

期貨結算系統 - 期貨商 (結算會員)
資訊傳輸界面規範書

中華民國一〇五年六月二十四日修訂版

目錄

1. 前言	13
2. 連接結算系統之基本配置	14
2.1. 硬體設備配置	14
2.2. 硬體設備功能規格	15
2.2.1. 通訊線路	15
2.2.2. 主機及安控設備	15
2.3. 軟體系統配置	16
2.4. 軟體系統功能規格	17
2.4.1. 網路通訊協定	17
2.4.2. 安全控管系統	17
2.4.3. 資訊傳遞通訊服務程式 (MTS)	17
2.4.4. 資訊傳遞通訊服務程式介面 (MTS API)	18
2.4.5. 結算業務應用程式	21
3. 傳輸界面作業功能	22
3.1. 作業功能類別	22
3.2. 作業項目說明	28
3.2.1. 期貨部位管理作業	28
3.2.1.1. 交易人部位資料查詢	28
3.2.1.2. 期貨商部位資料查詢	29
3.2.1.3. 結算會員部位資料查詢	30
3.2.1.4. 部位調整 (互抵) 申請	31
3.2.1.5. 部位調整 (互抵) 申請記錄查詢	32
3.2.2. 期貨結算保證金作業(台幣商品)	33
3.2.2.1. 結算保證金查詢 → 停用	33
3.2.2.2. 結算保證金追繳資料查詢 → 停用	34
3.2.2.3. 盤中保證金追繳通告 → 停用	35
3.2.2.4. 結算保證金餘額查詢 → 停用	36
3.2.3. 其他連線作業	37
3.2.3.1. 交易人基本資料登錄(台指) → 停用	37
3.2.3.2. 交易人基本資料查詢(台指) → 停用	38
3.2.3.3. 期交所的公告資料查詢	39
3.2.3.4. 結算服務費資料查詢	40
3.2.3.5. 交易人基本資料登錄(個股)	41
3.2.3.6. 交易人基本資料查詢(個股)	42
3.2.3.7. 交易人公債帳戶登錄(公債) 暨 交易人集保帳號登錄(個股)	43

3.2.3.8. 交易人公債帳戶查詢(公債)	44
3.2.3.9. 期交稅資料查詢(台幣商品)	45
3.2.3.10. 交易人總開戶數查詢	46
3.2.3.11. 期交稅資料查詢	47
3.2.3.12. 匯率暨利率資料查詢	48
3.2.4. 到期履約及實物交割作業	49
3.2.4.1. 自動履約名冊查詢(台指)	49
3.2.4.2. 自動履約名冊登錄(台指)	50
3.2.4.3. 自動履約名冊刪除(台指)	51
3.2.4.4. 履約指派名冊查詢(台指)	52
3.2.4.5. 履約參考名冊查詢(台股)	53
3.2.4.6. 交易人標的證券匯入明細查詢(台股)	54
3.2.4.7. 交易人標的證券餘額查詢(台股)	55
3.2.4.8. 匯入異常資料查詢(台股)	56
3.2.4.9. 存券匯出申請(台股)	57
3.2.4.10. 存券匯出申請查詢(台股)	58
3.2.4.11. 匯出異常資料查詢(台股)	59
3.2.4.12. 匯出異常集保帳號調整(台股)	60
3.2.4.13. 調整台股(1：履約、2：指派、3：履約)集保帳號 暨 調整公債(4：交割)銀行帳戶	61
3.2.4.14. 撥轉名冊查詢(台股)	62
3.2.4.16. 自動履約名冊查詢(台股)	63
3.2.4.17. 自動履約名冊登錄(台股)	64
3.2.4.18. 自動履約名冊刪除(台股)	65
3.2.4.19. 履約指派名冊查詢(台股)	66
3.2.4.20. 債券商品交割明細查詢(公債)	67
3.2.4.21. 賣方交割債券明細申報(公債)	68
3.2.4.22. 買賣方交割債券明細查詢(公債)	69
3.2.4.23. 交易人標的債券匯入明細查詢(公債)	70
3.2.4.24. 交割價款明細查詢(公債)	71
3.2.4.25. 交易人標的證券匯入明細查詢(CoveredCall)	72
3.2.4.26. 交易人標的證券餘額查詢(CoveredCall)	73
3.2.4.27. 匯入異常資料查詢(CoveredCall)	74
3.2.4.28. 存券匯出申請(CoveredCall)	75
3.2.4.29. 存券匯出申請查詢(CoveredCall)	76
3.2.4.30. 匯出異常資料查詢(CoveredCall)	77
3.2.4.31. 匯出異常集保帳號調整(CoveredCall)	78
3.2.4.32. 賣權買方申請交割扣減股數之登錄(CoveredCall)	79
3.2.4.33. 交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢(CoveredCall)	80

3.2.4.34. 撥轉名冊查詢(CoveredCall)	81
3.2.4.35. 撥轉名冊查詢(抵繳)	82
3.2.4.36. 交易人期貨轉現貨申請登錄	83
3.2.4.37. 期貨轉現貨名冊查詢	84
3.2.5. 部位管理作業	86
3.2.5.1. 交易人部位資料查詢	86
3.2.5.2. 期貨商部位資料查詢	87
3.2.5.3. 結算會員部位資料查詢	88
3.2.5.4. 部位調整(互抵)申請	89
3.2.5.5. 部位調整(互抵)申請記錄查詢	90
3.2.5.6. 組合部位調整	91
3.2.5.7. 組合部位調整記錄查詢	92
3.2.5.8. 了結口數調整申請	93
3.2.5.9. 了結口數調整申請記錄查詢	94
3.2.5.10. 平倉錯誤資料查詢	95
3.2.5.11. 交易人組合部位資料查詢	96
3.2.5.12. 期貨商組合部位資料查詢	97
3.2.5.13. 交易人期貨多空組合部位明細資料查詢	98
3.2.5.14. 現金股利買賣方名冊資料查詢	99
3.2.5.15. 交易人部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)	100
3.2.5.16. 期貨商部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)	101
3.2.5.17. 結算會員部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)	102
3.2.6. 結算保證金作業(台幣商品)	103
3.2.6.1. 結算保證金查詢	103
3.2.6.2. 結算保證金追繳資料查詢	104
3.2.6.3. 盤中保證金追繳通告	105
3.2.6.4. 結算保證金餘額查詢	106
3.2.6.5. 商品結算保證金查詢	107
3.2.6.6. 結算保證金追繳資料查詢(CoveredCall)	108
3.2.7. 結算保證金作業	109
3.2.7.1. 結算保證金查詢	109
3.2.7.2. 結算保證金追繳資料查詢	110
3.2.7.3. 盤中保證金追繳通告	111
3.2.7.4. 結算保證金餘額查詢	112
3.2.7.5. 商品結算保證金查詢	113
3.2.7.6. 期交所代結匯資料查詢	114
3.2.7.7. 境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢	115
3.2.7.8. 結算保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)	116

3.2.7.9. 結算保證金追繳資料查詢(依 SPAN 保證金計算).....	117
3.2.7.10. 期貨商應存有暨原始保證金查詢(依 SPAN 保證金計算).....	118
3.2.7.11. 結算保證金各幣別餘額查詢.....	119
3.2.7.12. 期交所代結匯資料查詢(外幣).....	120
3.2.7.13. 期貨商應存有暨原始保證金查詢(外幣).....	121
3.2.7.14. 結算會員抵繳結算保證金資料查詢.....	122
3.2.7.15. 商品狀態查詢.....	123
3.2.7.16. 各盤別保證金及商品損益查詢.....	124
3.2.7.17. 結算保證金追繳資料查詢(多幣別).....	125
3.2.7.18. 結算保證金追繳資料查詢(SPAN+多幣別).....	126
3.2.7.19. 盤中保證金追繳通告(多幣別).....	127
3.2.8. 標的證券抵繳保證金作業.....	128
3.2.8.1. 交易人股票及國際債匯入明細查詢.....	128
3.2.8.2. 交易人股票及國際債餘額查詢.....	129
3.2.8.3. 股票及國際債匯入異常資料查詢.....	130
3.2.8.4. 股票及國際債存券匯出申請.....	131
3.2.8.5. 股票及國際債存券匯出申請資料查詢.....	132
3.2.8.6. 買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄.....	133
3.2.8.7. 交易人公債餘額查詢.....	134
3.2.8.8. 交易人公債抵繳明細資料申報.....	135
3.2.8.9. 交易人公債抵繳明細申報資料查詢.....	136
3.2.8.10. 交易人股票及國際債匯入明細查詢.....	137
3.2.8.11. 交易人公債匯出資料查詢.....	138
3.2.8.12. 交易人公債利息匯款帳號申報.....	139
3.2.8.13. 交易人公債利息明細資料查詢.....	140
3.2.8.14. 交易人有價證券抵繳保證金明細查詢.....	141
3.2.8.15. 交易人抵繳約定碼申報.....	142
3.2.8.16. 交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢.....	143
4. 訊息傳輸格式及說明.....	144
4.1. 訊息傳輸基本格式.....	144
4.2. 各項訊息傳輸格式.....	149
4.2.1. 期貨部位管理作業.....	149
4.2.1.1. 訊息代號：A01.....	149
4.2.1.2. 訊息代號：A02.....	151
4.2.1.3. 訊息代號：A03.....	153
4.2.1.4. 訊息代號：A04.....	154
4.2.1.5. 訊息代號：A05.....	156

4.2.1.6. 訊息代號：A06.....	157
4.2.1.7. 訊息代號：A07.....	159
4.2.1.8. 訊息代號：A08.....	161
4.2.1.9. 訊息代號：A09.....	163
4.2.1.10. 訊息代號：A10.....	164
4.2.2. 期貨結算保證金作業(台幣商品).....	166
4.2.2.1. 訊息代號：B01 → 停用.....	166
4.2.2.2. 訊息代號：B02 → 停用.....	167
4.2.2.3. 訊息代號：B03 → 停用.....	169
4.2.2.4. 訊息代號：B04 → 停用.....	170
4.2.2.5. 訊息代號：B05 → 停用.....	173
4.2.2.6. 訊息代號：B06 → 停用.....	175
4.2.2.7. 訊息代號：B07 → 停用.....	176
4.2.3. 其他連線作業.....	178
4.2.3.1. 訊息代號：C01 → 停用.....	178
4.2.3.2. 訊息代號：C02 → 停用.....	180
4.2.3.3. 訊息代號：C03 → 停用.....	181
4.2.3.4. 訊息代號：C04 → 停用.....	182
4.2.3.5. 訊息代號：C05.....	184
4.2.3.6. 訊息代號：C06.....	185
4.2.3.7. 訊息代號：C07.....	187
4.2.3.8. 訊息代號：C08.....	188
4.2.3.9. 訊息代號：C09.....	190
4.2.3.10. 訊息代號：C10.....	195
4.2.3.11. 訊息代號：C11.....	196
4.2.3.12. 訊息代號：C12.....	197
4.2.3.13. 訊息代號：C13.....	202
4.2.3.14. 訊息代號：C14.....	203
4.2.3.15. 訊息代號：C15.....	204
4.2.3.16. 訊息代號：C16.....	205
4.2.3.17. 訊息代號：C17.....	206
4.2.3.18. 訊息代號：C18.....	207
4.2.3.19. 訊息代號：C19.....	209
4.2.3.20. 訊息代號：C20.....	210
4.2.3.21. 訊息代號：C21.....	211
4.2.3.22. 訊息代號：C22.....	212
4.2.3.23. 訊息代號：C23.....	214
4.2.3.24. 訊息代號：C24.....	215

4.2.4. 到期履約及實物交割作業.....	217
4.2.4.1. 訊息代號：D01.....	217
4.2.4.2. 訊息代號：D02.....	218
4.2.4.3. 訊息代號：D03.....	220
4.2.4.4. 訊息代號：D04.....	222
4.2.4.5. 訊息代號：D05.....	223
4.2.4.6. 訊息代號：D06.....	225
4.2.4.7. 訊息代號：D07.....	226
4.2.4.8. 訊息代號：D08.....	227
4.2.4.9. 訊息代號：D09.....	229
4.2.4.10. 訊息代號：D10.....	231
4.2.4.11. 訊息代號：D11.....	233
4.2.4.12. 訊息代號：D12.....	234
4.2.4.13. 訊息代號：D13.....	236
4.2.4.14. 訊息代號：D14.....	237
4.2.4.15. 訊息代號：D15.....	239
4.2.4.16. 訊息代號：D16.....	240
4.2.4.17. 訊息代號：D17.....	242
4.2.4.18. 訊息代號：D18.....	243
4.2.4.19. 訊息代號：D19.....	244
4.2.4.20. 訊息代號：D20.....	245
4.2.4.21. 訊息代號：D21.....	247
4.2.4.22. 訊息代號：D22.....	248
4.2.4.23. 訊息代號：D23.....	250
4.2.4.24. 訊息代號：D24.....	251
4.2.4.25. 訊息代號：D25.....	252
4.2.4.26. 訊息代號：D26.....	254
4.2.4.27. 訊息代號：D27.....	255
4.2.4.28. 訊息代號：D28.....	257
4.2.4.31. 訊息代號：D31.....	260
4.2.4.32. 訊息代號：D32.....	262
4.2.4.33. 訊息代號：D33.....	264
4.2.4.34. 訊息代號：D34.....	266
4.2.4.35. 訊息代號：D35.....	267
4.2.4.36. 訊息代號：D36.....	268
4.2.4.37. 訊息代號：D37.....	269
4.2.4.38. 訊息代號：D38.....	270
4.2.4.39. 訊息代號：D39.....	272

4.2.4.40. 訊息代號：D40.....	273
4.2.4.41. 訊息代號：D41.....	275
4.2.4.42. 訊息代號：D42.....	276
4.2.4.43. 訊息代號：D43.....	277
4.2.4.44. 訊息代號：D44.....	278
4.2.4.45. 訊息代號：D45.....	280
4.2.4.46. 訊息代號：D46.....	281
4.2.4.47. 訊息代號：D47.....	283
4.2.4.48. 訊息代號：D48.....	284
4.2.4.49. 訊息代號：D49.....	286
4.2.4.50. 訊息代號：D50.....	287
4.2.4.51. 訊息代號：D51.....	289
4.2.4.52. 訊息代號：D52.....	290
4.2.4.53. 訊息代號：D53.....	294
4.2.4.54. 訊息代號：D54.....	295
4.2.4.55. 訊息代號：D55.....	297
4.2.4.56. 訊息代號：D56.....	298
4.2.4.57. 訊息代號：D57.....	299
4.2.4.58. 訊息代號：D58.....	300
4.2.4.59. 訊息代號：D59.....	302
4.2.4.60. 訊息代號：D60.....	303
4.2.4.61. 訊息代號：D61.....	305
4.2.4.62. 訊息代號：D62.....	307
4.2.4.63. 訊息代號：D63.....	308
4.2.4.64. 訊息代號：D64.....	309
4.2.4.65. 訊息代號：D65.....	310
4.2.4.66. 訊息代號：D66.....	312
4.2.4.67. 訊息代號：D67.....	314
4.2.4.68. 訊息代號：D68.....	316
4.2.4.69. 訊息代號：D69.....	319
4.2.4.70. 訊息代號：D70.....	321
4.2.4.71. 訊息代號：D71.....	324
4.2.4.72. 訊息代號：D72.....	325
4.2.4.73. 訊息代號：D73.....	326
4.2.4.74. 訊息代號：D74.....	327
4.2.5. 部位管理作業.....	329
4.2.5.1. 訊息代號：E01.....	329
4.2.5.2. 訊息代號：E02.....	331

4.2.5.3. 訊息代號：E03	334
4.2.5.4. 訊息代號：E04	335
4.2.5.5. 訊息代號：E05	338
4.2.5.6. 訊息代號：E06	339
4.2.5.7. 訊息代號：E07	342
4.2.5.8. 訊息代號：E08	344
4.2.5.9. 訊息代號：E09	346
4.2.5.10. 訊息代號：E10	347
4.2.5.11. 訊息代號：E11.....	349
4.2.5.12. 訊息代號：E12	352
4.2.5.13. 訊息代號：E13	353
4.2.5.14. 訊息代號：E14	354
4.2.5.15. 訊息代號：E15	356
4.2.5.16. 訊息代號：E16	358
4.2.5.17. 訊息代號：E17	359
4.2.5.18. 訊息代號：E18	360
4.2.5.19. 訊息代號：E19	362
4.2.5.20. 訊息代號：E20	363
4.2.5.21. 訊息代號：E21	365
4.2.5.22. 訊息代號：E22	367
4.2.5.23. 訊息代號：E23	369
4.2.5.24. 訊息代號：E24	370
4.2.5.25. 訊息代號：E25	372
4.2.5.26. 訊息代號：E26	373
4.2.5.27. 訊息代號：E27	375
4.2.5.28. 訊息代號：E28	376
4.2.5.29. 訊息代號：E29	378
4.2.5.30. 訊息代號：E30	380
4.2.5.3. 訊息代號：E31	383
4.2.5.4. 訊息代號：E32	384
4.2.5.5. 訊息代號：E33	387
4.2.5.6. 訊息代號：E34	388
4.2.6. 結算保證金作業(台幣商品).....	392
4.2.6.1. 訊息代號：F01.....	392
4.2.6.2. 訊息代號：F02.....	393
4.2.6.3. 訊息代號：F03.....	395
4.2.6.4. 訊息代號：F04.....	396
4.2.6.5. 訊息代號：F05.....	400

4.2.6.6. 訊息代號：F06.....	402
4.2.6.7. 訊息代號：F07.....	403
4.2.6.8. 訊息代號：F08.....	406
4.2.6.9. 訊息代號：F09.....	407
4.2.6.10. 訊息代號：F10.....	410
4.2.6.11. 訊息代號：F11.....	411
4.2.7. 結算保證金作業.....	415
4.2.7.1. 訊息代號：G01.....	415
4.2.7.2. 訊息代號：G02.....	416
4.2.7.3. 訊息代號：G03.....	418
4.2.7.4. 訊息代號：G04.....	419
4.2.7.5. 訊息代號：G05.....	424
4.2.7.6. 訊息代號：G06.....	426
4.2.7.7. 訊息代號：G07.....	427
4.2.7.8. 訊息代號：G08.....	431
4.2.7.9. 訊息代號：G09.....	432
4.2.7.10. 訊息代號：G10.....	435
4.2.7.11. 訊息代號：G11.....	436
4.2.7.12. 訊息代號：G12.....	438
4.2.7.13. 訊息代號：G13.....	439
4.2.7.14. 訊息代號：G14.....	441
4.2.7.15. 訊息代號：G15.....	442
4.2.7.16. 訊息代號：G16.....	444
4.2.7.17. 訊息代號：G17.....	445
4.2.7.18. 訊息代號：G18.....	450
4.2.7.19. 訊息代號：G19.....	451
4.2.7.20. 訊息代號：G20.....	453
4.2.7.21. 訊息代號：G21.....	454
4.2.7.22. 訊息代號：G22.....	456
4.2.7.23. 訊息代號：G23.....	457
4.2.7.24. 訊息代號：G24.....	459
4.2.7.25. 訊息代號：G25.....	460
4.2.7.26. 訊息代號：G26.....	462
4.2.7.27. 訊息代號：G27.....	463
4.2.7.28. 訊息代號：G28.....	465
4.2.7.29. 訊息代號：G29.....	466
4.2.7.30. 訊息代號：G30.....	467
4.2.7.31. 訊息代號：G31.....	468

4.2.7.32. 訊息代號：G32.....	471
4.2.7.33. 訊息代號：G33.....	472
4.2.7.34. 訊息代號：G34.....	478
4.2.7.35. 訊息代號：G35.....	479
4.2.7.36. 訊息代號：G36.....	485
4.2.8. 標的證券抵繳保證金作業.....	487
4.2.8.1. 訊息代號：H01.....	487
4.2.8.2. 訊息代號：H02.....	488
4.2.8.3. 訊息代號：H03.....	490
4.2.8.4. 訊息代號：H04.....	491
4.2.8.5. 訊息代號：H05.....	494
4.2.8.6. 訊息代號：H06.....	495
4.2.8.7. 訊息代號：H07.....	498
4.2.8.8. 訊息代號：H08.....	500
4.2.8.9. 訊息代號：H09.....	501
4.2.8.10. 訊息代號：H10.....	502
4.2.8.11. 訊息代號：H11.....	504
4.2.8.12. 訊息代號：H12.....	506
4.2.8.13. 訊息代號：H13.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.14. 訊息代號：H14.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.15. 訊息代號：H15.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.16. 訊息代號：H16.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.17. 訊息代號：H17.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.18. 訊息代號：H18.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.19. 訊息代號：H19.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.20. 訊息代號：H20.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.21. 訊息代號：H21.....	錯誤! 尚未定義書籤。
4.2.8.23. 訊息代號：H23.....	525
4.2.8.24. 訊息代號：H24.....	526
4.2.8.25. 訊息代號：H25.....	527
4.2.8.27. 訊息代號：H27.....	531
4.2.8.28. 訊息代號：H28.....	533
4.2.8.29. 訊息代號：H29.....	535
4.2.8.30. 訊息代號：H30.....	536
4.2.8.31. 訊息代號：H31.....	537
4.2.8.32. 訊息代號：H32.....	538
4.2.8. 訊息代號：E99.....	539
5. 附錄.....	540

5.1. 訊息代號一覽表.....	540
5.2. 各項代碼對照表.....	551
5.3. 錯誤回覆代碼對照表.....	557
5.4. MTS 應用程式介面 API 使用說明.....	566
5.4.1. MTS 使用架構及功能：.....	566
5.4.1.1. MTS 使用架構圖.....	566
5.4.1.2. MTS 使用架構說明.....	567
5.4.1.3. MTS 股務程式功能.....	567
5.4.2. 應用程式介面 (API) 函式.....	568
5.4.3. 應用程式介面 (API) 編碼順序.....	570
5.4.3.1. 同步方式(synchronous).....	570
5.4.3.2. 非同步方式交易(asynchronous).....	572
5.4.3.3. one-way 訊息傳送.....	573
5.4.4. 程式範例說明.....	574
5.4.4.1. 單筆交易 (synchronous).....	574
5.4.4.2. 多筆交易 (synchronous).....	577
5.4.4.3. 單筆、多筆交易 (asynchronous).....	580
5.4.5. 編譯程式.....	585
5.5. MTS 資訊傳輸界面規範說明.....	586
5.5.1. MTS 系統架構.....	586
5.5.2. 資訊傳輸介面規範總則.....	587
5.5.2.1. 一般格式：.....	587
5.5.2.2. 資料加解密原則.....	588
5.5.3. 資訊傳輸介面規範細目.....	589
5.5.3.1. 開業申請作業.....	589
5.5.3.2. 開機連線作業.....	591
5.5.3.3. 資訊傳輸作業.....	600
5.5.3.4. 關機連線作業.....	612
5.5.3.5. 期交所新金匙(Public Key) 發佈交換作業.....	614
5.5.4. 「控制參數對照表」.....	618
5.5.5. 「控制碼對照表」.....	622
5.5.6. 「MSG ID 對照表」.....	624

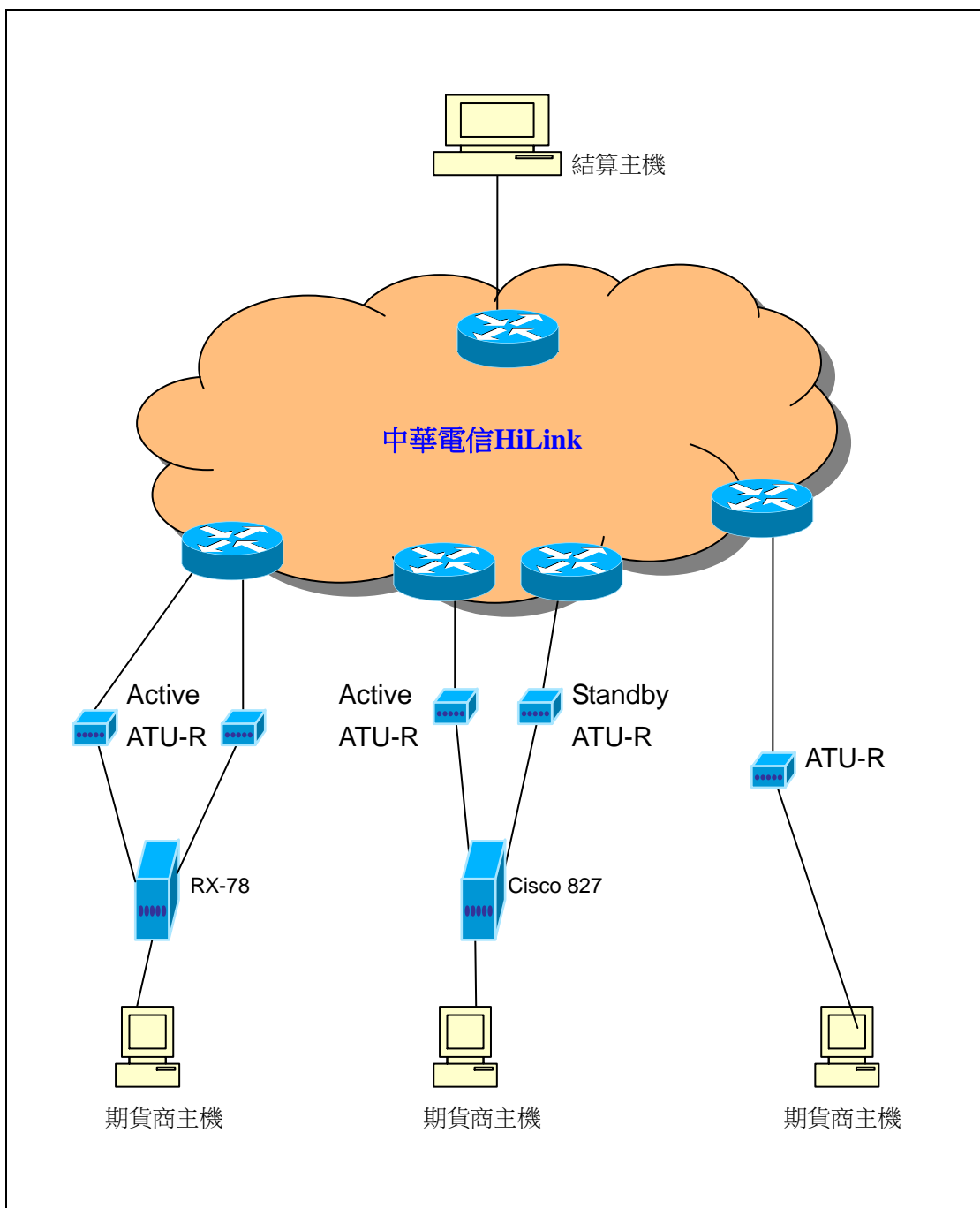
1. 前言

台灣期貨交易所(以下簡稱期交所)因應國內經濟發展趨勢,規劃期貨市場採取電腦自動撮合之交易方式,而有關於其與結算會員間之結算作業亦規劃以電腦連線作業方式完成,俾期貨市場之整體運作達到高度安全且有效率之目標。

本規範書係訂定期貨商(結算會員)使用之電腦與期交所結算主機間電腦連線作業之資訊傳輸界面,作為期貨商(結算會員)開發其相關電腦系統之主要依據。本規範書之編列方式除前言外,並將按連接期交所結算主機基本配置,傳輸界面作業功能,訊息傳輸格式及說明以及附錄等大綱依序編撰,主要內容為期交所與各期貨商(結算會員)間處理有關期貨結算業務時電腦連線之作業方式及雙方之通訊協定;本規範書經編訂後,未來得視實際需要再行補充或修訂,並由期交所公佈。

