

#### 4.2.5.9. 訊息代號：E09

訊息名稱：部位調整（互抵、當沖）申請記錄查詢通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	5：部位管理作業
	作業項目	9(2)	05：部位調整（互抵）申請記錄查詢
	來源單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號，後三碼應為‘000’或為‘999’
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號‘0001000’
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	欲查詢之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢之期貨商代號，‘9999999’表查詢其全部期貨商資料
	查詢類別	X(1)	0：查詢移出(含當沖)申請記錄 1：查詢移入(含當沖)申請記錄 2：查詢互抵申請記錄

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為‘0’（0：單次傳送處理），傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得惟一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

#### 4.2.5.10. 訊息代號：E10

訊息名稱：部位調整（互抵、當沖）申請記錄查詢回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明	
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統	
	作業類別	9(1)	5：部位管理作業	
	作業項目	9(2)	05：部位調整（互抵）申請記錄查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'	
	目的地單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號, 後三碼應為 '000' 或為 '999'	
	訊息時間	9(6)	回覆資料之時間	
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳, 1：部位已結帳	
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：部位調整（互抵）申請記錄	
	01 資料群組內容	撥出結算會員代號	X(7)	調整口數內容可為正、負值 申請日期格式為：YYYYMMDD 申請時間格式為：HH：MM：：SS
		撥出期貨商代號	X(7)	
		撥出交易人帳號	X(7)	
		撥入結算會員代號	X(7)	
		撥入期貨商代號	X(7)	
		撥入交易人帳號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	

欄位		屬性	欄位說明
	履約價格	X(5)	
	買賣別	X(1)	
	調整口數	9(5)	
	申請日期	9(8)	
	申請時間	9(8)	
	申請編號	9(8)	
	調整狀態	X(1)	空白為尚未核准 'Y' 為申請調整 'N' 為沖正調整 'T' 為當沖申請調整 't' 為當沖沖正申請調整

格式說明：

1. 為期交所應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息資料與傳送 E09 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為資料控制區及資料群組代號內容。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為該資料群組代號(01：部位調整(互抵)申請記錄)下之各筆資料群組內容。
5. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 1 表仍有資料，為 integer 0 表資料結束)。
6. 因包含沖正交易之內容，調整口數之數值可能為正、負值。

#### 4.2.5.41. 訊息代號：E41

訊息名稱：當沖部位調整申請通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	5：部位管理作業
	作業項目	9(2)	21：當沖部位調整申請
	來源單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號, 後三碼應為 '000' 或為 '999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	撥出結算會員代號	X(7)	
	撥出期貨商代號	X(7)	
	撥出交易人帳號	X(7)	
	撥入結算會員代號	X(7)	
	撥入期貨商代號	X(7)	
	撥入交易人帳號	X(7)	
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	空白
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	空白
	買賣別	X(1)	B：買進, S：賣出
調整口數	9(5)	可輸入原調整口數之負值以辦理沖正	

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag) 設定為 '0' (0:單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得惟一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
3. 若欲沖正錯誤之輸入，可輸入原調整口數之負值，例如：欲沖正原調整口數為 10 口之申請，可再輸入-0010 辦理沖正
4. 可申請辦理當沖部位調整之部位餘額 =  $\text{MIN}(\text{本日買進(賣出)部位餘額} - \text{本日買進(賣出)組合部位餘額} + \text{了結口數})$ ，當沖買進(賣出)部位+EUREX 當沖買進(賣出)部位+當沖買進(賣出)撥入部位-當沖買進(賣出)撥出部位)。
5. 撥出方與撥入方需同一期貨商(7碼)及同一個 ID 之不同帳戶。
6. 當沖部位調整需於該商品收盤前(結算系統尾筆接收完成)，即可進行調整。

## 4.2.5.42. 訊息代號：E42

訊息名稱：當沖部位調整申請回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明	
訊 息 控 制 區	系統代號	9(1)	0：結算系統	
	作業類別	9(1)	5：部位管理作業	
	作業項目	9(2)	21：當沖部位調整申請	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'	
	目的地單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號, 後三碼應為 '000' 或為 '999'	
	訊息時間	9(6)	回覆資料之時間	
	當沖截止記號	9(1)	0：當沖未截止, 1：當沖已截止	
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號	
訊 息 資 料 區	資料群組代號	9(2)	01：當沖部位調整申請	
	01 資 料 群 組 內 容	申請日期	9(8)	申請日期格式為：YYYYMMDD 申請時間格式為：HH：MM：SS
		申請時間	9(8)	
		申請編號	9(8)	

格式說明：

1. 為期交所應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 結算會員應用程式依MTS服務程式接收之回覆訊息資料與傳送E41 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為資料控制區及資料群組代號內容。

4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為該資料群組代號(01：當沖部位調整申請資料)下之各筆資料群組內容。
5. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 1 表仍有資料，為 integer 0 表資料結束)。