

證券櫃檯買賣中心

店頭衍生性金融商品交易資訊儲存
庫(TR)申報格式修改宣導說明會



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange



簡報大綱

- 申報依據
- 上線時程
- 衍生性商品交易申報格式修改(格式A、B)
 - LEI識別碼說明
 - 格式說明
 - LEI申報問題



簡報大綱

- 結構型商品交易申報格式修改(格式D)
 - 格式說明
 - 商品案例
 - 未到期交易資料補正方式
- TR申報常見問題



申報依據



申報依據

- 金融監督管理委員會107年1月24日金管銀外字第10600290140號函。
- 金融監督管理委員會107年2月5日證期(券)字第1070302159號函。
- 櫃買中心107年2月14日證櫃債字第10700030601號公告。



上線時程



序號	重要工作項目	預定時程
1	格式修改公告	107年02月14日
2	申報機構提供本中心LEI資訊	107年06月29日 或取得日起一個月內
3	使用者系統操作測試	107年07月02日 ~08月31日
4	新版格式正式上線	107年09月03日
5	結構型商品未到期交易(一年內到期) 補正期限	107年12月03日 (上線後3個月內)
6	結構型商品未到期交易(一年以上到期) 補正期限	108年03月04日 (上線後6個月內)

指上線後一年內到期之交易，意即於108年9月3日前到期之交易

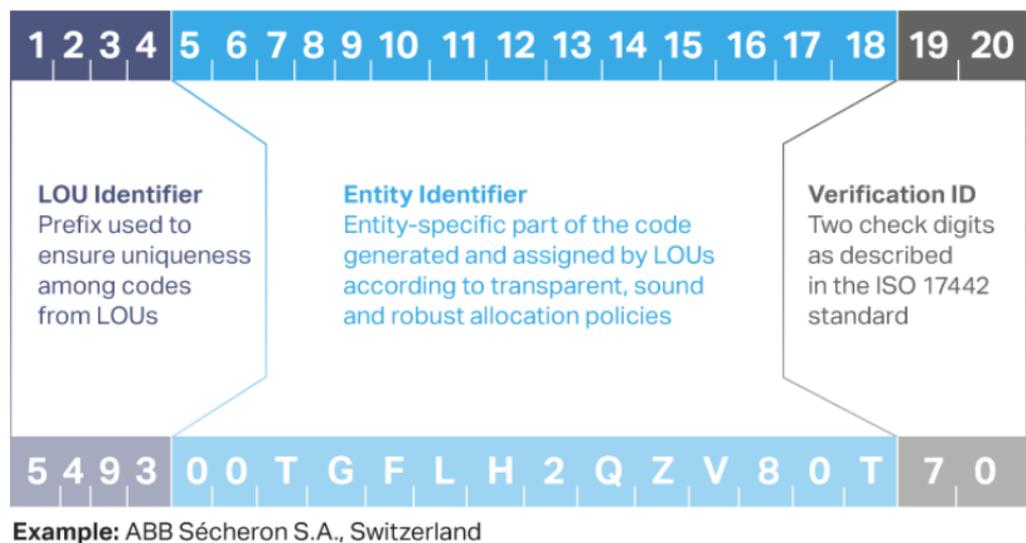


衍生性商品交易申報 格式修改(格式A、B)



LEI 識別碼說明

□ 何謂法人機構識別碼(Legal Entity Identifier, LEI)?



LEI 識別碼為一組20個字元編碼，依ISO-17442:2012所編製，可作為法人機構於全球交易的唯一識別，自2018年1月3日起，歐盟已強制要求金融機構提供之交易與服務若屬須申報至交易資料儲存庫者，皆須先取得客戶或對手的LEI編碼後，方能提供相關交易與服務。



LEI 識別碼說明(續)

□ 如何知道一組LEI是否有效或存在?

1) 可至GLEIF(全球LEI基金會)網站搜尋：<https://www.gleif.org/zh/lei/search/>

LEI Search

[< Back to LEI Data](#) [How to Use LEI Search >](#)

[in Share](#) [Tweet](#)

The Global Legal Entity Identifier (LEI) Index provides information, updated daily, on all [Legal Entity Identifiers \(LEIs\)](#) issued to date. Interested parties can access and search the complete LEI data pool using the web-based LEI search tool developed by the [Global Legal Entity Identifier Foundation \(GLEIF\)](#). The information made available with the Global LEI Index is based on the data included with the [Level 1 LEI-Common Data File Format Version 2.1 Concatenated File](#).

The LEI search tool developed by GLEIF is a sophisticated yet easy to use search engine. Results are presented in the web browser or in various other formats for further processing (Excel, CSV, XML, JSON). Other features that ensure user friendliness include: pre-defined queries; comparison of results for multiple LEIs; and the ability to store complex queries for recurrent searches.

1,110,078 LEI Records available for given search parameters

SUBMIT

[+ Add Filter](#)

2) 或至GLEIF下載檔案(XML檔案)：<https://www.gleif.org/en/lei-data/gleif-concatenated-file/download-the-concatenated-file>



格式A說明

- 格式A包含FXD、IRS、TED、FXO、FXO2、SWPT、IRS2、IRO、CDS、FED、CMS及CMO等所有衍生性金融商品。
- LEI編碼格式為20位元英數字，並置於交易對手代號之後，各商品新舊格式內容長度對照請見P17。

欄位	格式	內容	說明	比對
交易對手代號	X(10)	依對手類別填報代號、編號或免填	1.國內金融機構與國內金融機構海外分公司：「金融機構代號一覽表」代號 2.國內政府機構、國內其他法人：統一編號(中央銀行免填) 3.國內個人：免填 4.國外金融機構：請填報前八碼之SWIFT CODE，若該金融機構無SWIFT CODE請填報A 5.國外法人、個人(1)若為國外個人請填報A,(2)若為國外法人,請優先填報聯徵中心虛擬統編，若無聯徵中心虛擬統編請填入FINI代號，若無虛擬統編與FINI代號請填報B 6.若交易對手類別為C，請依表E填入CCP代號	=#3
交易對手LEI識別碼	X(20)	填報交易對手LEI識別碼	交易對手已取得法人機構識別碼(Legal Entity Identifier, LEI)者，請填報對手之LEI識別碼，未取得LEI識別碼者，可免填。	
交易動機	X(1)	1：Back-to-Back避險 2：跨市避險－現貨市場 3：跨市避險－期貨市場 4：其他會計避險或保險業避險目的之交易 Z：其他	1.「其他會計避險」係指非屬1"、"2"和"3"，且以避險會計入帳者，「保險業避險」係指非屬1"、"2"和"3"，且保險公司依「保險業從事衍生性金融商品交易管理辦法」所從事之避險交易 2.填報"4"和"Z"者該筆交易必須填報格式C。 3.填報"1"、"2"和"3"者該筆交易僅須填報格式C之"契約市價"與"信用風險抵減"欄位	

格式A說明(續)

□ 只要交易對手屬於法人者，皆需申報其LEI編碼，CCP也要(一定有)。

6	交易對手類別	X(1)	<p>1：國內金融機構(限銀行、票券、)</p> <p>2：國內政府機構(含政府基金)</p> <p>3：國內其他法人</p> <p>4：國內個人</p> <p>5：國外金融機構</p> <p>6：國外法人、個人</p> <p>7：國內金融機構海外分公司</p> <p>8：去識別化-對手未同意</p> <p>9：去識別化-當地國法令</p> <p>C：CCP</p>	<p>1. 交易對手為國內金融機構OBU請填報「國內金融機構」</p> <p>2. 交易對手為OBU客戶請填報「國外法人、個人」</p> <p>3. 交易對手為信託業請填報「國內其他法人」</p> <p>4. 交易對手為中央銀行請填報「國內政府機構(含政府基金)」</p> <p>5. 交易對手為FINI/Non FINI請填報「國外法人、個人」</p> <p>6. 若海外分行已盡力尋求交易對手出具書面同意書仍未獲交易對手同意，請填報8：去識別化-對手未同意</p> <p>7. 若海外分行依當地國法規於取得交易對手同意後仍不得申報者，請填報9：去識別化-當地國法令</p> <p>8. 若交易對手為CCP(無中交易對手)請填報C:CCP</p>	選"1"者須比對
7	交易對手名稱	X(40)	中文或英文名稱	<p>1. 請填入交易對手全名或可資辨識之名稱關鍵字或縮寫</p> <p>2. 交易對手為中央銀行者免填報</p>	
8	交易對手代號	X(10)	依對手類別填報代號、編號或免填	<p>1. 國內金融機構與國內金融機構海外分公司：「金融機構代號一覽表」代號</p> <p>2. 國內政府機構、國內其他法人：統一編號(中央銀行免填)</p> <p>3. 國內個人：免填</p> <p>4. 國外金融機構：請填報前八碼之SWIFT CODE，若該金融機構無SWIFT CODE請填報A</p> <p>5. 國外法人、個人：(1)若為國外個人請填報A，(2)若為國外法人，請優先填報聯徵中心虛擬統編，若無聯徵中心虛擬統編請填入FINI代號，若無虛擬統編與FINI代號請填報B</p> <p>6. 若交易對手類別為C，請依表E填入CCP代號</p>	=#3
9	交易對手LEI識別碼	X(20)	填報交易對手LEI識別碼	交易對手已取得法人機構識別碼(Legal Entity Identifier, LEI)者，請填報對手之LEI識別碼，未取得LEI識別碼者，可免填。	



