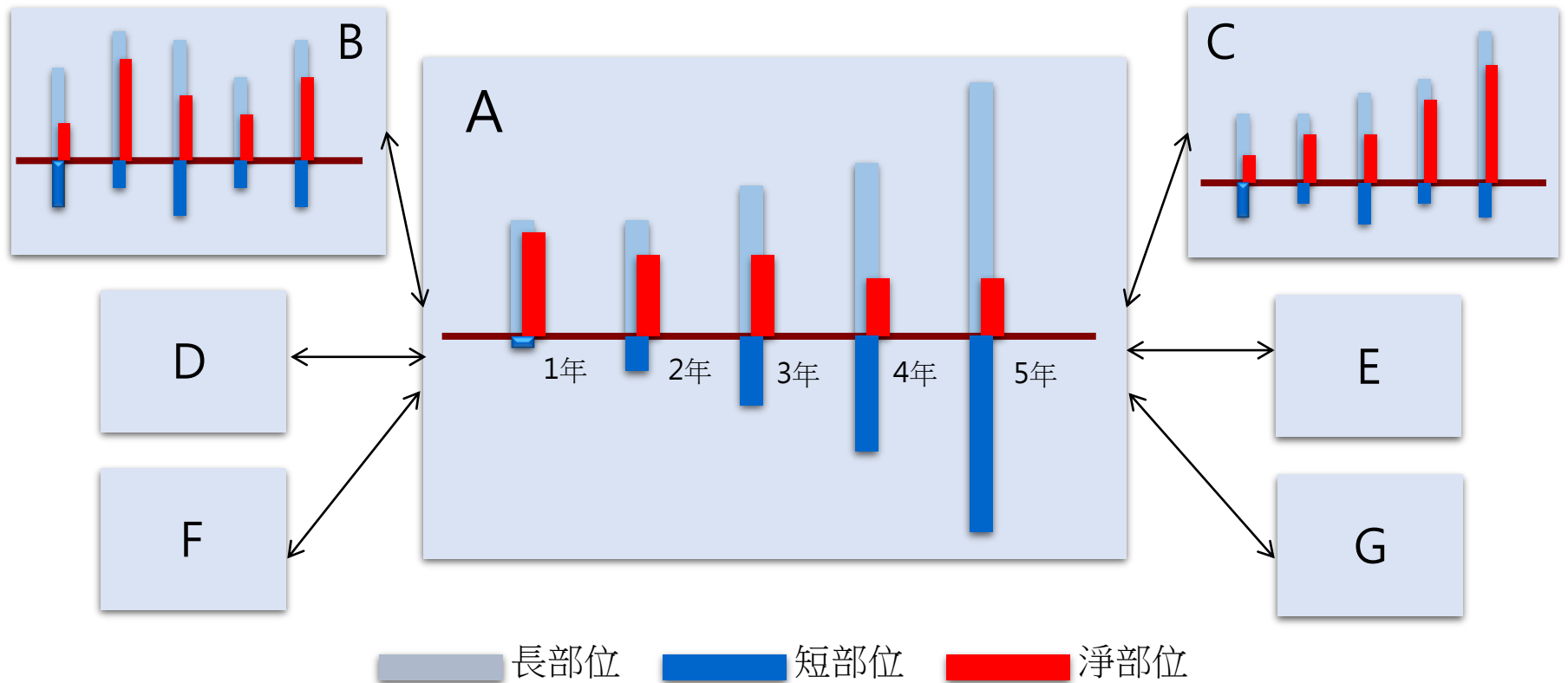


店頭衍生性金融商品 提前了結系統說明

簡報大綱

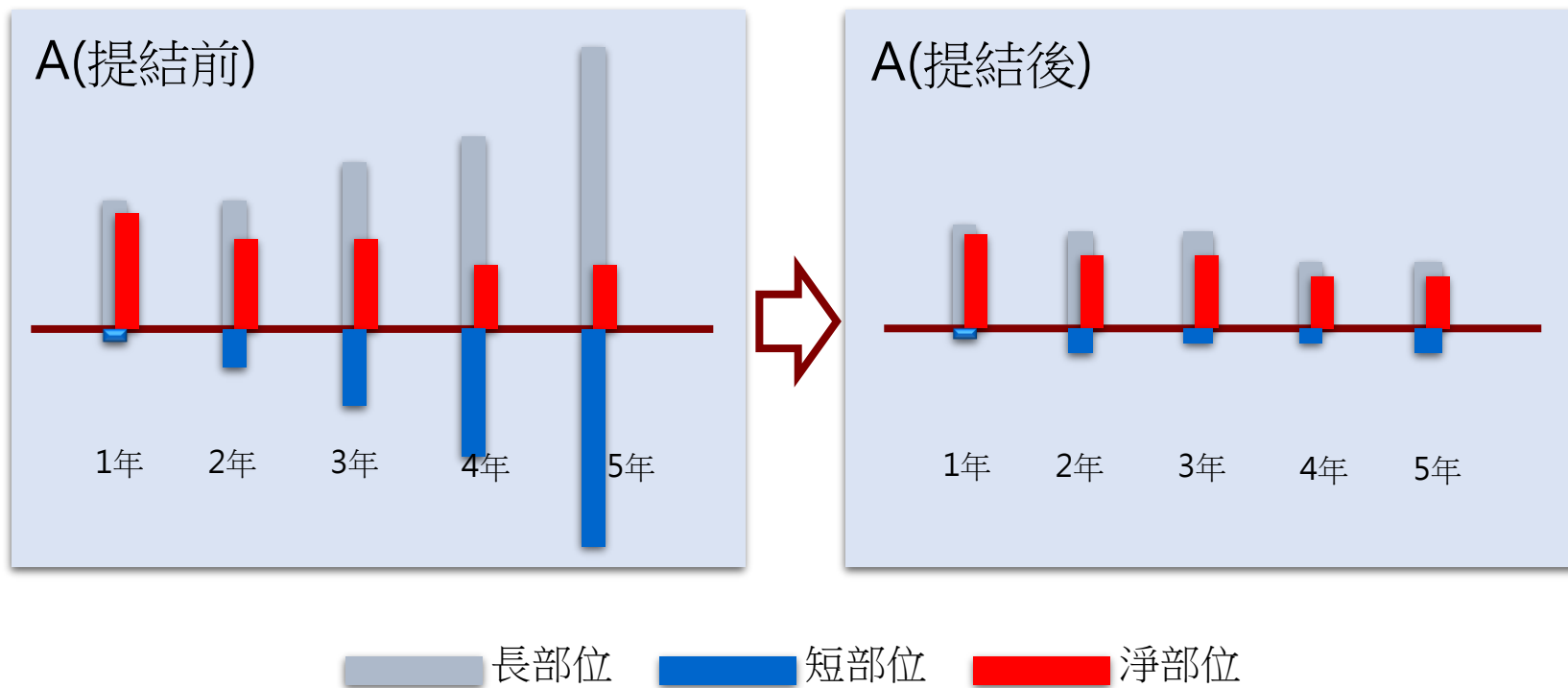
- 何謂提前了結作業？
- 參與本中心提前了結的優點
- 提前了結作業時程
- 提前了結作業步驟說明
 - 契約資料下載
 - 風險資訊上傳
 - 預演結果下載
 - 正式作業

