
衍生性商品交易系統 IRS交易優化功能說明

2025年11月



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange

簡報大綱

- TADS系統簡介
- IRS交易平台簡介
- IRS交易平台優化功能介紹
 - ✓ 新臺幣IRS傳送CCP功能
 - ✓ 新臺幣IRS傳送TR功能
 - ✓ DV01報價
- 法規修正說明
- 獎勵活動介紹

TADS 系統簡介

法規依據

店頭金融商品電腦交易系統作業辦法

第一章 總則

第4條

本辦法所稱金融機構，指證券商、銀行、票券金融公司、保險公司及經主管機關核定之其他事業。

第5條

本辦法所稱參加人，指已簽訂「衍生性金融商品交易系統契約」之金融機構。

第二章 衍生性金融商品交易系統

第7條

衍生性金融商品交易系統之交易契約，以下列為限：

- 一、債券選擇權契約。
- 二、債券遠期契約。
- 三、利率交換契約。
- 四、遠期利率協定。

TADS 系統簡介

商品類別

- 債券選擇權(Bond Option)
- 債券遠期(Bond Forward)
- 新台幣利率交換(IRS)
- 新台幣遠期利率協定(FRA)

96.03上線

103.12上線

系統交易時間

- 債券遠期、債券選擇權：09：00~13：30
- 利率交換、利率遠期：09：00~16：00

系統交易方式

- 買賣申報
- 點選成交
- 詢價交易

TADS系統簡介

● 業務服務費費率

■ Bond Option/Forward點選方： $\frac{1.5}{100\text{萬}}$

■ Bond Option/Forward報價方： $\frac{1}{100\text{萬}}$

■ FRA點選方： $\frac{2}{100\text{萬}}$

✓ IRS點選方： $\min\left\{\text{成交年期} \times \frac{5}{100\text{萬}}, \frac{2}{10\text{萬}}\right\}$

✓ IRS/FRA報價方費率為點選方費率減半

新台幣3億5年期契約
，點選方收費僅6,000

● 業務服務費：成交名目本金*費率

● 證券商透過系統成交之交易，毋須再繳納營業處所經營衍生性商品業務服務費

TADS系統簡介

● 電子交易系統效益佳

■ 提升市場交易公平性與透明度

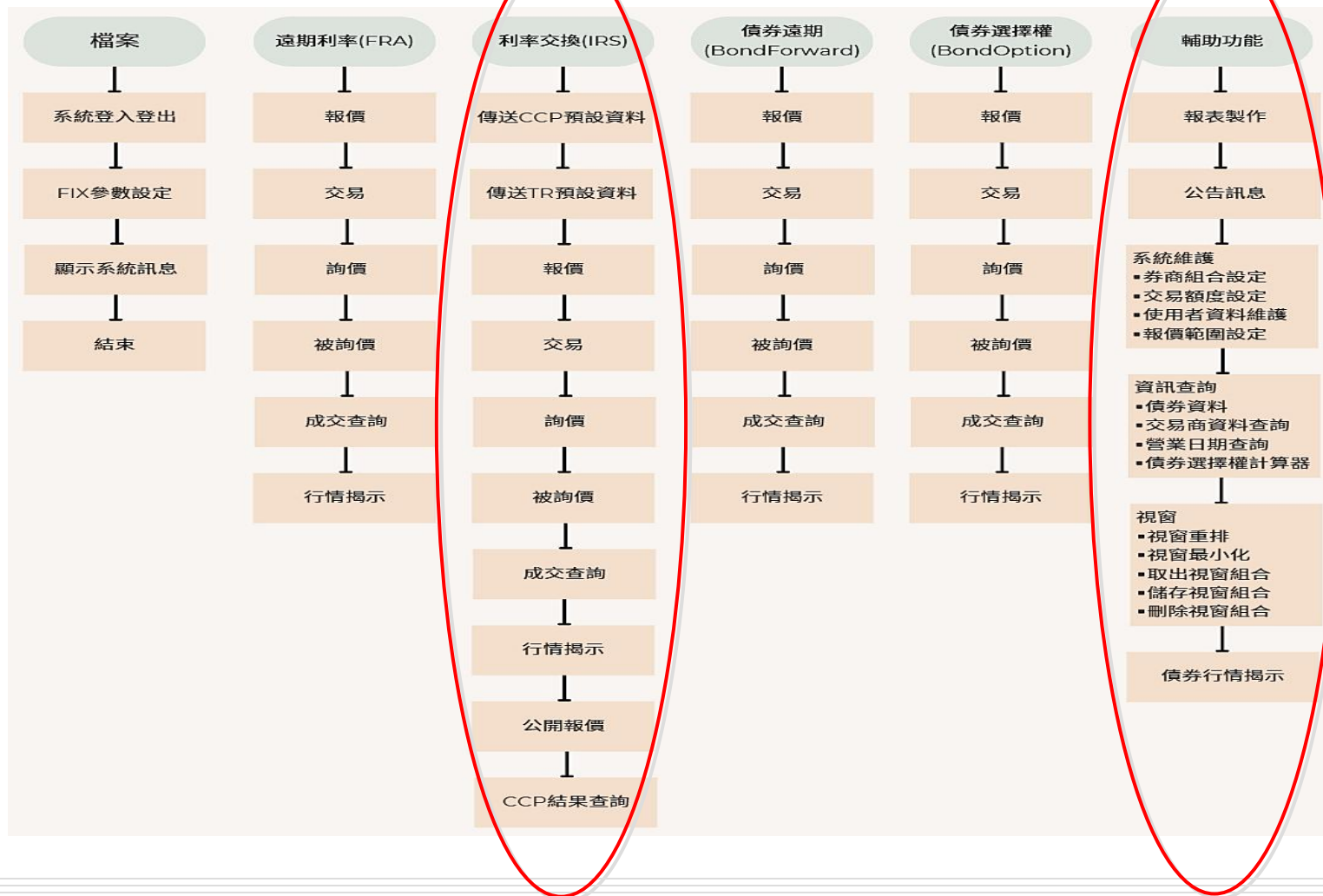
- ✓ 電子交易平台參與者，可於交易前取得多家報價、進行比價，並可獲知市場成交行情，交易過程公平公正公開，提升交易效率及資訊透明度。

