報	✗

收到詢價單: 10004 [交易商: 元大實來證券 交易員: 周文陸]

接受全市場詢價 報價=Alt+S 追回=Alt+C 不報價=Alt+N

※ 請留意被詢價之連結指標，可能為浮動利率指標「TAIBOR」或「TAIBIR02」。

◎利率交換—成交查詢

功能說明：

成交狀況查詢，可依使用者的權限，即時查詢當日成交資料。

操作說明：

點選「利率交換」，於出現的選單中點選「成交查詢」後，出現「利率交換—成交狀況查詢」畫面。

畫面說明：

檔案 遠期利率 利率交換 債券遠期 債券選擇權 輔助功能 測試版本[1.90]

報價
交易
詢價
被詢價
成交查詢
行情揭示

利率交換-成交狀況查詢

交易商: 9800 元大寶來證券 交易員: 周文陸 查詢 排序 列印 複製

交易員限額 成交日 累計成交 0.0 億元 累計買進 0.0 億元
一年期 999 億元 2014/11/13 買賣超 0.0 億元 累計賣出 0.0 億元

序號	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	契約年限	連結指標	買賣別	成交利率	名目本金	到期日	成交時間	成交編號
尚無成交資料												

註：盤中申請改帳，僅申請更改成交利率乙項者，成交狀況及時更新；更改其餘交易條件者，於盤後處理。

◎利率交換—成交行情

即時揭露全市場最新的利率交換成交行情，做為使用者調整買賣決策的重要參考資訊。

備案

遠期利率

利率交換

債券遠期

債券選擇權

輔助功能

開發測試20150409A版本[2.00]

報價

交易

跨價

被跨價

成交量鉤

成交行情

公開報價

利率交換-成交行情【顯示全部】

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率交換-成交行情

利率

◎利率交換－公開報價

本視窗揭示全市場所有公開報價行情(三家以上)，未於報價方報價群組內之交易方，亦可看見報價，但僅作為價格參考，不作為交易使用。

3億			5億		
項目	買價	賣價	項目	買價	賣價
1	1.2	1.2	1	1.2	1.2
2	1.1	1.23	2	1.1	1.23
3	--	--	3	--	--
4	--	--	4	--	--
5	--	--	5	--	--
6	--	--	6	--	--

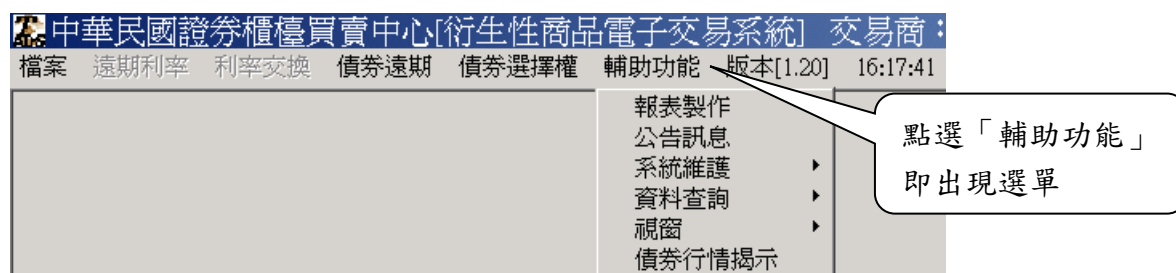
公開報價家數計算係採報價時報價群組家數扣除雙方暫停報價對象家數。

◎輔助功能

功能說明：

選單項目	功能說明	頁次
報表製作	提供交易商後台人員製作當日成交清單	83
公告訊息	提供交易商查詢系統公告之訊息	84
系統維護	提供交易商設定券商組合、交易額度、使用者及報價範圍限制	85
資料查詢	提供交易商查詢債券、交易商、營業日期等資料，並可利用「債券選擇權計算器」試算債券選擇權交易之權利金金額	95
視窗	提供交易商設定視窗顯示方式及視窗組合	100
債券行情揭示	提供交易商查詢債券最新成交行情	105

畫面說明：



◎輔助功能－報表製作

功能說明：

提供交易商後台人員製作當日成交清單。

操作說明：

系統日結後，按下「報表製作」即出現報表查詢畫面。系統將自動帶出各報表檔名，當下載欄顯示「完成」，即可執行「製作」進行 Excel 巨集轉檔，以 Excel 程式顯示報表。

畫面說明：

No.	檔名	代碼	下載
1	壓縮報表檔	100	完成
2	遠期利率協定成交行情表	101	完成
3	利率交換成交行情表	102	完成
4	債券遠期成交行情表	103	完成
5	債券選擇權成交行情表	104	完成
6	債券遠期成交清單	107	完成
7	債券選擇權成交清單	108	完成

顯示報表已下載完成

開啓後，請執行「製作」使用Excel巨集進行轉檔！

◎輔助功能－公告訊息

功能說明：

提供使用者查詢系統公告之訊息。

操作說明：

1. 如為開盤前緊急公告，使用者上機後，「市場公告」視窗即自動跳出；如為盤中緊急公告，不論使用者正執行任何指令，「市場公告」視窗均自動跳出。
2. 使用者可利用「輔助功能」選單中「公告訊息」，查詢一般公告及緊急公告內容。

畫面說明：

市場公告					
日期	序號	類別	交易	更新	主旨
20060525	0009	緊急公告	遠期利率	0000	Test公告
20031201	0008	緊急公告	遠期利率	0000	內容。
20031201	0007	緊急公告	遠期利率	0000	即日起,台証證券證
20031128	0006	緊急公告	遠期利率	0000	上網查詢.
Test公告 92.11.25.證櫃債字第35959號函,公告公債借貸交易將於92.12.31.實					