何謂提前了結作業?



何謂提前了結作業?

提前了結前後，A金融機構IRS部位變化情形



參與本中心提前了結的優點

- 空出交易額度
- 降低後台作業手續及作業風險
- 降低信用(交易對手)風險暴露
- 降低擔保品提列需求
- 降低資本計提
- 費用低廉，目前費率為百萬分之一以下

提前了結業務服務費費率

➤ 金融機構使用本系統提前了結作業之業務服務費費率標準如下：

✓費率：成功解約總金額達

100億元(含)以下者，費率為百萬分之1；

逾100億元至300億元(含)者，費率為百萬分之0.7；

逾300億元至500億元(含)者，費率為百萬分之0.5；

逾500億元至1,000億元(含)者，費率為百萬分之0.3；

逾1,000億元者，費率為百萬分之0.1。

✓業務服務費=契約名日本金*剩餘年限*費率

✓舉例：名日本金3億元，剩餘年期1年之契約，若解約總金額未達

100億元，該筆業務服務費 = 300,000,000*1/1,000,000 = 300元

提前了結服務作業時程

112年 IRS 提前了結作業時間表

星期日	星期一	星期二	星期三	星期四	星期五	星期六
8月27日	8月28日	8月29日	8月30日	8月31日	9月1日	9月2日
	開放登記參與 112年 IRS 提前了結服務			開放下載「可供提前了結資料報表」		
					上傳預演資料 (基準日：9/1) (上傳時間：9/1 09:00 ~ 9/5 17:00)	

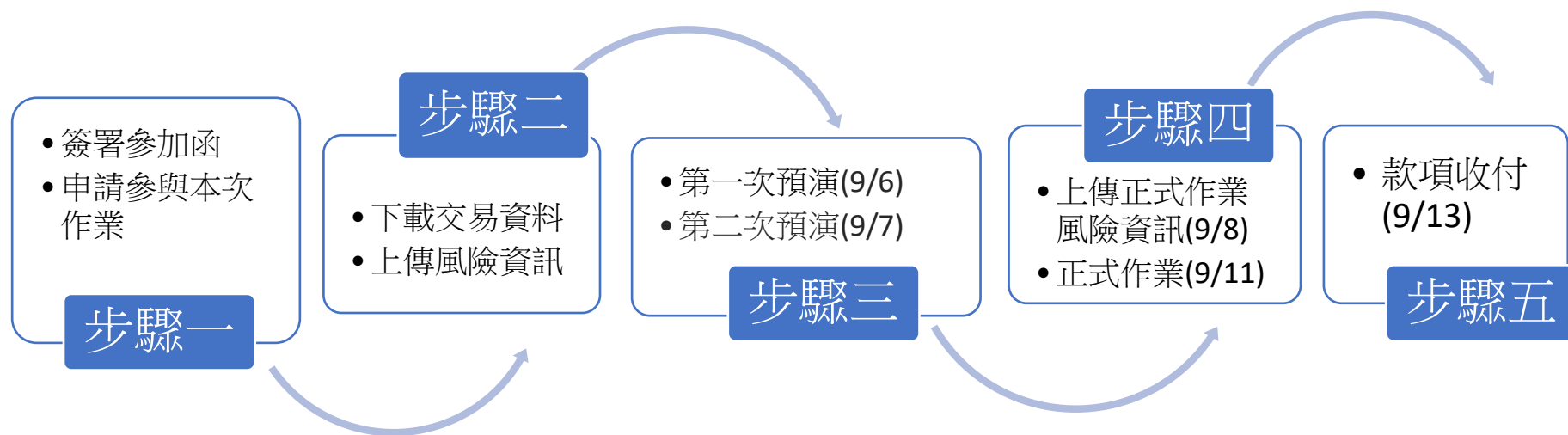
星期日	星期一	星期二	星期三	星期四	星期五	星期六
9月3日	9月4日	9月5日	9月6日	9月7日	9月8日	9月9日
	開放下載「可供提前了結資料報表」		提前了結預演(2次) (12:00~17:00 下載預演結果報表) (9/6 17:00 前更新預演資料) (註1)		上傳正式作業資料 (基準日：9/8) (上傳時間 09:00~22:00)	
	上傳預演資料 (基準日：9/1) (上傳時間：9/1 09:00 ~ 9/5 17:00)					

星期日	星期一	星期二	星期三	星期四	星期五	星期六
9月10日	9月11日	9月12日	9月13日	9月14日	9月15日	9月16日
	下載正式結果報表 (08:00~17:00)		收/付款日 (註2)			

