

# 臺灣期貨交易所股份有限公司受理「新臺幣利率交換契約」集中結算之契約規格

本公司受理新臺幣利率交換契約集中結算契約規格如下：

- 一、商品類型 (Product type)：固定利率對浮動利率之交換契約。
- 二、計價幣別 (Currency)：新臺幣。
- 三、名目本金 (Notional Amount)：金額固定，最小計價單位為新臺幣 1 元。
- 四、契約最短期間 (Minimum Term)：契約生效日至契約到期日之期間至少須達 3 個月以上。
- 五、契約最長剩餘期間 (Maximum Residual Term)：契約提交日至契約到期日之期間不得逾 15 年。
- 六、契約最短剩餘期間 (Minimum Residual Term)：契約提交日至契約到期日之期間至少須達 3 個營業日以上。
- 七、浮動利率指標 (Floating Rate Option)：台北金融業拆款定盤利率 (Taipei Interbank Offered Rate, TAIBOR)。
- 八、浮動利率天期 (Floating Rate Tenor)：3 個月。
- 九、浮動利率付息頻率 (Floating Rate Payment Frequency)：3 個月。
- 十、浮動利率重設頻率 (Floating Rate Reset Frequency)：3 個月。
- 十一、浮動利率定價日 (Floating Rate Fixing Date)：各利息計算期間 (Calculation Period) 開始前 2 個營業日。
- 十二、浮動利率定價日及付息日之金融中心 (Floating Rate Fixing Date Financial Center & Floating Rate Payment Date Financial Center)：台北。
- 十三、浮動利率計息天數 (Floating Rate Day Count Fraction)：
  - (1) Actual/360。
  - (2) Actual/365 (Fixed)。
- 十四、固定利率付息頻率 (Fixed Rate Payment Frequency)：3 個月。
- 十五、固定利率計息天數 (Fixed Rate Day Count Fraction)：
  - (1) Actual/Actual。

- (2) Actual/365 (Fixed)。
- (3) Actual/360。
- (4) 30/360。
- (5) 30E/360。
- (6) 30E/360 (ISDA)。

十六、付款遞延天數 (Payment Lag)：無。

十七、營業日原則 (Business Day Convention)：

- (1) 順延至次一營業日 (Following)。
- (2) 修正式次營業日 (Modified Following)。
- (3) 提前至前一營業日 (Preceding)。

十八、月末調整原則 (Roll Convention)：

- (1) 標準型 (Standard)。
- (2) 調整至月底 (End of Month, EOM)。

十九、其他應收付款項 (Additional payment) 以預付款費用 (Upfront fee) 為限，並應符合下列規定：

- (1) 每筆交易契約不得超過一期。
- (2) 幣別須與契約之計價幣別相同。
- (3) 款項收付日期不得為契約生效日之前或契約到期日之後。

本項契約規格之用語適用 ISDA 相關定義。

本項契約有下列任一情形者，本公司得不受理集中結算：

- 一、交易契約之交易相對方相同。
- 二、利息計算區間之首期及末期均為畸零天期。
- 三、契約之畸零天期大於 6 個月。