臺灣集中保管結算所股份有限公司
TDCC Taiwan Depository & Clearing Corporation

短期票券利率指標編製系統

票券商介面規格書

V4.2

中 華 民 國 1 0 1 年 九 月 十 日

Sep 10, 2012

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

目　錄

1 前言 1
1.1 一般說明 2
1.1.1 系統目的與範圍 2
1.1.2 系統架構與連線方式 4
1.1.3 安控機制 6
1.1.4 作業服務時間 7
1.1.5 利率指標說明 8
1.1.6 國庫券利率指標說明 13
1.2 作業流程 14
1.2.1 報價利率作業 14
1.2.2 票券成交明細資料作業 15
1.2.3 補正事項作業 16
1.2.4 取消事項作業 17
1.2.5 成交利率指標作業 18
1.2.6 公告事項作業 19
1.2.7 初次級市場報價利率作業 20
1.2.8 國庫券成交利率指標作業 22
1.3 訊息格式及欄位型態屬性 23
1.3.1 票券商連接介面訊息格式 25
1.3.2 電文訊息附加說明 38
1.4 傳檔工作站作業 40
1.5XML DTD 檔案 42
1.6MQ 規範 46
1.6.1 主機對主機連線 MQ Server 命名規則與設定 46
1.6.2 傳檔工作站 MQ 命名規則與設定 50
1.6.3 主機對主機連線方式 MQ 相關注意事項 51
1.7 附錄 52
1.7.1 附錄一(電文回覆訊息說明) 52
1.8 版本異動說明 55

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

文件修訂履歷

發行/修訂 版次	發行/修訂 生效日期	發行與變更 說明	備 註
1.0	2002/06/05	新版第一次發行	
1.1	2003/05/02	如附錄 1.8	
2.0	2004/02/02	如附錄 1.8	
3.0	2006/03/27	如附錄 1.8	
4.0	2007/10/29	如附錄 1.8	增加A05訊息相關流程
4.1	2009/06/24	如附錄 1.8	
4.2	2012/09/10	如附錄 1.8	

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1 前言

「短期票券利率指標編製系統」之「連線介面規格書」(以下簡稱介面規格書)係民國 91 年依據財政部金融局委託對票券市場交易利率指標資訊之編製規劃及期貨交易所商品研究小組之規劃，並參酌臺灣集中保管結算所股份有限公司(以下簡稱集保結算所)之業務作業需求編撰而成。本介面規格書適用於「主機對主機」及「傳檔工作站」與集保結算所連線之票券商的連線作業規範。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1一般說明

本介面規格書主要在說明短期票券利率指標編製系統(以下簡稱本系統)作業中，票券商之主機或傳檔工作站與集保結算所主機間之各項介面規定。內容包括有：系統架構、連線方式、安控機制、作業流程說明、傳檔工作站說明、訊息格式、XML DTD、與 MQ 規範等。

1.1.1 系統目的與範圍

1.1.1.1 系統目的

本系統建置主要目的，在為票券市場建立一個高效率、安全可靠之電子化交易資訊提供與利率指標運算的機制，透過系統之運行，進而達到票券市場交易資訊的透明化、減少投資風險、提高交易效率、活絡交易市場等長遠目標。

1.1.1.2 系統範圍

	專營票券商	兼營票券商
輸單作業	1.當日報價利率傳送作業 2.票券成交明細資料傳送作業 3.票券成交明細資料補正傳送作業 4.票券成交明細資料取消傳送作業 5.初次級市場報價利率傳送作業	1.初次級市場報價利率傳送作業 2.票券成交明細資料傳送作業 3.票券成交明細資料補正傳送作業 4.票券成交明細資料取消傳送作業
行情揭示作業	1.當日報價利率揭示作業 2.成交利率指標行情揭示作業 3.公告事項作業 4.當日初次級市場報價利率揭示作業 5. TAIBIR當日最新初級市場報價利率 6. TAIBIR當日最新次級市場報價利率 7. TAIBIR當日初級市場定盤利率 8. TAIBIR當日次級市場定盤利率 9. TAIBIR歷史初級市場定盤利率 10. TAIBIR 歷史次級市場定盤利率	1.TAIBIR當日最新初級市場報價利率 2.TAIBIR當日最新次級市場報價利率 3.TAIBIR當日初級市場定盤利率 4.TAIBIR當日次級市場定盤利率 5.TAIBIR歷史初級市場定盤利率 6.TAIBIR歷史次級市場定盤利率 7.成交利率指標行情揭示作業 8.公告事項作業

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有所有，未經本公司同意不准引用或翻印

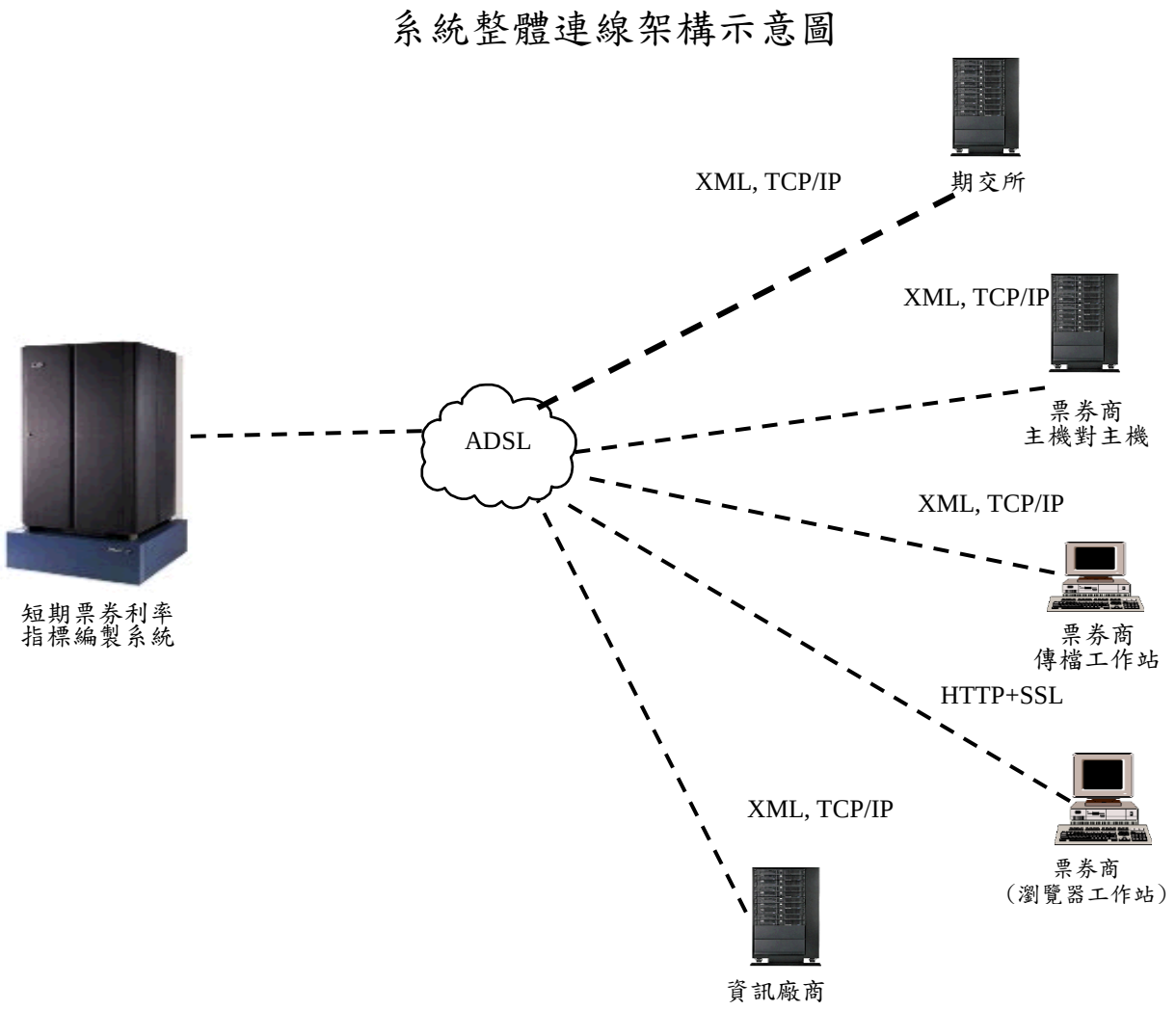
說明：

1.資料傳送作業提供專/兼營票券商端瀏覽器輸入及電文格式。

2.行情揭示作業提供專/兼營票券商端瀏覽器工作站查詢。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.2 系統架構與連線方式



> 各參加單位以64K以上之專線與集保結算所連線

> 資料傳輸格式以XML為標準

> 各參加單位使用ADSL VPN為標準

> 除了瀏覽器工作站外，所有訊息皆使用TCP/IP over frame relay之通訊協定並透過MQ傳送

1.1-1 系統架構與連線方式示意圖

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

票券商可使用下列方式連線至集保結算所：

1. 瀏覽器工作站：以專線、固定 IP、TCP/IP over frame relay、HTTPS 方式。票券商透過瀏覽器工作站之瀏覽器輸入報價利率、成交明細資料、成交明細資料補正、成交明細資料取消等訊息，並透過瀏覽器工作站之瀏覽器直接瀏覽利率指標行情及公告事項。
2. 傳檔工作站：以專線、固定 IP、TCP/IP over frame relay、MQ Client 方式。 由集保結算所提供應用程式供票券商傳送報價利率、成交明細資料、成交明細資料補正、成交明細資料取消。票券商需先將成交明細資料組成 XML 檔案格式並置於工作站之傳送專屬目錄下，應用程式會逐筆讀取該傳送專屬目錄下之報價利率及成交明細資料 XML 檔案，再逐筆傳送至本系統。有關利率指標行情及公告事項則須透過瀏覽器工作站之瀏覽器瀏覽。
3. 主機對主機：以專線、固定 IP、TCP/IP over frame relay、MQ Server 方式。票券商以專線方式，透過 MQ 傳送報價利率、成交明細資料、成交明細資料補正、成交明細資料取消。有關利率指標行情及公告事項則須透過瀏覽器工作站之瀏覽器瀏覽。

各單位在申請加入本系統時，應視本身需求提出與本系統之連線方式(傳檔工作站或主機對主機只能選一種)及瀏覽器工作站組數，系統將分派適當 TCP/IP 位址。分派之 TCP/IP 位址不得任意變更，否則將導致無法連線。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.3 安控機制

本系統之安控機制依據連線之方式，共分為三類：

1.主機對主機。

2.傳檔工作站。

3.瀏覽器工作站。

系統連線所提供的安全機制如下：

1. 所有票券商均透過專線及固定 IP 的管制與本系統連線。
2. 在票券商的資料傳輸上應加裝路由器(Router)亂碼功能。
3. 針對瀏覽器工作站提供：
   - 參加單位的帳號密碼的認證機制。
   - HTTP + SSL Protocol。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.4 作業服務時間