註1：9月6日第一次預演結果公佈後，各參與機構可於當日17:00前自行調整第二次預演資料。

註2：已成功提前了結之交易，無須自行申報TR系統，本中心將於9月13日收付款完成後，統一辦理申報作業(生效日為9月11日)。

參加提前了結作業步驟



成功解約之交易本中心將統一辦理TR EVENT申報作業，無需自行申報EVENT

參加步驟說明

➤ 步驟一：簽署參加函及申請提結作業

1. 尚未簽署「**提前了結協定書參加函**」者，請連同「**提前了結系統款項結算帳戶申報書**」一併發文本中心。
 - 「提前了結協定書參加函」僅須簽署乙次。
 - 「提前了結系統款項結算帳戶申報書」除變更帳戶者外，亦僅需提供乙次。
2. 8月28日~8月30日：已簽署之金融機構，請於8月30日前，至TR系統提前了結功能項下，申請登記參加當次提前了結作業。

相關文件下載位置

- 業務宣導網站>證券商/金融機構/投信專區 > 店頭衍生性商品 > 提前了結系統文件下載

證券商/金融機構/投信專區 / 店頭衍生性商品 / 提前了結系統文件下載

提前了結系統文件下載

序號	文件名稱	檔案下載/連結
1	2021店頭衍生性金融商品提前了結系統說明(簡報檔)	下載
2	2021店頭衍生性金融商品提前了結系統說明(影音檔)	影音連結
3	衍生性金融商品交易提前了結系統媒體傳輸格式	下載
4	市場風險(MKTRISK)上傳範例檔案	下載
5	信用風險(CDTRISK)上傳範例檔案	下載
6	契約風險(CONTRACT)上傳範例檔案	下載
7	本中心衍生性金融商品交易提前了結協定書(中文版)	下載
8	提前了結系統款項結算帳戶申報書	下載

敬啟者：

主旨：財團法人中華民國櫃檯買賣中心於中華民國 102 年 3 月 14 日訂定之提前了結總協定書(下稱「本協定書」)參加

茲確認立書人參加本協定書並遵循提前了結準則。本函構成本協定書所述之參加函。

本協定書所載之定義及規定均納入本參加函，增補並構成立書人與其他協定書參加人間簽署之相關總約定書之一部份。

1. 特定條款 附錄二之條款應予以適用。
2. 指定代理人及免除責任 立書人茲指派櫃買中心為本協定書之目的為立書人之代理人，立書人並拋棄並免除櫃買中心任何與本參加函或立書人對本協定書之參加，或任何經櫃買中心要求之行為(包含但不限於重新出具、出示、公告或刊登本參加函)相關之任何權利、求償、行為或原因或其他行為(不論係由契約、侵權或其他所生)。
3. 聯絡資訊 就本參加函，立書人之聯絡資訊如下

名稱：
地址：
電話：
傳真：
電子郵件：

請填關於本協定書參加函授權之聯絡人

立書人茲同意櫃買中心將本參加函複本公開或揭露本函之內容。

[協定書參加人名稱]

請填公司全名並加蓋貴公司大小章

姓名：
職稱：

公司代表人及職稱

一、金融機構基本資料

金融機構名稱：_____

TR 機構代號：_____

機構統一編號：_____

聯絡人：_____

聯絡電話：() _____ 分機 _____

填入TR基本資料

二、金融機構款項收付資料

金融機構應付櫃買中心款項，匯撥至台灣銀行營業部 帳號：003-004-375661

(戶名：財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心)

櫃買中心應付金融機構款項，匯撥至_____銀行_____分行(金資代號_____)

帳號：_____ 戶名：_____ 帳戶統一編號：_____

貴公司指定之款項撥入帳戶資料

帳號啟用(變更)日期：____/____/____ 櫃買中心承辦人員：_____

【註：申請變更登記時，未更修之欄位毋須重複填製】

貴公司大小章

(公司大小章)

TR系統>>提前了結作業>>參與登記

TR 衍生性商品資料儲存庫

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 ▲

資料維護 ▾

[IRSAGE] 參與登記

查詢

修改

申報

資料上傳 ▾

[IRSAGE] 參與登記

[TRIRSXT] IRS提前了結報表下載

[IRRSchedule] 時程查詢

申報狀態 [與錯誤說明]

--

IRS提前了結參與書

提供參與IRS提前了結機構，參與登記。

本公司依財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心衍生性金融商品交易提前了結系統作業要點第4點規定，申請參與下列提前了結作業：

提前了結商品:新台幣利率交換契約。

提前了結時間:107年11月12日至11月28日。

作業時程:

11月12日至14日:開放申請參與本次IRS提前了結作業。

11月15日至20日:開放參與機構下載IRS契約資料報表。

11月16日至20日:申報第一次提前了結預演作業契約資料，並以11月16日作為評價基準日，申報截止時間為11月20日17:00，未申報資料者，視同放棄參與本次提前了結作業資格。

11月21日~22日:辦理預演作業，演結果僅作為參與機構參與最終提前了結作業之參考，預演結果不生任何法律上之效力。

11月23日:辦理最終作業契約資料上傳。並以11月23日作為評價基準日，最遲須於當日22:00申報，逾時未申報資料者，依規定將沿用第二次預演之申報資料。

11月26日:辦理最終作業結果下載，對結果有異議者，須於當日10:00前提出。

11月28日:提前了結付款日，請於13:30前完成付款。

業務聯絡人:

聯絡人電話:

EMail:

已詳閱並同意櫃買中心上列參與書內容

參加步驟說明(續)

➤ 步驟二：下載交易資料及上傳風險資訊

1. 8月31日~9月5日(9/2周六及9/3周日除外)：開放參與機構下載已申報至TR之交易明細表，此明細表內之交易即為本次可解約之交易。(對手僅含當次有參與之機構，並會排除了結作業期間到期及正式作業期間付息之契約)
2. 9月1日~9月5日：請依規定格式並以**9月1日**作為**評價基準日**，於9月5日**17:00**前，完成上傳第一次預演作業風險資訊。(未上傳者不可參與**第2次預演**以及**正式作業**)
3. 9月5日：**17:30~18:30**開放下載第一次預演作業初步比對報表，可由此報表得知交易對手已上傳或未上傳之交易。