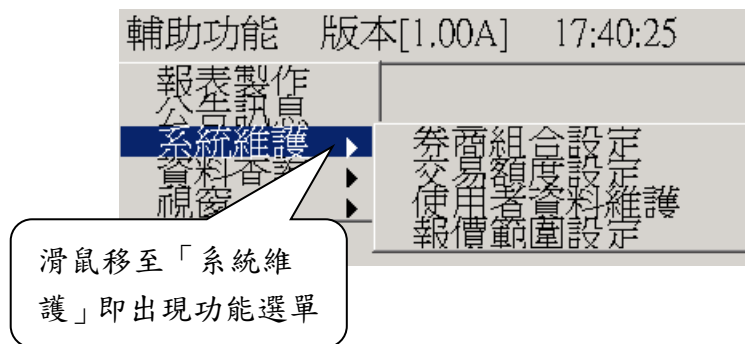
市場公告資料查詢成功

◎輔助功能－系統維護

功能說明：

功能名稱	功能說明	頁次
交易商組合設定	提供交易商設定「報價組合」、「詢價組合」、「不接受詢價組合」及「特殊組合」	86
交易額度設定	提供交易商設定交易員及交易對手額度	88
使用者資料維護	提供交易商新增、修改或刪除使用者資料	91
報價範圍設定	提供交易商設定公司及個人報價範圍	94

畫面說明：



【系統維護/交易商組合設定】

功能說明：

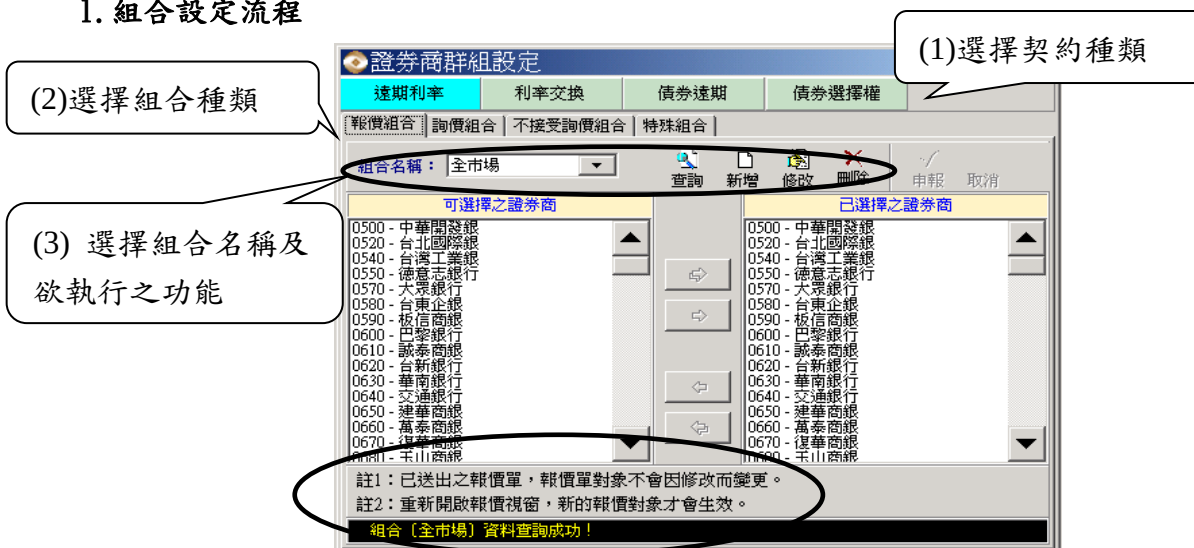
提供交易商設定各項商品契約「報價組合」、「詢價組合」、「不接受詢價組合」及「特殊組合」。

操作說明：

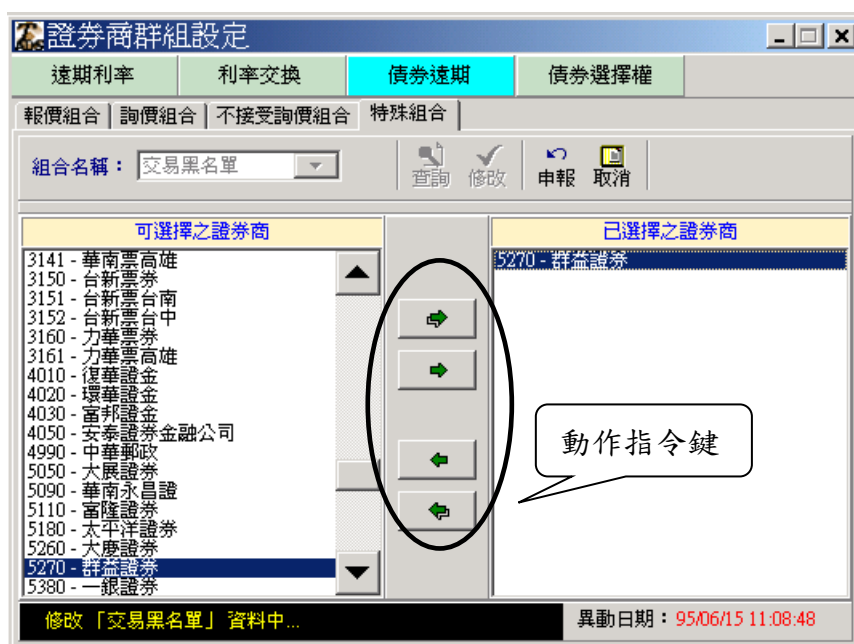
1. 點選「輔助功能」項下「系統維護」－「交易商組合設定」，即出現組合設定之視窗。
2. 點選商品契約名稱後，點選所欲設定之組合種類，即可進行組合查詢、新增、修改或删除。
3. 組合名稱中「全市場」包括所有已簽約之交易對象名單，由本中心維護，使用者僅能查詢，無法增刪或修改，如有所異動，須向本中心提出申請變更。
4. 使用者可於「特殊組合」中設定「暫停交易對象名單」。當使用者點選「暫停交易對象名單」交易商之報價，系統將出現「送出交易單錯誤〔交易對象在暫停交易對象名單之列〕」訊息，交易失敗（但系統不抽回該報價單）。
5. 組合名稱之設定，長度限制為 10 個字元（5 個中文字）。
6. 「詢價組合」設定不得包含自己，若選取自己，系統會出現錯誤訊息「詢價組合交易商不得包括自己所在交易商」；每一個詢價組合的交易商家數以 6 家為上限，選取第 7 家時，系統會出現錯誤訊息「詢價組合之交易商不可超過 6 個」。
7. 原設定存在於各項組合中之金融機構，如已不復於交易對象（ISDA 簽約對象）名單中，若未於組合中予以刪除，則以群組送出報價時，將顯示報價失敗。