2. 連接結算系統之基本配置

2.1. 硬體設備配置



2.2. 硬體設備功能規格

2.2.1. 通訊線路

使用中華電信公司 ADSL 專線；相關線路申請表請至集保結算所網站

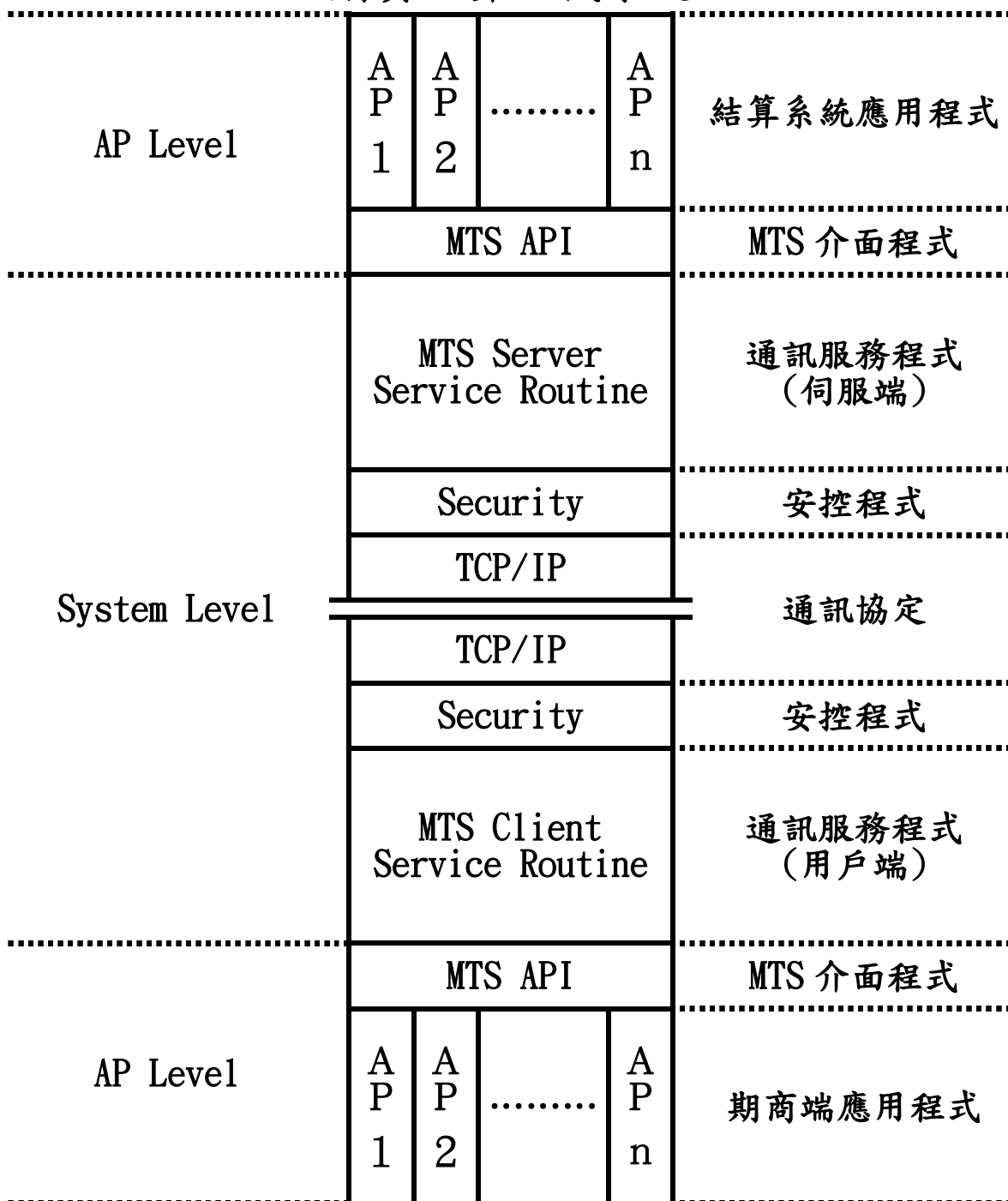
(<http://www.tdcc.com.tw>) 下載專區中之其他下載資料下載。

2.2.2. 主機及安控設備

- (1) 使用之電腦主機設備，配合開放式環境系統其硬體規格並無特別限定。
- (2) 使用之安控設備需符合 RSA 規範並可達成下列功能：
 - (a) 主機透過 TCP/IP 網路與前項電腦主機連接。
 - (b) 具備產生 RSA 密匙(key)功能並可採用 Smart Card 方式或其他儲存設備存放 RSA 密匙。
 - (c) 具備與期貨結算主機安控系統協同工作之能力。

2.3. 軟體系統配置

期貨結算主機系統



期商端電腦系統

2.4. 軟體系統功能規格

2.4.1. 網路通訊協定

通訊底層使用目前應用最為廣泛之 TCP/IP 通訊協定。

2.4.2. 安全控管系統

安全系統需提供用戶端應用程式對期交所各項安全控管之對應處理功能。包括 RSA、DES、IDEA 的加解密計算方法，MD5、SHA-1 的雜湊函數、電子簽章以及所衍生之各項功能。

- (1) 使用 RSA 1024 bits 與 DES 等獨立硬體加解密之安全運算能力。使用 real time clock 可於進行電子簽章時自動加入時間戳印。
- (2) 提供 API 以便與應用系統整合（包括 Windows-NT 及各主要 UNIX）。
- (3) 提供內接式 1.44MB 磁碟機，可依客戶環境進行安裝
- (4) 及金匙交換使用。亦可選購使用具備讀寫 IC Card 之讀卡機（具備 ISO 7816 Standard, 如 Gemplus card）。
- (5) 私有式基碼自磁碟機或 IC 卡內讀出後直接於硬體機體內部進行 RSA 運算，私有式基碼產製(Key Generation)過程不脫離機體。
- (6) 可經由 RS-232 埠或乙太網路卡與用戶端設備連線。
- (7) 本項設備為密封式，受任何外力開啟護蓋時，即自動銷毀內部基碼資料。
- (8) 本安控系統內建系統介面由 MTS 進行整體安控服務。期貨後台應用程式，透過 MTS API，由 MTS 系統負責呼叫安控系統，提供各式加解密及身份認證功能。如期貨商後台系統不採用 MTS 系統服務，則其通訊服務、資訊傳輸服務及資料安控服務需自行建置，其系統架構自行發展。

2.4.3. 資訊傳遞通訊服務程式 (MTS)

為降低結算業務應用程式、用戶端應用程式及伺服與用戶端網路通訊收送程式之

編寫複雜度，規劃使用主機常駐資訊傳遞通訊服務程式(MTS:Message Transport Services)於結算伺服器與用戶端主機之連線作業。

由 MTS 負責伺服器與用戶端之 TCP/IP 網路通訊與資訊傳遞之收送。伺服器與用戶端結算業務應用程式僅需呼叫 MTS 之應用程式介面(API)即可完成結算相關資訊收送目的，MTS 具備之功能如下：

- (1) 保證送達資訊(Guaranteed Delivery)。
- (2) 自動追蹤資訊順序(Sequence)。
- (3) 檢查資訊長度。
- (4) 使用儲送模式(Stored and Forward)斷線後重新傳送。
- (5) 連線主機日期及時間中央基準化(Date/Time synchronization)。
- (6) 提供 C 高階程式語言介面。
- (7) 可自動負載平衡(Workload balance)。
- (8) 多主機備援。

2.4.4. 資訊傳遞通訊服務程式介面 (MTS API)

期貨商結算業務應用程式使用 MTS 服務程式功能時，需配合使用該程式介面(MTS API)提供之函式，使用方式詳如附錄 5.4. 「MTS 應用程式介面 API 使用說明」，基本函式如下：

(1) integer mts_init(sid)

integer *sid

Return Code :

0 : 正常 ; sid 為 session number

-1 : 不正常

此函式為應用程式要求 mts 服務前必須呼叫之起啟函式。

(2) integer mts_close(sid)

integer *sid

Return Code :

0 : 正常 ; sid 為 session number

-1 : 不正常

此函式為應用程式結束 mts 服務前必須呼叫之函式。

(3) integer mts_get(sid, buffer, length)

integer sid 為 session number

char *buffer(為資料存放區)

integer *length (length 先設為 buffer 長度，函式呼叫結束後，length 為實際資料長度)

Return Code :

0 : 資料結束(No More Data, 此筆為最後一筆)

-1 : 不正常

-2 : 尚未建立 session

-3 : buffer length 不夠長

1 : 還有資料可取

2 : 資料不完整

3 : 資料尚未來

此函式為應用程式向 mts 服務索取資料所呼叫之函式。

(4) integer mts_put(sid, flag, buffer, length)

integer sid 為 session number

char flag ('0' 表最後一筆資料送出， '1' 表後面還有資料需送出)

char *buffer(為資料存放區)

integer *length (length 先設為 buffer 長度，函式呼叫結束後，length 為實際資料長度)

Return Code :

- 0 : 資料結束
- 1 : 不正常
- 2 : 尚未建立 session
- 3 : length 太長
- 4 : flag 不正確

此函式為應用程式向 mts 服務要求資料傳送所呼叫之函式。

(5) integer mts_getreqid(sid , reqid)

integer sid

integer *reqid(request ID)

Return Code :

- 0 : 正常，且傳回 reqid 為 request ID
- 1 : 不正常
- 2 : 尚未建立 session

此函式為應用程式進行非同步程式設計時所使用之 mts 服務呼叫函式。

(6) integer mts_setreqid(sid , reqid)

integer sid

integer reqid(request ID)

Return Code :

- 0 : 正常，且傳回 reqid 為 request ID
- 1 : 不正常
- 2 : 尚未建立 session

此函式為應用程式進行非同步程式設計時所使用之 mts 服務呼叫函式。

2.4.5. 結算業務應用程式

期貨商(結算會員)結算應用程式可自行開發或使用資訊廠商開發之軟體;惟其功能需符合「期貨業務結算作業系統期貨商(結算會員)資訊傳輸界面說明書」所訂規格。

3. 傳輸界面作業功能

3.1. 作業功能類別

(1) 期貨商(結算會員)電腦系統與期交所結算主機間訊息傳輸界面，依作業功能

區分，可分為：

- (a) 期貨部位管理作業
- (b) 期貨結算保證金作業(台幣商品) → 停用
- (c) 其他連線作業等
- (d) 到期履約及實物交割作業等
- (e) 部位管理作業
- (f) 結算保證金作業(台幣商品)
- (g) 結算保證金作業
- (h) 標的證券抵繳保證金作業

八大類，於訊息傳輸格式中係以作業類別欄位作區分。

(2) 各類作業功能所提供之作業項目，對照訊息傳輸格式中之作業項目欄位分別

列示如下：

- (a) 1：期貨部位管理作業
 - 01：交易人部位資料查詢
 - 02：期貨商部位資料查詢
 - 03：結算會員部位資料查詢
 - 04：部位調整(互抵)申請
 - 05：部位調整(互抵)申請記錄查詢

- (b) 2：期貨結算保證金作業(台幣商品) → 全部交易停用

- 01：結算保證金查詢
- 02：結算保證金追繳資料查詢
- 03：盤中保證金追繳通告
- 04：結算保證金餘額查詢

(c) 3：其他連線作業

- 01：交易人基本資料登錄(台指) → 停用
- 02：交易人基本資料查詢(台指) → 停用
- 03：期交所的公告資料查詢
- 04：結算服務費資料查詢
- 05：交易人基本資料登錄(個股)
- 06：交易人基本資料查詢(個股)
- 07：交易人公債帳戶登錄(公債) 暨 交易人集保帳號登錄(個股)
- 08：交易人公債帳戶查詢(公債)
- 09：期交稅資料查詢(台幣商品)
- 10：交易人總開戶數查詢
- 11：期交稅資料查詢

(d) 4：到期履約及實物交割作業

- 01：自動履約名冊查詢(台指)
- 02：自動履約名冊登錄(台指)
- 03：自動履約名冊刪除(台指)
- 04：履約指派名冊查詢(台指)
- 05：履約參考名冊查詢(個股)
- 06：交易人標的證券匯入明細查詢(個股)

- 07：交易人標的證券餘額查詢(個股)
- 08：匯入異常資料查詢(個股)
- 09：存券匯出申請(個股)
- 10：存券匯出申請查詢(個股)
- 11：匯出異常資料查詢(個股)
- 12：匯出異常集保帳號調整(個股)
- 13：調整個股(1：履約、2：指派、3：履約參考)集保帳號 暨 調整公債(4：交割)銀行帳戶
- 14：撥轉名冊查詢(個股)
- 16：自動履約名冊查詢(個股)
- 17：自動履約名冊登錄(個股)
- 18：自動履約名冊刪除(個股)
- 19：履約指派名冊查詢(個股)
- 20：債券商品交割明細查詢(公債)
- 21：賣方交割債券明細申報(公債)
- 22：買賣方交割債券明細查詢(公債)
- 23：交易人標的債券匯入明細查詢(公債)
- 24：交割價款明細查詢(公債)
- 25：交易人標的證券匯入明細查詢(CoveredCall)
- 26：交易人標的證券餘額查詢(CoveredCall)
- 27：匯入異常資料查詢(CoveredCall)
- 28：存券匯出申請(CoveredCall)
- 29：存券匯出申請查詢(CoveredCall)
- 30：匯出異常資料查詢(CoveredCall)
- 31：匯出異常集保帳號調整(CoveredCall)

- 32：賣權買方申請交割扣減股數之登錄(CoveredCall)
- 33：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢(CoveredCall)
- 34：撥轉名冊查詢(CoveredCall)
- 35：撥轉名冊查詢(抵繳)

(e) 5：部位管理作業

- 01：交易人部位資料查詢
- 02：期貨商部位資料查詢
- 03：結算會員部位資料查詢
- 04：部位調整(互抵)申請
- 05：部位調整(互抵)申請記錄查詢
- 06：組合部位調整
- 07：組合部位調整記錄查詢
- 08：了結口數調整
- 09：了結口數調整紀錄查詢
- 10：平倉錯誤資料查詢
- 11：交易人組合部位資料查詢
- 12：期貨商組合部位資料查詢
- 13：交易人期貨多空組合部位明細查詢

(f) 6：結算保證金作業(台幣商品)

- 01：結算保證金查詢
- 02：結算保證金追繳資料查詢
- 03：盤中保證金追繳通告
- 04：結算保證金餘額查詢

05：商品結算保證金查詢

06：結算保證金追繳資料查詢(CoveredCall)

(g) 7：結算保證金作業

01：結算保證金查詢

02：結算保證金追繳資料查詢

03：盤中保證金追繳通告

04：結算保證金餘額查詢

05：商品結算保證金查詢

06：期交所代結匯資料查詢

07：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢

08：結算保證金查詢

09：結算保證金追繳資料查詢

10：期貨商應存有暨原始保證金查詢

11：結算保證金各幣別餘額查詢

12：期交所代結匯資料查詢(外幣)

13：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢(外幣)

14：結算會員抵繳結算保證金資料查詢

15：商品狀態查詢

16：各盤別保證金及商品損益查詢

17：結算保證金追繳資料查詢(多幣別)

18：結算保證金追繳資料查詢(SPAN+多幣別)

19：盤中保證金追繳通告(多幣別)

(h) 8：標的證券抵繳保證金作業

- 01：交易人股票及國際債匯入明細查詢
- 02：交易人股票及國際債餘額查詢
- 03：股票及國際債匯入異常資料查詢
- 04：股票及國際債存券匯出申請
- 05：票及國際債存券匯出申請資料查詢
- 06：買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄
- 07：交易人公債餘額查詢
- 08：交易人公債抵繳明細資料申報
- 09：交易人公債抵繳明細申報資料查詢
- 10：交易人股票及國際債匯入明細查詢
- 11：交易人公債匯出資料查詢
- 12：交易人公債利息匯款帳號申報
- 13：交易人公債利息明細資料查詢
- 14：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢
- 15：交易人抵繳約定碼申報
- 16：交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢

3.2. 作業項目說明

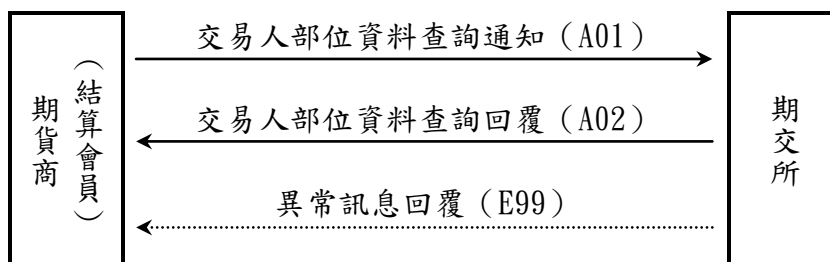
各類作業功能其作業項目提供之服務功能及相關訊息流程，說明如下：

3.2.1. 期貨部位管理作業

3.2.1.1. 交易人部位資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其分公司)向期交所查詢其交易人之部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

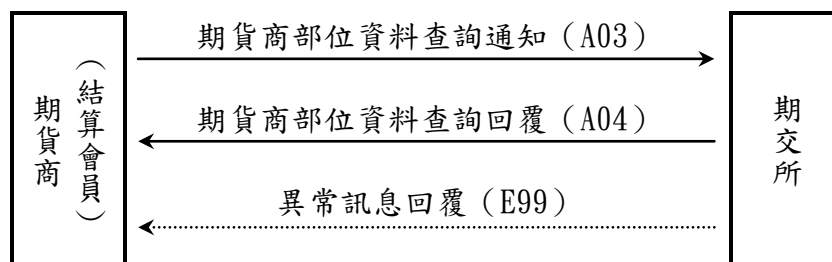


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(A01)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(A02)有關查詢之交易人部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.1.2. 期貨商部位資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

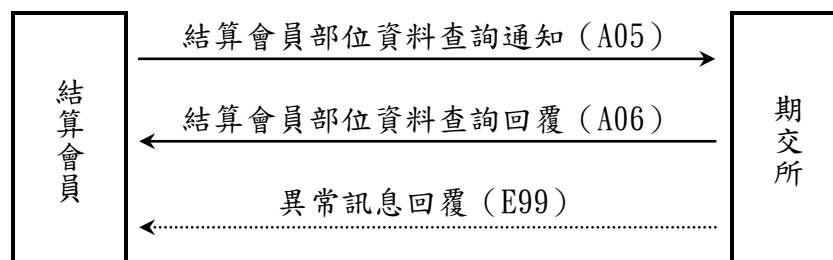


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(A03)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(A04)有關查詢之期貨商部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.1.3. 結算會員部位資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其所有(包含總分公司、經紀商及代結算)之部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

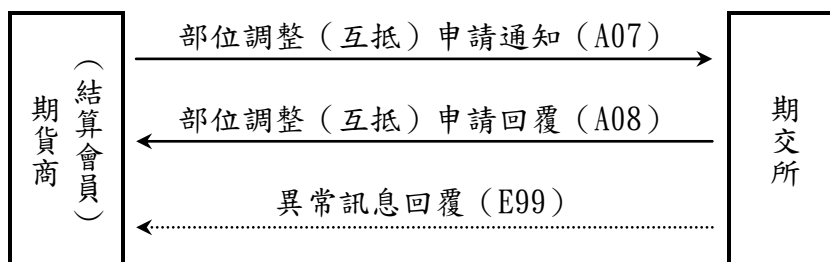


(3) 相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(A05) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(A06)有關查詢之部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.1.4. 部位調整(互抵)申請

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司;進行互抵時,可代其下手或分公司)向期交所申請辦理其未平倉部位數額移轉,為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

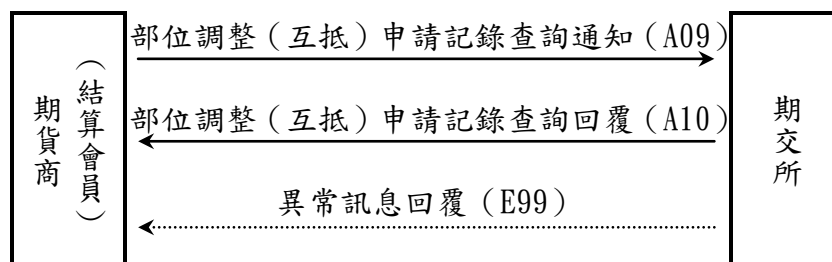


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(A07)訊息,通知期交所結算主機執行本項作業,若正常時即可自線上接收訊息代號(A08)有關調整(互抵)申請之回覆資料;異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.1.5. 部位調整（互抵）申請記錄查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其辦理申請部位調整（互抵）之記錄，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



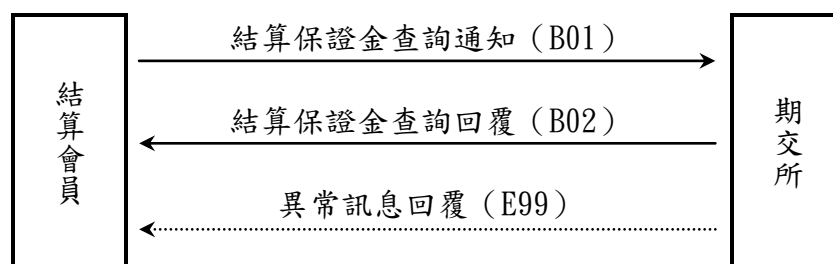
(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(A09)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(A10)有關調整申請記錄之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.2. 期貨結算保證金作業(台幣商品)

3.2.2.1. 結算保證金查詢 → 停用

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

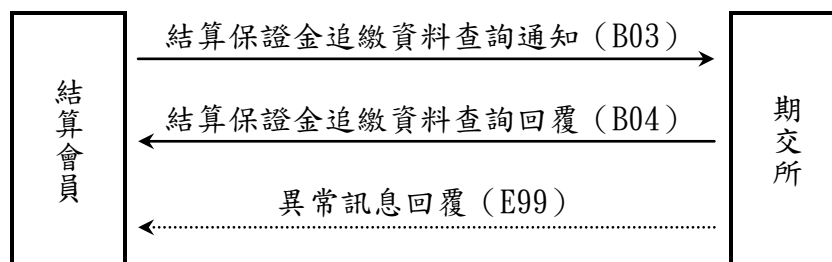


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(B01) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(B02)有關查詢之結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.2.2. 結算保證金追繳資料查詢 → 停用

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

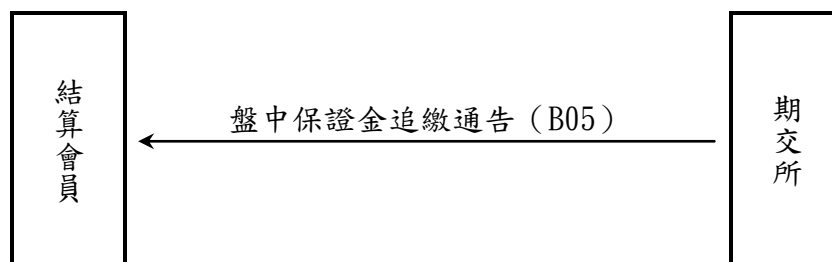


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(B03) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(B04)有關查詢之結算保證金追繳資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.2.3. 盤中保證金追繳通告 → 停用

(1)服務功能：期交所於盤中洗價後，主動通知須追繳保證金之結算會員其追繳資料，為一單向訊息通告。

(2)訊息流程：

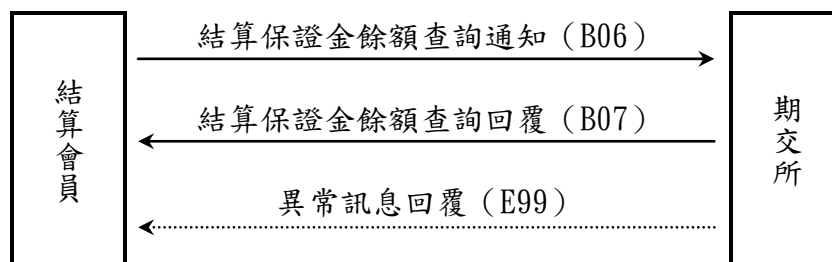


(3)相關說明：期交所以連線方式發送訊息代號(B05)將盤中追繳資料，主動通知結算會員接收。

3.2.2.4. 結算保證金餘額查詢 → 停用

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其結算保證金餘額資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



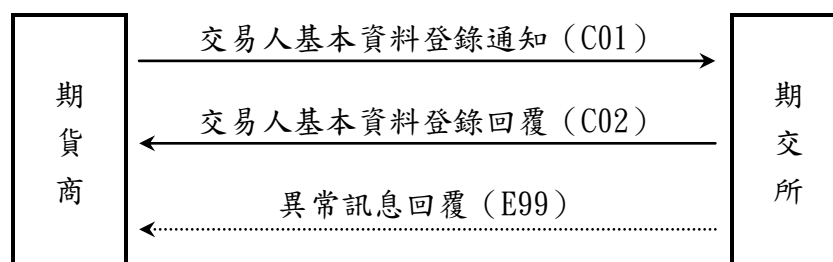
(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(B06) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(B07)有關查詢之結算保證金餘額資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3. 其他連線作業

3.2.3.1. 交易人基本資料登錄(台指) → 停用

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所登錄其交易人之基本資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

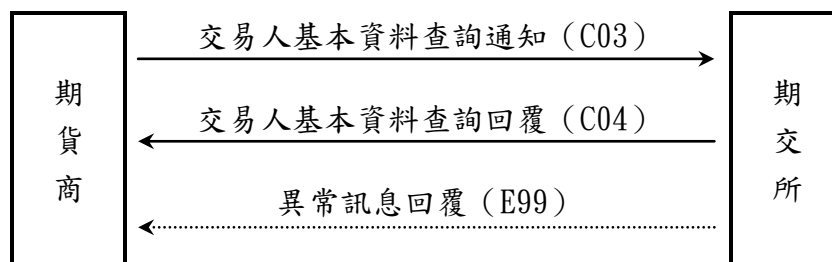


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C01)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，時即可自線上接收訊息代號(C02)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.2. 交易人基本資料查詢(台指) → 停用

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所查詢交易人基本資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

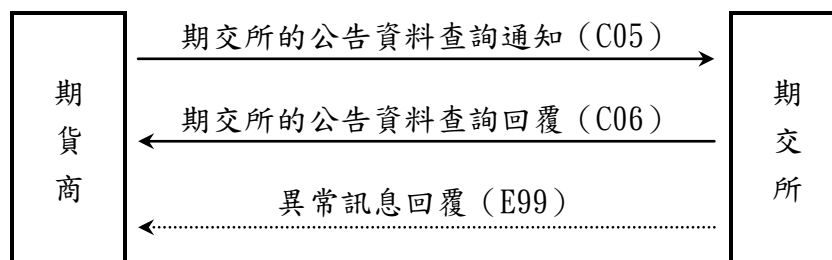


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C03) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C04)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.3. 期交所的公告資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商查詢期交所的公告資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

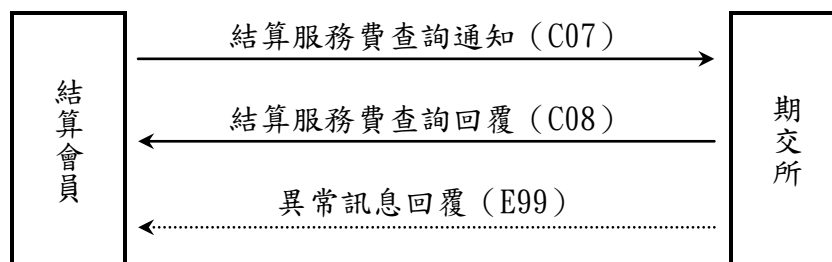


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(C05) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C06) 有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.4. 結算服務費資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所結算系統查詢結算服務費資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

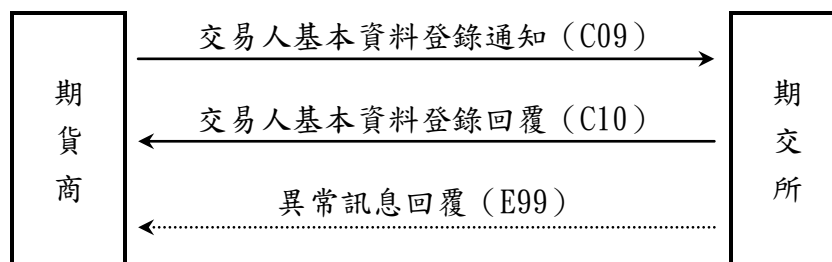


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(C07) 訊息，通知結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C08)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.5. 交易人基本資料登錄(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所登錄其交易人之基本資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