TR系統>>提前了結作業>> IRS提前了結報表下載

TR 衍生性商品資料儲存庫

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 ▲

資料維護 ▾

資料上傳 ▾

[IRSAGE] 參與登記

[TRIRSXT] IRS提前了結報表下載

[IRSSchedule] 時程查詢

IRS提前了結報表下載

1. 下載IRS提前了結報表
2. 限勾選提前了結/提前了結作業權限帳號使用。

報表下載

報表最後更新時間: --

下載

TR申報系統 IRS提前了結報表(申報端) (IRS Early Unwind Service Reports)

類別 (Category)	代碼 (Code)	名稱 (Name)	狀態 (Status)
可供提前了結資料報表 (Available Transactions Information)	TRDCC301	可供提前了結利率交換契約一覽表 (Available IRS Early Unwind Transactions Repository)	完成
	TRDCC302	應申報交易對手風險機構一覽表 (List of Counterparties)	完成
預演前回覆報表 (Pre-preview Reports)	TRDCC303	利率交換提前了結上傳資料比對未成功一覽表 (Unsuccessful Pair of Uploaded IRS Early Unwind Transactions)	完成
	TRDCC304	利率交換提前了結上傳資料比對成功一覽表 (Successful Pair of Uploaded IRS Early Unwind Transactions)	完成
配對預演結果報表 (Preview Reports)	TRDCC310	利率交換提前了結配對結果彙整表-預演 (Cash and Risk Exposures Proposal - Preview)	
	TRDCC313	利率交換提前了結配對成功契約一覽表-預演 (Terminated Transactions Proposal - Preview)	
正式配對結果報表 (Final Reports)	TRDCC320	利率交換提前了結配對結果彙整表 (Cash and Risk Exposures Proposal - Final)	
	TRDCC323	利率交換提前了結配對成功契約一覽表 (Paired IRS Early Unwind Transactions-Final)	
	TRDCC324	利率交換提前了結契約-確認書 (IRS Early Unwind Transactions-Confirmation Letter)	

TRDCC301 可供提前了結利率交換契約一覽表

0000000 XX商業銀行
可供提前了結利率交換契約一覽表
(Available IRS Early Unwind Transactions Repository)

日期(Date) : 2022/11/15

機構名稱(Name) : XX商業銀行

機構代號(ID) : 0000000

序號 (Seiral Number)	資料序號 (Reference Number)	交易對手名稱 (Counterparty Name)	交易對手代號 (Counterparty ID)	交易日 (Trade Date)	生效日 (Effective Date)	到期日 (Termination Date)	名目本金 (Notional Principal Amount)	幣別 (Currency)	固定利率 (Fixed Rate)	利率指標 (Reference Index)	利息收付 (Payment/Receipt of Fixed Interest)
1	IRSXXXXX1	OO商業銀行	0000000	20180526	20190528	20200528	300,000,000	TWD	1.0000	TAIBOR	付固定
2	IRSXXXXX2	OO商業銀行	0000000	20181224	20191228	20201228	300,000,000	TWD	1.0000	TAIBOR	付固定
3	IRSXXXXX3	OO商業銀行	0000000	20180309	20190311	20200311	300,000,000	TWD	1.0000	TAIBOR	收固定
4	IRSXXXXX4	OO商業銀行	0000000	20180309	20190311	20200311	300,000,000	TWD	1.0000	TAIBOR	收固定
5	IRSXXXXX5	OO商業銀行	0000000	20180922	20190924	20200924	300,000,000	TWD	1.0000	TAIBOR	收固定
6	IRSXXXXX6	OO商業銀行	0000000	20181120	20191124	20201124	300,000,000	TWD	1.0000	TAIBOR	收固定

TRDCC302 應申報交易對手風險機構一覽表

0000000 XX商業銀行
應申報交易對手風險機構一覽表
(List of Counterparties)

機構名稱(Name)：XX商業銀行

機構代號(ID)：0000000

序號 (Seiral Number)	交易對手名稱 (Counterparty Name)	交易對手代號 (Counterparty ID)
1	德商德意志銀行	0720000
2	新加坡商星展銀行	0780000
3	永豐商業銀行	8070000
4	凱基商業銀行	8090000
5	星展（台灣）商業銀行	8100000

TR系統>>提前了結作業>> 資料上傳

TR 衍生性商品資料儲存庫

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 ▲

資料維護 ▼

資料上傳 ▲

[IRSCT] CONTRACT契約上傳

[MKTRISK] 市場風險限額

[CDTRISK] 信用風險限額

[IRSAGE] 參與登記

[TRIRSXT] IRS提前了結報表下載

[IRSSchedule] 時程查詢

辜....您好，您上次登入時間為 2019/9/23 上午 09:53:57

歡迎使用「衍生性商品交易資訊儲存庫申報系統」

- 請點選上方功能列進行操作

TR系統>>提前了結作業>> 資料上傳>> CONTRACT契約上傳

TR 衍生性商品資料儲存庫 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 ▲ 資料維護 ▼

IRSCT] CONTRACT契約上傳 查詢 新增 修改 刪除 匯入檔案 匯出 ▼ 清畫面

資料上傳 ▲

- [IRSCT] CONTRACT契約上傳
- [MKTRISK] 市場風險限額
- [CDTRISK] 信用風險限額
- [IRSAGE] 參與登記
- [TRIRSXT] IRS提前了結報表下載
- [IRSSchedule] 時程查詢

資料序號	名目本金(元)	契約市值(元)
0~1個月(含) PVBP (元)	1~3個月(含) PVBP (元)	3~6個月(含) PVBP (元)
9個月~1年(含) PVBP (元)	1~2年(含)PVBP (元)	2~3年(含)PVBP (元)
4~5年(含)PVBP (元)	5~6年(含)PVBP (元)	6~7年(含)PVBP (元)
8~9年(含)PVBP (元)	9~10年(含)PVBP (元)	10~15年(含)PVBP (元)
20~25年(含)PVBP (元)	25年以上 PVBP (元)	15~20年(含)PVBP (元)

