

# 衍生性金融商品電腦交易系統 (TADS)

系統操作手冊(V2.0)

中華民國財團法人證券櫃檯買賣中心

2020年10月30日

# 衍生性金融商品電腦交易系統(TADS)

## 系統操作手冊(V2.0)

### 目錄

設備需求.....	4
1. 交易終端機設備.....	4
2. 軟體安裝方式.....	5
衍生性金融商品電腦交易系統(TADS) –功能總表.....	7
一、檔案.....	8
1.檔案 – 登入.....	9
2.檔案 – 登出.....	10
3.檔案 – FIX 參數設定.....	11
4.檔案 – 顯示系統訊息.....	12
5.檔案 – 結束.....	13
二、遠期利率(FRA).....	14
1.遠期利率 – 報價.....	15
2.遠期利率 – 交易.....	17
3.遠期利率 – 詢價.....	19
4.遠期利率 – 被詢價.....	21
5.遠期利率 – 成交查詢.....	22
6.遠期利率 – 行情揭示.....	23
三、利率交換(IRS).....	24
1.利率交換 – 報價.....	25
2.利率交換 – 交易.....	27
3.利率交換 – 詢價.....	29
4.利率交換 – 被詢價.....	31
5.利率交換 – 成交查詢.....	32
6.利率交換 – 成交行情.....	33
7.利率交換 – 公開報價.....	34
四、債券遠期(BOND FORWARD).....	35
1.債券遠期 – 報價.....	36
1.1 債券遠期 – 報價-新增報價.....	37
1.2 債券遠期 – 報價-修改報價.....	39

1.3 債券遠期 – 報價-刪除報價 .....	40
1.4 債券遠期 – 報價-結束報價 .....	41
1.5 債券遠期 – 報價-報價未成功之情形.....	42
2.債券遠期 – 交易 .....	43
2.1 債券遠期 – 交易-點選交易 .....	44
2.2 債券遠期 – 交易-交易未成功之情形.....	45
3.債券遠期 – 詢價 .....	47
3.1 債券遠期 – 詢價-詢價.....	48
3.2 債券遠期 – 詢價-刪除.....	49
3.3 債券遠期 – 詢價-交易.....	50
3.4 債券遠期 – 詢價-結束.....	53
4.債券遠期 – 被詢價.....	54
4.1 債券遠期 – 被詢價-追回申報 .....	56
4.2 債券遠期 – 被詢價-不報價 .....	57
4.3 債券遠期 – 被詢價-不接受詢價 .....	58
4.4 債券遠期 – 被詢價-不顯示詢價單 .....	59
5.債券遠期 – 成交查詢 .....	60
6.債券遠期 – 行情揭示 .....	62
五、債券選擇權(BOND OPTION) .....	64
1.債券選擇權 – 報價.....	65
1.1 債券選擇權 – 報價-新增報價.....	67
1.2 債券選擇權 – 報價-修改報價.....	68
1.3 債券選擇權 – 報價-刪除報價 .....	69
1.4 債券選擇權 – 報價-結束報價.....	70
2.債券選擇權 – 交易 .....	71
2.1 債券選擇權 – 交易-點選報價 .....	74
2.2 債券選擇權 – 交易-超過交易限額 .....	75
2.3 債券選擇權 – 交易-暫停交易對象 .....	76
3. 債券選擇權 – 詢價.....	77
3.1 債券選擇權 – 詢價-詢價.....	78
3.2 債券選擇權 – 詢價-刪除 .....	79
3.3 債券選擇權 – 詢價-交易 .....	80
4. 債券選擇權 – 被詢價 .....	82

4.1 債券選擇權 – 被詢價-報價申報 .....	83
4.2 債券選擇權 – 被詢價-追回申報 .....	84
4.3 債券選擇權 – 被詢價-不報價 .....	85
4.4 債券選擇權 – 被詢價-不接受詢價 .....	86
4.5 債券選擇權 – 被詢價-不顯示詢價單 .....	87
5. 債券選擇權 – 成交查詢 .....	88
6. 債券選擇權 – 行情揭示 .....	90
六、輔助功能 .....	92
1. 輔助功能 – 報表製作 .....	93
2. 輔助功能 – 公告訊息 .....	96
3. 輔助功能 – 系統維護 .....	97
3.1 輔助功能 – 系統維護-交易商組合設定 .....	98
3.2 輔助功能 – 系統維護-交易額度設定 .....	100
3.3 輔助功能 – 系統維護-使用者資料維護 .....	103
3.4 輔助功能 – 系統維護-報價範圍設定 .....	109
4. 輔助功能 – 資料查詢 .....	110
4.1 輔助功能 – 資料查詢-債券資料 .....	111
4.2 輔助功能 – 資料查詢-交易商資料查詢 .....	112
4.3 輔助功能 – 資料查詢-營業日期查詢 .....	113
4.4 輔助功能 – 資料查詢-債券選擇權計算器 .....	114
5. 輔助功能 – 視窗 .....	115
5.1 輔助功能 – 視窗-視窗重排 .....	116
5.2 輔助功能 – 視窗-全部最小化 .....	117
5.3 輔助功能 – 視窗-儲存視窗組合 .....	118
5.4 輔助功能 – 視窗-取出視窗組合 .....	119
5.5 輔助功能 – 視窗-刪除視窗組合 .....	120
6. 輔助功能 – 債券行情揭示 .....	121

## 設備需求

### 1. 交易終端機設備

#### (一) 硬體設備：

1. CPU：Intel Core i3 (含) 以上。
2. 記憶體：2GB (含) 以上。
3. 硬碟空間：2GB (含) 以上。
4. 網路卡：10/100Mbps。

#### (二) 軟體需求

##### 1. 作業系統

- Windows 10 (32 或 64 位元)。
- 因微軟已終止支援 Windows 7，不再釋出更新及安全修補程式，考量資安問題本軟體無法在 Windows 7 上使用。

##### 2. 系統軟體

需安裝 Microsoft.NET Framework 4.6.2 (含) 以上 版本才能執行

##### 3. 作業系統時間格式限制

本軟體 FIX 連線僅支援作業系統西元年時間格式，請確認作業系統時間格式。

##### 🏠 變更資料格式

行事曆  
西曆 (中文)

一週的第一天  
星期一

開始日期  
2017/4/5

結束日期  
2017年4月5日

##### 4. 本軟體建議安裝路徑:

C:\TPEX\TADS 或 D:\TPEX\TADS，並請將 C:\TPEX 或 D:\TPEX 資料夾權限屬性可讀取、修改與寫入。

## 2. 軟體安裝方式

### 櫃買市場業務宣導網站下載

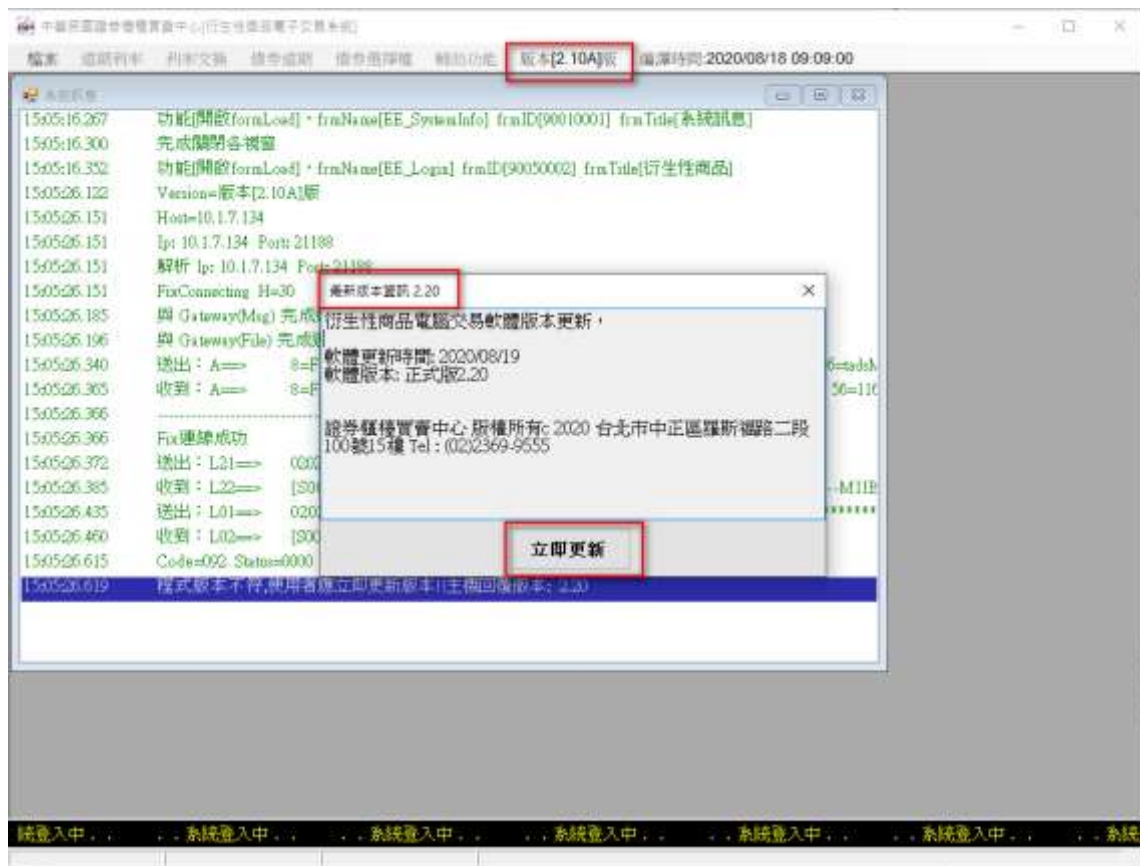
請至櫃買市場業務宣導網站>電腦資訊>衍生性商品交易系統 下載 InstallTADS(版號).exe 壓縮檔案(Ex : InstallTADS100.exe) (櫃買市場業務宣導網址：<https://dsp.tpex.org.tw/>)

註：與舊版安裝方式一致

### 系統自動換版機制

新版 TADS 軟體提供系統內自動換版機制，使用者登入時會檢查目前版本(2.10A)是否為最新版本(2.20)，若不是最新版本則系統會自動提示版本更新訊息及是否換版，使用者可以按下[立即更新]按鈕，系統則會自動下載安裝檔案並執行換版作業，如下列步驟所示

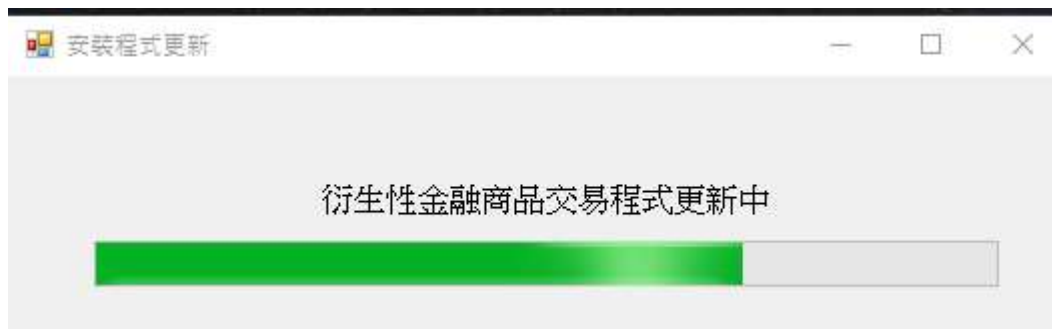
步驟一：點選立即更新



步驟二：系統會自動下載安裝檔案



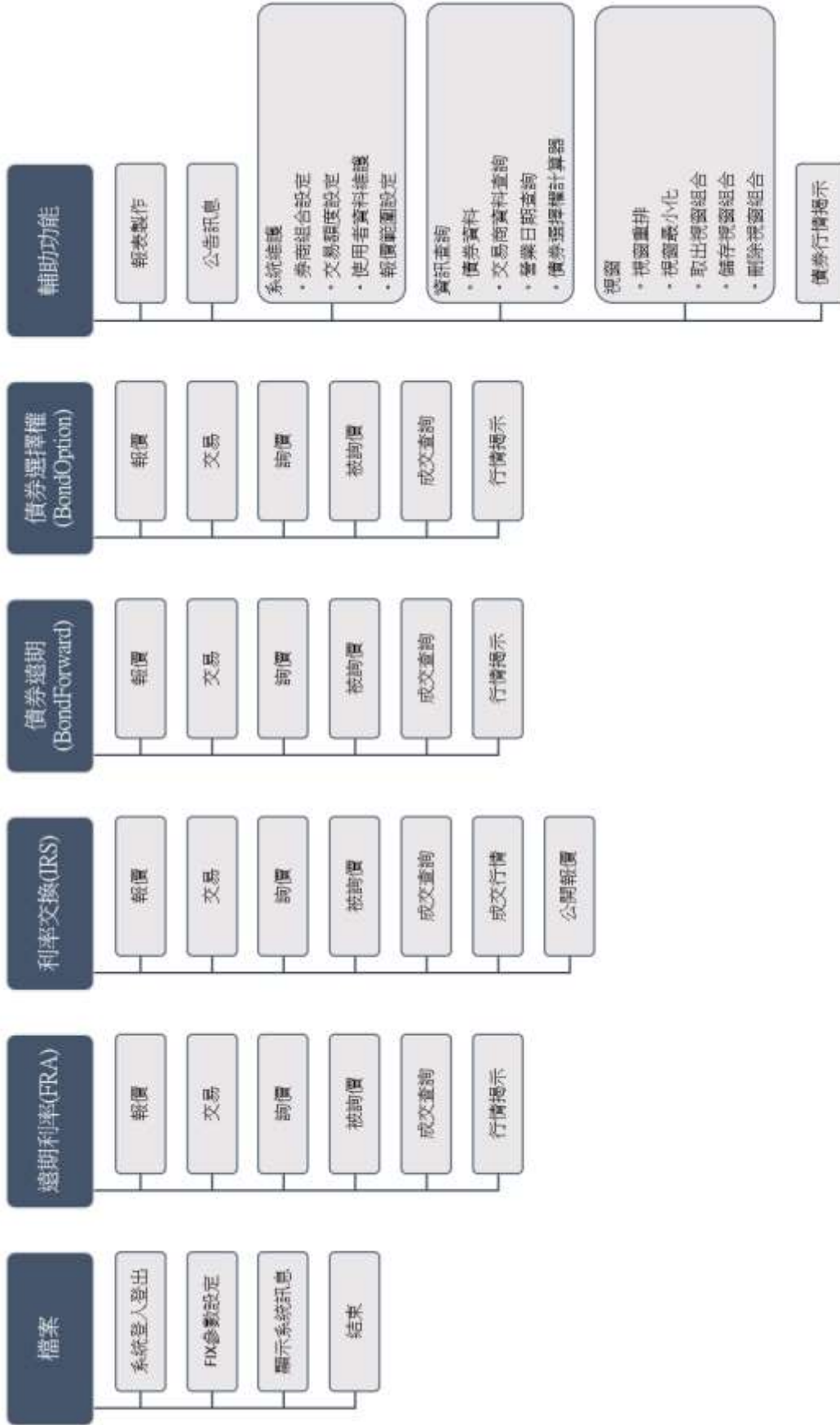
步驟三：系統自動執行換版作業



步驟四：系統完成自動換版後會自動重啟：請確認主視窗選單版本已為最新版(2.20)



# 衍生性金融商品電腦交易系統(TADS) – 功能總表



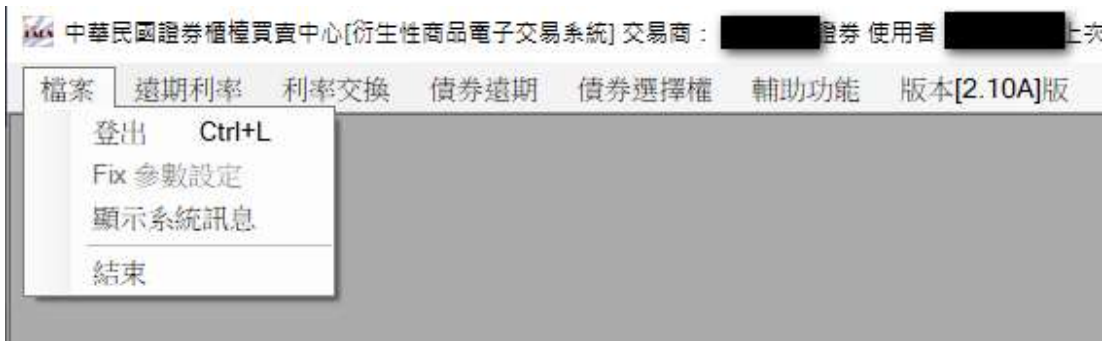


## 一、檔案

### 功能說明：

選單名稱	功能說明	頁次
系統登入/登出	執行衍生性金融商品交易系統上線(登出)功能	9
FIX 參數設定	設定資訊伺服器(Gateway)網路位址。	11
顯示系統訊息	該債券系統使用過程之完整紀錄。	12
結 束	離開衍生性金融商品交易系統	13

### 畫面說明：



## 1. 檔案 – 登入

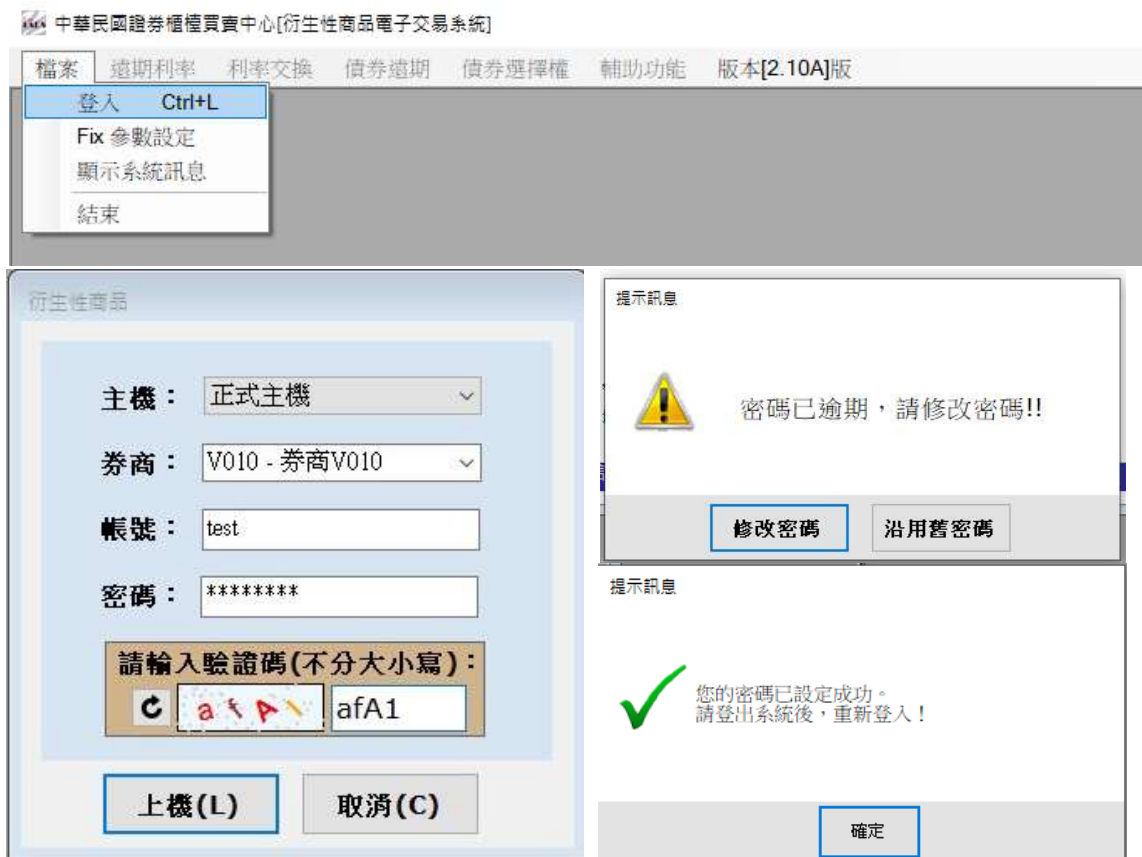
### 功能說明：

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「登入」，即出現登入視窗。
3. 輸入使用者之券商代號、帳號、密碼與驗證碼，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：08：00~18：30
5. 如 90 天未登入，會顯示「密碼已逾期，請修改密碼!!」提示，點選「修改密碼」，即開啟使用者維護畫面修改密碼並重新登入，若點選「沿用舊密碼」，則直接登入。

### 畫面說明：



## 2. 檔案 – 登出

### 功能說明：

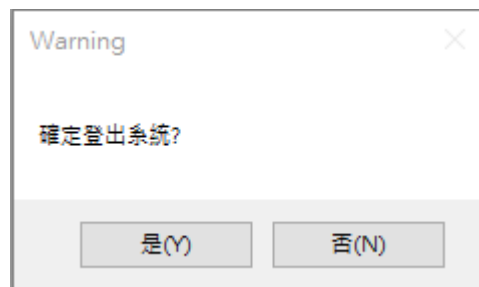
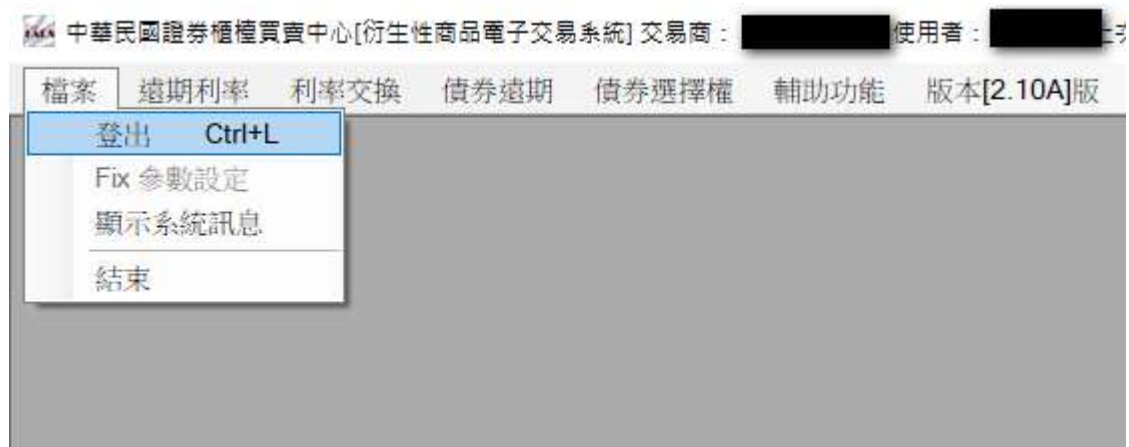
執行衍生性金融商品交易系統離線功能。