■ 降低交易商交易成本

- ✓ 透過人工中介成交費用相對較高，broker收取不低的服務費。電子交易平台的收費相對較為低廉，可降低交易商交易成本。

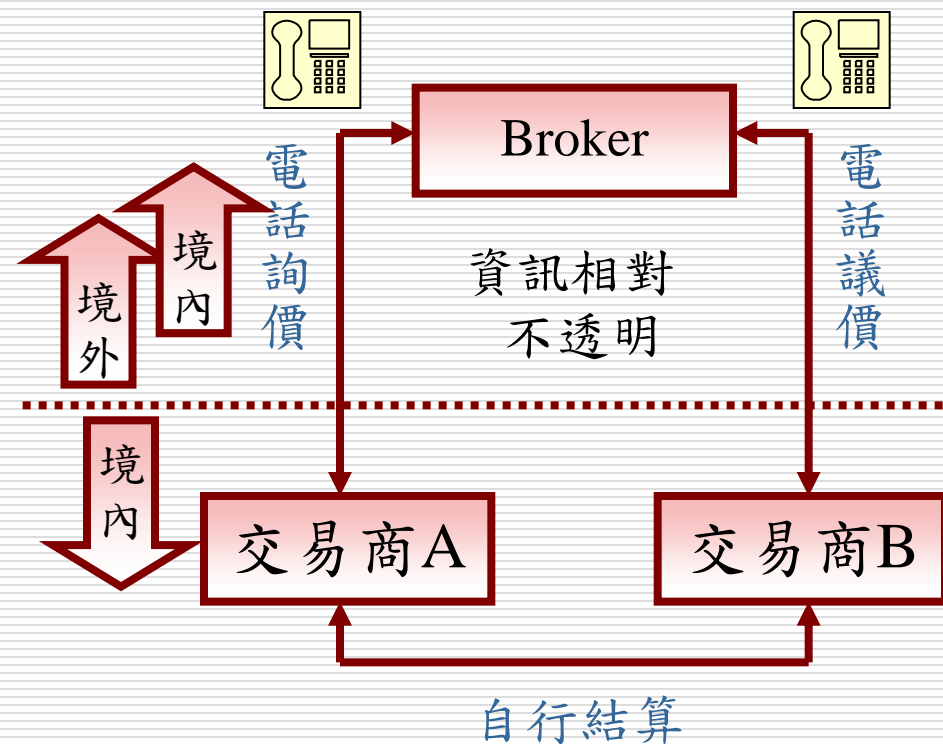
TADS系統簡介(五)

