TAIWAN DEPOSITORY & CLEARING CORP.

TDCC

票券數位監理申報業務宣導說明會

金融業務部 陳家琳

112.4.13

TDCC 臺灣集中保管結算所 Taiwan Depository & Clearing Corporation

大綱

壹、增修申報報表(3張)

一.apiCI002-修訂內容

二.apiCI230-填報內容及定義、檢核公式

三.apiCI460-填報內容及定義、檢核公式、申報流程

貳、測試暨上線時程

參、其他申報作業注意事項

肆、聯絡窗口資訊



壹、增修申報報表(3張)



apiCI002聯絡窗口資料
apiCI230利率敏感性資產負債分析表
apiCI460一年期以上固定利率循環發行商業本票契約評價表

項目	申報方式	申報週期	資料來源	檢核方式		
	API	次月15日	票券公司/BCSS系統	自表檢核	跨表檢核	集保檢核
修訂 apiCI002	✓	✓	全表(票券公司)			
新增 apiCI230	✓	✓	全表(票券公司)	✓	✓	
新增 apiCI460	✓	✓	多數欄位由BCSS系統提供，少數欄位由票券公司提供	✓		

一、apiCI002–修訂內容

增加apiCI230及apiCI460等2張新增申報報表之聯絡人資訊

報表名稱: 聯絡窗口資料
報表編號: apiCI002
報表年月: (yyyMM)
金融機構: (xxxxxxx七位代碼)

項目代號	項目名稱	聯絡人姓名 (A)	聯絡人電話 (B)	聯絡人E-mail (C)	部門別(D)
1001	一般窗口(1)				
1002	一般窗口(2)				

各apiCI報表至少需填1名負責人員

2301	apiCI230窗口(1)				
2302	apiCI230窗口(2)				
4601	apiCI460窗口(1)				
4602	apiCI460窗口(2)				

二、apiCI230 –新增報表內容

包含22個申報項目，5種天期(A-E欄)及其合計 (T欄) ，共97個申報欄位

項目代號	申報項目	0-30天(含) A	31-90天(含) B	91-180天(含) C	181天-1年(含) D	超過1年 E	合計 T
1000	資產						0
1100	利率敏感性資產	0	0	0	0	0	0
1110	存放銀行	0	0	0	0	0	0
1120	拆放金融同業			0	0	0	0
1130	附賣回票券投資			0	0	0	0
1140	附賣回債券投資			0	0	0	0
1150	債券投資			0	0	0	0
1160	票券投資			0	0	0	0
1190	其他	0	0	0	0	0	0
1200	無息資產						0
2000	負債						0
2100	利率敏感性負債	0	0	0	0	0	0
2110	向金融同業拆借及透支					0	0
2120	附買回票券負債					0	0
2130	附買回債券負債					0	0
2140	借入款					0	0
2190	其他					0	0
2200	無息負債						0
3000	淨值(權益)						0
4000	利率敏感性缺口					0	0
5000	利率敏感性資產與負債比率						0.00
6000	利率敏感性缺口與淨值比率						0.00

3層級、22列：
資產項目(10)、負債項目(8)、淨值(1)、敏感性缺口及相關比率(3)

黑影欄位不須填報

API 規格

欄位代碼	欄位名稱	屬性	欄位說明
5000T	利率敏感性資產與負債比率	N15 (13,2)	單位為%
6000T	利率敏感性缺口與淨值比率	N15(13,2)	單位為%
除上述兩欄位之其他欄位		N20(18,2)	新臺幣元

二、apiCI230 –填報定義

一、填報說明

- 本表金額單位為新臺幣元，外幣請依月底之結帳匯率折成新臺幣填報。不包括表外資產及表外負債項目。
- 「利率敏感性資產及負債」係指其收益或成本受利率變動影響之生利資產項目（票債券投資、存放銀行、拆放金融同業、其他資產）及付息負債項目（票債券負債、向金融同業拆借及透支、借入款、其他負債）。
- 本表所稱之「期間」係指「剩餘期間」，亦即自申報基準日距離到期日（固定利率者）或重定價日（浮動利率者）之天數。各項利率敏感性資產及負債，請依其「剩餘期間」，分別填入各該欄位。