新增：逐筆契約手動新增
匯入檔案：多筆契約一次匯入

契約資料格式

➤ 契約風險資訊

✓檔案：CONTRACT.txt/csv

✓應忠實反映各筆契約風險，本中心僅檢核1~3欄位

檔名：CONTRACT			
序號	欄位	格式	說明
1	申報機構代號	X(7)	請依TR申報機構代號填寫
2	資料序號	X(20)	需與TR申報之資料序號相同
3	名目本金	9(15)v9(2)	需與TR資料 <u>餘額</u> 相符
4	契約市值	S9(8)	
5	0~1個月 PVBP	S9(6)	
6	1~3個月 PVBP	S9(6)	
7	3~6個月 PVBP	S9(6)	
8	6~9個月 PVBP	S9(6)	
9	9個月~1年 PVBP	S9(6)	
10	1~2年PVBP	S9(6)	
11	2~3年PVBP	S9(6)	
12	3~4年PVBP	S9(6)	

13	4~5年PVBP	S9(6)	
14	5~6年PVBP	S9(6)	
15	6~7年PVBP	S9(6)	
16	7~8年PVBP	S9(6)	
17	8~9年PVBP	S9(6)	
18	9~10年PVBP	S9(6)	
19	10~15年PVBP	S9(6)	
20	15~20年PVBP	S9(6)	
21	20~25年PVBP	S9(6)	
22	25年以上 PVBP	S9(6)	

契約資料csv範例

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S	T	U	V
00000001	ABC1234	300000000000	700000	0	-1582	5899	17989	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
00000001	ABC4567	300000000000	2000000	1495	-8370	-62	2	-20850	-25288	-279	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
00000001	ABC8910	300000000000	-1500000	1483	-4305	-831	-10	199	-275	41	-25868	-212000	0	0	0	0	0	0	0	0	0

契約資料序號

MTM契約市值

申報機構代號

契約名目本金

各時間帶PVBP
(視契約剩餘年期)

TR系統>>提前了結作業>> 資料上傳>> 市場風險限額

[MKTRISK] 市場風險限額 查詢 修改 匯入檔案 申報 清除申報資料

- 資料上傳 ▲
- [IRRCT] CONTRACT契約上傳
- [MKTRISK] 市場風險限額**
- [CDTRISK] 信用風險限額
- [IRSAGE] 參與登記
- [TRIRSXT] IRS提前了結報表下載
- [IRSSchedule] 時程查詢

金融機構: 0040000
申報日期: 20190923

申報狀態 [與錯誤說明]
--

Level 1 PVBP減少上限(-)

-

Level 2 PVBP減少上限(-)

-

Level 3 PVBP減少上限(-)

-

Level 4 PVBP減少上限(-)

-

Level 1 PVBP增加上限(+)

+

Level 2 PVBP增加上限(+)

+

Level 3 PVBP增加上限(+)

+

Level 4 PVBP增加上限(+)

+

現金支付上限(-)

-

市場風險限額格式

➤ 風險增減及現金收付上限

✓檔案：MKTRISK.txt/csv

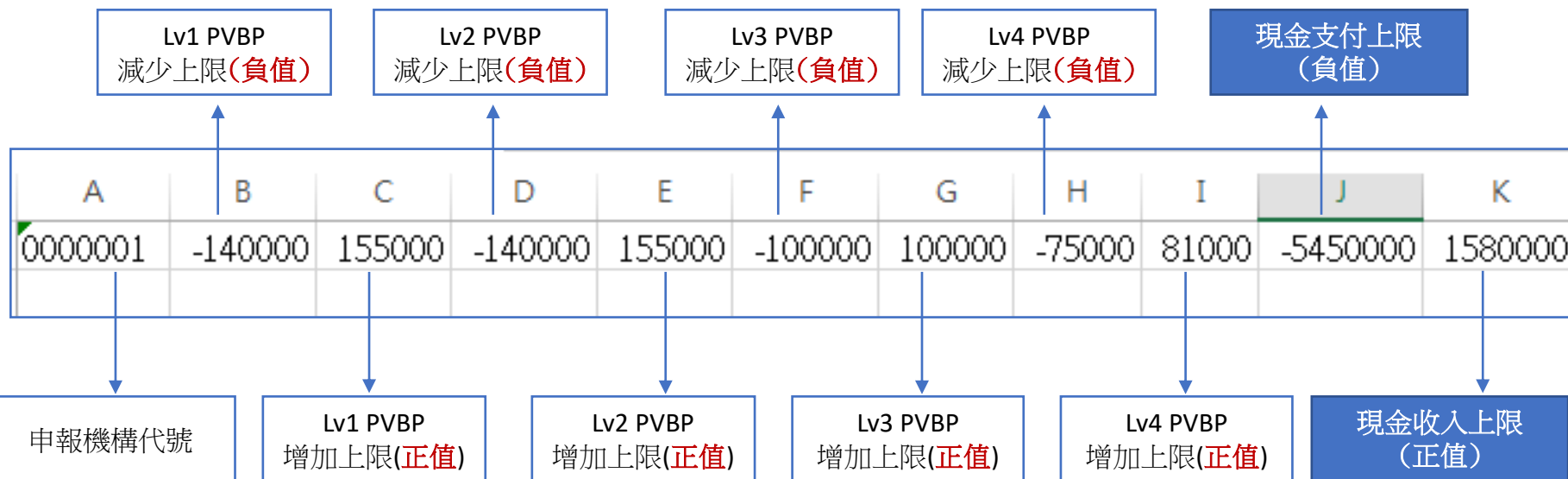
✓2~11欄位數值皆為自由設定，數值過小會降低提解成功率

檔名：MKTRISK			
序號	欄位	格式	說明
1	申報機構代號	X(7)	請依TR申報機構代號填寫
2	Level 1 PVBP減少上限	S9(12)	請填負號
3	Level 1 PVBP增加上限	S9(12)	請填正號
4	Level 2 PVBP減少上限	S9(12)	請填負號
5	Level 2 PVBP增加上限	S9(12)	請填正號
6	Level 3 PVBP減少上限	S9(12)	請填負號
7	Level 3 PVBP增加上限	S9(12)	請填正號
8	Level 4 PVBP減少上限	S9(12)	請填負號
9	Level 4 PVBP增加上限	S9(12)	請填正號
10	現金支付上限	S9(12)	請填負號
11	現金收入上限	S9(12)	請填正號