### 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「登出」，即出現詢問訊息。

3. 確定登出交易系統請點選  可離開系統，若不登出則請執行

### 畫面說明：



### 3. 檔案 – FIX 參數設定

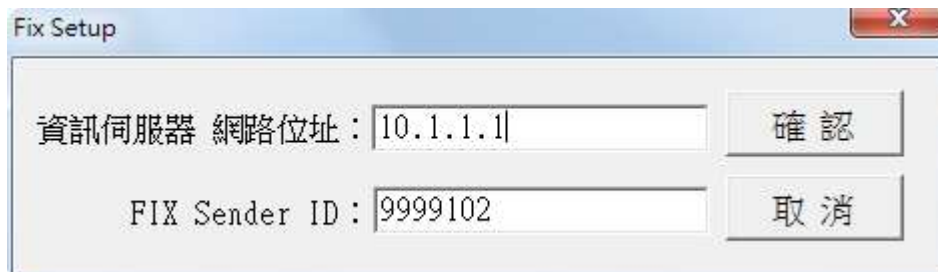
#### 功能說明：

設定資訊伺服器網路位址。

#### 操作說明：

1. 點選「檔案」下的「FIX參數設定」，開啟視窗。
2. 輸入資訊伺服器(Gateway) IP位置及 FIX Sender ID (請向貴公司資訊人員查詢)。
3. 按下  即設定完成。

#### 畫面說明：



## 4. 檔案 – 顯示系統訊息

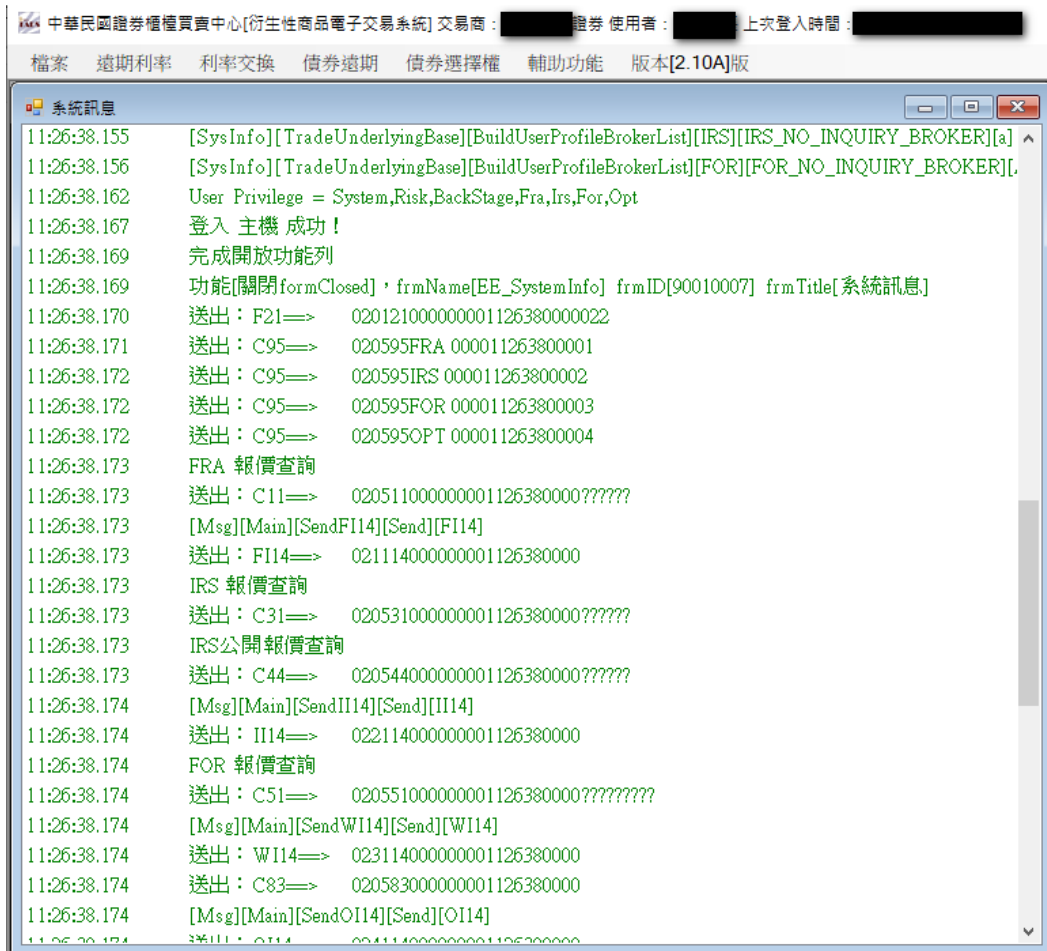
### 功能說明：

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：



## 5. 檔案 – 結束

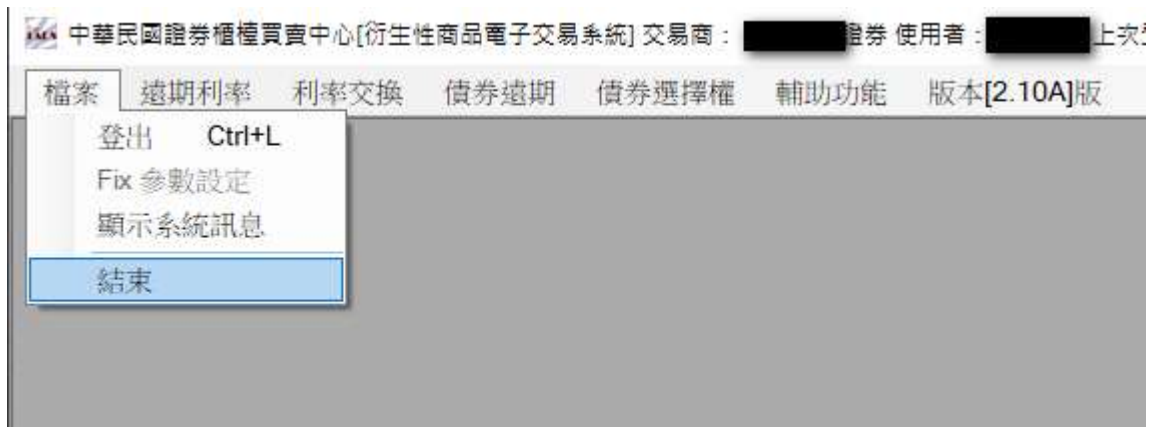
### 功能說明：

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  則結束程式， 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：

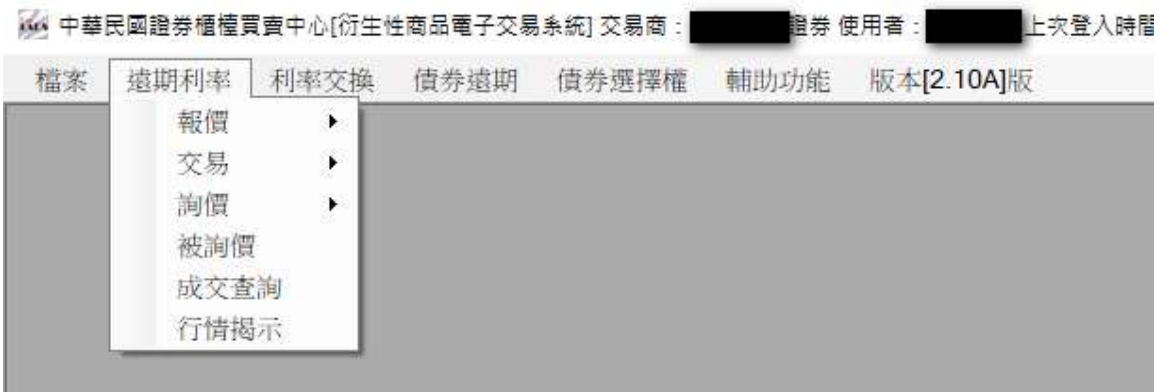


## 二、遠期利率(FRA)

### 功能說明：

選單名稱	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	15
交易	使用者可查詢各契約之報價狀況及進行成交	17
詢價	使用者可針對特定對象、特定契約規格進行詢價作業	19
被詢價	被詢價時報價回覆、不接受詢價作業	21
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	22
行情揭示	即時揭露全市場最新的遠期利率成交行情，做為使用者調整買賣決策的重要參考資訊	23

### 畫面說明：



## 1. 遠期利率 – 報價

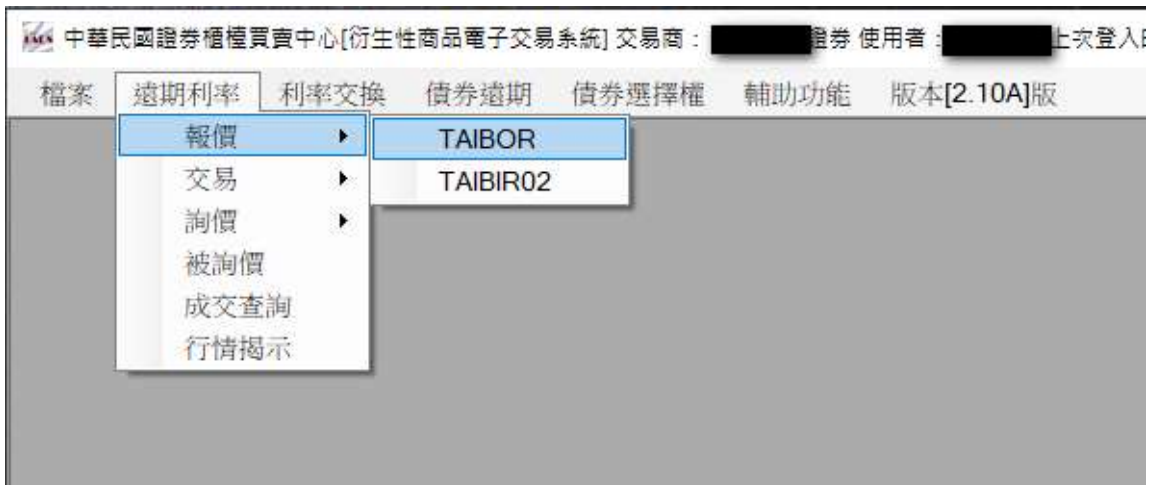
### 功能說明：

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。

### 操作說明：

1. 請參考本中心「店頭金融商品電腦交易系統作業辦法」。
2. 遠期利率系統之交易時間為 09：00~16：00。
3. 報價輸入應以利率為之，每一交易單位為新台幣十億元。
4. 報價數量必須為 1至 9個交易單位。
5. 證券商之買賣申報，應依契約形式、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。
6. 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。
7. 進行雙向報價時，買進利率不得高於賣出利率。
8. 使用者執行「登出」功能時，系統會自動將其系統上的報價單全數抽回。
9. 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：





Taibor :

契約形式	報價對象	隱名	量	買進	賣出	量	隱名
1x4	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1	2.000		1	<input checked="" type="checkbox"/>

Taibir02

契約形式	報價對象	隱名	量	買進	賣出	量	隱名
3x6	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			1	<input type="checkbox"/>
1x4	****-AA	<input type="checkbox"/>	1		2.000	1	<input type="checkbox"/>

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

報價相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明		頁次
新增報價		67
修改報價		68
刪除	刪除報價	69
	刪除全部報價	69
結束報價		70

## 2.遠期利率 – 交易

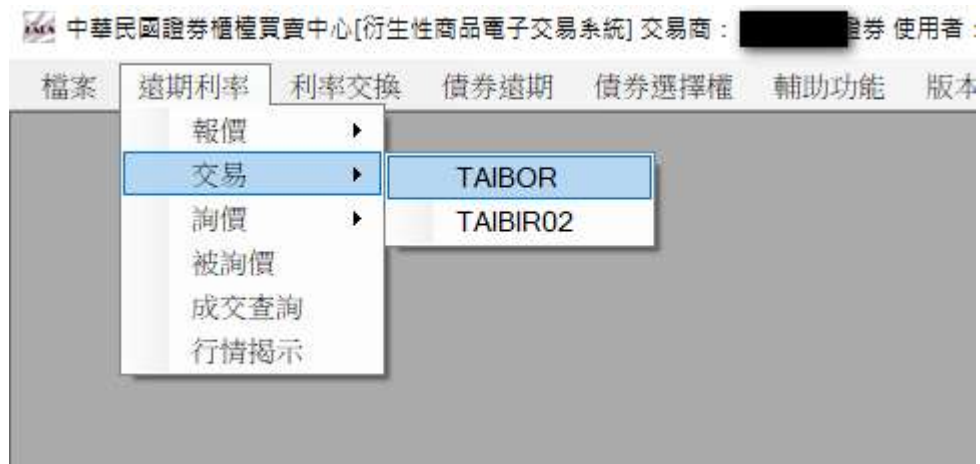
### 功能說明：

查詢遠期利率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：



Taibor

遠期利率交易(TAIBOR) [全部契約]						
TAIBOR						
契約形式	交易商	量	買價	賣價	量	交易商
1x4	████████	1	5.000			

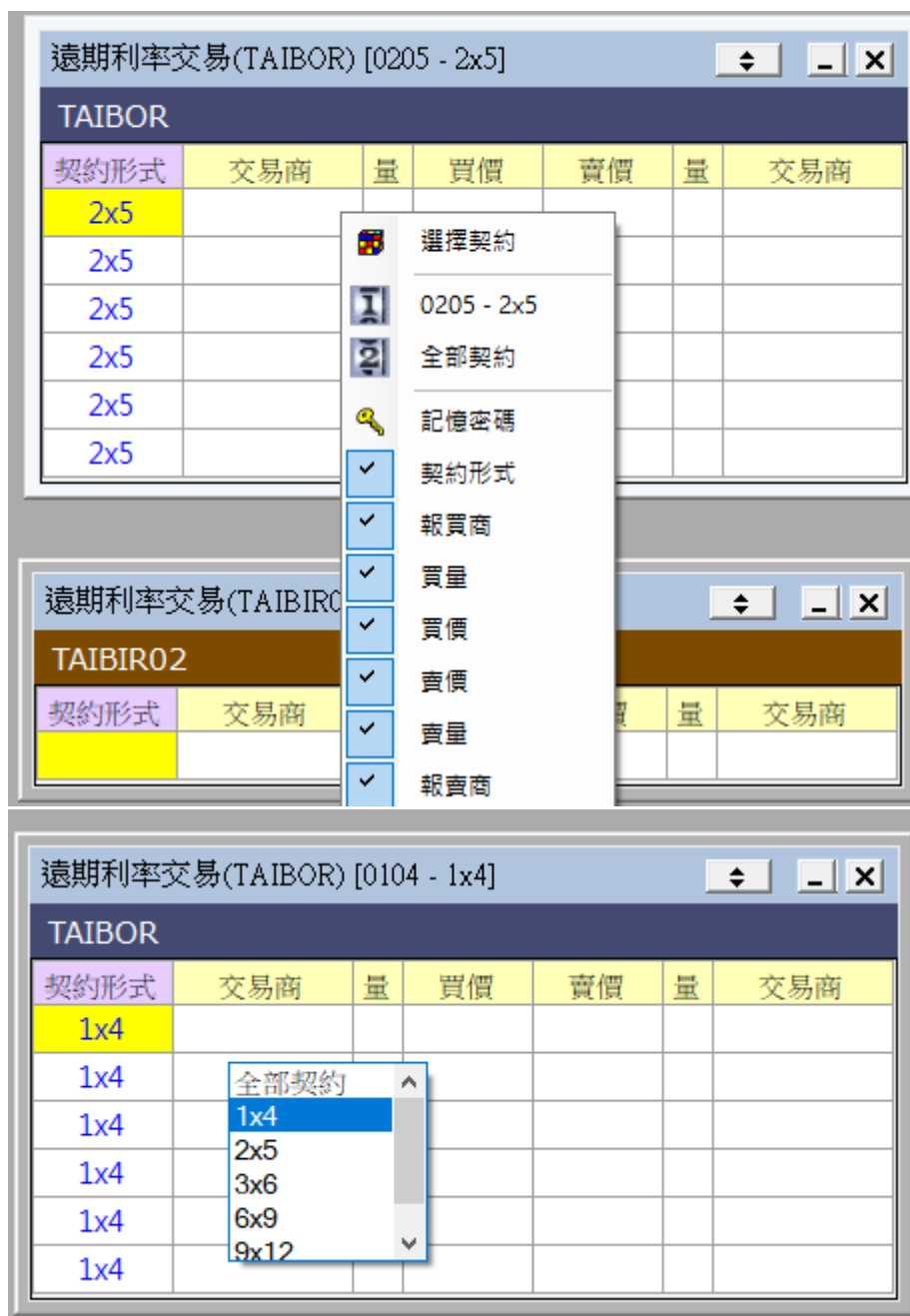
Taibir02

遠期利率交易(TAIBIR02) [全部契約]						
TAIBIR02						
契約形式	交易商	量	買價	賣價	量	交易商
3x6				2.000	1	████████

※ 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「遠期利率」，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「選擇契約」項下，點選欲查詢報價之契約形式。



交易相關操作功能請參考**債券選擇權**交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
點選報價	74
超過交易限額	75
暫停交易對象	76

### 3.遠期利率 – 詢價

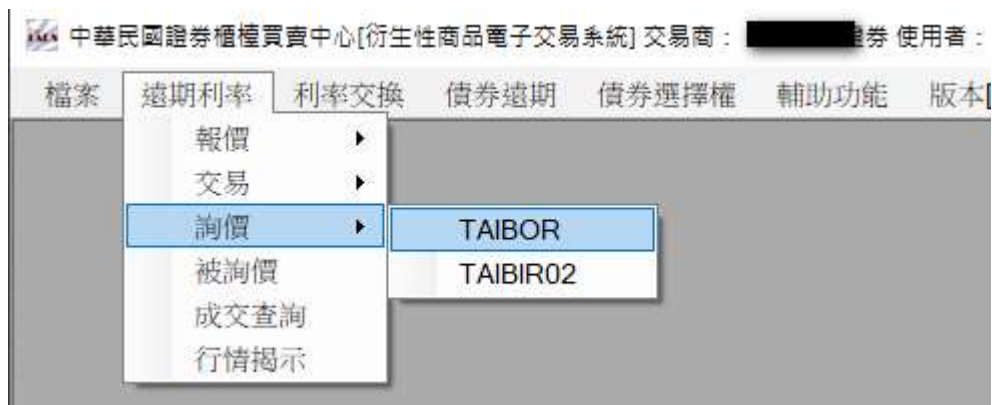
#### 功能說明：

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. 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。
3. 被詢價方於詢價方確認成交前，得取消其買賣報價。
4. 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。
5. 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：



#### Taibor



## Taibir02



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

詢價相關操作功能請參考**債券選擇權**交易的下列頁次說明：

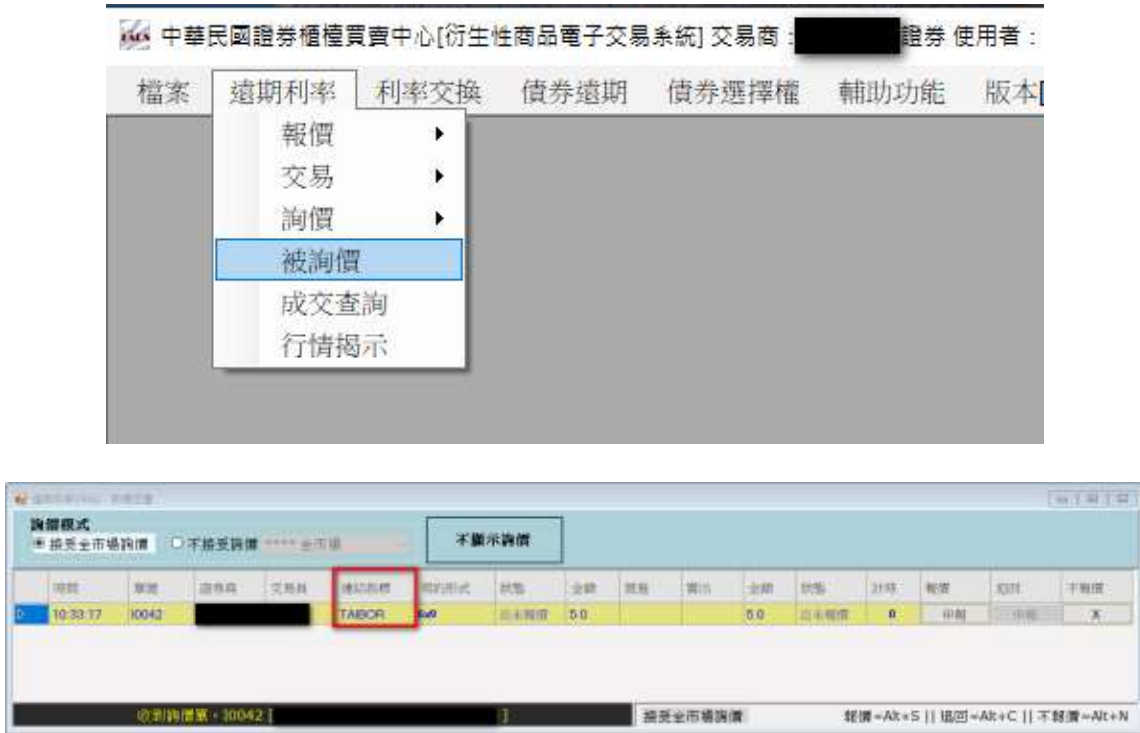
操作說明	頁次
詢 價	78
刪 除	79
交 易	80

## 4.遠期利率 – 被詢價

### 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。

### 畫面說明：



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

被詢價相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
報價申報	83
追回申報	84
不報價	85
不接受詢價	86
不顯示詢價	87

## 5.遠期利率 – 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。

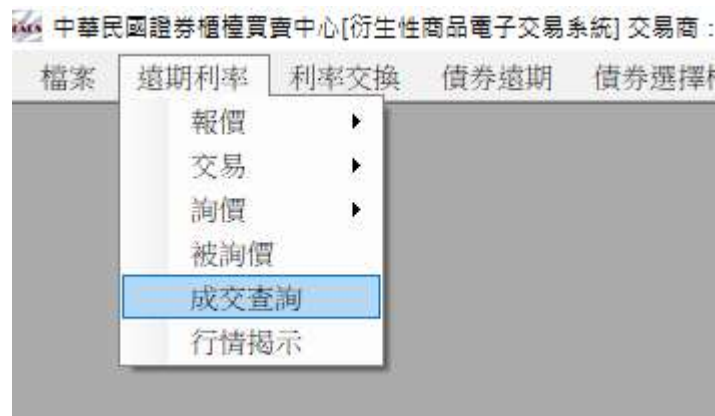
### 操作說明：

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

成交行情相關操作功能請參考**債券選擇權**交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
成交查詢	88