格式B說明

- 格式B(MODOTR)為非比對欄位資料異動格式，若發生LEI編碼格式申報錯誤者，可利用MODOTR修改。
- 新交易對手識別碼欄位置於新交易對手代號之後，格式B原格式長度為162位元組，新格式長度為182位元組。

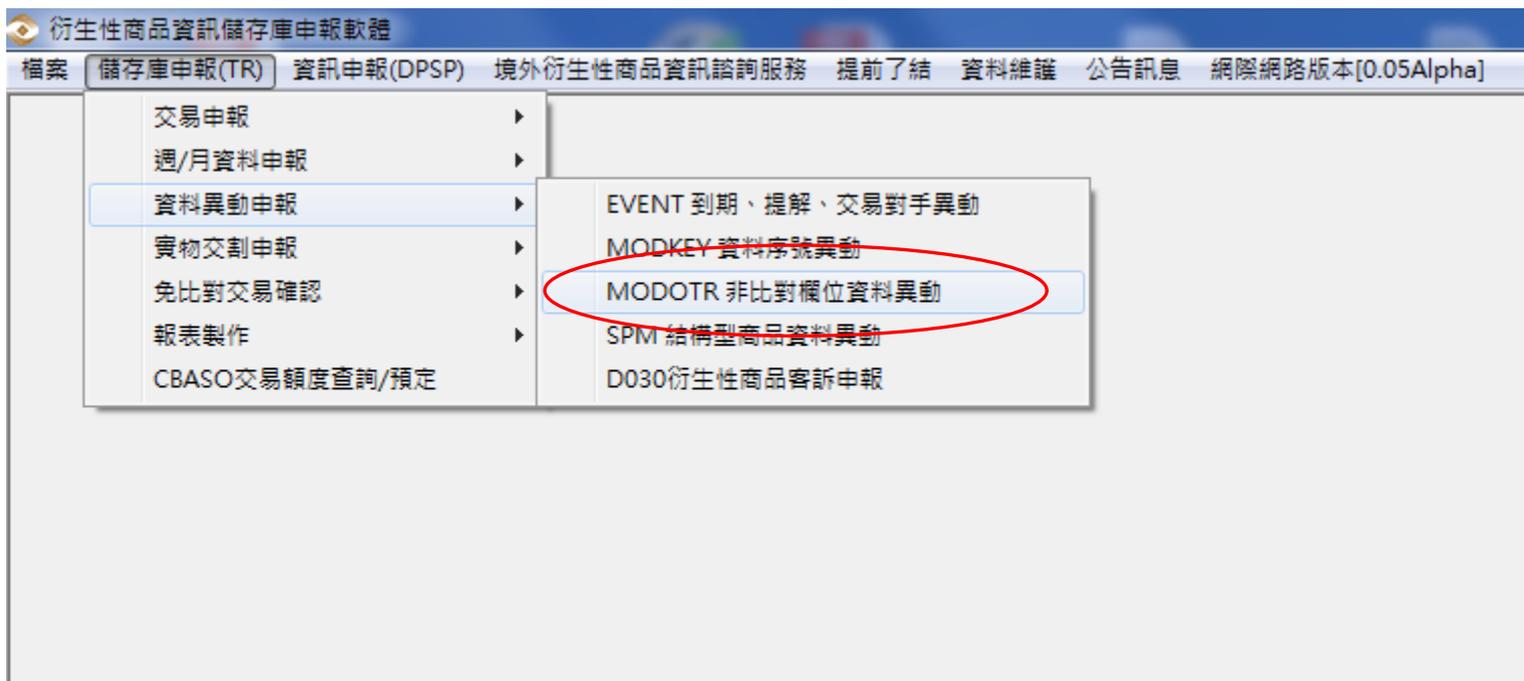
格式B (日資料異動格式－非比對欄位資料異動) 檔名：MODOTR.txt或MODOTR.csv

序號	欄位	格式	內容	說明
1	資料序號	X(20)	原申報機構自行編製之"資料序號"	原"資料序號"須已存在
2	新交易發生單位	X(1)	申報機構修改後之交易發生單位	
3	新交易動機	X(1)	申報機構修改後之交易動機	
4	新交易對手類別	X(1)	申報機構修改後之交易對手類別	
5	新交易對手名稱	X(40)	申報機構修改後之交易對手名稱	
6	新交易對手代號	X(10)	申報機構修改後之交易對手代號	
7	新交易對手LEI識別碼	X(20)	申報機構修改後之交易對手LEI識別碼	
8	交易對手承作目的	X(1)		
9	交易對手身分別	X(1)		



格式B說明

□MODOTR非比對資料異動位於資料異動申報功能內。





LEI 申報問題

□ 是否需提供櫃買中心LEI編碼?是否會提供LEI編碼對照表?LEI是否會檢核或比對?

- 1) TR簽約機構於今年5月31日前已取得LEI編碼者，請於6月29日前發函本中心LEI編碼及註冊名稱，5月31日後取得者，請於取得編碼後一個月內函報本中心，本中心將定期彙整予主管機關參考。
- 2) 本中心預計將於7月份公告TR機構代碼與LEI編碼對照表(僅供參考)，申報機構於TR系統鍵入對手TR機構代碼後，系統將自動帶出該對照表上之LEI編碼，但仍可自行修改。
- 3) 申報時會檢查LEI編碼格式是否正確但不比對，本中心每月會與GLEIF所公告之檔案進行比對，檢查各申報機構當月申報之交易對手LEI編碼是否為有效編碼，並出具異常報表予各申報機構(見P18)。



LEI 申報問題(續)

□ 外商在台分行是否需申請LEI編碼?是否可申報母行的LEI?

請遵循貴公司內部政策，目前並無強制規定海外分行須有獨立LEI編碼，說明如下：

- 1) 若貴公司分行已註冊LEI編碼，請函報分行LEI編碼予本中心；
- 2) 若貴公司分行未註冊LEI編碼，請遵循貴公司內部政策，母行允許分行使用母行LEI編碼者，則請函報母行LEI編碼予本中心；
- 3) 若貴行於台灣同時開立分行與子行業務者，請分別函報分行與子行的LEI碼予本中心。



LEI 申報問題(續)

□ 金融機構分行的LEI編碼是否皆與母行相同?

不一定，國內金融機構海外分行與母行之TR機構代碼相同，但LEI編碼可能不同，故申報時敬請注意。

□ 金融機構若已取得多個LEI編碼者(事業群獨立)，申報時發現與對照表不同，應申報何者?

若金融機構因事業群獨立而註冊多筆LEI編碼，申報交易資料時請以交易發生單位之LEI編碼為主，可與對照表不同。此外，若交易對手為基金者，請申報該檔基金之LEI編碼。

□ 107年9月3日上線後，流通在外的交易資料需補正LEI編碼嗎?