● 功能總覽

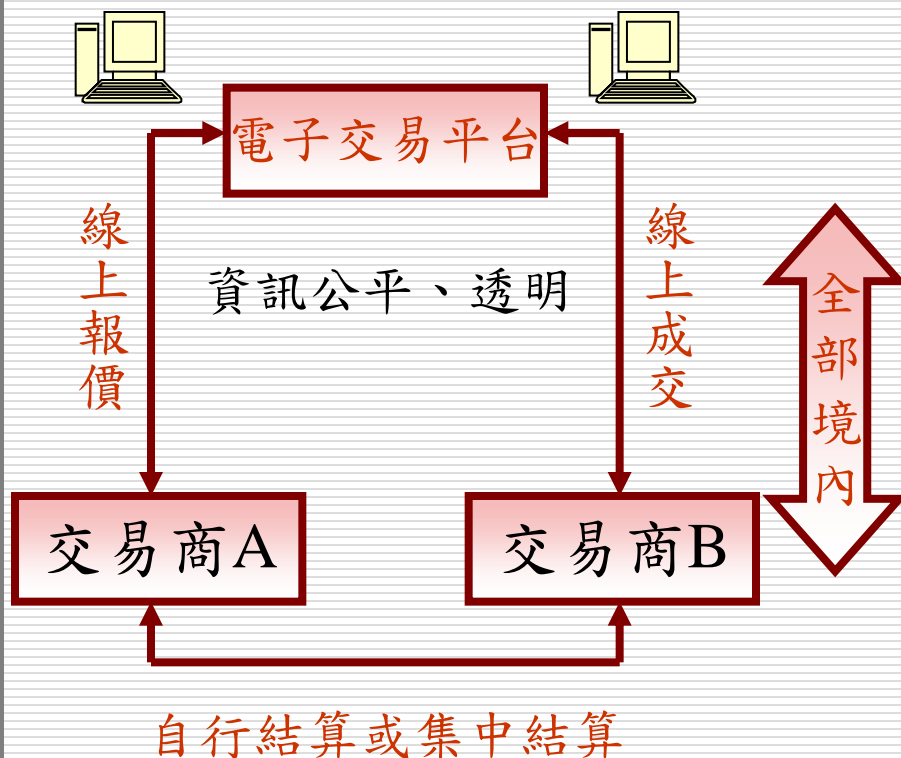


IRS交易平台

■ IDB 交易架構

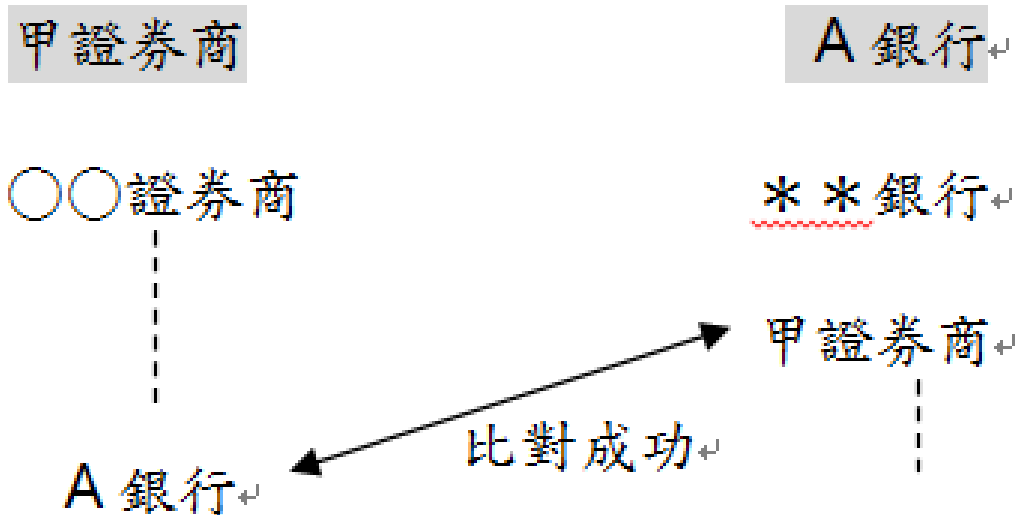


■ 電子交易系統架構

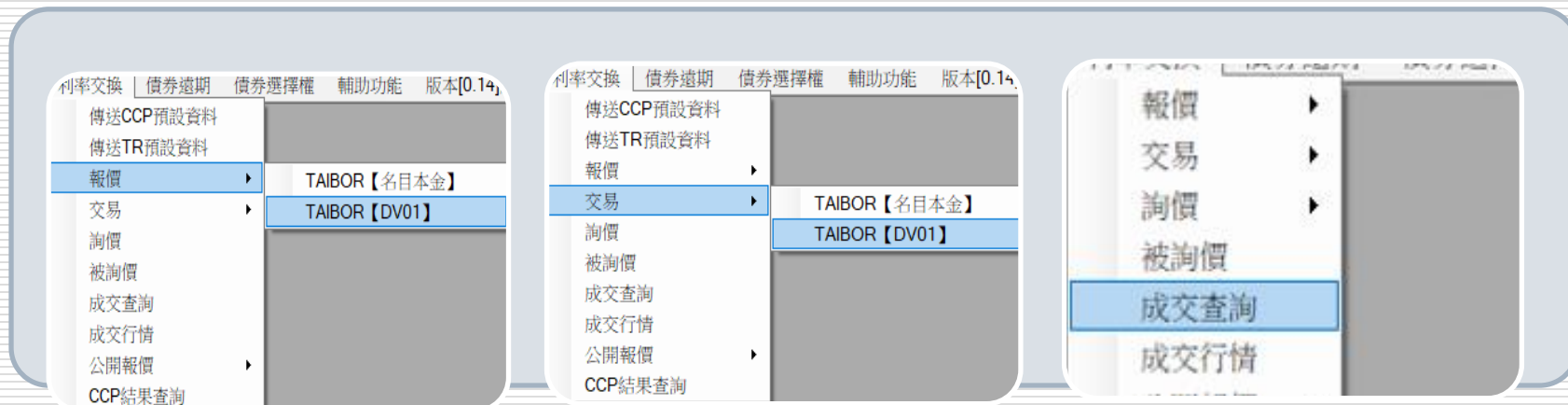


IRS交易平台

- 系統參加人：銀行、證券公司、票券金融公司及保險公司等金融機構，以業務經營交易商身分或客戶身分（不得報價）參加系統。
- 系統參與對象：向本中心申報ISDA簽約對象名單



IRS交易平台



報價

提供使用者選擇報價方式、報價對象、契約年期等進行線上即時報價。

點選

使用者可查詢各年期之報價狀況及進行成交。

成交

即時查詢確認當日盤中的成交資料。

IRS交易平台簡介

● 固定之契約規格

■ 連結標的：TAIBOR

■ 陽春型IRS，固定利率交換3個月期浮動利率

✓ 名目本金：

✓ 新臺幣3億元、5億元

✓ DV01報價：1K、5K

✓ 契約年限：1Y、2Y、3Y、4Y、5Y、7Y、10Y、
15Y、20Y

● 非固定規格可採詢價交易

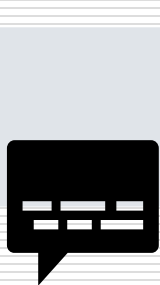
符合期交所公告
店頭衍生性金融商品集中結算
IRS契約規格

考量契約標準規格，
採詢價成交者不傳送CCP

IRS交易平台新增功能

成交資料傳輸
集中結算機構

完成交易、集中結算
及申報之直通式處理
(Straight-through
processing, STP)



系統新增
DV01報價單位



交易資料傳
送至TR系統
待申報區



IRS交易平台新增功能

- 新臺幣利率交換(IRS)交易成交資料可即時傳送結算機構
 - 金融監督管理委員會於114年3月18日以金管證期字第1140380894號公告，符合期交所受理集中結算之新臺幣利率交換契約為應集中結算適用商品，並自114年7月1日生效。
 - 完成交易同步完成集中結算提交作業
 - 有效提升交易提交集中結算之即時性

有效解決
交易額度問題

IRS 交易平台新增功能

● IRS 成交後預設將傳送集中結算

■ 固定兩次批次傳送

- ✓ 系統於下午 12:30 將 12:00 以前的交易傳送 CCP，下午 16:30 將超過 12:00 後的交易傳送 CCP
- ✓ 12:20(不含)~12:30 之間，以及超過 16:20 後不可修改同意或不同意傳送

■ 只要交易雙方其中一方未勾選同意傳送至 CCP，則該筆交易不會被傳送。

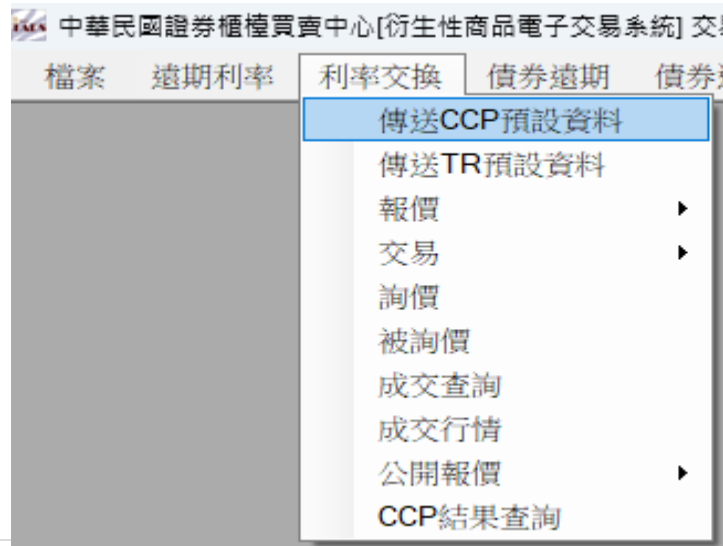
■ IRS 詢價之成交、契約年期 20 年的 IRS 點選成交，系統不會傳送 CCP。

畫面說明

交易員及後台
人員皆可設定

● 傳送CCP資料預設功能

- 在契約規格固定下，僅需就CCP會員資訊相關靜態資料(如：交易商結算會員及結算帳戶ID)於傳送CCP預設資料區先行設定，其餘皆為TADS系統交易資料



The screenshot shows the 'Interest Rate Swap (IRS) - CCP Pre-set Data Setting' dialog box. The 'Set User Account' (設定使用者帳號) field is set to 'tads002 - t*****2'. The 'Trader Settlement Member' (交易商結算會員) field is set to '0960000' and the 'Settlement Account ID' (結算帳戶ID) field is set to '000046'. These two fields are circled in red. Below the fields is a 'Save' (儲存) button. At the bottom of the dialog, a yellow banner displays the message 'CCP Setting Data Complete' (CCP設定資料完成).