二、欄位定義

項目代號	項目名稱	定　　義
1100	利率敏感性資產	「利率敏感性資產」係指其收益受利率變動影響之生利資產，例如票債券投資、存放銀行、拆放金融同業等。
2100	利率敏感性負債	「利率敏感性負債」係指其成本受利率變動影響之付息負債，例如票債券負債、向金融同業拆借及透支、借入款等。
2140	借入款	「借入款」係指資產負債表之「長期借款」、「應付商業本業」及「應付公司債」。
1200	無息資產	「無息資產」係指無法產生利息之各項資產，例如現金、股票、股權投資、無息債券、應收款項、預付款項、催收款項、不動產及設備等。
2200	無息負債	「無息負債」係指不支付利息之各項負債，例如應付款項、預收款項、存入保證金等。
4000	利率敏感性缺口	為利率敏感性資產(項目代號1100)減利率敏感性負債(項目代號2100)。
5000	利率敏性資產與負債比率	為利率敏感性資產(項目代號1100)除以利率敏感性負債(項目代號2100)，請填至小數點第2位(四捨五入後)。
6000	利率敏感性缺口與淨值比率	為利率敏感性缺口(項目代號4000)除以淨值(項目代號3000)，請填至小數點第2位(四捨五入後)。

二、apiCI230 –檢核公式(規則)

※詳細檢核公式請詳參Suptech專區公告

項目代號	申報項目	0-30天(含) A	31-90天(含) B	91-180天(含) C	181天-1年(含) D	超過1年 E	合計 T
1000	資產						1000T
1100	利率敏感性資產	0	0	0	0	0	0
1110	存放銀行	0	0	0			0
1120	拆放金融同業	0	0	0			0
1130	附賣回票券投資	0	0	0			0
1140	附賣回債券投資	0	0	0			0
1150	債券投資	0	0	0			0
1160	票券投資	0	0	0	0	0	0
1190	其他	0	0	0	0	0	0
1200	無息資產						0
2000	負債						2000T
2100	利率敏感性負債	0	0	0	0	0	0
2110	向金融同業拆借及透支						0
2120	附買回票券負債						0
2130	附買回債券負債	0	0	0	0	0	0
2140	借入款	0	0	0	0	0	0
2190	其他	0	0	0	0	0	0
2200	無息負債						0
3000	淨值(權益)						3000T
4000	利率敏感性缺口	0	0	0	0	0	0
5000	利率敏感性資產與負債比率						0.00
6000	利率敏感性缺口與淨值比率						0.00