作業項目	起始時間	結束時間
連線作業	8:30 開始連線	---
報價利率	8:30	15:30
初次級市場報價利率	8:30	15:30
票券成交明細資料	9:00	15:30
票券成交明細資料補正	9:00	15:30
票券成交明細資料取消	9:00	15:30
瀏覽器工作站資料查詢	9:00	17:00
系統關機	17:00 系統離線	---

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.5 利率指標說明

1.1.5.1 標的物

每筆賣斷與附買回條件賣出交易之 CP2。

1.1.5.2 利率指標商品

成交分盤利率指標。

成交累計利率指標。

1.1.5.3 各天期指標選取交易天期定義

利率指標	選取交易天期
一月期	21 天~31 天
三月期	61 天~90 天
六月期	151 天~180 天
九月期	241 天~270 天
十二月期	331 天~360 天

1.1.5.4 營業時間

每日早上九點到下午三點半。

1.1.5.5 分盤間距

每 15 分鐘為一盤。

1.1.5.6 分盤計算

成交分盤只計算一分盤時間的票券成交明細資料。

成交累計則是計算當日一開始(早上八點半)到分盤時間整的票券成交明細資料。

1.1.5.7 分盤時間定義說明

九點成交分盤時間定義為當日早上九點以前(含早上九點整)選樣資料。

九點成交累計時間定義為當日早上九點以前至早上九點以前(含九點整)選樣資料。

九點十五分成交分盤時間定義為當日早上九點以後(不含早上九點整)至早上九點十五分以前(含早上九點十五分整)選樣資料。

九點十五分成交累計時間定義為當日早上九點十五分以前(含九點十五分整)選樣資料。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.5.8 利率指標計算方式-成交分盤指標

變數定義：Ri 為每筆票券之成交利率，Qi 為每筆票券之成交金額

1.讀取該分盤所接收成交明細資料(接收時間介於分盤起始時間(不包含)及分盤結束時間(包含))

2.依據系統設定之天期天數設定(比如一月期的天期天數設定是 21 到 31 天)，檢核交易天數(剔除交易天數非落於天期天數設定中之資料)

3.以步驟 2 剩餘資料計算 Q_i 之平均數 $\overline{Q}$

4.定義新變數 X_i 為 $(R_i \times Q_i) / \overline{Q}$

5.計算 X_i 之平均數 $\overline{X}$ 及標準差 S_X ，標準差之計算公式如下。

$$S_X = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^{n}(X_i - \overline{X})^2}{n-1}} = \sqrt{\frac{n\sum X_i^2 - (\sum X_i)^2}{n(n-1)}}$$

6.依據 X 之 90%信賴區間($\overline{X}$ – 1.645×Sx ~ $\overline{X}$ + 1.645×Sx) ，剔除頭尾兩端 X_i 所對應資料，但若該筆成交金額大於或等於總成交金額之 5%則不予剔除

7.計算過程採至小數點第八位，超過位數無條件捨去

8.剩下之 Ri 及 Qi 計算即時指標(四捨五入至小數點以下五位)

9.即時指標計算方式為

SUM (Ri × Qi) ÷ SUM (Qi)

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.5.9 利率指標計算方式-成交累計指標

變數定義：Ri 為每筆票券之成交利率，Qi 為每筆票券之成交金額

1.讀取當日所接收成交明細資料(接收時間小於或等於分盤結束時間)

2.依據系統設定之天期天數設定(比如一月期的天期天數設定是 21 到 31 天)，檢核交易天數(剔除交易天數非落於天期天數設定中之資料)

3.步驟 2 剩餘資料計算 Q_i 之平均數 $\overline{Q}$

4.定義新變數 X_i 為 $(R_i \times Q_i) / \overline{Q}$

5.計算 X_i 之平均數 $\overline{X}$ 及標準差 S_X 標準差，標準差之計算公式如下。

$$S_X = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^{n}(X_i - \overline{X})^2}{n-1}} = \sqrt{\frac{n\sum X_i^2 - (\sum X_i)^2}{n(n-1)}}$$

6.依據 X 之 90%信賴區間($\overline{X}$ – 1.645×Sx ~ $\overline{X}$ + 1.645×Sx) ，剔除頭尾兩端 X_i 所對應資料，但若該筆成交金額大於或等於總成交金額之 5%則不予剔除

7.計算過程採至小數點第八位，超過位數無條件捨去

8.剩下之 Ri 及 Qi 計算即時指標(四捨五入至小數點以下五位)

9.即時指標計算方式為

SUM (Ri × Qi) ÷ SUM (Qi)

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.5.10 票券成交明細資料補正對短利指標之影響

票券成交明細資料補正功能 : 更正已傳送之錯誤資料

以下是範例說明

時間	票券商執行情形	分盤指標影響	累計指標影響
8:55	傳送一筆參考編號為003 的 CP2 票券成交明細資料		
9:00		參考編號為 003 的資料納入指標計算中.	參考編號為 003 的資料納入指標計算中.
9:25	更正原先參考編號為003 的成交明細資料,發送一筆更正參考編號為002,原始參考編號為003 的更正指令		
9:30		參考編號為 003 的資料不納入指標計算中.	已更正過參考編號為003 的資料納入指標計算中.
9:40	更正原先參考編號為003 的成交明細資料,發送一筆更正參考編號為004,原始參考編號為003 的更正指令		
9:45		參考編號為 003 的資料不納入指標計算中.	已再次更正過參考編號為 003 的資料納入指標計算中.

補充說明:

1.黃色部份為指標計算會受影響。

2.**補正功能:**在傳送補正的成交明細資料時,系統會註明原交易資料的參考編號,故每次補正成交資料時,該盤的分盤指標並不會受影響,且該盤累計指標是以最後補正的資料納入計算,符合補正原則。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.5.11 票券成交明細資料取消對短利指標之影響

票券成交明細資料取消功能 : 取消已傳送之成交明細資料

以下是範例說明

時間	票券商執行情形	分盤指標影響	累計指標影響
8:55	傳送一筆參考編號為 003 的 CP2 票券成交明細資料		
9:00		參考編號為 003 的資料納入指標計算中.	參考編號為 003 的資料納入指標計算中.
9:25	取消原先參考編號為 003 的成交明細資料,發送一筆取消參考編號為 001,原始參考編號為 003 的取消指令		
9:30		參考編號為 003 的資料不納入指標計算中.	參考編號為 003 的資料不納入指標計算中.

補充說明:

1.黃色部份為指標計算會受影響。

2. **取消功能:**當票券保管結算交割系統確認**交易取消**後,票券商傳送取消指令到 SIRIS 系統,該盤的分盤指標不會受影響和累計指標則將錯誤部分刪除後計算。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.1.6 國庫券利率指標說明

1.1.6.1 標的物

每筆賣斷與附買回條件賣出(RP 賣出)交易之 TB。

1.1.6.2 利率指標商品

國庫券成交利率指標。

1.1.6.3 各天期指標選取交易天期定義

期別	選取交易天期
10 天期	1 天~10 天
20 天期	11 天~20 天
30 天期	21 天~30 天
60 天期	31 天~60 天
90 天期	61 天~90 天
120 天期	91 天~120 天
150 天期	121 天~150 天
180 天期	151 天~180 天
365 天期	181 天以上

1.1.6.4 營業時間

每日早上九點到下午三點半。

1.1.6.5 分盤間距

每一營業日下午 3 點半後產製。

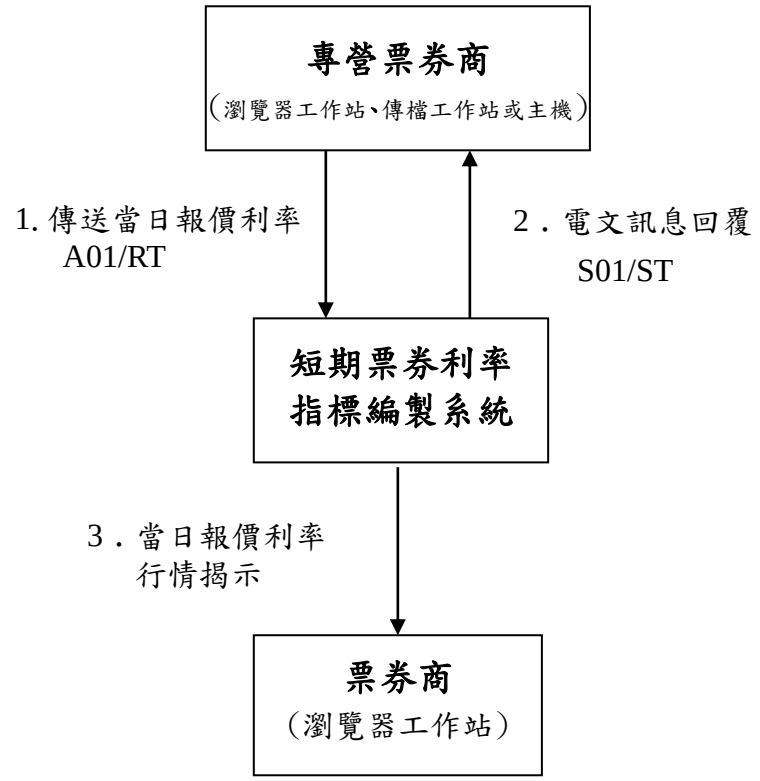
1.1..6 計算方式

採加權平均計算之方式，按各交易天期每筆賣斷與 RP 賣出之交易利率乘以該筆成交量之總和除以總成交量(四捨五入至小數第三位)。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2作業流程

1.2.1 報價利率作業



1.2-1 報價利率作業流程圖

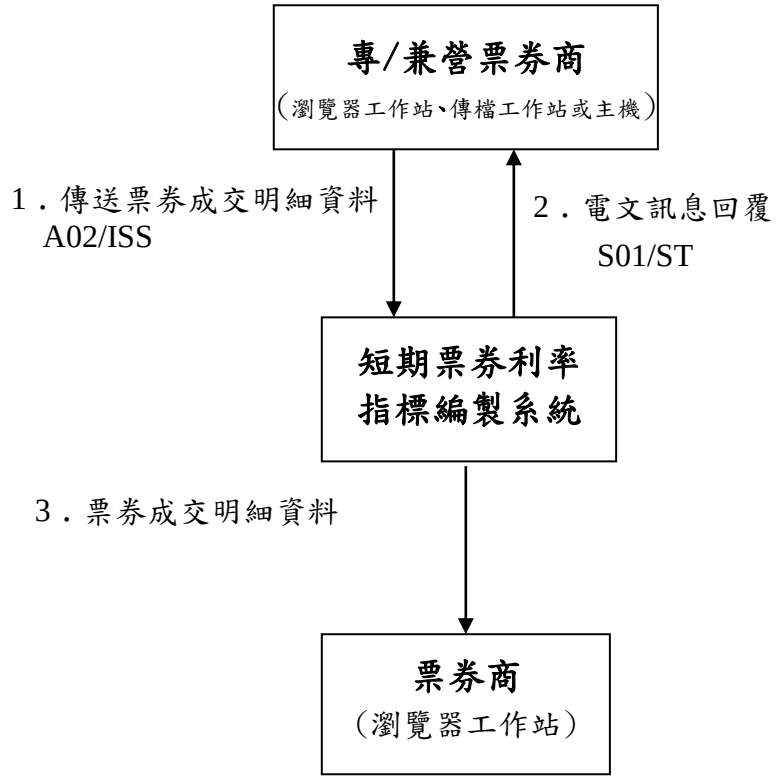
作業說明:

