

企業籌資更便捷

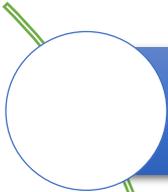
大眾投資更穩當

店頭衍生性金融商品 成交確認及傳送CCP 系統操作說明會

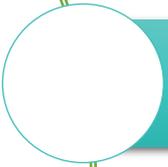


證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange

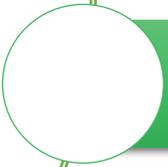
簡報大綱



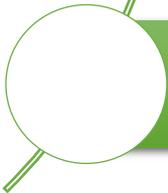
一、時程規劃



二、作業流程



三、系統操作



四、IRS申報常見問題

企業籌資更便捷

大眾投資更穩當

一、時程規劃



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange

時程規劃

項次	辦理時程	辦理事項	備註
1	111/2/14 ~ 111/4/24	TR格式修正測試、 成交確認系統功能測試	(詳下一頁說明)
2	111/4/25	TR格式修正上線、 成交確認系統上線	
3	111/2/14 ~ 111/7/24	傳送CCP系統功能測試 (平日測試)	(詳下一頁說明)
4	111/4 ~ 111/7	傳送CCP市場會測 (假日測試)	依期交所規劃時程辦理
5	111/7/25	傳送CCP上線	依期交所規劃時程辦理

時程規劃

- 有關TR格式修正測試、成交確認系統功能測試及傳送CCP系統功能測試，說明如下：
 1. 測試時間：
111年2月14日起(上班日)，每日9時至17時
 2. 測試系統網址：
<https://trtest.tpex.org.tw>
 3. 測試系統帳密：
帳號一 (帳號：tr001、密碼：tr001abc)
帳號二 (帳號：tr002、密碼：tr002abc)
帳號三 (帳號：tr003、密碼：tr003abc)