(二)自表檢核：縱向加總
次一層級項目之加總數=
上一層級項目數

(一)自表檢核：橫向加總
A~E欄加總值=合計T欄

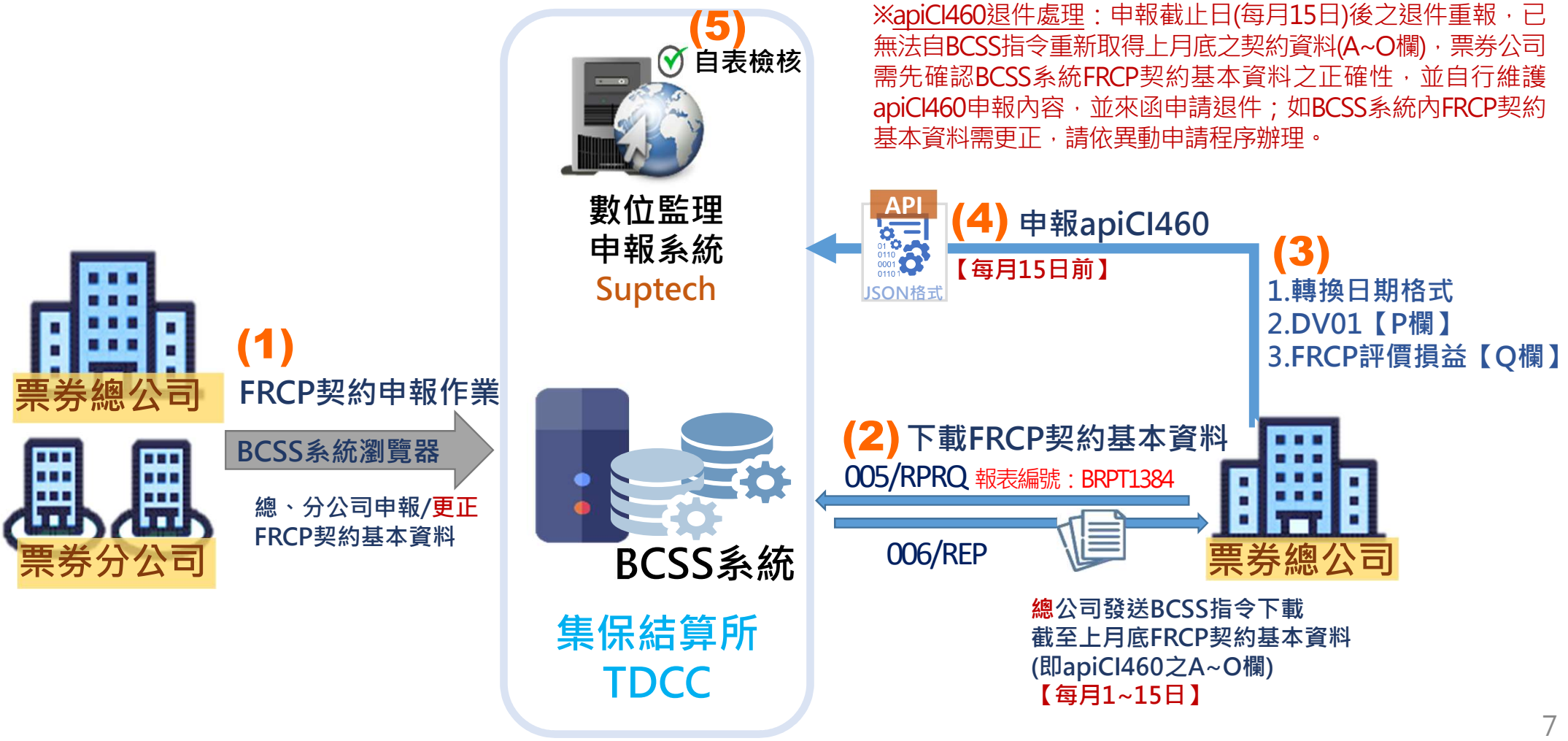
(四)跨表檢核apiCI201

apiCI201

(三)自表檢核：4000項目
利率敏感性資產-負債=缺口

三、apiCI460 –申報流程

※apiCI460退件處理：申報截止日(每月15日)後之退件重報，已無法自BCSS指令重新取得上月底之契約資料(A~O欄)，票券公司需先確認BCSS系統FRCP契約基本資料之正確性，並自行維護apiCI460申報內容，並來函申請退件；如BCSS系統內FRCP契約基本資料需更正，請依異動申請程序辦理。



三、apiCI460 –新增報表內容及檢核公式

包含3類資料，FRCP契約基本資料、票券發行資料、DV01/評價損益，申報逐筆明細17個欄位

報表名稱: 一年期以上固定利率循環發行商業本票契約評價表
報表編號: apiCI460
報表年月: yyyMM
金融機構: (xxxxxxx)7位代碼
單位: 元、%

淡黃底色處欄位之資料可由BCSS系統提供

FRCP契約基本資料(10欄)

FRCP契約編號	發行公司統一編號	發行公司名稱	保證方式	幣別	契約額度	契約起日	契約迄日	剩餘年限	契約利率條件
A	B	C	D	E	F	G	H	I	J
……									
合計9999999									

黑影欄位不須填報

票券發行資料(5欄)

票券批號	發行利率	發票日	發票到期日	發行金額
K	L	M	N	O
……				

DV01/評價損益(2欄)By 票券批號填報

DV01	評價損益
P	Q

青綠底色處欄位之資料需再由票券公司提供

(二)自表檢核：縱向加總逐筆明細之加總數=合計項目數

三、apiCI460 –填報定義及格式(一)