「報價利率」為各票券商每日開市公告之票券交易利率，交易利率分為一個月期、三個月期、六個月期、九個月期、以及十二個月期。每日一開市各票券商之各天期「報價利率」資料透過瀏覽器工作站、傳檔工作站或主機傳送至本系統，本系統統計各票券商各天期「報價利率」資料後，將公佈於瀏覽器工作站的行情揭示系統中。

票券商當日各天期「報價利率」若有異動時，亦需將異動後之「報價利率」資料依上述作業方式傳送至本系統。本系統更新各票券商各天期「報價利率」資料後，亦將公佈於瀏覽器工作站的行情揭示系統中。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.2 票券成交明細資料作業



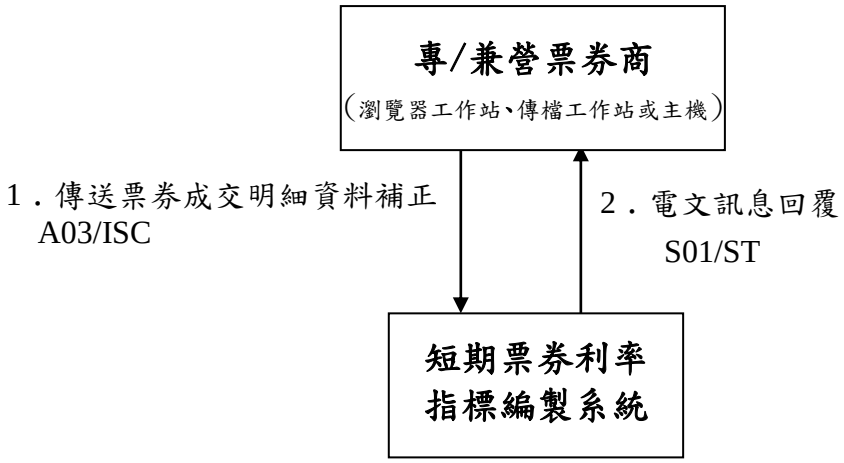
1.2-2 票券成交明細資料作業流程圖

作業說明:

「票券成交明細資料」的輸單時間，由每日的上午九時到下午十五時三十分為止。票券商當日之「票券成交明細資料」透過瀏覽器工作站、傳檔工作站或主機傳送至短期利率指標編製系統，票券商可透過瀏覽器工作站查詢到當日所傳送的票券成交明細資料。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.3 補正事項作業



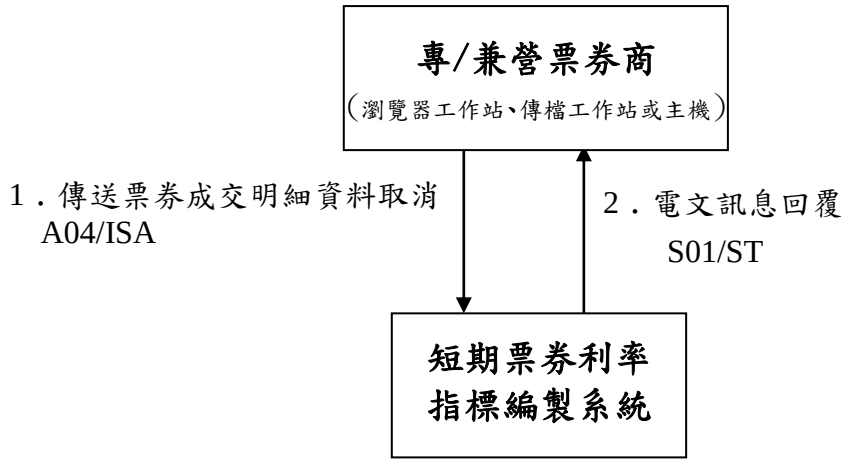
1.2-3 成交利率補正作業流程圖

作業說明:

「票券成交明細資料補正」的輸單時間，由每日的上午九時到下午十五時三十分為止。票券商當日之「票券成交明細資料補正」透過瀏覽器工作站、傳檔工作站或主機傳送至短期利率指標編製系統，系統根據票券成交明細資料補正，重新修正成交累計利率指標。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.4 取消事項作業



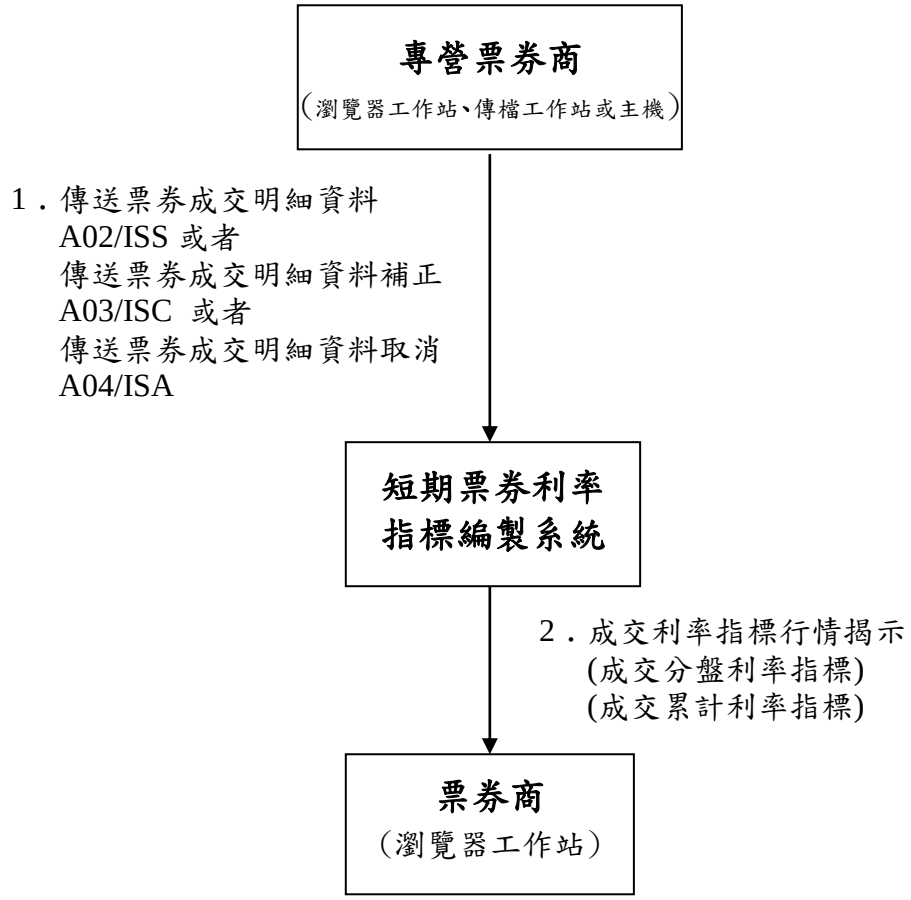
1.2-4 成交利率取消作業流程圖

作業說明:

「票券成交明細資料取消」的輸單時間，由每日的上午九時到下午十五時三十分為止。票券商當日之「票券成交明細資料取消」透過瀏覽器工作站、傳檔工作站或主機傳送至短期利率指標編製系統，系統根據票券成交明細資料取消，重新修正成交累計利率指標。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.5 成交利率指標作業



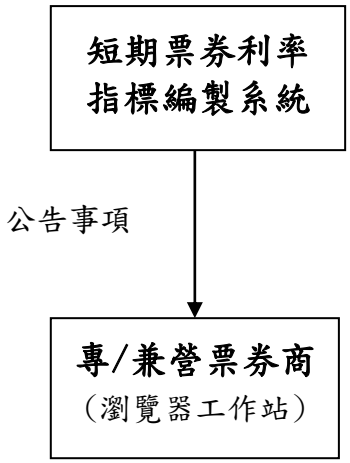
1.2-5 成交利率指標作業流程圖

作業說明:

票券商當日之「票券成交明細資料」或「票券成交明細資料補正」或「票券成交明細資料取消」透過瀏覽器工作站、傳檔工作站或主機傳送至短期利率指標編製系統，每十五分鐘(分盤時間) ，系統計算出成交分盤利率指標及成交累計利率指標後，將其利率指標行情公佈於瀏覽器工作站的行情揭示系統中。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.6 公告事項作業

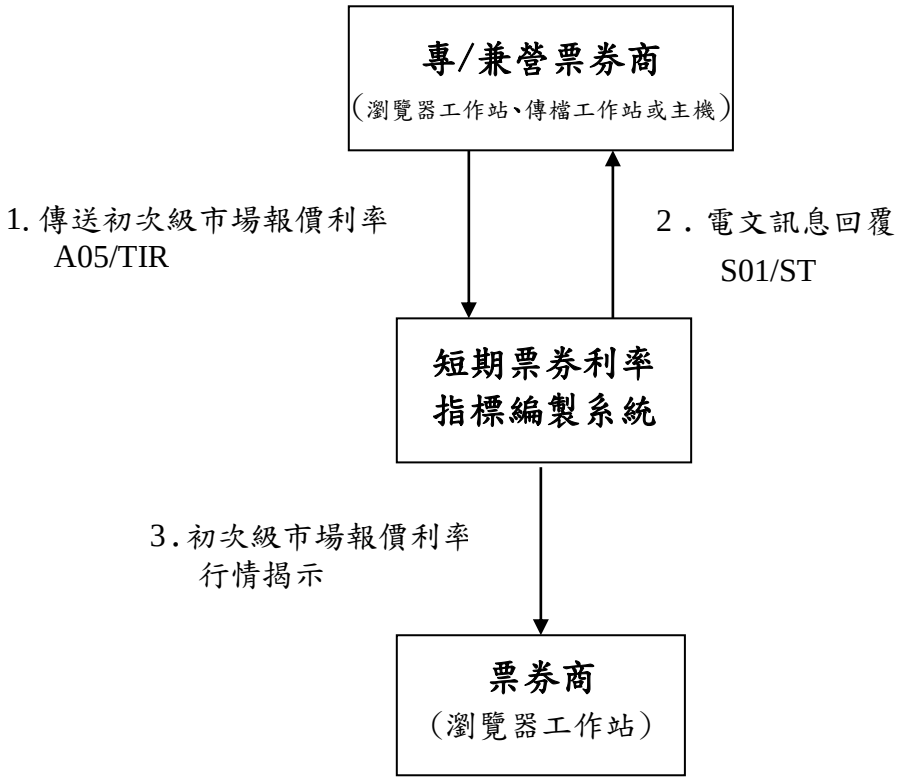


1.2-6 公告事項作業流程圖

「公告事項」由集保結算所因業務及其他事宜所需，公佈於瀏覽器工作站的公告系統中。由每日的上午九時，到下午十七時為止，不定時公告。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.7 初次級市場報價利率作業