不需要，上線日後之新作交易才需申報LEI編碼，流通在外交易無須補正。

新舊格式內容長度對照

格式名稱	商品/檔名	原格式內容長度(位元組)	新格式內容長度(位元組)	差異(位元組)
格式A	FXD	168	188	20
	IRS	225	245	20
	TED	341	361	20
	FXO	180	200	20
	FXO2	258	278	20
	SWPT	467	487	20
	IRS2	495	515	20
	IRO	331	351	20
	CDS	637	657	20
	FED	542	562	20
	CMS	508	528	20
CMO	245	265	20	
格式B	MODOTR	162	182	20
格式D	SP	320	562	242

LEI識別碼異常狀況月報表

LEI識別碼異常狀況月報表							
申報月份：201802		交易對手					
申報日	商品類別	資料序號	類別	名稱	代號	LEI識別碼	資料狀態
20180205	5	IRS0011010	1	00銀行	0020000	456800Y2I5WU0188YI01	LEI不存在



結構型商品交易申報 格式修改(格式D)

格式說明(1/22)

海外分行要申報！

欄位		格式	內容	填報說明
交易日期	年	9(4)		訂約日 (the day of the initiation of contract)
	月	9(2)		
	日	9(2)		
申報機構代號		X(7)	請依本中心編製「金融機構代號一覽表」輸入	參照「TR簽約機構一覽表」
申報機構交易發生單位		X(1)	1：國內總分公司 2：國際金融業務分行／國際證券業務分公司 ／國際保險業務分公司 3：國外分公司	1. 請填報總分支機構、國際金融業務分行、國際證券業務分公司或國際保險業務分公司資料。 2. 不包括海外子公司資料。
產品代號		X(20)	該功能用以確認為同一檔商品，可由公司自行編碼	本表係採逐檔商品填報方式。相同成立日期、名目本金幣別、商品種類、標的型態者以同一產品代號申報。 【檢核】產品代號不得重覆。
投資人限制		X(1)	1：僅限專業機構投資人及高淨值投資法人 2：限專業投資人 3：不限專業投資人	依產品是否訂有投資人限制填報。

格式說明(2/22)

註：內容2~H(未列示)未修正。

欄位	格式	內容	填報說明
商品型態	X(1)	1：結構型商品	「結構型商品」係指各申報機構依循下列規定所辦理之結構型商品業務：(1) 銀行：依「銀行辦理衍生性金融商品業務內部作業制度及程序管理辦法」所辦理者。(2) 證券商：依「證券商營業處所經營衍生性金融商品交易業務規則」所辦理者。(3) 槓桿交易商：依「槓桿交易商經營槓桿保證金契約交易業務規則」所辦理者。(4) 保險公司：依「投資型保險專設帳簿保管機構及投資標的應注意事項」所銷售之投資型保單連結國內結構型商品。(5) 信託業：依「信託業營運範圍受益權轉讓限制風險揭露及行銷訂約管理辦法」所銷售之境內結構型商品。

信託業銷售境內結構型商品要申報！



格式說明(3/22)

註：本頁欄位未修正。

欄 位		格 式	內 容	填 報 說 明
發行機構代號		X(7)		「商品型態」為2、F、G、H者，依【表C】「發行機構及保證機構代號一覽表」填報。 保險公司申報「商品型態」為「1：結構型商品」者，請依「TR簽約機構一覽表」填報。 【檢核】申報機構類別為「證券商」、「保險公司」及「信託業」者，且商品型態填報2、F、G、H，本欄為必要欄位，並應符合「TR簽約機構一覽表」及【表C】所列代號。
保證機構代號		X(7)		「商品型態」為2、F、G、H者，依【表C】「發行機構及保證機構代號一覽表」填報。 保險公司申報「商品型態」為「1：結構型商品」者，請依「TR簽約機構一覽表」填報。 【檢核】申報機構類別為「證券商」、「保險公司」及「信託業」者，且商品型態填報2、F、G、H，本欄為必要欄位，並應符合「TR簽約機構一覽表」及【表C】所列代號。
商品成立日期	年	9(4)	西元年	發行日期 (the issue date) 或生效日 (the effective date) 【檢核】商品成立日期必須小於商品到期日期。
	月	9(2)	月	
	日	9(2)	日	
商品到期日期	年	9(4)	西元年	商品最終到期日 【檢核】商品到期日期必須大於商品成立日期。
	月	9(2)	月	
	日	9(2)	日	
名目本金幣別		X(3)	依「國際貨幣代碼一覽表」輸入	本欄為必要欄位，請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」
名目本金金額		9(15)V(2)	單位：元	本欄為必要欄位，請填「名目本金幣別」之金額。

格式說明(4/22)

欄 位	格 式	內 容	填 報 說 明
商品種類	X(1)	1：保本型商品 2：非保本型商品	保本率100%（含）以上申報至保本型商品；保本率100%（不含）以下，申報至非保本型商品。
保本率	9(3)	單位：%	指產品未發生中途解約情形，且到期發行機構未發生違約情事，產品到期結算之稅前返還原計價幣別本金比率。 1. 如商品為100%保本，請填100。 2. 如商品非屬100%保本，但商品仍提供部分保本，請填部分保本比率，如：70。 3. 如商品不保證返還投資本金，請填0。 4. 如商品係屬階梯式保本，請填最低保本率。



格式說明(5/22)

欄位	格式	內容	填報說明
年化收益率	9(2)V9(2)	單位：%	<p>1. 整段投資期間如為配發固定收益者，請填固定配發(保證)年化收益率。</p> <p>2. 如非屬配發固定收益者，則排除保證收益條件後，填報產品符合一定條件下之「最高」稅前年化收益率(如無法填寫最高收益率，免填此欄位)。</p> <p>【檢核】僅「年化收益率是否有上限」欄位填報1者，本欄可免填。</p>
年化收益率是否有上限	X(1)	<p>1. 年化收益率無上限(依公式計算)</p> <p>2. 年化收益率有上限</p>	依年化收益率是否設有上限填報。

格式說明(6/22)

■ 「年化收益率」填報範例：

範例 1

收益率(稅前)	第 1 年：年率 11% 【預計】 第 2~10 年：5.6 x (CMS 30Y - CMS 5Y)；最低為 0%，最高為 10%
---------	---

非屬配發固定收益者，則排除保證收益條件後，填報產品符合一定條件下之「最高」稅前年化收益率，故應填報：10。

範例 2

若本商品契約存續期間遇連結標的配息，交易人可於各連結標的之配息交割日領回各連結標的之配息金額。

無法填寫最高收益率，則免填此欄位。
「年化收益率是否有上限」應填報1(無上限)。

格式說明(7/22)

欄位	格式	內容	填報說明
保證收益率	保證年期(年)	9(2)V9(2) 單位：年	產品保證固定給付之年期及年化報酬率。 1. 不考慮產品贖回情形，亦不考慮收益給付之幣別是否轉換。 2. 保證年期(年)如係以天數換算年期，請依計價貨幣國際慣例計息基礎換算(例：投資天數/360，或投資天數/365)。 3. 如產品無保證收益，保證年期及保證年化收益率請皆填0。
	保證年化收益率(%)	9(2)V9(2) 單位：%	
收益率計算方式	X(1)	1：依落入天期計 2：依特定日比價 3：配發固定收益 4：其他	1. 依產品收益率計算方式選填。 2. 如投資期間前段配發固定(保證)收益，後段配發浮動收益，依浮動收益計算方式選填。 3. 單純到期一次配發固定收益或定期配發固定收益者，請填3。

同時符合2種以上計算方式，或是定期配發不固定收益(但非屬1、2之計算方式)者，請填報4：其他。

格式說明(8/22)

■ 「收益率計算方式」填報範例：

範例 1

$$\text{產品收益} = \text{投資本金} \times (\text{年率}) \times N/M \times \text{Act}/365$$

應填報 1：依落入天期計。

範例 2

$$\text{產品收益} = \text{參與率} \times (\text{連結標的1} - \text{連結標的2})$$

產品收益依連結標的之定價計算，
應填報 2：依特定日比價。

格式說明(9/22)

欄位	格式	內容	填報說明
標的風險類別	X(1)	1：利率相關 2：匯率相關 3：權益證券相關 4：商品相關 5：信用相關 6：銀行業承作台股股權相關 Z：其他	1. 本欄位係以結構型商品契約隱含之主要風險為分類標準，分為利率、匯率、權益證券、商品及信用五類。 2. 「權益證券相關」含股價及股價指數等。 3. ETF及REITs依該基金投資標的之風險類別填報。 4. 若屬複合型結構型商品，應填報所隱含主要風險類別，若對風險分類有疑義時，則適用下列順序填報於該類風險欄位中：(1) 信用、(2) 商品(3) 權益證券、(4) 匯率、(5) 利率。若不屬於上述各類請填報於其他有關契約欄位，但填報其他須於後以文字表達該檔商品之中文名稱。 5. 銀行辦理台股股權結構型商品業務請填報6: 銀行業承作台股股權相關

申報規則修正，例：連結標的為原油ETF者，應填4：商品相關。



格式說明(10/22)