畫面說明

- 報價視窗及交易視窗新增欄位
 - 新增EOM欄位(調整至月底)

利率交換(TAIBOR)-報價輸入

TAIBOR

3 5

契約年期	報價對象	3億								5億								
		EOM	隱名	量	買	賣	量	隱名	EOM	EOM	隱名	量	買	賣	量	隱名	EOM	
02年	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>

02年
03年
04年
05年
07年
10年
15年
20年

畫面說明

● 成交查詢視窗新增欄位

■ 新增「確認交易傳送CCP」之欄位，預設v傳送

利率交換(IRS) - 成交狀況查詢

交易商: 5850 統**券 交易員: tads002 - t*****2 查詢 列印 複製

累計買進: 3.1 億元 累計成交: 18.9 億元 成交日: 2025/08/11
 累計賣出: 15.8 億元 買賣超: -12.7 億元 交易員限額: 一年期: 999 億元
 *請使用[查詢]按鈕以取得最新IRS成交狀態。
 最後查詢時間: 2025/08/11 11:21:10

序號	確認交易 傳送CCP	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
1	<input checked="" type="checkbox"/>	兆**券	t*****2	T0002	Q0001	1年0月	TAIBOR	賣出	1.070	15.10	2026/08/13	11:21:16.73	000003
2	<input checked="" type="checkbox"/>	兆**券	t*****2	Q0004	T0002	5年0月	TAIBOR	賣出	1.140	0.70	2030/08/13	10:49:32.76	000002
3	<input checked="" type="checkbox"/>	兆**券	t*****2	Q0001	T0001	5年0月	TAIBOR	買進	1.260	3.10	2030/08/13	10:34:08.10	000001

交易明細查詢下載完成。

畫面說明

- 雙方對交易內容確認
- 並可選擇是否透過本系統傳送CCP

利率交換(IRS) - 成交狀況查詢

交易商: 7000 兆**券 交易員: tads002 - t*****2 查詢 列印 複製

累計買進: 0.0 億元 累計成交: 0.7 億元 成交日: 2025/08/13
累計賣出: 0.7 億元 買賣超: -0.7 億元 交易員限額: 一年期: 999 億元

*請使用[查詢]按鈕以取得最新IRS成交狀態。
最後查詢時間: 2025/08/13 10:12:40

序號	確認交易 傳送CCP	成交對	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
1	<input checked="" type="checkbox"/>	統*	Q0001	5年0月	TAIBOR	賣出	1.250	0.70	2030/08/15	10:12:49.76	000001

是否不同意傳送CCP?

確定 取消

交易明細查詢下載完成。

利率交換(IRS) - 成交狀況查詢

交易商: 7000 兆**券 交易員: tads002 - t*****2 查詢 列印 複製

累計買進: 0.0 億元 累計成交: 0.7 億元 成交日: 2025/08/13
累計賣出: 0.7 億元 買賣超: -0.7 億元 交易員限額: 一年期: 999 億元

*請使用[查詢]按鈕以取得最新IRS成交狀態。
最後查詢時間: 2025/08/13 10:12:40

序號	確認交易 傳送CCP	成交對	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
1	<input type="checkbox"/>	統**券	Q0001	5年0月	TAIBOR	賣出	1.250	0.70	2030/08/15	10:12:49.76	000001

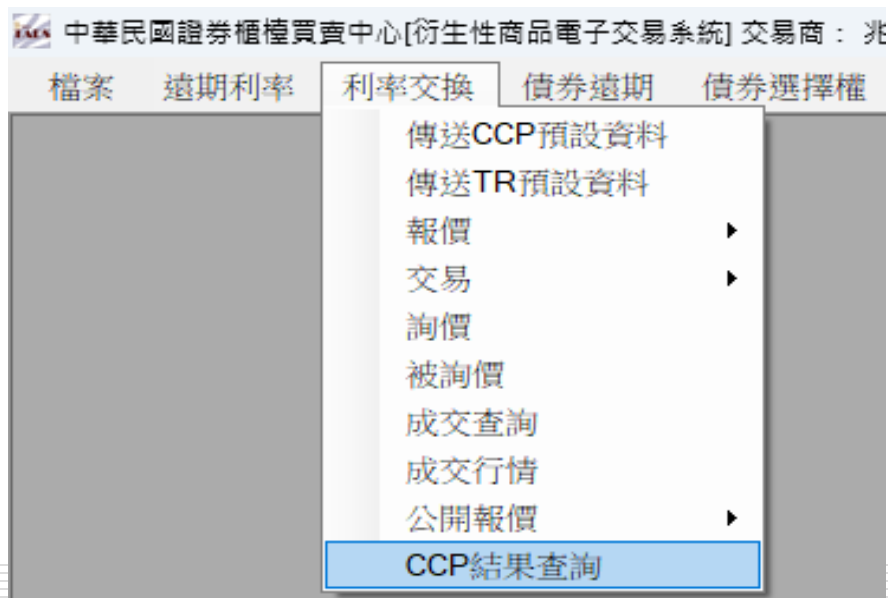
是否確認交易並同意傳送CCP?

確定 取消

處理CCP確認狀態異動更新訊息。

畫面說明

- 新增CCP結果查詢視窗
 - 於利率交換項下新增CCP結果查詢選項
 - 結合成交查詢欄位資訊。



- 利率交換(IRS) - CCP結果查詢

交易商: 7000 兆**券

交易員: tads002 - t*****2

查詢

*請使用[查詢]按鈕以取得最新CCP結果狀態。

最後查詢時間: --

執行 選項	提交 CCP流水號	CCP重送結果	CCP結算狀態	CCP結算序號	期交所回傳訊息	成交 日期	己方 交易員	成交 對象	對方 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	交易商 結算會員	交易商 結算帳戶ID	RollConvention
------	-----	------	------	-----	------	------	-------------	---------------	----------------

畫面說明

利率交換(IRS) - CCP結果確認

交易商: 5850 統**券 交易員: tads002 - t*****2 查詢

*請使用[查詢]按鈕以取得最新CCP結果狀態。
最後查詢時間: 2025/08/11 15:53:37

執行 選項	交易流水號	CCP重送結果	CCP結算狀態	CCP結算序號	期交所回傳訊息	成交日期	己方交 易員	成交對象	對方交 易員	己方 單號	對方 單號
-	00000005	-	接受	IR2025081100009		2025/08/11	t*****2	兆**券	t*****2	T0005	Q0005
-	00000004	-	接受	IR2025081100007		2025/08/11	t*****2	兆**券	t*****2	T0003	Q0004
-	00000003	-	接受	IR2025081100005		2025/08/11	t*****2	兆**券	t*****2	T0002	Q0001
-	00000002	-	接受	IR2025081100004	1111111111	2025/08/11	t*****2	兆**券	t*****2	Q0004	T0002
▶	00000001	-	接受	IR2025081100002	1111111111	2025/08/11	t*****2	兆**券	t*****2	Q0001	T0001