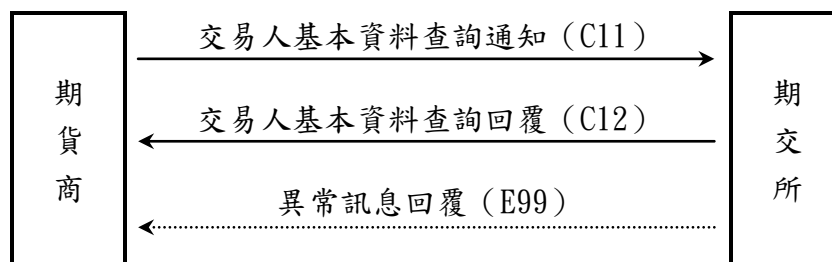


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C09) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，時即可自線上接收訊息代號(C10)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.6. 交易人基本資料查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所查詢交易人基本資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

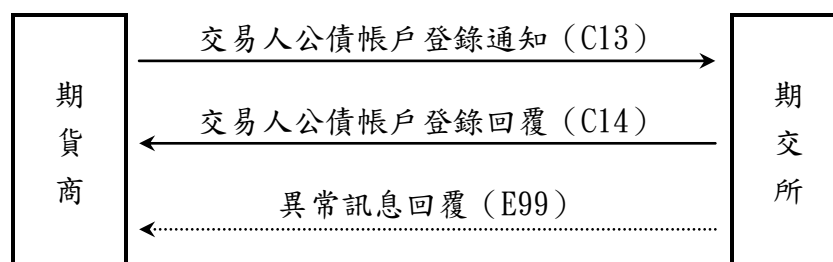


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C11) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C12)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.7. 交易人公債帳戶登錄(公債)暨 交易人集保帳號登錄(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所登錄其交易人之公債帳戶，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

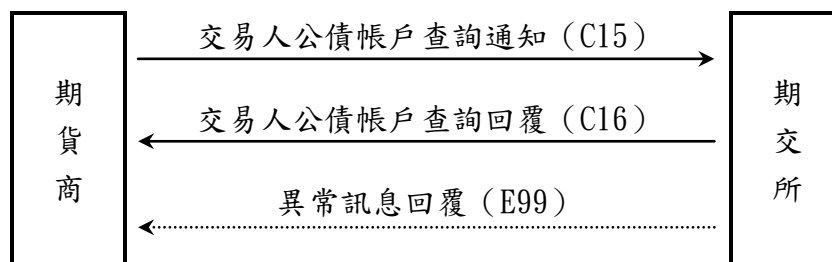


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C13) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，時即可自線上接收訊息代號(C14)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.8. 交易人公債帳戶查詢(公債)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所查詢交易人公債帳戶資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

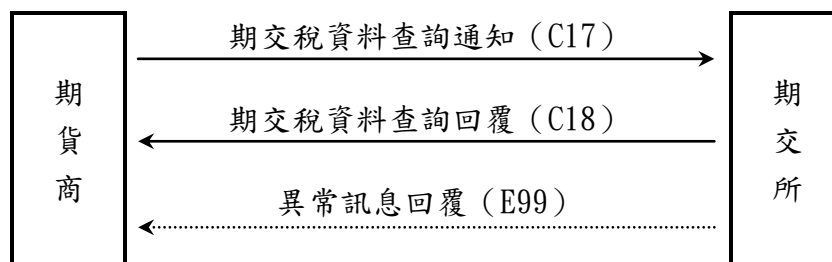


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C15) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C16)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.9. 期交稅資料查詢(台幣商品)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所查詢單一期貨商之期交稅資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

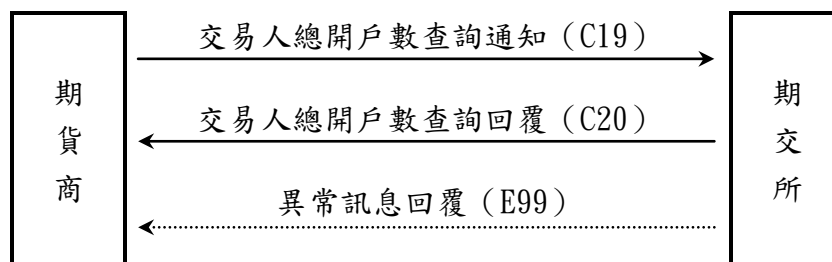


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C17) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C18)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.10. 交易人總開戶數查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢交易人總開戶數資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

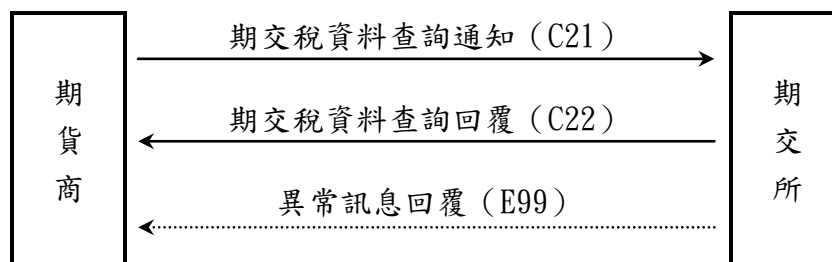


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C19) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C20)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.11. 期交稅資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所查詢單一期貨商之期交稅資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

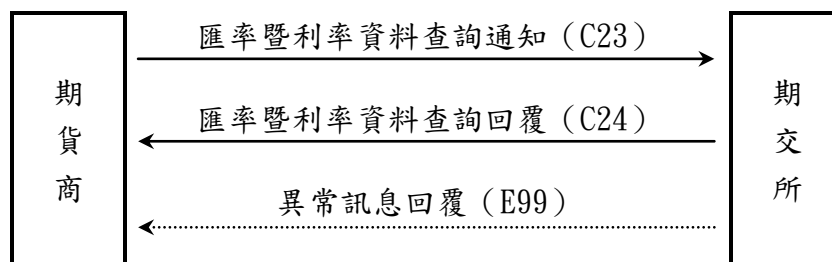


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C21) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C22)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.3.12. 匯率暨利率資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司)向期交所查詢匯率暨利率資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



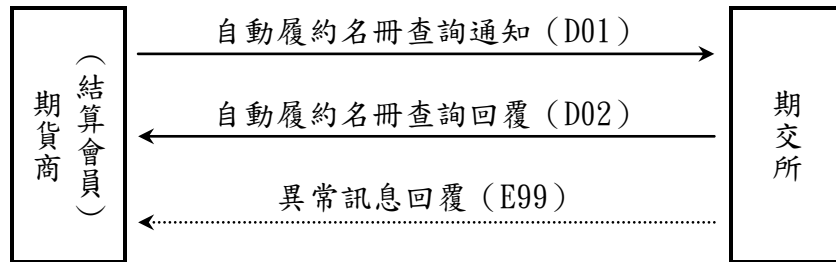
(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(C23) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常接收，即可自線上接收訊息代號(C24)有關回覆之資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4. 到期履約及實物交割作業

3.2.4.1. 自動履約名冊查詢(台指)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢自動履約名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

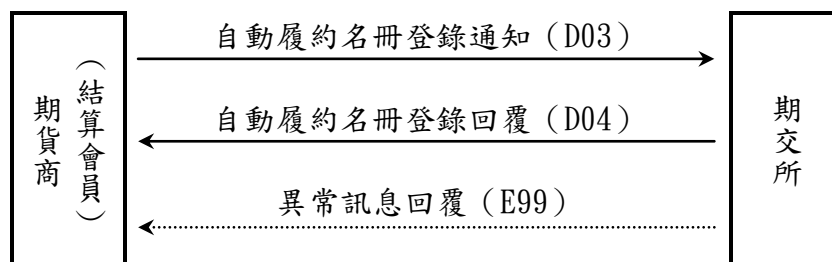


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D01)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D02)有關自動履約名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.2. 自動履約名冊登錄(台指)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所辦理欲自動履約之交易人部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

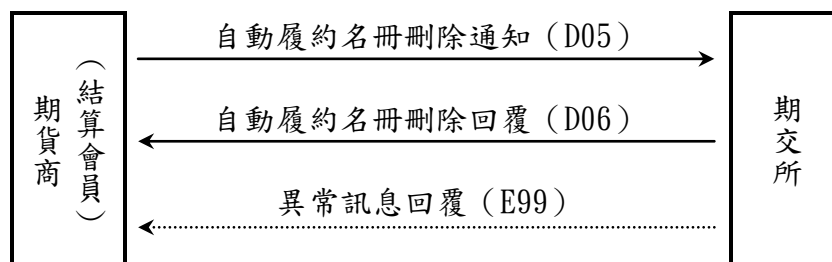


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D03)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D04)有關履約登錄成功之回覆訊息；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.3. 自動履約名冊刪除(台指)

(1)服務功能：提供期貨商及結算會員(可代其下手或分公司)向期交所辦理自動履約名冊資料刪除作業，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

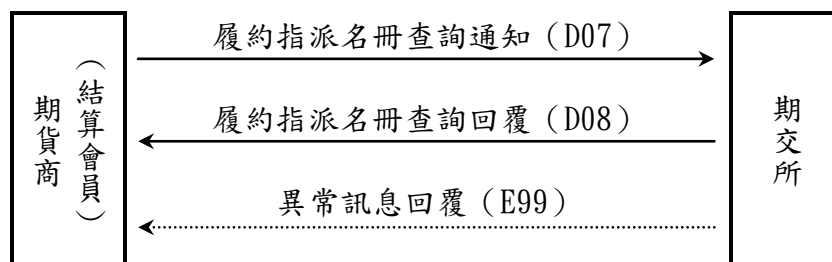


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D05)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D06)有關自動履約名冊刪除資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.4. 履約指派名冊查詢(台指)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢賣方履約指派名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

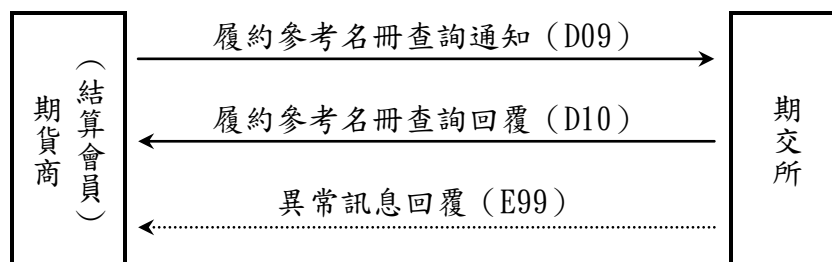


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D07)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D08)有關履約指派名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.5. 履約參考名冊查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢價內買權賣方交易人參考名冊及買權履約參考名冊，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

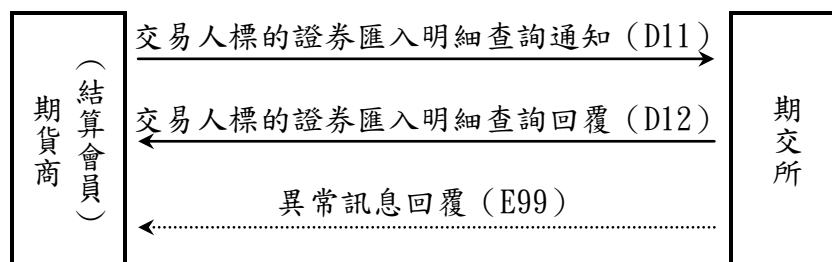


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D09)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D10)有關履約參考名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.6. 交易人標的證券匯入明細查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢本日交易人於交割專戶匯入明細資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

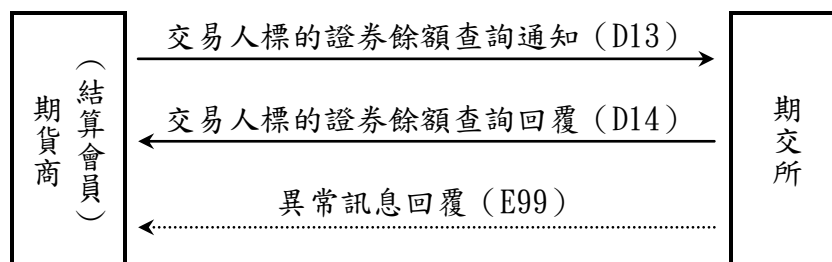


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D11)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D12)有關交易人標的證券匯入明細查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.7. 交易人標的證券餘額查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢交易人標的證券餘額之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

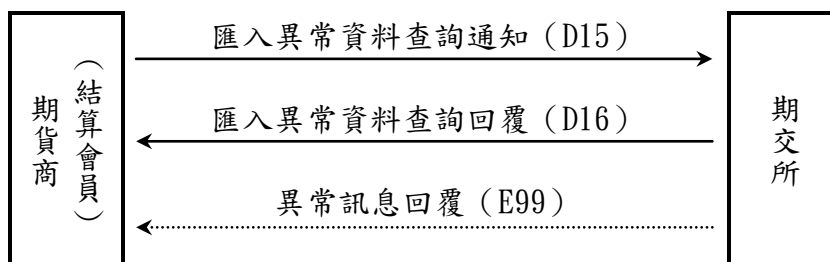


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D13)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D14)有關交易人標的證券餘額查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.8. 匯入異常資料查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢尚未調整或調整日期等於本日，非交易人本人名義之股票匯入異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

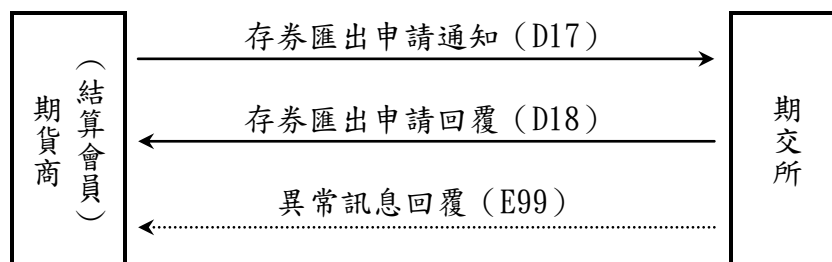


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D15)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D16)有關匯入異常查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.9. 存券匯出申請(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所申請匯出
交易人未履約之存券餘額，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

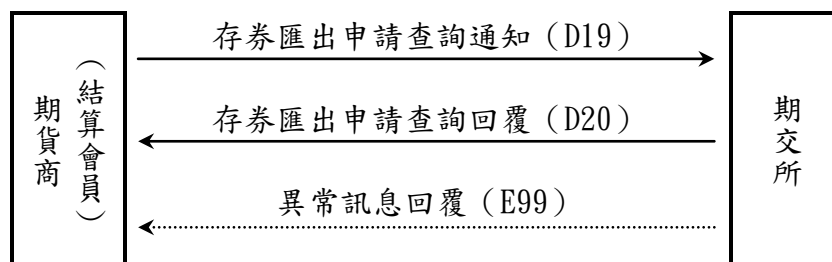


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(D17)訊息，通知期交所結算主機
執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D18)有關存券
匯出申請資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回
覆。

3.2.4.10. 存券匯出申請查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢本日交易人存券匯出申請資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

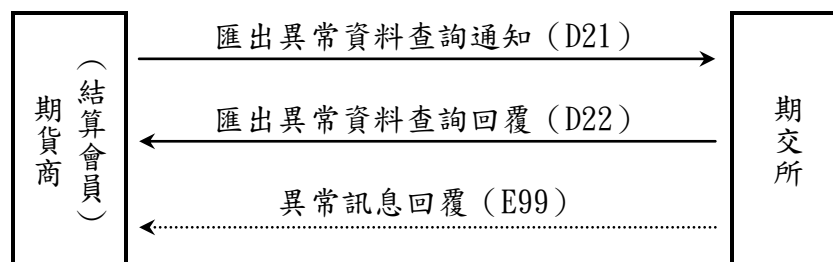


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D19)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D20)有關存券匯出申請查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.11. 匯出異常資料查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢本日所有及本日以前尚無法匯出之交易人異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

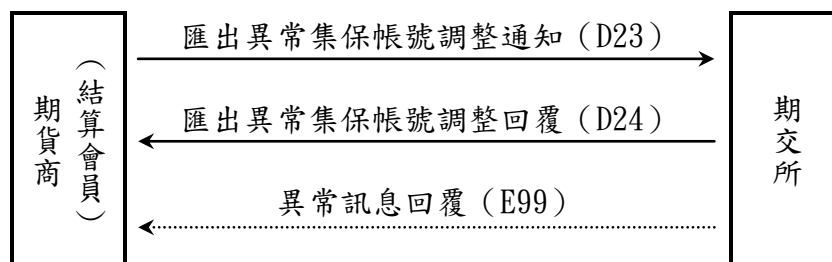


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D21)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D22)有關匯出異常查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.12. 匯出異常集保帳號調整(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)調整異常日無法入
交易人集保帳戶支匯出異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

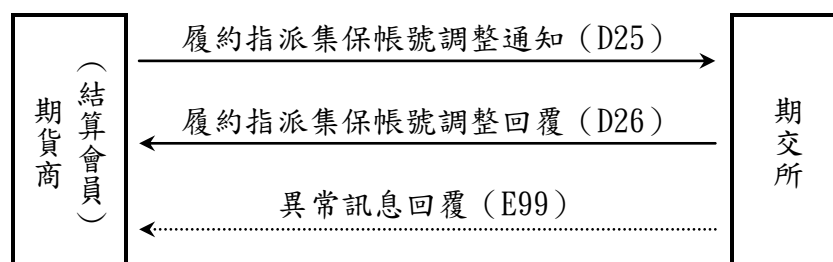


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(D23)訊息，通知期交所結算主機
執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D24)有關匯出
異常集保帳號調整回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常
訊息回覆。

3.2.4.13. 調整個股(1：履約、2：指派、3：履約)集保帳號 暨 調整公債(4：交割)銀行帳戶

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)調整履約指派集保帳號資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

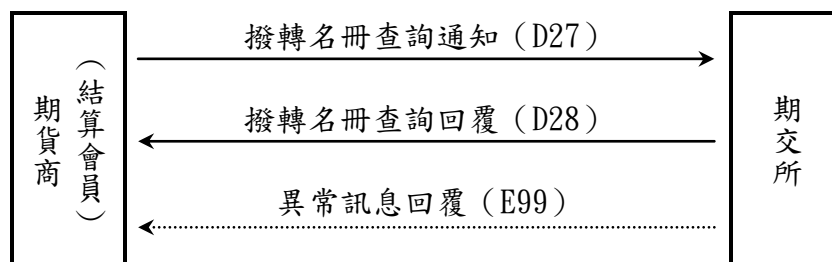


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D25)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D26)有關履約指派集保帳號調整回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.14. 撥轉名冊查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢已辦理存券撥轉名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

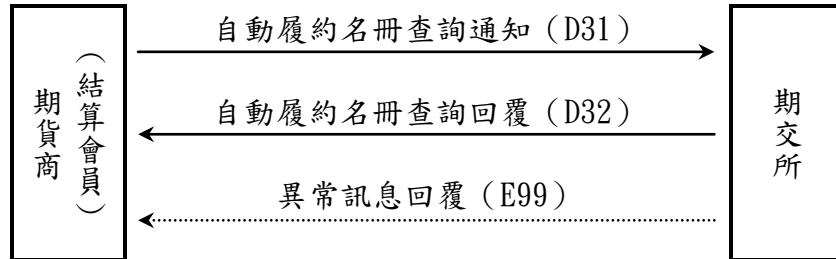


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D27)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D28)有關撥轉名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.16. 自動履約名冊查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢自動履約名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

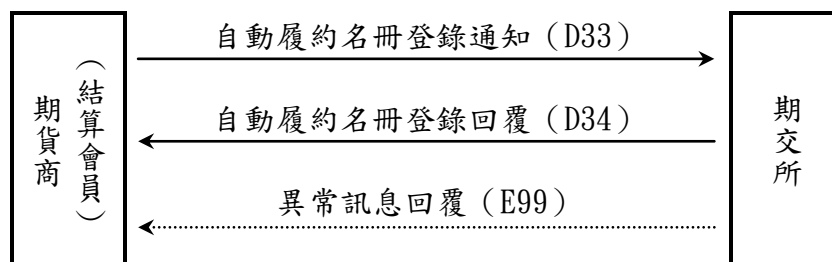


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D31)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D32)有關自動履約名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.17. 自動履約名冊登錄(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所辦理欲自動履約之交易人部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

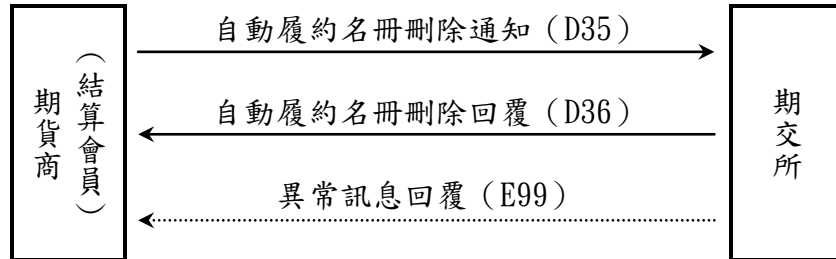


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D33)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D34)有關登錄之自動履約名冊資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.18. 自動履約名冊刪除(個股)

(1)服務功能：提供期貨商及結算會員(可代其下手或分公司)向期交所辦理自動履約名冊資料刪除作業，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

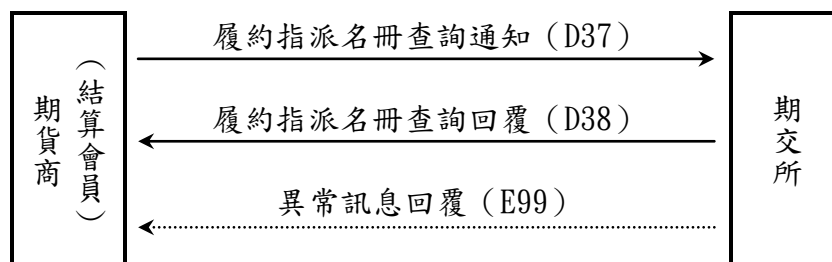


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D35)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D36)有關自動履約名冊刪除資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.19. 履約指派名冊查詢(個股)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢賣方履約指派名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

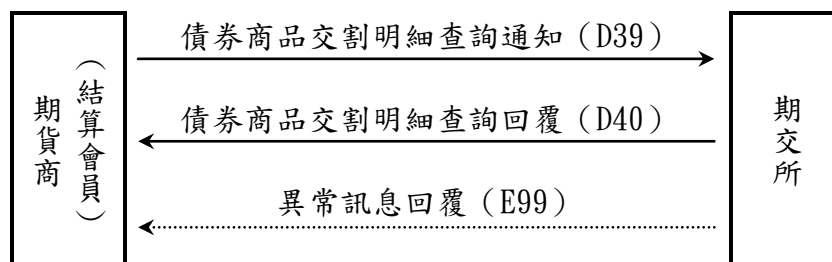


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D37)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D38)有關履約指派名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.20. 債券商品交割明細查詢(公債)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢債券商品交割之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

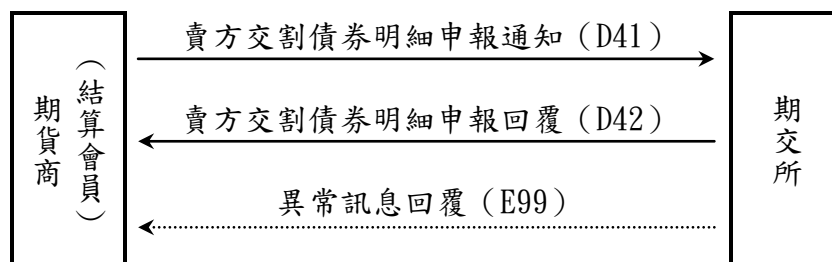


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D39)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D40)債券商品交割明細查詢回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.21. 賣方交割債券明細申報(公債)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)申報賣方交割債券明細作業，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

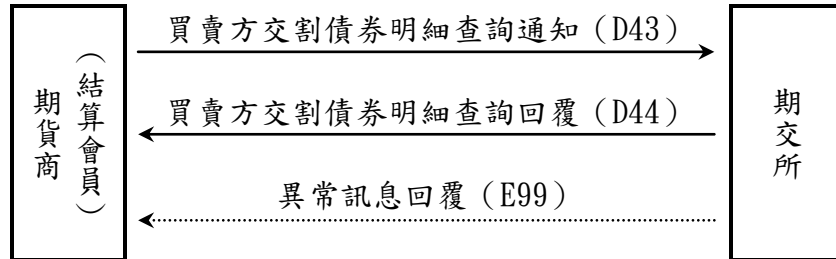


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D41)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D42)有關賣方交割債券明細申報回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.22. 買賣方交割債券明細查詢(公債)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢買賣方交割債券之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

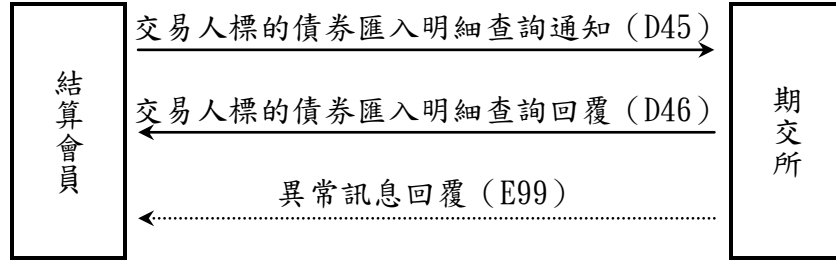


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D43)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D44)有關買賣方交割債券明細查詢回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.23. 交易人標的債券匯入明細查詢(公債)

(1)服務功能：提供結算會員查詢交易人標的債券匯入明細，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

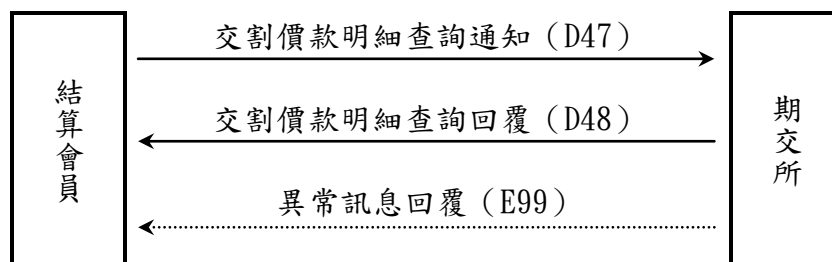


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(D45)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D46)有關交易人標的債券匯入明細查詢回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.24. 交割價款明細查詢(公債)

(1)服務功能：提供結算會員查詢交割價款明細，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

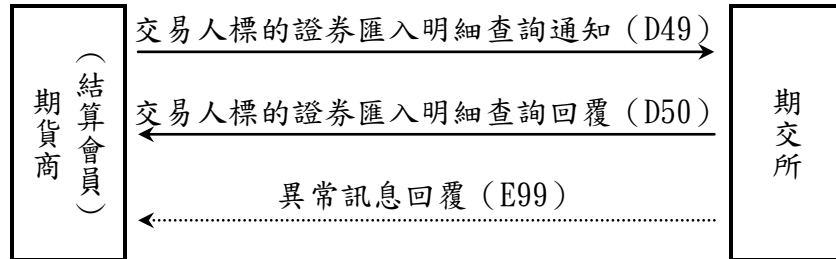


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(D47)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D48)有關交割價款明細查詢回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.25. 交易人標的證券匯入明細查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢本日交易人於交割專戶匯入明細資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

