

附表二

## 格式C (月資料申報格式) 檔名: MTM

序號	欄位	格式	內 容	備註
1	申報資料序號	X(20)		原申報機構自行編製之"資料序號"與結構型商品之產品代號
2	評價日	9(4)	西元年	請填報評價日之年月(月底)
	年	9(2)	月	
3	Dollar Delta	S9(12)V(2)	單位: 元	1. 避險交易免填報(格式A 交易動機填報1~3者) 2. 利率類免填報(含IRO與SWPT) 3. 限選擇權填報 4. Dollar Equivalent Delta: 交易契約之名目本金 $\times$ Delta值 5. 請依正負值加正負號 6. 若為匯率選擇權請填報被報價幣別之Dollar Delta
4	PVBP	S9(8)V(2)	單位: 新台幣元	1. 避險交易免填報(格式A 交易動機填報1~3者) 2. 限利率類商品填報 3. 殖利率曲線平行上移1BP產生的契約市價變動值 4. 請依正負值加正負號 5. 信用違約交換(CDS)請填CR01: credit spread curve平行上移1個基本點產生的契約市價變動值
5	契約市價	S9(12)V(2)	單位: 新台幣元(結構型商品為%)	1. 衍生性商品與結構型商品交易均須填報(所有的格式A與格式D未到期契約均須申報) 2. 請填報契約重置成本 3. 選擇權商品之契約市價之正負號原則上應與期初收付金額之正負號相同, 即買進選擇權之契約市價應填報負值, 賣出選擇權之契約市價應填報正值(一筆申報資料同時包含買選擇權與賣選擇權者除外) 4. 結構型商品(含境外結構型商品)請於契約市價欄位填入參考市價, 參考市價請以百元價表示。例如參考市價為98.34%, 請填入"00000000009834"
6	信用風險抵減	X(1)	1: 適用 2: 不適用	1. 請依各業別衍生性商品雙邊淨額結算合約之信用風險抵減規定填報是否適用信用風險抵減 2. 申報機構為保險公司請填"空白"
7	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, 70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MTM。

## 八、格式D-結構型商品(含境外結構型商品)不須填報Dollar Delta、PVBP與信用風險抵減欄位

## 九、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)或境內代理人, 不須申報。