### 畫面說明：



## 6.遠期利率 – 行情揭示

### 功能說明：

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

### 操作說明：

點選「遠期利率」，於出現的選單中點選「行情揭示」後，出現「遠期利率 - 成交行情」畫面。

行情揭示相關操作功能請參考**債券選擇權**交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
行情揭示	90

### 畫面說明：

選	連結指標	契約形式	最近	變動(bp)	最高	最低	累積成交	前日收盤
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	1x4	5.000	280.00	60.000	5.000	20.0	2.200
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	1x4	-	-	-	-	-	0.120
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	2x5	-	-	-	-	-	100.000
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	2x5	-	-	-	-	-	0.896
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	3x6	-	-	-	-	-	2.000
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	3x6	-	-	-	-	-	2.200
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	6x9	2.000	100.00	2.000	2.000	10.0	1.000
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	6x9	-	-	-	-	-	1.179
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	9x12	-	-	-	-	-	1.001
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	9x12	-	-	-	-	-	0.123

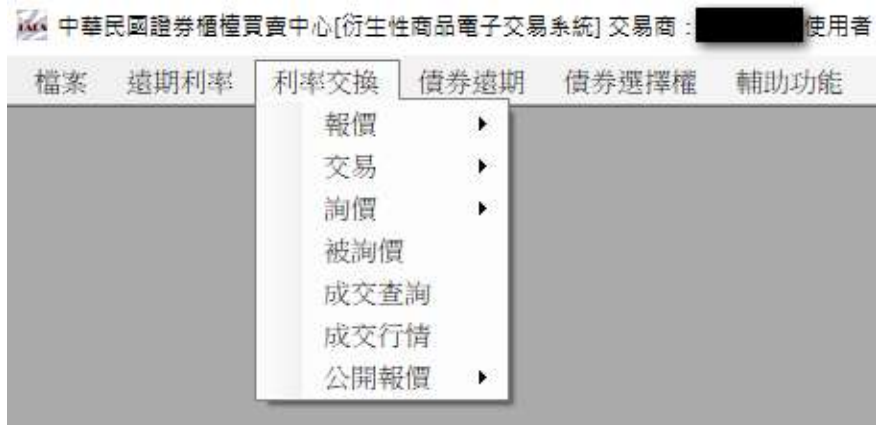


### 三、利率交換(IRS)

#### 功能說明：

選單名稱	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。	25
交易	使用者可查詢各年期之報價狀況及進行成交	27
詢價	使用者可針對特定對象、特定契約規格進行詢價作業	29
被詢價	被詢價時報價回覆、不接受詢價作業	31
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
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	33
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。	34

#### 畫面說明：



## 1. 利率交換 – 報價

### 功能說明：

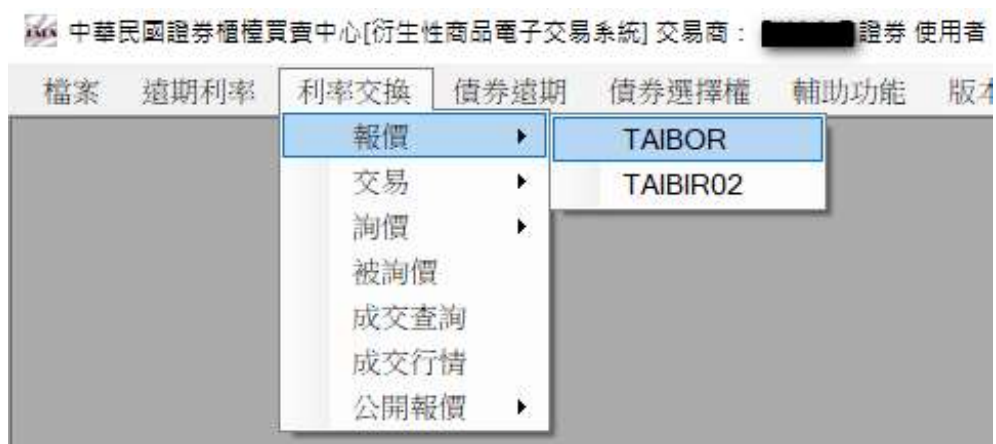
提供使用者可選擇浮動利率指標、契約年期、報價對象及名目本金，進行線上即時利率報價。

### 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 09：00~16：00。
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：



## Taibor

利率交換(TAIBOR)-報價輸入													
TAIBOR													
		3億						5億					
契約年期	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
01年	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	2.000		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input type="checkbox"/>
05年	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1		3.000	1	<input checked="" type="checkbox"/>

## Taibir02

利率交換(TAIBIR02)-報價輸入													
TAIBIR02													
		3億						5億					
契約年期	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
02年	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1	2.000		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1		3.000	1	<input checked="" type="checkbox"/>
		<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>

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

報價相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明		頁次
新增報價		67
修改報價		68
刪除	刪除報價	69
	刪除全部報價	69
結束報價		70

## 2.利率交換 – 交易

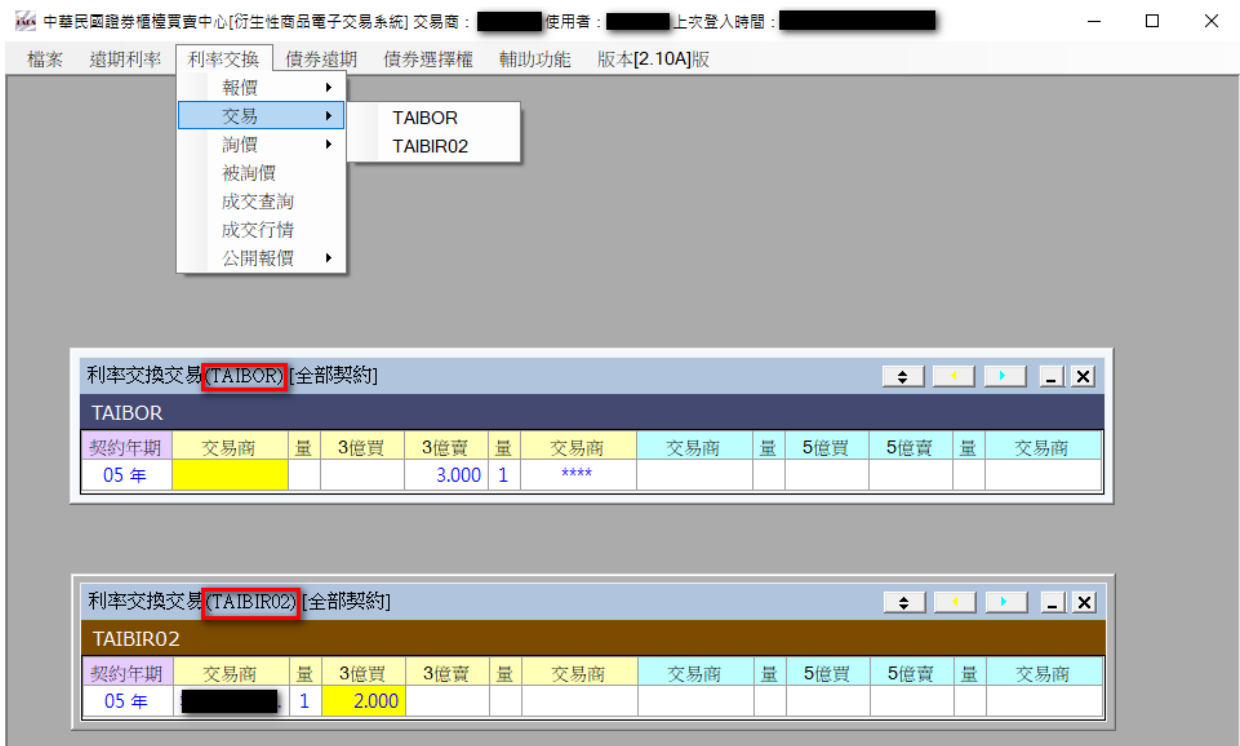
### 功能說明：

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。

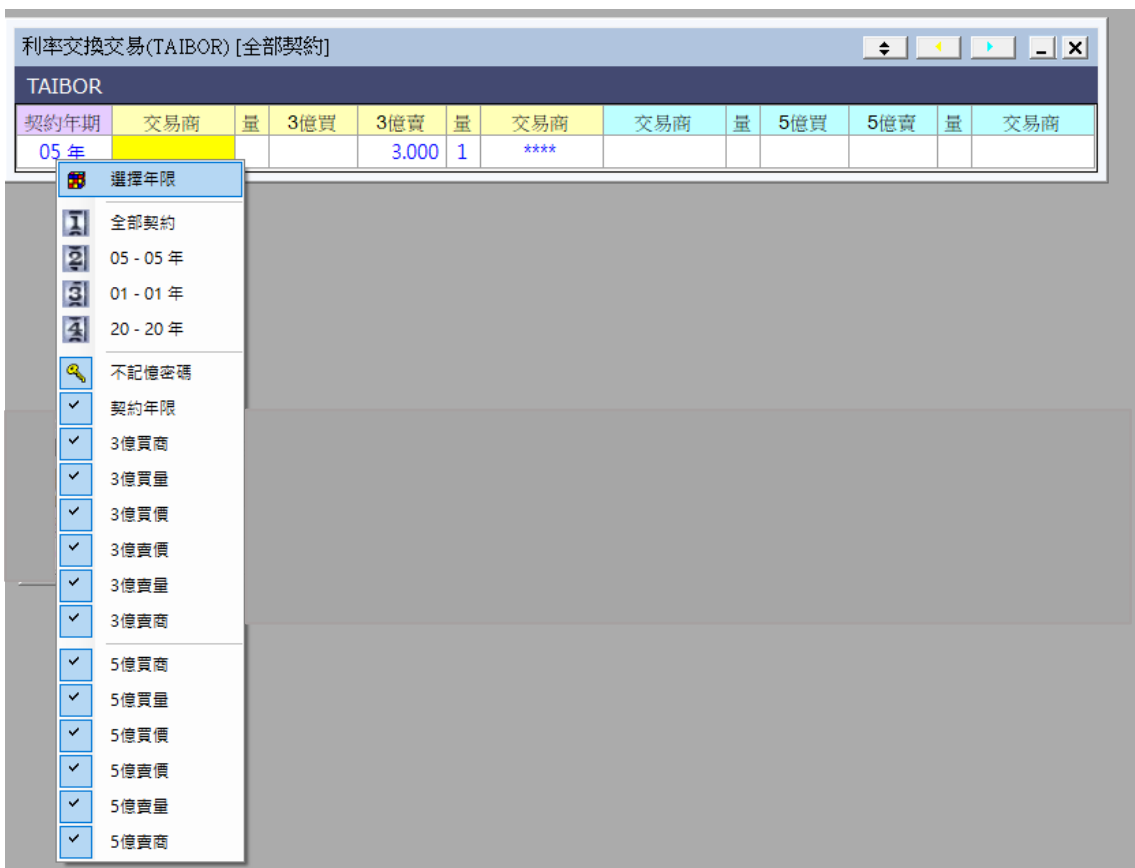
### 畫面說明：



※ 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**債券選擇權**交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
點選報價	74 錯誤! 尚未定義書籤。
超過交易限額	75
暫停交易對象	76

### 3. 利率交換 – 詢價

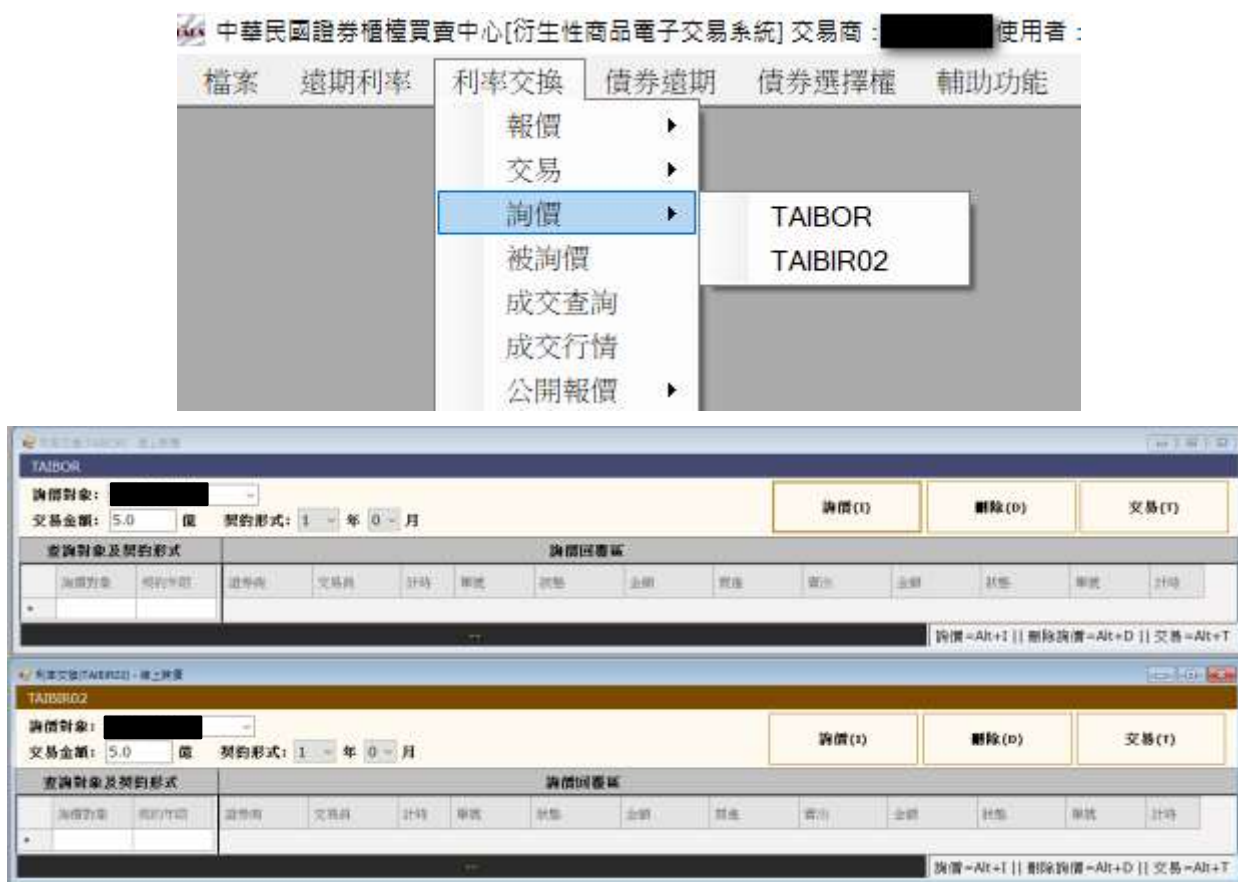
#### 功能說明：

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. 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。
3. 被詢價方於詢價方確認成交前，得取消其買賣報價。
4. 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。
5. 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。

詢價相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
詢 價	78
刪 除	79
交 易	80

## 4. 利率交換 – 被詢價

### 功能說明：

線上回覆詢價或不接受詢價設定，提供使用者回覆詢價之報價訊息、追回報價與不進行報價之選擇。

### 被詢價規則：

1. 得對單一對象或一群對象組合回覆詢價或不接受詢價。
2. 填入買賣金額，且申報為確定報價，詢價方在 60 秒內確認成交後，即行成交。
3. 被詢價方於詢價方確認成交前，得追回取消其買賣報價。

### 畫面說明：



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

被詢價相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
報價申報	83
追回申報	84
不報價	85
不接受詢價	86
不顯示詢價	87



## 5. 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。

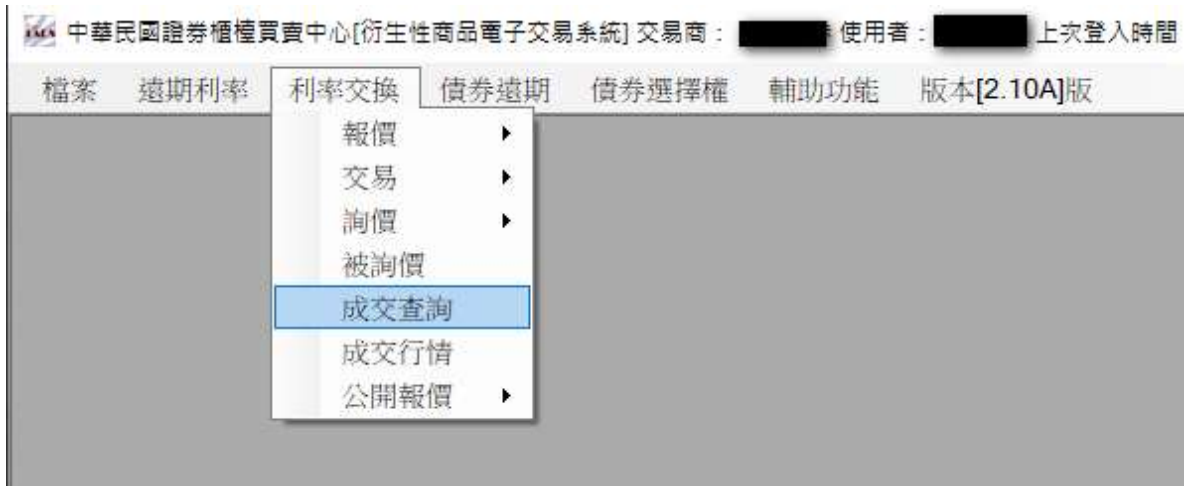
### 操作說明：

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。

成交查詢相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
成交查詢	88

### 畫面說明：



The screenshot shows the '利率交換(利率) - 成交狀況查詢' window. It displays a table of transaction details with the following columns: 序號, 成交對象, 交易員, 己方單號, 對方單號, 契約年數, 連結信標, 買賣別, 成交利率, 科目本金, 到期日, 成交時間, and 成交編號. The table contains three rows of data. A red box highlights the '連結信標' column for all three rows, which are 'TAIBOR'. The summary information at the top shows: 交易商: [redacted], 交易員: [redacted], 查詢, 列印, 複製, 累計買進: 8.0 億元, 累計成交: 13.0 億元, 成交日: 2020/07/20, 累計賣出: 5.0 億元, 買賣額: 3.0 億元, 交易員限額: 一年期: 9999 萬元.

序號	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	契約年數	連結信標	買賣別	成交利率	科目本金	到期日	成交時間	成交編號
1	[redacted]	[redacted]	T0004	Q0009	5年0月	TAIBOR	買進	3.000	3.0	2025/07/22	10:48:22.79	000001
2	[redacted]	[redacted]	Q0003	T0001	1年0月	TAIBOR	賣出	2.000	5.0	2021/07/22	11:13:59.34	000004
3	[redacted]	[redacted]	Q0004	T0002	5年0月	TAIBOR	買進	8.000	5.0	2025/07/22	11:14:03.07	000005

**備註：**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。

## 6. 利率交換 – 成交行情

### 功能說明：

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。

### 操作說明：

點選「利率交換」，於出現的選單中點選「成交行情」後，出現「利率交換 - 成交行情」畫面。

成交行情相關操作功能請參考債券選擇權交易的下列頁次說明：

操作說明	頁次
行情揭示	90

### 畫面說明：

The screenshot shows the '利率交換' (Interest Rate Swap) menu with '成交行情' (Transaction History) selected. Below is a table of transaction data for various interest rate swap contracts.

