

# PRIS 金融資產評價系統 操作手冊

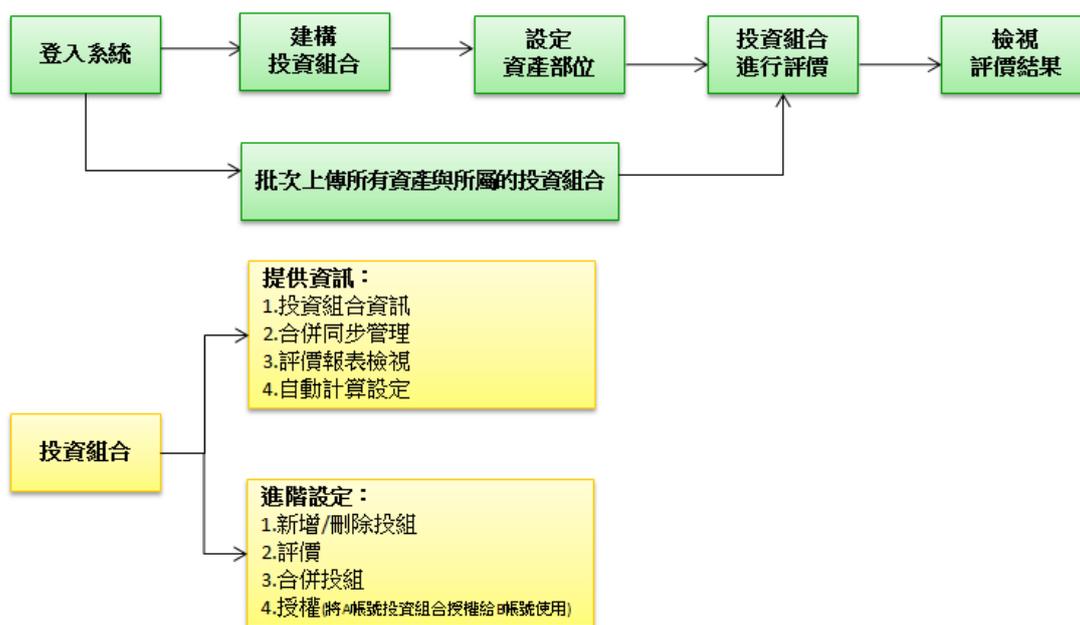


台灣經濟新報社

地址：台北市 11070 東興路 57 號 11 樓

電話：(02) 8768-1088 代表號

### PRIS 金融資產評價系統 操作流程



#### 一、登入帳號

##### 1.輸入帳號密碼



##### 2.登入成功後畫面如下



## 二、建構投資組合

### 1. 投資組合，點選加入投資組合



### 2. 輸入新增投資組合名稱，並點選確定。



### 3. 新增完成後，會出現於投資組合選單中。



### 三、將資產加入投資組合

1. 點擊”資產”按鈕，進入”資產”工具面板，開始進行建置投資組合的動作。

**OPRIS**

**資產** **投資組合**

主類別: 權益證券-現貨  
 次類別: 上市股票  
 資產代碼: 輸入資產代碼  
 代碼查詢 確定

資產名稱: \_\_\_\_\_  
 貨幣別: 台灣  
 持有部位(股)\*: \_\_\_\_\_  
 取得成本: \_\_\_\_\_  
 取得日期: \_\_\_\_\_