二、作業流程

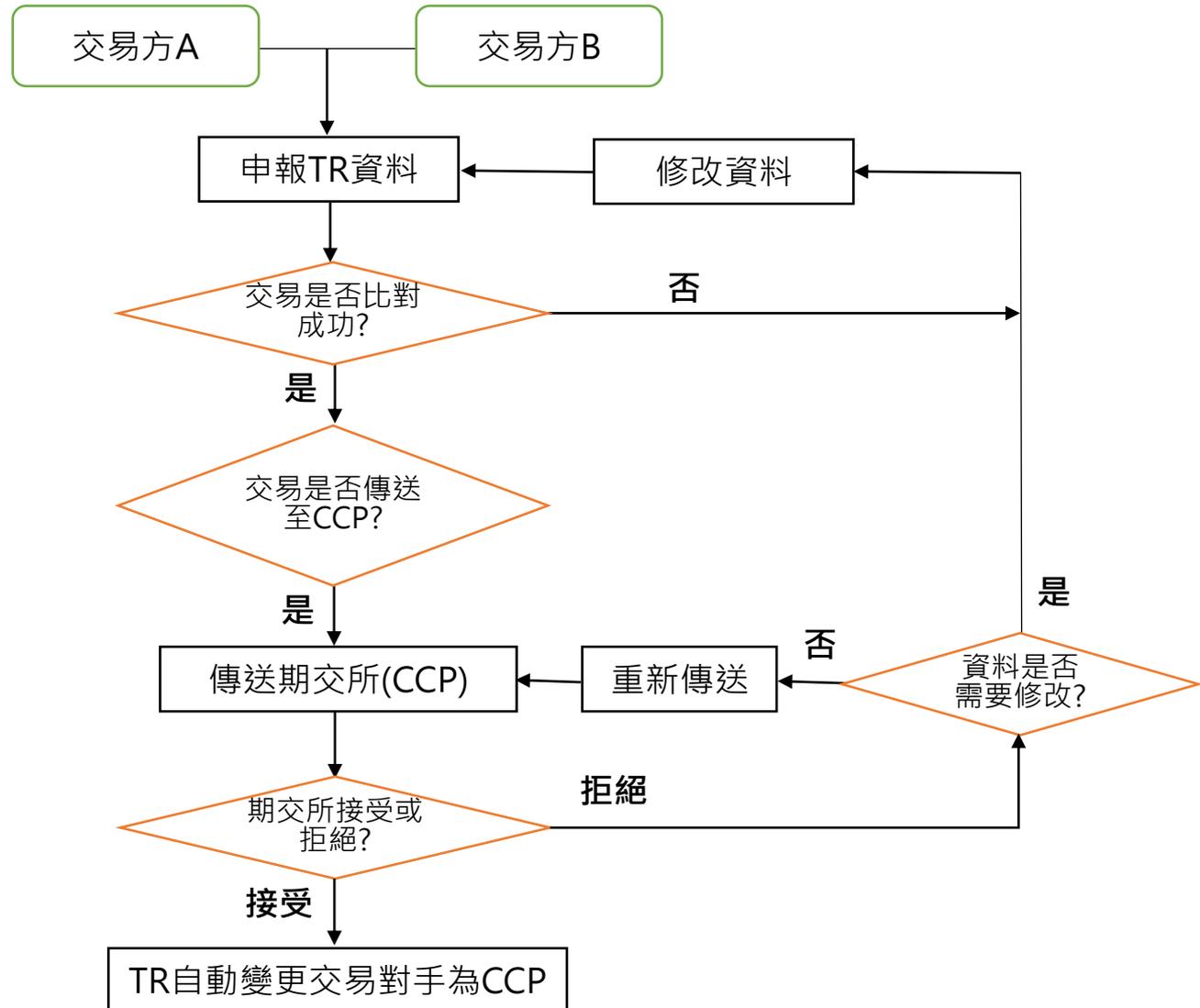
1. 流程圖

- ① 「雙方申報+傳送CCP」
- ② 「雙方申報確認+傳送CCP」
- ③ 「Broker申報雙方確認+傳送CCP」
- ④ 「單方申報確認」

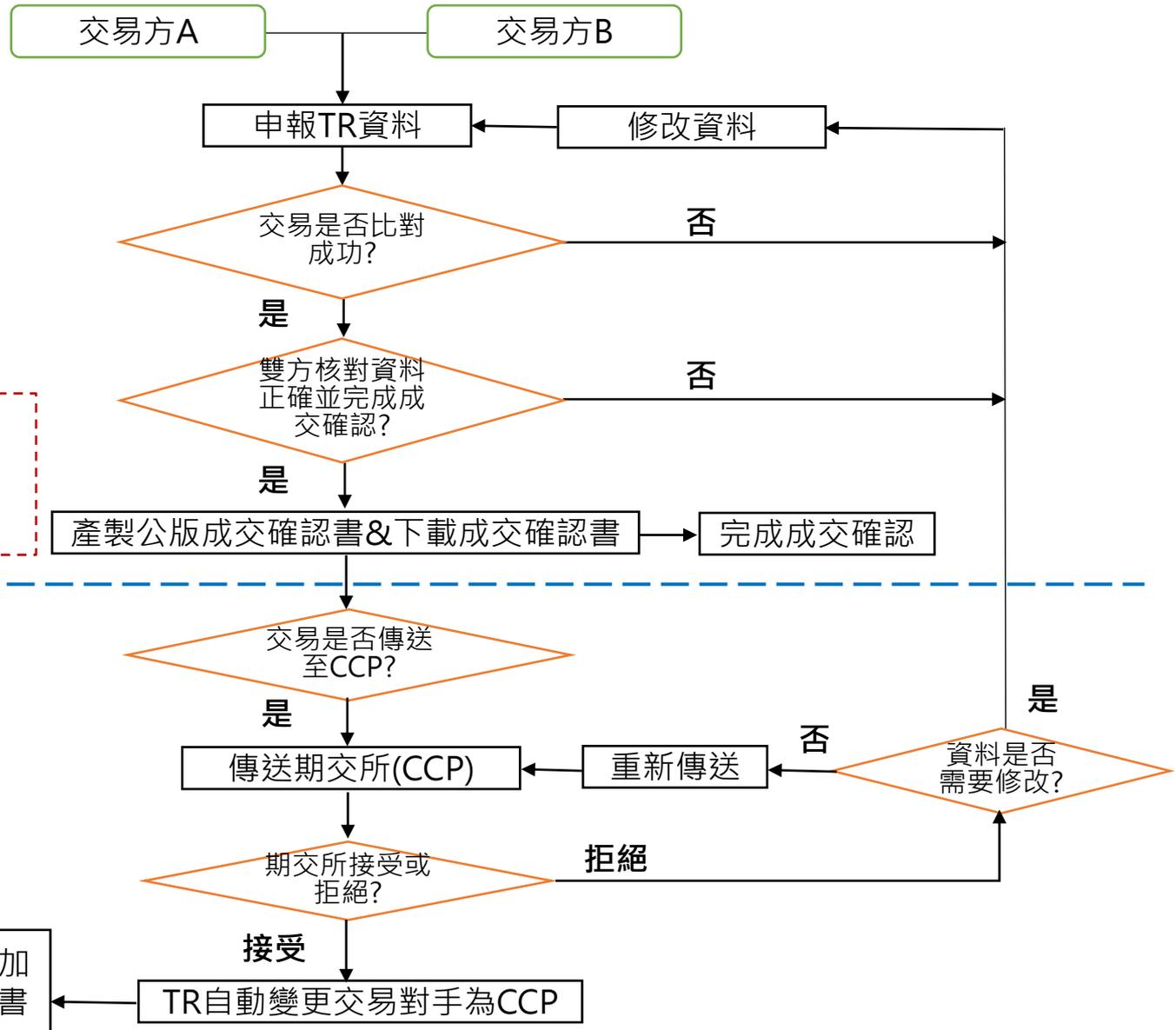
2. 作業流程說明



1. 流程圖 ① 「雙方申報+傳送CCP」

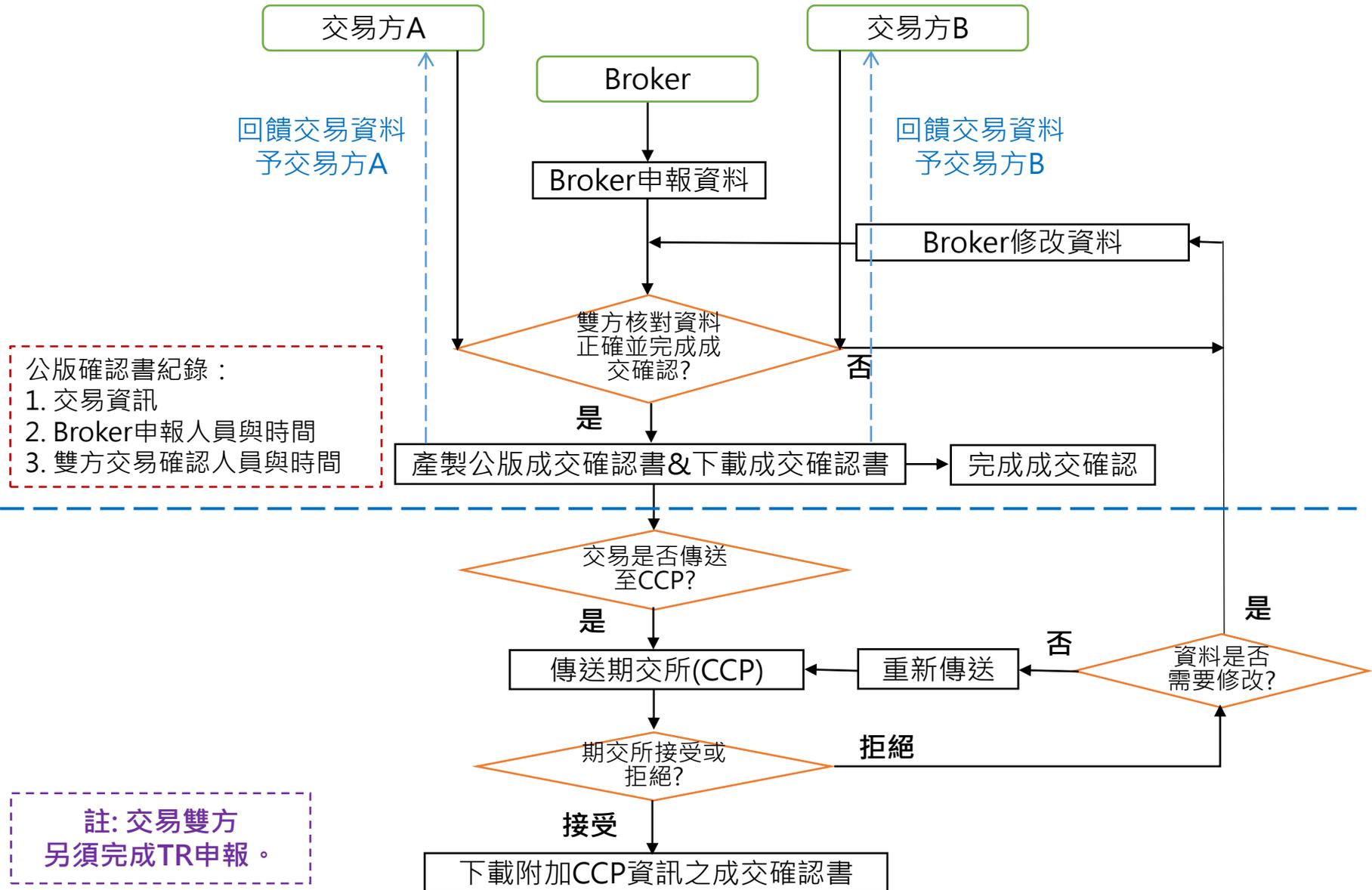


1. 流程圖 ② 「雙方申報確認+傳送CCP」

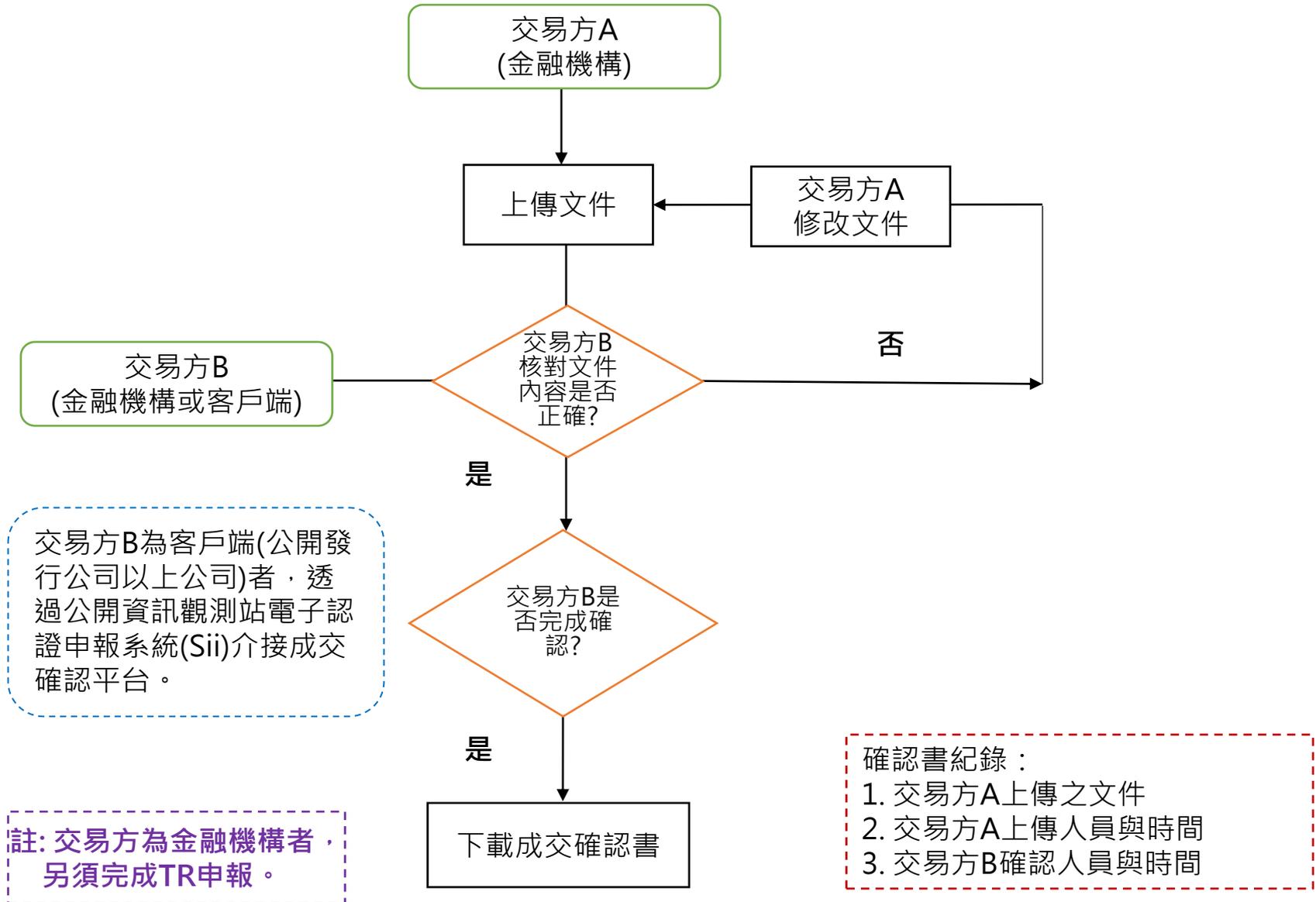


公版確認書紀錄：
1. 交易資訊
2. 雙方交易申報人員與時間
3. 雙方交易確認人員與時間

1. 流程圖 ③ 「Broker申報雙方確認+傳送CCP」



1. 流程圖 ④ 「單方申報確認」



2. 作業流程說明

項次	成交確認及傳送CCP方式	作業流程	備註
1	雙方申報 +傳送CCP	雙方申報TR → 傳送CCP	金融機構間陽春型IRS交易適用
2	雙方申報確認 +傳送CCP	雙方申報TR → 成交確認 → 傳送CCP	金融機構間陽春型IRS交易適用
3	Broker申報雙方確認 +傳送CCP	Broker申報 → 成交確認 → 傳送CCP	①金融機構間陽春型IRS交易適用 ②另須完成TR申報
4	單方申報確認	金融機構上傳文件 → 另一方成交確認	①金融機構間、金融機構與客戶 間所有店頭衍商交易均適用 ②另須完成TR申報

註1：配合期交所CCP推動時程，第一階段(111年7月25日起)CCP商品為**新臺幣陽春型IRS**，第二階段(112年中)CCP商品為**新臺幣NDF**。

註2：金融機構與**公開發行公司以上客戶**可透過「單方申報確認」方式辦理成交確認。

2. 作業流程說明

項次	成交確認及傳送CCP方式	作業流程	TR IRS格式 第43欄 「交易確認及傳送交易至CCP」 填報方式