畫面說明：

1. 組合設定流程



2. 「交易黑名單」設定



【系統維護/交易額度設定】

功能說明：

提供設定「交易員」及「交易商」額度。

操作說明：

1. 點選「輔助功能」項下「系統維護」－「交易額度設定」，即出現交易額度之視窗。
2. 額度設定可由「公司主管」或「風控人員」權限者於系統上逐筆建檔或利用「匯入」功能整批上傳公司所建立的額度檔。「匯出」功能則可整批輸出系統額度。
3. 每日開盤前預設之交易額度與前一日設定之額度相同。
4. 「交易員」及「交易商」額度均可於盤中隨時調升或調降，且立即生效，惟調降後之額度需大於或等於當日已交易金額。
5. 「交易員」及「交易商」額度均按交易契約種類分別設定額度，並以買賣交易額度加總計算已交易額度。
6. 設定「交易員」額度：由「公司主管」或「風控人員」權限者進行個別交易員額度設定。
7. 設定「交易商」額度：由「公司主管」或「風控人員」權限者進行各交易對象額度設定。
8. 「交易員額度」及「交易商額度」於交易時間內系統將自動扣除已承作額度，按下「查詢」即可查詢剩餘額度。

畫面說明：

1. 額度「匯入」、「匯出」功能

交易額度									
交易員額度	交易商額度	查詢	申報	匯入	匯出	列印	單位：億元		
交易對象	遠期利率	債券遠期	債券選擇權	利率交換IRS					
	FRA(餘)	BF(餘)	BO(餘)	1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)	
0070 第一銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	
0100 華僑銀行	0 (0)	0 (0)	10.0 (10.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	
0110 上海商業儲蓄銀行	0 (0)	0 (0)	10.0 (10.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	

2. 交易員額度設定

此三欄由系統自動帶出資料

輸入完成須按「申報」始能生效

交易員代號	帳號	姓名	遠期利率	債券遠期	債券選擇權	利率交換				
			FRA(餘)	BF(餘)	BO(餘)	1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)
0120	bakertu	杜宗恩	0 (0)	5.0 (5.0)	5.0 (1.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)

3. 交易對象額度設定

此欄由系統自動帶出已簽訂 ISDA 契約之交易對象

輸入完成須按「申報」始能生效

於欄位內輸入額度

交易對象	遠期利率	債券遠期	債券選擇權	利率交換IRS					
	FRA(餘)	BF(餘)	BO(餘)	1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	4Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)
0040 臺灣銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0050 土地銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0060 合作金庫	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0070 第一銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0080 華南銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0090 彰化銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0100 花旗(台灣)銀行	0 (0)	0 (0)	35.0 (35.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0110 上海銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0120 台北富邦銀	0 (0)	0 (0)	28.0 (28.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0130 國泰世華銀行	0 (0)	0 (0)	28.0 (28.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0160 高雄銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)

4. 剩餘額度查詢

按「查詢」鍵查詢剩餘額度

預設額度

剩餘額度

交易對象	遠期利率	債券遠期	債券選擇權	利率交換IRS				
	FRA(餘)	BF(餘)	BO(餘)	1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)
0280 紐約銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0370 法國興業銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0390 荷蘭銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0400 中華開發工業銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0610 中華票券	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0620 國際票券	0 (0)	10.0 (10.0)	30.0 (26.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0630 大中票券	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0700 中信票	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0720 德意志	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0760 美商摩根大通銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0780 星展銀行	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)

5. 盤中下調之額度須大於當天已成交金額

交易商額度：當天1年期已與對手成交金額3億元，則下調交易商1年期額度時需大於或等於3億元。

交易商額度：當天1年期已與對手成交金額3億元，則下調交易商1年期額度時需大於或等於3億元。

交易對象	遠期利率 FRA(餘)	債券遠期 BF(餘)	債券選擇權 BO(餘)	利率交換IRS					
				1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	4Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)
8060 元大銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)					
8070 永豐銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)					
8080 玉山銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)					
8120 台新銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)					
8140 大眾銀行	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)					
8150 日盛銀行	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)					
8160 安泰銀行	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)					
8220 中信銀	0 (0)	0 (0)	28.0 (28.0)	0 (0)					
8450 康和證券	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
9800 元大寶來證券	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (3.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)

中華民國證券櫃檯買賣中心衍生性商品電子交易系統

券商交易額度設定錯誤：
券商：9800 IRS 1Y 限額低於已成交與被挪用額度
請於修正資料後，重新上傳申報！
或使用查詢恢復原資料

OK

交易員額度：下調交易員額度同樣也需大於或等於當日已成交金額。

交易員額度：下調交易員額度同樣也需大於或等於當日已成交金額。

券商代號	帳號	姓名	遠期利率	債券遠期	債券選擇權 BO(餘)	利率交換					
						1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	4Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)
0110					0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0110					5.0 (5.0)	0 (0)	0 (0)	25.0 (25.0)	0 (0)	25.0 (25.0)	0 (0)
0110					5.0 (5.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0110					0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
0110					10.0 (10.0)	50.0 (50.0)	50.0 (50.0)	50.0 (50.0)	50.0 (50.0)	50.0 (50.0)	50.0 (50.0)
0110					0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)

中華民國證券櫃檯買賣中心衍生性商品電子交易系統

交易員額度設定錯誤資料：
交易員：0110 IRS 1Y 限額低於已成交與被挪用額度

OK

6. IRS 交易額度長天期可分予短天期使用

例如：5年期以上額度訂有10億，則5年期以下之契約可共用此10億額度；若短天期契約未設額度，則交易後剩餘額度會以負值顯示。

IRS 交易額度長天期可分予短天期使用

交易對象	遠期利率 FRA(餘)	債券遠期 BF(餘)	債券選擇權 BO(餘)	利率交換IRS					
				1Y(餘)	2Y(餘)	3Y(餘)	4Y(餘)	5Y(餘)	5Y以上(餘)
8050 遠東銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8060 元大銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8070 永豐銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8080 玉山銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8120 台新銀行	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8140 大眾銀行	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8150 日盛銀行	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8160 安泰銀行	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8220 中信銀	0 (0)	0 (0)	28.0 (28.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
8450 康和證券	0 (0)	0 (0)	14.0 (14.0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)	0 (0)
9800 元大寶來證券	0 (0)	0 (0)	21.0 (21.0)	3.0 (0)	0 (0)	0 (-5.0)	0 (-5.0)	0 (0)	10.0 (10.0)