CCP結算狀態	狀態說明
-	尚未傳輸給CCP
提交中，待回覆	已傳輸給CCP，等待CCP (期交所) 回覆中
已提交，檢核中	已提交CCP (期交所) 完成，CCP作業檢核中
接受	已提交CCP (期交所) 完成，CCP接受
拒絕	已提交CCP (期交所) 完成，CCP拒絕

畫面說明

- CCP拒絕時可重送CCP之功能，並保留T日及T-1日交易之資料。

利率交換(IRS) - CCP結果確認

交易商: 5850 統**券
交易員: tads002 - t*****2
查詢

*請使用[查詢]按鈕
最後查詢時間: 2025/08/13 10:33:23

執行 選項	交易流水號	CCP重送結果	CCP結算狀態	CCP結算序號	期交所回傳訊息	成交日期
▶ 重送	00000001	己方未重送，對方未重送	拒絕	IR2025081300001		2025/08/13

請使用[查詢]按鈕以取得最新CCP結果狀態。

最後查詢時間: 2025/08/13 10:33:23

成交日期	己方交易員	成交對象	對方交易員	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
2025/08/13	t*****2	統**券	t*****2	Q0002	T0001	3年0月	TAIBOR	賣出	1.6500	3	2028/08/15	10:21:00.39

交易明細查詢下載完成。

畫面說明

- 重送後會出現重送是否成功訊息，並可檢視對方重送狀況

利率交換 (IRS) - CCP重送資料確認

交易商: 執行選項

交易商結算會員: 0000001
結算帳戶ID: A0123456789

密碼:

☐ 儲存密碼

確認 取消

狀態: 使用者確認中

查詢

*請使用[查詢]最後查詢時間

結算序號	期交所回傳訊息	成交日期
		2025/08/1:

提示訊息

CCP重送單送出成功

確定

利率交換(IRS) - CCP結果查詢

交易商: 交易員: tads002 - t*****2

查詢

執行選項	交易流水號	CCP重送結果	CCP結算狀態	CCP結算序號	期交所回傳訊息
重送	00000004	己方未重送, 對方未重送	拒絕	IR2025081200008	保證金檢核不足
重送	00000005	己方未重送, 對方未重送	拒絕	IR2025081200010	價格性檢核不符
重送	00000006	不可重送	接受	IR2025081200012	

IRS交易平台新增功能

- **IRS交易資料一併傳送至TR系統待申報區**
 - 待申報專區提供金融機構當日及前一日於本中心 TADS 系統交易並傳輸 CCP 且經 CCP 接受新交易資料。
 - 僅需就相關靜態資料(如：申報機構交易商類別及交易發生單位等)於傳送TR預設資料區先行設定，其餘交易資訊皆自動傳輸至TR系統供金融機構申報使用。
 - 可於交易後至TR系統待申報區，自行就TR申報項目調整完成進行TR交易申報
 - TR系統新增API功能，提升資料自動化之效能，俾利金融機構交易申報更加便捷。

IRS交易平台新增功能

● 金融機構可於待申報專區修改新欄位資料如下：

- 資料序號
- 申報機構交易商類別
- 交易發生單位
- 交易動機
- 交易對手承作目的

屬預設靜態資料

IRS交易平台新增功能

● 待申報專區提供之修改方式如下：

- 使用「匯出」、「匯入」修改：於待申報區「匯出」>「匯出CSV(TADS傳輸CCP)」資料，修改後再「匯入檔案」>「匯入修改(TADS)」並申報。



請注意：

匯入檔案各交易的最後一欄應為TR系統編製之「系統成交序號」，於TADS系統成交者固定為TADS開頭+00+日期+成交編號共20碼



IRS 交易平台新增功能

- 手動修改：於待申報區點選單筆交易資料，手動修改並申報。
- 透過系統介接方式(API)修改：透過 API 查詢待申報區資料，修改後再以API申報(詳細說明文件請參考網址：
<https://dsp.tpex.org.tw>(業務宣導網站)>電腦資訊>衍生性商品交易資訊儲存庫>相關文件>衍生性商品申報系統Web API 說明文件)。

● TR EVENT

- TR系統將於比對成功當日自動產製該交易之 EVENT。
(交易對手異動為CCP)資料
- 金融機構可至EVENT申報畫面，點選「查詢」>「當日新增」，確認EVENT申報資料(EVENT需與交易對手比對)。

請注意：

金融機構已由本中心完成交易對手變更為結算機構者，不得重複向本中心申報。

IRS交易平台新增功能



透過本中心IRS交易系統交易並傳送CCP之交易，若不透過TR待申報專區申報TR，則TR申報第43欄位務必**選擇4**，並須自行申報TR EVENT(變更交易對手為CCP)。