1	雙方申報 + 傳送CCP	雙方申報TR → 傳送CCP	請選 2： 已透過其他方式完成交易確認； 同意透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所
2	雙方申報確認 + 傳送CCP	雙方申報TR → 成交確認 → 傳送CCP	請選 1： 於櫃買中心成交確認系統以「雙方申報 確認」方式辦理交易確認； 同意透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所
3	Broker申報雙方確認 + 傳送CCP	Broker申報 → 成交確認 → 傳送CCP	請選 4： 已透過其他方式完成交易確認； 不透過TR傳送交易至臺灣期貨交易所
4	單方申報確認	金融機構上傳文件 → 另一方成交確認	如交易要透過TR傳送CCP請選2 如交易不透過TR傳送CCP請選4

★ 【重要!!! 請注意!!!】

如雙方已於成交確認系統以「**Broker申報雙方確認**」方式完成交易確認並傳送至CCP者，
申報TR時，第43欄請務必填4，以避免同一筆交易重複傳送CCP。

★ 雙方於成交確認系統以「Broker申報雙方確認」或「單方申報確認」方式辦理交易確認者，
為第43欄選項所稱之「已透過其他方式完成交易確認」。

2. 作業流程說明

➤ TR IRS格式 第43欄「交易確認及傳送交易至CCP」填報方式整理：

雙方成交確認方式		雙方是否透過櫃買中心TR傳送CCP	雙方【同意】透過TR 傳送期交所CCP	雙方【不】透過TR 傳送期交所CCP (註1)
1	【不使用】櫃買中心 成交確認系統	(TR申報機構間交易)	填2	填4
2	【使用】櫃買中心 成交確認系統	雙方申報確認 (TR申報機構間交易)	填1 (註2)	填3
3		Broker申報雙方確認 (TR申報機構間交易)	填4 (註3)	填4
		單方申報確認 (TR申報機構間交易)	填2 (註4)	填4
4		單方申報確認 (TR申報機構與公發公司交易)	不適用	填4