**權益+債券測試**

建立時間: 20140626  
 資產種類: 0種  
 合併同步狀態: 0個投組同步  
 自動評價狀態: \_\_\_\_\_

資產類別	投資金額	%

資產類別	資產代碼	資產名稱	投資金額

2. 資產選擇

EX: 選擇 CBAS，則主類別選擇為”利率商品-衍生性”，次類別為”可轉債資產交換”時，點選”代碼查詢”按鈕，即可開啟資產代碼查詢工具。

**OPRIS**

**資產** **投資組合**

主類別: 利率商品-衍生性  
 次類別: 可轉債資產交換  
 資產代碼: \_\_\_\_\_  
 代碼查詢 確定

可轉債代碼\*: 19093  
 名目本金\*(千元): \_\_\_\_\_  
 資產交換型態\*: 換出選擇權  
 利率交換型態\*: 付固定收浮動

2. 資產代碼查詢工具：點選左側文字的可轉債分類名稱，即可顯示所有該類別公債。

水泥  
 食品  
 塑膠  
 紡織  
 電機機械  
 電線電纜  
 化學  
 玻璃陶瓷  
 造紙

3. 點選右側白色區域中的可轉債名稱，即會將此債券資料帶回”資產”工具面板。

水泥	士電一	東元二	東元三	正道一	台安一
食品	瑞利一	瑞利二	力山一	堤維一	耿鼎一
塑膠	耿鼎二	耿鼎三	恩德一	恩德二	樂士一
紡織	樂士一(P)	樂士二	亞崑一	亞崑二	車王一
電機機械	新企一	新企二	精確一	精確二	精確三
電線電纜	中宇一	和大一	和大二	和大三	廣隆一
化學	正峰一	鎢泰一	捷邦一	程泰一	和勤101-1(P)
玻璃陶瓷	永冠一	F-駿吉一	為升一	富鑫一	帝寶一
造紙	羅昇一	高力一	高力二	高力三	高力四
鋼鐵	和大三	樂士99-1(P)	樂士100-1(P)	宏易99-1(P)	擎邦一
橡膠	擎邦二	大同一	大同二	高鋒一	永彰一
汽車	東台一	方士霖一	方霖二	瑞智一	協易一
電子	協易機二	三林一	慶騰二	至興一	
營建					

4. 輸入欄位中將有打\*號者為必填欄位，其他為選填欄位，完成後請點選按鈕，將該筆資產加入投資組合中。

EX:

CBAS 必填欄位：

名目本金、資產交換型態、利率交換型態、契約起/迄日、基礎貨幣、換入貨幣、付息頻率、付固定利率、收固定利率。

\*只是當這筆契約為收取利息時，則『付固定利率』的欄位就填入 0，反之則在『收固定利率』的欄位填入 0。

資產 投資組合

主類別 利率商品-衍生性

次類別 可轉債資產交換

資產代碼

代碼查詢 確定

可轉債代碼\* 15861P

名目本金\*(千元) 1000

資產交換型態\* 換出選擇權

利率交換型態\* 付固定收浮動

契約起日\* 20130101

契約迄日\* 20151231

基礎貨幣\* 台幣

換入貨幣\* 台幣

付息頻率\* 每季

付固定利率\*(%) 0

收固定利率\*(%) 2

契約代碼

交易對手

帳號名稱: saletest  
 帳號權限: 操作帳號  
 最後過檔日期: 20141017 15:30:58:60  
 最後修改密碼時間: 20140424 15:10:36  
 version: 1.0.0.0

CBAS 選填欄位：

『契約代碼』：可供使用者於預覽畫面快速區分不同契約，可將使用者公司內部針對該契約建立的代碼或序號輸入此欄，以方便瀏覽。

『交易對手』：一欄請填入交易對手的證券代碼，若無，則會預設以 TCRI 等級 3 來考慮此一商品的信用風險利差。

契約代碼	VF0150608
交易對手	2845
信用保證	無保證
選擇權折現率 (%)	
LGD (%)	15
估計現金股利率 (%)	2
計息基準	365
契約匯率	

4. 按下加入投組按鈕後，即成功加入此一資產。

資產交換型態*	換出選擇權
利率交換型態*	付固定收浮動
贖約起日*	20130101
贖約迄日*	20151231
基礎貨幣*	台幣
換入貨幣*	台幣
付息頻率*	每季
付固定利率*(%)	0
收固定利率*(%)	2
贖約代碼	
交易對手	