中華民國證券櫃檯買賣中心衍生性商品電子交易系統

使用5年期額度

使用5年期額度

【系統維護 / 使用者資料維護】

功能說明：

提供交易商新增、修改或刪除使用者資料，及使用權限之建檔、異動或查詢。

操作說明：

1. 點選「輔助功能」項下「系統維護」－「使用者資料維護」，即出現查詢及維護之視窗。
2. 每家交易商只給予一個「公司主管」權限，須由交易商向本中心申請建立，其餘使用者由該「公司主管」自行新增、修改或刪除，不需向本中心申請。
3. 使用者基本資料及交易限額之變更，當日生效；使用者帳號之新增或刪除，及權限之變更，隔日生效。
4. 資料維護內容如下表

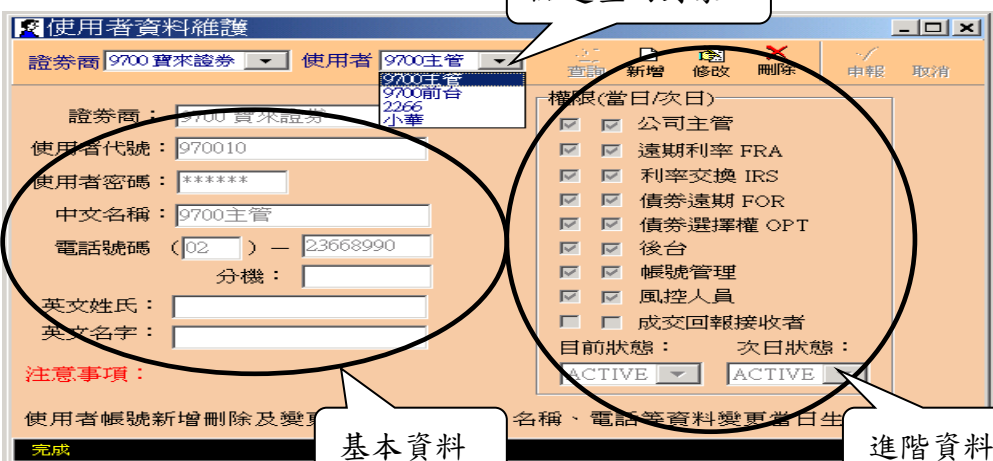
基本資料	證券商	由下拉式選單中選定	
	使用者代號	輸入欲建立使用者的基本資料	
	使用者密碼		
	中文名稱		
	電話號碼		
	英文姓氏		
	英文名字		
進階資料	使用權限	公司主管	1. 以勾選方式(Check Box)授予使用該功能之權限 2. 當日/次日：左欄 ☒ 表當日已具備之權限；右欄 ☒ 表修增或修改後，次日將生效之權限設定。
		債券遠期 FOR	
		債券選擇權 OPT	
		後台	
		帳號管理	
		風控人員	
		成交回報接受者	
	目前狀態	ACTIVE/SUSPEND/Fir st Time	顯示目前使用權限之設定或欲設定權限為「生效」、「暫停」或「首次設定」
	次日狀態	ACTIVE/Deleted	顯示所設定使用權限將於次日「生效」或「暫停」

- (1) 如要新增或異動「公司主管」權限時，交易商須向本中心提出申請書，由本中心處理，交易商無法自行建檔，其餘人員之權限則由該公司主管自行在系統上以  新增 鍵、 修改 鍵或  刪除 鍵處理（建檔完畢，記得按  申報 鍵）。
- (2) 「使用者代號」和「使用者密碼」的長度不得超過八個字元（characters），可用英文字母或數字，使用者代號另可使用中文（不得超過四個中文字）。
- (3) 「使用者代號」一經建檔後即不得修改，但「使用者密碼」可隨時由使用者本人自行修改之。
- (4) 每個使用者的權限均由「公司主管」所授與，使用者可自行修改基本資料及密碼，但不得修改進階資料及使用者代號。
- (5) 「債券遠期 FOR」及「債券選擇權 OPT」為交易人員權限，經勾選該項權限之使用者才能進行交易。
- (6) 「後台」權限始能執行「報表製作」功能。
- (7) 「帳號管理」權限可執行「使用者資料維護」建檔或異動功能，可由「公司主管」授權一「帳號管理」人員，負責使用者之新增、修該或删除。
- (8) 「風控人員」權限可查詢全部交易資料。
- (9) 「成交回報接收者」，每家交易商僅能設置一人，每筆交易完成後，系統自動即時傳送該交易商各筆成交回報資料予「成交回報接收者」。

畫面說明：

1. 查詢使用者資料：

於「使用者」欄位利用選單點選欲查詢之使用者。



畫面顯示「使用者資料維護」系統介面。上方有「證券商」和「使用者」下拉選單，分別顯示「9700 寶來證券」和「9700主管」。右側有「查詢」、「新增」、「修改」、「刪除」、「申報」、「取消」等按鈕。畫面分為「基本資料」和「進階資料」兩部分。

基本資料：

- 證券商：9700 寶來證券
- 使用者代號：970010
- 使用者密碼：*****
- 中文名稱：9700主管
- 電話號碼：(02) - 23668990
- 英文姓氏：

進階資料：

權限(當日/次日)：

☒	☒	公司主管
☒	☒	遠期利率 FRA
☒	☒	利率交換 IRS
☒	☒	債券遠期 FOR
☒	☒	債券選擇權 OPT
☒	☒	後台
☒	☒	帳號管理
☒	☒	風控人員
☐	☐	成交回報接收者