標	遠期名稱	契約年數	3個月				5個月							
			最近	變動(bp)	最高	最低	累積成交	前日收盤	最近	變動(bp)	最高	最低	累積成交	前日收盤
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	01	-	-	-	-	1,000	2,000	60.00	2,000	2,000	5.0	1,400	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	01	-	-	-	-	3,000	-	-	-	-	-	1,000	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	02	-	-	-	-	1,000	-	-	-	-	-	1,102	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	02	-	-	-	-	1,800	-	-	-	-	-	1,799	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	03	-	-	-	-	0,600	-	-	-	-	-	0,800	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	03	-	-	-	-	1,200	-	-	-	-	-	1,400	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	04	-	-	-	-	0,660	-	-	-	-	-	0,880	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	04	-	-	-	-	2,200	-	-	-	-	-	2,400	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	05	3,000	194.00	3,000	3,000	6.0	1,060	8,000	675.00	8,000	6,000	10.0	1,250
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	05	-	-	-	-	1,255	-	-	-	-	-	1,255	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	07	-	-	-	-	1,000	-	-	-	-	-	1,200	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	07	-	-	-	-	1,392	-	-	-	-	-	1,392	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	10	-	-	-	-	1,575	-	-	-	-	-	1,575	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	10	-	-	-	-	2,200	-	-	-	-	-	1,575	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	15	-	-	-	-	1,151	-	-	-	-	-	1,513	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	15	-	-	-	-	1,890	-	-	-	-	-	2,172	
<input type="checkbox"/>	TAIBOR	20	-	-	-	-	2,759	-	-	-	-	-	2,759	
<input type="checkbox"/>	TAIBIR02	20	-	-	-	-	1,033	-	-	-	-	-	1,055	

## 7.利率交換 – 公開報價

### 功能說明：

本視窗揭示全市場所有公開報價行情(三家以上)，位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。

### 操作說明：

點選「利率交換」，於出現的選單中點選「公開報價」後，出現「利率交換 - 公開報價」畫面。

### 畫面說明：

The screenshot shows the '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' interface. The '利率交換' menu is open, and '公開報價' is selected. Below are two windows showing public quotation data:

**TAIBOR (02年)**

3億			5億		
項目	買價	賣價	項目	買價	賣價
1	3.000	--	1	--	5.000
2	--	--	2	--	--
3	--	--	3	--	--
4	--	--	4	--	--
5	--	--	5	--	--
6	--	--	6	--	--

**TAIBIR02 (01年)**

3億			5億		
項目	買價	賣價	項目	買價	賣價
1	--	--	1	--	--
2	--	--	2	--	--
3	--	--	3	--	--
4	--	--	4	--	--
5	--	--	5	--	--
6	--	--	6	--	--

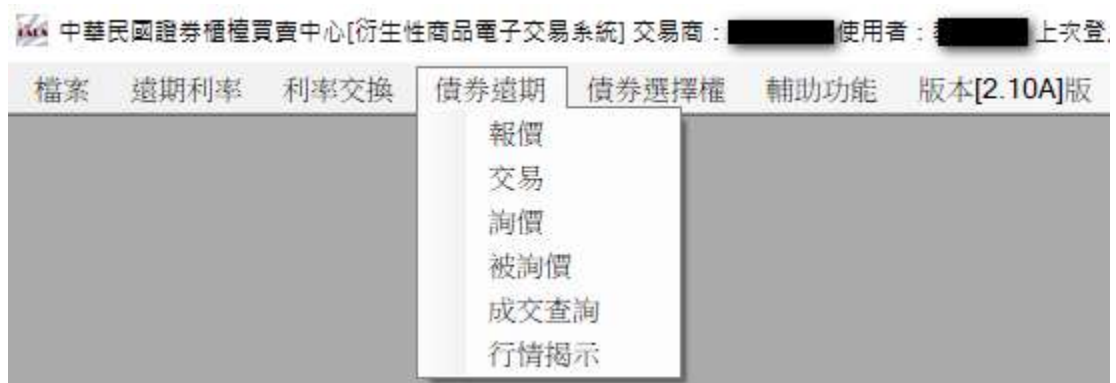
公開報價家數計算係採報價時報價群組家數扣除雙方暫停報價對象家數。

## 四、債券遠期(Bond Forward)

功能說明：

選單名稱	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	36
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	43
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	47
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	54
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	60
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	62

畫面說明：



## 1.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」。

### 操作說明：

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 09：00~13：30，且提前於 08：30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 個交易單位。
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

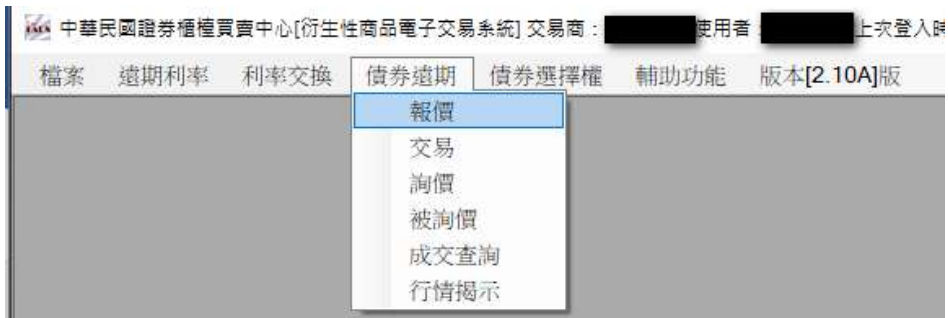
## 1.1 債券遠期 – 報價-新增報價

### 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，即可新增一列。
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



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
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	1.0000		<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1		100.0000	<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1
A06107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1

2. 選取「債券代號」及「報價對象」

債券代號	報價對象	1週		2週		3週		4週	
		隱名	量	買	賣	隱名	量	隱名	量
	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1
A00104	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1
A00107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1	<input checked="" type="checkbox"/>	1
A00108									
A00109									
A00201									
A01102									
A01104									

債券遠期 - 報價輸入

單位：5000萬元

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	
A99107		<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000		
A96107	0070-第一銀行	<input type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			
	0080-華南銀行											
	0090-彰化銀行											
	0110-上海銀行											
	0120-台北富邦銀											
	0130-國泰世華銀行											
	0170-兆豐銀行											

※「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「輔助功能\系統維護\券商組合設定」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

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
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A96107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input type="checkbox"/>

可選擇要顯示的天期欄位

債券遠期 - 報價輸入

單位：5000萬元

1 2 3 4

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
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	200.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A96107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input type="checkbox"/>

點選買賣輸入報價

## 1.2 債券遠期 – 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：







債券代號	報價對象	1週				2週			
		隱名	量	買	賣	隱名	量	買	賣
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1		
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	200.0000		<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000	
A96107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			<input checked="" type="checkbox"/>	1		

移至欲修改欄位，呈報價狀態(螢光黃色)

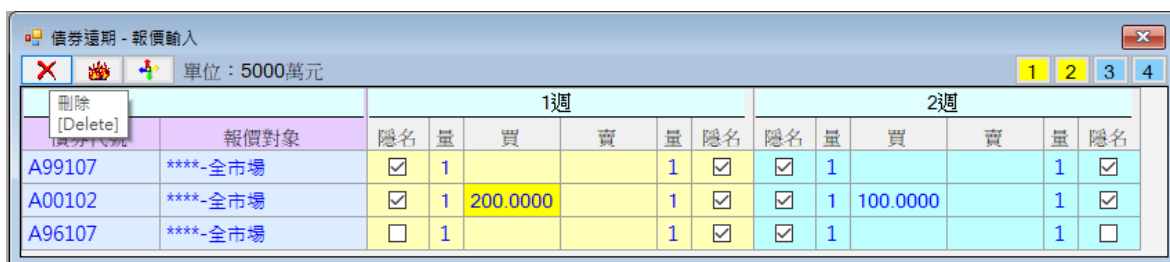


### 1.3 債券遠期 – 報價-刪除報價

#### 操作說明：

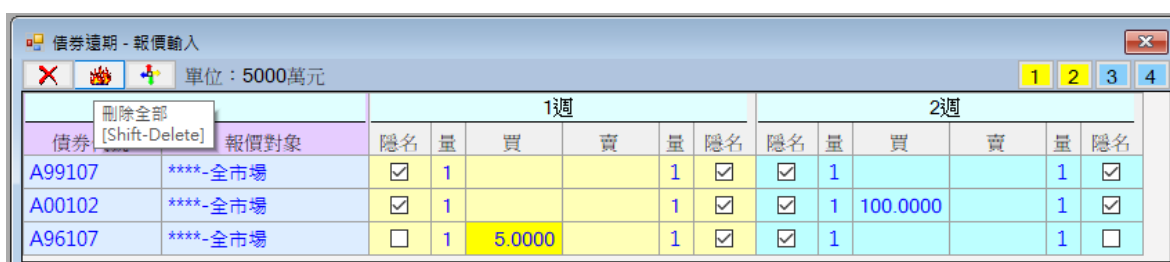
1. 刪除買價或賣價：將游標移至「報價輸入」視窗中欲刪除報價的欄位，或以滑鼠點選欲刪除之報價後，點選左上    角的鍵，該筆報價即被刪除；亦可以按下鍵盤上的「Delete」鍵，進行報價刪除。
2.    鍵，將所有報價單（數列多筆）一次刪除。當市場行情驟變，為免逐筆改價或抽單不及，可利用此功能。

#### 畫面說明：



債券遠期 - 報價輸入		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
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	200.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A96107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input type="checkbox"/>

刪除所選欄位報價




債券遠期 - 報價輸入		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
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A96107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1	5.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input type="checkbox"/>

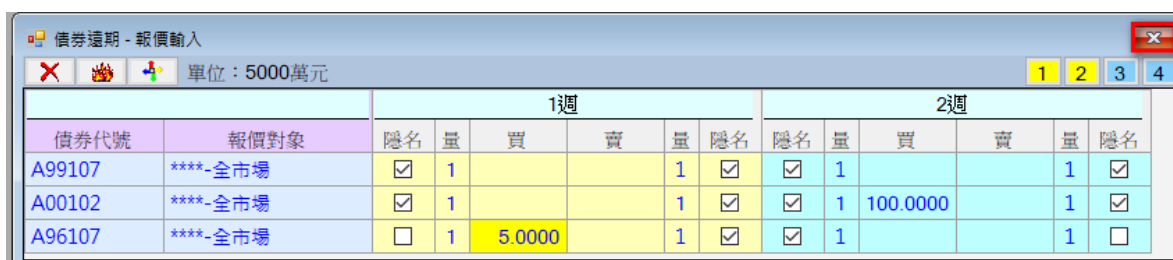
刪除所有欄位報價

## 1.4 債券遠期 – 報價-結束報價

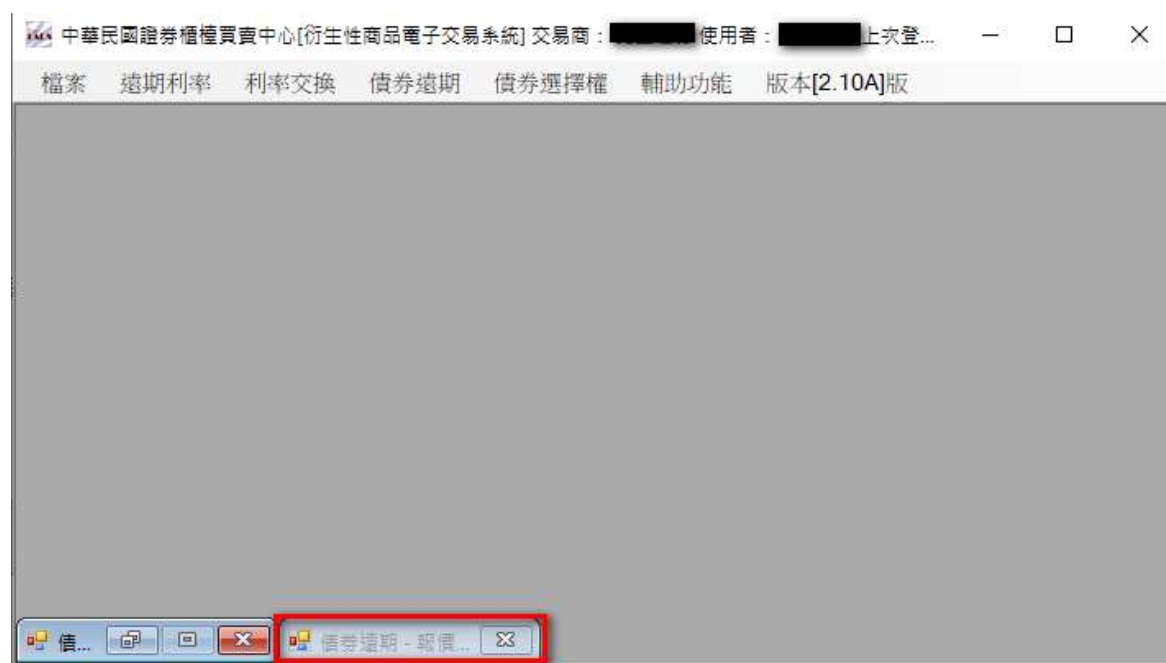
### 操作說明：

1. 按下右上角 ，若畫面仍有未成交報價單，其視窗僅會以最小化處理，以提醒使用者報價單仍存在。
2. 若畫面已無任何報價單，其視窗才可完全關閉。

### 畫面說明：



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	
A99107	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1				1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00102	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	100.0000			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A96107	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1	5.0000		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1				1	<input type="checkbox"/>



## 1.5 債券遠期 – 報價-報價未成功之情形

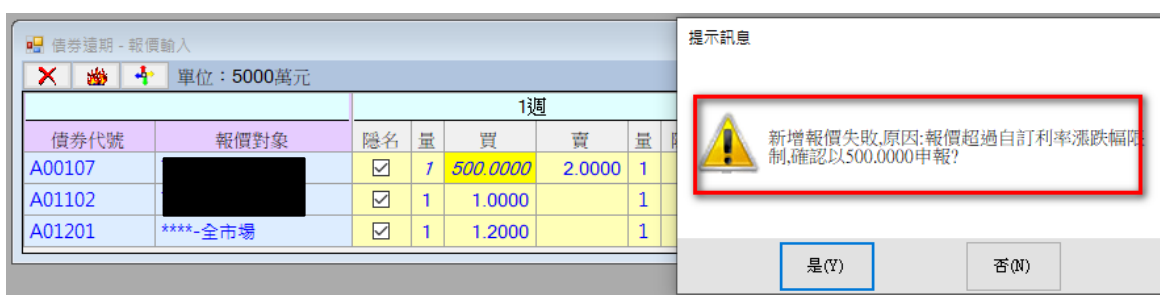
### 1. 買進利率低於賣出利率：須重新報價



按下 確定 或 Enter 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。



(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：



此時所報買價優於市場最佳賣價，提出警示，可選擇報出或修改。

## 2. 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。
4. 可同時開啟多個交易視窗，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. 單一債券最佳六筆報價

債券代號	交易商	量	1週買	1週賣	量	交易商
A00102	****	1	1.2000	1.3000	1	****
A00102	****	1	1.3000	1.2500	1	****
A00102	****	1	1.5000	1.2000	1	****
A00102	****	1	1.7000	1.1500	1	****
A00102	****	1	1.8000	1.1500	1	****
A00102	****	1	1.9000			

債券代號	交易商	量	1週買	1週賣	量	交易商
A00102	****	1	1.4000	1.7000	1	****
A00102	****	1	1.5000	1.6000	1	****
A00102	****	1	1.5000	1.5000	1	****
A00102	****	1	1.6000	1.5000	1	****
A00102	****	1	1.7000	1.4000	1	****
A00102	****	1	1.8000			

相同報價以相同顏色顯示，不足6筆者，保留空白列

#### 2. 全部債券最佳一筆報價

債券代號	交易商	量	1週買	1週賣	量	交易商
A00102	****	1	1.2000	1.3000	1	****
A00104	****	1	1.8000	1.5000	1	****

交易商「\*\*\*\*」即為報價方選擇隱名，故不顯示

## 2.1 債券遠期 – 交易-點選交易

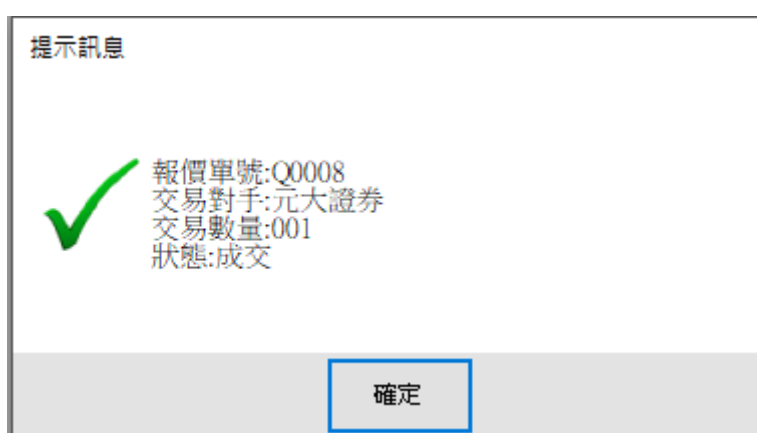
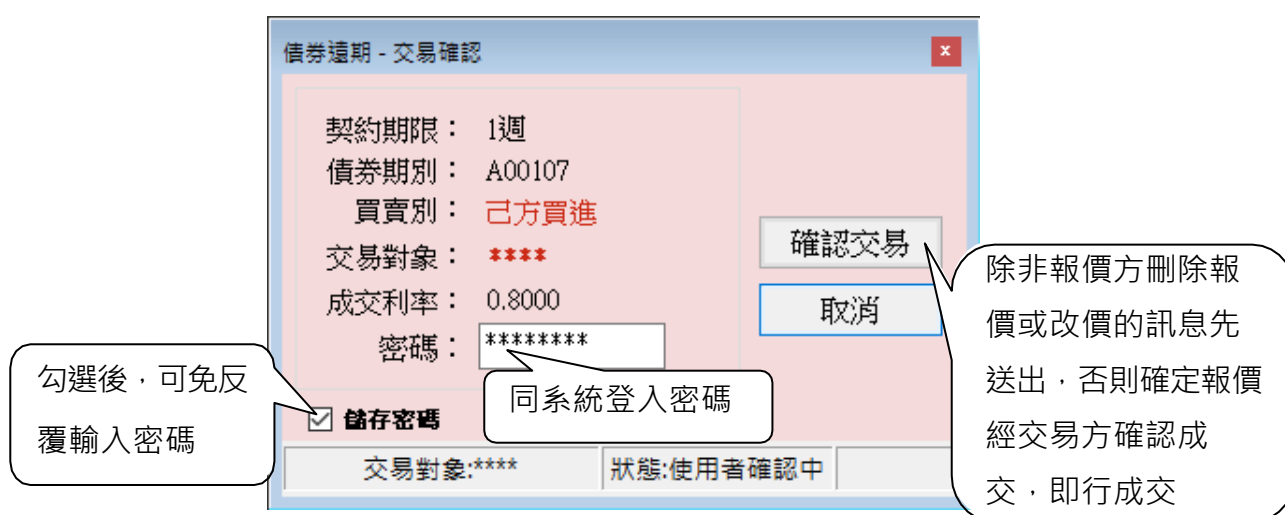
### 功能說明：

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 鍵 )，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。

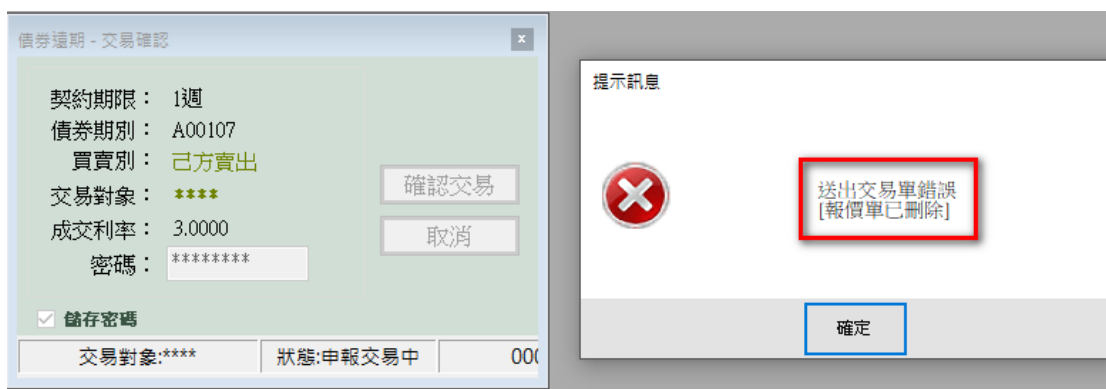
### 畫面說明：



## 2.2 債券遠期 – 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。



註解：

- (1)於交易出現「報價單已刪除」或「報價單已修改」訊息時，須以滑鼠左鍵單選點「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。

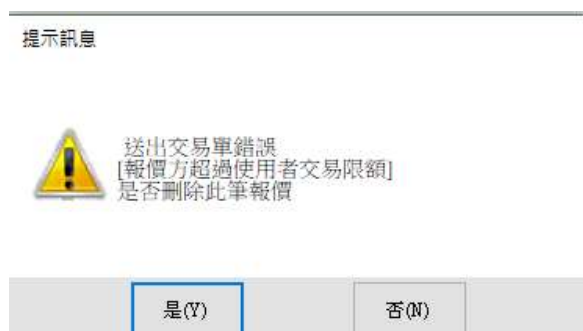
### 3. 超過交易限額

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。

#### 超出交易方交易限額



#### 超出報價方交易限額



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「暫停交易對象名單」之報價

The screenshot shows a trading confirmation dialog box titled "債券遠期 - 交易確認" (Bond Forward - Trade Confirmation). The dialog contains the following fields and buttons:

- 契約期限: 1週
- 債券期別: A00102
- 買賣別: 己方買進
- 交易對象: \*\*\*\*
- 成交利率: 5.0000
- 密碼: \*\*\*\*\*
- Buttons: 確認交易, 取消
- Checkbox:  儲存密碼
- Bottom bar: 交易對象:\*\*\*\*, 狀態:申報交易中, 000

To the right of the dialog is a warning message box with a yellow triangle icon. The message text is: "送出交易單錯誤 [交易方或報價方在對方暫停交易對象名單之列] 是否刪除此筆報價". Below the message are two buttons: "是(Y)" and "否(N)".

#### 5. 點選自家報價

The screenshot shows a trading confirmation dialog box titled "債券遠期 - 交易確認" (Bond Forward - Trade Confirmation). The dialog contains the following fields and buttons:

- 契約期限: 1週
- 債券期別: A00107
- 買賣別: 己方賣出
- 交易對象: \*\*\*\*
- 成交利率: 50.0000
- 密碼: \*\*\*\*\*
- Buttons: 確認交易, 取消
- Checkbox:  儲存密碼
- Bottom bar: 交易對象:\*\*\*\*, 狀態:申報交易中, 000

To the right of the dialog is an error message box with a red circle and 'X' icon. The message text is: "送出交易單錯誤 [不得與自家券商交易]". Below the message is a single button: "確定".

### 3. 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撤回。
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
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






### 3.2 債券遠期 – 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. 詢價方如欲撤回已新增成功之詢價單，得於詢價視窗點選 。
2. 詢價單撤回後，「查詢對象及債券代號」欄位下將無任何詢價資料。

#### 畫面說明：



### 3.3 債券遠期 – 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

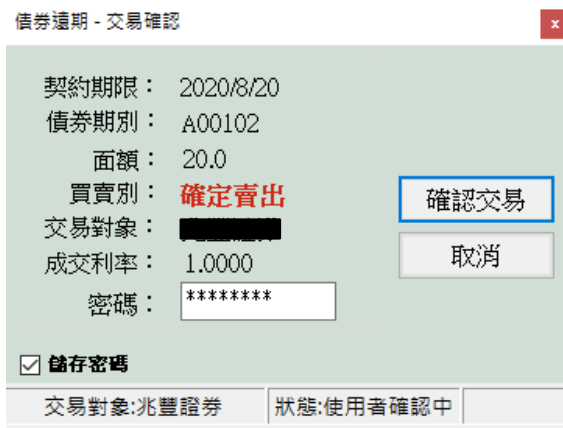


(1) 獲得詢價回覆(收到報價單)

(2) 回覆報價單計時

(3) 點選報價(買進/賣出)進行交易

2. 成交畫面

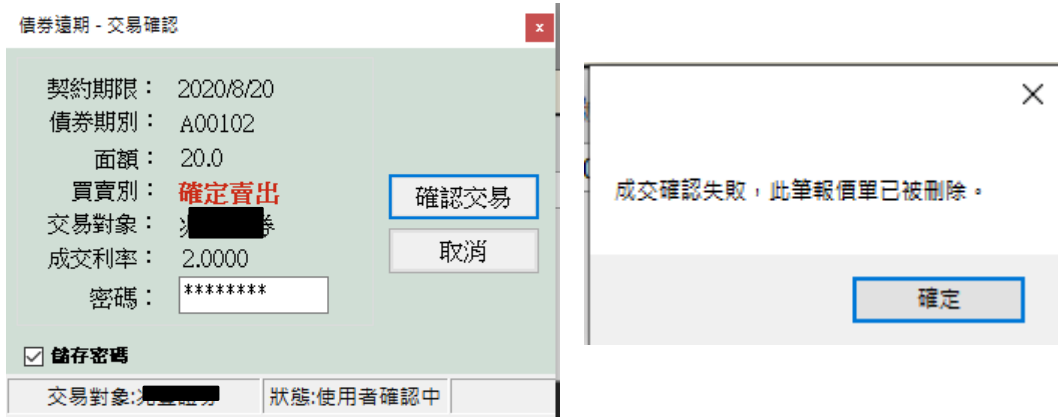


### 3. 報價逾時



※ 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。

※ 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」。



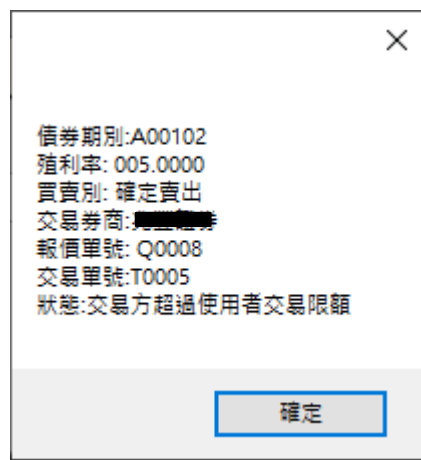
### 5. 不報價訊息

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。




※ 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. 超過報價方/交易方交易限額或密碼輸入錯誤等其他交易失敗原因



### 3.4 債券遠期 – 詢價-結束

#### 操作說明：

1. 按下右上角 ，若視窗內仍有有效詢價單，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?」則刪除詢價單並關閉視窗。
2. 若視窗內無任何有效詢價單，視窗立即關閉。

#### 畫面說明：



## 4. 債券遠期 – 被詢價

### 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。

申報

### 畫面說明：

#### 1. 「詢價回覆」視窗自動跳出



#### 2. 報價輸入



白底狀態即可輸入報價

#### 3. 報價完成



名詞說明：

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



## 4.1 債券遠期 – 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：追回報價

The screenshot shows the '債券遠期(FOR) - 報價回覆' window. The '詢價模式' (Quote Mode) is set to '接受全市場詢價' (Accept all market quotes). The '不顯示詢價' (Do not show quotes) button is visible. The table below shows a quote with the following details:

時間	單號	證券商	交易員	債券類別	契約到期日	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	撤回	不報價
13:58:14	I0001			A00102	2020/09/03	尚未報價	5.0			5.0	尚未報價	0	申報	申報	X

The status '尚未報價' is highlighted with a red box. The status bar at the bottom shows '已撤回報價：Q0001' (Quote withdrawn: Q0001).