市場風險各時間LEVEL

層級	市場風險容忍值	層級	市場風險容忍值	層級	市場風險容忍值	層級	市場風險容忍值
Level 4	S9(6)	Level 3	S9(6)	Level 2	S9(6)	Level 1	S9(6)
0~1個月(含) PVBP	+/- 300,000	0~2Y PVBP	+/- 200,000	0~5Y PVBP	+/- 160,000	0~25+Y PVBP	+/- 80,000
1~3個月(含) PVBP	+/- 300,000						
3~6個月(含) PVBP	+/- 300,000						
6~9個月(含) PVBP	+/- 300,000						
9個月~1年(含) PVBP	+/- 300,000						
1~2年(含) PVBP	+/- 300,000	2~5Y PVBP	+/- 200,000				
2~3年(含) PVBP	+/- 300,000						
3~4年(含) PVBP	+/- 300,000						
4~5年(含) PVBP	+/- 300,000						
5~6年(含) PVBP	+/- 300,000						
6~7年(含) PVBP	+/- 300,000	5~10Y PVBP	+/- 200,000	5~25+Y PVBP	+/- 160,000		
7~8年(含) PVBP	+/- 300,000						
8~9年(含) PVBP	+/- 300,000						
9~10年(含) PVBP	+/- 300,000						
10~15年(含) PVBP	+/- 300,000						
15~20年(含) PVBP	+/- 300,000	10~25+ PVBP	+/- 200,000				
20~25年(含) PVBP	+/- 300,000						
25年以上 PVBP	+/- 300,000						

市場風險csv範例



注意：限制範圍過窄容易發生提解率過低情形

TR系統>>提前了結作業>> 資料上傳>> 信用風險限額

TR 衍生性商品資料儲存庫

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 ▲

資料維護 ▾

[CDTRISK] 信用風險限額

查詢

新增

修改

刪除

匯入檔案

匯出 ▾

清畫面

申報

資料上傳 ▲

[IRSCT] CONTRACT契約上傳

[MKTRISK] 市場風險限額

[CDTRISK] 信用風險限額

[IRSAGE] 參與登記

[TRIRSXT] IRS提前了結報表下載

[IRSSchedule] 時程查詢

交易對手代號

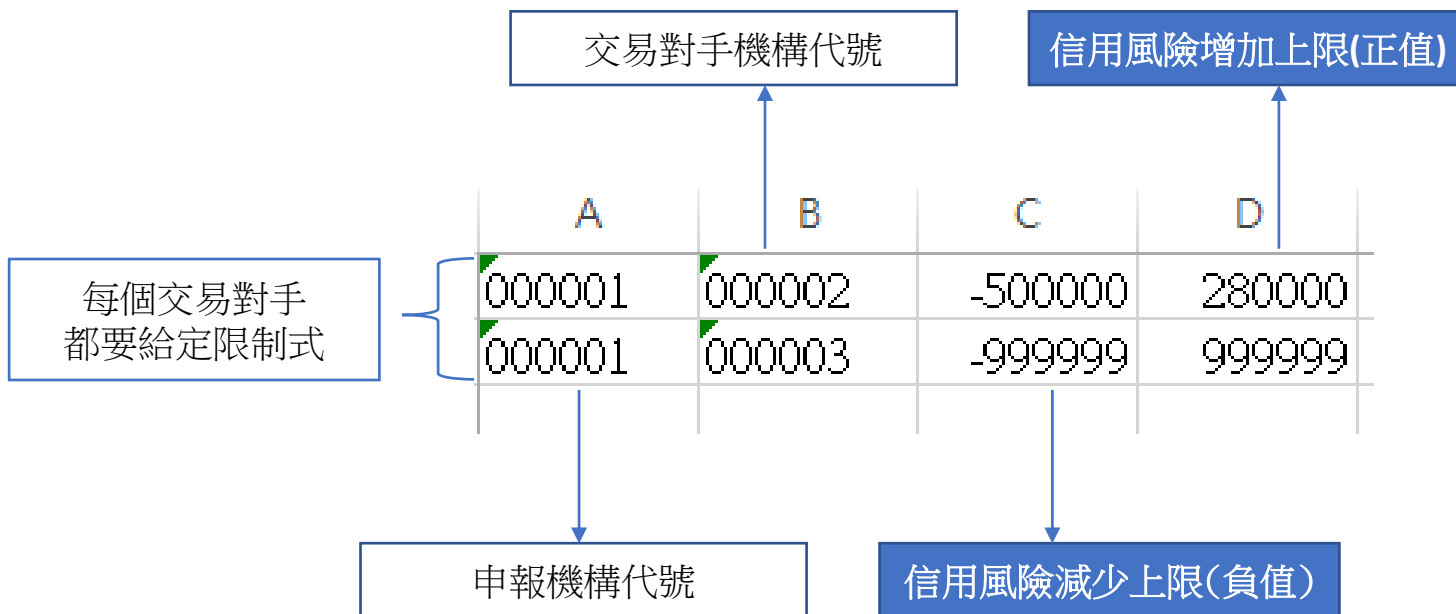
信用風險減少上限(

信用風險限額格式

- 交易對手風險維護
 - ✓檔名：CDTRISK.txt/csv
 - ✓3~4欄位自由設定
 - ✓信用風險增減係指損益之增減

檔名：CDTRISK			
序號	欄位	格式	說明
1	申報機構代號	X(7)	請依TR申報機構代號填寫
2	交易對手代號	X(7)	請依TR申報機構代號填寫
3	信用風險減少上限	S9(12)	請填負號
4	信用風險增加上限	S9(12)	請填正號