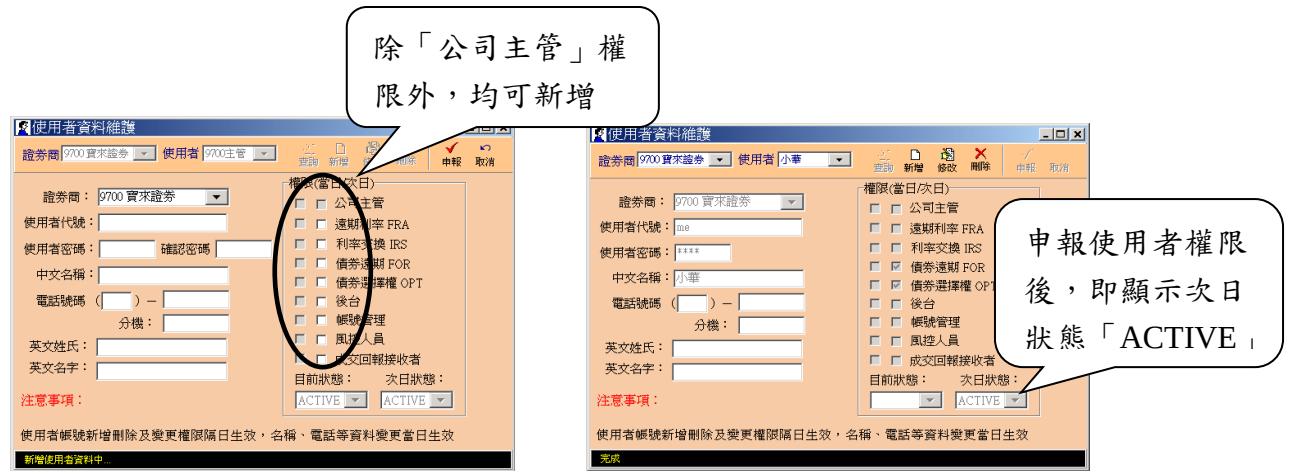
目前狀態：ACTIVE 次日狀態：ACTIVE

注意事項：使用者帳號新增刪除及變更名稱、電話等資料變更當日生效

完成

2. 新增使用者：

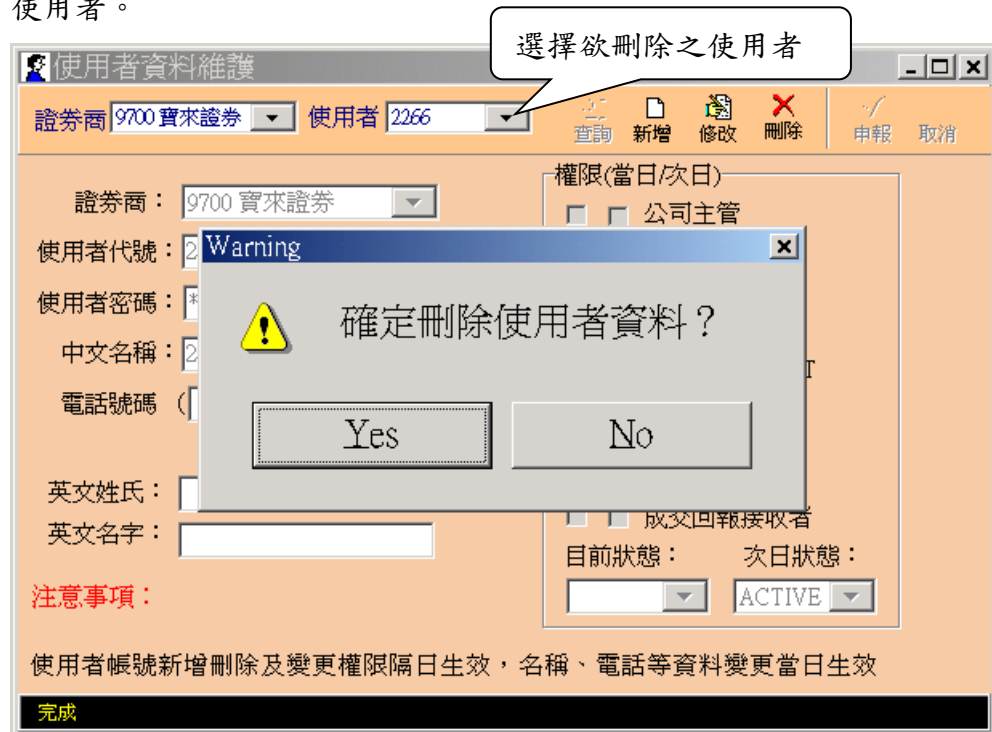
「公司主管」始能新增使用者。



3. 刪除使用者：

「公司主管」始能刪除使用者，於「使用者」欄位利用選單點選欲刪除之使用者。

按  後，出現提醒視窗「確定刪除使用者資料？」，按下  後，即刪除該名使用者。



【系統維護 / 報價範圍設定】

功能說明：

1. 供交易商設定各商品契約公司及個人報價範圍限制。
2. 所輸入之範圍設定值係指與前日收盤價之加減幅度：如設定為 20bp，若前日相同契約收盤利率為 2.2%，則該日報價區間為 2.0% ~2.4%；如債券選擇權設定為 3%，若前日相同契約收盤波動率為 13%，則該日報價區間為 10% ~16%。
3. 前日相同契約無成交資料時，系統設定收盤價為 0，因此交易商可擴大其報價範圍設定，以便順利報價。

操作說明：

1. 點選「輔助功能」項下「系統維護」—「報價範圍設定」。
2. 報價範圍設定值可輸入 0~999，輸入後按 Enter 即設定完成。
3. 「個人」報價範圍由交易員自行設定，設定若為 0 代表報價範圍不控管。交易員報價時如果超過設定之個人報價範圍，系統出現警示訊息，交易員仍可選擇申報出去。
4. 「公司」報價範圍由「公司主管」設定，設定若為 0 代表報價範圍不控管。交易員報價時如果超過公司的報價範圍，則出現錯誤訊息無法申報出去。