註1: 包含交易透過其他提交平台傳送CCP，及交易不傳送至期交所CCP。

註2: 交易經TR比對成功後，會自動拋轉至【成交確認】頁面，再拋轉至【傳送CCP】頁面。

註3: 交易已透過【成交確認系統】傳送至CCP，故TR申報需填報4，避免交易重覆傳送至CCP。

註4: 交易僅透過【成交確認系統】完成成交確認，故如欲透過TR傳送交易至CCP，需填報2。

三、系統操作

1. 前置作業
2. 雙方申報+傳送CCP
3. 雙方申報確認+傳送CCP
4. Broker申報雙方確認+傳送CCP
5. 單方申報確認



1. 前置作業

➤ 辦理成交確認及傳送CCP前，請「**主管或帳管權限人員**」先進行公司相關資料及人員權限設定，項目如下：

1. 成交確認資料維護：

① 我方資料維護

公司基本資料、一關/兩關制、結算資訊

② 交易對手資料維護

2. 傳送CCP資料維護：

機構資料維護(放行CCP設定)

3. 使用者資料維護：

成交確認人員權限、傳送CCP人員權限

1. 前置作業①成交確認資料維護

➤ 我方資料維護：

(公司基本資料、一關/兩關制、結算資訊)

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結

資料維護

[USER] 使用者資料維護
[ORG] 機構資料維護
[Certificate] 憑證註冊
[CFMMaintain] 成交確認維護作業

成交確認資料維護

- 申報機構資料維護：僅修改功能。
- 資料異動時須憑證簽章，若為無憑證名單者無需驗章。

修改

登入機構代號： 0040000 (臺灣銀行)

我方資料維護：

公司基本資料： ※此欄位資訊將顯示於成交確認書，請填寫完整名稱

公司名稱(中文):
臺灣銀行股份有限公司

公司名稱(英文):
12345Taiwan NO.1

成交確認 - 一關/兩關制
 一關 兩關

結算會員及結算帳戶：(第一組為預設)

1. 前置作業①成交確認資料維護

➤ 我方資料維護：

(公司基本資料、一關/兩關制、結算資訊)

我方資料維護：

① **公司基本資料：** *必填
此欄位資訊將顯示於成交確認書，請填寫完整名稱

公司名稱(中文):
臺灣銀行股份有限公司

公司名稱(英文):
12345Taiwan NO.1

② **成交確認 - 一關/兩關制**
設定貴公司成交確認採一關/兩關確認

一關 兩關

③ **結算會員及結算帳戶：(第一組為預設)**
如貴公司欲使用「Broker申報雙方確認+傳送CCP」功能，請填寫此欄資訊，成交確認系統方可帶入預設資訊

第一組：
123

第二組：
2

第三組：
1 xx

第四組：
請輸入結算會員代碼 請輸入結算帳戶ID

第五組：
請輸入結算會員代碼 請輸入結算帳戶ID

1. 前置作業①成交確認資料維護

➤ 交易對手資料維護：

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 資料維護 使用者

1 資料維護

2 [CFMMaintain] 成交確認維護作業

成交確認資料維護

1. 申報機構資料維護：僅修改功能。
2. 資料異動時須憑證簽章，若為無憑證名單者無需驗章。

確定 取消

登入機構代號： 0040000(臺灣銀行)

3 交易對手資料維護：

新增 匯入 匯出

交易對手代碼

● 如貴公司欲使用「雙方申報確認」、「Broker申報雙方確認」功能，請填寫此欄資訊，成交確認系統方可產製公版成交確認書

● 輸入與交易對手簽訂之ISDA版本(年份)，系統將執行比對

		交易對手代碼	交易對手名稱	簽訂ISDA版本	資料維護狀態
修改	刪除	0060000	合作金庫商業銀行	2006	--

1. 前置作業②傳送CCP資料維護

➤ 集中結算交易放行CCP功能設定：

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 1 資料維護

2 [USER] 使用者資料維護
[ORG] 機構資料維護
[Certificate] 憑證註冊
[CFMMaintain] 成交確認維護作業

機構資料維護

1. 申報機構資料維護：僅修改功能。
2. 資料異動時須憑證簽章，若為無憑證名單者無需驗章。

修改

登入機構代號： 0040000 (臺灣銀行)

機構名稱(全銜)： 臺灣銀行股份有限公司	負責人姓名： 曾銘宗	營利事業統一編號： 03557311 <small>※此欄位應與電子憑證之公司統籌欄位相符，請謹慎修改</small>
區碼： 請輸入區碼	電話號碼： 23493456	分機： 請輸入分機
信評機構： 中華信評(S&P)	信用評級： AAA	
總公司地址： 台北市重慶南路一段120號1樓		
結構型商品相關網站(150位文數字)： 請輸入網址		

3 集中結算交易放行CCP功能設定：
 手動 自動

預設為手動放行CCP，可變更為自動放行CCP

1. 前置作業③使用者資料維護

➤ 傳送CCP人員權限設定：

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結

資料維護

[USER] 使用者資料維護
[ORG] 機構資料維護
[Certificate] 憑證註冊
[CFMMaintain] 成交確認維護作業

使用者資料維護

- 主管及帳管可新增、修改、刪除、匯出該機構使用者基本資料與權限。
- 一般使用者限修改自己的基本資料，不可異動權限。
- 主管帳號權限已全部開啟無法調整其權限。
- 資料異動時須憑證簽章，若為無憑證名單者無需驗章。
- 異動資料說明：
 - 新增、刪除使用者帳號隔日生效。
 - 修改使用者基本資料(名稱、密碼等)及權限當日生效。

登入機構代號： 0040000(臺灣銀行) 使用者： -- 請選擇 --

金融機構：
—

使用者代號：
請輸入使用者代號

使用者密碼：
請輸入使用者密碼

TR申報權限

<input type="checkbox"/> FXD外匯遠期，交換	<input type="checkbox"/> FXO外匯選擇權	<input type="checkbox"/> TED台股股權衍生性商品	<input type="checkbox"/> IRS利率交換
<input type="checkbox"/> SP結構型商品	<input type="checkbox"/> EVENT到期、提解、交易對手異動	<input type="checkbox"/> MODKEY資料序號異動	<input type="checkbox"/> 後台(下報表)
<input type="checkbox"/> 衍生性商品交易確認書上傳	<input type="checkbox"/> 結構型商品交易確認書上傳	<input type="checkbox"/> FXO2非陽春外匯選擇權	<input type="checkbox"/> SWPT利率交換選擇權
<input type="checkbox"/> IRS2利率交換2	<input type="checkbox"/> IRO利率選擇權	<input type="checkbox"/> CDS信用違約交換	<input type="checkbox"/> FED國外股權衍生性商品
<input type="checkbox"/> CMS商品交換	<input type="checkbox"/> CMO商品選擇權	<input type="checkbox"/> D030衍生性商品客訴	<input type="checkbox"/> CBASO交易額度查詢/預定
<input type="checkbox"/> IRS利率交換_傳輸CCP權限			