#### 2. 已成交：無法追回報價

The screenshot shows the '債券遠期(FOR) - 報價回覆' window. The '詢價模式' (Quote Mode) is set to '接受全市場詢價' (Accept all market quotes). The '不顯示詢價' (Do not show quotes) button is visible. The table below shows a quote with the following details:

時間	單號	證券商	交易員	債券類別	契約到期日	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	撤回	不報價
13:58:14	I0001			A00102	2020/09/03	成交	5.0	3		5.0	尚未報價	0	申報	申報	X

The status '成交' is highlighted with a red box. The status bar at the bottom shows '報價單交易成功，報價單號：Q0002' (Quote order transaction successful, quote order number: Q0002).

#### 3. 報價逾時：無法追回報價

The screenshot shows the '債券遠期(FOR) - 報價回覆' window. The '詢價模式' (Quote Mode) is set to '接受全市場詢價' (Accept all market quotes). The '不顯示詢價' (Do not show quotes) button is visible. The table below shows a quote with the following details:

時間	單號	證券商	交易員	債券類別	契約到期日	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	撤回	不報價
14:14:35	K0002			A00102	2020/09/03	報價逾時	5.0		3	5.0	報價逾時	0	申報	申報	X

The status '報價逾時' is highlighted with a red box. The status bar at the bottom shows '收到新增報價：Q0003' (Received new quote: Q0003).

## 4.2 債券遠期 – 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 **X** 鍵。

### 畫面說明：



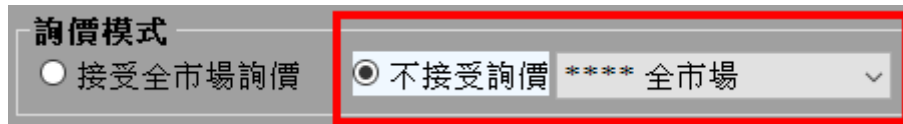
### 4.3 債券遠期 – 被詢價-不接受詢價

#### 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



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：



#### 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」。

#### 4.4 債券遠期 – 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「不顯示詢價」按鈕，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：

- (1) 被詢價方執行指令時，僅將送來的詢價單從畫面上移除。
- (2) 若想重新顯示詢價單，重新開啟被詢價視窗，詢價單會重新顯示。
- (3) 若關閉視窗再重新開啟，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。

## 5.債券遠期 – 成交查詢

### 功能說明：

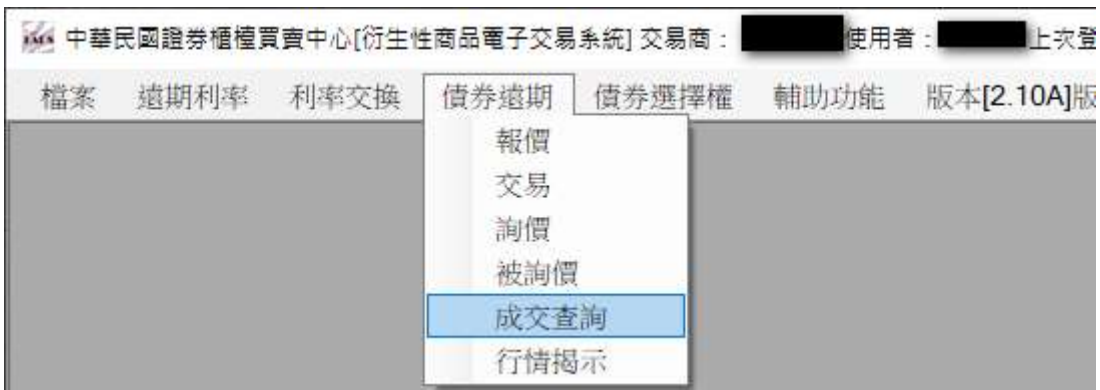
成交狀況查詢，可依使用者的權限，即時查詢當日成交資料。

### 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：

選擇債券遠期「成交查詢」功能。



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。

債券遠期(FOR) - 成交狀況查詢

交易商： 7000 兆豐證券 交易員： █████ 查詢 列印 複製

累計買進： 20.0 億元 累計成交： 90.0 億元 成交日： 2020/07/20  
累計賣出： 70.0 億元 買賣差： -50.0 億元 交易員限額： 100 億元

序號	成交對象	交易員	己方單號	對方單號	債券代號	契約期間	到期日	買賣別	成交利率	面額(億)	成交時間	成交編號
1			Q0003	T0001	A00102	0期	2020/08/20	賣出	2.0000	20.0	16:33:44.42	000010
2			Q0004	T0002	A00102	0期	2020/08/20	買進	1.0000	20.0	16:34:23.47	000011
3			Q0006	T0003	A00102	0期	2020/08/20	賣出	3.0000	20.0	16:38:20.37	000012
4			Q0007	T0004	A00102	0期	2020/08/20	賣出	5.0000	20.0	16:38:37.68	000013
5			Q0013	T0006	A00102	0期	2020/07/24	賣出	2.0000	5.0	16:45:27.22	000014
6			Q0015	T0001	A00102	0期	2020/07/31	賣出	2.0000	5.0	16:51:03.71	000015

交易明細查詢下載完成。

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

序號	成交對象	交易員	己方單號	對方單號
----	------	-----	------	------

※ 可點擊欄位標頭，進行下列不同欄位資料排序（資料由小變大或由大變小排序）：

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。



※ 滑鼠拖曳欄位標頭，則可直接進行欄位排序。

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）



## 6. 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。

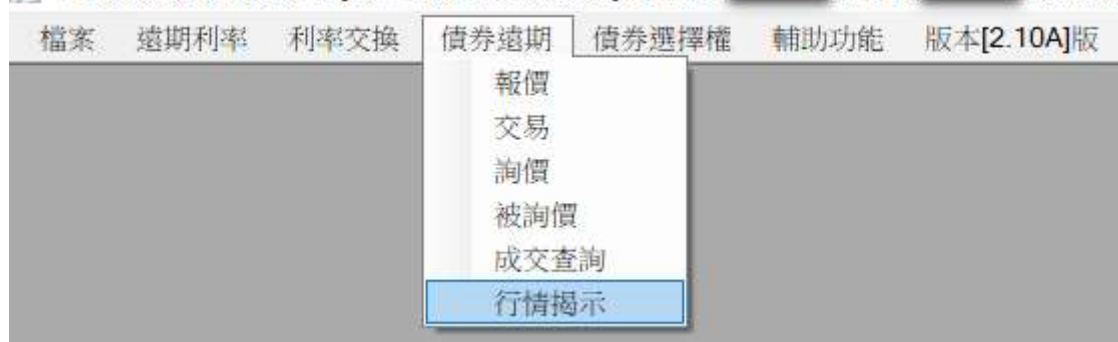
### 操作說明：

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 - 成交行情」畫面。

### 畫面說明：

1. 選擇債券遠期「行情揭示」功能。

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： ██████████ 使用者： ██████████ 上次登入時



2. 系統預設總覽全部債券市場成交行情

The screenshot displays a data table with columns for '債券代號' (Bond Code), '前日收盤' (Previous Day Close), '開盤' (Open), '最高' (High), '最低' (Low), '累計成交' (Cumulative Volume), '前日收盤' (Previous Day Close), '開盤' (Open), '最高' (High), '最低' (Low), '累計成交' (Cumulative Volume), '前日收盤' (Previous Day Close), '開盤' (Open), '最高' (High), '最低' (Low), '累計成交' (Cumulative Volume), '前日收盤' (Previous Day Close), '開盤' (Open), '最高' (High), '最低' (Low), '累計成交' (Cumulative Volume). The table lists various bond codes such as A00102, A00104, A00107, A00108, A00109, A00201, A01102, A01104, A01105, A01107, A01108, A01109, A01201, A01202, A02101, A02102, A02105, A02106, A02108, and A02109.

(1) 可輸入代號進行搜尋

(2) 按下可儲存為 excel 畫面並設定列印



### 3. 自選行情揭示

滑鼠雙擊“選”欄位，可選擇或取消自選債券

選	債券代號	1週					2週						
		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
<input checked="" type="checkbox"/>	A00102	100.0...	9900....	100.0...	20.00...	1.0	1.0000	3.0000	-200.00	3.0000	3.0000	0.5	5.0000
<input type="checkbox"/>	A00104	-	-	-	-	-	0.9999	-	-	-	-	-	0.1999
<input checked="" type="checkbox"/>	A00107	3.0000	-110.00	3.0000	1.6000	1.0	4.1000	-	-	-	-	-	1.2000
<input checked="" type="checkbox"/>	A00108	-	-	-	-	-	0.5000	-	-	-	-	-	0.1000
<input type="checkbox"/>	A00109	-	-	-	-	-	1.0000	-	-	-	-	-	1.0000
<input type="checkbox"/>	A00201	-	-	-	-	-	1.0000	-	-	-	-	-	1.0010
<input type="checkbox"/>	A01102	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01104	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	A01105	-	-	-	-	-	1.0000	-	-	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01107	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

行情顯示若點選「自選」，則僅揭示自選債券市場成交行情

選	債券代號	1週					2週						
		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
<input checked="" type="checkbox"/>	A00102	100.0...	9900....	100.0...	20.00...	1.0	1.0000	3.0000	-200.00	3.0000	3.0000	0.5	5.0000
<input checked="" type="checkbox"/>	A00107	3.0000	-110.00	3.0000	1.6000	1.0	4.1000	-	-	-	-	-	1.2000
<input checked="" type="checkbox"/>	A00108	-	-	-	-	-	0.5000	-	-	-	-	-	0.1000
<input checked="" type="checkbox"/>	A01105	-	-	-	-	-	1.0000	-	-	-	-	-	-

### 4. 交易明細

序號	時間	加權平均	變動(bp)	成交面額
1	09:05	-	-	-
2	09:10	-	-	-
3	09:15	-	-	-
4	09:20	-	-	-
5	09:25	-	-	-

以「明細」查詢每 5 分鐘市場成交行情明細

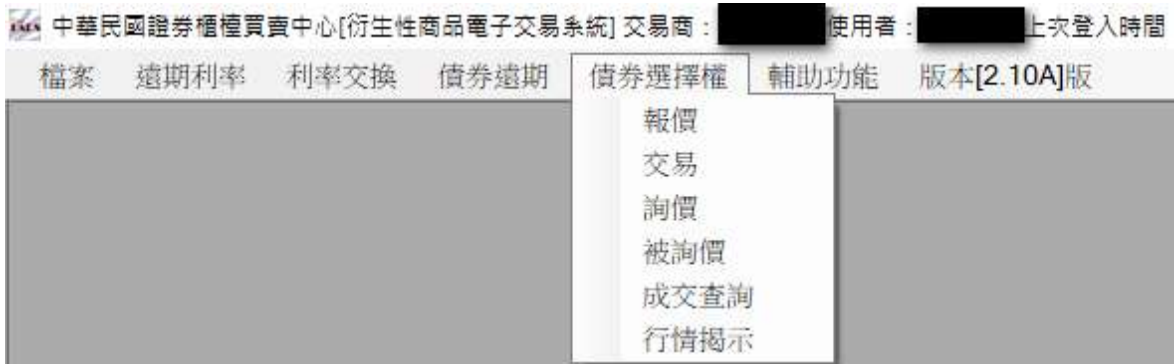


## 五、債券選擇權(Bond Option)

### 功能說明：

選單名稱	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	65
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	71
詢價	使用者可針對特定對象、特定契約規格進行詢價作業	77
被詢價	被詢價時報價回覆、不接受詢價作業	82
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	88
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	90

### 畫面說明：



## 1.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。

### 畫面說明：



債券代號	履約利率	契約年期	報價對象	CALL				PUT			
				買	賣	買	賣	買	賣	買	賣
A00109	1.17	01 禮	****-全市場	9	15.00	16.00	9	1	14.00	15.00	1
A07109	2.13	02 禮	****-全市場	1	14.00	15.00	1	1	13.00	14.00	1
A07111	2.10	03 禮	****-全市場	1	15.00	16.00	1	1	13.00	14.00	1
A08105	3.39	04 禮	****-全市場	1			1	1			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

**名詞說明：**

名詞	說明
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）
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。

## 1.1 債券選擇權 – 報價-新增報價

### 操作說明：

1. 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。
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，即可新增一欄。
3. 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）。
4. 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。
5. 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、履約利率、契約期限、報價對象，或用滑鼠點選下拉式選單


※ 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。

## 1.2 債券選擇權 – 報價-修改報價

### 操作說明：

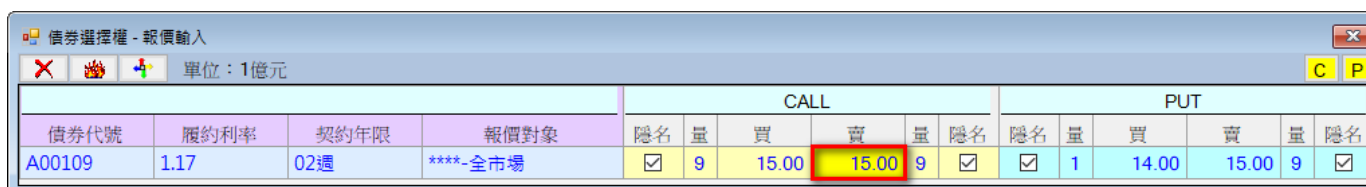
1. 以滑鼠左鍵單點欲修改的數量欄或報價欄 ( 或以「↑、↓、←、→」鍵盤鍵的方式移動 )，進入修改狀
2. 輸入新的數量或殖利率波動度。
3. 按 Enter 鍵，即完成報價或數量的修改。

### 畫面說明：



債券代號				CALL				PUT							
債券代號	履約利率	契約年限	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	02週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	9	15.00	16.00	9	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	14.00	15.00	9	<input checked="" type="checkbox"/>

移動游標或以滑鼠點選欲修改的欄位



債券代號				CALL				PUT							
債券代號	履約利率	契約年限	報價對象	隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	02週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	9	15.00	15.00	9	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	14.00	15.00	9	<input checked="" type="checkbox"/>

修改完成，按 Enter 鍵及完成改價或改量

### 1.3 債券選擇權 – 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



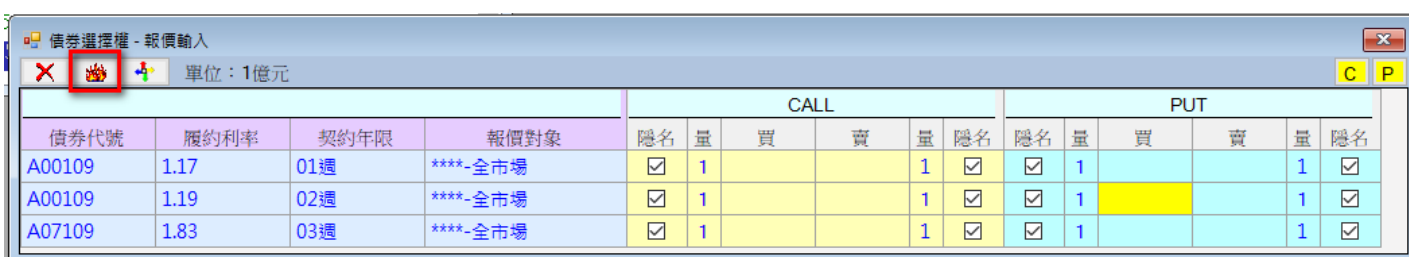
債券代號	履約利率	契約年限	報價對象	CALL					PUT						
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	01週	****-全市場	<input type="checkbox"/>	1	5.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	5.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00109	1.19	02週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	2.00	3.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	3.00	4.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>
A07109	1.83	03週	****-四含5270	<input checked="" type="checkbox"/>	1	53.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	47.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>






債券代號	履約利率	契約年限	報價對象	CALL					PUT						
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	01週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	5.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	5.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00109	1.19	02週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	2.00	3.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1		4.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>
A07109	1.83	03週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	53.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	47.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>

按下    或 Delete，即可刪除該筆報價

##### 2. 刪除全部報價資料



債券代號	履約利率	契約年限	報價對象	CALL					PUT						
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	01週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A00109	1.19	02週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A07109	1.83	03週	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>

※ 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   ，將所有報價單(數列多筆)一次刪除。

## 1.4 債券選擇權 – 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  之後，其視窗僅會以最小化處理。



債券代號	票的利率	票的年限	報價對象	CALL						PUT					
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	03禮	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	8	1.00	3.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	5	5.00	6.00	4	<input checked="" type="checkbox"/>
A07111	1.72	04禮	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1	2.00	3.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	1.00	2.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>
A08102	0.97	04禮		<input checked="" type="checkbox"/>	1	4.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	5.00		1	<input checked="" type="checkbox"/>
A08105	3.25	01禮		<input checked="" type="checkbox"/>	1	2.00	3.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1	3.00	5.00	1	<input checked="" type="checkbox"/>



2. 當報價輸入視窗中無任何報價資料，按  之後，其視窗才可完全關閉。



債券代號	票的利率	票的年限	報價對象	CALL						PUT					
				隱名	量	買	賣	量	隱名	隱名	量	買	賣	量	隱名
A00109	1.17	03禮	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A07111	1.72	04禮	****-全市場	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A08102	0.97	04禮		<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>
A08105	3.25	01禮		<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	1			1	<input checked="" type="checkbox"/>

## 2. 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. 可同時開啟多個交易視窗，滿足業者單一債券選擇權契約一個交易視窗揭示之需求。



## 畫面說明：

### 1. 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：		02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
A00109	1.17	****	1	255.00	250.00	1	****	****	1	12.00	12.50	1	****
A07111	2.08	****	1	15.00	16.00	1	****	****	1	1.00	2.00	1	****
A08101	1.55	****	1	20.00	21.00	1	****	****	1	12.00	16.00	1	****
A08101	1.27	****	1	14.00	15.00	1	****	****	1	13.00	15.00	1	****

各顯示最佳一筆報價

### 2. 單一債券

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：		03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
A00109	1.17	****	5	5.00	6.00	1	****	****	1	1.00	3.00	1	****
A07111	1.72	****	5	3.00				****	1	1.00	2.00	1	****

只顯示最佳一筆報價

### 3. 單一債券單一履約利率

債券選擇權交易 [A00109 - 100央債甲9]													
債券代號：		A00109	履約利率：		1.17		契約期限：		01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
A00109	1.17	****	1	5.00	1.00	1	****	****	1	6.00	1.00	1	****
A00109	1.17	****	1	3.00	2.00	1	****	****	1	2.50	1.50	1	****
A00109	1.17	****	1	2.50	2.50	1	****	****	1	2.00	2.00	1	****
A00109	1.17	****	1	2.00	3.00	1	****	****	1	1.50	2.50	1	****
A00109	1.17	****	1	1.00	5.00	1	****	****	1	1.00	6.00	1	****
A00109	1.17												

顯示最佳六筆

## 排序：依履約利率排序

### 1. 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：		01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
A00109	1.17	****	1	5.00	1.00	1	****	****	1	6.00	1.00	1	****
A00109	1.19	****	1	5.00	3.50	1	****	****	1	3.00	0.50	1	****
A07111	1.70	****	1	3.00	6.00	1	****						
A08101	1.15	****	1	3.00									
A08105	3.33	****	1	3.00	5.00	1	****						
A08101	1.17	****	1	3.00	6.00	1	****						

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
A00109	1.17	****	1	5.00	1.00	1	****	****	1	6.00	1.00	1	****
A00109	1.19	****	1	5.00	3.50	1	****	****	1	3.00	0.50	1	****
A07111	1.70	****	1	3.00	6.00	1	****						
A08101	1.15	****	1	3.00									
A08101	1.17	****	1	3.00	6.00	1	****						
A08105	3.33	****	1	3.00	5.00	1	****						

按下「履約利率」即可排序

※關閉交易視窗後重新開啟，系統亦將自動排序。

### 名詞說明：

名詞	說明
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

## 2.1 債券選擇權 – 交易-點選報價

### 功能說明：

於交易視窗-報價欄雙擊合意之報價，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 鍵），即行成交。
3. 密碼可先行記憶，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： 01週  
債券期別： A00109  
選擇權形式： 賣權Call  
買賣別： 己方買進  
交易對象： \*\*\*\*  
成交利率： 2.00  
密碼：

儲存密碼

確認交易  
取消

交易對象:\*\*\*\* 狀態:使用者確認中

## 2.2 債券選擇權 – 交易-超過交易限額

交易限額區分為四類：

1. 己方交易員額度超過限制	<p>提示訊息</p>  <p>交易對象:XXXX 報價單號:Q0031 交易單號:T0011 交易方超過使用者交易限額</p> <p>確定</p>
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	
2. 己方交易商額度超過限制	<p>提示訊息</p>  <p>交易對象:XXXX 報價單號:Q0031 交易單號:T0016 交易方超過券商交易限額</p> <p>確定</p>
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	
3. 對方交易員額度超過限制	<p>提示訊息</p>  <p>送出交易單錯誤 [報價方超過使用者交易限額] 是否刪除此筆報價</p> <p>是(Y) 否(N)</p>
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。 <u>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。</u>	
4. 對方交易員額度限制超過	<p>提示訊息</p>  <p>送出交易單錯誤 [報價方超過券商交易限額] 是否刪除此筆報價</p> <p>是(Y) 否(N)</p>
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。 <u>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。</u>	

註解：

- (1)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」。
- (2)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」。

## 2.3 債券選擇權 – 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，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：



※ 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」。

### 3. 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。

#### 詢價說明：

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」。

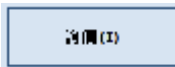
### 3.1 債券選擇權 – 詢價-詢價

#### 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 ，詢價單即送出，等候被詢價方的回覆。

#### 畫面說明：

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

#### 名詞說明：

名詞	說明
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
證 券 商	回覆詢價之被詢價交易商名稱

### 3.2 債券選擇權 – 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. 交易商如欲撤回現有的詢價單，得於詢價視窗點選 **刪除(D)** 指令。
2. 原先送出的詢價單撤回後，「查詢對象及契約形式」欄位下將無任何詢價資料。

#### 畫面說明：

查詢對象及契約形式			詢價回覆區											
詢價對象	債券代號	契約利率	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
	A00109	1.0												

查詢對象及契約形式			詢價回覆區											
詢價對象	債券代號	契約利率	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



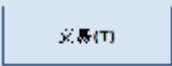
### 3.3 債券選擇權 – 詢價-交易

#### 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，或點選進行交易。
3. 「詢價交易確認」畫面出現後，請輸入密碼，並點選確認交易。
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。



### 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」，該筆報價逕予取消。



### 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。



※ 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。

## 4. 債券選擇權 – 被詢價

### 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。

### 畫面說明：

### 名詞說明：

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
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
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（契約名日本金）
Call/Put	詢價選擇權之形式，可區分為買權及賣權
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

## 4.1 債券選擇權 – 被詢價-報價申報

### 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），隨時抽回。

### 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	證券類別	債券標的	到期日期	Call/Put	報價方式	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	抽回	下報價
14:54:25	0001			AG0100	901.00	2020/09/28	Call	即時	已報價	5.0	5	5	5.0	已報價	15	申報	抽回	5

## 4.2 債券選擇權 – 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：

- 未成交：取消報價



The screenshot shows the 'Quote Mode' window with a table of quotes. The first quote is highlighted, and its status is 'Quote Cancelled'. The 'Quote' column contains 'Quote Cancelled', and the 'Status' column contains 'Quote Cancelled'. The 'Quote' column also contains 'Quote Cancelled'.