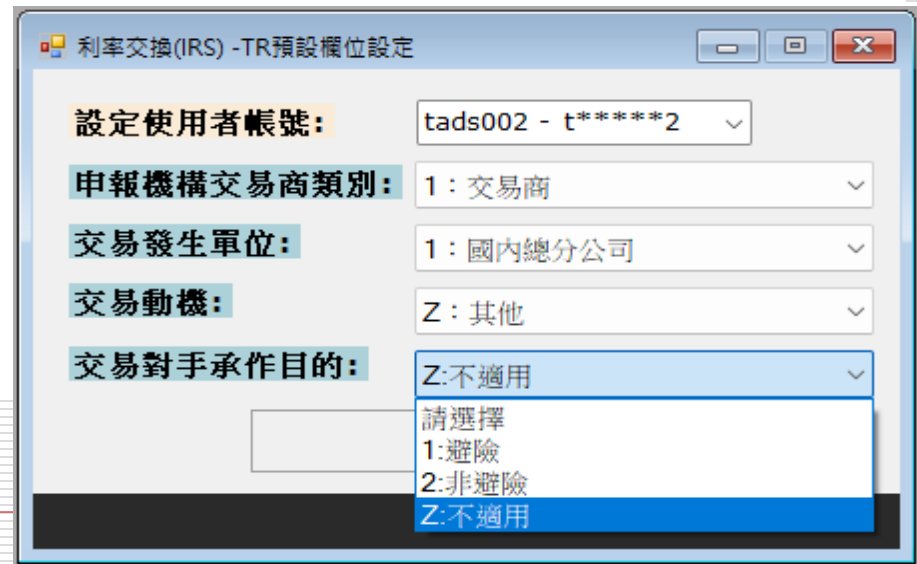
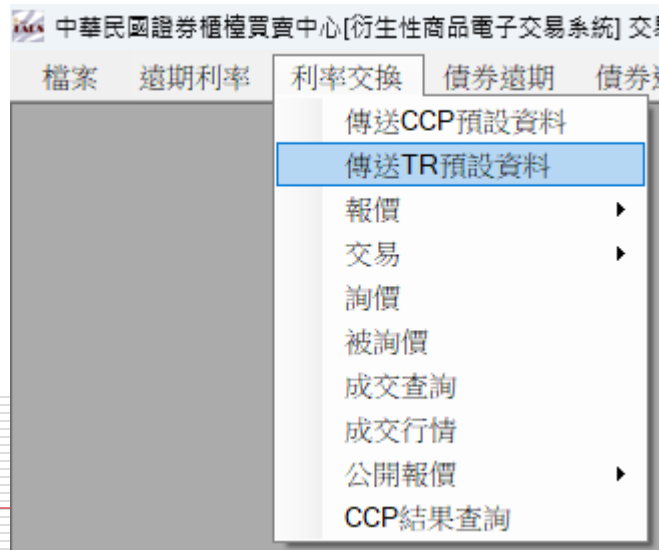
43	交易確認及傳送交易至CCP	X(1)	<div>1： 於櫃買中心成交確認系統以「雙方申報確認」方式辦理交易確認； 同意透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所</div> <div>2： 已透過其他方式完成交易確認； 同意透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所</div> <div>3： 於櫃買中心成交確認系統以「雙方申報確認」方式辦理交易確認； 不透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所</div> <div>4： 已透過其他方式完成交易確認； 不透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所</div>	請選4
----	---------------	------	---	-----

畫面說明

目前規劃交易員及後台人員皆可設定

● 傳送TR資料預設功能

- TADS之IRS成交資料除自動傳送集中結算外，亦同時自動傳送至本中心TR系統待申報區
- 僅需就相關靜態資料(如：申報機構交易商類別及交易發生單位等)於傳送TR預設資料區先行設定，其餘交易資訊皆自動傳輸至TR系統供業者申報使用。



畫面說明

- 「IRS-利率交換」申報頁面新增「TADS 已 CCP 交易(待申報)」專區



The screenshot shows the 'IRS申報' (IRS Declaration) interface. The '查詢' (Query) dropdown menu is open, displaying the following options:

- 本日新增資料
- 所有資料
- 當日比對成功/免比對
- 非當日比對成功/免比對
- 比對未成功
- 修改未成功(暫存資料)
- TADS已CCP交易(待申報)**



待申報專區提供金融機構當日及前一日，於本中心TADS系統交易並傳輸CCP，且經CCP接受之新交易資料

畫面說明

- 待申報專區資料格式與「IRS-利率交換」申報頁面資料格式相同

TR 衍生性商品資料儲存庫
成交確認系統
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
ETF加掛外幣
資料維護
使用者: tr001 登出

測試系統

TR申報
成交確認
IRS傳輸CCP

[IRS] 利率交換
查詢
查詢對手
新增
修改
刪除
匯入檔案
匯出
清畫面
申報

金融機構: 5850000
申報日期: 20250813

商品類別	本日新增資料 所有資料	資料序號	申報機構交易商類別	交易發生單位	交易對手類別
-- 請選擇 --	當日比對成功/免比對		-- 請選擇 --	-- 請選擇 --	-- 請選擇 --
交易對手代號	非當日比對成功/免比對	交易對手LEI	交易動機	交易日	生效日
	比對未成功		-- 請選擇 --	20250813	20250813
	修改未成功(暫存資料)				
到期日	TADSECCP交易(待申報)	期初收付幣別	期初收付金額	名目本金幣別	名目本金金額
20250813	20250813	-- 請選擇 --		-- 請選擇 --	
利息收付方向	營業日金融中心 - 固定利率 / 浮動利率(1)	營業日金融中心 - 浮動利率 / 浮動利率(2)	營業日金融中心 - 利息收付	營業日原則	利息交割方式
-- 請選擇 --				-- 請選擇 --	-- 請選擇 --

固定利率

固定利率(%)	付息周期	計息天數
	-- 請選擇 --	-- 請選擇 --

浮動利率指標(1)

利率指標	利率指標天期	付息周期	利率指標重設周期	利率加減碼(%)	計息天數	是否複利計算
	-- 請選擇 --	-- 請選擇 --	-- 請選擇 --		-- 請選擇 --	-- 請選擇 --

浮動利率指標(2)

javascript:doPostBack('ctl00\$ContentPlaceHolder1\$tabContainerCCP\$tabPanel1\$IRS CCP APPLY\$btnQryTADSCCP','')