可辦理放行CCP人員權限

1. 前置作業③使用者資料維護

➤ 成交確認人員權限設定：(同前頁之路徑、畫面，選取使用者後)

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

成交確認人員名稱(有權確認人員名稱)：
請輸入中文或英文
(此欄位資訊將顯示於成交確認書，請填寫真實名稱)

電子郵件信箱：
請輸入Email

目前狀態：
有效

次日狀態：
有效

成交確認人員權限
 執行成交確認(第一關) 執行成交確認(第二關)

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

結構型客訴申報 公債部位

可辦理第一關/第二關成交確認人員權限

此欄位資訊將顯示於成交確認書，請填寫真實名稱

當有新交易待確認，系統將自動Email通知具成交確認權限之人員

2. 雙方申報+傳送CCP

➤ TR申報畫面：

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護

2

TR申報 成交確認 傳輸CCP

[IRS] 利率交換 查詢 查詢對手 新

交易申報 ▲

- [FXD] 外匯遠期、交換
- [FXO] 外匯選擇權
- [FXO2] 非陽春外匯選擇權
- 1 [IRS] 利率交換

清畫面 申報

商品類別	異動類別	資料序號	申報機構交易商類別	交易發生單位	交易對手類別
1=利率交換(IRS)	-- 請選擇 --	0040000-20220118-03	1=交易商	1=總分支機構	1=國內金融機構
交易對手代號	交易對手名稱	交易對手LEI	交易動機	交易日	生效日
9800000	元大證券	213800DCGUIXGBT4KU10	1=Back-to-Back 避險	20211116	20211117
到期日	期初收付款日	期初收付幣別	期初收付金額	名目本金幣別	名目本金金額
20220131	20211120	AED	99308.00	AUD	99308.00
利息收付方向	營業日金融中心 - 固定利率 / 浮動利率(1)	營業日金融中心 - 浮動利率 / 浮動利率(2)	營業日金融中心 - 利息收付	營業日原則	利息交割方式
1=收浮動利率(1), 付固定利率	JU	JU	JU	1=Actual	1=Net Payment
固定利率					
固定利率(%)	付息周期		計息天數		
1.00000	1M=1個月		1=Actual/365		

2. 雙方申報+傳送CCP

➤ TR申報、傳輸CCP畫面：

點選「傳輸CCP」頁籤後會另開新分頁

全選	執行選項	資料序號	TR資料狀態	傳輸狀態	CCP結算序號	CCP結算狀態	期交所回傳訊息
<input type="checkbox"/>	放行 取消放行			-		-	

2. 雙方申報+傳送CCP

➤ 傳輸CCP畫面：

[CCP] 傳輸CCP 查詢 匯出							
執行選項		資料序號	TR資料狀態	傳輸狀態	CCP結算序號	CCP結算狀態	期交所回傳訊息
<input type="checkbox"/>	放行	0040000-s1-006	比對成功	-		-	

1. 單筆「放行」
2. 亦可多筆勾選後「全部放行」
3. 如設定自動放行者，「放行」步驟可省略

傳輸狀態	CCP結算狀態	狀態說明
-	-	我方未放行CCP
待傳輸	-	我方已放行CCP，交易對方未放行CCP
已傳輸	提交中，待回覆	已傳輸給CCP，等待CCP (期交所) 回覆中
	已提交，檢核中	已提交CCP (期交所) 完成，CCP作業檢核中
	接受	已提交CCP (期交所) 完成，CCP接受
	拒絕	已提交CCP (期交所) 完成，CCP拒絕

註：交易經CCP接受後，TR系統將(於日結時)自動變更雙方之交易對手為CCP。

2. 雙方申報+傳送CCP

➤ Backloading 作業方式：

- ① 於IRS申報畫面「查詢」已申報且尚有餘額之交易，並單筆於系統「修改」相關欄位資訊後「申報」；或是將欲Backloading之交易，依新版IRS格式製作成檔案，以「匯入修改」方式整批匯入後「申報」
- ② 請注意「名目本金金額」欄位須為「目前餘額」數字
- ③ 系統比對交易雙方修改後資料，(第43欄「交易確認及傳送交易至CCP」如選2)，比對成功將傳送至「傳輸CCP」畫面



TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護

TR申報 成交確認 傳輸CCP

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

匯入新增
匯入修改

商品類別	異動類別	料序號	申報
1=利率交換 (IRS)	請選擇 --	0040000-1234556	1=交
		交易對手LEI	交易
		213800DCGUIXGBT4KU10	1=B

可查詢「修改未成功(暫存資料)」，即我方已修改，但尚未重新比對成功之(暫存)資料

3. 雙方申報確認 + 傳送CCP

➤ TR申報畫面：

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護

2

TR申報 成交確認 傳輸CCP

[IRS] 利率交換 查詢 查詢對手 新

交易申報

[FXD] 外匯遠期、交換

[FXO] 外匯選擇權

[FXO2] 非陽春外匯選擇權

1

[IRS] 利率交換

清畫面 申報

商品類別	異動類別	資料序號	申報機構交易商類別	交易發生單位	交易對手類別
1=利率交換(IRS)	-- 請選擇 --	0040000-20220118-03	1=交易商	1=總分支機構	1=國內金融機構
交易對手代號	交易對手名稱	交易對手LEI	交易動機	交易日	生效日
9800000	元大證券	213800DCGUIXGBT4KU10	1=Back-to-Back 避險	20211116	20211117
到期日	期初收付款日	期初收付幣別	期初收付金額	名目本金幣別	名目本金金額
20220131	20211120	AED	99308.00	AUD	99308.00
利息收付方向	營業日金融中心 - 固定利率 / 浮動利率(1)	營業日金融中心 - 浮動利率 / 浮動利率(2)	營業日金融中心 - 利息收付	營業日原則	利息交割方式
1=收浮動利率(1), 付固定利率	JU	JU	JU	1=Actual	1=Net Payment
固定利率					
固定利率(%)	付息周期		計息天數		
1.00000	1M=1個月		1=Actual/365		