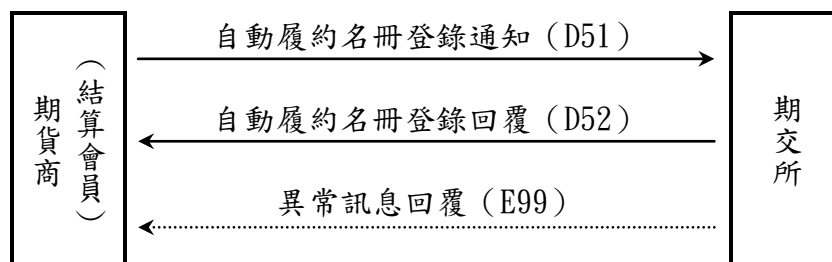


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D49)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D50)有關交易人標的證券匯入明細查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.26. 交易人標的證券餘額查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢交易人標的證券餘額之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

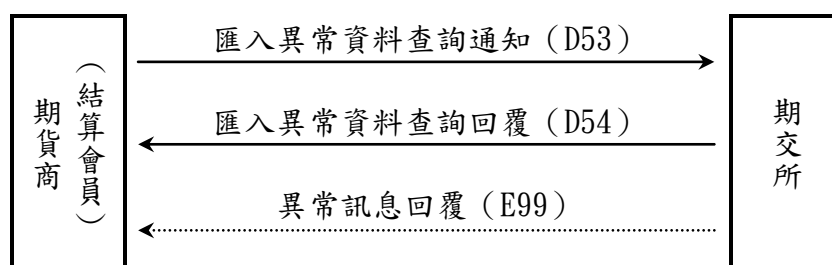


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D51)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D52)有關交易人標的證券餘額查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.27. 匯入異常資料查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢尚未調整或調整日期等於本日，非交易人本人名義之股票匯入異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

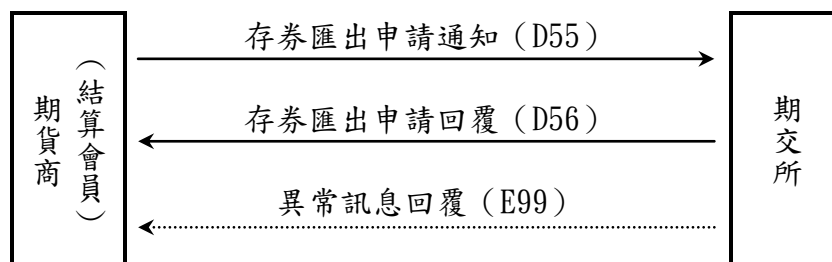


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D53)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D54)有關匯入異常資料查詢回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.28. 存券匯出申請(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所申請匯出
交易人未履約之存券餘額，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

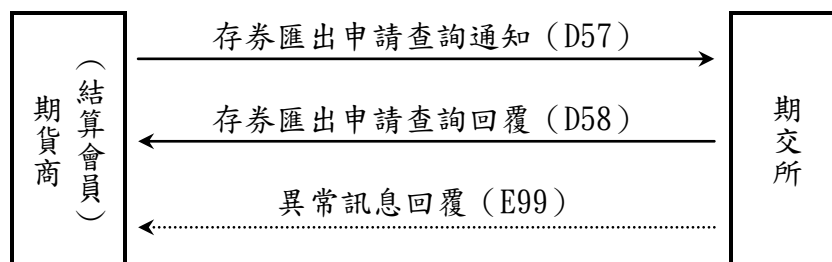


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(D55)訊息，通知期交所結算主機
執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D56)有關存券
匯出申請資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回
覆。

3.2.4.29. 存券匯出申請查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢本日交易人存券匯出申請資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

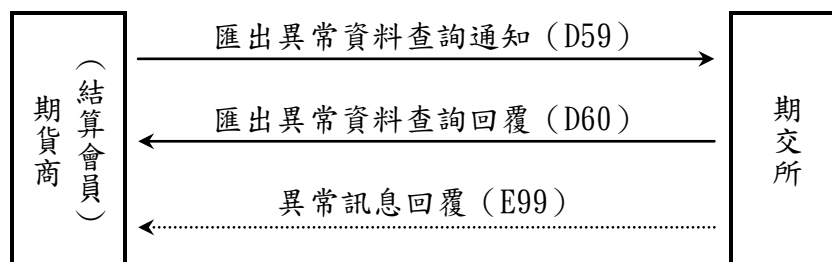


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D57)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D58)有關存券匯出申請查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.30. 匯出異常資料查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢本日所有及本日以前尚無法匯出之交易人異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

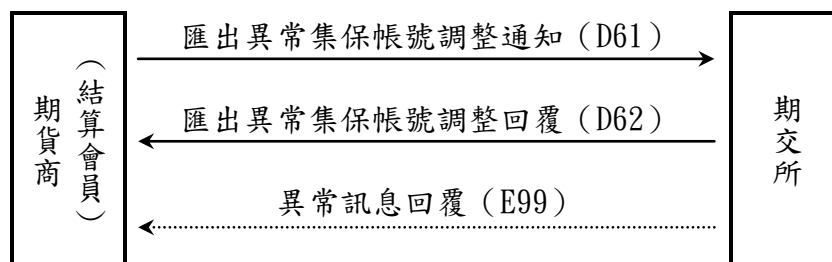


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D59)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D60)有關匯出異常查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.31. 匯出異常集保帳號調整(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)調整異常日無法入
交易人集保帳戶支匯出異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



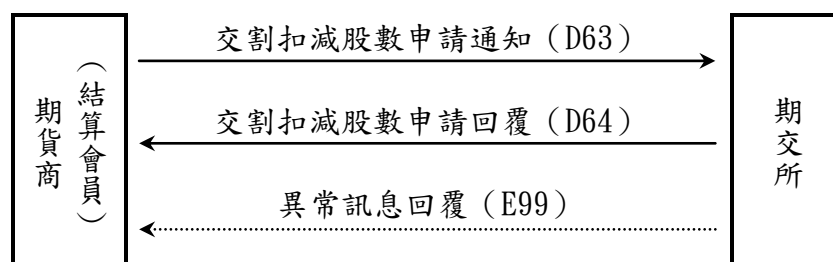
(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(D61)訊息，通知期交所結算主機
執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D62)有關匯出
異常集保帳號調整回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常
訊息回覆。

3.2.4.32. 賣權買方申請交割扣減股數之登錄

(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所申請交割扣減股數，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

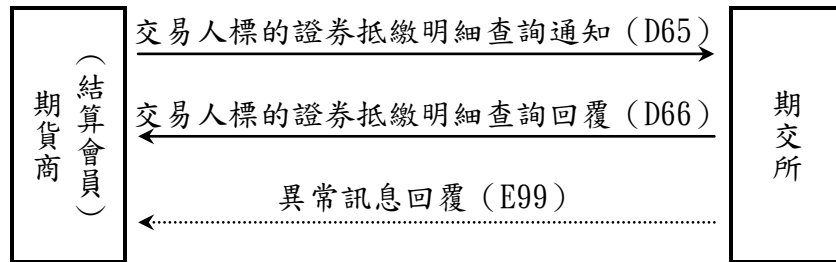


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(D63)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D64)有關交割扣減股數申請資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.33. 交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢 (CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢交易人標的證券抵繳明細查詢資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

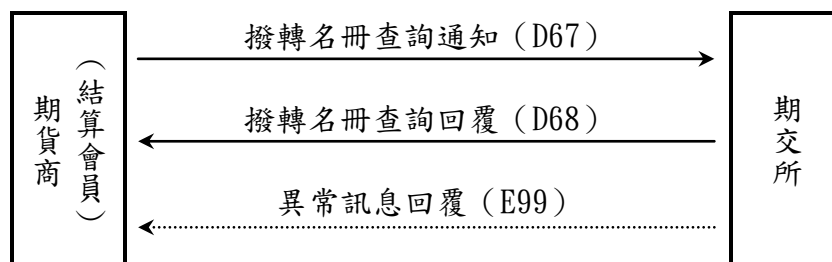


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D65)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D66)有關交易人標的證券抵繳明細查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.34. 撥轉名冊查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢已辦理存券撥轉名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

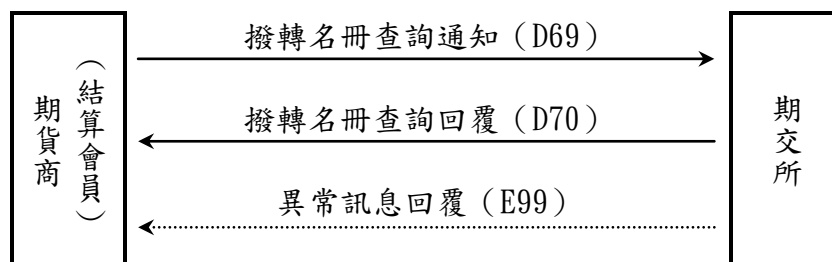


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D67)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D68)有關撥轉名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.35. 撥轉名冊查詢(抵繳)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢已辦理存券撥轉名冊之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

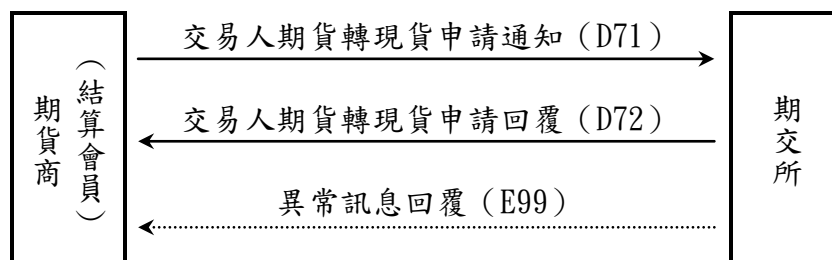


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D69)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D70)有關撥轉名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.36. 交易人期貨轉現貨申請登錄

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所申請交易人期貨轉現貨，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

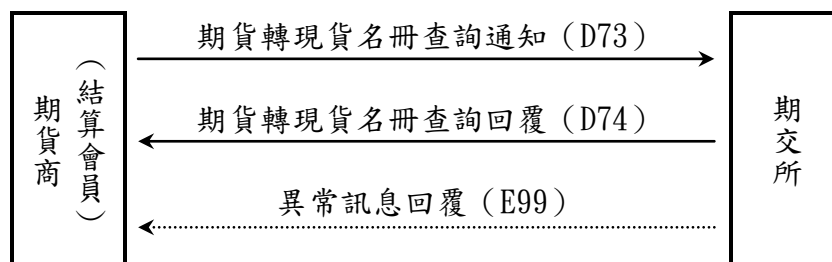


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(D71)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D72)有關交易人期貨轉現貨申請資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.4.37. 期貨轉現貨名冊查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)查詢期貨轉現貨名冊資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



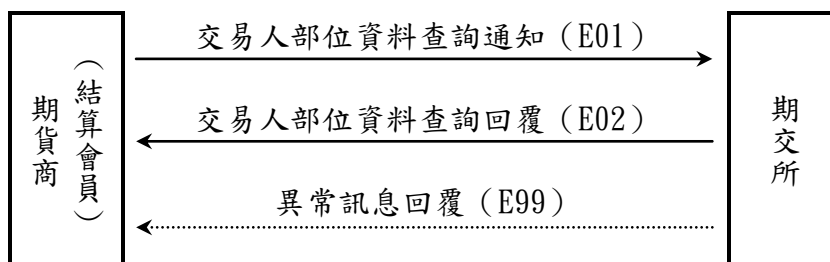
(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(D73)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(D74)有關期貨轉現貨名冊查詢資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5. 部位管理作業

3.2.5.1. 交易人部位資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其分公司)向期交所查詢其交易人之部位資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

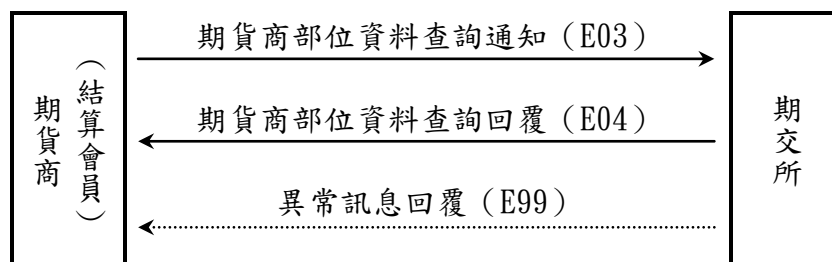


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E01) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E02)有關查詢之交易人部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.2. 期貨商部位資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

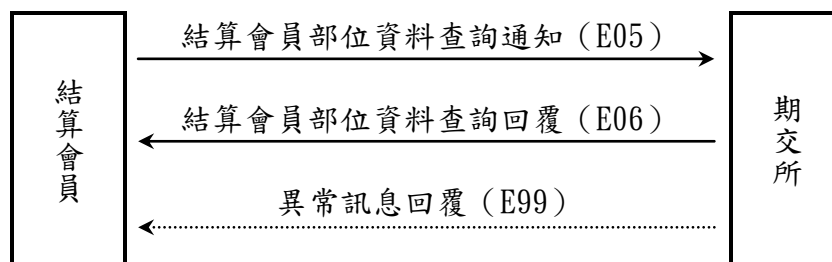


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E03) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E04)有關查詢之期貨商部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.3. 結算會員部位資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其所有(包含總分公司及代結算)之部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

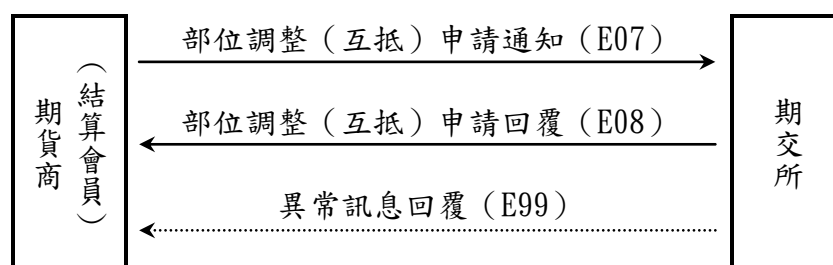


(3) 相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(E05) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E06)有關查詢之結算會員部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.4. 部位調整（互抵）申請

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其分公司；進行互抵時，可代其下手或分公司)向期交所申請辦理其未平倉部位數額移轉，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

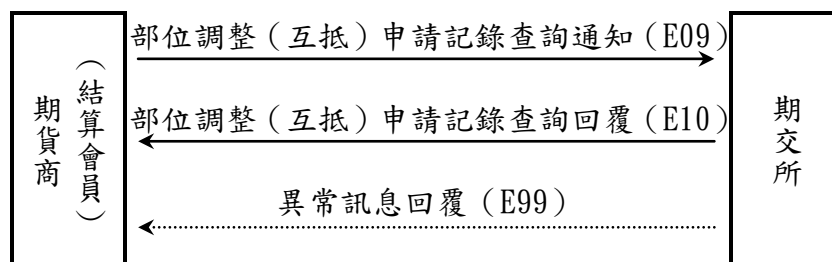


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E07) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E08)有關調整（互抵）申請之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.5. 部位調整（互抵）申請記錄查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其辦理申請部位調整（互抵）之結果，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

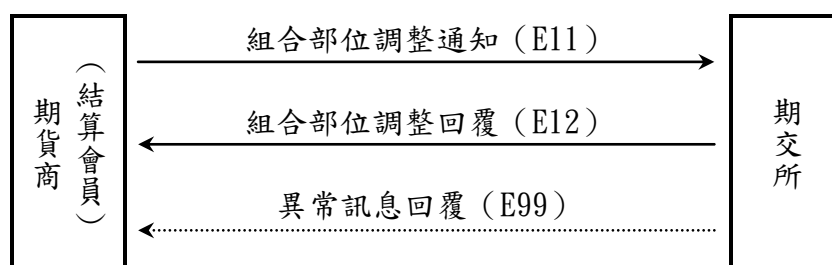


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E09)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E10)有關調整申請記錄之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.6. 組合部位調整

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)使用，於選擇權新增或異動其交易人之組合部位餘額，本項作業須於部位結帳前執行，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

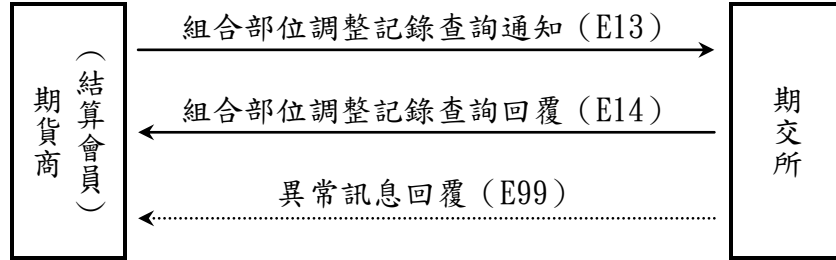


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E11)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E12)有關組合部位調整之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.7. 組合部位調整記錄查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所查詢其辦理申請組合部位調整之結果，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

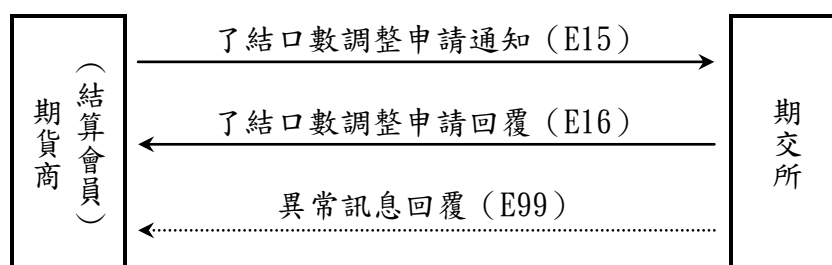


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E13)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E14)有關組合部位調整記錄之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.8. 了結口數調整申請

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)使用，於輸入之開平倉碼錯誤導致部位餘額不符時，需調整當日了結口數者，本項作業須於部位結帳前執行，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

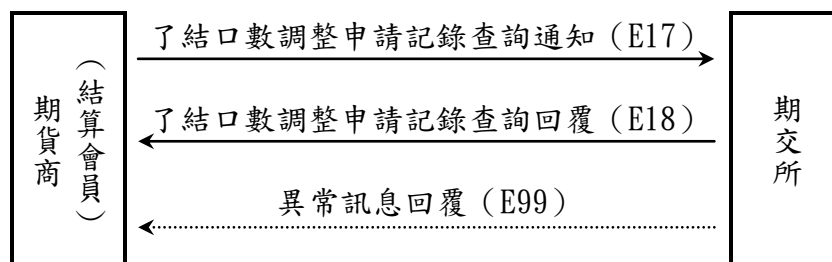


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E15)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E16)有關了結口數調整申請之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.9. 了結口數調整申請記錄查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所查詢其辦理申請了結口數調整之結果，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

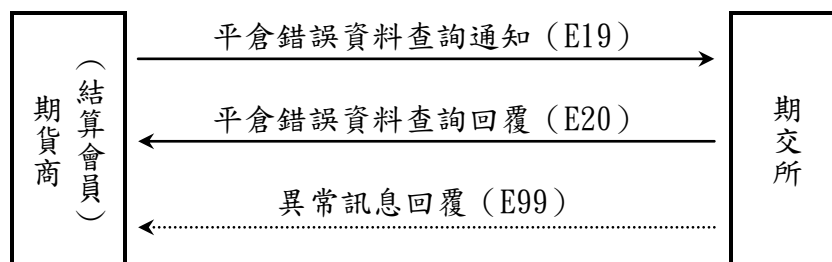


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E17)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E18)有關了結口數調整申請記錄之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.10. 平倉錯誤資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可代其下手或分公司)向期交所查詢其平倉錯誤改以新倉部位記錄之資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

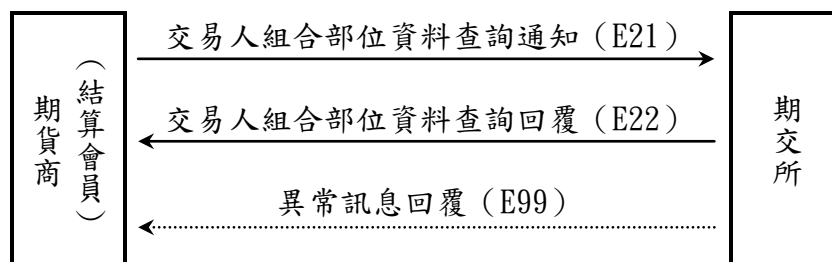


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E19)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E20)有關平倉錯誤之回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.11. 交易人組合部位資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其分公司)向期交所查詢其交易人之組合部位資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

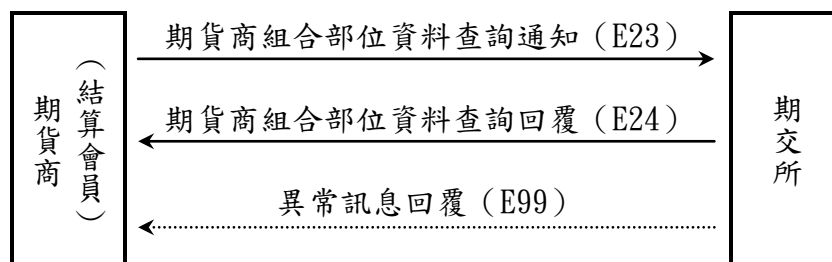


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E21)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E22)有關查詢之交易人組合部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.12. 期貨商組合部位資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其組合部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

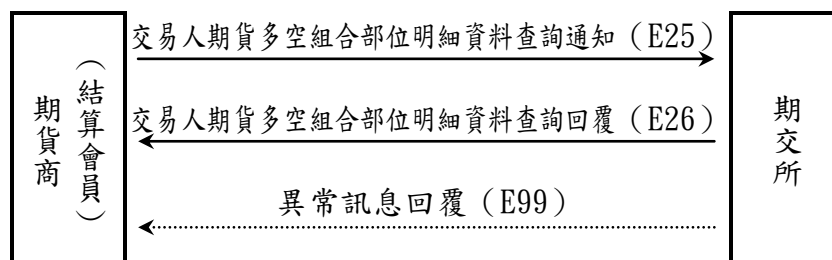


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E23)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E24)有關查詢之期貨商組合部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.13. 交易人期貨多空組合部位明細資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其交易人之期貨多空組合部位明細資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

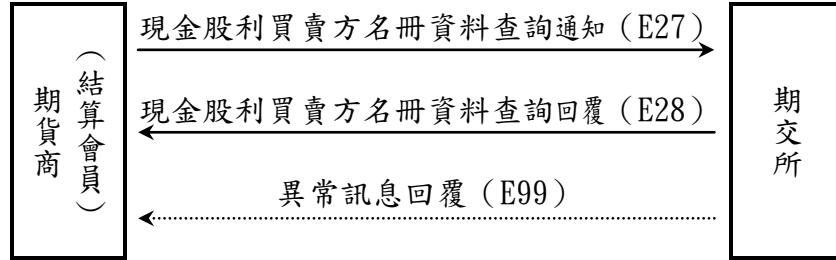


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E25)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E26)有關查詢之交易人期貨多空組合部位明細資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.14. 現金股利買賣方名冊資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其分公司)向期交所查詢其交易人之現金股利買賣方名冊資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

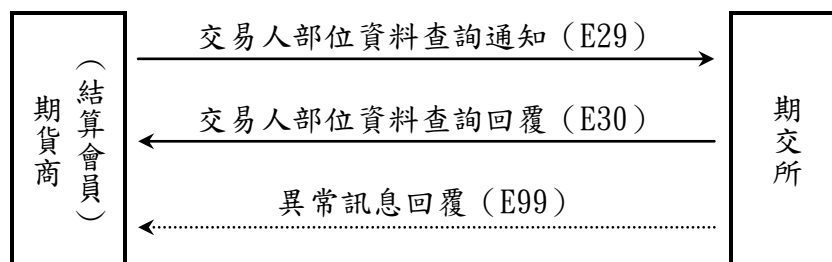


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E27)息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E28)關查詢之交易人現金股利買賣方名冊資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.15. 交易人部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其分公司)向期交所查詢其交易人之部位資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

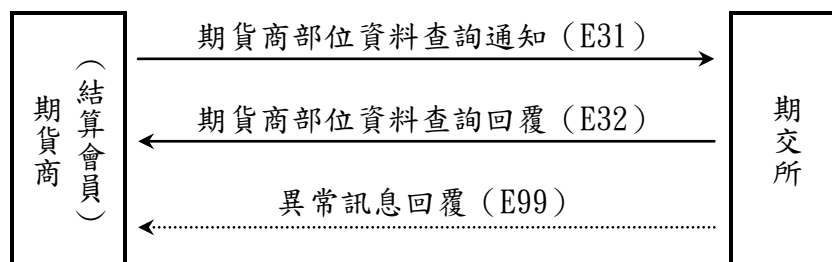


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E29)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E30)有關查詢之交易人部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.16. 期貨商部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

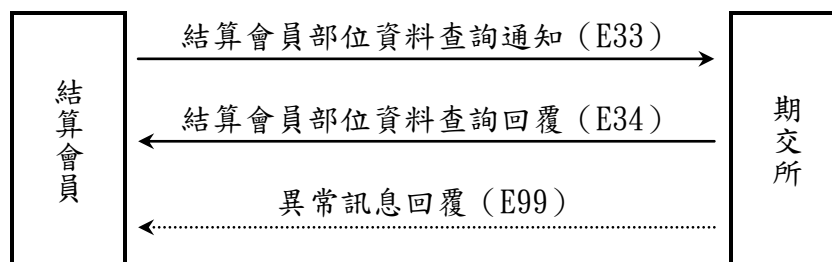


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(E31) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E32)有關查詢之期貨商部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.5.17. 結算會員部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其所有(包含總分公司及代結算)之部位資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



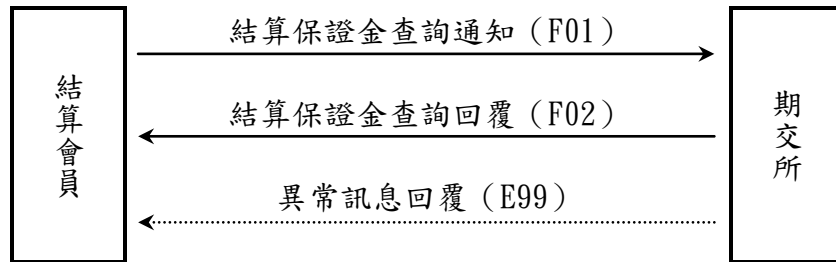
(3) 相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(E33) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(E34)有關查詢之結算會員部位資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.6. 結算保證金作業(台幣商品)

3.2.6.1. 結算保證金查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

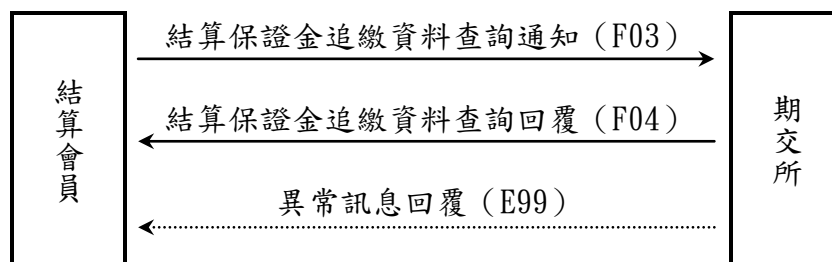


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(F01) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(F02)有關查詢之結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.6.2. 結算保證金追繳資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

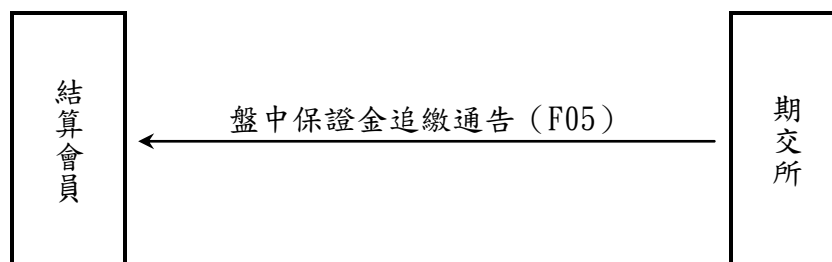


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(F03) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(F04)有關查詢之結算保證金追繳資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.6.3. 盤中保證金追繳通告