畫面說明：

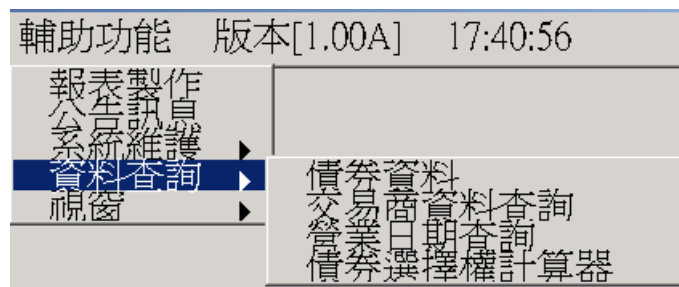


◎輔助功能－資料查詢

功能說明：

功能名稱	功能說明	頁次
債券資料	查詢各期債券發行條件及還本付息資料	96
交易商資料查詢	查詢交易商之基本資料及聯絡資料	97
營業日期查詢	提供使用者查詢債券市場營業及非營業日	98
債券選擇權計算器	提供使用者試算債券選擇權交易之權利金額	99

畫面說明：



【資料查詢 / 債券資料】

功能說明：

查詢各期債券發行條件及還本付息時點與金額。

操作說明：

1. 點選「輔助功能」項下「資料查詢」－「債券資料」。
2. 於「債券代號」欄利用下拉式選單選取欲查詢之債券期次，按「查詢」即可查得債券資料。

畫面說明：

債券資料查詢

選取債券代號

債券代號： A94103

查詢 列印

基本資料

債券名稱： 94中央政府建設公債甲三

債券代號： A94103 債券國別： 國內債券

債券簡稱： 94央債甲三 幣別： TWD

償還期限： 20.00年 開始交易日期： 民國94年02月25日

債券類別： 中央建設公債 發行日期： 民國94年02月25日

發行總額： 60,000,000,000元 到期日： 民國114年02月25日

票面面額： 10萬元

還本條件敘述： 到期一次還本

☒ 登錄債
☐ 銀行擔保

☐ 實體債
☐ 免稅債券

☒ 指標債券
☐ 發行前交易債券

☐ 賣回權型態

進階資料

信用評等：

評等日期： 民國-1911年00月00日 每年付息次數： 1

息票別： 息票 每年計息次數： 1

利率型態： 固定利率 交易稅率： 0.000

利率別： 單利 標售價格： 2.4750

票載利率： 2.3750 標售利率： 0.0000

擔保情形：

還本付息(單位：萬元)

No.	日期	利息/本金	金額
3	97年02月25日	利息	237.5000
4	98年02月25日	利息	237.5000
5	99年02月25日	利息	237.5000
6	100年02月25日	利息	237.5000
7	101年02月25日	利息	237.5000
8	102年02月25日	利息	237.5000
9	103年02月25日	利息	237.5000
10	104年02月25日	利息	237.5000
11	105年02月25日	利息	237.5000
12	106年02月25日	利息	237.5000
13	107年02月25日	利息	237.5000
14	108年02月25日	利息	237.5000
15	109年02月25日	利息	237.5000
16	110年02月25日	利息	237.5000
17	111年02月25日	利息	237.5000
18	112年02月25日	利息	237.5000
19	113年02月25日	利息	237.5000
20	114年02月25日	利息	237.5000
21	114年02月25日	本金	10000.0000

【資料查詢 / 交易商資料查詢】

功能說明：

查詢交易商之基本資料及聯絡資料。

操作說明：

1. 先進入「輔助功能」選單下，點選「資料查詢」－「交易商資料查詢」功能。
2. 由「交易商代號」下拉式選單中點選欲作查詢的交易商代號後，即顯示所查詢交易商之基本資料及簽約與交易限額狀態。
3. 交易商資料由櫃買中心統籌建檔和維護，交易商可向櫃買中心申請更新資料。

畫面說明：

選取欲查詢券商

證券商資料查詢	
券商代號：0680 - 玉山商銀	查詢
基本資料	
證券商代號：0680	營利事業統一編號：86517510
證券商中文名稱：玉山商銀	營業種類：自營
證券商英文名稱：	
遠期利率協定FRA	利率交換IRS
簽約交易商：Yes	簽約交易商：Yes
交易限額：999億元	交易限額：999億元
債券遠期交易FOR	債券選擇權OPT
簽約交易商：Yes	簽約交易商：Yes
交易限額：999億元	交易限額：999億元
聯絡資料	
聯絡人姓名：余振旭	聯絡人電話號碼：02-23611313
證券商電話號碼：02-23891313	聯絡人電話分機：8745
證券商登記地址：台北市中正區武昌街一段77號	
聯絡地址：台北市中正區永綏街5號7F	

【資料查詢 / 營業日期查詢】

功能說明：

提供使用者查詢債券市場營業及非營業日。

操作說明：

1. 先進入「輔助功能」選單下，點選「資料查詢」－「營業日期查詢」功能。
2. 輸入營業日期及選擇查詢項目後，執行「查詢」指令，即可顯示查詢結果。
3. 債券市場營業日期資料由櫃檯中心統籌維護。

畫面說明：

輸入營業日期

星期日	星期一	星期二	星期三	星期四	星期五	星期六
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30	31				

☐ 營業日 ☒ 非營業日

電腦議價交易營業日：民國 95 年 10 月資料查詢成功

【資料查詢 / 債券選擇權計算器】

功能說明：

提供使用者試算債券選擇權交易之權利金金額。

操作說明：

1. 先進入「輔助功能」選單下，點選「資料查詢」－「債券選擇權計算器」功能，即出現計算器視窗。
2. 選擇債券期別、交易日、到期日，輸入波動率、履約利率，按 **計算** 鍵，即可計算出買權及賣權權利金價值。
3. 無風險利率及債券殖利率兩個欄位將由系統自動帶出，但使用者也可依自己的需求進行修改。

畫面說明：

計算權利金			
	波動率:	CALL	PUT
履約利率	15.0000		
2.13		98,500	237,200
2.16		230,400	102,200
2.18		355,700	50,000