時間	單號	證券碼	交易員	債券類別	票面利率	契約到期日	Call/Put	報價方式	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	撤回	不報價
14:34:25	K0003			A00108	001.00	2020/08/28	Call	流動性	報價取消	5.0			5.0	報價取消	0	申報	撤回	X

被詢價方於詢價方成交前，先行追回報價，原報價單逕予取消

- 已成交：無法追回報價



The screenshot shows the 'Quote Mode' window with a table of quotes. The first quote is highlighted, and its status is 'Quote Executed'. The 'Quote' column contains 'Quote Executed', and the 'Status' column contains 'Quote Executed'. The 'Quote' column also contains 'Quote Executed'.

時間	單號	證券碼	交易員	債券類別	票面利率	契約到期日	Call/Put	報價方式	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	撤回	不報價
15:02:22	K0004			A00108	001.00	2020/08/28	Call	流動性	成交	5.0	2		5.0	成交	0	申報	撤回	X

如該筆報價已成交，則追回指令失敗

- 報價逾時：無法追回報價



The screenshot shows the 'Quote Mode' window with a table of quotes. The first quote is highlighted, and its status is 'Quote Expired'. The 'Quote' column contains 'Quote Expired', and the 'Status' column contains 'Quote Expired'. The 'Quote' column also contains 'Quote Expired'.

時間	單號	證券碼	交易員	債券類別	票面利率	契約到期日	Call/Put	報價方式	狀態	金額	買進	賣出	金額	狀態	計時	報價	撤回	不報價
15:03:50	K0005			A00108	001.00	2020/08/28	Call	流動性	報價逾時	5.0	5		5.0	報價取消	0	申報	撤回	X

被詢價方追回報價時，若此時逾 60 秒，則追回指令失敗

### 4.3 債券選擇權 – 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：





## 4.4 債券選擇權－被詢價-不接受詢價

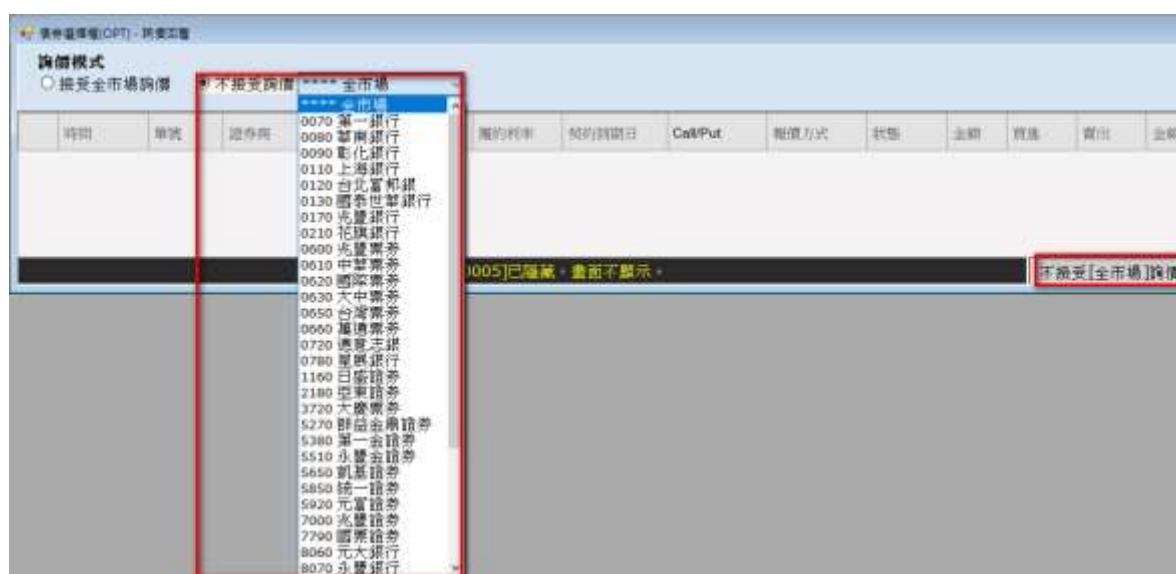
### 功能說明：

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  不接受詢價 \*\*\*\* 全市場
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：



被詢價方執行「不接受詢價」指令後，系統將會在下次的詢價中，依據使用者所設定的條件進行篩選。

### 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，重新送出新的詢價單。



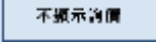
被詢價方如已開啟「不接受詢價」狀態，詢價方詢價視窗狀態會顯示「拒收」

## 4.5 債券選擇權－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，按下  按鈕，即可從詢價回覆視窗上移除該筆詢價單。

### 畫面說明：



被詢價方如按下「不顯示詢價」，則視窗內詢價資訊將會被清除

註解：

- (1)被詢價方按下「不顯示詢價」按鈕時，僅將畫面上詢價單清除，若關閉視窗再重新開啟，此詢價單仍然存在，且按下「不顯示詢價」按鈕時，並不會回應對方（詢價方）任何訊息。
- (2)若要重新顯示市場詢價單資料，則可重新開啟被詢價視窗。



## 5. 債券選擇權 – 成交查詢

### 功能說明：

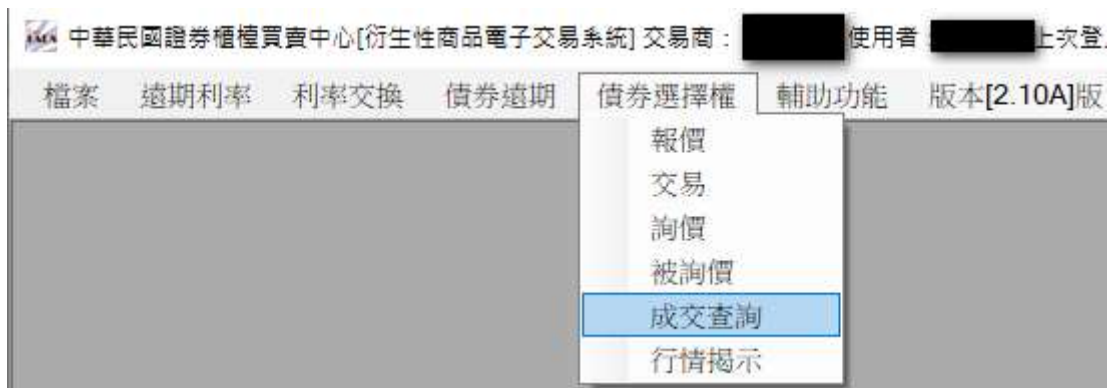
成交狀況查詢，可依使用者的權限，即時查詢當日成交資料。

### 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。

The screenshot displays the 'Transaction Query' results table. The table has columns for '序號', '己占率號', '對方率號', '債券代號', '匯約利率', '標的利率', '交易員', '成交對象', '到期日', '買賣權', '買賣型', '權利金(元)', '高點價', '前日開盤', '成交時間', '成交筆數', and 'Delta'. The table contains four rows of transaction data. Summary statistics at the top include: '累計買進: 4.0 億元', '累計賣出: 6.0 億元', '累計成交: 10.0 億元', '買賣差: -2.0 億元', 'Delta加總: 1.1 億元', and '成交日期: 2020/07/23'. The 'Delta' column shows values of 3.00, -1.60, 1.05, and -1.57 for the four rows respectively.

序號	己占率號	對方率號	債券代號	匯約利率	標的利率	交易員	成交對象	到期日	買賣權	買賣型	權利金(元)	高點價	前日開盤	成交時間	成交筆數	Delta
1	Q0006	T0005	A09105	2.50	3.4500	test002	[redacted]	2020/07/27	Put	價升	42,118,100	5.0000	3.0	09:47:38.92	000016	3.00
2	Q0005	T0004	A09105	2.50	3.4500	test002	[redacted]	2020/07/27	Put	價漲	22,465,520	2.0000	1.8	09:47:34.60	000015	-1.60
3	Q0003	T0002	A07111	1.50	1.9000	test002	[redacted]	2020/07/27	Call	價漲	46,240	10.0000	2.4	09:46:49.22	000013	1.05
4	Q0004	T0003	A07111	1.50	1.9000	test002	[redacted]	2020/07/27	Call	價升	96,800	15.0000	3.0	09:46:52.24	000014	-1.57

「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。

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

序號	成交對象	交易員	己方單號	對方單號
----	------	-----	------	------

※ 可點擊欄位標頭，進行下列不同欄位資料排序（資料由小變大或由大變小排序）：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。

序號	成交對象	己方單號	對方單號	交易員	債券代號
----	------	------	------	-----	------

序號	成交對象	己方單號	交易員	債券代號	對方單號
----	------	------	-----	------	------

滑鼠拖曳欄位標頭，則可直接進行欄位排序。

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）

序號	己方單號	對方單號	債券代號	契約利率	到期日	成交對象	買賣別	成交利率	面額	成交時間	成交編號	Delta		
1	00007	T0002	407109	1.80	1/9000	20200819	Cat	買	0	2020/07/23	000018	0.00		
2	00008	T0011	407109	1.80	1/9000	20200908	Cat	買	0	2020/07/23	000017	0.00		
3	00009	T0002	407111	1.80	1/9000	20200727	Cat	買	-8.240	10.0000	2.4	10-46-49.22	000013	1.05
4	00004	T0003	407111	1.80	1/9000	20200727	Cat	買	96.900	10.0000	3.0	10-46-52.24	000014	-1.37
5	00005	T0004	A00105	2.50	3/4000	20200727	Put	買	22,463,500	3.0000	1.6	10-47-34.60	000015	-1.60
6	00006	T0005	A00105	2.50	3/4000	20200727	Put	買	42,116,100	5.0000	3.0	10-47-36.02	000016	3.00

## 6. 債券選擇權 – 行情揭示

### 功能說明：

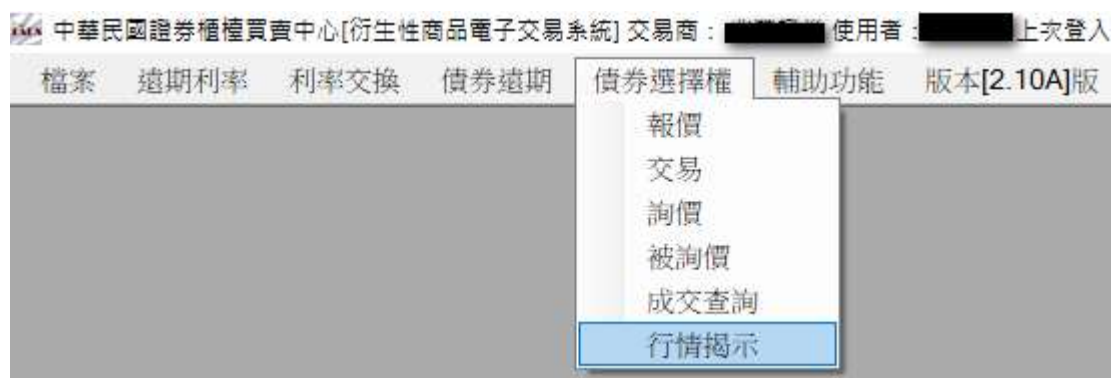
成交行情揭示，即時揭露系統上全市場成交行情。

### 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 - 成交行情」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

The screenshot shows the 'Market Data' window with the following data:

選	債券代號	契約期間	票面利率	CALL					PUT				
				最高	變動(%)	最高	最低	累積成交	最高	變動(%)	最高	最低	累積成交
<input type="checkbox"/>	A00109	02	001.17	2.00	2.00	2.00	1.00	2.0	53.00	53.00	53.00	53.00	1.0
<input type="checkbox"/>	A00109	02	001.19	2.00	2.00	2.00	2.00	1.0	4.00	4.00	4.00	4.00	1.0

- (1) 按下可儲存為 csv 檔並設定列印
- (2) 可選擇顯示 CALL 欄位與 PUT 欄位
- (3) 可輸入債券代號進行搜尋

### 3. 自選行情揭示

債券選擇權(OPT)-成交行情

存檔列印 成交單位: 億元

瀏覽 Call明細 Put明細

行情顯示  總覽  自選 債券代號 搜尋 價位顯示  CALL  PUT

選	債券代號	契約期限	權的利率	CALL					PUT				
				最近	變動(%)	最高	最低	累積成交	最近	變動(%)	最高	最低	累積成交
<input checked="" type="checkbox"/>	A00109	02	001.17	2.00	2.00	2.00	1.00	2.0	53.00	53.00	53.00	53.00	1.0
<input type="checkbox"/>	A00109	02	001.19	2.00	2.00	2.00	2.00	1.0	4.00	4.00	4.00	4.00	1.0

債券選擇權(OPT)-成交行情

存檔列印 成交單位: 億元

瀏覽 Call明細 Put明細

行情顯示  總覽  自選 債券代號 搜尋 價位顯示  CALL  PUT

選	債券代號	契約期限	權的利率	CALL					PUT				
				最近	變動(%)	最高	最低	累積成交	最近	變動(%)	最高	最低	累積成交
<input checked="" type="checkbox"/>	A00109	02	001.17	2.00	2.00	2.00	1.00	2.0	53.00	53.00	53.00	53.00	1.0

按下「自選」揭示所點選之債券行情

### 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(OPT)-成交行情

存檔列印 成交單位: 億元

瀏覽 Call明細 Put明細

[A00109] 契約期限: 02 履約利率: 001.17 Put

今日成交資訊 前日成交資訊

最高: - 成交數量: - 億元 開盤: -

最低: - 平均: - 收盤: -

最近成交: - 累計成交: 1.0

序號	時間	加權平均	變動(%)	成交金額
1	09:05	-	-	-
2	09:10	-	-	-
3	09:15	-	-	-
4	09:20	-	-	-
5	09:25	-	-	-
6	09:30	-	-	-
7	09:35	-	-	-
8	09:40	-	-	-
9	09:45	-	-	-
10	09:50	-	-	-
11	09:55	-	-	-
12	10:00	-	-	-
13	10:05	-	-	-
14	10:10	-	-	-

## 六、輔助功能

### 功能說明：

選單名稱	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	93
公告訊息	提供交易商查詢系統公告之訊息	96
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	97
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	110
視窗	提供交易商設定視窗顯示方式及視窗組合	115 錯誤! 尚未定義書籤。
債券行情揭示	提供交易商查詢債券最新成交行情	121 錯誤! 尚未定義書籤。

### 畫面說明：



## 1. 輔助功能 – 報表製作

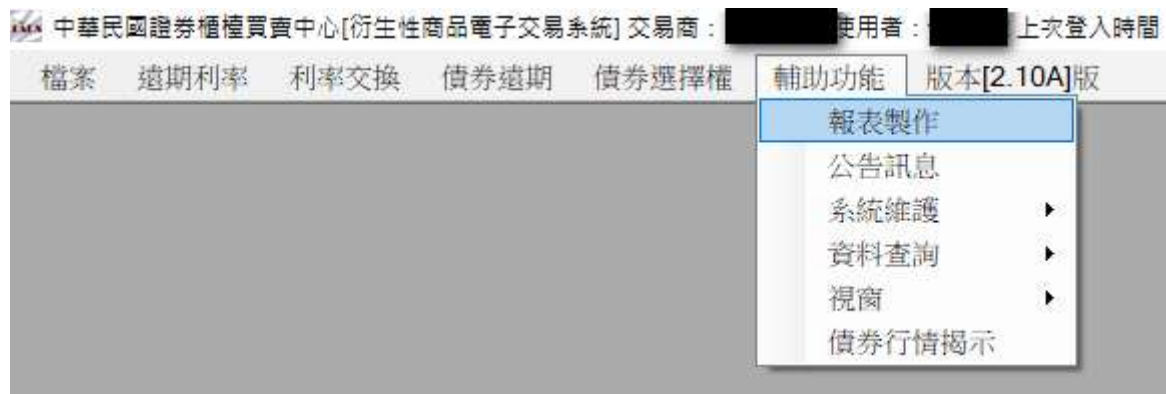
### 功能說明：

提供交易商後台人員製作當日成交清單。

### 操作說明：

點選「輔助功能」，於出現的選單中點選「報表製作」後，出現「報表查詢」畫面。

本功能提供會產製報表檔案格式 xlsx。



### 畫面說明：

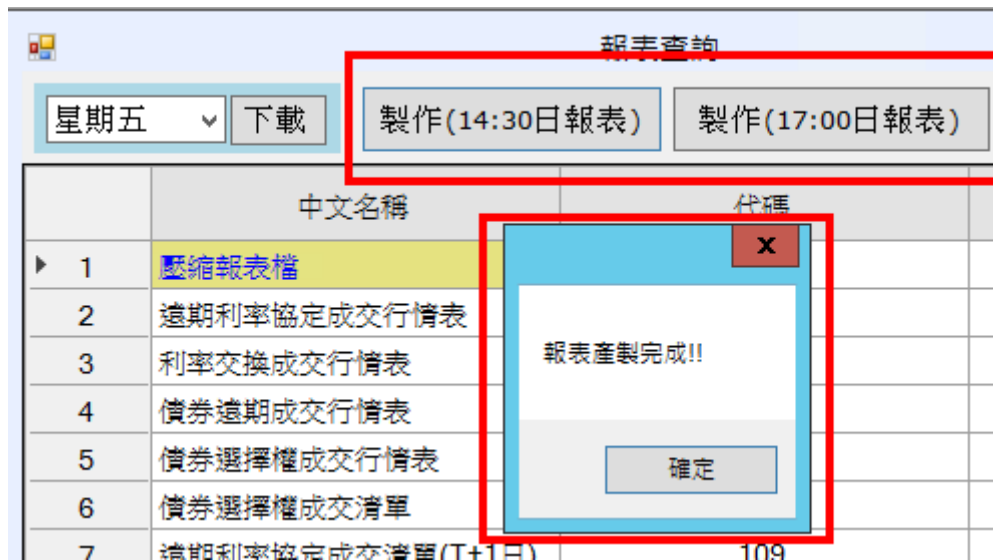
1. 選擇您所要製作的報表日期。本功能開啟預設為今日，並保留一週報表資料。



2. 選擇完日期後，會自動下載報表原始資料，如下圖下載狀態由[未完成]異動為[完成]。(可手動按下[下載]按鈕，再次執行下載報表原始資料)