1.2-7 初次級市場報價利率作業流程圖

作業說明:

「初次級市場報價利率」為各票券商每日開市公告之票券交易利率，交易利率分為(1)初級市場 CP2 承銷(註 1) (2)次級市場 ABCP 以外買入 (3)次級市場 ABCP 以外賣出 (4)次級市場 ABCP 買入(註 2) (5)次級市場 ABCP 賣出(註 2)共五組，分別有(1)10 天期、(2)20 天期、(3)30 天期、(4)60 天期、(5)90 天期、(6)120 天期、(7)150 天期、(8)180 天期、(9)365 天期。每日一開市各票券商之各天期「初次級市場報價利率」資料透過瀏覽器工作站、傳檔工作站或主機傳送至本系統，本系統統計各票券商各天期「初次級市場報價利率」資料後，將公佈於瀏覽器工作站的行情揭示系統中。

註 1：初級發行利率報價係指報價金融機構承銷（不含保證費）之商業本票報價利率。

註 2：ABCP 以外係指 CP1、CP2、BA 及 NCD 等短期票券；兼營票券商不需輸入次級市場 ABCP 及 TB 報價利率，資料預設以不報價規格送出。

票券商當日各天期「初次級市場報價利率」第一盤資料需於當日 9:15

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

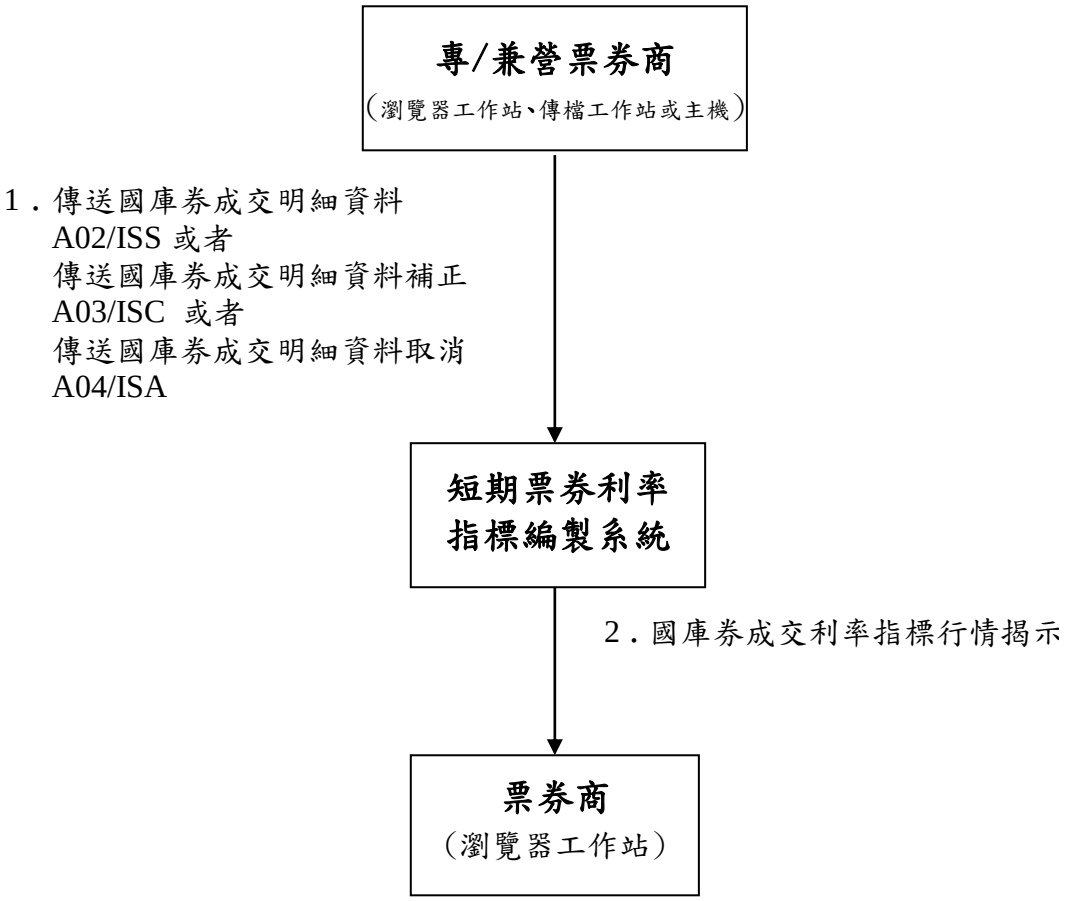
前依上述作業方式傳送至本系統。若有異動時，亦需將異動後之「初次級市場報價利率」資料依上述作業方式傳送至本系統。本系統更新各票券商各天期「初次級市場報價利率」資料後，亦將公佈於瀏覽器工作站的行情揭示系統中。

各天期定義如下:

期別	選取交易天期
10 天期	1 天~10 天
20 天期	11 天~20 天
30 天期	21 天~30 天
60 天期	31 天~60 天
90 天期	61 天~90 天
120 天期	91 天~120 天
150 天期	121 天~150 天
180 天期	151 天~180 天
365 天期	181 天以上

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.2.8 國庫券成交利率指標作業



1.2-8 國庫券成交利率指標作業流程圖

作業說明:

「國庫券成交明細資料」則於日終由系統計算出成交行情及指標後，將其利率資訊行情公佈於瀏覽器工作站的行情揭示系統中。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3訊息格式及欄位型態屬性

1. 訊息格式定義之設計原則

(1) 票券及行情資料之相關金額欄位均以新台幣元為單位基礎。

(2) 本系統定義之所有訊息均包含訊息標頭(Message Header)及訊息主體(Message Body)兩部分。

(3) 訊息標頭包含以下欄位：

所有參加單位傳送至本系統之訊息(Inbound Message)：

訊息代號：MSG_TYPE
功能碼：ACTION
使用者代號：ORIGIN
註記：NARR
時間戳記：TS
發送者參考編號：SNDR_REF
系統營業日期：SIRIS_BUS_DT

(4)訊息欄位表頭之定義與說明：

例如：

1.3.1.1 當日報價利率傳送指令： A01/RT (OPEN_RATE_IN)

"A01" ：訊息代號。

"RT" ：功能碼。

"OPEN_RATE_IN" ：XML 組態之元素(Element)，非對應至參考功能碼之作業簡稱。

2. 訊息欄位型態暨屬性定義

訊息欄位型態格式：

欄位型態	欄位型態描述	表示方式
A	英文字母	一般表示方式，且不需補足欄位長度
C	英文字母及數字	一般表示方式，且不需補足欄位長度
N	數字	一般表示方式，且不需補足欄位長度 (例一)交易利率 7.2% → 0.072 (例二)交易金額 16,801,500 元→ 16801500
X	英文字母、數字與特殊字元	一般表示方式，且不需補足欄位長度
D	日期	限定之格式為 YYYY-MM-DD(西元年-月-日)

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

T	日期時間	限定之格式為 YYYY-MM-DDTHH:MM:SS (西元年-月-日 T 時:分:秒)

屬性定義：

屬性	描述	是否需組成 XML 訊息格式
E：Empty		否
M：Mandatory	必須輸入之欄位	是
O：Option	選擇性輸入欄位	如欄位需填值者，則需組成 XML 訊息格式，反之則否。

欄位說明：

利率之欄位長度如為 6(1,5) ，則 7.2% 之表示方式為 0.072 非 0.07200。

3. 縮寫標準：

下面縮寫在 XML 訊息格式為標準用法，(*)參考自 “Technical Specification of the swift XML design rule”)

Description	*Abbreviation*	*意義*
Amount	AMT	金額
Business	BUS	營業
Cash	CSH	現金
Date	DT	日期
Description	DESC	內容
Index	IDX	指標
Issue	ISS	發行
Level	LVL	類別
Maturity	MAT	兌償
Message	MSG	訊息
Narrative (*)	NARR	註記
Participant	PRTY_ID	參加單位
Public Information	PI	公告事項
Rate	RT	利率
RateIndex	RI	利率指標
Sender Reference	SNDR_REF	發送者參考編號
Settlement	STLM	交割日
Timestamp	TS	時間戳記
Trading	TRD	交易

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1 票券商連接介面訊息格式

當日報價利率傳送指令：	“A01/RT” (OPEN_RATE_IN)
票券成交明細資料傳送指令：	“A02/ISS” (ISSUE2_IN)
票券成交明細資料補正傳送指令：	“A03/ISC” (ISSUE2_CORRECTION_IN)
票券成交明細資料取消傳送指令：	“A04/ISA” (ISSUE2_CANCEL_IN)
初次級市場報價利率傳送指令：	“A05/TIR” (TODAY_INTEREST_RATE)
電文訊息回覆接收指令：	“S01/ST” (SYS_ECHO)

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1.1 當日報價利率傳送指令： A01/RT (OPEN_RATE_IN)

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
HEADER	1	Message Type 訊息代號	MSG_TYPE	“A01”	C	3	M
	2	Action code 功能碼	ACTION	“RT”	C	4	M
	3	Origin 使用者代號	ORIGIN	參加單位代號共八碼 WXXXYYYZ 編碼原則如下： W ： 參加單位類別，”B”為票券商或是銀行 XXX：票券商或是銀行代碼，YYY：總行機構，Z：檢查碼(XXXYYYZ 為參加單位之代碼) 本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
	4	Narrative 註記	NARR	參加單位可依本身之需求在此欄位加註必要之說明。	X	40	O
	5	Time Stamp 時間戳記	TS	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS 交易時間	T	19	M
	6	Sender Reference 發送者參考編號	SNDR_REF	發送者自行編立之參考編號當日不可重複	C	13	M
	7	SIRIS Business Date 系統營業日	SIRIS_BUS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	8	Resend Indicator 重送註記	RESEND			1	E
BODY	9	Participant 參加單位代號	PRTY_ID	本欄位定義方式如 HEADER 之使用者代碼 此電文為報價利率傳送指令，本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
	10	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_1	一個月期報價利率	N	6(1,5)	M
	12	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_3	三個月期報價利率	N	6(1,5)	M
	13	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_6	六個月期報價利率	N	6(1,5)	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
	14	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_9	九個月期報價利率	N	6(1,5)	M
	15	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_12	十二個月期報價利率	N	6(1,5)	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1.2 票券成交明細資料傳送指令：A02/ISS (ISSUE2_IN)