欄 位		格 式	內 容	填 報 說 明
標的資產個數		9(2)		產品連結標的資產個數。
標的資產明細1	標的資產明細	X(20)		1. 填寫產品連結標的資產明細，及收益配發(不考慮收益給付之幣別是否轉換)條件區間。 2. 如該產品超過3個連結標的，請填報其中3個標的資產明細。 3. 匯率相關者請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」，其餘參照【表D】「標的資產明細代號表」說明填報。 4. 填寫範例： (1)標的資產明細：EUR/USD 收益配發條件區間：1.1 < EUR/USD < 1.5 (2)標的資產明細：GDX UP EQUITY 收益配發條件區間：GDX UP EQUITY ≥ 期初價格75%
	收益配發條件區間	X(80)		
標的資產明細2	標的資產明細	X(20)		5. 僅「無連結特定標的之固定收益產品」(利率類商品)可免填此欄位。 【檢核】 1. 僅「收益率計算方式」填報3，且「保本率」填報100者，可免填「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。 2. 「收益率計算方式」填報3，但「保本率」非填報100者，可免填「收益配發條件區間」(仍須填寫「標的資產明細」)。 3. 除上述條件外，其它類型產品皆需至少填報一組「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。
	收益配發條件區間	X(80)		
標的資產明細3	標的資產明細	X(20)		
	收益配發條件區間	X(80)		

格式說明(11/22)

範例 1

■ 「標的資產明細」填報範例：

連結標的	連結標的 1：USD CMS 30Y (30 年期美元固定期限交換利率) 連結標的 2：USD CMS 5Y (5 年期美元固定期限交換利率) CMS(Constant Maturity Swap)：固定期限交換利率
收益率(稅前)	第 1 年：年率 11% 【預計】 第 2~10 年：5.6 x (CMS 30Y - CMS 5Y)；最低為 0%，最高為 10%

標的資產明細1	標的資產明細	USD CMS 30Y
	收益配發條件區間	(CMS 30Y-CMS 5Y)>0
標的資產明細2	標的資產明細	USD CMS 5Y
	收益配發條件區間	(CMS 30Y-CMS 5Y)>0
標的資產明細3	標的資產明細	
	收益配發條件區間	

格式說明(12/22)

■ 「標的資產明細」填報範例：

範例 2

稅前收益：◦ 第 1 期至第 4 期：◦ 1.5000%◦
 第 5 期至第 40 期：◦ 前期稅前收益率-最大值(參與率 × 當期利差, 0)×1/4，稅前
 收益率最低為 0%◦
 當期利差：◦ 期初美元 3 個月期倫敦同業拆款利率-期末美元 3 個月期倫敦同業拆款利率◦

標的資產明細 1	標的資產明細	USD LIBOR 3M
	收益配發條件區間	(前期稅前收益率-MAX(參與率*(期初 USD LIBOR 3M - 期末 USD LIBOR 3M), 0)*1/4) > 0
標的資產明細 2	標的資產明細	
	收益配發條件區間	
標的資產明細 3	標的資產明細	
	收益配發條件區間	

格式說明(13/22)

■ 「標的資產明細」填報範例：

範例 3

第 1 年至第 5 年: $1.1700 \leq \text{美元兌新加坡幣匯率(USD/SGD)}$
且
第 1 年至第 5 年: $0.0000 \leq \text{美元兌南非幣匯率(USD/ZAR)} \leq 13.2000$
第 6 年至第 8 年: $1.200 \leq \text{美元兌新加坡幣匯率(USD/SGD)}$
且
第 6 年至第 8 年: $0.0000 \leq \text{美元兌南非幣匯率(USD/ZAR)} \leq 13.0000$

不需考慮配發條件為聯集
或交集(填報方式一樣)。

標的資產明細 1	標的資產明細	USD/SGD
	收益配發條件區間	$1.17 \leq \text{USD/SGD}$ (第 1 年至第 5 年) $1.2 \leq \text{USD/SGD}$ (第 6 年至第 8 年)
標的資產明細 2	標的資產明細	USD/ZAR
	收益配發條件區間	$0 \leq \text{USD/ZAR} \leq 13.2$ (第 1 年至第 5 年) $0 \leq \text{USD/ZAR} \leq 13$ (第 6 年至第 8 年)
標的資產明細 3	標的資產明細	
	收益配發條件區間	



格式說明(14/22)

■ 「標的資產明細」填報範例：

範例 4

連結標的	名稱(彭博代碼)	交易所	期初價格	配息門檻及執行價格 (期初價格的【75%】)
1	西德州原油近月期貨基金 (USO) (USO UP Equity)	NYSE	【待定】	【待定】
2	iShares MSCI 巴西股票指數 基金(EWZ) (EWZ UP Equity)	NYSE	【待定】	【待定】
3	VanEck Vectors 黃金礦業 ETF(GDX) (GDX UP Equity)	NYSE	【待定】	【待定】

標的資產明細1	標的資產明細	USO UP Equity
	收益配發條件區間	USO UP Equity \geq 期初價格*75%
標的資產明細2	標的資產明細	EWZ UP Equity
	收益配發條件區間	EWZ UP Equity \geq 期初價格*75%
標的資產明細3	標的資產明細	GDX UP Equity
	收益配發條件區間	GDX UP Equity \geq 期初價格*75%



格式說明(15/22)

欄位	格式	內容	填報說明
客戶別及 客戶數	1：國內金融機構	9(6)	<p>本欄為必要欄位。</p> <p>1. 請填該檔商品各類客戶別之客戶數。</p> <p>2. 「國內」或「國外」係以交易對象所在地為區分標準，因此「國內」包含外國金融機構在台分支機構、外國人在台設立之分公司及取得中華民國政府給予居留權之外國投資人。</p> <p>3. 交易對手為國內金融機構OBU請填報「國內金融機構」</p> <p>4. 交易對手為OBU客戶請填報「國外法人、個人」。</p> <p>5. 交易對手為信託業請填報「國內其他法人」。</p> <p>6. 客戶別為「國內其他法人」、「國內個人」、及「國外法人、個人」者請再區分專業客戶及非專業客戶。</p> <p>【檢核】「投資人限制」欄位填報1或2者，應填報本欄1或2或3或5或7或8之客戶數。</p>
	2：國內政府機構(含政府基金)	9(6)	
	3：國內其他法人(專業客戶)	9(6)	
	4：國內其他法人(非專業客戶)	9(6)	
	5：國內個人(專業客戶)	9(6)	
	6：國內個人(非專業客戶)	9(6)	
	7：國外金融機構	9(6)	
	8：國外法人、個人(專業客戶)	9(6)	
	9：國外法人、個人(非專業客戶)	9(6)	

申報格式修正，由9(7)改成9(6)！



格式說明(16/22)

欄位	格式	內容	填報說明
提前出場條件	X(1)	1：累積收益出場 2：達特定價格出場 3：發行機構有權在特定日期後提前終止契約 4：累積收益出場+達特定價格出場 5：累積收益出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 6：達特定價格出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 7：其他條件出場 8：無提前出場條件	1. 依產品提前出場條件選填。 2. 本欄提前出場條件係指「發行機構」或「契約設計」是否訂有提前出場/終止條件，不含「客戶可主動提前終止契約之條件」。

格式說明(17/22)

■ 「提前出場條件」填報範例：

範例 1

本商品配發收益累計達投資本金之 30%時，本商品即於當期收益配發日自動提前到期，且當期收益仍依收益公式配發收益。

應填報 1：累積收益出場。

範例 2

自動提前到期價格：連結標的之期初價格的【100%】

應填報 2：達特定價格出場。



格式說明(18/22)

■ 「提前出場條件」填報範例：

範例 3

提前到期條款：

◎本產品於下列情形將提前終止交易：

1. XX銀行自民國00年00月00日起(含當日)，有權利(但非義務)於本產品之任一收益配發日(不含到期日)提前終止本交易。
2. 本產品自生效日起，於任一期收益配發日所配發之收益加上先前各期所配發收益累計達投資本金25%時，則本產品於該期收益配發日自動提前到期…。

應填報 5：累積收益出場 + 發行機構有權在特定日期後提前終止契約。



格式說明(19/22)

欄位	格式	內容	填報說明
履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細1」之履約價/轉換價，如「標的資產明細1」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。
	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細2」之履約價/轉換價，如「標的資產明細2」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。
	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細3」之履約價/轉換價，如「標的資產明細3」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。

申報規則修正，「非」僅有連結標的為國內上市櫃股票或ETF者必填。

若【履約價/轉換價】有重設的機制，期初無確定價格，可先免填，惟達重設條件時有新價格或有確定價格時需補報。

格式說明(20/22)

