

格式D(結構型商品日資料申報格式) 檔名：SP.txt或SP.csv

附表1

欄 位		格 式	內 容	填 報 說 明
交易日期	年	9(4)		訂約日（the day of the initiation of contract）
	月	9(2)		
	日	9(2)		
申報機構代號		X(7)	請依本中心編製「金融機構代號一覽表」輸入	參照「TR簽約機構一覽表」
產品代號		X(20)	該功能用以確認為同一檔商品，可由公司自行編碼	本表係採逐檔商品填報方式。相同成立日期、名目本金幣別、商品種類、標的型態者以同一產品代號申報。 【檢核】產品代號不得重覆。
商品型態	X(1)	1：結構型商品		「結構型商品」係指各申報機構依循下列規定所辦理之結構型商品業務：(1)銀行：依「銀行辦理衍生性金融商品應注意事項」所辦理者。(2)證券商：依「證券商營業處所經營衍生性金融商品交易業務規則」所辦理者。(3)槓桿交易商：依「槓桿交易商經營槓桿保證金契約交易業務規則」所辦理者。(4)保險公司：依「投資型保險專設帳簿保管機構及投資標的應注意事項」所銷售之投資型保單連結國內結構型商品。
		2：境外結構型商品		「境外結構型商品」係指 信託業、證券商及保險公司 依「境外結構型商品管理規則」所銷售於中華民國境外發行，以固定收益商品結合連結股權、利率、匯率、指數、商品、信用事或其他利益等衍生性金融商品之複合式商品，且以債券方式發行者。如於 境外結構型商品管理規則實施以後(98.08.23) 銷售之境外結構型商品，不須申報。 如 境外結構型商品之來源為發行人或總代理人(依境外結構型商品規則定義) ，不須申報。 【檢核】申報機構類別為「證券商」、「保險公司」及「信託業」者，且本欄填報2者，新增申報之交易日期欄位應早於98.08.23。
		A：結構型商品（OSU／業務經營）		證券商適用。係指國際證券業務分公司（OSU）依「國際證券業務分公司管理辦法」第12條所辦理之外幣結構型商品業務。
		B：結構型商品（OSU／自行買賣／避險）		證券商適用。係指國際證券業務分公司（OSU）依「國際金融業務條例」第22-4條第1項第3款自行買賣之外幣結構型商品，且該筆交易係基於避險目的而從事者。
		C：結構型商品（OSU／自行買賣／非避險）		證券商適用。係指國際證券業務分公司（OSU）依「國際金融業務條例」第22-4條第1項第3款自行買賣之外幣結構型商品，且該筆交易係基於非避險目的而從事者。
		D：結構型商品（自行買賣／避險）		證券商適用。係指證券商依金管會103年7月25日金管證券字第1030010224號及10300102241號令自行買賣之結構型商品，且該筆交易係基於避險目的而從事者。
		E：結構型商品（自行買賣／非避險）		證券商適用。係指證券商依金管會103年7月25日金管證券字第1030010224號及10300102241號令自行買賣之結構型商品，且該筆交易係基於非避險目的而從事者。
		F：境外結構型商品（OBU/OSU/OIU）		依國際金融業務條例核准設立之國際金融業務分行、國際證券業務分公司及國際保險業務分公司，對中華民國境外之個人、法人、政府機關或金融機構受託投資、受託買賣境外結構型商品或以之為投資型保單投資標的者。 如 境外結構型商品之來源為發行人或總代理人(依境外結構型商品規則定義) ，不須申報。
		G：境外結構型商品（專業機構投資人）		境外結構型商品以專業機構投資人為受託或銷售對象，專業機構投資人的定義請依境外結構型商品管理規則。如銷售對象同時符合專業機構投資人與高淨值投資法人之條件，請填報G。 如 境外結構型商品之來源為發行人或總代理人(依境外結構型商品規則定義) ，不須申報。
		H：境外結構型商品（高淨值投資法人）		境外結構型商品以高淨值投資法人為受託或銷售對象者，高淨值投資法人的定義請依境外結構型商品管理規則。 如 境外結構型商品之來源為發行人或總代理人(依境外結構型商品規則定義) ，不須申報。
發行機構代號		X(7)		「商品型態」為2、F、G、H者，依【表C】「發行機構及保證機構代號一覽表」填報。 保險公司申報「商品型態」為「1：結構型商品」者，請依「TR簽約機構一覽表」填報。 【檢核】申報機構類別為「證券商」、「保險公司」及「信託業」者，且商品型態填報2、F、G、H，本欄為必要欄位，並應符合「TR簽約機構一覽表」及【表C】所列代號。
保證機構代號		X(7)		「商品型態」為2、F、G、H者，依【表C】「發行機構及保證機構代號一覽表」填報。 保險公司申報「商品型態」為「1：結構型商品」者，請依「TR簽約機構一覽表」填報。