(1)服務功能：期交所於盤中洗價後，主動通知須追繳保證金之結算會員其追繳資料，為一單向訊息通告。

(2)訊息流程：

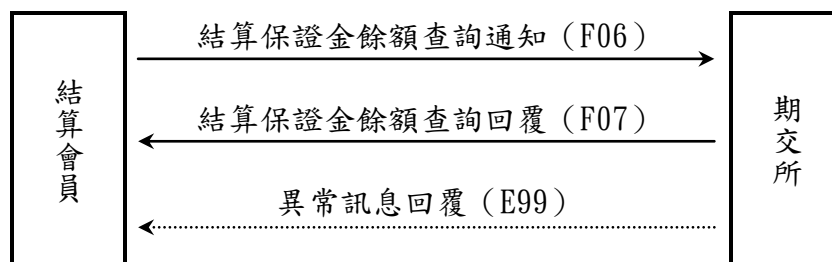


(3)相關說明：期交所以連線方式發送訊息代號(F05)將盤中追繳資料，主動通知結算會員接收。

3.2.6.4. 結算保證金餘額查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其結算保證金餘額資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

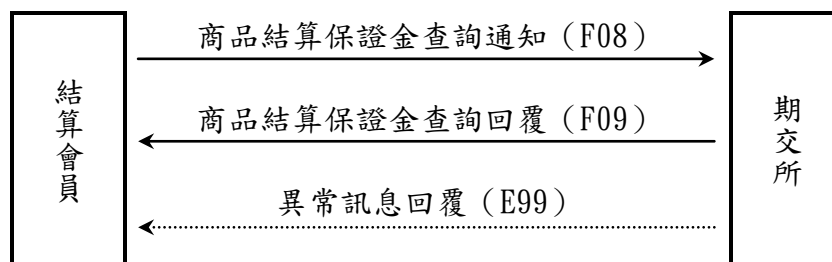


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(F06) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(F07)有關查詢之結算保證金餘額資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.6.5. 商品結算保證金查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其商品結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

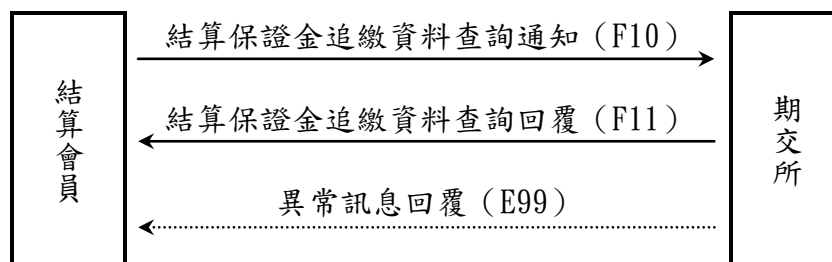


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(F08) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(F09)有關查詢之商品結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.6.6. 結算保證金追繳資料查詢(CoveredCall)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



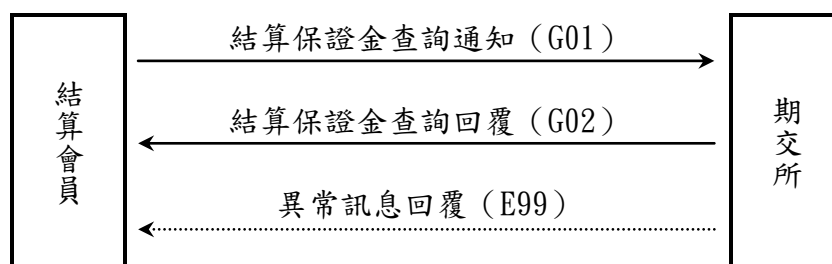
(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(F10) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(F11)有關查詢之結算保證金追繳資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7. 結算保證金作業

3.2.7.1. 結算保證金查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

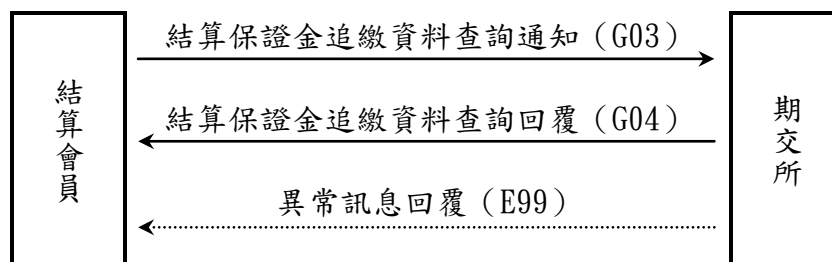


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G01) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G02)有關查詢之結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.2. 結算保證金追繳資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

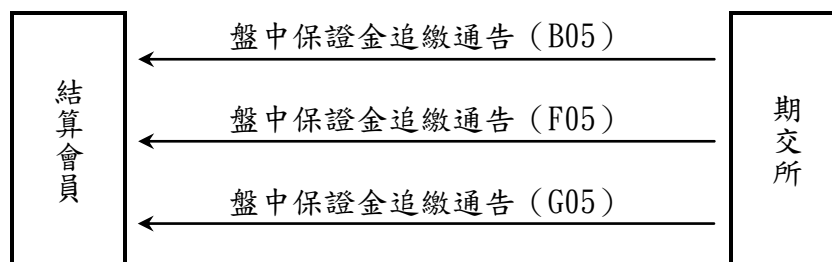


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G03) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G04)有關查詢之結算保證金追繳資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.3. 盤中保證金追繳通告

(1)服務功能：期交所於盤中洗價後，主動通知須追繳保證金之結算會員其追繳資料，為一單向訊息通告。

(2)訊息流程：

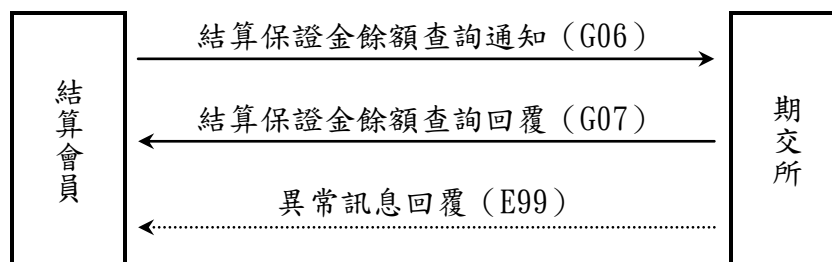


(3)相關說明：期交所以連線方式同時發送訊息代號(B05, F05, G05)將盤中追繳資料，主動通知結算會員接收。

3.2.7.4. 結算保證金餘額查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其結算保證金餘額資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

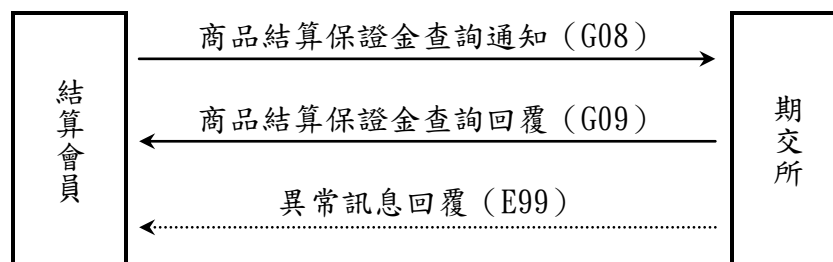


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G06) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G07)有關查詢之結算保證金餘額資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.5. 商品結算保證金查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其商品結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

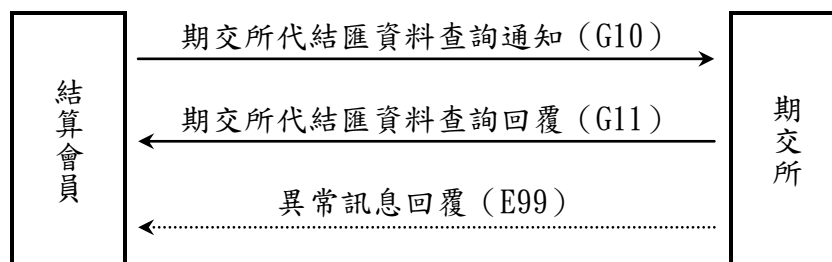


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G08) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G09)有關查詢之商品結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.6. 期交所代結匯資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日期交所代結匯資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

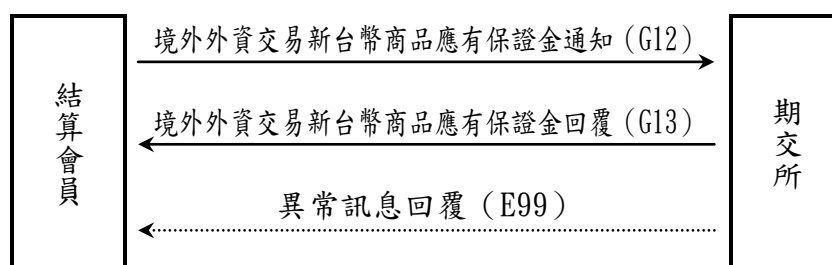


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G10) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G11)有關查詢之期交所代結匯資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.7. 境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其境外外資客戶交易新台幣商品應有保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

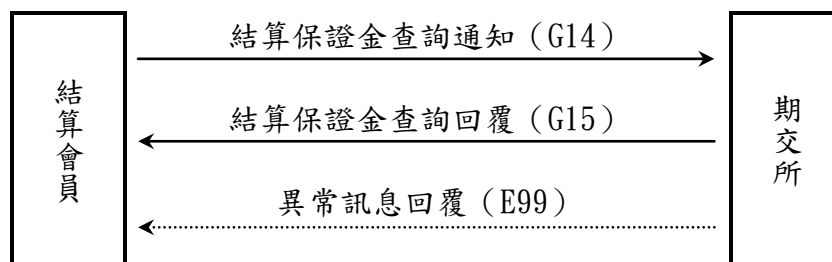


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(G12) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G13)有關查詢之境外外資交易新台幣商品應有保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.8. 結算保證金查詢 (依 SPAN 保證金計算)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

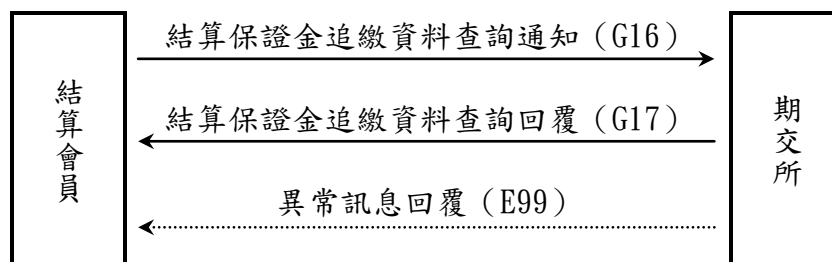


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G14) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G15)有關查詢之結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.9. 結算保證金追繳資料查詢(依 SPAN 保證金計算)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

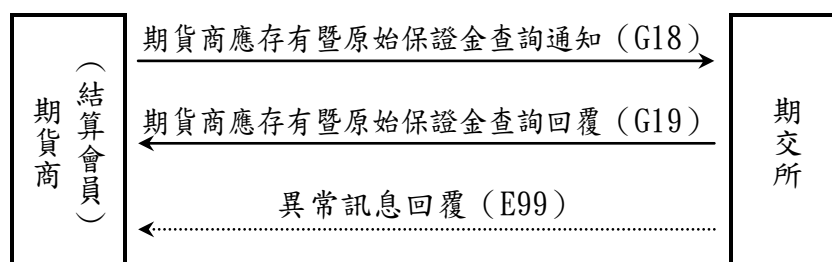


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G16) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G17)有關查詢之結算保證金追繳資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.10. 期貨商應存有暨原始保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其應存有暨原始保證金查詢資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

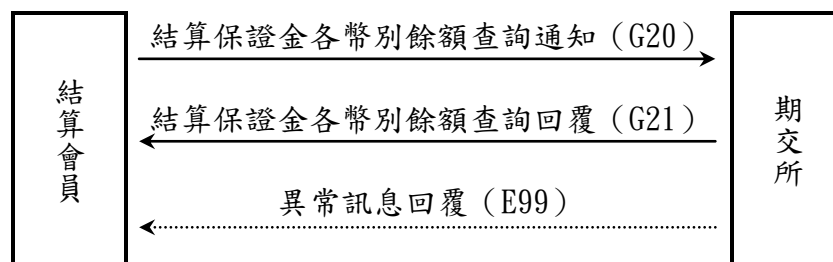


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(G18)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G19)有關查詢之期貨商應存有暨原始保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.11. 結算保證金各幣別餘額查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日結算保證金各幣別餘額資料，
為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

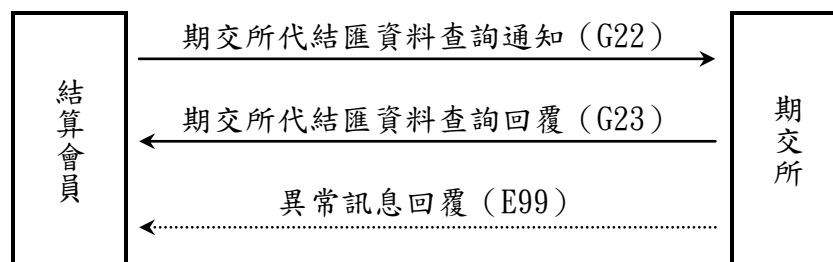


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G20) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G21)有關查詢之期交所代結匯資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.12. 期交所代結匯資料查詢(外幣)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其本日期交所代結匯資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

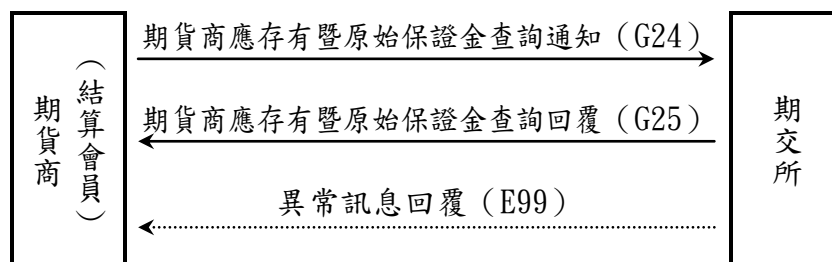


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G22) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G23)有關查詢之期交所代結匯資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.13. 期貨商應存有暨原始保證金查詢(外幣)

(1)服務功能：提供期貨商或結算會員(可查詢其下手或分公司)向期交所查詢其應存有暨原始保證金查詢資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

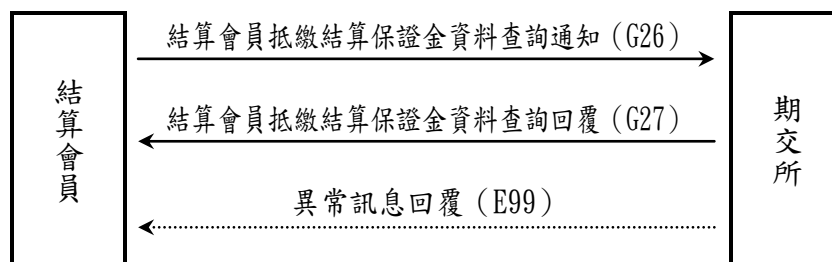


(3)相關說明：期貨商或結算會員以連線方式發送訊息代號(G24)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G25)有關查詢之期貨商應存有暨原始保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.14. 結算會員抵繳結算保證金資料查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其抵繳結算保證金資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

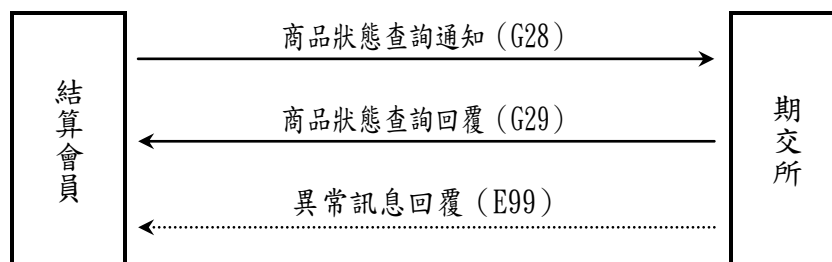


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G26)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G27)有關查詢之結算會員抵繳結算保證金資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.15. 商品狀態查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢其商品狀態資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

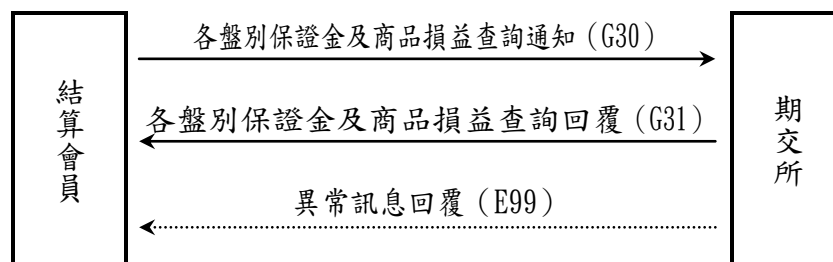


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G28)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G29)有關查詢之商品狀態資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.16. 各盤別保證金及商品損益查詢

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢各盤別保證金及商品損益資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

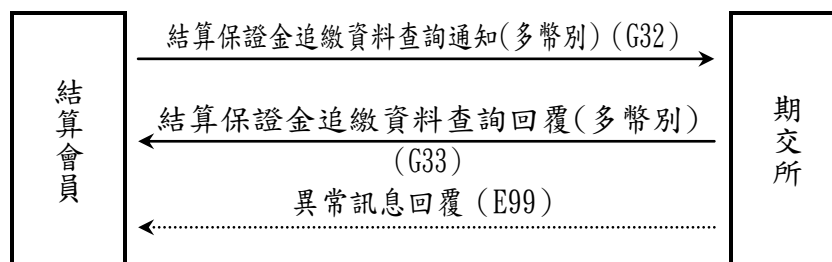


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G30)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G31)有關查詢之各盤別保證金及商品損益資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.17. 結算保證金追繳資料查詢(多幣別)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

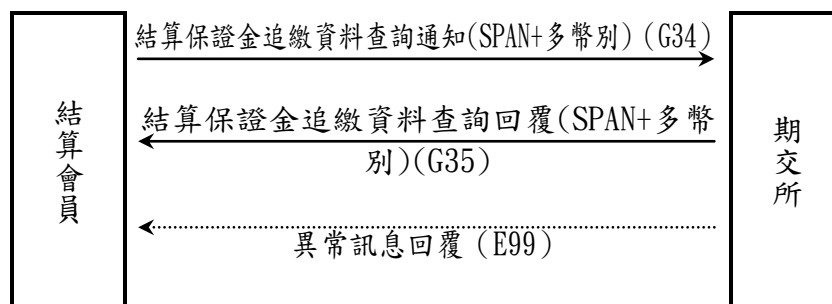


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G32)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G33)有關查詢之結算保證金追繳(多幣別)資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.18. 結算保證金追繳資料查詢(SPAN+多幣別)

(1)服務功能：提供結算會員向期交所查詢結算保證金追繳資料，為一雙向訊息交換處理

(2)訊息流程：

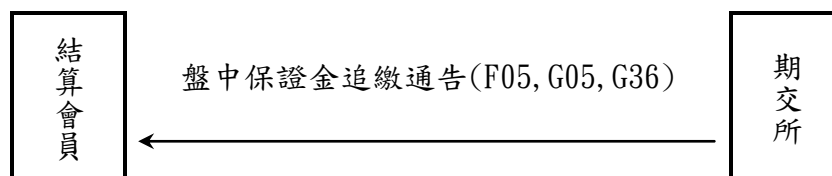


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(G34)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(G35)有關查詢之結算保證金追繳(SPAN+多幣別)資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.7.19. 盤中保證金追繳通告(多幣別)

(1)服務功能：期交所於盤中洗價後，主動通知須追繳保證金之結算會員其追繳資料(多幣別)，為一單向訊息通告。

(2)訊息流程：



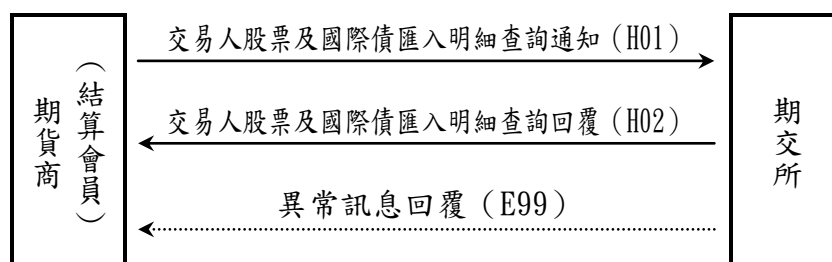
(3)相關說明：期交所以連線方式同時發送訊息代號(F05, G05, G36)將盤中追繳資料，主動通知結算會員接收。

3.2.8. 標的證券抵繳保證金作業

3.2.8.1. 交易人股票及國際債匯入明細查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人股票及國際債匯入明細資料，
為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

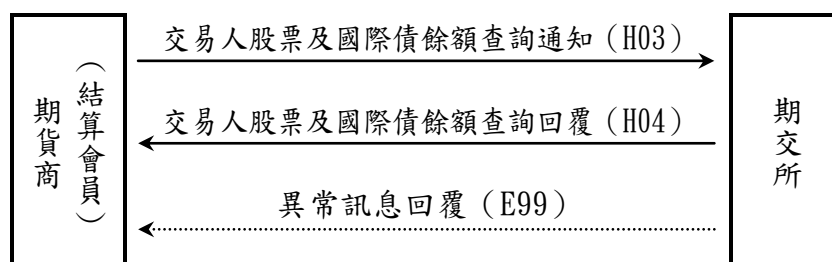


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H01) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H02)有關查詢之交易人股票及國際債匯入明細資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.2. 交易人股票及國際債餘額查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人股票及國際債餘額資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

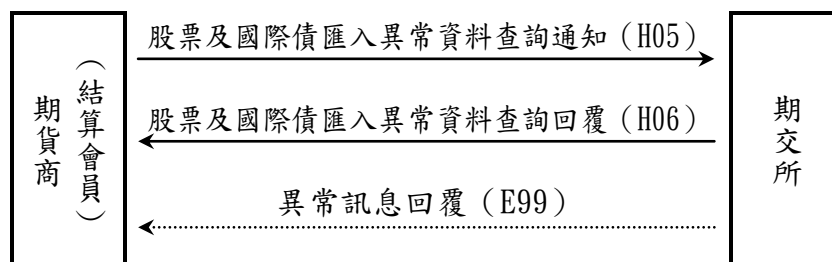


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H03)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H04)有關查詢之交易人股票及國際債餘額資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.3. 股票及國際債匯入異常資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其股票及國際債匯入異常資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

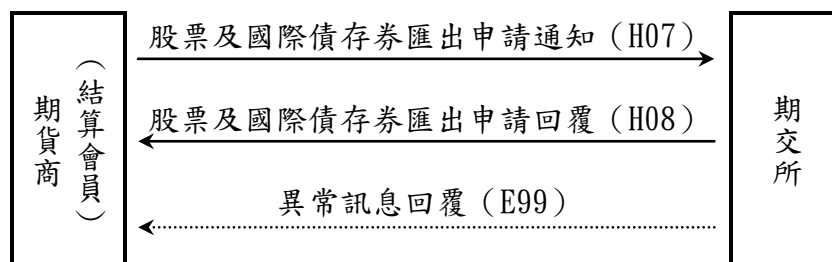


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H05)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H06)有關查詢之股票及國際債匯入異常資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.4. 股票及國際債存券匯出申請

(1)服務功能：提供期貨商向期交所申請其股票及國際債存券匯出資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

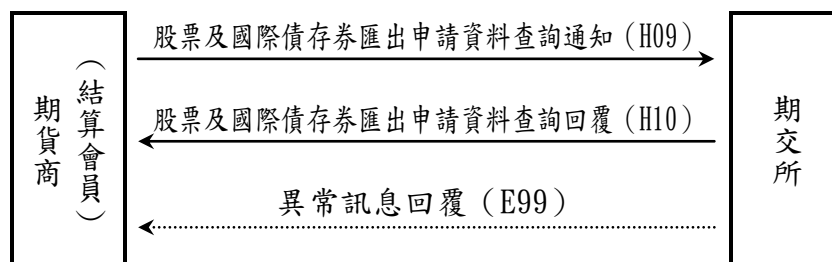


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H07) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H08)有關股票及國際債存券匯出申請回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.5. 股票及國際債存券匯出申請資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其股票及國際債存券匯出申請資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

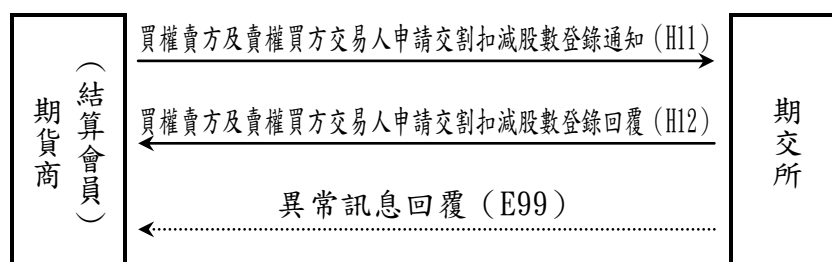


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H09)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H10)有關查詢之股票及國際債存券匯出申請資料查詢；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.6. 買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄

(1)服務功能：提供期貨商向期交所登錄其買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

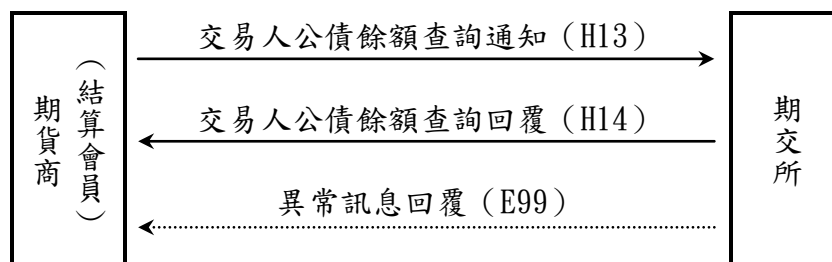


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H11)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H12)有關買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.7. 交易人公債餘額查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人公債餘額資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

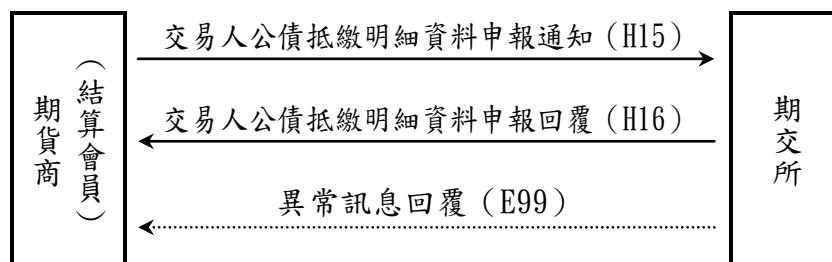


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H13) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H14)有關查詢之交易人公債餘額資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.8. 交易人公債抵繳明細資料申報

(1)服務功能：提供期貨商向期交所申報其交易人公債抵繳明細資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

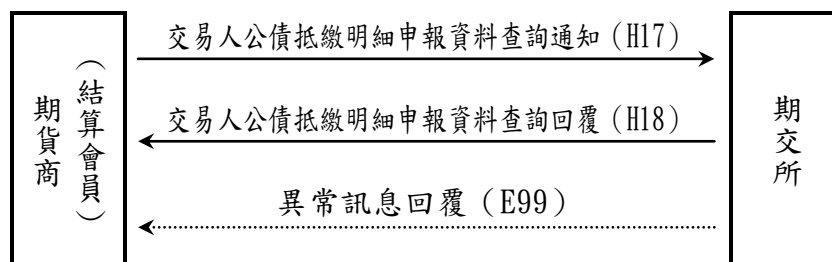


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H15) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H16)有關交易人公債抵繳明細資料申報回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.9. 交易人公債抵繳明細申報資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人公債抵繳明細申報資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