BCSS系統下載

TDCC

	欄位代號	項目名稱	BCSS系統 BRPT1084下載格式	屬性	定　　義
FRCP契約基本資料(10欄)	A	FRCP契約編號	VARCHAR(20)	C(20)	請填列FRCP契約編號(屬初級市場之FRCP)。（最多20碼）
	B	發行公司統一編號	VARCHAR(10)	C(10)	1.請填報統一編號。(8碼) 2.如無統一編號者，請填聯合徵信中心之虛擬統編。 3.如為個人戶，請填身份證字號前2碼+英文大寫6碼 4.以上三類均無者，請填申報單位內部之編號。
	C	發行公司名稱	VARCHAR(80)	C(80)	請填繁體中文名稱，無中文名稱時始可填英文名稱，請勿填列其他語言導致系統無法完整顯示發行公司名稱。
	D	保證方式	VARCHAR(1)	C(1)	請填數字代碼(1碼)：1=票券公司保證、2=銀行保證、4=免保證
	E	幣別	VARCHAR(3)	C(3)	請填幣別代碼(3碼)：TWD=新臺幣、USD=美金
	F	契約額度	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	請填報契約所載之總發行額度(面額)，**欄位數值應大於0**。
	G	契約起日	DATE(yyyy-mm-dd)	D(9)	請填報契約所載之起始日期，例如112年1月3日，BCSS日期格式為2023-01-03，請於申報時轉換日期格式為112/01/03【(民國)OOO/OO/OO】。
	H	契約迄日	DATE(yyyy-mm-dd)	D(9)	請填報契約所載之到期日期，請於申報時轉換日期格式為(民國)OOO/OO/OO【同契約起日(G欄)格式】。
	I	剩餘年限	DECIMAL(5,2)	N5(3,2)	請填報自申報基準日起至契約迄日止之剩餘年期，**欄位數值應大於0，請四捨五入後申報至小數點後2位(單位：年)**。
	J	契約利率條件	VARCHAR(1)	C(1)	請填報數字代碼(1碼)：1=固定、2=浮動、3=綜合型(固定+浮動)
票券發行資料(5欄)	K	票券批號	VARCHAR(12)	C(12)	指FRCP契約編號所對應已發行未兌償之票券批號。(12碼)
	L	發行利率	DECIMAL(6,4)	N6(2,4)	係指實際發行該筆商業本票之利率水準(係指包銷首買之成交利率，不含簽證費、承銷費、保證費)，**請申報至小數點4位，無需填"%"**。
	M	發票日	DATE(yyyy-mm-dd)	D(9)	係指實際發行該筆商業本票之當天日期，請於申報時轉換日期格式為(民國)OOO/OO/OO【同契約起日(G欄)格式】。
	N	發票到期日	DATE(yyyy-mm-dd)	D(9)	係指發行該筆商業本票之屆期日期，請於申報時轉換日期格式為(民國)OOO/OO/OO【同契約起日(G欄)格式】。
	O	發行金額	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	係指申報基準日之已發行商業本票餘額(面額)，**無發行餘額時請填「0」**。

三、apiCI460 –填報定義及格式(二)

票券公司填報

TDCC

DV01/評價損益(2欄)

欄位代號	項目名稱	BCSS傳檔格式	屬性	定　　義
P	DV01	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	當利率變動一個基本點(0.01%)，所造成之票券價格變動金額，**欄位數值應大於或等於0，請四捨五入後申報至小數點後2位**。
Q	評價損益	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	於契約期間內依公司內部評價方式評估，並認列資產負債表之評價調整數金額，**如為評價損失請以負值填報，如無數值者請填0**。

FRCP契約編號

合計9999999

欄位代號	項目名稱	BCSS傳檔格式	屬性	定　　義
O	合計-發行金額	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	係指申報基準日所有FRCP契約之已發行商業本票餘額(O欄)合計數。
P	合計-DV01	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	係指申報基準日所有FRCP契約之DV01(P欄)合計數。
Q	合計-評價損益	DECIMAL(15,2)	N15(13,2)	係指申報基準日所有FRCP契約之評價損益(Q欄)合計數。

三、apiCI460 –案例(一)

報表編號: apiCI460
報表年月: 11203 yyyMM
金融機構: 0670001 (xxxxxxx)7位代碼
單位: 元、%

下載FRCP契約及票券發行基本資料

FRCP契約編號	發行公司統一編號	發行公司名稱	保證方式	幣別	契約額度	契約起日	契約迄日	剩餘年限	契約利率條件(註)	票券批號	發行利率	發票日	發票到期日	發行金額	DV01	評價損益
17544548012	17544548	QQ公司	4	TWD	100,000,000	2023-02-01	2025-01-31	1.84	1	067001123478	0.9978	2023-02-05	2023-05-05	100,000,000		
17544548013	17544548	QQ公司	4	TWD	200,000,000	2023-02-10	2025-02-09	1.87	2	067001123479	0.9986	2023-02-13	2023-05-13	200,000,000		

