

臺灣集中保管結算所股份有限公司
短期票券利率指標編製、使用與查核作業準則

民國 95 年 3 月 27 日訂立

民國 98 年 9 月 24 日修訂

民國 101 年 10 月 16 日修訂

壹、總則

第 一 條 本準則依據「短期票券集中保管結算機構許可及管理辦法」第二十五條訂定之。

第 二 條 為有效管理本公司之短期票券利率資訊，有關短期票券利率指標之蒐集、編製、揭示、使用與查核，適用本作業準則。

第 三 條 本作業準則以票券金融管理法之主管機關為主管機關。

第 四 條 本準則用詞定義如下：

一、短期票券利率指標（以下簡稱短率指標）係指下列利率指標：

（一）報價利率指標：指以票券商傳輸至本公司之報價利率資料，依一定之公式計算出之不同天期別利率。

（二）成交利率指標：指以票券商傳輸至本公司之成交利率資料，依一定之公式計算出不同天期別之下列利率指標：

1、融資性商業本票成交利率指標：於每日營業時間內編製，包含成交分盤利率指標與成交累計利率指標。

2、國庫券成交利率指標：於每日營業時間結束後編製。

二、當日報價利率：指票券商於營業日依不同天期別於其營業場所及網站公開揭露之初級市場承銷及次級市場買賣牌告利率。

三、營業時間：指每營業日上午九時至下午三時三十分。

四、交易時間：依據票券金融管理法第二十二條第一項規定應詳實紀錄交易之時間。

五、成交利率：指票券商辦理短期票券賣斷與附買回條件賣出交易之成交利率。

六、分盤：指營業時間內，依本準則訂定之時間間距。

七、成交分盤利率指標：係本公司依據每一分盤所接收之成交資料，依一定之公式編製計算出之利率指標。

八、成交累計利率指標：係本公司當日至該分盤截止時間之累計成交資料，依一定之公式編製計算出之利率指標。

貳、短率指標蒐集及編製

第 五 條 票券商應於每一營業日上午九時十五分前，將編製報價利率指標之當日報價利率輸入至本公司短率指標編製系統（以下簡稱本系統）。當日中午十二時前，票券商變更當日報價利率時應重新輸入。

第 六 條 票券商於每日營業時間內，除國庫券交易資訊外，應將每筆賣斷與附買回條件賣出交易，於成交後

五分鐘內將票券商代號、交易日期、時間、方式、天期、利率、金額及票券類別等相關成交利率指標編製資料傳送至本系統。票券商輸入資料有誤或遺漏時，應於發現後即時取消、更正或補行輸入。

第六條之一 票券商於每日營業時間結束前，應將每筆國庫券買斷、賣斷、附買回條件賣出、附賣回條件買入交易之票券商代號、交易日期、時間、方式、天期、利率、金額、票券類別及票券代號等相關成交利率指標編製資料傳送至本系統。票券商輸入資料有誤或遺漏時，應於發現後即時取消、更正或補行輸入。

第七條 報價利率指標之編製相關資料內容及方式，本公司得視中華民國票券金融商業同業公會需要修訂公告之。

融資性商業本票成交利率指標編製之相關資料內容、方式、及分盤間距，本公司得與中華民國票券金融商業同業公會及臺灣期貨交易所股份有限公司協商後修訂公告之。

國庫券成交利率指標編製之相關資料內容及方式，本公司得依主管機關及中央銀行需要，或與中華民國票券金融商業同業公會協商後修訂公告之。

第八條 本系統編製之短率指標編製相關資料於營業時間結束後，應轉成歷史檔，並保存五年。

參、短率指標及相關資訊之揭示與使用

第九條 申請揭示使用本公司短率指標等相關資訊之金融行業、資訊公司、新聞媒體機構或電信事業等(以下簡

稱使用單位)，應與本公司簽訂授權使用契約，本公司得收取使用費用。

第十條 本公司對本系統內儲存之原始資料，除須遵守相關法令規定應予保密者外，得將該原始資料，以公開競標等方式，授權得標單位使用，並收取使用費用。

第十一條 前二條收費方式，經報請董事長核准後實施，調整時亦同。

肆、輸入資料之核對及稽核

第十二條 本公司應指定專責部門連線查看各票券商當日報價利率及成交資料之傳輸情形。

第十二之一條 本公司專責部門查看人員，發現或經相關單位通知屬中華民國票券金融商業同業公會「臺灣短期票券報價利率指標作業規範」所訂之異常情事時，應通知該公會，並依其需求提供相關資料。

第十三條 本公司每年應對不特定之票券商，就本作業準則第六條規定事項進行一般性查核。

第十四條 票券商傳輸成交利率指標相關編製資料內容異常時，本公司專責部門應與票券商核對，並作成處理報告紀錄，除有合理原因或不可歸責於票券商之情事並經本公司認可外，應將處理報告陳報主管機關備查，並副知中央銀行。

前項情形如有必要，本公司得派員至該票券商進行查核。

第十五條 本公司對票券商所為之查核，若發現有違反本作業準則者，應即函報主管機關處理，並副知中央銀行。

第 十六 條 本公司應將票券商輸入之時間、系統接收時間及其他異常情形每月編製報表送主管機關備查，並副知中央銀行。

第 十七 條 本公司為應臺灣期貨交易所股份有限公司驗證、查核或跨市場監視作業之需要，得傳輸提供本系統內儲存之原始資料予該公司。

伍、突發狀況之處理程序

第 十八 條 本系統故障或線路中斷，導致連線作業全面無法正常運作，或無法正常傳輸資料時，本公司得宣布暫停作業並通知使用單位。

前項本系統事故修復完成後，票券商應自宣佈重新傳輸之時點起，傳送當時及作業中斷期間之短率指標編製資料。

第 十九 條 票券商本身系統故障，或線路中斷時應向本公司借用終端設備，或以本公司認可之方式傳輸資料，以維持本系統之正常運作。

第 二十 條 使用單位系統故障或線路中斷時，本公司俟其修復完成後，即傳送當時之短率指標資料，並補行傳送其作業中斷期間之短率指標相關資料。

陸、附則

第二十一條 本作業準則未規定者，依相關法令及本公司公布之短期票券業務操作辦法、配合事項、作業要點、業務手冊及技術手冊規定辦理。

第二十二條 本作業準則報請主管機關及中央銀行備查後施行，修正時亦同。