3. 雙方申報確認+傳送CCP

➤ TR申報、成交確認畫面：

點選「成交確認」頁籤後會另開新分頁

3. 雙方申報確認+傳送CCP

➤ 成交確認畫面：

步驟：

1. 點選交易，交易資訊顯示於下方
2. 確認交易資訊 (共有五個頁籤)
3. 點選確認 (亦可多筆勾選後全部確認)
4. 待交易雙方均完成確認，可下載確認書

查詢功能：

1. 所有資料
2. 當日上傳/申報
3. 己方尚未完成確認
4. 對手尚未完成確認
5. 自訂條件查詢

註：交易經CCP接受後，雙方可重新下載附加CCP資訊之成交確認書。

3. 雙方申報確認+傳送CCP

➤ TR申報、傳輸CCP畫面：

點選「傳輸CCP」頁籤後會另開新分頁

全選	執行選項	資料序號	TR資料狀態	傳輸狀態	CCP結算序號	CCP結算狀態	期交所回傳訊息
<input type="checkbox"/>	放行 取消放行			-		-	

3. 雙方申報確認+傳送CCP

➤ 傳輸CCP畫面：

[CCP] 傳輸CCP 查詢 匯出							
執行選項		資料序號	TR資料狀態	傳輸狀態	CCP結算序號	CCP結算狀態	期交所回傳訊息
<input type="checkbox"/>	放行	0040000-s1-006	比對成功	-		-	

1. 單筆「放行」
2. 亦可多筆勾選後「全部放行」
3. 如設定自動放行者，「放行」步驟可省略

傳輸狀態	CCP結算狀態	狀態說明
-	-	我方未放行CCP
待傳輸	-	我方已放行CCP，交易對方未放行CCP
已傳輸	提交中，待回覆	已傳輸給CCP，等待CCP (期交所) 回覆中
	已提交，檢核中	已提交CCP (期交所) 完成，CCP作業檢核中
	接受	已提交CCP (期交所) 完成，CCP接受
	拒絕	已提交CCP (期交所) 完成，CCP拒絕

註：交易經CCP接受後，TR系統將(於日結時)自動變更雙方之交易對手為CCP。

3. 雙方申報確認+傳送CCP

➤ Backloading 作業方式：

- ① 於IRS申報畫面「查詢」已申報且尚有餘額之交易，並單筆於系統「修改」相關欄位資訊後「申報」；或是將欲Backloading之交易，依新版IRS格式製作成檔案，以「匯入修改」方式整批匯入後「申報」
- ② 請注意「名目本金金額」欄位須為「目前餘額」數字
- ③ 系統比對交易雙方修改後資料，(第43欄「交易確認及傳送交易至CCP」如選1)，比對成功將傳送至「成交確認」畫面，待雙方確認後，再傳送至「傳輸CCP」畫面

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護

TR申報 成交確認 傳輸CCP

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

商品類別	自動類別	科序號	申報
		0040000-1234556	1=交
		交易對手LEI	交易

可查詢「修改未成功(暫存資料)」，即我方已修改，但尚未重新比對成功之(暫存)資料

4. Broker申報雙方確認+傳送CCP

1) Broker輸入交易資訊後，交易雙方可於「成交確認」畫面查看交易資訊，並辦理成交確認。

➤ 成交確認畫面：

全選	執行選項	申報狀態	狀態說明	狀態代碼	己方確認狀態	交易對手確認狀態	交易對手
	<input type="button" value="確認"/> <input type="button" value="取消確認"/> <input type="button" value="下載確認書"/>						

交易資料 <input type="button" value="修改"/>		
<input type="button" value="主要交易條件"/> <input type="button" value="固定利率端"/> <input type="button" value="浮動利率端"/> <input type="button" value="其他交易條件"/> <input type="button" value="交易雙方基本資料"/>		
交易日	契約天期(年月)	生效日
幣別	名目本金金額	固定利率端支付機構

註：此畫面同IRS申報畫面點選「成交確認」後另開之分頁畫面。

4. Broker申報雙方確認+傳送CCP

➤ 成交確認畫面：

步驟：

1. 點選交易，交易資訊顯示於下方
2. 查看交易資訊 (共有五個頁籤)
3. 如交易資訊(第一~四個頁籤)有誤，請洽Broker修改
4. 結算會員及帳號為預帶資料，交易雙方可自行修改
5. 點選確認
6. 待交易雙方均完成確認，可下載確認書

查詢功能：

1. 所有資料
2. 當日上傳/申報
3. 己方尚未完成確認
4. 對手尚未完成確認
5. 自訂條件查詢

The screenshot shows the CFM transaction confirmation interface. At the top, there are buttons for '全部確認' (All Confirm), '全部取消確認' (All Cancel Confirm), and '下載確認書' (Download Confirmation Book). Below this is a navigation bar with '全選' (All), '執行選項' (Execution Options), and '申報狀態' (Reporting Status). A callout box (1) points to the '交易' (Transaction) button. Below the navigation bar, there are buttons for '確認' (Confirm), '取消確認' (Cancel Confirm), and '下載確認書' (Download Confirmation Book), with callouts (5) and (6) respectively. A callout box (4) points to the '修改' (Modify) button in the '交易資料' (Transaction Information) section. Below this, there are five tabs: '主要交易條件' (Main Transaction Conditions), '固定利率端' (Fixed Rate Side), '浮動利率端' (Floating Rate Side), '其他交易條件' (Other Transaction Conditions), and '交易雙方基本資料' (Basic Information of Both Parties). Callouts (2) and (3) point to the first and second tabs. The main area contains a table with the following columns: '交易日' (Transaction Date), '契約天期(年月)' (Contract Tenor (Year/Month)), '生效日' (Effective Date), and '到期日' (Maturity Date). The table has several rows of data. A callout (1) points to the '交易' (Transaction) button in the top right corner of the interface.

註：交易經CCP接受後，雙方可重新下載附加CCP資訊之成交確認書。

4. Broker申報雙方確認+傳送CCP

2) 交易雙方點選成交確認後，可辦理傳送CCP作業。

➤ 傳輸CCP畫面：

The screenshot shows the 'TR 衍生性商品資料儲存庫' (TR Derivative Product Data Warehouse) interface. The '成交確認系統' (Transaction Confirmation System) menu is open, showing options: '成交確認' (Transaction Confirmation), '傳輸CCP' (Transfer CCP), '[CFMCCP] 傳輸CCP' (highlighted with a red box), '單方申報確認' (Single Party Declaration Confirmation), and '[VRF] 確認書檔案驗證作業' (VRF Confirmation Document File Verification Operation). The main interface includes buttons for '全部放行' (All Release) and '全部取消放行' (All Cancel Release), and a table with columns for '資料狀態' (Data Status), '傳輸狀態' (Transfer Status), and 'CCP結算序號' (CCP Settlement Sequence Number).