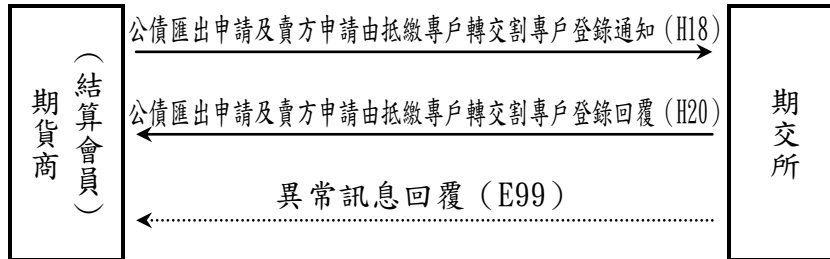


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H17)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H18)有關查詢之交易人公債抵繳明細申報資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.10. 交易人股票及國際債匯入明細查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所登錄其公債匯出申請及賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

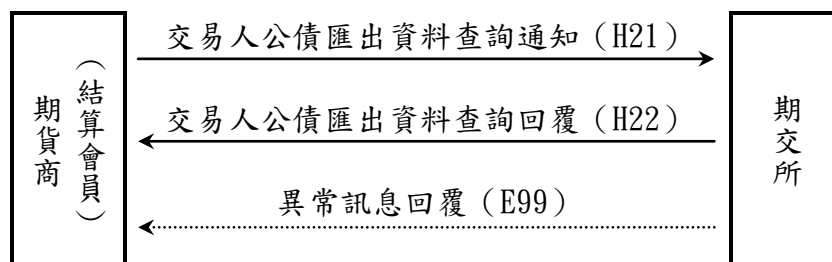


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H18)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H20)有關公債匯出申請及賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶登錄回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.11. 交易人公債匯出資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人公債匯出資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

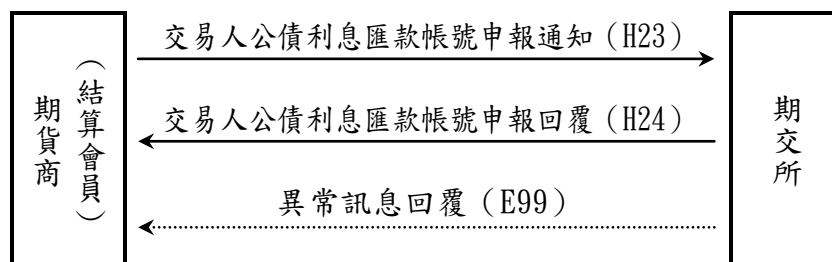


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H21) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H22)有關查詢之交易人公債匯出資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.12. 交易人公債利息匯款帳號申報

(1)服務功能：提供期貨商向期交所申報其交易人公債利息匯款帳號，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

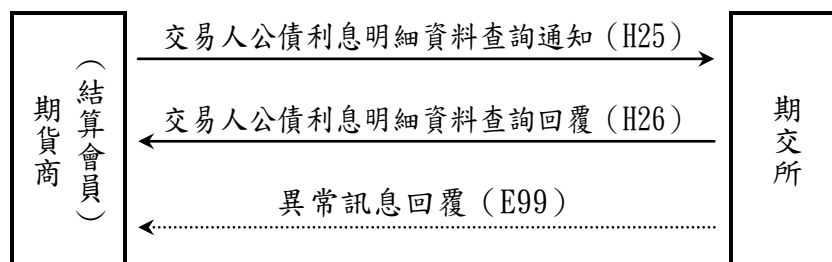


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H23)訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H24)有關交易人公債利息匯款帳號申報回覆資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.13. 交易人公債利息明細資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人公債利息明細資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

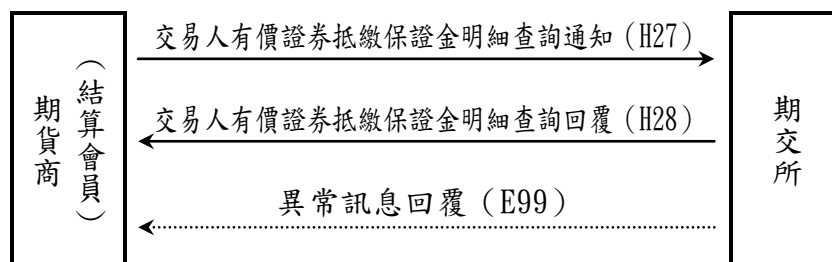


(3)相關說明：結算會員以連線方式發送訊息代號(H25) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H26)有關查詢之交易人公債利息明細資料資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.14. 交易人有價證券抵繳保證金明細查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人有價證券抵繳保證金明細資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

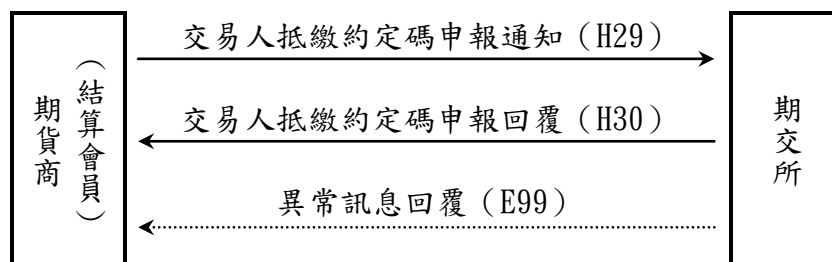


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(H27) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H28)有關查詢之交易人有價證券抵繳保證金明細資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.15. 交易人抵繳約定碼申報

(1)服務功能：提供期貨商向期交所申報其交易人抵繳約定碼資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：

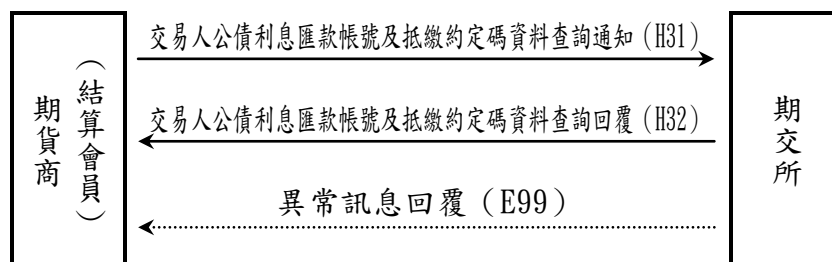


(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(H29) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H30)有關交易人抵繳約定碼申報回覆；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

3.2.8.16. 交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢

(1)服務功能：提供期貨商向期交所查詢其交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料，為一雙向訊息交換處理。

(2)訊息流程：



(3)相關說明：期貨商以連線方式發送訊息代號(H31) 訊息，通知期交所結算主機執行本項作業，若正常時即可自線上接收訊息代號(H32)有關查詢之交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料；異常時則將接收訊息代號為(E99)之異常訊息回覆。

4. 訊息傳輸格式及說明

4.1. 訊息傳輸基本格式

有關本傳輸界面之訊息傳輸格式，其訂定方式係以實際作業需要，配合 MTS 服務程式及其應用程式界面處理功能，同時將資訊傳輸效率，及簡化資料傳輸流程等方面作綜合考量，經整體分析及歸類後，基本格式概可分為單筆要求訊息、多筆要求訊息、單筆回覆訊息、多筆回覆訊息及廣播通告訊息五大類，其基本格式說明如下：

(1)單筆要求訊息(One-row Request)

為期貨商(結算會員)應用程式利用 MTS 界面發送給期交所之要求訊息格式，為單次發送處理，其訊息格式包含訊息控制區及訊息資料區。

項次	欄位名稱	屬性	欄位說明	
訊息控制區	1	系統代號	9(1)	
	2	作業類別	9(1)	
	3	作業項目	9(2)	
	4	來源單位代號	X(7)	為期貨商(結算會員)代號
	5	目的單位代號	X(7)	為期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	6	應用資料	依實際需要設計	要求訊息之應用資料內容

(2)多筆要求訊息(Multi-row Request)

為期貨商(結算會員)應用程式利用 MTS 界面發送給期交所之要求訊息格式，期貨商(結算會員)應用程式可依需要多次發送應用資料內容，其訊息格式包含訊息控制區及多筆訊息資料區。

項次	欄位名稱	屬性	欄位說明
訊息控制區	1 系統代號	9(1)	
	2 作業類別	9(1)	
	3 作業項目	9(2)	
	4 來源單位代號	X(7)	為期貨商(結算會員)代號
	5 目的單位代號	X(7)	為期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	6 應用資料(多筆)	依實際需要設計	為多筆之應用資料

(3)單筆回覆訊息(One-row Reply)

為期交所應用程式應期貨商(結算會員)之要求所回覆之各式訊息資料格式，為單次傳送處理，其訊息格式僅由訊息控制區組成。

項次	欄位名稱	屬性	欄位說明	
訊息控制區	1	系統代號	9(1)	
	2	作業類別	9(1)	
	3	作業項目	9(2)	
	4	來源單位代號	X(7)	為期交所單位代號 '0001000'
	5	目的單位代號	X(7)	為期貨商(結算會員)代號
	6	訊息時間	9(6)	
	7	回覆代碼	9(5)	00000：正常，其餘異常代碼說明參閱附錄三

(4)多筆回覆訊息(Multi-row Reply)

為期交所應用程式應期貨商(結算會員)要求所回覆之資料格式，為多次傳送處理，其訊息格式初次傳送內容包括訊息控制區及資料群組代號，再次傳送為該資料群組代號下之各筆資料群組內容；若多筆回覆訊息中包含有不同格式之資料群組，則將再次收到含資料群組代號，及該資料群組代號下之各筆資料群組內容之資料。

項次	欄位名稱	屬性	欄位說明	
訊息控制區	1	系統代號	9(1)	
	2	作業類別	9(1)	
	3	作業項目	9(2)	
	4	來源單位代號	X(7)	為期交所單位代號 '0001000'
	5	目的單位代號	X(7)	為期貨商(結算會員)代號
	6	訊息時間	9(6)	
	7	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位已結帳 3：款項未結帳 4：款項已結帳
	8	結算會員代號	X(4)	
訊息資料區	9	資料群組代號	9(2)	代表此一資料群組之代號
	10	資料群組內容	依實際需要設計	為多筆之應用資料內容

(5)廣播通告訊息(Broadcast Message)

為期交所主動傳送給期貨商(結算會員)之資料格式，為多次傳送處理，其訊息格式與多筆回覆訊息格式相同；惟其配合 MTS 界面傳回之功能參數中 Request ID 值固定為 integer 99。

4.2. 各項訊息傳輸格式

各項傳輸訊息將按訊息代號、訊息名稱、訊息類別、訊息格式及格式說明分述如下：

4.2.1. 期貨部位管理作業

4.2.1.1. 訊息代號：A01

訊息名稱：交易人部位資料查詢通知

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)	1：期貨部位管理作業
	作業項目	9(2)	01：交易人部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(4)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號
	商品代號	X(7)	如查詢單一交易人(起訖號相同)之部位資料,得為'999999'查詢所有商品部位資料,餘者均須輸入商品代號
	交割月份	X(6)	如查詢單一交易人(起訖號相同)之部位資料,得為'999999'查詢所有月份部位資料,餘者均須輸入交割月份

格式說明：

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號,且總公司可查詢其分公司交易人之資料。

4.2.1.2. 訊息代號：A02

訊息名稱：交易人部位資料查詢回覆

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)	1：期貨部位管理作業	
	作業項目	9(2)	01：交易人部位資料查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	目的單位代號	X(7)	期貨商代號	
	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：交易人部位資料	
	01 資料 群組 內容	期貨商代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		交易人帳號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		前日買進部位餘額	9(5)	
		前日賣出部位餘額	9(5)	
		買進部位口數	9(5)	
		賣出部位口數	9(5)	
撥入買進部位口數	9(5)			

欄位		屬性	欄位說明
	撥入賣出部位口數	9(5)	
	撥出/到期買進部位口數	9(5)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(5)	
	了結部位口數	9(5)	
	本日買進部位餘額	9(5)	
	本日賣出進部位餘額	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 A01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數
7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數
8. 到期交割之商品部位依買賣別，於交割日移至撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.1.3. 訊息代號：A03

訊息名稱：期貨商部位資料查詢通知

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)	1：期貨部位管理作業
	作業項目	9(2)	02：期貨商部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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(4)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢結算會員所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有商品部位資料

格式說明：

- 期貨商(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設定(Flag)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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.1.4. 訊息代號：A04

訊息名稱：期貨商部位資料查詢回覆

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)	1：期貨部位管理作業	
	作業項目	9(2)	02：期貨商部位資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：期貨商部位資料	
	01 資料 群組 內容	期貨商代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		前日買進部位餘額	9(7)	
		前日賣出部位餘額	9(7)	
		買進部位口數	9(7)	
		賣出部位口數	9(7)	
		撥入買進部位口數	9(7)	
		撥入賣出部位口數	9(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	撥出/到期買進部位口數	9(7)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(7)	
	了結部位口數	9(7)	
	本日買進部位餘額	9(7)	
	本日賣出進部位餘額	9(7)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)要求所回覆正常資料格式。
2. 期貨商(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 A03 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：期貨商部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式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. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數
7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數
8. 到期交割之商品部位依買賣別，於交割日移至撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.1.5. 訊息代號：A05

訊息名稱：結算會員部位資料查詢通知

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)	1：期貨部位管理作業
	作業項目	9(2)	03：結算會員部位資料查詢
	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' 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(4)	為欲查詢資料之結算會員代號
	商品代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有商品部位資料

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。

4.2.1.6. 訊息代號：A06

訊息名稱：結算會員部位資料查詢回覆

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)	1：期貨部位管理作業	
	作業項目	9(2)	03：結算會員部位資料查詢	
	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：結算會員部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		前日買進部位餘額	9(7)	
		前日賣出部位餘額	9(7)	
		買進部位口數	9(7)	
		賣出部位口數	9(7)	
		撥入買進部位口數	9(7)	
		撥入賣出部位口數	9(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	撥出/到期買進部位口數	9(7)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(7)	
	了結部位口數	9(7)	
	本日買進部位餘額	9(7)	
	本日賣出部位餘額	9(7)	

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 A05 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：結算會員部位資料)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 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(1 表有資料，0 表資料結束)。
6. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數
7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數
8. 到期交割之商品部位依買賣別，於交割日移至撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.1.7. 訊息代號：A07

訊息名稱：部位調整（互抵）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)	1：期貨部位管理作業
	作業項目	9(2)	04：部位調整（互抵）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(4)	
	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(4)	
	撥入期貨商代號	X(7)	
	撥入交易人帳號	X(7)	
	商品代號	X(7)	
	交割月份	X(6)	
	買賣別	X(1)	B：買進, S：賣出
	調整口數	9(5)	輸入之調整口數限於一萬口以下，可輸入負值以辦理沖正

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. 輸入之調整口數應小於一萬口，若欲沖正錯誤之輸入，可輸入負值，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. 台指期貨與小型台指期貨互抵作業說明
 - (1)撥入結算會員代號固定使用' 0002'
 - (2)撥入期貨商代號固定使用' 0000000'
 - (3)撥入交易人帳號固定使用' 0000000'
 - (4)商品代號、交割月份、買賣別、調整口數均以台指期貨為代表，結算系統自動會依 1：4 原則處理相對互抵之小型台指期貨。

4.2.1.8. 訊息代號：A08

訊息名稱：部位調整（互抵）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)	1：期貨部位管理作業	
	作業項目	9(2)	04 部位調整（互抵）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	
	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	
	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A09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 應為 integer 0 (表資料結束)，為最後一筆資料。

4.2.1.9. 訊息代號：A09

訊息名稱：部位調整（互抵）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)	1：期貨部位管理作業
	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(4)	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：查詢移出申請記錄 1：查詢移入申請記錄 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。

4.2.1.10. 訊息代號：A10

訊息名稱：部位調整（互抵）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)	1：期貨部位管理作業	
	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(4)	為多筆之應用資料內容 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 空白為尚未核准, 'Y' 為已核准, 'N' 為不予核准
		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(4)	
		撥入期貨商代號	X(7)	
		撥入交易人帳號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		買賣別	X(1)	

欄位		屬性	欄位說明
	調整口數	9(5)	
	申請日期	9(8)	
	申請時間	9(8)	
	申請編號	9(8)	
	核准狀態	X(1)	

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 A09 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。

4.2.2. 期貨結算保證金作業(台幣商品)

4.2.2.1. 訊息代號：B01 → 停用

訊息名稱：結算保證金查詢通知

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)	2：期貨結算保證金作業
	作業項目	9(2)	01：結算保證金查詢
	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'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(4)	

格式說明：

- 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.2.2. 訊息代號：B02 → 停用

訊息名稱：結算保證金查詢回覆

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)	2：期貨結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	01：結算保證金查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：部位結算會員部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位 資料
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		買進部位餘額	9(7)	
		賣出部位餘額	9(7)	
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金資料	
	02 資料 群組	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位 資料
應存有結算保證金數額		9(12)		

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要求代碼(Request ID)，與傳送 B01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容，將陸續重覆收取直至另一資料群組代號(02)
5. 結算會員應用程式以 MTS 服務程式功能參數之長度區別再次收取之資料格式，為資料群組代號(02)，可由前後筆資料長度不同判別。
6. 結算會員應用程式陸續收取之資料格式，為 02 資料群組內容。
7. 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
8. 應存有結算保證金數額 = (買進部位口數 + 賣出部位口數) × 每口期貨部位結算保證金

4.2.2.3. 訊息代號：B03 → 停用

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知

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)	2：期貨結算保證金作業
	作業項目	9(2)	02：結算保證金追繳資料查詢
	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'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(4)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.2.4. 訊息代號：B04 → 停用

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆

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)	2：期貨結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	02：結算保證金追繳資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：結算保證金追繳資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		應存有結算保證金數額	9(12)	
		原存有結算保證金權益	9(12)	
		補足前日追繳款項金額	9(12)	
		本日存入/移入款項金額	9(12)	
		本日提領/移出款項金額	9(12)	
		本日成交差益數額	9(12)	
		本日成交差損數額	9(12)	
		本日部位差益數額	9(12)	

欄位		屬性	欄位說明
	本日部位差損數額	9(12)	
	本日到期差益數額	9(12)	
	本日到期差損數額	9(12)	
	現存有結算保證金權益	9(12)	
	可提領款項金額	9(12)	
	應追繳款項金額	9(12)	

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要求代碼(Request ID)，與傳送 B03 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
6. 各項金額欄位皆以元為單位，其有關之計算式如下：
 - 現存有結算保證金權益 = 原存有結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 - 次日申請提領款項金額
 - 應追繳款項金額 = 應存有結算保證金數額 - 現存有結算保證金權益數額 > 0
 - 可提領款項金額 = 應存有結算保證金數額 - 現存有結算保證金權益數額

益數額 < 0

- 本日提領/移出款項金額 = 前一日次日提領 + 當日提領

4.2.2.5. 訊息代號：B05 → 停用

訊息名稱：盤中保證金追繳通告

訊息類別：廣播通告訊息

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)	2：期貨結算保證金作業
	作業項目	9(2)	03：盤中保證金追繳通告
	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' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳
	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：盤中保證金追繳
	01 期貨商代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商及自營商保證金追繳資料
	資料群組內容 應追繳數額	9(12)	

格式說明：

1. 為期交所主動傳送給結算會員之正常資料格式。
2. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式，得到一特定之要求代碼(Request ID)為 integer 99，用以代表此為廣播通告訊息。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。

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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

4.2.2.6. 訊息代號：B06 → 停用

訊息名稱：結算保證金餘額查詢通知

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)	2：期貨結算保證金作業
	作業項目	9(2)	04：結算保證金款項查詢
	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'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(4)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.2.7. 訊息代號：B07 → 停用

訊息名稱：結算保證金餘額查詢回覆

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)	2：期貨結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	04：結算保證金餘額查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳	
	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：結算保證金餘額資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商保證金餘額資料
		原存有結算保證金權益	9(12)	
		補足前日追繳金額	9(12)	
		本日存入/移入款項金額	9(12)	
		本日提領/移出款項金額	9(12)	
		本日劃撥追繳款項金額	9(12)	
		本日差益金額	9(12)	
		本日差損金額	9(12)	
現存有結算保證金權益	9(12)			

欄位		屬性	欄位說明
	結算手續費	9(12)	
	交割手續費	9(12)	
	調整手續費	9(12)	
	移轉手續費	9(12)	

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要求代碼(Request ID)，與傳送 B06 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
5. 結算會員應用程式以 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
6. 現存有結算保證金權益 = 原存有結算保證金款項餘額 + 補足前日追繳金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日劃撥追繳金額 + 本日差益金額 - 本日差損金額 - 次日申請提領款項金額
7. 本日提領/移出款項金額 = 前一日申請之次日提領金額 + 本日申請之當日提領金額
8. 本日差益金額 = 本日成交差益數額 + 本日部位差益數額 + 本日到期差益數額
9. 本日差損金額 = 本日成交差損數額 + 本日部位差損數額 + 本日到期差損數額
10. 結算、交割、調整及移轉手續費等係為前一營業日之各項資料。

4.2.3. 其他連線作業

4.2.3.1. 訊息代號：C01 → 停用

訊息名稱：交易人基本資料登錄通知

訊息類別：多筆要求訊息

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)	3：其他連線作業	
	作業項目	9(2)	01：交易人基本資料登錄	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
訊息資料區	期貨商代號	X(7)	戶別： 1. 保留欄位空白 2. 身份碼欄位請依期交所訂定之編碼原則 非個人戶者不須輸入身份證統一編號 出生/設立日期：採西元年月日 YYYYMMDD 姓名/名稱：採變動欄位 中文採 Big-5 碼，前四碼不得空白	
	交易人交易帳號	X(7)		
	戶別	保留		X(1)
		身份碼		X(1)
	出生/設立日期	9(8)		
	身份證統一編號	X(10)		
	營利事業/扣繳單位統一編號	X(8)		
	主要關係期貨商代號	X(7)		
	主要關係人交易帳號	X(7)		
姓名/名稱	X(4)~ X(120)			

格式說明：

1. 期貨商應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定

為' 0' (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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。

4.2.3.2. 訊息代號：C02 → 停用

訊息名稱：交易人基本資料登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	01：交易人基本資料登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：接收正常，其餘如附件三

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.3.3. 訊息代號：C03 → 停用

訊息名稱：交易人基本資料查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	02：交易人基本資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	期貨商代號	X(7)	
	交易人交易帳號	X(7)	

格式說明：

1. 資訊廠商應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag) 設定為' 0' (單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給集保結算所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 資訊廠商應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
X：表示文數字，9 表示數字。
3. 來源單位代號內容為資訊廠商總公司或自營商代號時，可查詢分公司交易人基本資料

4.2.3.4. 訊息代號：C04 → 停用

訊息名稱：交易人基本資料查詢回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	3：其他連線作業	
	作業項目	9(2)	02：交易人基本資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	訊息代碼	9(5)	"00000"	
訊息 資料 區	期貨商代號	X(7)	戶別： 1. 保留欄位空白 2. 身份碼欄位依期交所訂定之編碼原則	
	交易人交易帳號	X(7)		
	戶別	保留		X(1)
		身份碼		X(1)
	出生/設立日期	9(8)	出生/設立日期： 1. 採西元年月日 YYYYMMDD	
	身份證統一編號	X(10)	公司戶者不須輸入身份證統一編號	
	營利事業/扣繳單位統一編號	X(8)		
	主要關係期貨商代號	X(7)	個人戶者不須輸入營利事業/扣繳單位統一編號	
	主要關係人交易帳號	X(7)	姓名/名稱：採變動欄位 1. 中文採 Big-5 碼，前四碼不得空白	
	開戶日期	9(8)		
姓名/名稱	X(4)~ X(120)			

格式說明：

1. 為結算系統應期貨商之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C03 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.3.5. 訊息代號：C05

訊息名稱：公告資料查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	03：公告資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號(或結算會員)
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	日期	X(8)	欲查詢公告之日期： 日期：採西元年月日 YYYYMMDD 如輸入 99999999 表示欲查詢目前最新公告資料 如輸入 88888888 表示欲查詢目前錯誤訊息代碼對照資料 如輸入 11111111 表示欲查詢目前結帳狀態資料

格式說明：

- 期貨商(結算會員)之應用程式需配合 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結算系統，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 期貨商(結算會員)應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
- X：表示文數字，9：表示數字

4.2.3.6. 訊息代號：C06

訊息名稱：公告資料查詢回覆

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	03：公告資料查詢
	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)	為期貨商代號(或結算會員)
	訊息時間	9(6)	回覆訊息時間
	訊息代碼	9(5)	"00000"
訊息資料區	公告時間	X(8)	採西元年月日 YYYYMMDD
	公告序號	9(4)	序號："0001" to "9999"
	公告資料內容	X(80)	
	公告時間	X(8)	採西元年月日 YYYYMMDD
	公告序號	9(4)	序號："0001" to "9999"
	公告資料內容	X(80)	
	• • • • •	• •	• • • • •

格式說明：

1. 為結算系統應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼 (Request ID)，與傳送 C05 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商(結算會員)應用程式收取之資料格式為訊息控制區及訊息資料區，如上

所述，訊息資料區內容為 [公告時間 + 公告序號 + 公告資料內容]、[公告時間 + 公告序號 + 公告資料內容]…，並以公告序號小到大依序送出。

4. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

5. X：表示文數字，9：表示數字

6. 如輸入 11111111 查詢，依結帳狀態回覆之內容為：

公告時間	公告序號	公告資料內容
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：未結帳，第 2 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：已結帳

4.2.3.7. 訊息代號：C07

訊息名稱：結算服務費查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	04：結算服務費查詢
	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'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(4)	
	商品代號	X(7)	“FITX” 或 “FITF” 或 “FITE” 或 “9999999” 表所有商品

格式說明：

1. 結算會員端應用程式需配合 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 結算會員端應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
3. X：表示文數字，9：表示數字。

4.2.3.8. 訊息代號：C08

訊息名稱：結算服務費查詢回覆

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)	3：其他連線作業	
	作業項目	9(2)	04：結算服務費查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳	
	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：結算服務費資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商保證金餘額資料
		商品代號	X(7)	
		結算手續費	9(12)	
		交割手續費	9(12)	
		調整手續費	9(12)	
		移轉手續費	9(12)	

格式說明：

1. 為結算系統應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 結算會員端應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C07 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。

3. 結算會員端應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員端應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
5. 結算會員端應用程式以 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
6. 結算、交割、調整及移轉手續費等係為前一營業日之各項資料。
7. X：表示文數字，9：表示數字

4.2.3.9. 訊息代號：C09

訊息名稱：交易人基本資料登錄通知

訊息類別：多筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	X(1)	0：結算系統
	作業類別	X(1)	3：其他連線作業
	作業項目	X(2)	05：交易人基本資料登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	1. 期貨商代號	X(7)	
	2. 交易人帳號	X(7)	
	3. 戶別(身份碼)	X(1)	不得為空白
	4. 出生/設立日期	X(8)	格式為 YYYYMMDD
	5. 身份證編號/營利事業統一編號	X(10)	
	6. 證券商代號	X(7)	
	7. 交易人集保帳號	X(7)	
	8. 電話	X(20)	
	9. 戶籍地址	X(80)	前十碼不得為空白
	10. 通訊地址	X(80)	
	11. 郵遞地址(郵寄對帳單)	X(80)	前十碼不得為空白
	12. 法人受任人/自然人代理人姓名-1	X(20)	法人戶必填/自然人有代理人必填 前四碼不得為空白