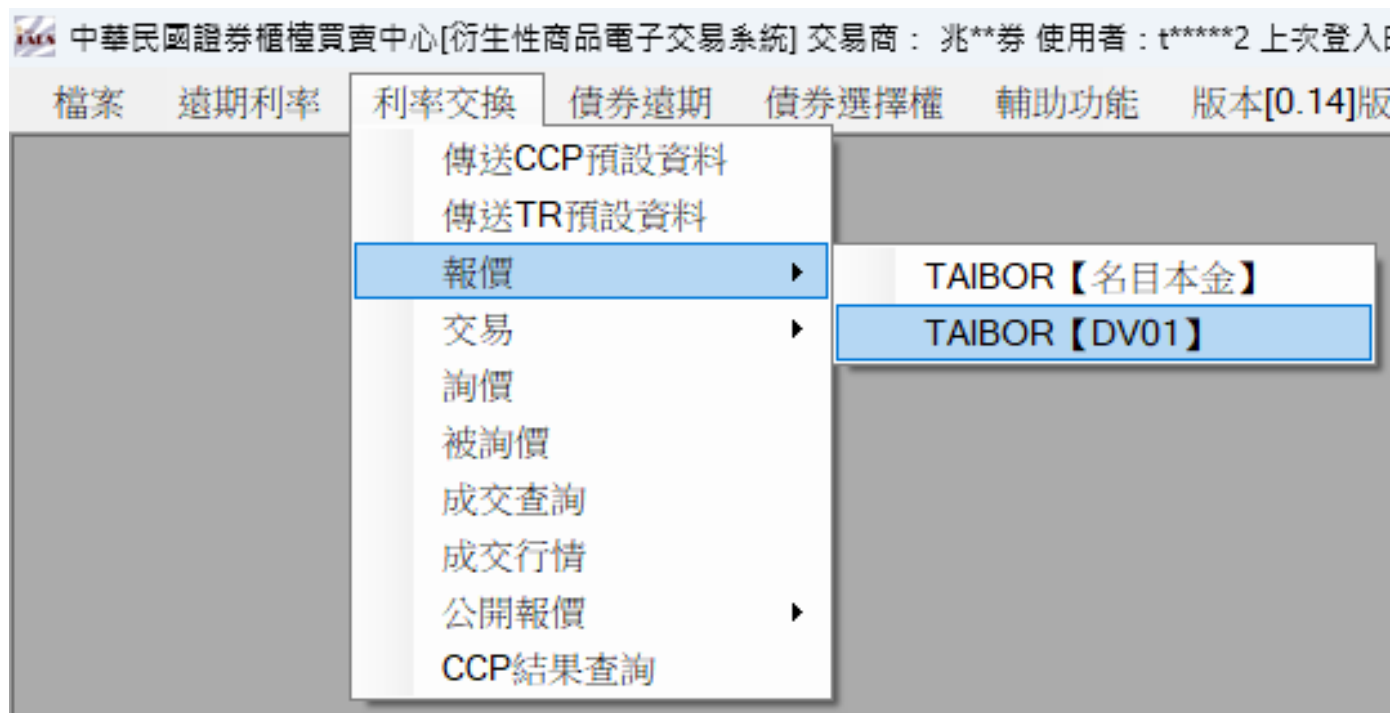
IRS交易平台新增功能

● 新增以美金DV01換算之名目日本金作為報價選項

- 固定名目日本金報價、DV01換算之名目日本金報價並行
- DV01報價：1K及5K兩種選項，每日提供9種契約年期之新台幣名目日本金(單位：億元)
- 系統以前一日收盤即期中價美元匯率換算新台幣名目日本金。
- 配合美金DV01換算之新台幣名目日本金格式異動，調整「利率交換交易DailyTrades檔案格式」

畫面說明

● 新增美金DV01報價



畫面說明

● 新增美金DV01報價

利率交換(TAIBOR) - 【DV01】報價輸入

TAIBOR

1K 5K

契約年期	1K名目本金	5K名目本金	報價對象	1K				5K								
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名	
01 年	3.1	15.6	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1				1	<input checked="" type="checkbox"/>
07 年	0.4	2.2	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1				1	<input checked="" type="checkbox"/>

系統每日計算
換算之新台幣
名目本金

畫面說明

● 新增美金DV01報價- 報價行情

利率交換(TAIBOR)-【DV01】報價輸入

TAIBOR

1K 5K

契約年期	1K名目本金	5K名目本金	報價對象	1K				5K							
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
05 年	0.6	3	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	1.420	1.510	1	<input checked="" type="checkbox"/>

利率交換(TAIBOR)-【DV01】公開報價行情

TAIBOR

05 年 1K名目本金: 0.6 5K名目本金: 3

1K			5K		
項目	買價	賣價	項目	買價	賣價
1	--	--	1	1.420	1.510
2	--	--	2	--	--
3	--	--	3	--	--
4	--	--	4	--	--
5	--	--	5	--	--
6	--	--	6	--	--

畫面說明

● 新增美金DV01報價- 點選畫面

【DV01】利率交換交易(TAIBOR) [全部契約]

TAIBOR

契約年期	1K名目本金	5K名目本金	交易商	量	1K買	1K賣	量	交易商	交易商	量	5K買	5K賣	量	交易商
01年	3.1	15.1							****	1	1.070	1.130	1	****
05年	0.7	3.1	****	1	1.030							0.000	0	2XXX

系統每日計算
換算之新台幣
名目本金

IRS交易系統常見問題

● 是否可以設定暫停交易對象？

可於系統點選「輔助功能」項下「系統維護」－「交易商組合設定」，設定「暫停交易對象名單」。

● 是否提供交易額度設定？

- 可於系統點選「輔助功能」項下「系統維護」－「交易額度設定」，提供設定「交易員」及「交易商」額度設定。由「公司主管」或「風控人員」權限者進行逐筆設定或匯出入設定。
- 額度設定5年以上可以讓5年以下共用。
- 因交易已強制集中結算，金融機構可評估放寬額度設定。(最高可設定5位整數1位小數(單位為億元))。

● 是否有報價範圍設定功能？

- 報價區間設0為不控管
- 點選「輔助功能」項下「系統維護」－「報價範圍設定」。
- 報價範圍設定值可輸入 0~999(bp)，輸入後按 Enter 鍵即設定完成。

IRS交易系統常見問題

- 是否有一鍵取消報價之功能？

有的，有全部報價取消鍵。圖案為  ；個別取消鍵則為  。

- 是否能透過程式將報價資訊匯入系統？

可洽本中心資訊人員取得Fix protocol (FIX通訊協定)，透過程式報價。

- 是否可即時自伺服器接收成交資料？

若貴公司資訊人員有自行開發程式需求，可以接洽本中心資訊人員取得FIX通訊協定，則可即時擷取資訊。

- 成交查詢中，勾選是否「確認交易傳送CCP」之權限為何？

因成交查詢的權限為交易員及風控人員，故僅交易員與風控人員可以勾選。

上線前應辦事項

- 簽訂「衍生性金融商品交易系統契約」成為系統參加人(現已簽約38家金融機構無須另行簽約)
- 金融機構備文，並檢附下列書件申請使用系統(函文範本詳本中心業務宣導專區)：
 - 「衍生性金融商品交易系統契約」一式二份
 - 金融機構暨人員登記申請書
 - 金融機構簽訂ISDA總契約對象名單申報書

電腦環境需求

- **申請交易暨行情線路**：請至本中心業務宣導網站/電腦資訊/資訊整合項下，依「交易暨行情傳輸網路線路申請及異動程序」辦理連線申請。已有使用本中心債券等殖成交系統之業者無須再次申請。
- **申請資訊伺服器連線**：請填具「資訊系統連通異動申請表函」送本中心資訊部，與本中心資訊部進行線路及資訊伺服器連線測試。資訊伺服器硬體需自備。已有債券等殖資訊伺服器之業者可使用同一台設備並安裝TADS資訊伺服器軟體。
- 於交易終端機安裝「**衍生性商品電腦交易軟體**」：
 - ◆ **硬體設備**：
 - ✓ CPU: Intel Core i3(含)以上。
 - ✓ 記憶體: 2GB(含)以上。
 - ✓ 硬碟空間： 2GB (含)以上。
 - ✓ 網路卡: 10/100Mbps。
 - ◆ **軟體需求**
 - ✓ Windows 10 (1903 或更高版本)、Windows 11
 - ✓ 需安裝 Microsoft .NET Framework 4.8(含)以上版本才能執行