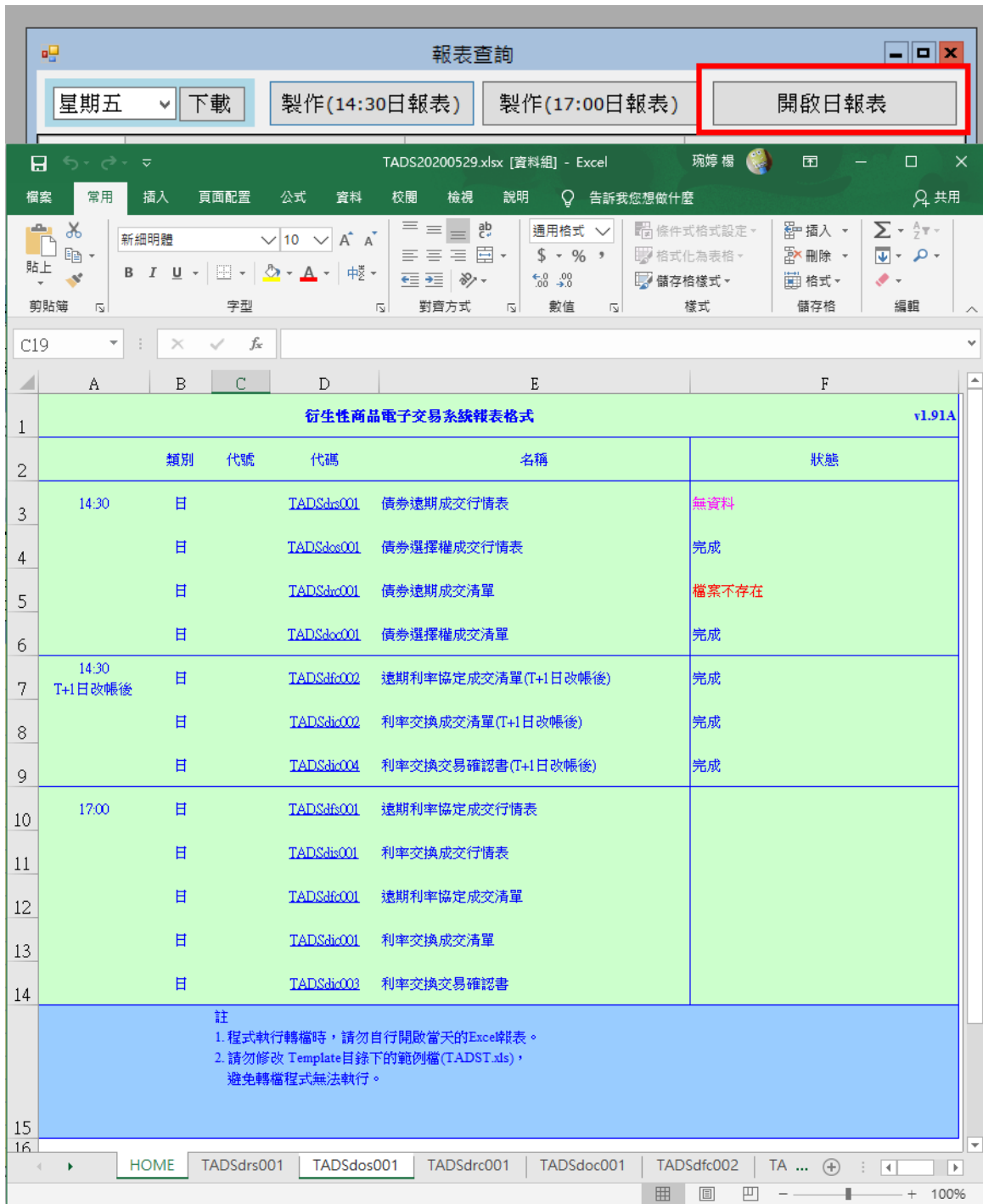


3. 原始報表資料下載完畢後，可選擇執行製作按鈕[製作(14：30 日報表)]或[製作(17：00 日報表)]，產製報表。





4. 產製報表完成後，按下開啟[日報表]按鈕，會開啟報表檔，即可查看報表資料。



註解：

- (1) 若要手動開啟報表檔，位置會在 TPEX \Reports\0~6 資料夾內。
- (2) 0~6 資料夾是對應下載報表的星期數，ex.若下載星期日的報表，相對應的資料夾路徑為 TPEX\Reports\0。



## 2. 輔助功能 – 公告訊息

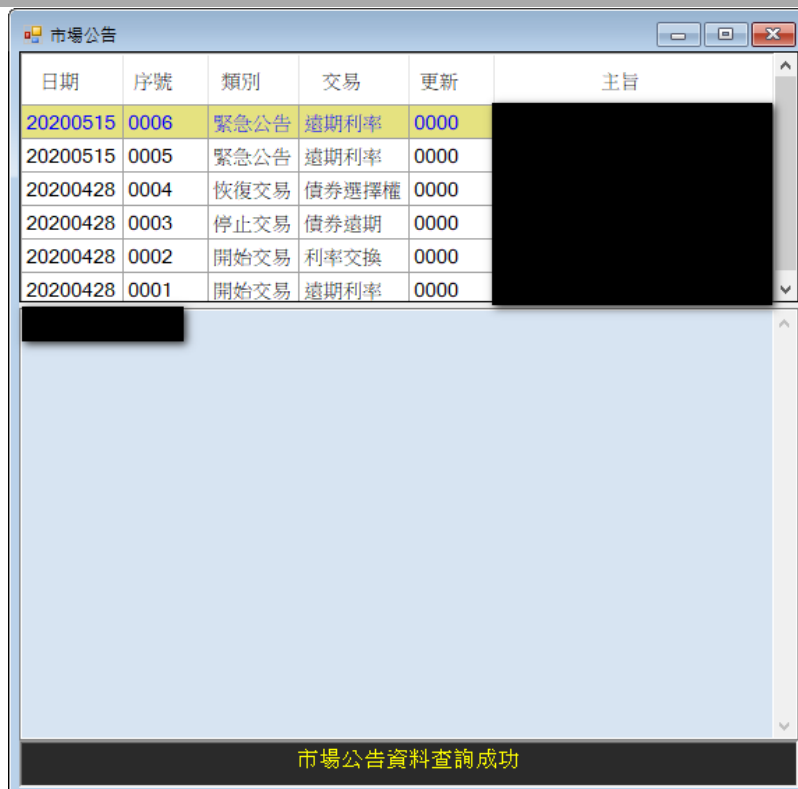
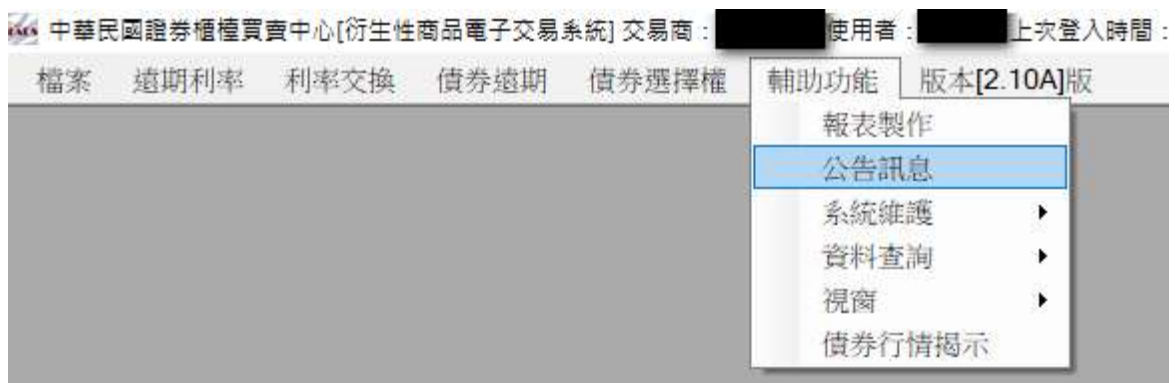
### 功能說明：

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：

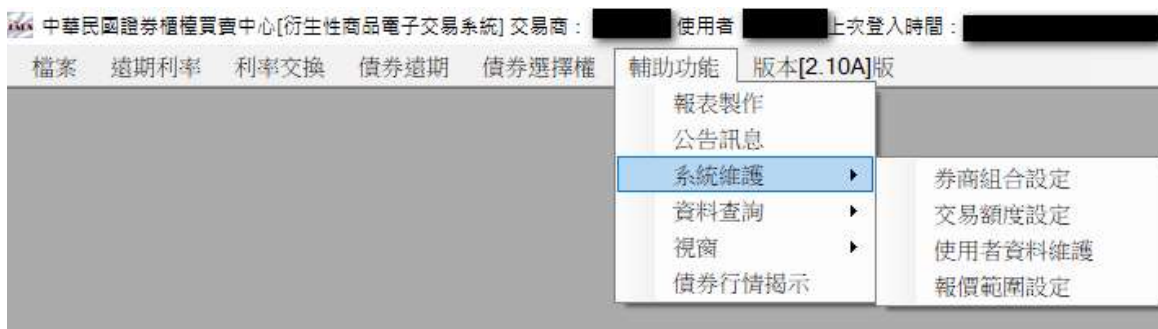


### 3.輔助功能 – 系統維護

功能說明：

選單名稱	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」	112
交易額度設定	提供交易商設定交易員及交易對手額度	100
使用者資料維護	提供交易商新增、修改或刪除使用者資料	103
報價範圍設定	提供交易商設定公司及個人報價範圍	109

畫面說明：



### 3.1 輔助功能 – 系統維護-交易商組合設定

#### 功能說明：

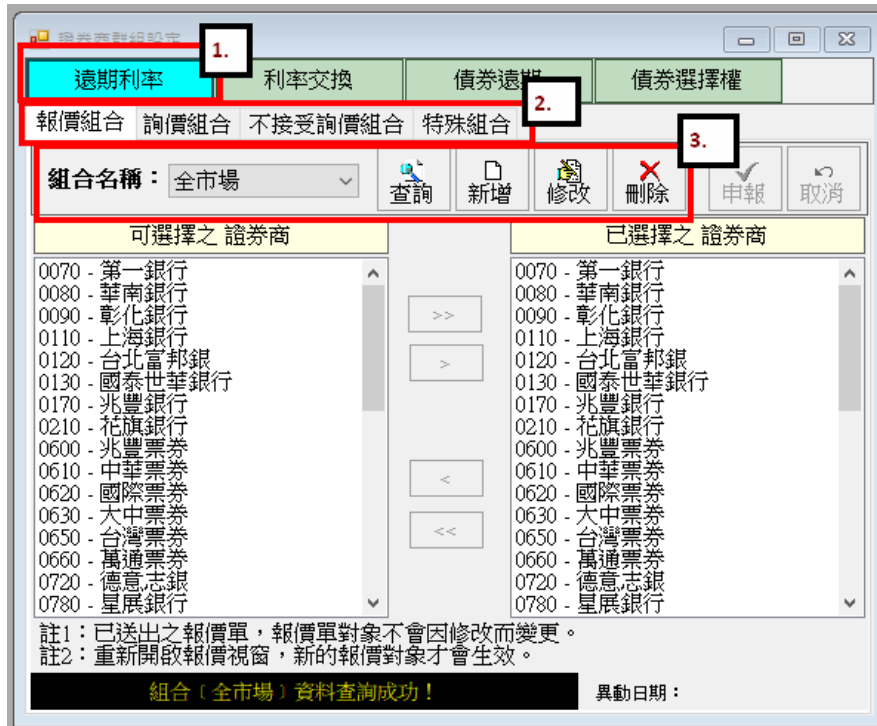
提供交易商設定各項商品契約「報價組合」、「詢價組合」、「不接受詢價組合」及「特殊組合」。

#### 操作說明：

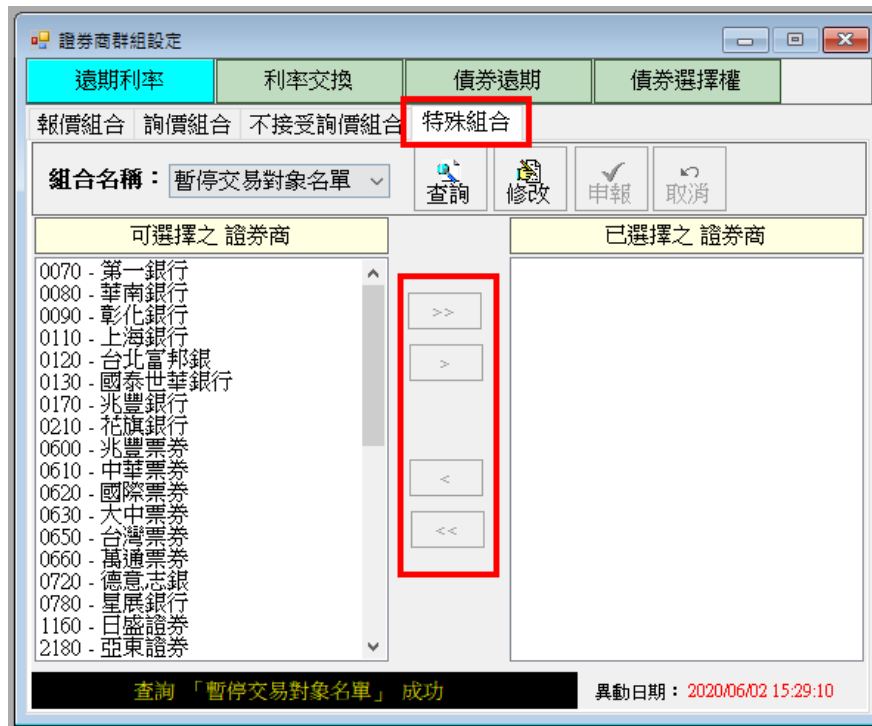
1. 點選「輔助功能」項下「系統維護」-「交易商組合設定」，即出現組合設定之視窗。
2. 點選商品契約名稱後，點選所欲設定之組合種類，即可進行組合查詢、新增、修改或刪除。
3. 組合名稱中「全市場」包括所有已簽約之交易對象名單，由本中心維護，使用者僅能查詢，無法增刪或修改，如有所異動，須向本中心提出申請變更。
4. 使用者可於「特殊組合」中設定「暫停交易對象名單」。當使用者點選「暫停交易對象名單」交易商之報價，系統將出現「送出交易單錯誤〔交易對象在暫停交易對象名單之列〕」訊息，交易失敗（但系統不抽回該報價單）。
5. 組合名稱之設定，長度限制為 10 個字元（5 個中文字）。
6. 「詢價組合」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



1. 選擇契約種類(遠期利率/利率交換/債券遠期/債券選擇權)
  2. 選擇組合種類(報價組合/詢價組合/不接受詢價組合/特殊組合)
  3. 選擇組合名稱及欲執行之功能(新增修改刪除)
2. 「暫停交易對象名單」設定



動作指令鍵，方便使用者新增刪除證券商資料於組合中



## 2. 交易員額度設定

交易員額度設定

券商代號	帳號	姓名	遠期利率		債券遠期		債券選擇權	
			FRA限額	FRA餘額	BF限額	BF餘額	BO限額	BO餘額
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)

交易員額度設定

券商代號	帳號	姓名	遠期利率		債券遠期		債券選擇權	
			FRA限額	FRA餘額	BF限額	BF餘額	BO限額	BO餘額
			0.0	(0.0)	500.0	(500.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
			0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)

輸入完成須按「申報」始能生效

## 3. 交易對象額度設定

交易員額度設定

交易對象	遠期利率		債券遠期		債券選擇權	
	FRA限額	FRA餘額	BF限額	BF餘額	BO限額	BO餘額
	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	21.0	(21.0)
	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)
	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)
	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)
	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)

交易員額度設定

交易對象	遠期利率		債券遠期		債券選擇權	
	FRA限額	FRA餘額	BF限額	BF餘額	BO限額	BO餘額
	0.0	(0.0)	300.0	(300.0)	21.0	(21.0)
	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)
	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)
	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)
	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)

## 4. 剩餘額度查詢

交易員額度設定

交易對象	遠期利率		債券遠期		債券選擇權	
	FRA限額	FRA餘額	BF限額	BF餘額	BO限額	BO餘額
	9999.0	(9999.0)	0.0	(0.0)	21.0	(21.0)
	220.0	(220.0)	0.5	(0.5)	21.0	(21.0)
	0.0	(0.0)	5.1	(5.1)	0.0	(0.0)
	1.0	(1.0)	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。

The screenshot shows a trading system interface with a table of transaction limits. The table has columns for '交易對象' (Counterparty), '遠期利率' (Forward Rate), '債券遠期' (Bond Forward), '債券選擇權' (Bond Option), and '利率交換' (Interest Rate Swap). The '遠期利率' section includes FRA and BF contracts. The '債券選擇權' section includes BO contracts. The '利率交換' section includes 1Y contracts. A dialog box is overlaid on the table, containing the following text:

● 交易商額度設定錯誤  
 例如：5Y 遠期合約已成交金額超過  
 請於每日交易結束後，重新上傳申報！  
 或與貴商請洽業務資料

Buttons: 確定

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。

### 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

The top screenshot shows a table of interest rate swap (IRS) transaction limits. The columns are: 1Y, 1Y, 2Y, 2Y, 3Y, 3Y, 4Y, 4Y, 5Y, 5Y, 5Y以上, 5Y以上. The values are:

1Y	1Y	2Y	2Y	3Y	3Y	4Y	4Y	5Y	5Y	5Y以上	5Y以上
0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)
999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	999.0	(999.0)	10.0	(10.0)
10.0	(-8.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	10.0	(10.0)	10.0	(10.0)

The bottom screenshot shows the same table with a red box highlighting the 1Y and 2Y columns, indicating negative values:

1Y	1Y	2Y	2Y	3Y	3Y	4Y	4Y	5Y	5Y	5Y以上	5Y以上
10.0	(-13.0)	0.0	(-3.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	10.0	(10.0)	10.0	(10.0)
999.0	(999.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)	0.0	(0.0)

### 3.3 輔助功能 – 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. <input checked="" type="checkbox"/> 表 當日已具備之權限；右欄 <input checked="" type="checkbox"/> 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/ First 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」	



註解：

- (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，本中心處理完畢會主動發 Email 通知，公司主管帳號已設定完畢。
- (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) 「公司主管」權限可建置「帳號管理」權限人員，由「帳號管理」權限人員修改「公司主管」人員密碼及負責一般使用者之新增、修改或刪除。
- (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。

## 2. 新增使用者：



「公司主管」及「帳號管理」權限始能新增使用者。

The image shows two screenshots of a software interface for user management. The left screenshot shows the 'Add User' form with the 'Company Manager' (公司主管) checkbox selected in the permissions list. The right screenshot shows the same form with the 'Current Status' (目前狀態) dropdown set to 'FirstTime'.

※ 除「公司主管」權限外，均可新增


※ 申報使用者權限後，即顯示次日狀態「FirstTime」

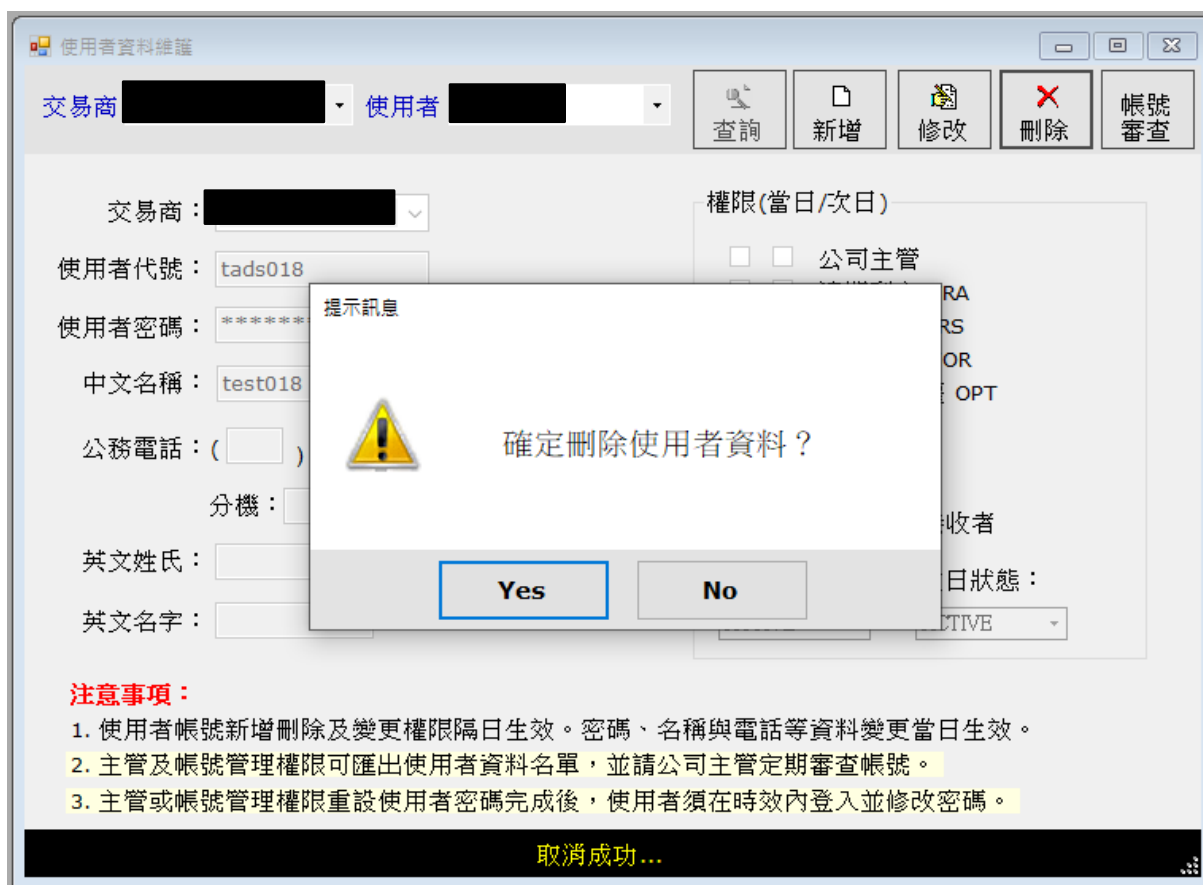
## 3. 修改使用者：

於視窗點選  後，即可修改使用者資料，修改完成後點選 ，資料即修改完成。

The image shows two screenshots of a software interface for user management. The top screenshot shows the 'Modify User' form with the 'Modify' (修改) button highlighted. The bottom screenshot shows the same form with the 'Submit' (申報) and 'Cancel' (取消) buttons highlighted.