1筆FRCP契約發行1筆票券批號：
DV01、評價損益可直接歸屬於該筆票券批號，如無數值，則填報0。

上傳apiCI460申報報表(日期格式需轉換)

FRCP契約編號	發行公司統一編號	發行公司名稱	保證方式	幣別	契約額度	契約起日	契約迄日	剩餘年限	契約利率條件(註)	票券批號	發行利率	發票日	發票到期日	發行金額	DV01	評價損益
17544548012	17544548	QQ公司	4	TWD	100,000,000	112/02/01	114/01/31	1.84	1	067001123478	0.9978	112/02/05	112/05/05	100,000,000	17,896.36	-144,121.60
17544548013	17544548	QQ公司	4	TWD	200,000,000	112/02/10	114/02/09	1.87	2	067001123479	0.9986	112/02/13	112/05/13	200,000,000	0.00	0
合計9999999														300,000,000	17,896.36	-144,121.60

(註：契約利率條件：1=固定、2=浮動、3=綜合型[固定+浮動])

三、apiCI460 –案例(二)

下載FRCP契約及票券發行基本資料

FRCP契約編號	發行公司統一編號	發行公司名稱	保證方式	幣別	契約額度	契約起日	契約迄日	剩餘年限	契約利率條件	票券批號	發行利率	發票日	發票到期日	發行金額	DV01	評價損益
17544548014	17544548	QQ公司	4	TWD	500,000,000	2023-03-01	2026-02-28	2.92	1	067001123500	1.0012	2023-03-01	2023-05-30	100,000,000		
17544548014	17544548	QQ公司	4	TWD	500,000,000	2023-03-01	2026-02-28	2.92	1	067001123501	1.0013	2023-03-10	2023-06-05	200,000,000		
17544548014	17544548	QQ公司	4	TWD	500,000,000	2023-03-01	2026-02-28	2.92	1	067001123502	1.0016	2023-03-15	2023-06-12	200,000,000		
合計9999999																

1筆FRCP契約發行多筆票券批號：

(1)DV01、評價損益可直接歸屬於各筆票券者，直接填列於各該筆票券。

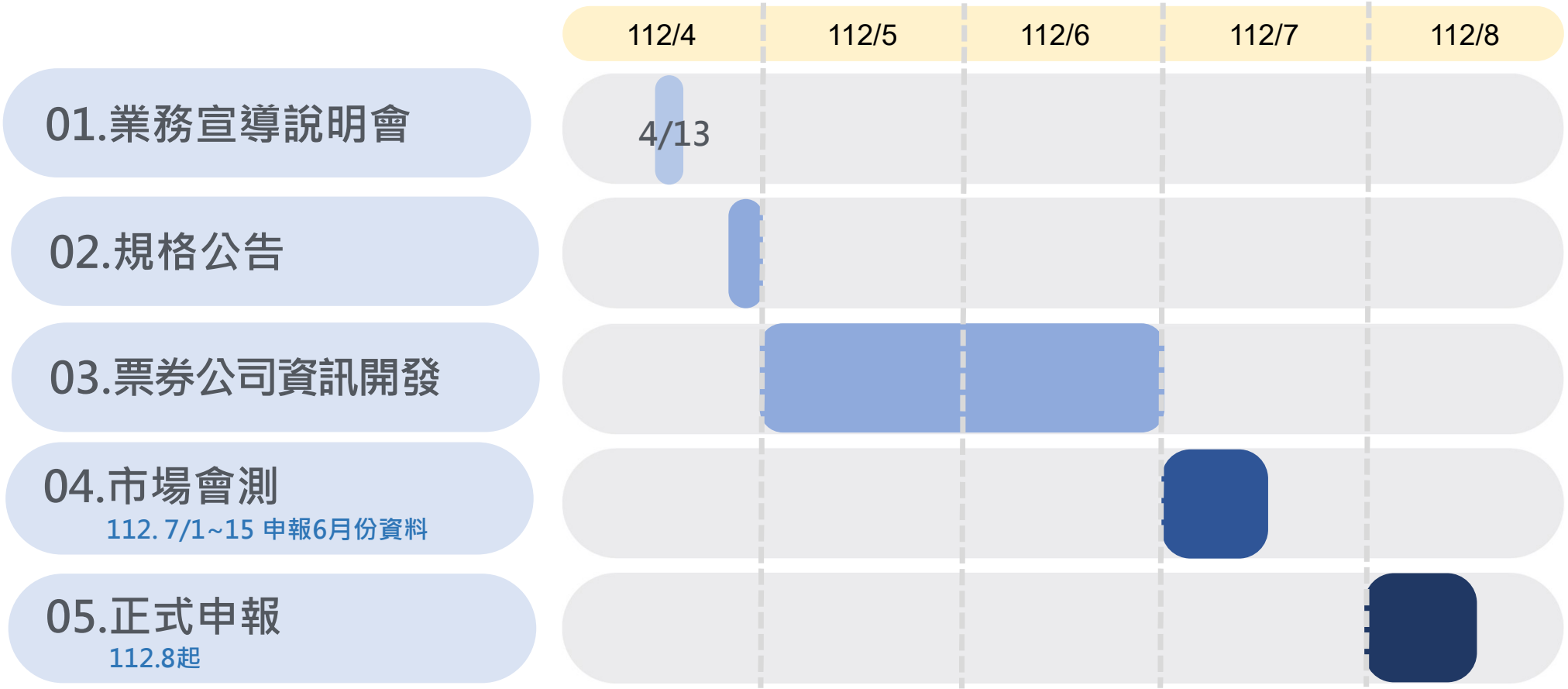
(2)DV01、評價損益無法直接歸屬於各筆票券者，規劃以「發行金額」比重分配於各該筆票券。