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
HEADER	1	Message Type 訊息代號	MSG_TYPE	“A02”	C	3	M
	2	Action code 功能碼	ACTION	“ISS”	C	4	M
	3	Origin 使用者代號	ORIGIN	參加單位代號共八碼 WXXXYYYZ 編碼原則如下： W ： 參加單位類別，”B”為票券商或是銀行 XXX：票券商或是銀行代碼，YYY：總行機構，Z：檢查碼(XXXYYYZ 為參加單位之代碼) 本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
	4	Narrative 註記	NARR	參加單位可依本身之需求在此欄位加註必要之說明。	X	40	O
	5	Time Stamp 時間戳記	TS	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS	T	19	M
	6	Sender Reference 發送者參考編號	SNDR_REF	發送者自行編立之參考編號當日不可重複	C	13	M
	7	SIRIS Business Date 系統營業日	SIRIS_BUS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	8	Resend Indicator 重送註記	RESEND			1	E
BODY	9	Participant 參加單位代號	PRTY_ID	本欄位定義方式如 HEADER 之使用者代碼 此電文為票券成交明細資料傳送指令，本欄位應視資料來源填入參加單位(總行/分支機構)代碼)	C	8	M
	10	Record Type 資料類別	REC_TYPE	“2”：成交明細資料	C	1	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
	11	Issue Type 票券類別	ISS_TYPE	“1”：交易性商業本票(CP1) “2”：融資性商業本票(CP2) “3”：銀行承兌匯票(BA) “4”：可轉讓定存單(NCD) “5”：短期受益證券(ABCP) “6”：國庫券(TB) 註 1	C	1	M
	12	Trading Date 交易日期	TRD_DT	須等於系統營業日 YYYY-MM-DD(西元年月日)	D	10	M
	13	Deal Type 交易類別	DEAL_TYPE	“1”：賣斷 “2”：RP 賣出 “3”：買斷(註 2) “4”：RS 買入(註 2)	C	1	M
	14	Cash Amount 交易金額	CSH_AMT		N	15(13,2)	M
	15	Issue Days 票載發行天數	ISS_DAYS	1 <= 票載發行天數	N	5	M
	16	Trading Rate 交易利率	TRD_RT	0 < 交易利率 < 1	N	6(1,5)	M
	17	Rate Type 利率類別	RT_TYPE	利率方式是否為收益率(貼現率) CP1、CP2、BA、TB=“Y”； NCD=“N”。	C	1	M
	18	Settlement Date 交割日	STLM_DT	須等於系統營業日 YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	19	Issue Date 發票日	ISS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	20	Maturity Date 兌償日/履約日	MAT_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日) 當欄位 13 交易類別為 “1”賣斷或“3”買斷時須填入實際兌償日；當欄位 13 交易類別為“2”RP 賣出或“4”RS 買入時須填入履約日	D	10	M
	21	Treasury Bill 國庫券代號	TB_ID	當欄位 11 票券類別為”6”國庫券時此欄位屬性為 M，其餘為 E。	C	6	O

註 1:專營票券商可傳送之票券類別為 CP1、CP2、BA、NCD、ABCP、TB；兼營票券商只可傳送 TB 之成交資訊。

註 2:當票券類別為 TB 時，交易類別才能選擇“買斷”或“RS 買入”。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1.3 票券成交明細資料補正傳送指令：A03/ISC (ISSUE2_CORRECTION_IN)

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
HEADER	1	Message Type 訊息代號	MSG_TYPE	“A03”	C	3	M
	2	Action code 功能碼	ACTION	“ISC”	C	4	M
	3	Origin 使用者代號	ORIGIN	參加單位代號共八碼 WXXXYYYZ 編碼原則如下： W ： 參加單位類別，”B”為票券商或是銀行 XXX：票券商或是銀行代碼，YYY：總行機構，Z：檢查碼(XXXYYYZ 為參加單位之代碼) 本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
	4	Narrative 註記	NARR	參加單位可依本身之需求在此欄位加註必要之說明。	X	40	O
	5	Time Stamp 時間戳記	TS	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS	T	19	M
	6	Sender Reference 發送者參考編號	SNDR_REF	發送者自行編立之參考編號當日不可重複	C	13	M
	7	SIRIS Business Date 系統營業日	SIRIS_BUS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	8	Resend Indicator 重送註記	RESEND			1	E
BODY	9	Participant 參加單位代號	PRTY_ID	本欄位定義方式如 HEADER 之使用者代碼 此電文為票券成交明細資料傳送指令，本欄位應視資料來源填入參加單位(總行/分支機構)代碼)	C	8	M
	10	Record Type 資料類別	REC_TYPE	“3”：票券成交明細資料補正	C	1	M
	11	Origin Sender Reference 原發送者參考編號	ORIG_SNDR_REF	欲補正之原票券成交明細資料傳送指令：A02/ISS 之發送者參考編號	C	13	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
	12	Issue Type 票券類別	ISS_TYPE	“1”：交易性商業本票(CP1) “2”：融資性商業本票(CP2) “3”：銀行承兌匯票(BA) “4”：可轉讓定存單(NCD) “5”：短期受益證券(ABCP) “6”：國庫券(TB) 註 1	C	1	M
	13	Trading Date 交易日期	TRD_DT	須等於系統營業日 YYYY-MM-DD(西元年月日)	D	10	M
	14	Deal Type 交易類別	DEAL_TYPE	“1”：賣斷 “2”：RP 賣出 “3”：買斷(註 2) “4”：RS 買入(註 2)	C	1	M
	15	Cash Amount 交易金額	CSH_AMT		N	15(13,2)	M
	16	Issue Days 票載發行天數	ISS_DAYS	1 <= 票載發行天數	N	5	M
	17	Trading Rate 交易利率	TRD_RT	0 < 交易利率 < 1	N	6(1,5)	M
	18	Rate Type 利率類別	RT_TYPE	利率方式是否為收益率(貼現率) CP1、CP2、BA、TB =“Y”； NCD=“N”。	C	1	M
	19	Settlement Date 交割日	STLM_DT	須等於系統營業日 YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	20	Issue Date 發票日	ISS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	21	Maturity Date 兌償日/履約日	MAT_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日) 當欄位 13 交易類別為 “1”賣斷或“3”買斷時須填入實際兌償日；當欄位 13 交易類別為“2”RP 賣出或“4”RS 買入時須填入履約日	D	10	M
	22	Treasury Bill 國庫券代號	TB_ID	當欄位 12 票券類別為”6”國庫券時此欄位屬性為 M，其餘為 E。	C	6	O

註 1:專營票券商可傳送之票券類別為 CP1、CP2、BA、NCD、ABCP、TB；兼營票券商只可傳送 TB 之成交資訊。

註 2:當票券類別為 TB 時，交易類別才能選擇“買斷”或“RS 買入”。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1.4 票券成交明細資料取消傳送指令：A04/ISA(ISSUE2_CANCEL_IN)

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
HEADER	1	Message Type 訊息代號	MSG_TYPE	“A04”	C	3	M
	2	Action code 功能碼	ACTION	“ISA”	C	4	M
	3	Origin 使用者代號	ORIGIN	參加單位代號共八碼 WXXXYYYZ 編碼原則如下： W ： 參加單位類別，”B”為票券商或是銀行 XXX：票券商或是銀行代碼，YYY：總行機構，Z：檢查碼(XXXYYYZ 為參加單位之代碼) 本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
	4	Narrative 註記	NARR	參加單位可依本身之需求在此欄位加註必要之說明。	X	40	O
	5	Time Stamp 時間戳記	TS	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS	T	19	M
	6	Sender Reference 發送者參考編號	SNDR_REF	發送者自行編立之參考編號當日不可重複	C	13	M
	7	SIRIS Business Date 系統營業日	SIRIS_BUS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	8	Resend Indicator 重送註記	RESEND			1	E
BODY	9	Participant 參加單位代號	PRTY_ID	本欄位定義方式如 HEADER 之使用者代碼 此電文為票券成交明細資料傳送指令，本欄位應視資料來源填入參加單位(總行/分支機構)代碼)	C	8	M
	10	Record Type 資料類別	REC_TYPE	“4”：票券成交明細資料取消	C	1	M
	11	Origin Sender Reference 原發送者參考編號	ORIG_SNDR_REF	欲取消之原票券成交明細資料傳送指令：A02/ISS 之發送者參考編號	C	13	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1.5 初次級市場報價利率傳送指令：A05/TIR (TODAY_INTEREST_RATE)

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
HEADER	1	Message Type 訊息代號	MSG_TYPE	“A05”	C	3	M
	2	Action code 功能碼	ACTION	“TIR”	C	4	M
	3	Origin 使用者代號	ORIGIN	參加單位代號共八碼 WXXXYYYZ 編碼原則如下： W ： 參加單位類別，”B”為票券商或是銀行 XXX：票券商或是銀行代碼，YYY：總行機構，Z：檢查碼(XXXYYYZ 為參加單位之代碼) 本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
	4	Narrative 註記	NARR	參加單位可依本身之需求在此欄位加註必要之說明。	X	40	O
	5	Time Stamp 時間戳記	TS	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS 交易時間	T	19	M
	6	Sender Reference 發送者參考編號	SNDR_REF	發送者自行編立之參考編號當日不可重複	C	13	M
	7	SIRIS Business Date 系統營業日	SIRIS_BUS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	8	Resend Indicator 重送註記	RESEND			1	E
BODY	9	Participant 參加單位代號	PRTY_ID	本欄位定義方式如 HEADER 之使用者代碼 此電文為報價利率傳送指令，本欄位請填入參加單位之總行代碼	C	8	M
		<GROUP>	PRI_MRK_UND	初級市場-承銷首買報價利率			
	10	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_010	10 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	11	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_020	20 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	12	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_030	30 天期報價利率	N	6(1,5)	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

序號	欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
13	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_060	60 天期報價利率	N	6(1,5)	M
14	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_090	90 天期報價利率	N	6(1,5)	M
15	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_120	120 天期報價利率	N	6(1,5)	M
16	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_150	150 天期報價利率	N	6(1,5)	M
17	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_180	180 天期報價利率	N	6(1,5)	M
18	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_360	365 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	<GROUP>	SEC_MRK_NON_ABCP_OP	次級市場非 ABCP 買入報價利率(Secondary Market Non ABCP Outright Purchasing)			
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_010	10 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_020	20 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_030	30 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_060	60 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_090	90 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_120	120 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_150	150 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_180	180 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_360	365 天期報價利率	N	6(1,5)	M
	<GROUP>	SEC_MRK_NON_ABCP_OS	次級市場非 ABCP 賣出報價利率(Secondary Market Non ABCP Outright Sale)			
	List Rate 當日報價利率	LIST_RT_010	10 天期報價利率	N	6(1,5)	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_020	20 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_030	30 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_060	60 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_090	90 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_120	120 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_150	150 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_180	180 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_360	365 天期報價利率	N	6(1,5)	M
		<GROUP>	SEC_MRK_ABCP_OP	次級市場 ABCP 買入報價利率 (Secondary Market ABCP Outright Purchasing)			
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_010	10 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_020	20 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_030	30 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_060	60 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_090	90 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_120	120 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_150	150 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_180	180 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_360	365 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
		<GROUP>	SEC_MRK_ABCP_OS	次級市場 ABCP 賣出報價利率 (Secondary Market ABCP Outright Sale)			
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_010	10 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_020	20 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_030	30 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_060	60 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_090	90 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_120	120 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_150	150 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_180	180 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M
		List Rate 當日報價利率	LIST_RT_360	365 天期報價利率。兼營票券商此欄位預設為” 0.00000”	N	6(1,5)	M

註 1:當日報價利率(List Rate)為必輸欄位,輸入值需介於 0.00000 到 1,輸入值 0 時,表示本日無該報價利率報價

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.1.6 電文訊息回覆接收指令： S01/ST (SYS_ECHO)

