

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

中央銀行 99 年 9 月 3 日台央業字第 0990044347 號函同意備查
行政院金融監督管理委員會 99 年 9 月 6 日金管銀票字第 09900343820 號函准予備查

第一章 總則

第一條 中華民國票券金融商業同業公會為建立公正之短期票券報價利率指標，並促進金融市場使用短期票券利率之健全發展，特訂定本規範。

第二條 本規範以票券金融管理法之主管機關為主管機關。

第三條 本規範用詞定義如下：

- 一、臺灣短期票券報價利率指標（以下簡稱利率指標）：指報價金融機構傳輸至臺灣集中保管結算所股份有限公司（以下簡稱集保結算所）之報價利率資料，於每一營業日上午十一時整依一定之公式計算出之利率。
- 二、報價金融機構：指依本規範第二章規定選定之金融機構。
- 三、當日報價利率：指報價金融機構於營業日依各天期別於其營業場所或網站公開揭露之初級市場承銷及次級市場買賣牌告利率。
- 四、報價時間：指每營業日上午九時至中午十二時。

第二章 報價金融機構之遴選

第四條 本公會應依下列原則，由本公會會員中選定二十家以上之報價金融機構：

- 一、專營票券商為當然報價金融機構。
- 二、最近一年短期票券次級市場交易量市佔率達一定比率以上之兼營票券業務銀行及證券商。
- 三、資金充沛之本國銀行。
- 四、最近一年曾辦理短期票券交易，或經選定之外商銀行。

本公會選定前項報價金融機構後，應報請主管機關及中央銀行備查。

第五條 本公會原則每年定期或必要時召開報價金融機構遴選會議，並邀請主管機關或中央銀行派員列席指導，及中華民國銀行商業同業公會、中華民國證券商業同業公會、集保結算所列席。

第 六 條 金融機構經選定為報價金融機構且經主管機關及中央銀行備查後，應於一個月內完成與集保結算所簽約及資訊系統連線等相關作業。

第三章 利率指標之蒐集、編製、揭示與使用

第 七 條 報價金融機構應於每一營業日上午九時十五分前，將當日報價利率輸入至集保結算所指標編製系統（以下簡稱指標編製系統），當日報價時間內，報價金融機構變更報價利率時應重新輸入。

前項當日報價利率輸入之內容如下：

- 一、初級市場報價：指報價金融機構承銷（不含保證費）之商業本票報價利率。
- 二、次級市場報價：指短期受益證券或資產基礎證券以外之短期票券買入及賣出報價利率。

第 八 條 集保結算所應於每一營業日上午十一時整，依下列方式計算初級及次級市場之利率指標：

- 一、初級市場取各報價金融機構之各天期報價；次級市場依各報價金融機構之各天期買入報價及賣出報價計算中價。
- 二、分別將前款初級市場各天期報價及次級市場各天期中價，由高至低排序，並剔除各天期最高及最低五分之一家數之報價及中價後，取中間佔總家數五分之三之報價及中價，簡單平均計算初級及次級市場之利率指標。
- 三、前款最高及最低報價金融機構之家數無法整除時，採無條件捨去取整數。
- 四、報價金融機構未於每一營業日上午十一時前輸入當日報價利率，該報價金融機構之利率視為最低，並適用第二款剔除規定。
- 五、第一款各天期買價及賣價計算中價，及第二款利率指標之計算，皆四捨五入至小數點以下第四位。

第 九 條 集保結算所應於該公司網站公告下列資訊：

- 一、各報價金融機構最新報價利率。
- 二、當日之利率指標。
- 三、利率指標之歷史資料。

前項資訊集保結算所得授權資訊廠商等機構揭露及使用。

第四章 利率指標作業之監控及突發狀況之處理

第十條 集保結算所應指定專責部門於每一營業日即時監控報價金融機構利率傳輸及報價利率內容等情形，並即時提供相關資訊予主管機關及中央銀行參考。

第十一條 集保結算所監控人員發現或經相關單位通知以下異常情形時，應通知本公會：

一、報價金融機構當日未進行報價。

二、報價金融機構對連續三日定盤時之報價利率，呈現一定比率之V型或倒V型現象。

三、其他經本公會認定屬異常情事。

本公會應視異常影響程度，請集保結算所提供相關資料，並請發生異常情形之金融機構說明，或召開臨時評議會，就報價金融機構之異常情形進行評議。

經本公會就異常情形評議，除有合理原因或不可歸責於報價金融機構之情事並經認可外，得予以警告、要求改善、或取消其報價金融機構資格，並副知主管機關及中央銀行。

第十二條 報價金融機構傳輸利率時，如遇斷線或其他因素致無法傳輸至指標編製系統，應立即以電話通知集保結算所，並應將當日報價利率以書面方式傳真至集保結算所。

集保結算所應於接收報價金融機構傳真後三十分鐘內，將該報價金融機構傳真書面上記載之利率輸入至指標編製系統。

第十三條 集保結算所如遇資訊系統異常致無法公告當日之利率指標時，應將相關資訊傳真至本公會辦理公告。

第五章 附則

第十四條 本規範經中華民國票券金融商業同業公會理監事會討論通過，報經主管機關及中央銀行備查後施行，修正時亦同。