ex. 1筆FRCP契約(#17544548014)發行3筆票券批號(#500、#501、#502)，倘票券公司評估整個FRCP契約之DV01、評價損益分別為$140,280及$275,680，另依3筆票券發行金額計算比重分別為20%、40%、40%，將前述DV01、評價損益依比重分配於3筆票券之數值如下:

上傳apiCI460申報報表(日期格式需轉換)

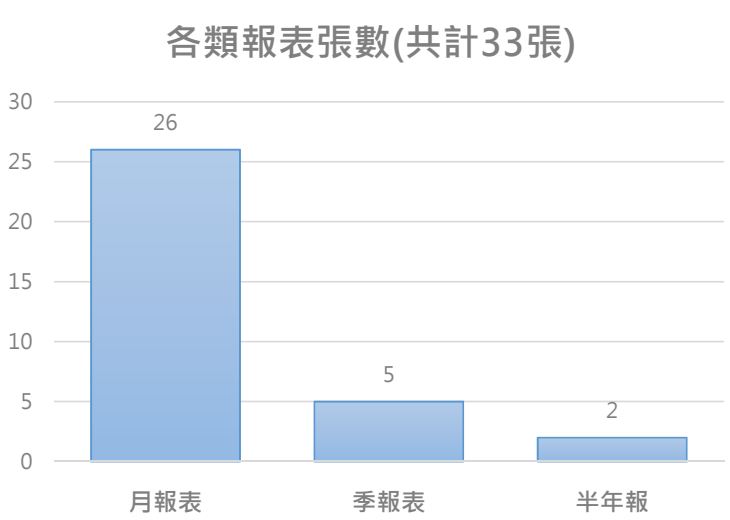
FRCP契約編號	發行公司統一編號	發行公司名稱	保證方式	幣別	契約額度	契約起日	契約迄日	剩餘年限	契約利率條件	票券批號	發行利率	發票日	發票到期日	發行金額	DV01	評價損益
17544548014	17544548	QQ公司	4	TWD	500,000,000	112/03/01	115/02/28	2.92	1	067001123500	1.0012	112/03/01	112/05/30	100,000,000	28,056.00	55,136.00
17544548014	17544548	QQ公司	4	TWD	500,000,000	112/03/01	115/02/28	2.92	1	067001123501	1.0013	112/03/10	112/06/05	200,000,000	56,112.00	110,272.00
17544548014	17544548	QQ公司	4	TWD	500,000,000	112/03/01	115/02/28	2.92	1	067001123502	1.0016	112/03/15	112/06/12	200,000,000	56,112.00	110,272.00
合計9999999														500,000,000	140,280.00	275,680.00