序號		欄位名稱	DTD	欄位說明	型態	長度	屬性
HEADER	1	Message Type 訊息代號	MSG_TYPE	“S01”	C	3	M
	2	Action code 功能碼	ACTION	“ST”	C	4	M
	3	Origin 使用者代號	ORIGIN	“SIRIS”	C	8	M
	4	Narrative 註記	NARR	本系統之補充說明	X	40	O
	5	Timestamp 時間戳記	TS	YYYY-MM-DDTHH:MM:SS	T	19	M
	6	SIRI Reference 系統參考編號	SNDR_REF	本系統針對產生之資料，會賦予一個唯一之流水編號	C	13	M
	7	SIRI Business Date 系統營業日期	SIRIS_BUS_DT	YYYY-MM-DD (西元年月日)	D	10	M
	8	Resend Indicator 重送註記	RESEND		A	1	E
BODY	9	Return Code 回覆訊息代碼	RT_COD	處理結果成功：“0000”成功 處理結果異常：其他編號	C	4	M
	10	Return Description 回覆訊息說明	RT_DESC	處理結果說明	X	250	M
	11	Origin Sender Reference No 原發送者參考編號	ORIG_SNDR_REF	原始指令的發送者參考編號	C	13	M
	12	Origin Message Type 原訊息代號	ORIG_MSG_TYPE	原始指令的訊息代號	C	3	M
	13	Origin Action Code 原功能碼	ORIG_ACTION	原始指令的功能碼	C	4	M

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.3.2 電文訊息附加說明

1. 本系統接收專票券商傳送過來的電文訊息有 A01 當日報價利率、A02 票券成交明細資料電文訊息、A03 票券成交明細資料補正電文訊息、A04 票券成交明細資料取消電文訊息，與 A05 初次級市場報價利率傳送指令；接收兼營票券商傳送過來的電文訊息有 A02 票券成交明細資料電文訊息、A03 票券成交明細資料補正電文訊息、A04 票券成交明細資料取消電文訊息、A05 初次級市場報價利率傳送指令。
2. 本系統會回覆給票券商 S01 電文訊息。
3. 參加單位傳送至本系統之電文訊息，需遵照電文訊息格式規定。
4. A02 票券成交明細資料電文訊息和 A03 票券成交明細資料補正電文訊息中的 STLM_DT(交割日)欄位值必須等於 SIRIS_BUS_DT(系統營業日)欄位值。
5. A02 票券成交明細資料電文訊息和 A03 票券成交明細資料補正電文訊息中的 ISS_DAYS(發行天數)欄位值大於或等於 1。
6. A02 票券成交明細資料電文訊息和 A03 票券成交明細資料補正電文訊息中的 MAT_DT(兌償日/履約日)欄位值必須大於或等於 STLM_DT(交割日)欄位值。
7. A02 票券成交明細資料電文訊息和 A03 票券成交明細資料補正電文訊息中的 STLM_DT(交割日)欄位值必須大於或等於 ISS_DT(發票日)欄位值。
8. A01 當日報價利率電文訊息中的 LIST_RT_1(一月期報價利率)欄位值，LIST_RT_3(三月期報價利率)欄位值，LIST_RT_6(六月期報價利率)欄位值，LIST_RT_9(九月期報價利率)欄位值，LIST_RT_12(十二月期報價利率)欄位值，必須介於 0 到 1 之間(不包含 0 和 1)。
9. A02 票券成交明細資料電文訊息和 A03 票券成交明細資料補正電文訊息中的 TRD_RT(交易利率)欄位值，必須介於 0 到 1 之間(不包含 0 和 1)。
10. A02 票券成交明細資料電文訊息和 A03 票券成交明細資料補正電文訊息中的 MAT_DT(兌償日/履約日)欄位值，必須大於或等於 TRD_DT(交易日期)欄位值。
11. A01 和 A02 和 A03 和 A04 和 A05 電文訊息中的 ORIGIN(使用者代號)欄位值，須為票券商總行代碼。
12. A01 和 A02 和 A03 和 A04 和 A05 電文訊息中的 PRTY_ID(參加單位代號)欄位值，可以是總公司代碼或分行代碼，但代碼需先向集保結算所登記。
13. A01 和 A02 和 A03 和 A04 和 A05 電文訊息中的 SIRIS_BUS_DT(系統營業日)欄位值，需與短期利率指標編制系統的營業日相同。
14. A02 和 A03 電文訊息中的 Maturity Date 欄位，當票券為 RP 時，Maturity Date 欄位則為附條件履約日。若票券非 RP 時，Maturity Date 欄位則為實際兌償日。
15. A05 電文訊息中的 LIST_RT_010(10 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_020(20 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_030(30 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_060(60 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_090(90 天期報價利率)欄位值，

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

LIST_RT_120(120 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_150(150 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_180(180 天期報價利率)欄位值，LIST_RT_360(365 天期報價利率)欄位值，必須介於 0 到 1 之間(不包含 1; 輸入值 0 時,表示本日無該報價利率報價)。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.4傳檔工作站作業

參加單位以“傳檔工作站”方式與本系統連線，其訊息格式與“主機對主機”方式一致(訊息格式請參考 1.3 及 1.5)。茲針對傳檔工作站所需之設備、目錄檔案設定以及處理程序等加以說明如下。

一、傳檔工作站(Isolation Workstation)平台：

硬體：Pentium III 500MHz，256M RAM，10G DASD (或以上)，網路卡。

軟體：Windows 2000，Java(TM) 2 SDK, Standard Edition, v 1.2.2_008。

二、傳檔工作站目錄、檔案名稱：

目錄、檔案名稱	用途說明
SIRIS 傳檔工作站應用程式及相關設定	
C:\SIRIS\	傳檔工作站預設之目錄；放置傳檔應用程式、設定檔...等之目錄
C:\SIRIS\SIRISBDU.JAR	傳送接收之應用程式
C:\SIRIS\SIRISCFG.ini	SIRIS 設定檔名稱
C:\SIRIS\SIRISBDU.bat	程式啟動 batch
C:\SIRIS\SIRIS.dtd	訊息 XML 之 DTD
C:\SIRIS\MKDIR.bat	產生 C:\SIRIS 目錄下方的其他目錄夾
傳送至 SIRIS 的相關目錄及定義	
C:\SIRIS\SENDMSG\	放置待傳送檔案之目錄
C:\SIRIS\BACKMSG\	放置已傳送內容正確之檔案目錄 已傳送之正確檔案將被移至此處
C:\SIRIS\RECVMSG\	存放所接收到訊息之目錄
C:\SIRIS\ERRMSG\	放置內容錯誤無法傳送檔案之目錄 經檢查內容錯誤之檔案將移至此處
SIRIS 系統訊息日誌目錄及定義	
C:\SIRIS\LOGMSG\	系統訊息及系統日誌
C:\SIRIS\LOGMSG\MessageLog_YYYYMMDD.log	紀錄系統傳送接收資料日誌檔
C:\SIRIS\LOGMSG\ErrorLog_YYYYMMDD.log	紀錄系統錯誤日誌檔

三、檔案內容：ASCII CODE 檔：

- 每一個傳送檔案為一筆 XML 訊息。

四、作業程序：

傳送作業：

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

- 將欲傳送之 XML 訊息檔案放入 C:\SIRIS\SENDMSG 目錄中。
- 應用程式每 N 秒（可由使用者於設定檔中自行設定），會自行啟動執行，讀取檔案內之 XML 訊息，檢查資料內容，確認無誤後，傳送至本系統之 MQ Queue 內。
- 傳送成功之檔案，應用程式將檔案移至 C:\SIRIS\BACKMSG 目錄中，傳送失敗之檔案應用程式將把檔案移至 C:\SIRIS\ERRMSG 目錄中，並記錄 log。
- 重複處理下一個待傳送之檔案，直到所有傳送檔案傳送完成。

接收作業：

- 應用程式每 N 秒（可由使用者於設定檔中自行設定），會自行啟動執行，至本系統之 MQ Queue 內，接收訊息，並將訊息內容存放至 C:\SIRIS\RECVMSG\。
- 將成功接收檔案內容，記錄到 log。

五、參加單位責任：

1. 確保傳檔工作站正常運作(PC、作業系統、連線、應用程式等)。
2. 確保傳送檔案每一筆資料符合本系統之 XML 訊息格式，並放置於 C:\SIRIS\SENDMSG 目錄內。
3. C:\SIRIS\BACKMSG 目錄內之內容正確已傳送檔案的維護、刪除等…。
4. C:\SIRIS\ERRMSG 目錄內之內容有誤無法傳送檔案的確認、刪除等…。
5. C:\SIRIS\RECVMSG 目錄內接收訊息檔案的確認、刪除等…。
6. C:\SIRIS\LOGMSG 目錄內系統訊息及系統日誌檔案的確認、刪除等…。
7. 確保定時備份檔案及必要時的回復作業。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.5XML DTD檔案

```
<!ELEMENT SIRISMESSAGE ( OPEN_RATE_IN|ISSUE2_IN|ISSUE2_CORRECTION_IN|
ISSUE2_CANCEL_IN|SYS_ECHO|TODAY_INTEREST_RATE )>
<!ATTLIST SIRISMESSAGE
      MSG_TYPE        (A01|A02|A03|A04|S01|A05)          #REQUIRED
      ACTION          (RT|ISS|ISC|ISA|ST|TIR)            #REQUIRED
      ORIGIN          CDATA                              #REQUIRED
      NARR            CDATA                              #IMPLIED
      TS              CDATA                              #REQUIRED
      SNDR_REF        CDATA                              #REQUIRED
      SIRIS_BUS_DT    CDATA                              #REQUIRED
      RESEND          CDATA                              #IMPLIED
>
<!ELEMENT OPEN_RATE_IN EMPTY>
<!ELEMENT ISSUE2_IN EMPTY>
<!ELEMENT ISSUE2_CORRECTION_IN EMPTY>
<!ELEMENT ISSUE2_CANCEL_IN EMPTY>
<!ELEMENT SYS_ECHO EMPTY>
<!ELEMENT TODAY_INTEREST_RATE ( PRI_MRK_UND, SEC_MRK_NON_ABCP_OP,
SEC_MRK_NON_ABCP_OS, SEC_MRK_ABCP_OP, SEC_MRK_ABCP_OS ) >
<!ATTLIST OPEN_RATE_IN
      PRTY_ID         CDATA                              #REQUIRED
      LIST_RT_1       CDATA                              #REQUIRED
      LIST_RT_3       CDATA                              #REQUIRED
      LIST_RT_6       CDATA                              #REQUIRED
      LIST_RT_9       CDATA                              #REQUIRED
      LIST_RT_12      CDATA                              #REQUIRED
>
<!ATTLIST ISSUE2_IN
      PRTY_ID         CDATA                              #REQUIRED
      REC_TYPE        (2)                                #REQUIRED
      ISS_TYPE        (1|2|3|4|5|6)                      #REQUIRED
      TRD_DT          CDATA                              #REQUIRED
      DEAL_TYPE       (1|2|3|4)                          #REQUIRED
      CSH_AMT         CDATA                              #REQUIRED
      ISS_DAYS        CDATA                              #REQUIRED
      TRD_RT          CDATA                              #REQUIRED
      RT_TYPE         (Y|N)                              #IMPLIED
```