「履約價/轉換價」填報範例：

範例 1

連結標的	名稱(彭博代碼)	交易所	期初價格	配息門檻及執行價格 (期初價格的【75%】)
1	西德州原油近月期貨基金 (USO) (USO UP Equity)	NYSE	【待定】	【待定】
2	iShares MSCI 巴西股票指數 基金(EWZ) (EWZ UP Equity)	NYSE	【待定】	【待定】
3	VanEck Vectors 黃金礦業 ETF(GDX) (GDX UP Equity)	NYSE	【待定】	【待定】

標的資產明細1	標的資產明細	USO UP Equity	履約價/轉換價	標的資產明細1 履約價/轉換價	期初價格*75%
	收益配發條件區間	USO UP Equity ≥ 期初價格*75%		標的資產明細2 履約價/轉換價	期初價格*75%
標的資產明細2	標的資產明細	EWZ UP Equity	履約價/轉換價	標的資產明細3 履約價/轉換價	期初價格*75%
	收益配發條件區間	EWZ UP Equity ≥ 期初價格*75%			
標的資產明細3	標的資產明細	GDX UP Equity	履約價/轉換價		
	收益配發條件區間	GDX UP Equity ≥ 期初價格*75%			

↑ 對應關係

格式說明(21/22)

「履約價/轉換價」填報範例：

範例 2

連結標的：
 1. 歐元兌美元匯率(EURUSD，即指標 A)
 2. 美元兌南非幣匯率(USDZAR，即指標 B)

到期金額支付說明：(1)若符合提前到期條款而提前到期，投資人將收回全部原始本金及產品收益。

(2)若未符合提前到期條款，且投資人持有至到期日，於轉換比價日時若指標 B ≤ 13.00 ，投資人將收回全部原始本金及產品收益。

(3)若未符合提前到期條款，且投資人持有至到期日，於轉換比價日時若指標 B > 13.00 ，投資本金將轉換為南非幣，到期將支付美元產品收益及南非幣本金，支付到期金額(稅前)如下：

到期金額(稅前) = 產品收益(美元) + 投資本金金額 $\times 13$ (南非幣)

標的資產明細1	標的資產明細	EUR/USD	履約價/轉換價	標的資產明細1 履約價/轉換價	13
	收益配發條件區間	$1.10 \leq \text{EUR/USD} \leq 1.52$		標的資產明細2 履約價/轉換價	
標的資產明細2	標的資產明細	USD/ZAR	標的資產明細3 履約價/轉換價		
	收益配發條件區間	$0.00 \leq \text{USD/ZAR} \leq 13.50$			
標的資產明細3	標的資產明細				
	收益配發條件區間				

對應關係

格式說明(22/22)

註：本頁欄位未修正。

欄 位	格 式	內 容	填 報 說 明
預計履約數量	9(10)		連結標的為單一國內上市櫃股票或ETF者，本欄為必要欄位。
標的型態為其他的說明	X(50)		「標的風險類別」填報「Z：其他」者，請填報該檔商品之商品中文名稱。 【檢核】標的風險類別為其他者，本欄須說明商品中文名稱
資料結尾識別碼	X(2)		0d0a

格式D txt資料內容：固定長度，562位元組。(原為320位元組)



商品案例(1/17)

1. 單純到期一次配發收益 100%保本型商品

收益計算期間	本商品收益計算期間之起日為民國 106 年 6 月 6 日(含)，迄日為民國 108 年 6 月 6 日(不含)；收益計算期間不依營業日規範調整。
到期本金保本率	於未發生提前終止之情形，且到期時本行未發生違約情事，到期結算返還稅前金額為 100%原計價幣別本金。
收益配發日	本商品於預計到期日(預計為民國 108 年 6 月 6 日)配發一次收益，期間無任何收益配發，收益配發日依營業日規範調整之。
稅前參考收益率	本商品於到期時，配發一次總收益，總稅前收益率如下： 總稅前收益率 = 12%
本行提前買回	無



商品案例(2/17)

1. 單純到期一次配發收益 100%保本型商品

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
保本率		9(3)	單位：%	指產品未發生中途解約情形，且到期發行機構未發生違約情事，產品到期結算之稅前返還原計價幣別本金比率。 1. 如商品為100%保本，請填100。 2. 如商品非屬100%保本，但商品仍提供部分保本，請填部分保本比率，如：70。 3. 如商品不保證返還投資本金，請填0。 4. 如商品係屬階梯式保本，請填最低保本率。	100
年化收益率		9(2)V9(2)	單位：%	1. 整段投資期間如為配發固定收益者，請填固定配發(保證)年化收益率。 2. 如非屬配發固定收益者，則排除保證收益條件後，填報產品符合一定條件下之「最高」稅前年化收益率(如無法填寫最高收益率，免填此欄位)。 【檢核】僅「年化收益率是否有上限」欄位填報1者，本欄可免填。	6
年化收益率是否有上限		X(1)	1. 年化收益率無上限(依公式計算) 2. 年化收益率有上限	依年化收益率是否設有上限填報。	2
保證收益率	保證年期(年)	9(2)V9(2)	單位：年	產品保證固定給付之年期及年化報酬率。	2
	保證年化收益率(%)	9(2)V9(2)	單位：%	1. 不考慮產品贖回情形，亦不考慮收益給付之幣別是否轉換 2. 保證年期(年)如係以天數換算年期，請依計價貨幣國際價例計息基礎換算(例：投資天數/360，或投資天數/365)。 3. 如產品無保證收益，保證年期及保證年化收益率請皆填0。	6
收益率計算方式		X(1)	1：依落入天期計 2：依特定日比價 3：配發固定收益 4：其他	1. 依產品收益率計算方式選填。 2. 如投資期間前段配發固定(保證)收益，後段配發浮動收益依浮動收益計算方式選填。 3. 單純到期一次配發固定收益或定期配發固定收益者，請填3。	3



商品案例(3/17)

1. 單純到期一次配發收益 100%保本型商品

欄 位		格 式	內 容	填 報 說 明	填寫範例
標的資產個數		9(2)		產品連結標的資產個數。	0
標的資產明細1	標的資產明細	X(20)		1. 填寫產品連結標的資產明細，及收益配發(不考慮收益給付之幣別是否轉換)條件區間。 2. 如該產品超過3個連結標的，請填報其中3個標的資產明細。 3. 匯率相關者請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」，其餘參照【表D】「標的資產明細代號表」說明填報。 4. 填寫範例： (1)標的資產明細：EUR/USD 收益配發條件區間：1.1 < EUR/USD < 1.5 (2)標的資產明細：GDX UP EQUITY 收益配發條件區間：GDX UP EQUITY ≥ 期初價格	
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細2	標的資產明細	X(20)		75% 5. 僅「無連結特定標的之固定收益產品」(利率類商品)可免填此欄位。 【檢核】 1. 僅「收益率計算方式」填報3，且「保本率」填報100者可免填「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。 2. 「收益率計算方式」填報3，但「保本率」非填報100者可免填「收益配發條件區間」(仍須填寫「標的資產明細」)。 3. 除上述條件外，其它類型產品皆需至少填報一組「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。	
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細3	標的資產明細	X(20)		75% 5. 僅「無連結特定標的之固定收益產品」(利率類商品)可免填此欄位。 【檢核】 1. 僅「收益率計算方式」填報3，且「保本率」填報100者可免填「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。 2. 「收益率計算方式」填報3，但「保本率」非填報100者可免填「收益配發條件區間」(仍須填寫「標的資產明細」)。 3. 除上述條件外，其它類型產品皆需至少填報一組「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。	
	收益配發條件區間	X(80)			

商品案例(4/17)

1. 單純到期一次配發收益 100%保本型商品

欄 位		格 式	內 容	填 報 說 明	填寫範例
提前出場條件		X(1)	1：累積收益出場 2：達特定價格出場 3：發行機構有權在特定日期後提前終止契約 4：累積收益出場+達特定價格出場 5：累積收益出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 6：達特定價格出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 7：其他條件出場 8：無提前出場條件	1. 依產品提前出場條件選填。 2. 本欄提前出場條件係指「發行機構」或「契約設計」是否訂有提前出場/終止條件，不含「客戶」可主動提前終止契約之條件。	8
履約價/轉換價	標的資產明細1 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細1」之履約價/轉換價，如「標的資產明細1」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	
	標的資產明細2 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細2」之履約價/轉換價，如「標的資產明細2」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	
	標的資產明細3 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細3」之履約價/轉換價，如「標的資產明細3」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	