信用風險csv範例



注意：誤填對手代碼將導致結果錯誤，建議可跟TRDCC302報表(應申報交易對手風險機構一覽表)比對是否正確

媒體格式與傳輸範例下載位置

- 業務宣導網站 > 證券商/金融機構/投信專區 > 店頭衍生性商品 > 提前了結系統文件下載

提前了結系統文件下載

序號	文件名稱	檔案下載/連結
1	107年10月09日宣導說明資料	下載
2	衍生性金融商品交易提前了結系統媒體傳輸格式	下載
3	市場風險(MKTRISK)上傳範例檔案	下載
4	信用風險(CDTRISK)上傳範例檔案	下載
5	契約風險(CONTRACT)上傳範例檔案	下載
6	本中心衍生性金融商品交易提前了結協定書(中文版)	下載
7	提前了結系統款項結算帳戶申報書	下載

參加步驟說明(續)

➤ 步驟三：預演作業

1. 9月6日：

- ✓ 12:00~17:00 開放下載第一次預演結果報表。
- ✓ 12:00~17:00 請依規定格式並以9月1日作為評價基準日，於9月6日17:00前，完成上傳第二次預演作業資料。
- ✓ 17:30~18:30，開放下載第二次預演作業資料初步比對結果。

2. 9月7日

- ✓ 12:00~17:00，開放下載第二次預演結果報表

TR申報系統 IRS提前了結報表(申報端) (IRS Early Unwind Service Reports)

類別 (Category)	代碼 (Code)	名稱 (Name)	狀態 (Status)
可供提前了結資料報表 (Available Transactions Information)	TRDCC301	可供提前了結利率交換契約一覽表 (Available IRS Early Unwind Transactions Repository)	完成
	TRDCC302	應申報交易對手風險機構一覽表 (List of Counterparties)	完成
預演前回覆報表 (Pre-preview Reports)	TRDCC303	利率交換提前了結上傳資料比對未成功一覽表 (Unsuccessful Pair of Uploaded IRS Early Unwind Transactions)	完成
	TRDCC304	利率交換提前了結上傳資料比對成功一覽表 (Successful Pair of Uploaded IRS Early Unwind Transactions)	完成
配對預演結果報表 (Preview Reports)	TRDCC310	利率交換提前了結配對結果彙整表-預演 (Cash and Risk Exposures Proposal - Preview)	完成
	TRDCC313	利率交換提前了結配對成功契約一覽表-預演 (Terminated Transactions Proposal - Preview)	完成
正式配對結果報表 (Final Reports)	TRDCC320	利率交換提前了結配對結果彙整表 (Cash and Risk Exposures Proposal - Final)	
	TRDCC323	利率交換提前了結配對成功契約一覽表 (Paired IRS Early Unwind Transactions-Final)	
	TRDCC324	利率交換提前了結契約-確認書 (IRS Early Unwind Transactions-Confirmation Letter)	

參加步驟說明(續)

➤ 步驟四：正式作業

1. 9月8日：請依規定格式並以9月8日作為評價基準日，於9月8日09:00起至22:00前，上傳正式作業資料。逾時未上傳資料者，將依規定沿用第二次預演資料，作為正式作業之依據。
2. 9月11日：08:00~17:00開放下載正式作業結果報表。
 - ✓ 對正式作業結果無意見，請於9月11日10:00前，經有權人簽章簽署之《TRDCC323》報表傳真至本中心。
 - ✓ 對結果有異議者，須於9月11日10:00前提出。

TR申報系統 IRS提前了結報表(申報端) (IRS Early Unwind Service Reports)

類別 (Category)	代碼 (Code)	名稱 (Name)	狀態 (Status)
可供提前了結資料報表 (Available Transactions Information)	TRDCC301	可供提前了結利率交換契約一覽表 (Available IRS Early Unwind Transactions Repository)	完成
	TRDCC302	應申報交易對手風險機構一覽表 (List of Counterparties)	完成
預演前回覆報表 (Pre-preview Reports)	TRDCC303	利率交換提前了結上傳資料比對未成功一覽表 (Unsuccessful Pair of Uploaded IRS Early Unwind Transactions)	完成
	TRDCC304	利率交換提前了結上傳資料比對成功一覽表 (Successful Pair of Uploaded IRS Early Unwind Transactions)	完成
配對預演結果報表 (Preview Reports)	TRDCC310	利率交換提前了結配對結果彙整表-預演 (Cash and Risk Exposures Proposal - Preview)	完成
	TRDCC313	利率交換提前了結配對成功契約一覽表-預演 (Terminated Transactions Proposal - Preview)	完成
正式配對結果報表 (Final Reports)	TRDCC320	利率交換提前了結配對結果彙整表 (Cash and Risk Exposures Proposal - Final)	完成
	TRDCC323	利率交換提前了結配對成功契約一覽表 (Paired IRS Early Unwind Transactions-Final)	完成
	TRDCC324	利率交換提前了結契約-確認書 (IRS Early Unwind Transactions-Confirmation Letter)	完成