註：此畫面同IRS申報畫面點選「傳輸CCP」後另開之分頁畫面。

4. Broker申報雙方確認+傳送CCP

➤ 傳輸CCP畫面：

[CCP] 傳輸CCP 查詢 匯出							
全選	執行選項	資料序號	TR資料狀態	傳輸狀態	CCP結算序號	CCP結算狀態	期交所回傳訊息
<input type="checkbox"/>	放行 取消放行	0040000-s1-006	比對成功	-	-	-	

1. 單筆「放行」
2. 亦可多筆勾選後「全部放行」
3. 如設定自動放行者，「放行」步驟可省略

傳輸狀態	CCP結算狀態	狀態說明
-	-	我方未放行CCP
待傳輸	-	我方已放行CCP，交易對方未放行CCP
已傳輸	提交中，待回覆	已傳輸給CCP，等待CCP (期交所) 回覆中
	已提交，檢核中	已提交CCP (期交所) 完成，CCP作業檢核中
	接受	已提交CCP (期交所) 完成，CCP接受
	拒絕	已提交CCP (期交所) 完成，CCP拒絕

5. 單方申報確認

➤ 單方申報確認畫面：

TR 衍生性商品資料儲存庫		成交確認系統	儲存庫申報(TR)	其他資訊申報	境外衍生性商品資訊諮詢服務	提前了結	資料維護
[CFMS] 單方申報確認		<ul style="list-style-type: none"> 成交確認 傳輸CCP 單方申報確認 [CFMS] 單方申報確認 	申報	匯出			
全選	功能選項	申報狀態	狀態說明	狀態代碼	確認狀態	交	
	瀏覽上傳文件 確認 取消確認 下載確認書						

5. 單方申報確認

1) 上傳方(TR簽約機構)：

- ① 上傳我方已簽署完成之成交確認文件(PDF檔)
- ② 待交易對手點選「確認」後，可下載成交確認書

➤ 單方申報確認畫面：

查詢功能：

1. 所有資料
2. 當日上傳/申報
3. 己方尚未完成確認
4. 對手尚未完成確認
5. 自訂條件查詢

1. 檔案格式：限PDF檔

2. 檔名規則：
交易對手代號_交易類別_交易日_資料序號
(詳下一頁說明)

3. 可「單筆上傳」或「多筆一次上傳」
(直接選取多筆，不需先壓縮在同一個檔)

4. 上傳後要按下「申報」才完成喔

5. 單方申報確認

➤ 上傳方上傳文件之檔名規則：

交易對手代號_交易類別_交易日_資料序號

1)交易對手代號：

如交易對手為TR簽約機構，請填TR機構代碼(7碼)

如交易對手為公發公司客戶，請填公司統一編號(8碼)

2)交易類別：請填代號

A：新作交易、B：修改交易、C：取消交易、D：提前終止交易

3)交易日：請填原始交易日期 YYYYMMDD

4)資料序號：請填自編資料序號(最長20碼英數字)

➤ 範例：

0090000_A_20220121_T00001

(與彰化銀行於 2022/01/21 新作 T00001 交易)

22099131_D_20220105_T00002

(與台積電提前終止 T00002 交易，該交易原始交易日期為 2022/01/05)

5. 單方申報確認

2) 確認方(如為TR簽約機構)：

- ① 閱覽上傳方上傳之文件內容並核對
- ② 核對資料無誤後，點選「確認」
- ③ 確認後可下載成交確認書

➤ 單方申報確認畫面：

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統 儲存庫申報(TR) 其他資訊申報 境外衍生性商品資訊諮詢服務 提前了結 資料維護

[CFMS] 單方申報確認 查詢 上傳文件 刪除 申報 匯出

全部確認 全部取消確認 下載確認書

全選 功能選項 申報

① 閱覽上傳文件 ② 確認 取消確認 ③ 下載確認書

查詢功能：
 1. 所有資料
 2. 當日上傳/申報
 3. 己方尚未完成確認
 4. 對手尚未完成確認
 5. 自訂條件查詢

狀態代碼	確認狀態	交

5. 單方申報確認

3) 確認方(如為公發公司客戶)：

① 登入公開資訊觀測站電子認證申報系統(Sii)

關鍵字查詢

- 各項公告申報作業
- 股東常會除權息申報作業(上櫃公司使用)
- 變更會計師公告
- 庫藏股申報作業
- 買回臺灣存託憑證申報作業
- 員工認股權憑證申報(舊資料查詢)
- 員工認股權憑證申報
- 限制員工權利新股申報
- 非格式化檔案電子資料申報
- 依據「公開收購公開發行公司有價證券管理辦法」規定公告
- 依據「公開發行公司取得或處分資產處理準則」規定公告(含25條及32條)
- 公開發行公司資金貸與及背書保證處理準則第二十二條、二十五條應公告事項
- 取得或處分私募有價證券公告
- 依據主管機關訂頒之各業別「財務報告編製準則」規定之會計變動資訊公告
- 公司治理資訊之揭露辦理情形申報作業
- 獨立董監事兼任情形申報作業
- 財務預測申報作業
- 內部人事前申報作業

1 公開資訊觀測站

櫃買測登錄完成

請點選左列各選項進入

注意：102/01/01 財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心個人資料管理政策聲明及個人資料蒐集處理利用告知事項
[財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心個人資料管理政策聲明](#)
[個人資料蒐集處理利用告知事項](#)

請預先設定中文輸入法：只顯示BIG5字集
 以避免網頁產生亂碼

② 主帳號人員可設定該公司成交確認人員權限

股票或公司債核准上市(櫃)或終止上市(櫃)之公告

關鍵字查詢

有價證券交付或發放股利前辦理之公告

- 採候選人提名制選任董監事及召開股東常會受理股東提案之申報作業(僅上市/櫃/興櫃適用)
- 依證交法第43條之1第1項取得股份申報辦法應公告及申報事項
- 受託機構及特殊目的公司申報項目
- 證券商風險管理品質化資訊申報作業
- 櫃買基金申報作業
- 受託機構資產池資料申報作業
- 溫室氣體排放及減量資訊
- 企業併購法資訊申報作業
- 上櫃掛牌(TDR)單位數增減申報作業

使用者建立作業

使用者代號： L400100 新增 修改 刪除 查詢 密碼變更 帳號清單查詢

- 櫃買電子問卷
- 櫃買電子收據
- 櫃買繳款通知單暨收據列印作業
- 櫃買公文查詢作業
- 衍生性商品交易確認作業
- 衍生性商品交易確認作業

2

5. 單方申報確認

3) 確認方(如為公發公司客戶)：

③ 成交確認人員登入Sii，點選「衍生性商品交易確認作業」

公開資訊觀測站
櫃買網登錄完成
請點選左列各選項進入

注意：102/01/01 財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心個人資料管理政策聲明及個人資料蒐集處理利用告知事項
[財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心個人資料管理政策聲明](#)