商品案例(5/17)

2. 雙元貨幣組合式商品(DCI)

指標匯率：	NZD 兌 USD (參考現匯價：0.7198)
履約匯率值：	0.71
投資期間：	8 天
投資本金：	USD 1,000,000.00
商品稅前年化收益率：	3.3 %
決價匯率：	決價日台北時間下午兩點，於國際市場之連結標的之即期匯價
到期本金情形：	須比價時，若決價日台北時間下午兩點之決價匯率 (1) 大於履約匯率值，則投資人領回投資本金 USD 1,000,000.00 於到期日轉入投資人外匯活期性帳戶 (2) 小於或等於履約匯率值，則投資人本金以履約匯率值轉換為紐幣，到期領回本金 NZD 1,408,450.70 於到期日轉入投資人外匯活期性帳戶

商品案例(6/17)

2. 雙元貨幣組合式商品(DCI)

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
保本率		9(3)	單位：%	指產品未發生中途解約情形，且到期發行機構未發生違約情事，產品到期結算之稅前返還原計價幣別本金比率。 1. 如商品為100%保本，請填100。 2. 如商品非屬100%保本，但商品仍提供部分保本，請填部分保本比率，如：70。 3. 如商品不保證返還投資本金，請填0。 4. 如商品係屬階梯式保本，請填最低保本率。	0
年化收益率		9(2)V9(2)	單位：%	1. 整段投資期間如為配發固定收益者，請填固定配發(保證)年化收益率。 2. 如非屬配發固定收益者，則排除保證收益條件後，填報產品符合一定條件下之「最高」稅前年化收益率(如無法填寫最高收益率，免填此欄位)。 【檢核】僅「年化收益率是否有上限」欄位填報1者，本欄可免填。	3.3
年化收益率是否有上限		X(1)	1. 年化收益率無上限(依公式計算) 2. 年化收益率有上限	依年化收益率是否設有上限填報。	2
保證收益率	保證年期(年)	9(2)V9(2)	單位：年	產品保證固定給付之年期及年化報酬率。 1. 不考慮產品贖回情形，亦不考慮收益給付之幣別是否轉換。 2. 保證年期(年)如係以天數換算年期，請依計價貨幣國際慣例計息基礎換算(例：投資天數/360，或投資天數/365)。	0.02
	保證年化收益率(%)	9(2)V9(2)	單位：%	3. 如產品無保證收益，保證年期及保證年化收益率請皆填0。	3.3
收益率計算方式		X(1)	1：依落入天期計 2：依特定日比價 3：配發固定收益 4：其他	1. 依產品收益率計算方式選填。 2. 如投資期間前段配發固定(保證)收益，後段配發浮動收益，依浮動收益計算方式選填。 3. 單純到期一次配發固定收益或定期配發固定收益者，請填3。	3

商品案例(7/17)

2. 雙元貨幣組合式商品(DCI)

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
標的資產個數		9(2)		產品連結標的資產個數。	1
標的資產明細1	標的資產明細	X(20)		1. 填寫產品連結標的資產明細，及收益配發(不考慮收益給付之幣別是否轉換)條件區間。 2. 如該產品超過3個連結標的，請填報其中3個標的資產明細。 3. 匯率相關者請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」，其餘參照【表D】「標的資產明細代號表」說明填報。 4. 填寫範例： (1)標的資產明細：EUR/USD 收益配發條件區間：1.1 < EUR/USD < 1.5 (2)標的資產明細：GDX UP EQUITY 收益配發條件區間：GDX UP EQUITY ≥ 期初價格75% 5. 僅「無連結特定標的之固定收益產品」(利率類商品)可免填此欄位【檢核】 1. 僅「收益率計算方式」填報3，且「保本率」填報100者，可免填「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。 2. 「收益率計算方式」填報3，但「保本率」非填報100者，可免填「收益配發條件區間」(仍須填寫「標的資產明細」)。 3. 除上述條件外，其它類型產品皆需至少填報一組「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。	NZD/USD
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細2	標的資產明細	X(20)			
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細3	標的資產明細	X(20)			
	收益配發條件區間	X(80)			

商品案例(8/17)

2. 雙元貨幣組合式商品(DCI)

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
提前出場條件		X(1)	1：累積收益出場 2：達特定價格出場 3：發行機構有權在特定日期後提前終止契約 4：累積收益出場+達特定價格出場 5：累積收益出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 6：達特定價格出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 7：其他條件出場 8：無提前出場條件	1. 依產品提前出場條件選填。 2. 本欄提前出場條件係指「發行機構」或「契約設計」是否訂有提前出場/終止條件不含「客戶」可主動提前終止契約之條件。	8
履約價/轉換價	標的資產明細1 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細1」之履約價/轉換價，如「標的資產明細1」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	0.71
	標的資產明細2 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細2」之履約價/轉換價，如「標的資產明細2」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	
	標的資產明細3 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細3」之履約價/轉換價，如「標的資產明細3」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	



商品案例(9/17)

3. 信用連結商品(CLN)

信用連結標的 (Reference Obligation)	28884。 (每張面額新台幣十萬元整。櫃買中心代號: 新金三)。
票面利率 (Interest)	1%。
票面利息支付日 (Payment Dates)	自 2017/10/13(含)起, 至 2019/08/27 止。每年 02/27、05/27、08/27、11/27。並適用於”修正式次一營業日慣例(Modified Following Business Day Convention)”之調整。若本交易因賣方提前解約或信用連結標的發行公司「信用事件」而提前終止契約, 則賣方不再支付應計利息。
計息基礎 (Day Count)	N/365。 首期計息期間N為自交易生效日(含)起至首次利息支付日(不含)止之實際日數; 後續之每一計息期間, N為則自前期之支付日起(含), 至該票面利息支付日(不含)之實際日數。
到期結算收益 (Final Payment)	若在契約期間無信用事件或賣方提前買回之情事發生, 則賣方將於到期日將本商品剩餘名目本金×100%, 加計應付利息金額。
最大可能損失 (Max Loss)	名目本金×(交易價格+交易手續費)。
提前買回條款 (Early Call)	適用。自交易生效日(含)起至交易到期日之任何營業日內, 賣方需於買回執行日當日台北時間下午二點整前, 以電話或書面通知買方提前一部份或全部買回, 並於提前買回執行日後第一個營業日進行交割。但經扣除提前買回名目本金後之剩餘名目本金餘額為零時, 則本契約於該次執行雙方完成交割後終止。若於買回執行日當日台北時間下午二點整後通知, 則此通知之有效性將被視為下一個營業日發出。

商品案例(10/17)

3. 信用連結商品(CLN)

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
保本率		9(3)	單位：%	指產品未發生中途解約情形，且到期發行機構未發生違約情事，產品到期結算之稅前返還原計價幣別本金比率。 1. 如商品為100%保本，請填100。 2. 如商品非屬100%保本，但商品仍提供部分保本，請填部分保本比率，如：70。 3. 如商品不保證返還投資本金，請填0。 4. 如商品係屬階梯式保本，請填最低保本率。	0
年化收益率		9(2)V9(2)	單位：%	1. 整段投資期間如為配發固定收益者，請填固定配發(保證)年化收益率。 2. 如非屬配發固定收益者，則排除保證收益條件後，填報產品符合一定條件下之「最高」稅前年化收益率(如無法填寫最高收益率，免填此欄位)。 【檢核】僅「年化收益率是否有上限」欄位填報1者，本欄可免填。	1
年化收益率是否有上限		X(1)	1. 年化收益率無上限(依公式計算) 2. 年化收益率有上限	依年化收益率是否有上限填報。	2
保證收益率	保證年期(年)	9(2)V9(2)	單位：年	產品保證固定給付之年期及年化報酬率。 1. 不考慮產品贖回情形，亦不考慮收益給付之幣別是否轉換。 2. 保證年期(年)如係以天數換算年期，請依計價貨幣國際慣例計息基礎換算(例：投資天數/360，或投資天數/365) 3. 如產品無保證收益，保證年期及保證年化收益率請皆填0。	(請將投資期間年化)
	保證年化收益率(%)	9(2)V9(2)	單位：%		1
收益率計算方式		X(1)	1：依落入天期計 2：依特定日比價 3：配發固定收益 4：其他	1. 依產品收益率計算方式選填。 2. 如投資期間前段配發固定(保證)收益，後段配發浮動收益，依浮動收益計算方式選填。 3. 單純到期一次配發固定收益或定期配發固定收益者，請填3。	3

商品案例(11/17)