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

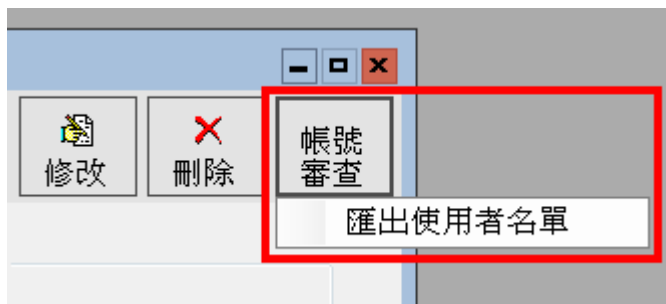


#### 5. 密碼重設：

「公司主管」與「帳號管理」可重新設定使用者密碼，密碼重設完成後，使用者需盡快完成登入並修改密碼，超過登入時效會無法登入，需再次重設密碼。

#### 6. 匯出使用者帳號狀態：

「公司主管」與「帳號管理」，可於視窗點選  後，選擇「匯出使用者名單」，匯出 csv 檔，儲存全部使用者之資料。



帳號權限與功能對照表：

使用者權限 系統功能		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	備 註
檔案	系統登入 / 登出	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	顯示系統訊息	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	結束	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
遠期利 率(FRA)	報價	○	○								交易商須具 備 FRA 商品 權限，才可 開啟 FRA 相 關畫面
	交易	○	○								
	詢價	○	○								
	被詢價	○	○								
	成交查詢	○	○						○		
行情揭示	○	○									
利率交 換(IRS)	報價	○		○							交易商須具 備 IRS 商品 權限，才可 開啟 IRS 相 關畫面
	交易	○		○							
	詢價	○		○							
	被詢價	○		○							
	成交查詢	○		○					○		
	行情揭示	○		○							
公開報價	○		○								
債券遠 期(FOR)	報價	○			○						交易商須具 備 FOR 商 品權限，才 可開啟 FOR 相關畫面
	交易	○			○						
	詢價	○			○						
	被詢價	○			○						
	成交查詢	○			○				○		
行情揭示	○			○							
債券選 擇權 (OPT)	報價	○				○					交易商須具 備 OPT 商 品權限，才 可開啟 OPT 相關畫面
	交易	○				○					
	詢價	○				○					
	被詢價	○				○					
	成交查詢	○				○			○		
	行情揭示	○				○					

使用者權限 系統功能		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	備 註
輔助功能	報表製作	○					○				
	公告訊息	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	視 窗	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	債券行情揭示	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
輔助功能/ 系統維護	券商組合設定	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	交易額度設定	○	○	○	○	○	○	○	○	○	限主管與 風控權限 異動交易 額度
	使用者資料維護	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	報價範圍設定	○	○	○	○	○	○	○	○	○	限主管權 限修改公 司報價範 圍
輔助功能/ 資料查詢	債券資料	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	交易商資料查詢	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	營業日期查詢	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
	債券選擇權計算 器	○	○	○	○	○	○	○	○	○	
全公司成交回報接收										○	

### 3.4 輔助功能 – 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 鍵即設定完成。
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：

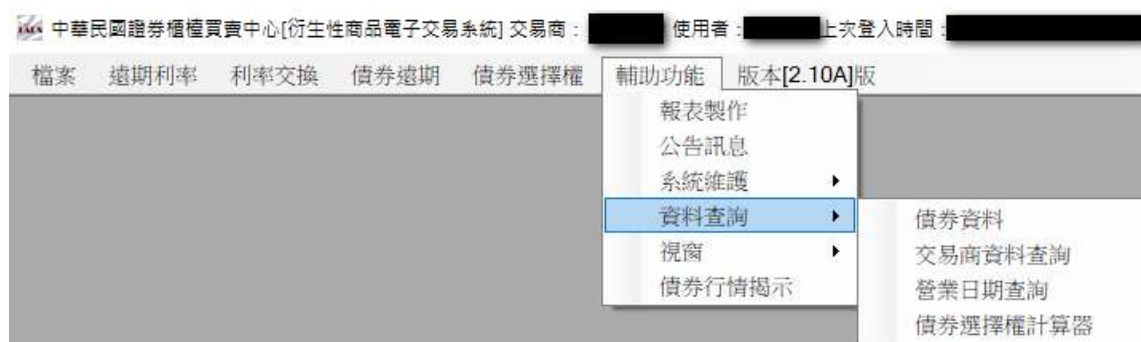
	公司	個人
遠期利率[FRA]	999 bp	999 bp
利率交換[IRS]	999 bp	999 bp
債券遠期[FOR]	999 bp	10 bp
債券選擇權[OPT]	999 %	999 %

## 4. 輔助功能 – 資料查詢

功能說明：

選單名稱	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	111
交易商資料查詢	查詢交易商之基本資料及聯絡資料	112
營業日期查詢	提供使用者查詢債券市場營業及非營業日	113
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金額	114

畫面說明：



#### 4.1 輔助功能 – 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

債券代號: [ ] 查詢 列印

基本資料

債券名稱: [ ] 債券代號: [ ] 債券國別: [ ] 幣別: [ ]

債券面額: [ ] 開始交易日期: [ ]

償還期限: [ ] 發行日期: [ ] 到期日: [ ]

債券類別: [ ]

發行總額: [ ]

無償面額: [ ]

還本條件款項:

登錄債  實價債  指標債券

銀行擔保  免稅債券  發行前交易債券  實時權型債

進階資料

信用評等: [ ] 每年付息次數: [ ]

評等日期: [ ] 每年計息次數: [ ]

息票別: [ ] 交易稅率: [ ]

利率型態: [ ] 標售價格: [ ]

利率別: [ ] 標售利率: [ ]

票載利率: [ ]

擔保情形: [ ]

還本付息(單位:萬元)

	日期	利息/本金	金額
1	101年08月10日	利息	0.0000
2	102年08月10日	利息	150.0000
3	103年08月10日	利息	150.0000
4	104年08月10日	利息	150.0000
5	105年08月10日	利息	150.0000
6	106年08月10日	利息	150.0000
7	107年08月10日	利息	150.0000
8	108年08月10日	利息	150.0000
9	109年08月10日	利息	150.0000
10	110年08月10日	利息	150.0000
11	111年08月10日	利息	150.0000
12	112年08月10日	利息	150.0000
13	113年08月10日	利息	150.0000
14	114年08月10日	利息	150.0000
15	115年08月10日	利息	150.0000
16	116年08月10日	利息	150.0000
17	117年08月10日	利息	150.0000



## 4.2 輔助功能 – 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：

證券商資料查詢

證券商代號： [ ] 查詢

**基本資料**

證券商代號： [ ]  
證券商中文名稱： [ ]  
證券商英文名稱： [ ]  
營利事業統一編號： [ ]  
營利種類： [ ]

**遠期利率協定FRA**

簽約交易商： [ ]  
交易限額： [ ]

**利率交換IRS**

簽約交易商： [ ]  
交易限額： [ ]

**債券遠期交易FOR**

簽約交易商： [ ]  
交易限額： [ ]

**債券選擇權OPT**

簽約交易商： [ ]  
交易限額： [ ]

**聯絡資料**

聯絡人姓名： [ ]  
證券商電話號碼： [ ]  
證券商登記地址： [ ]  
聯絡人電話號碼： [ ]  
聯絡人電話分機： [ ]  
聯絡地址： [ ]

### 4.3 輔助功能 – 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：

營業日期資料查詢

營業日期：  
 民國  年  月  
 電腦議價交易  
 電腦議價交割

民國 109 年 8 月之電腦議價交易營業日期表

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 109 年 8 月資料查詢成功

#### 4.4 輔助功能 – 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：

波動率	CALL	PUT
1.10	2,054,800	0
1.20	3,126,300	0
1.30	4,185,500	0

註解：

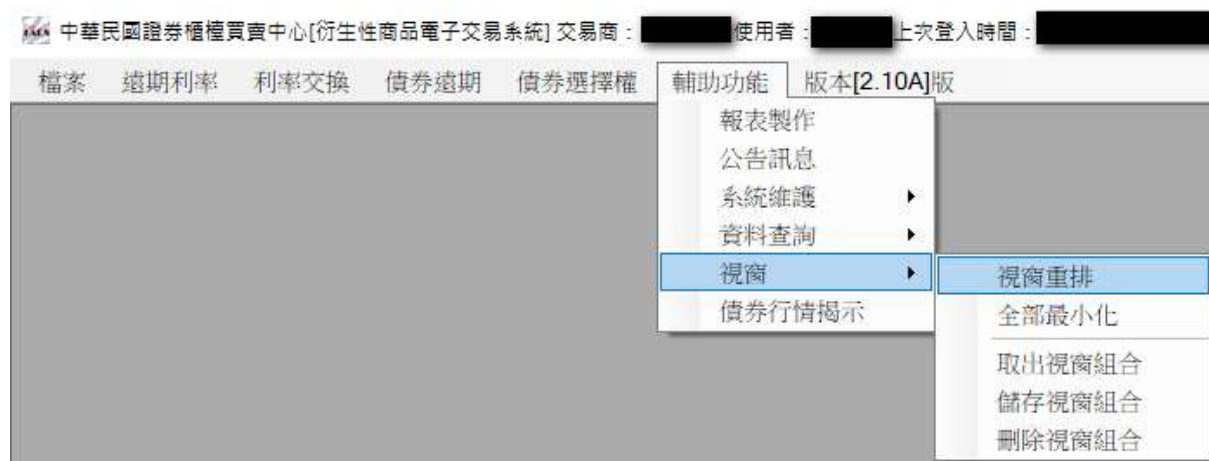
- (1) 無風險利率：前一日日本中心營業處所議價 RP2~10 天期平均成交利率。
- (2) 債券殖利率：所選擇計算之債券期別，於債券等殖成交系統之最近成交殖利率。

## 5. 輔助功能 – 視窗

### 功能說明：

選單名稱	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	116
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	117
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	118
取出視窗組合	提供使用者讀取已儲存之視窗組合	119
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	120

### 畫面說明：



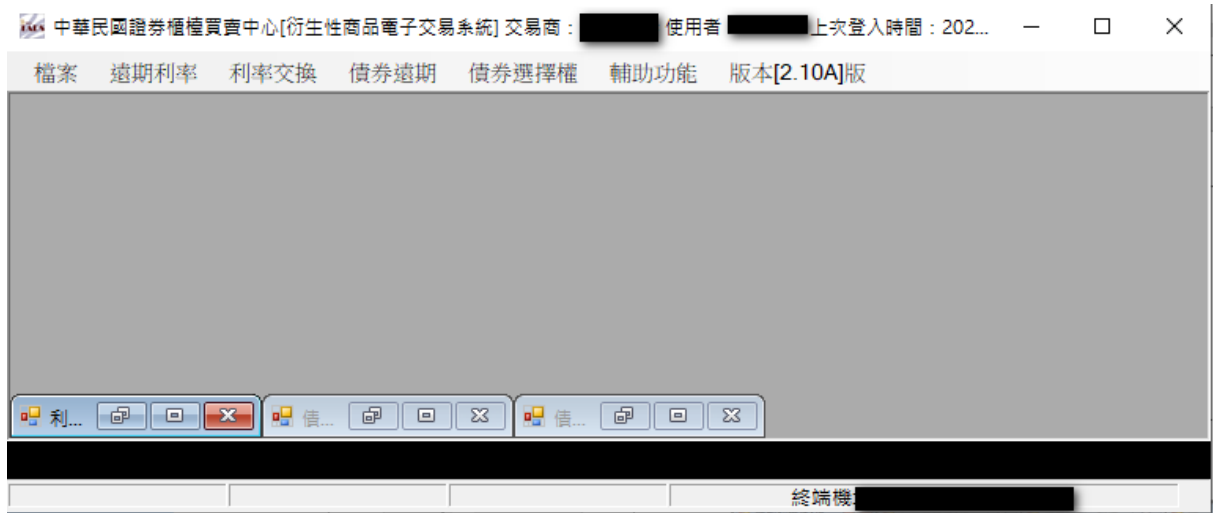


## 5.2 輔助功能－視窗-全部最小化

### 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：



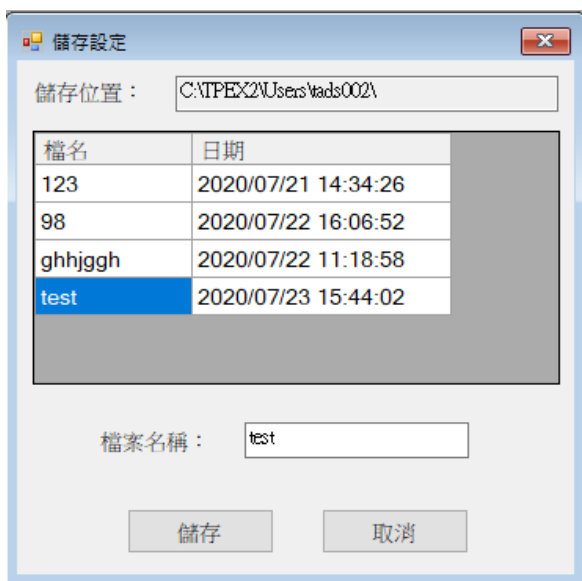
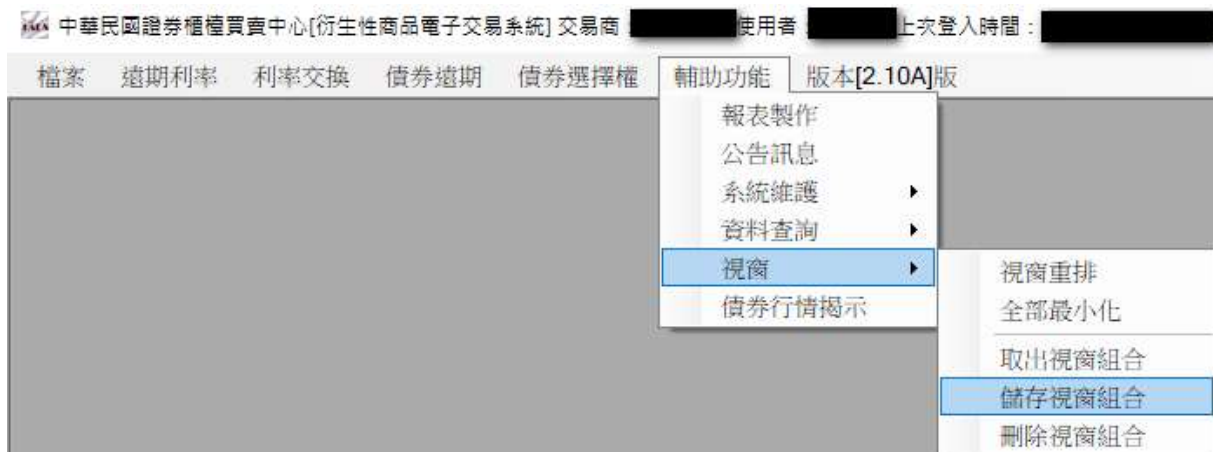
### 5.3 輔助功能— 視窗-儲存視窗組合

#### 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。



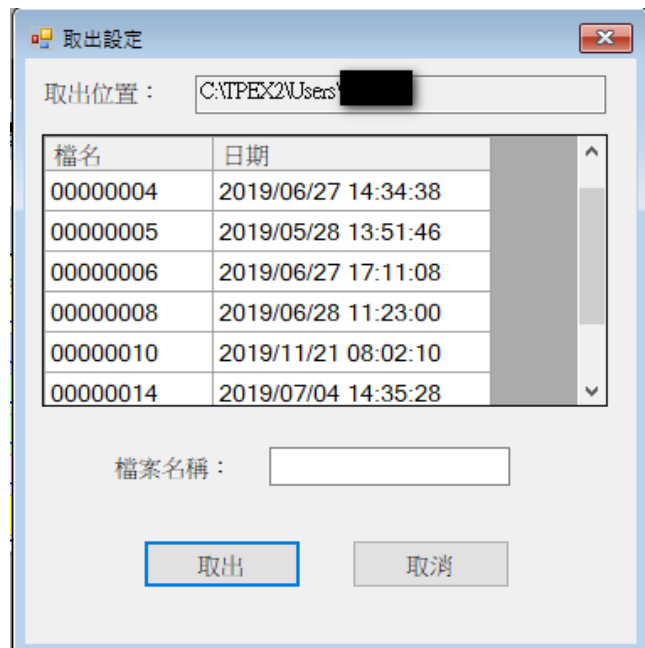
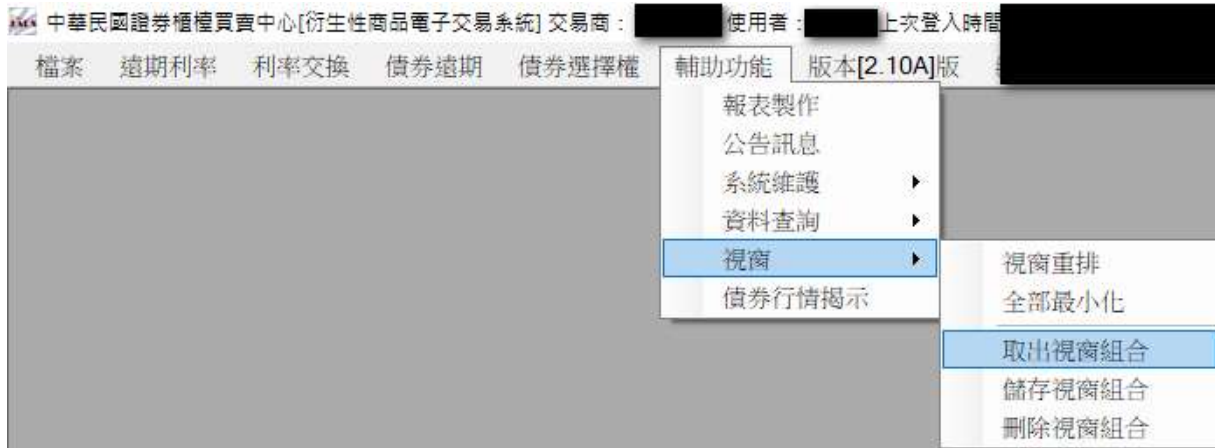
## 5.4 輔助功能 – 視窗-取出視窗組合

### 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。



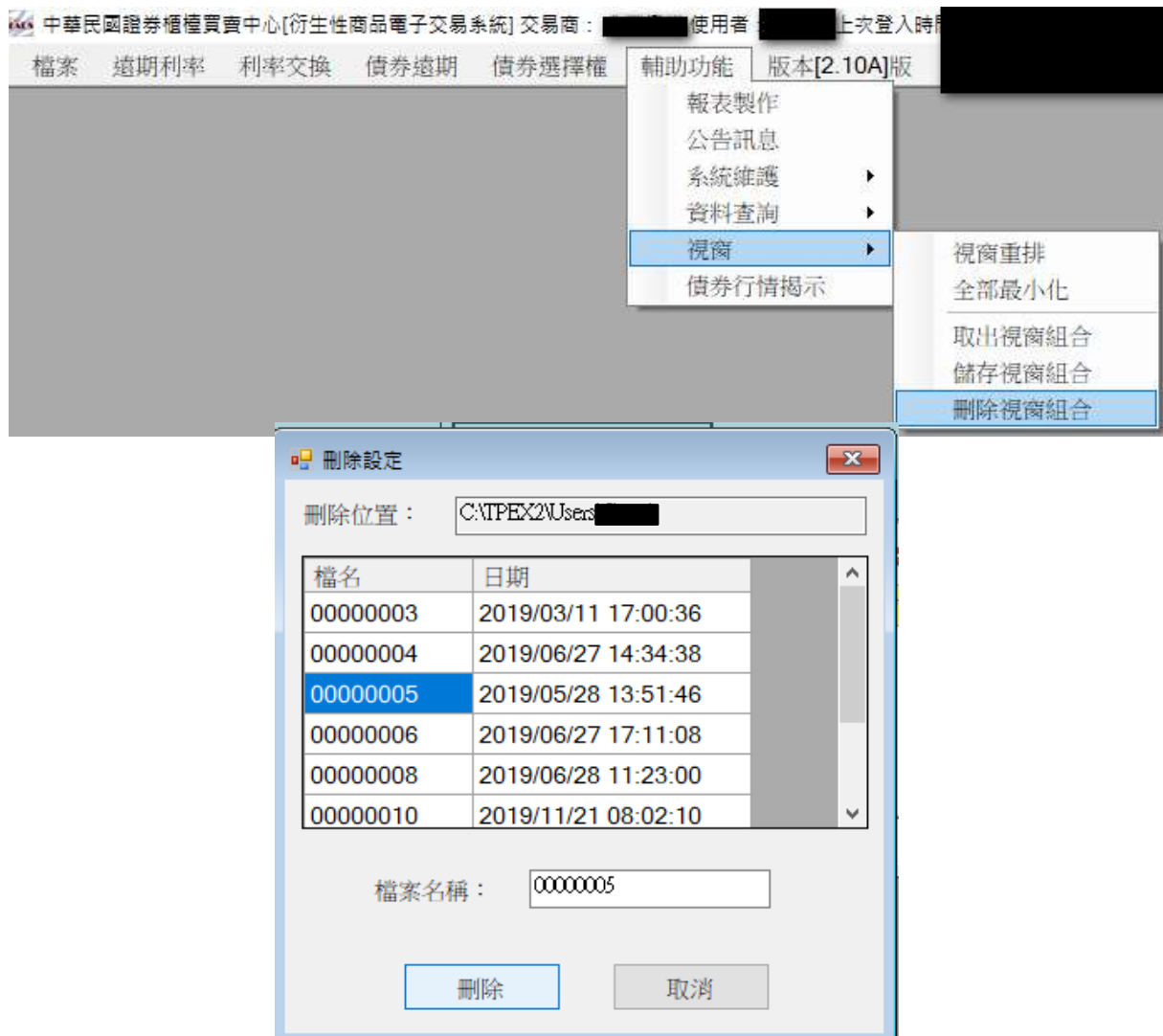


## 5.5 輔助功能 – 視窗-刪除視窗組合

### 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。

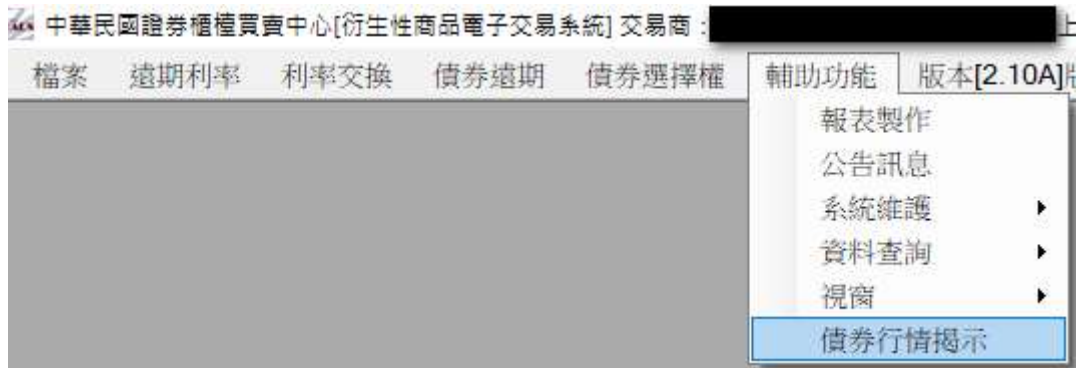
## 6. 輔助功能- 債券行情揭示

### 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。  
行情揭示選擇「總覽」，可以看到所有商品的行情資料。

選	債券代號	最近利率(%)	最高利率(%)	最低利率(%)	累積成交(億)
<input type="checkbox"/>	A00102	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A00104	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A00107</b>	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A00108	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A00109</b>	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A00201</b>	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A01102</b>	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01104	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01105	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01107	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01108	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01109	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01201	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A01202	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A02101	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A02103	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A02105	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A02106	-	-	-	-
<input type="checkbox"/>	A02108	-	-	-	-

若勾選「選」欄位，並在行情揭示選擇「自選」，則可顯示自選商品行情。

選	債券代號	最近利率(%)	最高利率(%)	最低利率(%)	累積成交(億)
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A00107</b>	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A00201</b>	-	-	-	-
<input checked="" type="checkbox"/>	<b>A01102</b>	-	-	-	-