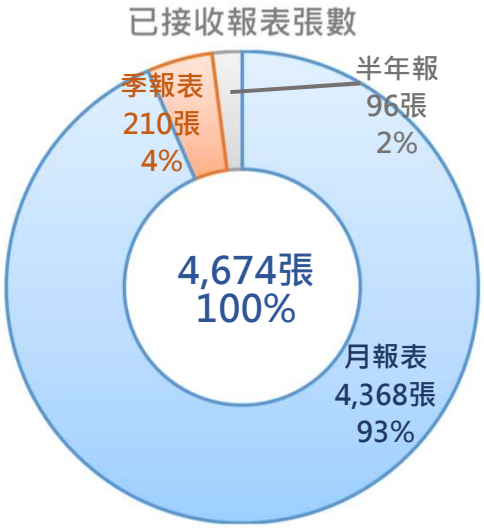
貳、測試暨上線時程

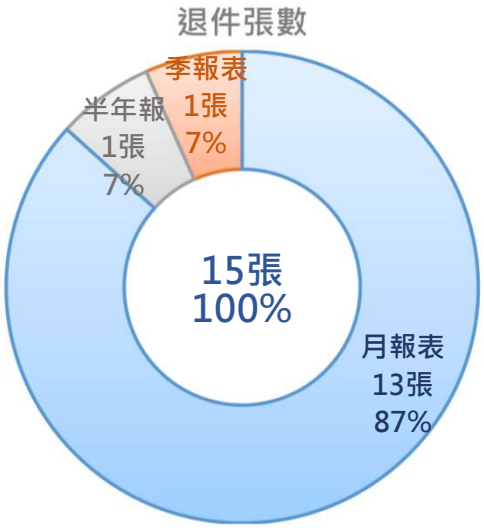

112/4
112/5
112/6
112/7
112/8
01.業務宣導說明會
4/13
02.規格公告
03.票券公司資訊開發
04.市場會測
112. 7/1~15 申報6月份資料
05.正式申報
112.8起

參、其他申報作業注意事項

自110/6/28正式上線迄今(112/3/15)~已受理21期申報資料



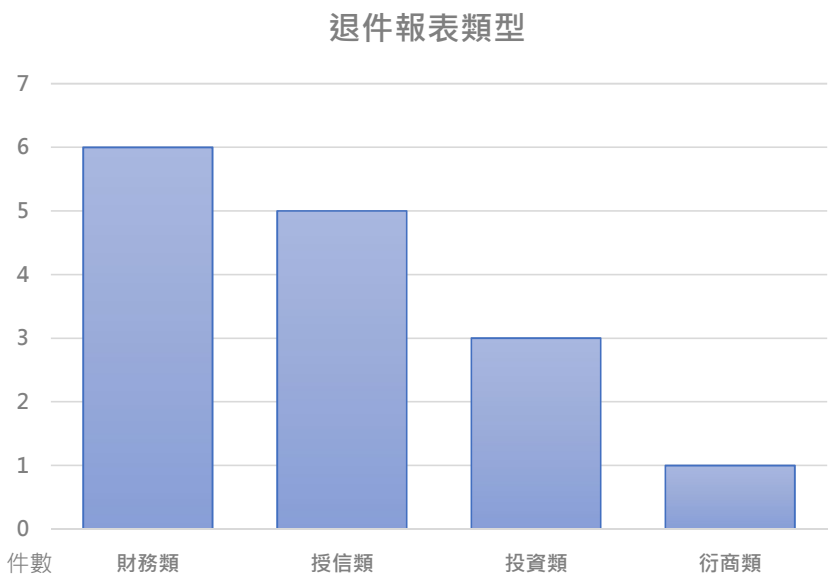




退件率=15張/4,674張=0.32%

參、其他申報作業注意事項

退件錯誤態樣分析



類型	態樣
財務類	會計科目歸類、內部系統設定及資料等錯誤
授信類	數值誤植、以前期資料申報、apiCI343填報定義疑義
投資類	人工申報錯誤、債券基本資料及會計科目錯誤
衍商類	申報數值少一位數

肆、集保結算所聯絡窗口

業務窗口 金融業務部

陳家琳　2719-5805#299　clchen@tdcc.com.tw
陳泰華　2719-5805#556　john@tdcc.com.tw
劉應寬　2719-5805#808　david_liu@tdcc.com.tw



資訊窗口 金融資訊部

數位監理申報系統

許佳雯　2719-5805#815　coldocean@tdcc.com.tw

BCSS系統

連宏基　2719-5805#871　andy_lien@tdcc.com.tw

TDCC

創新．韌性．永續．普惠金融

簡報結束 敬請指教