交易確認書範例

000000 XX證券公司
利率交換提前了結配對成功契約一覽表
(Paired IRS Early Unwind Transactions-Final)

序號 (Serial Number)	資料序號 (Reference Number)	交易對手名稱 (Counterparty Name)	交易對手代號 (Counterparty ID)	交易對手資料序號 (Counterparty Reference Number)	交易日 (Trade Date)	生效日 (Effective Date)	到期日 (Maturity Date)	名目本金 (Notional Principal Amount)	幣別 (Currency)	固定利率 (Fixed Rate)	利率指標 (Reference Index)	利息收付 (Payment/Receipt of Fixed Interest)	自結損益 (NPV)	結算損益 (Settlement Value)
1			0720000					180,000,000	TWD		TAIBOR	付固定	5,000,000	5,000,000
2			0720000					300,000,000	TWD		TAIBOR	收固定	5,000,000	5,000,000
3			0720000					300,000,000	TWD		TAIBOR	付固定	5,000,000	5,000,000
4			0720000					300,000,000	TWD		TAIBOR	付固定	5,000,000	5,000,000
5			0720000					300,000,000	TWD		TAIBOR	收固定	5,000,000	5,000,000
6			8070000					300,000,000	TWD		TAIBOR	收固定	5,000,000	5,000,000
7			8070000					300,000,000	TWD		TAIBOR	付固定	5,000,000	5,000,000
合計(Total)								1,980,000,000					35,000,000	35,000,000

本公司同意並接受本報表所列之提前了結作業最終執行結果於(2019/11/25)生效，並同意於交割日(2019/11/27)依櫃買中心計算之本公司應收金額新臺幣3,343,785元與櫃買中心辦理完成款項結算作業。

We, the undersigned, agree and acknowledge that the result of the final implementation of the early unwind operations as detailed in this table will be effective as of (2019/11/25) and the total amount of NTD 35,000,000 which is calculated and provided by Taipei Exchange, will be transferred and received by us from the account designated by Taipei Exchange on the Settlement Date(2019/11/27) in

XX證券公司

有權人簽章(Signature):

日期(Date):

經有權人簽章後於9月11日上午10時前傳真至本中心

交易確認書範例

8220000 中國信託商業銀行 利率交換提前了結契約-確認書 (IRS Early Unwind Transactions-Confirmation Letter)												
日期(Date): 2018/11/08			機構代號(ID): 8220000									
機構名稱(Name): 中國信託商業銀行			交割日期(Settlement Date): 2018/11/12									
提解日期(Unwind Date): 2018/11/08												
序號 (Serial Number)	資料序號	交易對手名稱	交易對手代號	交易對手資料序號	交易日	生效日	到期日	名目本金	幣別	固定利率	利率指標	利息收付
1												
2	18386711	彰化商業銀行	0090000	16IRS05815199	20160912	20160914	20210914	500,000,000	TWD	0.785	TAIBOR	收固定
合計(Total)								800,000,000				

本確認書包含交易雙方間於櫃檯買賣中心舉辦之提前了結作業中（提解日期：2018/11/08）提前了結成功之所有契約，交易雙方確認以上提前了結最終執行結果之契約條件正確無誤，交易雙方於本確認書所列之契約並無直接的款項收付，所有提前了結產生之款項皆透過櫃檯買賣中心辦理收付（交割日期：2018/11/12），並於交易雙方完成與櫃檯買賣中心之款項金額之收付無誤後，交易雙方就上述所列最終執行結果之利率交換契約視為終止，雙方之權利義務消滅。

We, the undersigned, agree and acknowledge that this Confirmation Letter comprises all transactions between us as the parties participating therein that have been successfully early unwound (Unwind Date: 2018/11/08) under the early unwind process conducted by Taipei Exchange. We confirm that the terms and conditions of the result of the final implementation of the early unwind operations as stated above are correct and accurate and that no direct payment of any amount in relation to the transactions listed in this Confirmation Letter will be made between us. Instead, the amount due from the early unwind operations will be received and paid through the account designated by Taipei Exchange (Settlement Date: 2018/11/12). We further confirm that upon completion of payment of the amount between us and Taipei Exchange, all IRS transactions as listed in the above result of the final implementation of the early unwind operations will be deemed to be terminated and each party has no rights against or obligations to the other party.

中國信託商業銀行簽章

簽章(sign):

日期(Date):

彰化商業銀行簽章

簽章(sign):

日期(Date):

四家交易對手會有四份交易確認書

8220000 - 0090000

8220000 - 0120000

8220000 - 0720000

8220000 - 0780000

參加步驟說明(續)

➤ 步驟五：款項收付

1. 9月13日：應付款項之機構，9月13日當日下午1時30分前，將款項匯入本中心專戶《003-004-37566-1》；有應收款項之機構，本中心將於收足款項後，於下午1時30分起，匯入各機構之指定專戶。
2. 本中心於雙方收付權利義務完成後，將於統一辦理TR解約申報作業(生效日為9月11日)，參與機構無需自行申報。

提前了結媒體格式申報建議

➤ 契約資料上傳之PVBP時間帶沒有區分這麼細，怎麼辦？

依貴公司既有區分方式之計算資料填入即可

➤ 是否需要同時申報長短部位？

依據互抵原則，建議同時申報長短部位，有助於提升提解率

➤ 雙方契約互抵後是否會新增第三方契約？

不會，本中心提解為整筆契約FULLY UNWIND

➤ 契約市值評價依據？

依貴公司現行評價IRS契約市值方式即可，基準日請依本中心公告為準

➤ 若有意提升提解率，請在可接受風險波動前提下，放寬PVBP增減上下限、現金收支上下限以及信用風險上下限。

TR 衍生性商品資料儲存庫

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 ▾

資料維護 ▲

[USER] 使用者資料維護

[ORG] 機構資料維護

[Certificate] 憑證註冊

使用者資料維護

區碼：

請輸入區碼

電話號碼：

請輸入電話號碼

分機：

請輸入分機

目前狀態：

有效 ▾

次日狀態：

有效 ▾

結構型客訴申報 公債部位

免比對確認權限

衍生性商品免比對交易確認 結構型商品免比對交易確認

提前了結

參與書登記 提前了結作業

境外衍生性資訊諮詢服務

服務申報 提前解約申報

管理權限

主管 帳號管理者

感謝聆聽

謝依璇
證券櫃檯買賣中心 債券部
Tel：(02)2366-6147
Fax：(02)2365-7861
E-mail：louise@tpex.org.tw

林雅雯
證券櫃檯買賣中心 債券部
Tel：(02)2366-8077
Fax：(02)2365-7861
E-mail：sylvia@tpex.org.tw