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

```
        STLM_DT          CDATA                    #REQUIRED
        ISS_DT           CDATA                    #REQUIRED
        MAT_DT           CDATA                    #REQUIRED
        TB_ID            CDATA                    #IMPLIED
>
<!ATTLIST ISSUE2_CORRECTION_IN
        PRTY_ID          CDATA                    #REQUIRED
        REC_TYPE         (3)                      #REQUIRED
        ORIG_SNDR_REF    CDATA                    #REQUIRED
        ISS_TYPE         (1|2|3|4|5|6)            #REQUIRED
        TRD_DT           CDATA                    #REQUIRED
        DEAL_TYPE        (1|2|3|4)                #REQUIRED
        CSH_AMT          CDATA                    #REQUIRED
        ISS_DAYS         CDATA                    #REQUIRED
        TRD_RT           CDATA                    #REQUIRED
        RT_TYPE          (Y|N)                    #IMPLIED
        STLM_DT          CDATA                    #REQUIRED
        ISS_DT           CDATA                    #REQUIRED
        MAT_DT           CDATA                    #REQUIRED
        TB_ID            CDATA                    #IMPLIED
>
<!ATTLIST ISSUE2_CANCEL_IN
        PRTY_ID          CDATA                    #REQUIRED
        REC_TYPE         (4)                      #REQUIRED
        ORIG_SNDR_REF    CDATA                    #REQUIRED
>
<!ATTLIST SYS_ECHO
        RT_COD           CDATA                    #REQUIRED
        RT_DESC          CDATA                    #REQUIRED
        ORIG_SNDR_REF    CDATA                    #REQUIRED
        ORIG_MSG_TYPE    (A01|A02|A05)            #REQUIRED
        ORIG_ACTION      (RT|ISS|TIR)             #REQUIRED
>
<!ATTLIST TODAY_INTEREST_RATE
        PRTY_ID          CDATA                    #REQUIRED
>
<!ELEMENT PRI_MRK_UND EMPTY >
<!ATTLIST PRI_MRK_UND
```

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

```
    LIST_RT_010     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_020     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_030     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_060     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_090     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_120     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_150     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_180     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_360     CDATA                   #REQUIRED
>
<!ELEMENT SEC_MRK_ABCP_OP EMPTY >
<!ATTLIST SEC_MRK_ABCP_OP
    LIST_RT_010     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_020     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_030     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_060     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_090     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_120     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_150     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_180     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_360     CDATA                   #REQUIRED
>
<!ELEMENT SEC_MRK_ABCP_OS EMPTY >
<!ATTLIST SEC_MRK_ABCP_OS
    LIST_RT_010     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_020     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_030     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_060     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_090     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_120     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_150     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_180     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_360     CDATA                   #REQUIRED
>
<!ELEMENT SEC_MRK_NON_ABCP_OP EMPTY >
<!ATTLIST SEC_MRK_NON_ABCP_OP
    LIST_RT_010     CDATA                   #REQUIRED
    LIST_RT_020     CDATA                   #REQUIRED
```

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

```
    LIST_RT_030    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_060    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_090    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_120    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_150    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_180    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_360    CDATA                    #REQUIRED
>
<!ELEMENT SEC_MRK_NON_ABCP_OS EMPTY >
<!ATTLIST SEC_MRK_NON_ABCP_OS
    LIST_RT_010    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_020    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_030    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_060    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_090    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_120    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_150    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_180    CDATA                    #REQUIRED
    LIST_RT_360    CDATA                    #REQUIRED
>
```

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.6MQ規範

1.6.1 主機對主機連線 MQ Server 命名規則與設定

1. Host 識別碼規定

(1) 本系統對每一個參加單位規定了 8 碼的代號(參加單位代號)，這個代號將用來做為該 host 的識別碼 PRTY_ID。

2. MQ 佇列命名規則

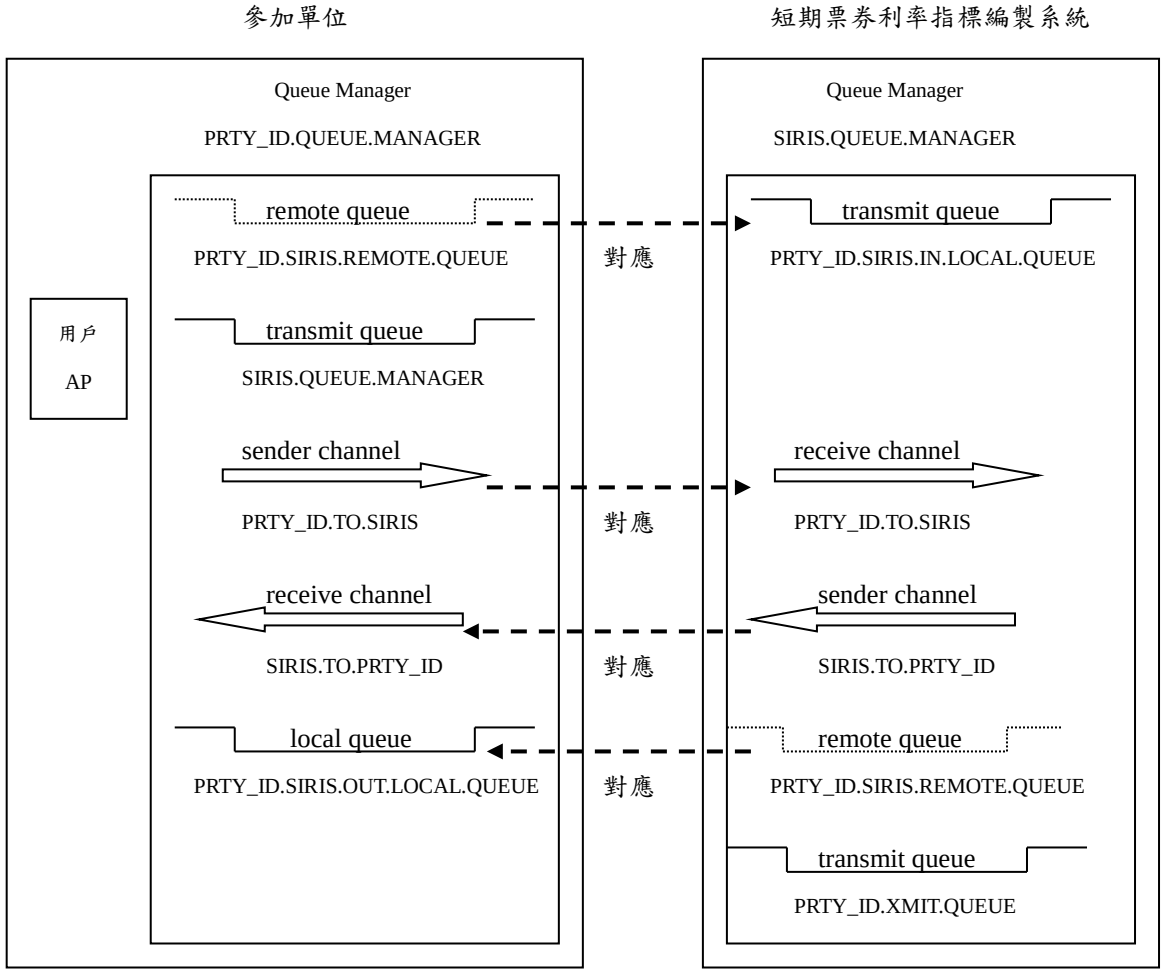
用戶端 MQSeries 設定命名原則說明：

(1) 假設用戶端之 Host 識別碼為 PRTY_ID，在用戶端的 MQSeries Server 上需定義一個遠程定義(remote queue)、一個本端佇列、一個傳輸佇列(transmission queue)和一組 channel (如下圖)

(2) 發送訊息：透過傳送通道(sender channel)：PRTY_ID.TO.SIRIS 將訊息送入 PRTY_ID.SIRIS.IN.LOCAL.QUEUE

(3) 收取訊息：透過接收通道(receiver channel)：SIRIS.TO.PRTY_ID 將訊息由 PRTY_ID.SIRIS.OUT.LOCAL.QUEUE 收入

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印



PS:如遇 PRTY_ID,請代入真實的參加單位代號。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

3. 用戶端使用 MQSeries Server 參考設定

(1) 假設用戶端的識別碼為 PRTY_ID。

(2) 用戶端之 MQSeries Server 應定義下列設定：

- 本端佇列管理程式(local queue manager)：
  PRTY_ID.QUEUE.MANAGER
  - 針對 TCP/IP 協定的接聽器埠號(listener port)：1414
  - 預設傳輸佇列(default transmission queue)：
    SYSTEM.DEFAULT.XMIT.QUEUE
  - 無法傳遞的郵件佇列(default dead-letter queue)：
    SYSTEM.DEAD.LETTER.QUEUE
  - 其它設定使用預設值

- 本端佇列(local queue)：
  PRTY_ID.SIRIS.OUT.LOCAL.QUEUE

- 本端傳輸佇列(local transmission queue)：SIRIS.QUEUE.MANAGER

- 遠程定義(remote definition)：
  PRTY_ID.SIRIS.REMOTE.QUEUE
  - 遠端佇列名稱(remote queue name) ：
    PRTY_ID.SIRIS.IN.LOCAL.QUEUE
  - 遠端佇列管理程式名稱(remote queue manager name)：
    SIRIS.QUEUE.MANAGER
  - 傳輸佇列名稱(transmission queue name)：
    SIRIS.QUEUE.MANAGER
  - 其它設定使用預設值

- 傳送端通道：PRTY_ID.TO.SIRIS
  - 傳輸通信協定(transmission protocol)：TCP/IP
  - 連線名稱(connection name)：<依實際集保結算所公告伺服器的 IP 位址，設定接聽器埠號 listener port：1414>
  - 傳輸佇列(transmission queue)：SIRIS.QUEUE.MANAGER
  - 其它設定使用預設值

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

˙ 接收端通道：SIRIS.TO.PRTY_ID

ˇ 傳輸通信協定(transmission protocol)：TCP/IP

PS:如遇 PRTY_ID，請代入真實的參加單位代號

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.6.2 傳檔工作站 MQ 命名規則與設定

當參加單位使用傳檔工作站連線時，因本端沒有 MQ 物件，所有 MQ 物件均在本系統之 MQ 伺服器上，所以參加單位必須修正傳檔工作站之設定檔 SIRISCFG..ini。(詳細設定清參考傳檔工作站安裝光碟片上之相關說明文件)：

- 遠端佇列管理程式名稱：SIRIS.QUEUE.MANAGER
- 本系統之 MQ 伺服器之 IP 位址
- 本系統開放給 MQ Client 之 TCP 埠
- 本系統開放給 MQ Client 之通道名稱：[PRTY_ID].SVRCONN
- 傳送用佇列名稱：PRTY_ID.SIRIS.IN.LOCAL.QUEUE
- 接收用佇列名稱：PRTY_ID.SIRIS.OUT.LOCAL.QUEUE