				【檢核】申報機構類別為「證券商」、「保險公司」及「信託業」者，且商品型態填報2、F、G、H，本欄為必要欄位，並應符合「TR簽約機構一覽表」及【表C】所列代號。
商品成立日期	年	9(4)	西元年	發行日期 (the issue date) 或生效日 (the effective date)
	月	9(2)	月	
	日	9(2)	日	
商品到期日期	年	9(4)	西元年	【檢核】商品成立日期必須小於商品到期日期。 商品最終到期日
	月	9(2)	月	
	日	9(2)	日	
名目本金幣別		X(3)	依「國際貨幣代碼一覽表」輸入	本欄為必要欄位，請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」
名目本金金額		9(15)V(2)	單位：元	本欄為必要欄位，請填「名目本金幣別」之金額。
商品種類		X(1)	1：保本型商品 2：非保本型商品	保本率100%（含）以上申報至保本型商品；保本率100%（不含）以下，申報至非保本型商品。
標的風險類別		X(1)	1：利率相關 2：匯率相關 3：權益證券相關 4：商品相關 5：信用相關 6：銀行業承作台股股權相關 Z：其他	1.本欄位係以結構型商品契約隱含之主要風險為分類標準，分為利率、匯率、權益證券、商品及信用五類。 2.「權益證券相關」含股價、ETF、REITs及指數等。 3.若屬複合型結構型商品，應填報所隱含主要風險類別，若對風險分類有疑義時，則適用下列順序填報於該類風險欄位中：（1）信用、（2）商品、（3）權益證券、（4）匯率、（5）利率。若不屬於上述各類請填報於其他有關契約欄位，但填報其他須於後以文字表達該檔商品之中文名稱。 4銀行辦理台股股權結構型商品業務請填報6:銀行業承作台股股權相關
標的資產明細		X(120)		本欄為必要欄位，匯率相關者請參照【表B】「國際貨幣代碼一覽表」，其餘參照【表D】「標的資產明細代號表」說明填報，如連結標的超過一個者，各代碼間以"/"區隔。
客戶別及客戶數	1：國內金融機構	9(7)		本欄為必要欄位。 請填該檔商品各類客戶別之客戶數。 1.「國內」或「國外」係以交易對象所在地為區分標準，因此「國內」包含外國金融機構在台分支機構、外國人在台設立之分公司及取得中華民國政府給予居留權之外國投資人。 3. 交易對手為國內金融機構OBU請填報「國內金融機構」。 4. 交易對手為OBU客戶請填報「國外法人、個人」。 5.交易對手為信託業請填報「國內其他法人」。
	2：國內政府機構(含政府基金)	9(7)		
	3：國內其他法人	9(7)		
	4：國內個人	9(7)		
	5：國外金融機構	9(7)		
	6：國外法人、個人	9(7)		
履約價格		9(4)V9(4)		連結標的為國內上市櫃股票或ETF者，本欄為必要欄位。惟契約有多個履約價或履約價為公式計算等情形，履約價無法以單一價格表達者，請填「0」。
預計履約數量		9(10)		連結標的為單一國內上市櫃股票或ETF者，本欄為必要欄位。
標的型態為其他的說明		X(50)		「標的風險類別」填報「Z：其他」者，請填報該檔商品之商品中文名稱。 【檢核】標的風險類別為其他者，本欄須說明商品中文名稱
資料結尾識別碼		X(2)		0d0a

說明：

一、txt 格式

1. 9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，採右靠左補0。
2. X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，採左靠右補空白。

二、txt資料內容：固定長度，320位元組。

三、csv格式

1. 9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，母須補 0。
2. X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，母須補空白。

四、csv資料內容

1. 各欄位資料以逗號結尾區隔下一欄位。
2. 若該欄位無資料則填一逗號。
3. 每筆資料最後一欄無論有無資料均不加逗號。

五、檔案結構：傳輸必須為 LINE SEQUENTIAL FILE (必須含 0d0a)。

六、傳輸時間：營業日 9:00 ~ 17:00。

七、傳輸方式

1. 證券商總、分公司交易由總公司合併申報。
2. 每日進行檔案傳輸前，須將資料存入規定之檔案名稱內，一次傳送完畢，若發現傳輸內容錯誤或資料不完整時，得重新傳輸，惟本中心作業時，僅處理最後一版檔案（後檔案將覆蓋前傳檔案）。
3. 證券商應於於規定時間內將成交資料傳送至本中心。

七、未到期之結構型商品

八、檔案名稱：資料檔名為SP。

九、申報機構應於每個月15日前，依格式C-MTM填報未到期結構型商品(含境外結構型商品)之契約市價。

格式E (結構型商品日資料異動格式) 檔名：SPM.txt或SPM.csv				
序號	欄 位	格 式	內 容	說 明
1	資料庫異動類別	X(1)	1：提前到期	1、2：全部或部分提前到期/解約 3：原商品(即格式D已存在之產品代號)再次開放申購
			2：提前解約	
			3：再次申購	
2	產品代號	X(20)		原申報產品代號
3	生效日	年	9(4)	西元年
		月	9(2)	
		日	9(2)	
4	到期/解約/申購名目本金金額	9(15)V(2)	單位：元	提前到期/解約之金額
5	資料結尾識別碼	X(2)	0d0a	

說明：

一、txt 格式

1. 9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，採右靠左補0。
2. X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，採左靠右補空白。

二、txt資料內容：固定長度，48位元組。

三、csv格式

1. 9(a)表數字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，毋須補 0。
2. X(a)表文字格式，其中a為欄位長度，長度不足時，毋須補空白。

四、csv資料內容

1. 各欄位資料以逗號結尾區隔下一欄位。
2. 若該欄位無資料則填一逗號。
3. 每筆資料最後一欄無論有無資料均不加逗號。

五、檔案結構：傳輸必須為 LINE SEQUENTIAL FILE (必須含 0d0a)。

六、傳輸時間：營業日 9:00 ～ 17:00。

七、檔案名稱：資料檔名為SPM。

八、如境外結構型商品之來源為發行人或總代理人(依境外結構型商品規則定義)，不須申報。