

# 中華民國銀行商業同業公會全國聯合會（金融業拆款中心）

## 公開市場操作一般指定交易商應配合辦理事項

- 一、本配合辦理事項依中央銀行「公開市場操作指定交易商實施要點」第五點規定訂定之。
- 二、公開市場操作一般指定交易商（以下簡稱一般指定交易商）應積極參與金融業拆款市場，以協助中央銀行調節市場資金。
- 三、一般指定交易商應就中華民國銀行商業同業公會全國聯合會（以下簡稱本會）金融業拆款中心（以下簡稱本中心）規定之各期別拆款，依本身資金情況，對拆款市場持續進行拆進與拆出之雙向報價，且其報價利差應在合理範圍內。
- 四、一般指定交易商之拆出報價，係對長期信用評等達下列等級之一之金融業拆款中心會員單位所提具市場參考性之最佳報價：
  - （一）標準普爾公司（Standard & Poor's Corporation）評級 A-以上。
  - （二）穆迪投資人服務公司（Moody's Investors Service）評級 A3 以上。
  - （三）惠譽國際信用評等公司（Fitch Ratings Ltd.）評級 A-以上。
  - （四）中華信用評等股份有限公司評級 twA-以上。
  - （五）英商惠譽國際信用評等股份有限公司台灣分公司評級 A-（tw）以上。
  - （六）穆迪信用評等股份有限公司評級 A3.tw 以上。。
- 五、一般指定交易商另應就台北金融業拆款之定盤利率（fixing rate）進行報價；其作業規範由本中心擬訂，並報中央銀行同意後實施。

六、一般指定交易商應於拆款交易成交後立即將成交資料回報本中心，以提高拆款市場交易資訊系統之揭示效率。

七、本中心對未依第三點至第六點規定辦理之一般指定交易商，得予以警告，並陳報中央銀行。

八、一般指定交易商應按月維持其於金融業拆款市場拆款交易量佔整體市場交易量之一定比率。

前項之一定比率，由本中心擬訂，並報中央銀行同意後實施。

九、本中心對一般指定交易商應按月就下列各款事項辦理考評，並將考評結果彙報中央銀行：

（一）一般指定交易商是否善盡持續雙向報價之義務，且其報價利差尚在全體一般指定交易商之報價利差合理範圍內。

（二）一般指定交易商對本應配合辦理事項規定之報價是否偏離市場實際成交行情。

（三）一般指定交易商是否按月維持其於金融業拆款市場拆款交易量佔整體市場交易量之一定比率。

十、本配合辦理事項經本會理事會通過並報請中央銀行同意後實施；修正時亦同。