3. 信用連結商品(CLN)

欄 位		格 式	內 容	填 報 說 明	填 寫 範 例
標的資產個數		9(2)		產品連結標的資產個數。	1
標的資產明細1	標的資產明細	X(20)		1. 填寫產品連結標的資產明細，及收益配發(不考慮收益給付之幣別是否轉換)條件區間。 2. 如該產品超過3個連結標的，請填報其中3個標的資產明細。 3. 匯率相關者請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」，其餘參照【表D】「標的資產明細代號表」說明填報。 4. 填寫範例：	28884
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細2	標的資產明細	X(20)		(1)標的資產明細：EUR/USD 收益配發條件區間： $1.1 < \text{EUR/USD} < 1.5$ (2)標的資產明細：GDX UP EQUITY 收益配發條件區間： $\text{GDX UP EQUITY} \geq \text{期初價格}75\%$	
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細3	標的資產明細	X(20)		【檢核】 1. 僅「收益率計算方式」填報3，且「保本率」填報100者，可免填「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。 2. 「收益率計算方式」填報3，但「保本率」非填報100者，可免填「收益配發條件區間」(仍須填寫「標的資產明細」)。 3. 除上述條件外，其它類型產品皆需至少填報一組「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。	
	收益配發條件區間	X(80)			

商品案例(12/17)

3. 信用連結商品(CLN)

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
提前出場條件		X(1)	1：累積收益出場 2：達特定價格出場 3：發行機構有權在特定日期後提前終止契約 4：累積收益出場+達特定價格出場 5：累積收益出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 6：達特定價格出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 7：其他條件出場 8：無提前出場條件	1. 依產品提前出場條件選填。 2. 本欄提前出場條件係指「發行機構」或「契約設計」是否訂有提前出場/終止條件，不含「客戶」可主動提前終止契約之條件。	7
履約價/轉換價	標的資產明細1 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細1」之履約價/轉換價，如「標的資產明細1」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	
	標的資產明細2 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細2」之履約價/轉換價，如「標的資產明細2」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	
	標的資產明細3 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細3」之履約價/轉換價，如「標的資產明細3」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	

商品案例(13/17)

4. 連結基金不保本商品

保本率(G)：0%

連結標的 1：A 基金月配息型

連結標的 2：A 基金月配息型

連結標的 3：A 基金月配息型

期初價格 S0(1)：A 基金月配息型於[申購日連結標的公告淨值]

期初價格 S0(2)：A 基金月配息型於[申購日連結標的公告淨值]

期初價格 S0(3)：A 基金月配息型於[申購日連結標的公告淨值]

履約價格 K(1)：期初價格 S0(1)×70%

履約價格 K(2)：期初價格 S0(2)×70%

履約價格 K(3)：期初價格 S0(3)×70%

結算價格 ST(1)：如無發生提前到期事件者，B 基金累積型於[到期日連結標的公告淨值]

結算價格 ST(2)：如無發生提前到期事件者，B 基金月配息型於[到期日連結標的公告淨值]

結算價格 ST(3)：如無發生提前到期事件者，B 基金月配息型於[到期日連結標的公告淨值]

下限價格(B)：25%



商品案例(14/17)

4. 連結基金不保本商品

投資收益本息之給付及其計算方式：

1. 若本商品契約存續期間任一日契約價格小於下限價格(B)，則契約提前到期。
2. 若本商品契約存續期間每日契約價格皆大於或等於下限價格(B)，則以到期日當日之連結標的公告淨值為結算價格，交易人可於到期交割日領回：
契約本金 \times Max[(結算價格ST(1)-履約價格K(1))/期初價格S0(1)+(結算價格ST(2)-履約價格K(2))/
期初價格S0(2)+(結算價格ST(3)-履約價格K(3))/期初價格S0(3),0]
3. 若本商品契約存續期間遇連結標的配息，交易人可於各連結標的之配息交割日領回各連結標的之
配息金額。

商品案例(15/17)

4. 連結基金不保本商品

欄位	格式	內容	填報說明	填寫範例
保本率	9(3)	單位：%	指產品未發生中途解約情形，且到期發行機構未發生違約情事 產品到期結算之稅前返還原計價幣別本金比率。 1. 如商品為100%保本，請填100。 2. 如商品非屬100%保本，但商品仍提供部分保本，請填部分保本比率，如：70。 3. 如商品不保證返還投資本金，請填0。 4. 如商品係屬階梯式保本，請填最低保本率。	0
年化收益率	9(2)V9(2)	單位：%	1. 整段投資期間如為配發固定收益者，請填固定配發(保證)年化收益率。 2. 如非屬配發固定收益者，則排除保證收益條件後，填報產品符合一定條件下之「最高」稅前年化收益率(如無法填寫最高收益率，免填此欄位)。 【檢核】僅「年化收益率是否有上限」欄位填報1者，本欄可免填。	
年化收益率是否有上限	X(1)	1. 年化收益率無上限(依公式計算) 2. 年化收益率有上限	依年化收益率是否設有上限填報。	1
保證收益率	保證年期(年)	9(2)V9(2) 單位：年	產品保證固定給付之年期及年化報酬率。 1. 不考慮產品贖回情形，亦不考慮收益給付之幣別是否轉換。 2. 保證年期(年)如係以天數換算年期，請依計價貨幣國際慣例計息基礎換算(例：投資天數/360，或投資天數/365)。 3. 如產品無保證收益，保證年期及保證年化收益率請皆填0。	0
	保證年化收益率(%)	9(2)V9(2) 單位：%		0
收益率計算方式	X(1)	1：依落入天期計 2：依特定日比價 3：配發固定收益 4：其他	1. 依產品收益率計算方式選填。 2. 如投資期間前段配發固定(保證)收益，後段配發浮動收益，依浮動收益計算方式選填。 3. 單純到期一次配發固定收益或定期配發固定收益者，請填3。	4

商品案例(16/17)

4. 連結基金不保本商品

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
標的資產個數		9(2)		產品連結標的資產個數。	1
標的資產明細1	標的資產明細	X(20)		1. 填寫產品連結標的資產明細，及收益配發(不考慮收益給付之幣別是否轉換)條件區間。 2. 如該產品超過3個連結標的，請填報其中3個標的資產明細。 3. 匯率相關者請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」，其餘參照【表D】「標的資產明細代號表」說明填報。 4. 填寫範例： (1)標的資產明細：EUR/USD 收益配發條件區間：1.1 < EUR/USD < 1.5 (2)標的資產明細：GDX UP EQUITY 收益配發條件區間：GDX UP EQUITY ≥ 期初價格75% 5. 僅「無連結特定標的之固定收益產品」(利率類商品)可免填此欄位。 【檢核】 1. 僅「收益率計算方式」填報3，且「保本率」填報100者，可免填「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。 2. 「收益率計算方式」填報3，但「保本率」非填報100者，可免填「收益配發條件區間」(仍須填寫「標的資產明細」)。 3. 除上述條件外，其它類型產品皆需至少填報一組「標的資產明細」及「收益配發條件區間」。	(請填基金代號)
	收益配發條件區間	X(80)			依連結標的配息金額配發
標的資產明細2	標的資產明細	X(20)			
	收益配發條件區間	X(80)			
標的資產明細3	標的資產明細	X(20)			
	收益配發條件區間	X(80)			

商品案例(17/17)

4. 連結基金不保本商品

欄位		格式	內容	填報說明	填寫範例
提前出場條件		X(1)	1：累積收益出場 2：達特定價格出場 3：發行機構有權在特定日期後提前終止契約 4：累積收益出場+達特定價格出場 5：累積收益出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 6：達特定價格出場+發行機構有權在特定日期後提前終止契約 7：其他條件出場 8：無提前出場條件	1. 依產品提前出場條件選填。 2. 本欄提前出場條件係指「發行機構」或「契約設計」是否訂有提前出場/終止條件不含「客戶」可主動提前終止契約之條件。	2
履約價/轉換價	標的資產明細1 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細1」之履約價/轉換價，如「標的資產明細1」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	(請填連結標的期初價格*70%之數值)
	標的資產明細2 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細2」之履約價/轉換價，如「標的資產明細2」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	
	標的資產明細3 履約價/轉換價	9(8)V9(4)		填報「標的資產明細3」之履約價/轉換價，如「標的資產明細3」無相關轉換條件及履約執行條件，可免填此欄位。	



未到期交易資料補正方式(1/6)