- * 各項公告申報作業
- * 股東常會除權息申報作業(上櫃公司使用)
- * 變更會計師公告
- * 庫藏股申報作業
- * 買回臺灣存託憑證申報作業
- * 員工認股權憑證申報(舊資料查詢)
- * 員工認股權憑證申報
- * 限制員工權利新股申報
- * 非格式化檔案電子資料申報
- * 依據「公開收購公開發行公司有價證券管理辦法」規定公告
- * 依據「公開發行公司取得或處分資產處理準則」規定公告(含25條及32條)
- * 溫室氣體排放及減量資訊
- * 企業併購/去資訊申報作業
- * 上櫃掛牌(TDR單位數/增)減申報作業
- * 創投公司投資情形申報作業
- * 創投公司電子掛牌
- * 創投公司電子掛牌
- * 衍生性商品交易確認作業
- * 衍生性商品交易確認作業
- * 買賣長、買賣主管及買賣人員資料申報作業

④ 輸入憑證PIN CODE 即進入成交確認系統

TR 衍生性商品資料儲存庫

進行憑證登入系統

請插入憑證，並輸入PIN 憑證登入

無認證登入請按我

5. 單方申報確認

3) 確認方(如為公發公司客戶)：

⑤ 第一次進入成交確認系統請先進行使用者資料維護

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統

使用者資料維護 公司資料維護

5 使用者資料維護

1. 使用者限修改自己的基本資料(使用者名稱、電話、E-mail、人員權限)，當日生效。

公司名稱：櫃買中心

	公司統編	SII帳號	使用者名稱	連絡電話	E-Mail	關卡	建檔日期
選取	92002238	00				第一關	2022/02/09 21:45:27

公司統編：(公開資訊觀測站)使用者帳號：

92002238 pjwu

姓名：電話號碼：

請輸入中文姓名 23666666

電子郵件信箱：成交確認人員權限：

00 執行成交確認(第一關) 執行成交確認(第二關)

點選「選取」輸入：

1. 姓名
2. 電話號碼
3. E-mail
4. 成交確認人員權限(第一關/第二關)

5. 單方申報確認

3) 確認方(如為公發公司客戶)：

⑥ 設定該公司成交確認關卡數(僅須設定一次即全公司適用)

TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統

使用者資料維護 公司資料維護

⑥ 公司資料維護

1. 修改「成交確認- 一關/兩關制」設定，將影響公司辦理成交確認之作業流程，請先確認後再行修改。

公司名稱： 櫃買中心

公司名稱：
92002238

成交確認 - 一關/二關制：
 一關制 二關制

5. 單方申報確認

3) 確認方(如為公發公司客戶)：

⑦ 進入成交確認作業畫面



TR 衍生性商品資料儲存庫 成交確認系統

[SiiUser] 使用者維護

⑦ [CFMSii] 成交確認作業

[CFMSii] 單方申報確認 查詢 匯出

全部確認 全部取消確認 下載確認書

全選	執行選項	申報狀態	狀態說明	狀態代碼	確認狀態	交易對手	交易類別
	閱覽上傳文件 確認 取消確認 下載確認書						

⑧ 閱覽金融機構上傳之交易文件，核對無誤點選確認，確認後即可下載成交確認書



[CFMSii] 單方申報確認 查詢 匯出

全部確認 全部取消確認 下載確認書

全選	執行選項	申報狀態	狀態說明	狀態代碼	確認狀態	交易對手	交易類別
⑧	閱覽上傳文件 確認 取消確認 下載確認書						

企業籌資更便捷

大眾投資更穩當

四、IRS申報常見問題



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange

1. 「營業日金融中心」欄位填報方式

序號	欄位	格式	內容	說明	比對	
21	營業日 金融中心	① 固定利率 / 浮動利率(1)	X(3)	固定VS浮動交易： 請填固定利率端營業日金融中心 浮動VS浮動交易： 請填浮動利率(1)端營業日金融中心	請依【表F】「金融中心代號一覽表」輸入。 如金融中心超過一個，請按代號順序填報。 例如：倫敦及紐約請填報「JU」。	Y
		② 浮動利率 / 浮動利率(2)	X(3)	固定VS浮動交易： 請填浮動利率端營業日金融中心 浮動VS浮動交易： 請填浮動利率(2)端營業日金融中心		
		③ 利息收付	X(4)	請填利息收付之營業日金融中心		

- 「營業日金融中心」是3個欄位，均請參照【表F】並按代號(A→Z)順序填報。
- 如為「固定VS浮動」交易：
 - 第1欄「固定利率 / 浮動利率(1)」請填固定利率端營業日金融中心，僅需考慮Payment。
 - 第2欄「浮動利率 / 浮動利率(2)」請填浮動利率端營業日金融中心，同時考慮Fixing及Payment(取聯集)。
 - 第3欄「利息收付」請填Payment營業日金融中心。
- 如為「浮動VS浮動」交易：
 - 第1欄「固定利率 / 浮動利率(1)」請填浮動利率(1)端營業日金融中心，同時考慮Fixing及Payment(取聯集)。
 - 第2欄「浮動利率 / 浮動利率(2)」請填浮動利率(2)端營業日金融中心，同時考慮Fixing及Payment(取聯集)。
 - 第3欄「利息收付」請填Payment營業日金融中心。

2. 「SOFR交易」相關欄位填報方式

序號	欄位	格式	內容	說明	比對
27	利率指標	X(12)	請依本中心編製「標的資產明細」之貨幣市場利率代號填入	參照【表D】「標的資產明細代號表」，例如TAIBOR。	Y
28	利率指標天期	X(3)	1D：overnight	字母大小寫均可	Y
			1M：1個月		
			2M：2個月		
			3M：3個月		
29	付息周期	X(3)	4M：4個月		
			5M：5個月		
			6M：6個月		
			7M：7個月		
30	利率指標重設周期	X(3)	8M：8個月		
			9M：9個月		
			10M：10個月		
			11M：11個月		
33	是否複利計算	X(1)	12M：12個月	1. 付息周期=指標重設周期→填報1：Inapplicable。 2. 付息周期≠指標重設周期→依交易約定填報2：Compounding或3：Not Compounding。	Y
			Z：其他		
			1：Inapplicable		
			2：Compounding		
			3：Not Compounding		

- 利率指標：SOFR
- 利率指標天期：1D
- 付息周期：(按實際付息頻率填寫，例如：12M)
- 利率指標重設周期：(按計算區間(Calculation Period)重設頻率(Reset Frequency)填寫，例如12M)
- 是否複利計算：
 - 如付息周期=指標重設周期 → 填報1：Inapplicable。
 - 如付息周期≠指標重設周期 → 依交易約定填報2：Compounding 或3：Not Compounding。

企業籌資更便捷

大眾投資更穩當

簡報結束 敬請指教

債券部

李小姐 Tel: 02-2366-5966
Email: Kellie@tpex.org.tw

林小姐 Tel: 02-2366-8077
Email: sylvia@tpex.org.tw

資訊部

吳先生 Tel: 02-2366-6153
Email: pjwu@tpex.org.tw

劉先生 Tel: 02-2366-8048
Email: chihsun@tpex.org.tw



證券櫃檯買賣中心
Taipei Exchange