TADS法規修正說明

- 配合主管機關推動我國新臺幣利率交換契約應集中結算制度
- 強化系統服務功能
- 規劃於本中心衍生性金融商品交易系統新增新臺幣利率交換交易成交資料傳送結算機構功能
- 亦將交易資料傳送至本中心衍生性金融商品交易資訊儲存庫系統供金融機構申報使用
 - 修正「店頭金融商品電腦交易系統作業辦法」第2條、第9條之1、第14條、增訂第14條之2條文
 - 修正「衍生性金融商品交易資訊儲存庫系統管理規定」第12條之3，並自115年1月12日起施行

TADS法規修正說明

● 店頭金融商品電腦交易系統作業辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>第二條</p> <p>本辦法所稱主管機關，為金融監督管理委員會。</p> <p><u>本辦法所稱結算機構，為主管機關規定應集中結算之店頭衍生性金融商品之結算機構。</u></p>	<p>第二條</p> <p>本辦法所稱主管機關，為金融監督管理委員會。</p>	<p>一 <u>新增第二項。</u></p> <p>二 配合我國店頭衍生性金融商品市場集中結算制度之實施，爰新增本辦法所稱結算機構之定義</p>

TADS法規修正說明

● 店頭金融商品電腦交易系統作業辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>第九條之一</p> <p>利率交換契約之交易規格為：</p> <p>一、契約名目本金 (Notional Amount)得為新台幣三億元、五億元<u>或其他依本系統按日揭示之金額</u>。</p>	<p>第九條之一</p> <p>利率交換契約之交易規格為：</p> <p>一、契約名目本金 (Notional Amount)得為新台幣三億元、五億元。</p>	<p>配合新台幣利率交換交易市場實務，新增以美元DV01 (dollar value of a basis point)換算新台幣名目本金之契約規格選項，本系統將按日計算揭示依美元DV01計算之名目本金，並考量日後因應市場報價需求新增其他名目本金選項，爰修正第五項第一款。</p>

TADS法規修正說明

● 店頭金融商品電腦交易系統作業辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>第十四條</p> <p>(前三項略)</p> <p>衍生性金融商品交易系統參加人自行辦理給付結算者，應依系統成交紀錄為之。</p> <p><u>參加人採集中結算方式辦理利率交換契約給付結算作業者，應依結算機構相關規定辦理。</u></p>	<p>第十四條</p> <p>(前三項略)</p> <p>衍生性金融商品交易系統參加人自行辦理給付結算者，應依系統成交紀錄為之。</p>	<p>一、新增第五項。</p> <p>二、配合我國店頭衍生性金融商品市場集中結算制度之實施，且依主管機關規定符合結算機構規範規格之新臺幣利率交換交易應集中結算，爰新增參加人採集中結算作業辦理給付結算之方式。</p>

TADS法規修正說明

● 店頭金融商品電腦交易系統作業辦法

修正條文	現行條文	說明
<p>第十四條之二</p> <p>參加人依第十一條第一項成交之利率交換契約並依主管機關規定而應採集中結算者，除依同條第二項詢價成交者外，成交後得由本中心傳輸交易資料予結算機構。</p> <p>依前項由本中心傳輸交易資料予結算機構者，不得申報改帳。</p>		<p>一、本條新增。</p> <p>二、配合我國店頭衍生性金融商品市場集中結算制度之實施，且依主管機關規定符合結算機構規範規格之新臺幣利率交換交易應集中結算，為協助金融機構提升作業效率及降低作業成本，並提升交易提交集中結算之即時性，爰提供金融機構於本中心衍生性金融商品交易系統成交之利率交換契約於交易確認後提交結算機構服務，另考量契約標準規格，採詢價成交者不適用之。</p> <p>三、因傳送集中結算之交易係為雙方已確認之交易結算契約不得變更內容，爰於第二項明定該等交易於傳輸結算機構後不得依第十二條規定向本中心申報改帳。</p>

TADS法規修正說明

● 衍生性金融商品交易資訊儲存庫系統管理規定

修正條文	現行條文	說明
<p>第十二條之三</p> <p>金融機構以本中心衍生性金融商品交易系統成交並由本中心傳輸交易資料予結算機構之利率交換契約，經結算機構接受後於本系統完成申報，本中心得將金融機構原申報資料之交易對手變更為結算機構。</p> <p>金融機構已由本中心完成前項交易對手變更為結算機構者，不得重複向本中心申報之。</p>		<p>一、本條新增。</p> <p>二、為提升服務效能，配合本中心店頭金融商品電腦交易系統作業辦法修正，金融機構使用本中心衍生性金融商品交易系統成交之利率交換契約經本中心傳輸集中結算者，本中心於交易經集中結算機構接受後，即將交易資料傳送至本系統待申報區供金融機構申報之，金融機構以待申報專區資料完成申報者，本中心即將金融機構原申報資料之交易對手變更為結算機構，期簡化金融機構於本系統申報作業，爰增訂第一項規定。</p> <p>三、為避免發生重複申報資訊之情事，爰於第二項明定金融機構已由本中心完成前項交易對手變更為結算機構者，不得重複向本中心進行申報。</p>

IRS 交易平台活動

● 交易獎勵活動 (草案)

■ 期間：115年1月12日～12月31日

■ 獎勵方式：

- 競賽獎項：每季就納入競賽之交易商按競賽方式計算所得積分，積分前三名之交易商依序頒發下列獎額
 1. 第一名：新臺幣 15萬元整。
 2. 第二名：新台幣 12萬元整。
 3. 第三名：新台幣 8萬元整。
- 競賽交易範圍內之成交契約，成交名目本金每新台幣 0.1億元即為1積分。
- 「報價成交」者採2倍積分
- 交易商於當季之月平均積分至少須達1800分始納入競賽



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange

聯絡資訊

業務內容	聯絡人資訊
交易規則相關問題	謝小姐 (02)23666147 louise@tpex.org.tw
衍生性商品電子交易軟體操作	陳小姐(02)23665934 susanchen@tpex.org.tw 楊小姐 (02)23665935 wtyang@tpex.org.tw 吳先生 (02)2366-6149 williamwu@tpex.org.tw
資訊伺服器操作與設定	黃先生(02)23666180 Tom880202@tpex.org.tw 蔡先生(02)23665955 dian_tsai@tpex.org.tw

簡報結束
敬請指教
Q&A