帳號名稱: saletest  
帳號權限: 操作帳號  
最後過檔日期: 20141017 15:30:58:60  
最後修改密碼時間: 20140424 15:10:36  
version: 1.0.0.0

5. 選擇投資組合，並點選確定。

PRIS

資產 投資組合

主類別: 利率商品-衍生性  
次類別: 可轉債資產交換  
資產代碼: [代碼查詢] [確定]

可轉債代碼\*: 16011  
名目本金\*(千元): 1000

資產交換型態*	換出選擇權
利率交換型態*	付固定收浮動
贖約起日*	20140101
贖約迄日*	20161231
基礎貨幣*	台幣
換入貨幣*	台幣
付息頻率*	每季
付固定利率*(%)	0
收固定利率*(%)	2
贖約代碼	
交易對手	

投資組合: 測試部位 [確定]

帳號名稱: saletest  
帳號權限: 操作帳號  
最後過檔日期: 20141017 15:30:58:60  
最後修改密碼時間: 20140424 15:10:36  
version: 1.0.0.0

## 四、投資組合管理

### A. 計算投資組合

1. 勾選欲計算之投資組合，點選評價

資產類別	投資金額	%
基金	32,000	72.27
股票	275.5	0.62
公司債	1,000	2.26
公債	6,000	13.55
CBAS-固定收益	4,000	9.03
外匯選擇權買權	1,000	2.26
總部位	44,275.5	100

2. 輸入評價基準日，點選確定。

### B. 檢視投資組合

1. 點選投資組合，相關資訊會顯示於右方空白處。

投組已建構完成之示意圖：

資產類別	投資金額	%	資產現值	%
基金	32,000	72.27	-	-
股票	275.5	0.62	-	-
公司債	1,000	2.26	-	-
公債	6,000	13.55	-	-
CBAS-固定收益	4,000	9.03	-	-
外匯選擇權買權	1,000	2.26	-	-
總部位	44,275.5	100	-	-

## C.合併投資組合

1.勾選已存在之投資組合，點選”合併”，即可以合併投資組合。

資產類別	投資金額	%	資產現值	%
基金	32,000	72.27	-	-
股票	275.5	0.62	-	-
公司債	1,000	2.26	-	-
公債	6,000	13.55	-	-
CBAS-固定收益	4,000	9.03	-	-
外匯選擇權買權	1,000	2.26	-	-
總部位	44,775.5	100	-	-

資產類別	資產代碼	資產名稱	投資數目	市價	理論價
基金	0050	台灣50	32,000	-	-
股票	1614	三洋電	156.5	-	-
股票	1907	永豐餘	119	-	-
公司債	B50147	遠東新103-1	1,000	-	-
公債	T10313R	央債甲103-13AR	5,000	-	-
CBAS-固定收益			4,000	N/A	-
公債	A00107	央債100-7	1,000	-	-
外匯選擇權買權		美元換台幣(台幣)買權	1,000	N/A	-

2.命名合併部位投資組合名稱，並勾選是否”同步”

若勾選同步，則未來子投資組合資產新增/刪除，則將連動合併部位

若未勾選同步，則代表此合併部位為一次式的部位建立，未來子部位變動將不會影響合併部位。

### D.投資組合詳細資訊查詢

點擊三角型後點選投資組合資訊，即會顯示此投資組合相關資訊

#### 1.顯示投資組合資訊

名稱	投資數目	市價	理論價
50	32,000	-	-
電	156.5	-	-
券	119	-	-
新103-1	1,000	-	-
甲103-	5,000	-	-
	4,000	N/A	-
100-7	1,000	-	-
換台幣(台	1,000	N/A	-
種權			