- 上線日前已申報且交易到期日為上線日起1年內者(108年9月3日前到期)，應於上線日起**3個月內**(107年12月3日前)完成資訊補正作業。
- 其他上線日前已申報但未到期之交易，應於上線日起**6個月內**(108年3月4日前)完成資訊補正作業。
- 補正方式：可於TR系統上「**單筆修正**」或製作檔案後(可多筆)「**匯入修正**」。

未到期交易資料補正方式(2/6)

■ 「結構型商品申報畫面」單筆修正：

(一)申報(修改)人員：

- 1.查詢(非當日資料)
- 2.修改欄位資料
- 3.申報

「標的資產明細1~3」及「履約價/轉換價1~3」欄位資料請重新填報！

衍生性商品資訊儲存庫申報軟體 - [結構型商品申報畫面-格式D-SP]

檔案 儲存庫申報(TR) 資訊申報(DPSP) 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護 公告訊息 網際網路版本[0.05Alpha]

查詢 新增 修改 刪除 匯入檔案 匯出檔案 清畫面 申報

交易日期 20180226 名目本金幣別 客戶數

產品代號 名目本金金額 0.00 國內金融機構 0

商品型態 商品種類 國內政府機構 0

發行機構代號 標的風險類別 國內其他法人 0

保證機構代號 標的資產明細 國內個人 0

商品成立日期 20180226 國外金融機構 0

商品到期日期 20180226 國外法人、個人 0

履約價格 0000.0000

預計履約數量 0

標的型態為其他的說明

申報狀態	狀態說明	狀態代碼	交易日	申報機構	產品代號	商品型態	發行機構代號	保證機構代號	生效日	到期日	名目本金



未到期交易資料補正方式(3/6)

■ 「結構型商品申報畫面」單筆修正：

(二)確認(覆核)人員：

1.查詢(歷史未確認資料) 2.勾選確認 3.申報

路徑：[儲存庫申報\(TR\)/免比對交易確認/結構型交易確認/結構型商品交易確認](#)

結構型商品確認畫面

查詢 匯入 匯出 全選已確認 申報 申報帳號 全部帳號 登入

期限內未確認資料(X)
期限內全部資料(Y)
歷史未確認資料(Z)

產品代號
交易日期

確認選項:

已確認	無法確認	申報狀態	狀態代碼	申報帳號	應確認日期	確認日期	交易日	產品代號

未到期交易資料補正方式(4/6)

■ 「結構型商品申報畫面」(多筆)匯入修正：

(一)申報(修改)人員：

1.匯入檔案(修改) 2.選取檔案 3.申報

- (1)將新增「匯入檔案(修改)」按鈕。
- (2)匯入檔案格式同新版SP申報格式。

衍生性商品資訊儲存庫申報軟體 - [結構型商品申報畫面]

檔案 儲存庫申報(TR) 資訊申報(DPSP) 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護 公告訊息 網際網路版本[0.05Alpha]

查詢 新增 修改 刪除 匯入檔案 匯出檔案 清畫面 申報

交易日期 20180226 名目本金幣別 [dropdown] 客戶數 履約價格 0000.0000
產品代號 [input] 名目本金金額 0.00 國內金融機構 0 預計履約數量 0
商品型態 [dropdown] 商品種類 [dropdown] 國內政府機構 0 標的型態為
發行機構代號 [dropdown] 標的風險類別 [dropdown] 國內其他法人 0 其他的說明
保證機構代號 [dropdown] 標的資產明細 [input] 國內個人 0
商品成立日期 20180226 國外金融機構 0
商品到期日期 20180226 國外法人、個人 0

申報狀態	狀態說明	狀態代碼	交易日	申報機構	產品代號	商品型態	發行機構代號	保證機構代號	生效日	到期日	名目本金



未到期交易資料補正方式(5/6)

■ 「結構型商品申報畫面」(多筆)匯入修正：

(二)確認(覆核)人員：

1.查詢(歷史未確認資料) 2.勾選確認 3.申報

路徑：[儲存庫申報\(TR\)/免比對交易確認/結構型交易確認/結構型商品交易確認](#)

結構型商品確認畫面

查詢 匯入 匯出 全選已確認 申報 申報帳號 全部帳號 登入

期限內未確認資料(X)
期限內全部資料(Y)
歷史未確認資料(Z)

產品代號
交易日期
確認選項:

已確認	無法確認	申報狀態	狀態代碼	申報帳號	應確認日期	確認日期	交易日	產品代號
-----	------	------	------	------	-------	------	-----	------



未到期交易資料補正方式(6/6)

■ 「結構型商品申報畫面」(多筆)匯入修正：

1. 請以**新版SP格式**匯入。

✓txt格式：固定長度，562位元組

✓csv格式：各欄位資料以逗號結尾區隔下一欄位

2. **所有欄位**資訊皆須(依規則)填報。

✓「匯入檔案(新增)」與「匯入檔案(修改)」差異僅為「產品代號」之檢核，故所有欄位(包含不須修正之欄位)資訊皆須填報。

3. 匯入申報後，新申報資料將**強制修改**原申報資料。

新舊格式內容長度對照

格式名稱	商品/檔名	原格式內容長度(位元組)	新格式內容長度(位元組)	差異(位元組)
格式A	FXD	168	188	20
	IRS	225	245	20
	TED	341	361	20
	FXO	180	200	20
	FXO2	258	278	20
	SWPT	467	487	20
	IRS2	495	515	20
	IRO	331	351	20
	CDS	637	657	20
	FED	542	562	20
	CMS	508	528	20
	CMO	245	265	20
格式B	MODOTR	162	182	20
格式D	SP	320	562	242

TR傳檔格式(107.09.03上線)已置於本中心首頁 > 衍生商品 > 衍生性商品交易資訊儲存庫專區 > 文件下載



TR申報常見問題



TR申報常見問題(衍生性商品)

Q1.依本中心107年1月16日證櫃債字第10704000262號函，格式A「交易對手身分別」新增4.高淨值投資法人，另有關「交易對手承作目的」填報方式是否有修正？

Ans：原則上並無修正，「交易對手承作目的」請依各業別衍生性商品法規、自律規範或是各金融機構內部規定填報，申報機構依規可不須區分交易對手承作目的者，可填報「Z：不適用」。

Q2.交易日後二營業日（T+2日）內到期結清契約之衍生性金融商品免申報，有關營業日之判斷方式為何？

Ans：營業日請依契約定義之營業日作判斷。



TR申報常見問題(衍生性商品)

Q3.保險業「交易動機」欄位如何填報?

Ans：保險業若從事符合依「保險業從事衍生性金融商品交易管理辦法」所規定之避險目的衍生性金融商品交易，請填報「4：其他會計避險或保險業避險目的之交易」，另如避險衍生性金融商品之連結標的或其商品組合與被避險項目價格變動率或報酬率相關係數為100%時，可填報「1:Back-to-Back避險」、「2:跨市避險-現貨市場」或「3:跨市避險-期貨市場」。

交易動機	X(1)	1：Back-to-Back 避險	1. 「其他會計避險」係指非屬1"、"2"和"3"，且以避險會計入帳者，「保險業避險」係指非屬1"、"2"和"3"，且保險公司依「保險業從事衍生性金融商品交易管理辦法」所從事之避險交易 2. 填報"4"和"Z"者該筆交易必須填報格式C。 3. 填報"1"、"2"和"3"者該筆交易僅須填報格式C之"契約市價"與"信用風險抵減"欄位
		2：跨市避險-現貨市場	
		3：跨市避險-期貨市場	
		4：其他會計避險或保險業避險目的之交易	
		Z：其他	



TR申報常見問題(結構型商品)

Q1. 「客戶別及客戶數」欄位資訊是否在第一次交易申報後仍須維護?

Ans：結構型商品若有提前到期、提前解約、同商品再次開放客戶申購之情形，除了以SPM檔申報相關資料異動之外，並應同時檢視客戶數資訊，如有異動，應於SP檔申報資料進行修改。

Q2. 依申報規定可免填之欄位(例：「履約價/轉換價」)，以檔案匯入時是否應補0或空白?

Ans：視匯入檔案格式為txt或csv而定。

txt 格式

1. 9(a)表數字格式，其中 a 為欄位長度，長度不足時，採右靠左補 0。
2. X(a)表文字格式，其中 a 為欄位長度，長度不足時，採左靠右補空白。

csv 格式

1. 9(a)表數字格式，其中 a 為欄位長度，長度不足時，毋須補 0。
2. X(a)表文字格式，其中 a 為欄位長度，長度不足時，毋須補空白。



簡報完畢
敬請指教