系統自動帶出

權利金交割日: 2006/06/15 債券交割日: 2006/06/22

註 解：

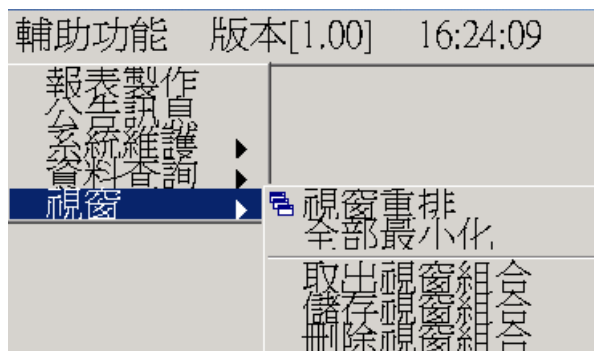
1. 無風險利率：前一日本中心營業處所議價 RP2~10 天期平均成交利率。
2. 債券殖利率：所選擇計算之債券期別，於債券等殖成交系統之最近成交殖利率。

◎輔助功能－視窗

功能說明：

功能名稱	功能說明	頁次
視窗重排	提供使用者將交易平台上出現之所有視窗重疊排列	100
全部最小化	提供使用者將交易平台上出現之所有視窗「最小化」於左下角	101
儲存視窗組合	提供使用者儲存目前交易平台上出現之視窗組合，方便日後讀取使用	101
取出視窗組合	提供使用者讀取已儲存之視窗組合	102
刪除視窗組合	提供使用者可利用此功能，刪除已儲存之視窗組合	103

畫面說明：

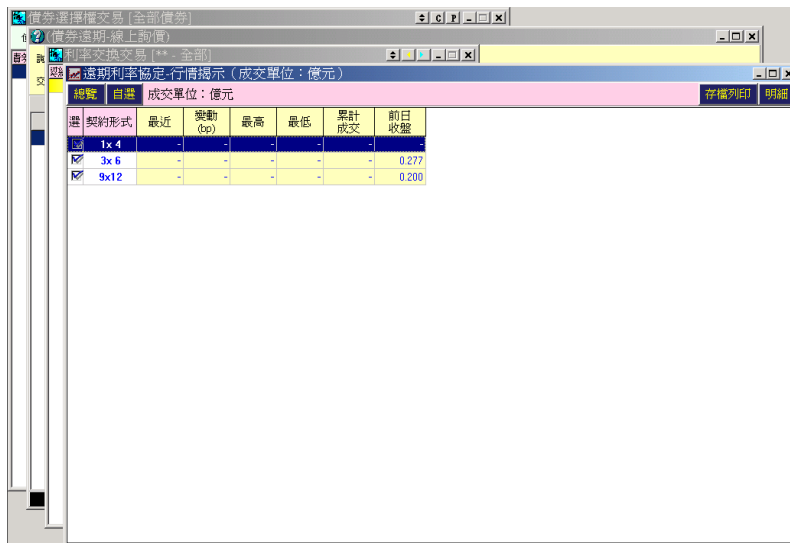


【視窗 / 視窗重排】

功能說明：

使用者選取此功能，系統立即將交易平台上出現之所有視窗重疊排列。

畫面說明：



選	契約形式	最近	變動 (bp)	最高	最低	累計 成交	前日 收盤
☐	1x 4	-	-	-	-	-	-
☒	3x 6	-	-	-	-	-	0.277
☒	9x12	-	-	-	-	-	0.200