13. 法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-1	X(10)	有輸入欄位 12(法人受任人/自然人代理人姓名-1)者必填
14. 法人受任人/自然人代理人電話-1	X(20)	有輸入欄位 12(法人受任人/自然人代理人姓名-1)者必填
15. 法人受任人/自然人代理人戶籍地址-1	X(80)	有輸入欄位 12(法人受任人/自然人代理人姓名-1)者必填
16. 法人受任人/自然人代理人通訊地址-1	X(80)	有輸入欄位 12(法人受任人/自然人代理人姓名-1)者必填
17. 法人受任人/自然人代理人姓名-2	X(20)	無資料者免填 有輸入者，前四碼不得為空白
18. 法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-2	X(10)	有輸入欄位 17(法人受任人/自然人代理人姓名-2)者必填
19. 法人受任人/自然人代理人電話-2	X(20)	有輸入欄位 17(法人受任人/自然人代理人姓名-2)者必填
20. 法人受任人/自然人代理人戶籍地址-2	X(80)	有輸入欄位 17(法人受任人/自然人代理人姓名-2)者必填
21. 法人受任人/自然人代理人通訊地址-2	X(80)	有輸入欄位 17(法人受任人/自然人代理人姓名-2)者必填
22. 法人受任人/自然人代理人姓名-3	X(20)	無資料者免填 有輸入者，前四碼不得為空白
23. 法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-3	X(10)	有輸入欄位 22(法人受任人/自然人代理人姓名-3)者必填
24. 法人受任人/自然人代理人電話-3	X(20)	有輸入欄位 22(法人受任人/自然人代理人姓名-3)者必填
25. 法人受任人/自然人代理人戶籍地址-3	X(80)	有輸入欄位 22(法人受任人/自然人代理人姓名-3)者必填
26. 法人受任人/自然人代理人通訊地址-3	X(80)	有輸入欄位 22(法人受任人/自然人代理人姓名-3)者必填

27. 法人受任人/自然人代理人姓名-4	X(20)	無資料者免填 有輸入者，前四碼不得為空白
28. 法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-4	X(10)	有輸入欄位 27(法人受任人/自然人代理人姓名-4)者必填
29. 法人受任人/自然人代理人電話-4	X(20)	有輸入欄位 27(法人受任人/自然人代理人姓名-4)者必填
30. 法人受任人/自然人代理人戶籍地址-4	X(80)	有輸入欄位 27(法人受任人/自然人代理人姓名-4)者必填
31. 法人受任人/自然人代理人通訊地址-4	X(80)	有輸入欄位 27(法人受任人/自然人代理人姓名-4)者必填
32. 法人受任人/自然人代理人姓名-5	X(20)	無資料者免填 有輸入者，前四碼不得為空白
33. 法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-5	X(10)	有輸入欄位 32(法人受任人/自然人代理人姓名-5)者必填
34. 法人受任人/自然人代理人電話-5	X(20)	有輸入欄位 32(法人受任人/自然人代理人姓名-5)者必填
35. 法人受任人/自然人代理人戶籍地址-5	X(80)	有輸入欄位 32(法人受任人/自然人代理人姓名-5)者必填
36. 法人受任人/自然人代理人通訊地址-5	X(80)	有輸入欄位 32(法人受任人/自然人代理人姓名-5)者必填
37. 介紹人	X(20)	
38. 聯絡人	X(20)	前四碼不得為空白
39. 聯絡人電話	X(20)	前五碼不得為空白
40. 開戶人職業	X(20)	
41. 全權委託業者代號	X(8)	全權委託戶必需輸入此項目
42. 外資帳戶保管機構代號	X(5)	外資帳戶必需輸入此項目

43. 交易人電子郵件信箱位址-1	X(40)	無資料者免填 有輸入者，須符合電子郵件規則
44. 交易人電子郵件信箱位址-2	X(40)	無資料者免填 有輸入者，須符合電子郵件規則
45. 入金帳戶銀行名稱-1	X(20)	無資料者免填
46. 入金帳戶銀行代號-1	X(3)	有輸入欄位 45(入金帳戶銀行名稱-1)者必填者
47. 入金帳戶存款帳號-1	X(16)	有輸入欄位 45(入金帳戶銀行名稱-1)者必填者
48. 入金帳戶幣別-1	X(2)	有輸入欄位 45(入金帳戶銀行名稱-1)者必填者
49. 約定入金帳戶日期-1	X(8)	有輸入欄位 45(入金帳戶銀行名稱-1)者必填者
50. 入金帳戶銀行名稱-2	X(20)	無資料者免填
51. 入金帳戶銀行代號-2	X(3)	有輸入欄位 50(入金帳戶銀行名稱-2)者必填者
52. 入金帳戶存款帳號-2	X(16)	有輸入欄位 50(入金帳戶銀行名稱-2)者必填者
53. 入金帳戶幣別-2	X(2)	有輸入欄位 50(入金帳戶銀行名稱-2)者必填者
54. 約定入金帳戶日期-2	X(8)	有輸入欄位 50(入金帳戶銀行名稱-2)者必填者
55. 入金帳戶銀行名稱-3	X(20)	無資料者免填
56. 入金帳戶銀行代號-3	X(3)	有輸入欄位 55(入金帳戶銀行名稱-3)者必填者
57. 入金帳戶存款帳號-3	X(16)	有輸入欄位 55(入金帳戶銀行名稱-3)者必填者
58. 入金帳戶幣別-3	X(2)	有輸入欄位 55(入金帳戶銀行名稱-3)者必填者
59. 約定入金帳戶日期-3	X(8)	有輸入欄位 55(入金帳戶銀行名稱-3)者必填者
60. 入金帳戶銀行名稱-4	X(20)	無資料者免填
61. 入金帳戶銀行代號-4	X(3)	有輸入欄位 60(入金帳戶銀行名稱-4)者必填者
62. 入金帳戶存款帳號-4	X(16)	有輸入欄位 60(入金帳戶銀行名稱-4)者必填者
63. 入金帳戶幣別-4	X(2)	有輸入欄位 60(入金帳戶銀行名稱-4)者必填者

64. 約定入金帳戶日期-4	X(8)	有輸入欄位 60(入金帳戶銀行名稱-4)者必填者
65. 開戶營業據點代號	X(7)	此欄位必填，於專、兼營期貨商營業據點辦理開戶者，請輸入期貨商(含分公司)代碼共計 7 碼，於期貨交易輔助人營業據點辦理開戶者，請輸入證券商(含分公司)代碼共計 4 碼，欄位後 3 碼空白。
66. 戶名	X(4)~ X(120)	為變動欄位，前四碼不得為空白

內容說明：

1. 本訊息因上傳資料超過預設暫存區長度，請於應用程式中分五次執行 PUT 功能，首次執行時參數類別(Flag)設定為' 1' (表仍有資料)，其內容為訊息控制區至訊息資料區第 11 個欄位(郵遞地址)；第二次執行參數類別設定為' 1' (表仍有資料)，其內容為訊息資料區第 12 欄至第 21 欄；第三次執行參數類別設定為' 1' (表仍有資料)，其內容為訊息資料區第 22 欄至第 31 欄；第四次執行參數類別設定為' 1' (表仍有資料)，其內容為訊息資料區第 32 欄至第 44 欄；第五次執行參數類別設定為' 0' (表資料結束)，其內容為訊息資料區第 45 欄至第 65 欄。

4.2.3.10. 訊息代號：C10

訊息名稱：交易人基本資料登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	05：交易人基本資料登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：接收正常，其餘如附件三

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.3.11. 訊息代號：C11

訊息名稱：交易人基本資料查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	06：交易人基本資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	期貨商代號	X(7)	
	交易人交易帳號	X(7)	

格式說明：

- 期貨商應用程式需配合 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結算系統，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 期貨商應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
X：表示文數字，9：表示數字
- 來源單位代號內容為期貨商總公司或自營商代號時，可查詢分公司交易人基本資料

4.2.3.12. 訊息代號：C12

訊息名稱：交易人基本資料查詢回覆

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)	3：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	06：交易人基本資料查詢	
	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'999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	顯示 0	
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號	
訊息資料區	01 資料群組代號	9(2)	01：交易人基本資料 1	
	01 資料群組內容	期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		戶別(身份碼)	X(1)	
		出生/設立日期	X(8)	格式為 YYYYMMDD
		身份證編號/營利事業統一編號	X(10)	
		開戶日期	X(8)	格式為 YYYYMMDD
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		電話	X(20)	

欄位		屬性	欄位說明
	戶籍地址	X(80)	
	通訊地址	X(80)	
	郵遞地址(郵寄對帳單)	X(80)	
02 資料群組代號		9(2)	02：交易人基本資料 2
02 資料 群組 內容	法人受任人/自然人代理人姓名-1	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-1	X(10)	
	法人受任人/自然人代理人電話-1	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人戶籍地址-1	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人通訊地址-1	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人姓名-2	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-2	X(10)	
	法人受任人/自然人代理人電話-2	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人戶籍地址-2	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人通訊地址-2	X(80)	
03 資料群組代號		9(2)	03：交易人基本資料 3

欄位		屬性	欄位說明
03 資料 群組 內容	法人受任人/自然人代理人姓名-3	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-3	X(10)	
	法人受任人/自然人代理人電話-3	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人戶籍地址-3	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人通訊地址-3	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人姓名-4	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-4	X(10)	
	法人受任人/自然人代理人電話-4	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人戶籍地址-4	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人通訊地址-4	X(80)	
04 資料群組代號	9(2)	04：交易人基本資料 4	
04 資料 群組 內容	法人受任人/自然人代理人姓名-5	X(20)	
	法人受任人/自然人代理人身分證統一編號-5	X(10)	
	法人受任人/自然人代理人電話-5	X(20)	

欄位		屬性	欄位說明
	法人受任人/自然人代理人戶籍地址-5	X(80)	
	法人受任人/自然人代理人通訊地址-5	X(80)	
	介紹人	X(20)	
	聯絡人	X(20)	
	聯絡人電話	X(20)	
	開戶人職業	X(20)	
	全權委託業者代號	X(8)	
	外資帳戶保管機構代號	X(5)	
	交易人電子郵件信箱位址-1	X(40)	
	交易人電子郵件信箱位址-2	X(40)	
	05 資料群組代號	9(2)	05：交易人基本資料 5
05 資料 群組 內容	入金帳戶銀行名稱-1	X(20)	
	入金帳戶銀行代號-1	X(3)	
	入金帳戶存款帳號-1	X(16)	
	入金帳戶幣別-1	X(2)	
	約定入金帳戶日期-1	X(8)	
	入金帳戶銀行名稱-2	X(20)	
	入金帳戶銀行代號-2	X(3)	
	入金帳戶存款帳號-2	X(16)	
	入金帳戶幣別-2	X(2)	

欄位	屬性	欄位說明
約定入金帳戶日期-2	X(8)	
入金帳戶銀行名稱-3	X(20)	
入金帳戶銀行代號-3	X(3)	
入金帳戶存款帳號-3	X(16)	
入金帳戶幣別-3	X(2)	
約定入金帳戶日期-3	X(8)	
入金帳戶銀行名稱-4	X(20)	
入金帳戶銀行代號-4	X(3)	
入金帳戶存款帳號-4	X(16)	
入金帳戶幣別-4	X(2)	
約定入金帳戶日期-4	X(8)	
開戶營業據點代號	X(7)	
戶名	X(4)~ X(120)	

內容說明：

1. 本訊息因傳送資料超過預設暫存區長度，請於應用程式中分五組資料群組接收。

4.2.3.13. 訊息代號：C13

訊息名稱：交易人公債帳戶登錄

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	07：交易人公債帳戶登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
+ 訊 息 資 料 區	期貨商代號	X(7)	為欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為欲登錄資料之交易人帳號
	身分證字號	X(10)	為欲登錄資料之交易人身分證字號'
	帳戶類別	X(1)	帳戶類別代號，公債：B，股票：S
	銀行代號	X(7)	登錄資料長度不足 7 位時以空白補滿
	交割公債帳號	X(21)	資料長度不足 21 位時以空白補滿

格式說明：

1. 本交易提供登錄交易人交割債券銀行帳號(帳戶類別為' B')或交割股票集保帳號(帳戶類別為' S')等所需之相關資料。
2. 登錄銀行代號資料長度不足 7 位時以空白補滿。登錄交易人銀行帳號資料長度不足 21 位時以空白補滿。

4.2.3.14. 訊息代號：C14

訊息名稱：交易人公債帳戶登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	07：交易人公債帳戶登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常 26038：身份證字號錯誤

4.2.3.15. 訊息代號：C15

訊息名稱：交易人公債帳戶查詢

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	08：交易人公債帳戶查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息 資料 區	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	

格式說明：

1. 本交易提供查詢債券交易人銀行帳號等之相關資料。

4.2.3.16. 訊息代號：C16

訊息名稱：交易人公債帳戶查詢回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	08：交易人公債帳戶查詢
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常
訊息 資料 區	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	
	銀行代號	X(7)	資料長度不足 7 位時以空白補滿
	交割公債帳號	X(21)	資料長度不足 21 位時以空白補滿

4.2.3.17. 訊息代號：C17

訊息名稱：期交稅查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	09：期交稅查詢
	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'999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	交易日期	X(8)	格式為 YYYYMMDD
	期貨商代號	X(7)	欲查詢之期貨商代號
	商品代號	X(7)	"9999999" 表所有商品
	交割月份	X(6)	"999999" 表所有交割月份
	查詢類別	X(1)	"0" 表期交稅 "1" 表到期期交稅 "2" 表證交稅

格式說明：

1. 結算會員端應用程式需配合 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 結算會員端應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
3. X：表示文數字，9：表示數字。
4. 輸入之交易日期，以“前一營業日”為準。
5. 各期貨商只可查詢自己公司之期交稅資料，不允許查詢其他期貨商之資料。

4.2.3.18. 訊息代號：C18

訊息名稱：期交稅查詢回覆

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)	3：其他連線作業	
	作業項目	9(2)	09：期交稅查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳	
	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：期交稅資料	
	01 資料 群組 內容	交易日期	X(8)	包含回覆結算會員經紀商、自營商保證金餘額資料
		期貨商代號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		查詢類別	X(1)	
		成交買進口數	9(8)	
		成交賣出口數	9(8)	
		成交買進總金額	9(12)	
		成交賣出總金額	9(12)	

欄位		屬性	欄位說明
	成交買進稅額	9(12)	
	成交賣出稅額	9(12)	

格式說明：

1. 為結算系統應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 結算會員端應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C17 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員端應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員端應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
5. 本功能提供之試算稅額僅供參考，實際稅額以國稅局核定為準

4.2.3.19. 訊息代號：C19

訊息名稱：交易人總開戶數查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	10：交易人總開戶數查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	查詢筆數	9(2)	01~10 筆 (盤中限查一筆)
	身分證統一編號／營利事業 統一編號	X(10)	對應 [查詢筆數] 欄位
	：	：	

格式說明：

- 期貨商端應用程式需配合 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 期貨商端應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
- 可同時查詢一至十筆資料，但盤中限查詢一筆資料。
- X：表示文數字 (左靠右補空白)，9：表示數字 (右靠左補 '0')。

4.2.3.20. 訊息代號：C20

訊息名稱：交易人總開戶數查詢回覆

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	10：交易人總開戶數查詢
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	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)	相關結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人開戶數資料
	01 身分證統一編號／營利事業統一編號	X(10)	
	資料群組內容 總開戶數	9(3)	
	最近五營業日內開戶數	9(3)	含本日
	最近一個月內開戶數	9(3)	

格式說明：

1. 為結算系統應期貨商之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商端應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C19 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商端應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 期貨商端應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。

4.2.3.21. 訊息代號：C21

訊息名稱：期交稅查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	11：期交稅查詢
	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'999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	交易日期	X(8)	格式為 YYYYMMDD
	期貨商代號	X(7)	欲查詢之期貨商代號
	商品代號	X(7)	"9999999" 表所有商品
	交割月份	X(6)	"999999" 表所有交割月份
	查詢類別	X(1)	"0" 表期交稅 "1" 表到期期交稅 "2" 表證交稅

格式說明：

1. 結算會員端應用程式需配合 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 結算會員端應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
3. X：表示文數字，9：表示數字。
4. 輸入之交易日期，以“前一營業日”為準。
5. 各期貨商只可查詢自己公司之期交稅資料，不允許查詢其他期貨商之資料。

4.2.3.22. 訊息代號：C22

訊息名稱：期交稅查詢回覆

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)	3：其他連線作業	
	作業項目	9(2)	11：期交稅查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳	
	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：期交稅資料	
	01 資料 群組 內容	交易日期	X(8)	包含回覆結算會員經紀商、自營商保證金餘額資料
		期貨商代號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		查詢類別	X(1)	
		成交買進口數	9(8)	
		成交賣出口數	9(8)	
		成交買進總金額	9(12) v99	
		成交賣出總金額	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	成交買進稅額	9(12) v99	
	成交賣出稅額	9(12) v99	

格式說明：

1. 為結算系統應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 結算會員端應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C21 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員端應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員端應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
5. 本功能提供之試算稅額僅供參考，實際稅額以國稅局核定為準

4.2.3.23. 訊息代號：C23

訊息名稱：匯率暨利率查詢通知

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)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	12：匯率暨利率查詢
	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'999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	查詢類別	X(1)	1：匯率、2：利率

格式說明：

1. 結算會員端應用程式需配合 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 結算會員端應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上所述。
3. X：表示文數字，9：表示數字。

4.2.3.24. 訊息代號：C24

訊息名稱：匯率暨利率查詢回覆

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)	3：其他連線作業	
	作業項目	9(2)	12：匯率暨利率查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：匯率資料	
	01 資料 群組 內容	換匯前幣別	X(1)	1：台幣、2：美金、3：歐元、4：日幣 5：英鎊、6：澳幣、7：港幣
		換匯後幣別	X(1)	
	匯率	9(4)v		
		9(6)		
	資料時間	9(6)		
	資料群組代號	9(2)	02：利率資料	
02 資料 群組 內容	幣別	X(1)	1：台幣、2：美金、3：歐元、4：日幣 5：英鎊、6：澳幣、7：港幣	

欄位		屬性	欄位說明
	利率	9(2)v 9(4)	

格式說明：

1. 為結算系統應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 結算會員端應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 C23 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員端應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01 or 02，視 C23 之查詢類別而定)。
4. 結算會員端應用程式再次收取之資料格式，視 C23 之查詢類別為 01 or 02 之資料群組內容。

4.2.4. 到期履約及實物交割作業

4.2.4.1. 訊息代號：D01

訊息名稱：自動履約名冊查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	01：自動履約名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為 '9' 查詢所有商品資料，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	得為 '999999' 以查詢所有商品資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有商品資料，期貨商品輸入空白

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。

4.2.4.2. 訊息代號：D02

訊息名稱：自動履約名冊查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	01：自動履約名冊查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	5：履約調整未截止 6：履約調整已截止	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：履約指派名冊資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		履約口數	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：履約指派名冊資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 遇同日進行「黃金選擇權(TGO)」與「短天期台指選擇權」履約作業，**或遇資訊異常改採分批到期作業時**，以' 9999999' 查詢所有商品名冊資料恐造成資料混淆，系統將回覆「26201 請以完整商品代號重新查詢」；建議取消 MTS0401 及 0404 交易，改以 0416 交易查詢履約名冊資料及 0419 交易查詢履約指派名冊。
7. 因應「短天期台指選擇權」上市，為避免本日及次日皆遇商品到期，原提供兩日名冊資料之查詢方式恐造成資料混淆，故本交易改為只提供當日名冊查詢。

4.2.4.3. 訊息代號：D03

訊息名稱：自動履約名冊登錄通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	02：自動履約名冊登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為' C' ，賣權為' P'
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	期貨商品輸入空白
	履約口數	9(5)	

格式說明：

1. 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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. 來源單位代號須為期貨商代號。

4.2.4.4. 訊息代號：D04

訊息名稱：自動履約名冊登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	02：自動履約名冊登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D03 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.5. 訊息代號：D05

訊息名稱：自動履約名冊刪除通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	03：自動履約名冊刪除
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲刪除資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲刪除資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為刪除資料之交易人帳號
	商品代號	X(7)	須輸入單一商品代號
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為' C'，賣權為' P'
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	期貨商品輸入空白
	履約口數	9(5)	

格式說明：

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號。

4.2.4.6. 訊息代號：D06

訊息名稱：自動履約名冊刪除回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	03：自動履約名冊刪除
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D05 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.7. 訊息代號：D07

訊息名稱：履約指派名冊查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	04：履約指派名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為 '9' 以查詢所有買賣權別資料，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	得為 '999999' 以查詢所有交割月份資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有履約價格資料，期貨商品輸入空白

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。

4.2.4.8. 訊息代號：D08

訊息名稱：履約指派名冊查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	04：履約指派名冊查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	5：履約調整未截止 6：履約調整已截止	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：履約指派名冊資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		履約口數	9(5)	
		不需履約口數	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D07 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：履約指派名冊資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 遇同日進行「黃金選擇權(TGO)」與「短天期台指選擇權」履約作業，**或遇資訊異常改採分批到期作業時**，以' 9999999' 查詢所有商品名冊資料恐造成資料混淆，系統將回覆「26201 請以完整商品代號重新查詢」；建議取消 MTS0401 及 0404 交易，改以 0416 交易查詢履約名冊資料及 0419 交易查詢履約指派名冊。
7. 因應「短天期台指選擇權」上市，為避免本日及次日皆遇商品到期，原提供兩日名冊資料之查詢方式恐造成資料混淆，故本交易改為只提供當日名冊查詢。

4.2.4.9. 訊息代號：D09

訊息名稱：履約參考名冊查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	05：履約參考名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為' 8888888' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為' 9' 查詢所有商品資料，期貨為空白，買權為' C'，賣權為' P'
	交割月份	X(6)	得為' 999999' 以查詢所有商品資料
	履約價格	X(5)	得為' 99999' 以查詢所有商品資料，期貨商品輸入空白
	查詢種類	9(1)	1：查詢指派參考名冊明細資料 2：查詢指派參考名冊彙總資料 3：查詢賣權履約申請明細資料 4：查詢賣權履約申請彙總資料

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. 查詢種類為' 1' , ' 3' 時，回覆 01 參考名冊明細群組資料，為' 2' 、' 4' 時，回覆 02 名冊彙總資料群組資料

4.2.4.10. 訊息代號：D10

訊息名稱：履約參考名冊查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	05：履約參考名冊查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	目地單位代號	X(7)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)		
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	01 明細資料群組代號	9(2)	01：參考名冊明細資料	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		買賣別	X(1)	
		履約口數	9(5)	

欄位		屬性	欄位說明
	證券商代號	X(7)	
	交易人集保帳號	X(7)	
	02 彙總資料群組代號	9(2)	
	期貨商代號	X(7)	
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	
	買賣別	X(1)	
	履約口數	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D09 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：履約指派名冊資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.11. 訊息代號：D11

訊息名稱：交易人標的證券匯入明細查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	06：交易人標的證券匯入明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	證券代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有證券匯入資料

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。

4.2.4.12. 訊息代號：D12

訊息名稱：交易人標的證券匯入明細查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	06：交易人標的證券匯入明細查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	7：期交所交割專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人標的證券匯入明細資料	
	01 資料 群組 內容	序號	9(8)	為多筆之應用資料內容
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		匯入股數	9(8)	
		匯撥時間	9(6)	

欄位		屬性	欄位說明
	匯撥交易序號	X(13)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D11 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人標的證券匯入明細資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.13. 訊息代號：D13

訊息名稱：交易人標的證券餘額查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	07：交易人標的證券餘額查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間起號
	交易人帳號訖號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間訖號
	證券代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有證券匯入資料

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。

4.2.4.14. 訊息代號：D14

訊息名稱：交易人標的證券餘額查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	07：交易人標的證券餘額查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	7：期交所交割專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人標的證券餘額資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		昨日餘額	9(8)	
		申請匯入股數	9(8)	
		存券轉入股數	9(8)	
		調整轉入股數	9(8)	
		買方交割轉入股數	9(8)	

欄位		屬性	欄位說明
	賣方交割轉入股數	9(8)	
	買方交割轉出股數	9(8)	
	賣方交割轉出股數	9(8)	
	交割存券匯出股數	9(8)	
	調整轉出股數	9(8)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D13 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人標的證券餘額資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 交易人存券餘額 = 昨日餘額 + 申請匯入股數 + 存券轉入股數 + 調整轉入股數 + 買方交割轉入股數 + 賣方交割轉入股數 - 買方交割轉出股數 - 賣方交割轉出股數 - 交割存券匯出股數 - 調整轉出股數

4.2.4.15. 訊息代號：D15

訊息名稱：匯入異常資料查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	08：匯入異常明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號

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。

4.2.4.16. 訊息代號：D16

訊息名稱：匯入異常資料查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	08：匯入異常資料查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	7：期交所交割專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：匯入異常資料	
	01 資料 群組 內容	異常日期	9(8)	格式為 YYYYMMDD
		序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券身分證字號	X(10)	
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	匯入股數	9(8)	
	匯撥時間	9(6)	
	匯撥交易序號	X(13)	
	異常原因	X(1)	1：證券期貨身分證字號或營利事業編號不符 2：交易人期貨帳戶不存在
	調整註記	X(1)	空白：尚未調整 1：調整入交易人存券帳 2：調整券返還原匯入之證券帳號
	調整日期	X(8)	YYYYMMDD

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D15 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：匯入異常資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.17. 訊息代號：D17

訊息名稱：存券匯出申請通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	09：存券匯出申請
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲申請之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲申請之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為申請之交易人帳號
	證券代號	X(7)	須輸入單一商品代號
	股數	9(8)	可為原輸入股數之負值以沖正該筆申請資料
	證券商代號	X(7)	存券欲匯入之交易人集保帳號
	交易人集保帳號	X(7)	

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。

4.2.4.18. 訊息代號：D18

訊息名稱：存券匯出申請回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	09：存券匯出申請
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D17 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.19. 訊息代號：D19

訊息名稱：存券匯出申請查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	10：存券匯出申請查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號

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。

4.2.4.20. 訊息代號：D20

訊息名稱：存券匯出申請查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	10：存券匯出申請查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)		
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：存券匯出申請資料	
	01 資料 群組 內容	序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		股數	9(8)	
		有效記號	X(1)	Y：有效，N：無效
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D19 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：存券匯出申請資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.21. 訊息代號：D21

訊息名稱：匯出異常資料查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	11：匯出異常明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號

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。

4.2.4.22. 訊息代號：D22

訊息名稱：匯出異常資料查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	11：匯出異常資料查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	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)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：匯出異常資料	
	01 資料 群組 內容	異常日期	9(8)	YYYYMMDD
		序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券身分證字號	X(10)	
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	匯撥股數	9(8)	
	異常原因	X(1)	1: 證券期貨身分證字號或營利事業編號不符 2: 交易人證券帳戶不存在
	調整證券商代號	X(7)	調整為匯入此交易人集保帳號
	調整交易人帳號	X(7)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D21 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：匯出異常資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.23. 訊息代號：D23

訊息名稱：匯出異常集保帳號調整通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	12：匯出異常集保帳號調整
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	異常日期	9(8)	
	序號	9(8)	
	結算會員代號	X(7)	欲調整資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲調整資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為調整資料之交易人帳號
	調整證券商代號	X(7)	
	調整交易人集保帳號	X(7)	

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。

4.2.4.24. 訊息代號：D24

訊息名稱：匯出異常集保帳號調整回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	12：匯出異常集保帳號調整
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D23 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.25. 訊息代號：D25

訊息名稱：履約指派集保帳號調整通知／買方交割公債帳戶調整

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	13：履約指派集保帳號調整
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	類別	X(1)	1：調整履約名冊內容 2：調整指派名冊內容 3：調整履約參考名冊內容 4：調整買方交割公債名冊銀行帳戶
	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	
	商品代號	X(7)	4：公債期貨代號
	買賣權別	X(1)	4：空白
	交割月份	X(6)	4：空白
	履約價格	X(5)	4：空白
	口數	9(7)	4：交割口數
	證券商代號	X(7)	4：銀行代號
	交易人集保帳號	X(7) X(21)	1、2、3：集保帳號 X(7) 4：交割公債帳戶 X(21)

格式說明：

1. 類別為' 4' 時表示調整交易人公債交割名冊之交割帳戶，格式中' 買賣權別'、' 交割月份'、' 履約價格' 皆輸入空白。
2. 類別為' 1'，' 2'，' 3' 時輸入交易人集保帳號表示為之股票交割集保帳號，長度為 7 byte，類別為' 4' 時，輸入交易人集保帳號表示為之債券交割帳號，長度為 21 byte。