PS:如遇 PRTY_ID,請代入真實的參加單位代號。

傳檔工作站使用的 Port 為 1420

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.6.3 主機對主機連線方式 MQ 相關注意事項

1. 用戶端必須安裝 IBM MQSeries 5.1 版或更新的版本之 MQSeries Server，系統不支援舊版本之 MQSeries 或者其它訊息傳送軟體。
2. IBM MQSeries 有適用於各種平台與作業系統之版本，用戶端應選擇正確之對應平台版本安裝。
3. 建議用戶端除安裝 IBM MQSeries 產品外，並安裝該版本最新的 Fixpack。Fixpack 可由 IBM 網站自行下載安裝，或由 MQSeries 產品工程師安裝。
4. 參加單位應指派專人負責 MQ 設定及日常 MQ 連線管理，集保結算所之 MQ 管理員將會同參加單位之 MQ 管理員負責連線作業，但不負責參加單位端之設定及管理工作。
5. 用戶端須依照前面章節之命名原則來定義 MQ 物件，不可自行更改，否則將無法正確接收或傳送訊息。
6. 用戶端所使用之通訊線路原則上並無限制，唯必須能使用 TCP/IP 協定。建議應採用品質可靠及安全無虞之通訊線路，且速率不宜過低。所有之 MQ 訊息均必須使用 TCP/IP 協定來傳送。
7. 所有傳送訊息均為 XML 格式，而且必須符合集保結算所所提供之 XML 格式規定。
8. 若參加單位之 MQ 接聽器(Listener)使用 1414 埠以外之 TCP 埠，須在送交集保結算所之申請表格上註明所使用的 TCP 埠號，若未註明則本系統將假設參加單之 MQ Server 使用 TCP 1414 埠。
9. 若參加單位有必要更改參加單位端之 MQ 物件之命名或接聽器之 TCP 埠號，必須事先以書面通報集保結算所，取得集保結算所同意後，約定非作業時間於參加單位及集保結算所兩端同步更改。若參加單位自行更改 MQ 設定或 MQ 設定錯誤則將無法與本系統建立 MQ 連線。
10. 除前面章節所提到必要之 MQ 物件外，使用者尚可自行定義其它 MQ 物件以供內部使用，以不影響必要 MQ 物件正常運作為原則。
11. 除了前面章節所提到之 MQ 物件參數之外，MQ 物件尚有其它之參數，建議使用預設值即可。使用者可自行修改參數以配合內部作業之需求，但必須注意錯誤的參數設定可能造成無法正確接收或傳送訊息之情形。
12. 用戶端之防火牆必須做適當的調整，開放 MQ 所使用之 1414 埠，使訊息傳送不致被防火牆所阻隔。
13. 用戶端之 MQ Series Server 必須有固定之 IP 位址，不可使用動態之 IP 位址。若用戶端更改 IP 位址必須通知集保結算所，否則將無法連線。建議 MQ Series Server 或 Client 伺服器不要使用 NAT(Network Address Translation)來分配 IP 位址，若用戶端必須使用 NAT，須自行負責保證所使用之 NAT 機制能正確轉送 MQ 訊息。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.7附錄

1.7.1 附錄一(電文回覆訊息說明)

訊息代號	訊息說明	主機對主機	傳檔工作站
0000	成功	V	V
0001	<XXX.yyy>--請確認檔案是否存在	---	V
0002	<XXX.yyy>--請確認為正常檔案	---	V
0003	<XXX.yyy>--請確認可正常讀取	---	V
0004	請檢查設定檔 C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 是否包含下列屬性設定(亦不可為空字串)：<xxx、yyy、....>	---	V
0005	請將 C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中 BDUChannel=PRTY_ID.SVRCONN 的 PRTY_ID 改成正確的參加單位代號	---	V
0006	請將 C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中 BDULocalqueueName=PRTY_ID.SIRIS.IN.LOCAL.QUEUE 的 PRTY_ID 改成正確的參加單位代號	---	V
0007	請將 C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中 BDDChannel=PRTY_ID.SVRCONN 的 PRTY_ID 改成正確的參加單位代號	---	V
0008	請將 C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中 BDDLocalQueueName=PRTY_ID.SIRIS.OUT.LOCAL.QUEUE 的 PRTY_ID 改成正確的參加單位代號	---	V
0009	請檢查 C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中設定，port 必須在 0 和 65535 之間。	---	V
0010	C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中 BDUSleeptime 為上傳間隔秒數，請填入正整數。	---	V
0011	C:\SIRIS\SIRISCFG.ini 中 BDDSleeptime 為傳送接收資料的間隔秒數，請填入正整數。	---	V
0012	<XXX>--請確認目錄是否存在	---	V
0013	<XXX>--請確認為正常目錄	---	V
0014	<XXX.yyy>--請確認可正常寫入	---	V
0015	傳送訊息非當日報價利率傳送指令(A01)或票券成交明細資料傳送指令(A02)或票券成交明細資料補正傳送指令(A03)或票券成交明細資料取消傳送指令(A04)，或 XML 元素(element)名稱錯誤。	V	V
0016	傳檔工作站啟動發生錯誤，請重新啟動一次。	---	V
0017	XML 格式錯誤--<XML 格式錯誤說明>	V	V
0018	ACTION 未輸入	V	V
0019	MSG_TYPE 未輸入	V	V
0020	請檢查 MSG_TYPE=A01，則 ACTION=RT。	V	V
0021	請檢查 MSG_TYPE=A02，則 ACTION=ISS。	V	V
0022	REC_TYPE 未輸入	V	V
0023	ORIGIN=<xxxxxxxx>--應為--><yyyyyyyy>	V	V
0024	PRTY_ID=<xxxxxxxx>--應為--><yyyyyyyy>	V	V
0025	MQ 傳輸發生錯誤,Completion Code=<xxxx>,Reason Code=<yyyy>	---	V
0026	發生系統錯誤。錯誤訊息如下：<錯誤訊息>	---	V

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

0027	傳檔工作站發生系統錯誤。錯誤訊息如下：<錯誤訊息>	---	V
0028	<tag>=<value>--並未合乎指定值	V	V
0029	<tag>--屬性未定義	V	V
0030	STLM_DT and SIRIS_BUS_DT 應為同一天	V	V
0031	ISS_DAYS 大於或等於 1	V	V
0032	STLM_DT 應大於或等於 ISS_DT	V	V
0033	MAT_DT 應大於或等於 STLM_DT	V	V
0034	<tag>=<value>--必輸入沒輸入	V	V
0035	<tag>=<value>--只能輸入英文字母	V	V
0036	<tag>=<value>--只能輸入英文字母及數字	V	V
0037	<tag>=<value>--數字不能小於 0	V	V
0038	<tag>=<value>--只能輸入數字	V	V
0039	<tag>=<value>--數字格式有誤	V	V
0040	<tag>=<value>--日期格式錯誤	V	V
0041	<tag>=<value>--時間格式錯誤	V	V
0042	<tag>=<value>--超過預設資料長度	V	V
0043	<tag>=<value>--利率不可大於 1	V	V
0044	請檢查 MSG_TYPE=<value>，ACTION=<value>是否輸入錯誤	V	V
0045	<XXX.yyy>--請確認傳送檔案類型只能為文字檔	---	V
0046	MAT_DT 應大於或等於 TRD_DT	V	V
0047	請檢查 MSG_TYPE=A03，則 ACTION=ISC。	V	V
0048	請檢查 MSG_TYPE=A04，則 ACTION=ISA。	V	V
0101	參加單位代號欄位 PRTY_ID：<BXXXXXXX>,並沒有註冊到 SIRIS 系統中	V	V
0102	參加單位代號欄位 PRTY_ID：<BXXXXXXX>,不符合該參加單位自己本身的代號	V	V
0103	使用者代號欄位 ORIGIN：<BXXXXXXX> 錯誤,正確的使用者代號應是 ：<BXXXXXXX>	V	V
0104	系統營業日欄位 SIRIS_BUS_DT：<YYYY-MM-DD> 錯誤,目前系統營業日是 ：<YYYY-MM-DD>	V	V
0105	發送者參考編號欄位 SNDR_REF：<XXXXXXXXXXXXX> 重覆	V	V
0106	SIRIS 系統的營業時間未設定	V	V
0107	目前系統開盤營業時間是 ：hhmm, 目前系統收盤營業時間是 ：hhmm, 已超出系統設定的營業時間範圍外	V	V
0108	無此原發送者參考編號欄位 ORG_SNDR_REF 所對應之票券明細	V	V
0201	新增報價利率資料至 A01 Table,失敗!(請通知集保結算所相關人員)	V	V
0202	新增成交利率資料至 A01 Table,失敗! (請通知集保結算所相關人員)	V	V
0210	查詢 A01 Table 的資料筆數,有錯誤(請通知集保結算所相關人員)	V	V
0211	查詢 A02Table 的資料筆數,有錯誤(請通知集保結算所相關人員)	V	V
0212	查詢 A03 Table 的資料筆數,有錯誤(請通知集保結算所相關人員)	V	V
0213	查詢 A04 Table 的資料筆數,有錯誤(請通知集保結算所相關人員)	V	V
0214	新增報價利率資料至 A01 Table,失敗! (請通知集保結算所相關人員)	V	V
0215	新增成交利率資料至 A01 Table,失敗! (請通知集保結算所相關人員)	V	V

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

PS:

1.訊息代號為 0001~0014、0016、0025~0027、0045 的訊息，只會出現在傳檔工作站連線方式中。

2.其他訊息代號則無論是傳檔工作站連線方式或主機對主機方式，都會出現。

3.使用傳檔工作站若發生 0001~0048 錯誤訊息，表式資料傳送至 SIRIS 系統之前，已經被傳檔工作站偵測出來有錯誤發生。

4.票券商若發現回覆訊息中訊息代號為 0201~0215 請通知集保結算所公司相關人員。

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印

1.8版本異動說明

版本 4.2 異動之內容說明 修改日期：101.09.10			
頁 次	修改型態	修 改 內 容	修 改 原 因
全部	修改	原「牌告利率」文字說明改成「報價利率」	
2	修改	1.1.1.2 系統範圍改成表格方說明。	
19	修改	1.2.7 作業說明 1.修改成 「初次級市場報價利率」為各票券商每日開市公告之票券交易利率，交易利率分為(1)初級市場 CP2 承銷 2.修改成 (9)365 天期 3.修改成 票券商當日各天期「初次級市場報價利率」第一盤資料需於當日 9:15 前依上述作業方式傳送至本系統。 4.增加兼營票券商作業說明。	
30-33	修改	1.3.1.5 初次級市場報價利率傳送指令 修改 LIST_RT_360 欄位說明成 365 天期報價利率	
全部	修改	新增國庫券成交資訊作業。	

本文件著作權屬臺灣集中保管結算所股份有限公司所有，未經本公司同意不准引用或翻印