【視窗 / 全部最小化】

功能說明：

使用者選取此功能，系統立即將交易平台上出現之所有視窗「最小化」於左下角。

畫面說明：



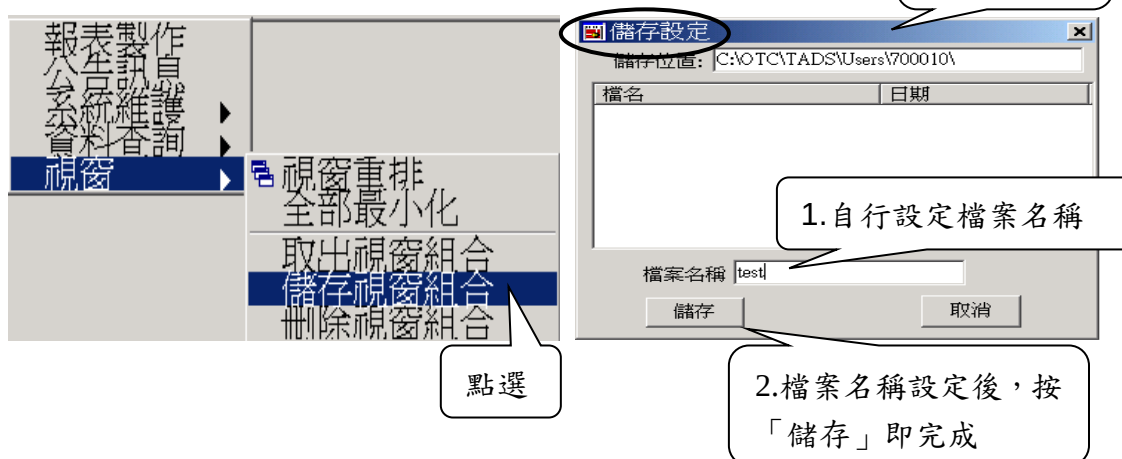
【視窗 / 儲存視窗組合】

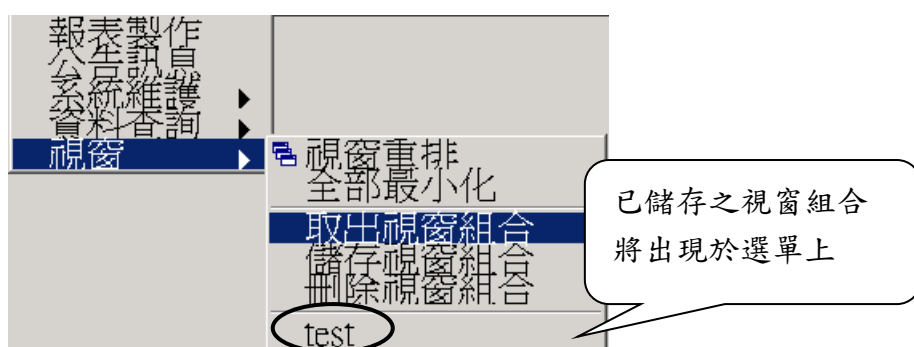
功能說明：

使用者可利用此功能，儲存目前交易平台上出現之視窗組合，方便日後讀取使用。

畫面說明：

點選「儲存視窗組合」即出現「儲存設定」視窗。





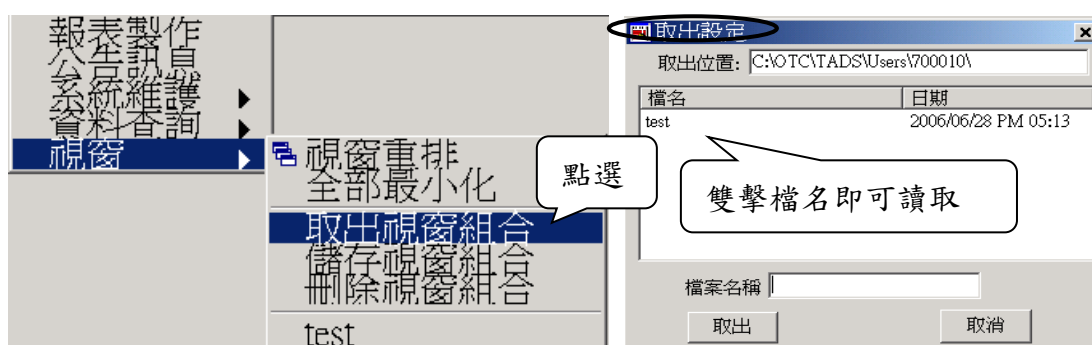
【視窗 / 取出視窗組合】

功能說明：

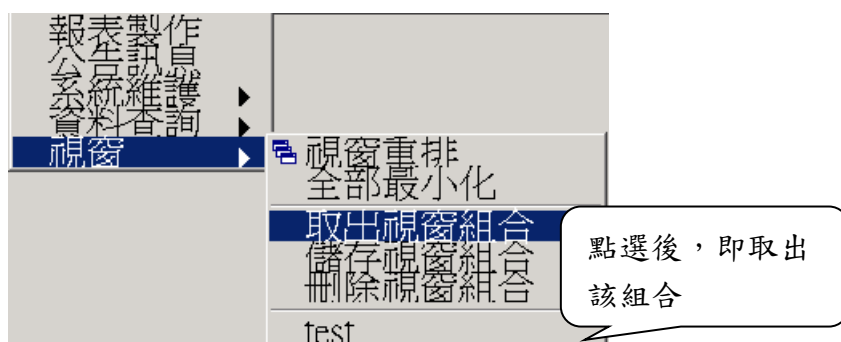
使用者可利用此功能，讀取已儲存之視窗組合。

畫面說明：

點選「取出視窗組合」即出現「取出設定」視窗。



※除前述步驟外，亦可直接點選視窗組合名稱，即可讀取視窗組合。



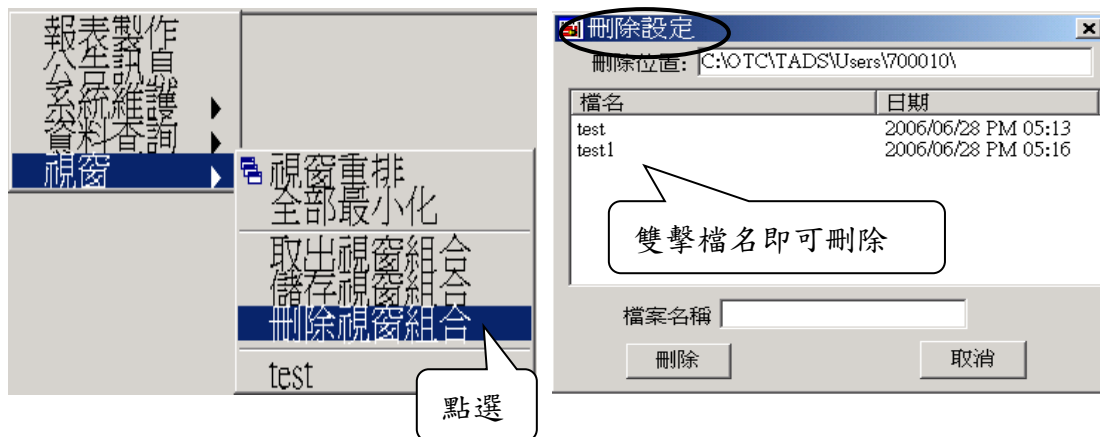
【視窗 / 刪除視窗組合】

功能說明：

使用者可利用此功能，刪除已儲存之視窗組合。

畫面說明：

點選「刪除視窗組合」即出現「刪除設定」視窗。

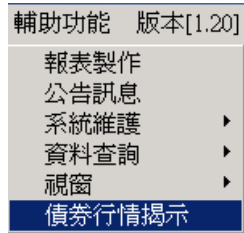


◎輔助功能－債券行情揭示

功能說明：使用者可利用此功能，查詢債券市場即時行情。

畫面說明：

1.點選「債券行情揭示」即可查詢。



2.揭示畫面可設定為「總覽」或「自選」債券券次。

債券現貨交易行情揭示 (成交單位: 億...)

總覽 自選 存檔列印

勾選即可設定「自選」券次行情揭示

選	債券代號	最近利率(%)	最高利率(%)	最低利率(%)	累計成交(億)
☐	A93102	-	-	-	-
☐	A93103	-	-	-	-
☐	A93104	-	-	-	-
☐	A93106	-	-	-	-
☐	A93107	-	-	-	-
☐	A93108	-	-	-	-
☐	A93109	-	-	-	-
☐	A94102	-	-	-	-
☐	A94103	-	-	-	-
☐	A94104	-	-	-	-
☐	A94105	-	-	-	-
☐	A94106	-	-	-	-
☐	A94107	-	-	-	-
☐	A94108	-	-	-	-
☐	A95101	-	-	-	-
☐	A95102	-	-	-	-
☐	A95103	-	-	-	-
☐	A95105	-	-	-	-
☐	A95106	-	-	-	-
☐	A95107	-	-	-	-
☐	A96101	1.500	5.890	1.500	2.0
☐	A96102	2.060	2.580	2.000	5.0
☐	A96103	1.530	5.360	1.530	1.0
☐	A96104	3.260	3.260	1.000	1.0
☐	A96105	1.266	2.500	1.266	1.0