

證券商承作衍生性商品餘額媒體資料格式

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

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

二、欄位輸入說明

欄 位	格 式	型 態	附 註	
日 期	年	9(3)	三位數字	民國年
	月	9(2)	二位數字	
	日	9(2)	二位數字	限申報當月最後一個營業日
申報券商代號	X(4)	四位文數字	總公司均以自營部代號表示 (EX. 980T: 元大證券)	
單號	X(5)	五位文數字	第一碼C，後四碼由0001 開始依序編號，每月傳輸由0001號開始重編	
信用評等	9(2)	二位數字	請參見信用評等代碼表(可免填)	
合格自有資本	9(8)	八位數字	以新台幣萬元為單位，請參見後合格自有資本說明	
風險約當金額	9(8)	八位數字	以新台幣萬元為單位，請參見後風險約當金額說明	
商品代碼	X(2)	二位文數字	請參見後商品代號	
契約剩餘年限	9(2)	二位數字	1→1年期 2→2年期 3→3年期 4→4年期 5→5年期 6→6年期 7→7年期 10→10年期 99→其他 契約剩餘年限低於1年者，請輸入1 契約剩餘年限低於2年高於1年者，請輸入2，以此類推 (EX. 契約剩餘年限為8.5年輸入10，契約剩餘年限大於10年者輸入99)	
債券代號	X(7)	七位文數字	前六碼以債券代號表示 (EX.A93101)，第七碼空白	
選擇權別	X(1)	一位文數字	1→ 買權 2→賣權 9→其他	
買賣別	X(1)	一位文數字	1→ 買入 2→賣出 3→收付股權報酬 9→其他 equity swap 「1」為「支付利息」、「2」為「收取利息」、「3」為「收取且支付股權報酬」、非屬前三類者為「9」。 信用商品「買入」為「信用保護買方」、「賣出」為「信用保護賣方」 bond swap 「1」為取得標的債券報酬；「2」支付標的債券報酬，若為兩債券標的的交換契約則分開兩筆資料輸入，非屬前二類者為「9」。	
流通在外餘額	9(8)	八位數字	以新台幣萬元為單位	
對應申報序號	9(5)	五位數字	一律補'0' (系統使用)	
異動別	X(1)	一位文數字	一律補'A' (系統使用)	

註：1.格式型態為9者，一律右靠左補0。

2.格式型態為X者，一律左靠右補空白。

信用評等代碼表：

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

註：*：包含中華信評及S&P國際評等

**：包含穆迪台灣評等及國際評等

***：包含惠譽台灣分公司評等及國際評等

合格自有資本說明：

請以**最近一期**自有資本適足申報資料中合格自有資本金額進行申報，每月申報上月自有資本適足率時請同步更新資料。請輸入大於零資料。

風險約當金額說明：

請以**最近一期**證券商營業處所經營衍生性金融商品額度控管檢查表，經風險管理主管覆核之市場風險約當金額”合計數”進行申報。請輸入大於零資料。

商品代碼：（2位數） X(2)

a1：遠期利率（FRA）

a2：利率交換（IRS）

a3：利率選擇權（IRO）

b1：債券遠期買賣斷（bond forward）

b2：債券選擇權（bond option）

b3：債券交換 (bond Swap)

c1：不保本型商品

c2：保本型商品

c3：信用違約連結商品 (CLN)

c4：股權選擇權 (equity option)

c5：股權交換 (equity swap)

c6：股權遠期 (equity forward)

d1：資產交換-固定收益端 (ASW)

d2：資產交換-選擇權端 (ASO)

d3：信用遠期 (credit forward)

d4：信用交換 (credit swap)

d5：信用選擇權 (credit option)

e1：商品遠期契約 (commodity forward)

e2：商品交換契約 (commodity swap)

e3：商品選擇權契約 (commodity option)

e4：其他遠期契約

e5：其他交換契約

e6：其他選擇權契約

契約流通在外餘額定義：

a1：遠期利率 (FRA) ---將同年期流通之長部位及短部位名目本金相加總

a2：利率交換 (IRS) ---將同年期流通之長部位及短部位名目本金相加總

a3：利率選擇權 (IRO) ---將同年期流通之長部位及短部位名目本金相加總

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

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

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

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

三、資料內容

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

四、檔案結構

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

五、傳輸時間

星期一至星期五 09:00 ~ 17:00

六、檔案名稱 → D43

七、傳輸方式

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