#### 2.檢視合併同步管理

詳列出該部位所合併之子部位清單，並可點選”X”，刪除該子部位。

有合併其他部位示意圖：

資產類別	投資金額	%	資產現值
	1,000	72.27	-
	5.5	0.62	-
	100	2.26	-
	100	13.55	-
	100	9.03	-
	100	2.26	-
	100	1.00	-

### 3. 評價報表檢視

查詢一段區間：輸入欲查詢之評價區間

查詢單一日期：起日與迄日輸入同一天



可預覽報表、下載單一資產報表、全部下載報表

部位名稱	日期	債券類別	債券代號	債券簡稱	剩餘期間	存續期間	DV01	票面利率 (%)	評信利率 (%)	成交價	成交價	理論債	理論債 (%)	加碼 (%)	TEJ加碼 (%)	VaR (%)	信賴水準 (%)	備註	
總公司部位	20141017	公債	A00107	100-7	16.802739726027397	14.445794	1373.018295	1.8750	2.088300	-	97.0035	97.4787	2.088300		0.021420036116498675	0.54	99%	此種利率資料日期為20141016	
總公司部位	20141017	公司債	B50147	遠東新103-1	101.5714		1.1439	2c		0.3261457545388424	0.18		99%	NTD	1.0	4.232655	418.472808	此種利率資料日期為20141016	
總公司部位	20141017		1614	三洋電	31.3				4		2.93						99%		
總公司部位	20141017		1907	永昌錶	11.9				5		2.44						99%		
總公司部位	20141017		0050	台灣50	64.0				-		1.62						99%	67.2514	此種交價資料日期為20141016

4.自動計算設定(建議勾選)



E.授權投資組合

1.勾選欲授權給其他使用者的投資組合



2. 選取欲授權的使用者帳號，按下確定後即將此投資組合複製一份給該使用者。



## F. 刪除投資組合

1. 勾選欲刪除之投資組合，點選刪除



## 五、批次上傳功能

### A、部位上傳

1. 點選上傳檔案按鈕，即可進行投資組合資訊的批次上傳

PRIS 資產 投資組合

主類別: 權益證券-現貨  
次類別: 上市股票  
資產代碼: 輸入資產代碼  
代碼查詢 確定

資產名稱:   
貨幣別: 台幣  
持有部位(張):   
取得成本:   
取得日期:

總公司部位

建立時間: 20141017  
資產種類: 7種  
合併同步狀態: 3個投組同步  
自動評價狀態

資產類別	投資金額	%	資產現值	%
基金	31,675	67.2	31,675	93.34
股票	1,958	4.15	275.5	0.81
公司債	1,000	2.12	1,000.52	2.95
公債	7,000	14.85	970.01	2.86
CBAS-固定收益	4,000	8.49	-	-
外匯選擇權買權	1,000	2.12	13	0.04
可轉債	500	1.06	-	-

資產類別	資產代碼	資產名稱	投資數目	市價	理論價
基金	0050	台灣50	31,675	31,675	-
股票	1614	三洋電	156.5	156.5	-
股票	1907	永豐餘	119	119	-
公司債	B50147	遠東新103-1	1,000	1,000.522	1016.1709999999999
公債	T10313R		5,000	-	-
CBAS-固定收益			4,000	N/A	-
公債	A00107	央債100-7	1,000	970.007	974.949
外匯選擇權買權		美元換台幣(台幣)買權	1,000	N/A	13.0
股票	1523	開德	1,682.5	-	-
公債	00063	北二高三	1,000	-	-
可轉債	11031	嘉泥一	500	-	-

2. 保持預設的資產設定檔選項，點選 **browse** 按鈕，進行檔案選取

上傳檔案類型

資產設定檔

請選擇一個或多個上傳檔案

browse

開始上傳 取消

## 六、資料維護狀況查詢功能

1. 點擊右上角小人圖示，展開功能視窗：



2. 點擊傳輸紀錄按鈕，即可開啟視窗查詢現在的資料傳輸過檔狀況，且每次點選就會作資料查詢更新。