4.2.4.26. 訊息代號：D26

訊息名稱：履約指派集保帳號調整回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	13：履約指派集保帳號調整
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D25 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.27. 訊息代號：D27

訊息名稱：撥轉名冊結果查詢

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	14：撥轉名冊結果查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號，' 9999999' 表查詢所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	' 9999999' 表查詢所有商品資料
	買賣權別	X(1)	' 9' 表查詢所有買賣權別資料
	交割月份	X(6)	' 999999' 表查詢所有月份資料
	履約價格	X(5)	' 99999' 表查詢所有履約價格資料
	撥轉類別	X(1)	1：賣權履約扣帳撥轉 2：買權指派扣帳撥轉 3：賣權指派入帳撥轉 4：買權履約入帳撥轉 5：匯入異常撥轉 6：存券匯出申請 7：匯出異常撥轉 9：全部資料

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。

4.2.4.28. 訊息代號：D28

訊息名稱：撥轉名冊明細查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	14：撥轉名冊明細查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)		
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：撥轉名冊明細資料	
	01 資料群組內容	撥轉類別	X(1)	1：賣權履約扣帳撥轉 2：買權指派扣帳撥轉 3：賣權指派入帳撥轉 4：買權履約入帳撥轉 5：匯入異常撥轉 6：存券匯出申請 7：匯出異常撥轉
		結算會代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人交易帳號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	

欄位		屬性	欄位說明
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	
	交易人證券商代號	X(7)	
	交易人集保帳號	X(7)	
	序號	9(8)	
	證券代號	X(7)	
	撥轉股數	9(8)	
	可扣存券股數	9(8)	
	應撥轉股數	9(8)	
	實際撥轉股數	9(8)	
	異常原因	X(1)	1, 3：帳號 id 不符 2, 4：交易人帳號錯誤 5：證券餘額不足 6：因券商調整餘額不足 9：其他錯誤

訊息說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D27 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：撥轉名冊明細資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 應撥轉股數 = 撥轉股數 - 可扣存券股數

4.2.4.31. 訊息代號：D31

訊息名稱：買方履約名冊查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	16：買方履約名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號，得為' 9999999' 以查所有期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為' 8888888' 以查詢所有股票選擇權實物交割商品部位資料 得為' 7777777' 以查詢所有股票選擇權現金結算商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為' 9' 查詢所有商品資料，期貨為空白，買權為' C'，賣權為' P'
	交割月份	X(6)	得為' 999999' 以查詢所有商品資料
	履約價格	X(5)	得為' 99999' 以查詢所有商品資料，期貨商品輸入空白
	查詢種類	9(1)	1：查詢履約明細資料 2：查詢履約彙總資料

格式說明：

- 商品代號可輸入" TX0" 查台指選擇權，或股票選擇權代號，或" 8888888" 查所有之股票選擇權實物交割資料，或" 7777777" 查所有之股票選擇權現金結算資料。
- 查詢種類為' 1' 時回覆 01 買方履約名冊明細資料群組，為' 2' 時回覆 02

買方履約名冊彙總資料群組

4.2.4.32. 訊息代號：D32

訊息名稱：買方履約名冊查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	16：買方履約名冊查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	5：指數選擇權履約調整截止 6：股票選擇權履約調整截止	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：買方履約名冊明細資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		履約口數	9(5)	
		證券商代號	X(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	交易人集保帳號	X(7)	
	實際撥轉張數	9(5)	
	資料群組代號	9(2)	02：買方履約名冊彙總資料
02 資料 群組 內容	期貨商代號	X(7)	
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	
	履約口數	9(5)	
	實際撥轉張數	9(5)	

格式說明：

1. 證券商代號 + 交易人集保帳號為股票選擇權買權應收券之集保帳號。
2. 「實際撥轉張數」每張股票代表 1000 股。
3. 結帳記號若為台指選擇權則以 0 表示台指選擇權履約調整未截止，5 表示台指選擇權履約調整已截止；若為股票選擇權則以 0 表示股票選擇權履約調整未截止，6 表示股票選擇權履約調整已截止。
4. 因應「短天期台指選擇權」上市，為避免本日及次日皆遇商品到期，原提供兩日名冊資料之查詢方式恐造成資料混淆，故本交易改為只提供當日名冊查詢。

4.2.4.33. 訊息代號：D33

訊息名稱：買方履約名冊登錄通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	17：買方履約名冊登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為'C'，賣權為'P'
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	期貨商品輸入空白
	履約口數	9(5)	
	證券商代號	X(7)	交易人欲匯入交割標的證券之集保帳號
	交易人集保帳號	X(7)	

格式說明：

1. 此交易可辦理台指及股票選擇權履約名冊登錄台指選擇權需登錄價內之契

約，且需登錄全數可履約之契約口數股票選擇權不限登錄價內之契約，且可登錄部分可履約之契約口數

2. 欲更正已登錄之履約名冊內容，需先執行「履約名冊刪除」，刪除此筆記錄後，再重新辦理履約名冊登錄。

4.2.4.34. 訊息代號：D34

訊息名稱：買方履約名冊登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	17：買方履約名冊登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

4.2.4.35. 訊息代號：D35

訊息名稱：買方履約名冊刪除通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	18：買方履約名冊刪除
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲刪除資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲刪除資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為刪除資料之交易人帳號
	商品代號	X(7)	須輸入單一商品代號
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為'C'，賣權為'P'
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	期貨商品輸入空白
	證券商代號	X(7)	
	交易人集保帳號	X(7)	
履約口數	9(5)		

4.2.4.36. 訊息代號：D36

訊息名稱：買方履約名冊刪除回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	18：買方履約名冊刪除
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

4.2.4.37. 訊息代號：D37

訊息名稱：賣方指派名冊查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	19：賣方指派名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為' 8888888' 以查詢所有股票選擇權實物交割商品部位資料 得為' 7777777' 以查詢所有股票選擇權現金結算商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為' 9' 以查詢所有買賣權別資料，期貨為空白，買權為'C'，賣權為'P'
	交割月份	X(6)	得為' 999999' 以查詢所有交割月份資料
	履約價格	X(5)	得為' 99999' 以查詢所有履約價格資料，期貨商品輸入空白
	查詢種類	9(1)	1：查詢指派明細資料 2：查詢指派彙總資料

格式說明：

1. 查詢種類為' 1' 時回覆 01 買方指派名冊明細資料群組，為' 2' 時回覆 02

買方指派名冊彙總資料群組

4.2.4.38. 訊息代號：D38

訊息名稱：賣方指派名冊查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	19：賣方指派名冊查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	5：指數選擇權履約調整已截止 6：股票選擇權履約調整已截止	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：賣方指派名冊明細資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		指派口數	9(5)	
		未被指派口數	9(5)	

欄位		屬性	欄位說明
	證券商代號	X(7)	交易人欲匯入交割標的證券之集保帳號
	交易人集保帳號	X(7)	
	實際撥轉張數	9(5)	
	資料群組代號	9(2)	02：賣方指派名冊彙總資料
	期貨商代號	X(7)	
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	
	指派口數	9(5)	
	未被指派口數	9(5)	
	實際撥轉張數	9(5)	

格式說明：

1. 「實際撥轉張數」每張股票代表 1000 股。
2. 結帳記號若為台指選擇權則以 0 表示台指選擇權履約調整未截止，5 表示台指選擇權履約調整已截止；若為股票選擇權則以 0 表示股票選擇權履約調整未截止，6 表示股票選擇權履約調整已截止。
3. 因應「短天期台指選擇權」上市，為避免本日及次日皆遇商品到期，原提供兩日名冊資料之查詢方式恐造成資料混淆，故本交易改為只提供當日名冊查詢。

4.2.4.39. 訊息代號：D39

訊息名稱：債券商品交割名冊查詢

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	20：債券商品交割名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號，' 9999999' 可查詢所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	為欲查詢之債券期貨商品代號，' 9999999' 可查詢所有商品資料
	查詢類別	X(1)	B：債券商品買方交割名冊 S：債券商品賣方交割名冊

內容說明：

1. 本交易之'期貨商代號'若輸入'9999999'，或'商品代號'輸入'9999999'，則限查詢300筆，若輸入單一期貨商及單一商品代號則不限查詢筆數。

4.2.4.40. 訊息代號：D40

訊息名稱：債券商品交割名冊查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	20：債券商品交割名冊查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：表示應收付交割名冊內容(參考用) 1：表示實收付交割名冊內容	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：債券商品交割名冊明細資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		買賣別	X(1)	'B' 表示買方，'S' 表示賣方
		交割口數	9(5)	需辦理債券交割之口數
		應現金交割口數	9(5)	交割口數中按申報口數計算後，應以現金辦理交割之口數
		實現金交割口數	9(5)	交割口數中按實券口數計算後，實際以現金辦理交割之口數

欄位		屬性	欄位說明
	交割銀行代號	X(7)	為買方交易人存放應收實物公債之帳號
	交割公債帳戶	X(21)	

內容說明：

- 1.本交割名冊可於 T+1 日辦理查詢，唯‘應現金交割口數’，‘實現金交割口數’等各欄內容將配合期交所 T+2 日交割作業流程才產生相關資料。
- 2.T+2 日結帳記號為‘0’時，產生‘應現金交割口數’；結帳記號為‘1’時，產生‘實現金交割口數’。

4.2.4.41. 訊息代號：D41

訊息名稱：賣方交割債券明細申報通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	21：賣方交割債券明細申報
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	登錄資料之交易人帳號
	公債代號	X(7)	登錄資料之公債代號
	申報張數	9(5)	登錄公債申報張數
	公債銀行代號	X(7)	登錄交易人欲匯出交割公債銀行代號
	公債銀行帳號	X(21)	登錄交易人欲匯出交割公債銀行帳號

格式說明：

1. 此交易可辦理賣方交割債券明細申報登錄。
2. 賣方交割債券明細申報登錄，可登錄不同交割公債實物。
3. 修改已登錄交割公債申報張數，將依輸入之登錄公債申報張數更正原申報張數。

4.2.4.42. 訊息代號：D42

訊息名稱：賣方交割債券明細申報回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	21：賣方交割債券明細申報
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

4.2.4.43. 訊息代號：D43

訊息名稱：買賣方交割債券明細查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	22：買賣方交割債券明細查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號，得為 '9999999' 以查詢所有期貨商資料
	債券代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢所有債券資料
	查詢類別	X(1)	" B"：買方交割債券明細資料 " S"：賣方交割債券明細資料

格式說明：

1. 本交易之'期貨商代號'若輸入'9999999'，或'公債代號'輸入'9999999'，則限查詢300筆，若輸入單一期貨商及單一公債代號則不限查詢筆數。

4.2.4.44. 訊息代號：D44

訊息名稱：買賣方交割債券明細查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	22：買賣方交割債券明細查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：產生應收(付)交割債券明細 1：產生實收(付)交割債券明細	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：買賣方交割債券明細查詢	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	“B”表買方，“S”表賣方
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		公債代號	X(7)	
		買賣方	X(1)	
		銀行代號	X(7)	
		銀行帳號	X(21)	
		申報口數	9(5)	
		實物口數	9(5)	

格式說明：

1. 依結帳記號內容，顯示不同時段之交割明細資料，結帳記號為” 0” 時，表尚未辦理最後分配作業，故本項查詢僅提供試行指派之資料，即” 申報口數” 。” 申報口數” 內容，賣方係依自行申報之口數，買方則依賣方申報口數辦理指派後之口數。” 實物口數” 欄位於買賣方皆為零。結帳記號為” 1” 時，” 實物口數” 為買賣方實物交割之口數。

4.2.4.45. 訊息代號：D45

訊息名稱：交易人標的債券匯入明細查詢通知

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	23：交易人標的債券匯入明細查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	公債代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有公債匯入資料

內容說明：

1. 本交易提供結算會員查詢其交易人匯入期交所交割專戶之債券商品明細資料。
2. 本交易之' 公債代號' 輸入' 9999999' 時，限查詢 300 筆，若輸入單一公債代號則不限查詢筆數。

4.2.4.46. 訊息代號：D46

訊息名稱：交易人標的債券匯入明細查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	23：交易人標的債券匯入明細查詢	
	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)	結算會員代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	開放債券查詢記號	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人標的債券匯入明細資料	
	01 資料 群組 內容	序號	9(8)	為多筆之應用資料內容
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		銀行代號	X(7)	
		交易人銀行帳號	X(21)	
		債券代號	X(7)	
		匯入面額	9(13)	
		匯撥日期	X(8)	

欄位		屬性	欄位說明
	匯撥時間	X(6)	
	匯撥交易序號	X(13)	

4.2.4.47. 訊息代號：D47

訊息名稱：交割價款明細查詢

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	24：交割價款明細查詢
	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'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)	

4.2.4.48. 訊息代號：D48

訊息名稱：交割價款明細查詢回覆

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	24：交割價款明細查詢
	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' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：產生應收(付)交割價款 1：產生實收(付)交割價款
	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：交割價款明細資料
	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
	期貨實物交割應收款項	9(12)	
	期貨實物交割應付款項	9(12)	
	期貨實物不足現金結算應收款項	9(12)	
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12)	
	期貨實物交割實收款項	9(12)	
	期貨實物交割實付款項	9(12)	
	期貨實物不足現金結算實收款項	9(12)	
	期貨實物不足現金結算實付款項	9(12)	

格式說明：

1. 本交易提供期貨商 T+2 日查詢公債期貨交割價款相關資料，結帳記號為' 0' 時，顯示應收付相關交割價款資料；結帳記號為' 1' 時，增加顯示實收付相關交割價款資料。

4.2.4.49. 訊息代號：D49

訊息名稱：交易人標的證券匯入明細查詢通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	25：交易人標的證券匯入明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	證券代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有證券匯入資料
	專戶類別	X(1)	"1" -交割專戶 "2" -抵繳專戶

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. 專戶類別為" 1" 時：表示查詢交割專戶當日匯入明細；
專戶類別為" 2" 時：表示查詢抵繳專戶昨日匯入明細

4.2.4.50. 訊息代號：D50

訊息名稱：交易人標的證券匯入明細查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	25：交易人標的證券匯入明細查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人標的證券匯入明細資料	
	01 資料 群組 內容	序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		匯入股數	9(8)	
		匯撥時間	9(6)	交易人標的證券昨日匯入抵繳專戶之時間。

欄位		屬性	欄位說明
	匯撥交易序號	X(13)	
	匯撥日期	9(8)	交易人標的證券匯入之日期。
	專戶類別	X(1)	“1” - 交割專戶 “2” - 抵繳專戶

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D49 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人標的證券匯入明細)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.51. 訊息代號：D51

訊息名稱：交易人標的證券餘額查詢通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	26：交易人標的證券餘額查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員代號或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間起號
	交易人帳號訖號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間訖號
	證券代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有證券匯入資料
	專戶類別	X(1)	"1" -交割專戶 "2" -抵繳專戶

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。

4.2.4.52. 訊息代號：D52

訊息名稱：交易人標的證券餘額查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	26：交易人標的證券餘額查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	目地單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)		
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人標的證券交割專戶餘額資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		昨日餘額	9(8)	
		申請匯入股數	9(8)	交易人當日申請匯入交割專戶之股數
		存券轉入股數	9(8)	賣權買方及買權賣方自交易人集保帳戶轉入之存券股數
		調整轉入股數	9(8)	
		買方交割轉入股數	9(8)	買權買方交割應收之股數

欄位		屬性	欄位說明
02 資料 群組 內容	賣方交割轉入股數	9(8)	賣權賣方交割應收之股數
	買方交割轉出股數	9(8)	賣權買方交割應付之股數
	賣方交割轉出股數	9(8)	買權賣方交割應付之股數
	交割存券匯出股數	9(8)	因交割匯出至交易人集保帳號之股數
	調整轉出股數	9(8)	因存券匯出申請匯出至交易人集保帳號之股數
	買權賣方抵繳交割轉入股數	9(8)	買權賣方抵繳專戶交割應付之股數
	賣權買方抵繳交割轉入股數	9(8)	賣權買方抵繳專戶交割應付之股數
	資料群組代號	9(2)	02：交易人標的證券抵繳專戶餘額資料
	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	
	證券代號	X(7)	
	昨日餘額	9(8)	不含交易人昨日申請匯入期交所抵繳專戶之股數
	昨日申請匯入股數	9(8)	交易人昨日申請匯入期交所抵繳專戶之股數
本日申請匯出股數	9(8)	交易人本日申請匯出期交所抵繳專戶之股數(含減資合併之契約調整返還股數)	
異常匯入調整轉入股數	9(8)	本日申請將異常匯入而調整轉入交易人存券帳之股數	
異常匯出調整轉入股數	9(8)	本日申請將異常匯出而調整轉入交易人存券帳之股數	
買權賣方交割轉出股數	9(8)	買權賣方交割應付之股數	
賣權買方交割轉出股數	9(8)	賣權買方交割應付之股數	
賣權買方申請交割扣減之股數	9(8)		
抵繳股數	9(8)	充抵買權賣方部位之抵繳股數	

欄位		屬性	欄位說明
	抵繳保證金	9(12)	
	剩餘股數	9(12)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D51 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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(01 或 02)內容。
4. 期貨商(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：交易人標的證券交割專戶餘額；02：交易人標的證券抵繳專戶餘額)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 專戶類別為 “1” — 交割專戶 時：
 - A. 結帳記號：“0” — 期交所交割專戶未結帳
“7” — 期交所交割專戶已結帳
 - B. 交易人存券餘額 = 昨日餘額 + 申請匯入股數 + 存券轉入股數 + 調整轉入股數 + 買方交割轉入股數 + 賣方交割轉入股數 - 買方交割轉出股數 - 賣方交割轉出股數 - 交割存券匯出股數 - 調整轉出股數 + 買權賣方抵繳交割轉入股數 + 賣權買方抵繳交割轉入股數
 - C. 買權賣方抵繳交割轉入股數：到期交割時，買權賣方抵繳專戶交割應付之股數
 - D. 賣權買方抵繳交割轉入股數：到期交割時，賣權買方抵繳專戶交割應付之

股數

7. 專戶類別為 “2” — 抵繳專戶時：

A. 結帳記號：“0” — 部位未結帳

“1” — 部位已結帳

B. 交易人存券餘額 = 昨日餘額 + 昨日申請匯入股數 - 本日申請匯出
股數 + 異常匯入調整轉入股數 + 異常匯出調整轉入股數 - 買權賣
方交割轉出股數 - 賣權買方交割轉出股數

C. 抵繳保證金 = 充抵買權賣方部位之應收保證金 * 充抵買權賣方部位
口數

D. 剩餘股數：指計算充抵買權賣方部位保證金時，當時交易人存券餘額扣除
抵繳股數後之餘額

4.2.4.53. 訊息代號：D53

訊息名稱：匯入異常資料查詢通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	27：匯入異常資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	專戶類別	X(1)	“1” -交割專戶 “2” -抵繳專戶

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。

4.2.4.54. 訊息代號：D54

訊息名稱：匯入異常資料查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	27：匯入異常資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：匯入異常資料	
	01 資料 群組 內容	異常日期	9(8)	格式為 YYYYMMDD
		序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券身分證字號	X(10)	
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	匯入股數	9(8)	
	匯撥時間	9(6)	
	匯撥交易序號	X(13)	
	異常原因	X(1)	1：證券期貨身分證字號或營利事業編號不符 2：交易人期貨帳戶不存在
	調整註記	X(1)	空白：尚未調整 1：調整入交易人存券帳 2：調整券返還原匯入證券帳號，交易成功 3：調整券返還原匯入證券帳號，交易待處理中 4：調整券返還原匯入證券帳號，交易失敗
	調整日期	X(8)	YYYYMMDD
	專戶類別	X(1)	“1” -交割專戶 “2” -抵繳專戶

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D53 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：匯入異常資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.55. 訊息代號：D55

訊息名稱：存券匯出申請通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	28：存券匯出申請
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲申請之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲申請之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為申請之交易人帳號
	證券代號	X(7)	須輸入單一證券代號
	股數	9(8)	可為原輸入股數之負值以沖正該筆申請資料
	證券商代號	X(7)	存券欲匯入之交易人集保帳號
	交易人集保帳號	X(7)	
	專戶類別	X(1)	"1" -交割專戶 "2" -抵繳專戶

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。

4.2.4.56. 訊息代號：D56

訊息名稱：存券匯出申請回覆(coveredcall)

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	28：存券匯出申請
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D55 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.57. 訊息代號：D57

訊息名稱：存券匯出申請查詢通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	29：存券匯出申請查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	專戶類別	X(1)	"1" -交割專戶 "2" -抵繳專戶

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。

4.2.4.58. 訊息代號：D58

訊息名稱：存券匯出申請查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	29：存券匯出申請查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：匯出申請未截止 8：匯出申請已截止	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：存券匯出申請資料	
	01 資料 群組 內容	序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		股數	9(8)	
		有效記號	X(1)	Y：有效，N：無效，R：減資合併之契約 調整返還資料，h：處分申請匯出資料
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	專戶類別	X(1)	“1” -交割專戶 “2” -抵繳專戶

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D57 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：存券匯出申請資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.59. 訊息代號：D59

訊息名稱：匯出異常資料查詢通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	30：匯出異常資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	專戶類別	X(1)	"1" -交割專戶 "2" -抵繳專戶

格式說明：

- 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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.4.60. 訊息代號：D60

訊息名稱：匯出異常資料查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	30：匯出異常資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：匯出異常資料	
	01 資料 群組 內容	異常日期	9(8)	YYYYMMDD
		序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券身分證字號	X(10)	
		證券商代號	X(7)	
		交易人集保帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	匯撥股數	9(8)	
	異常原因	X(1)	1：證券期貨身分證字號或營利事業編號不符 2：交易人證券帳戶不存在
	調整證券商代號	X(7)	調整為匯入此交易人集保帳號
	調整交易人集保帳號	X(7)	
	調整狀態	X(1)	空白：尚未調整 1：調整入交易人存券帳 2：調整券轉出至指定集保帳號，交易成功 3：調整券轉出至指定集保帳號，交易待處理中 4：調整券轉出至指定集保帳號，交易失敗
	專戶類別	X(1)	“1” -交割專戶 “2” -抵繳專戶

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D59 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：匯出異常資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.4.61. 訊息代號：D61

訊息名稱：匯出異常集保帳號調整通知(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	31：匯出異常集保帳號調整
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	異常日期	9(8)	
	序號	9(8)	
	結算會員代號	X(7)	調整資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	調整資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	調整資料之交易人帳號
	調整證券商代號	X(7)	
	調整交易人集保帳號	X(7)	
	專戶類別	X(1)	“1”-交割專戶 “2”-抵繳專戶 “4”-期貨轉現貨

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. 專戶類別為 “1” - 交割專戶及 “4” - 期貨轉現貨時：

A. 必須輸入調整證券商代號及調整交易人集保帳號，即表示調整券轉出至指定集保帳號。

4. 專戶類別為 “2” — 抵繳專戶 時：

A. 若輸入調整證券商代號為” 0000000” 及調整交易人集保帳號為” 0000000” ，即表示調整返還入交易人存券帳，否則輸入其他之調整證券商代號及調整交易人集保帳號，即表示調整券轉出至指定集保帳號。

4.2.4.62. 訊息代號：D62

訊息名稱：匯出異常集保帳號調整回覆(coveredcall)

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	31：匯出異常集保帳號調整
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D61 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.63. 訊息代號：D63

訊息名稱：賣權買方申請交割扣減股數之登錄(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	32：賣權買方申請交割扣減股數之登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	證券代號	X(7)	
	申請交割可扣減之股數	9(8)	賣權買方交易人申請由抵繳專戶交割可扣減之股數，但不可超過交易人抵繳專戶存券餘額

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. 此交易可辦理賣權買方由抵繳專戶申請交割扣減股數之登錄
4. 若欲更正已登錄之申請交割可扣減股數，則可再重新輸入欲申請交割扣減之股數。

4.2.4.64. 訊息代號：D64

訊息名稱：賣權買方申請交割扣減股數之登錄回覆(coveredcall)

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	32：賣權買方申請交割扣減股數之登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 D63 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.4.65. 訊息代號：D65

訊息名稱：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	33：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號，得為 '9999999' 以查詢所有交易人之資料
	商品代號	X(7)	如為 '9999999' 查詢所有股票選擇權部位資料，餘者均須輸入商品代號
	買賣權別	X(1)	'買權' (即為 'C')
	交割月份	X(6)	輸入交割月份，如為 '999999' 查詢所有月份部位資料
	履約價格	X(5)	輸入履約價格，如為 '99999' 查詢所有履約價格資料

格式說明：

- 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料。
4. 履約價格需為 5 位文數字內容，若履約價格不足 5 位數字應於前補零，
如' 07800' 。

4.2.4.66. 訊息代號：D66

訊息名稱：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	33：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		本日賣出部位餘額	9(5)	指單一部位餘額(不含組合部位)
		抵繳股數	9(8)	

欄位		屬性	欄位說明
	抵繳保證金	9(12)	
	交易人身分碼	X(1)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D65 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。
7. 抵繳股數：抵繳專戶中充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股數
8. 抵繳保證金：抵繳專戶中充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股數，依充抵到之買權賣方部位所應收保證金換算為抵繳保證金
【公式：充抵買權賣方部位之抵繳保證金 = 每一商品部位口數之應收保證金 * 充抵買權賣方部位口數】

4.2.4.67. 訊息代號：D67

訊息名稱：撥轉名冊結果查詢(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	34：撥轉名冊結果查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號，' 9999999' 表查詢所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	' 9999999' 表查詢所有商品資料
	買賣權別	X(1)	' 9' 表查詢所有買賣權別資料
	交割月份	X(6)	' 999999' 表查詢所有月份資料
	履約價格	X(5)	' 99999' 表查詢所有履約價格資料

	撥轉類別	X(1)	1：賣權履約扣帳撥轉(交割專戶) 2：買權指派扣帳撥轉(交割專戶) 3：賣權指派入帳撥轉(交割專戶) 4：買權履約入帳撥轉(交割專戶) 5：匯入異常撥轉(交割專戶) 6：存券匯出申請(交割專戶) 7：匯出異常撥轉(交割專戶) C：買權賣方交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) D：賣權買方申請由抵繳專戶交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) E：申請由抵繳專戶匯出存券(抵繳專戶) H：處分 9：全部資料
--	------	------	--

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。

4.2.4.68. 訊息代號：D68

訊息名稱：撥轉名冊明細查詢回覆(coveredcall)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	34：撥轉名冊明細查詢
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：撥轉名冊明細資料
	01 資料群組內容 撥轉類別	X(1)	1：賣權履約扣帳撥轉 2：買權指派扣帳撥轉 3：賣權指派入帳撥轉 4：買權履約入帳撥轉 5：匯入異常撥轉(交割專戶) 6：存券匯出申請(交割專戶) 7：匯出異常撥轉(交割專戶) C：買權賣方交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) D：賣權買方交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) E：申請由抵繳專戶匯出存券(抵繳專戶) F：匯入異常撥轉 G：匯出異常撥轉 H：處分
	結算會代號	X(7)	

欄位	屬性	欄位說明
期貨商代號	X(7)	
交易人交易帳號	X(7)	
商品代號	X(7)	
買賣權別	X(1)	
交割月份	X(6)	
履約價格	X(5)	
交易人證券商代號	X(7)	
交易人集保帳號	X(7)	
序號	9(8)	
證券代號	X(7)	
撥轉股數	9(8)	
可扣存券股數(交割專戶)	9(8)	
應撥轉股數	9(8)	
實際撥轉股數	9(8)	
異常原因	X(1)	1,3:帳號 id 不符 2,4:交易人帳號錯誤 5:證券餘額不足 6:因券商調整餘額不足 9:其他錯誤'
可扣存券股數(抵繳專戶)	9(8)	

訊息說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D67 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：撥轉名冊明細資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 可扣存券股數(抵繳專戶) = 抵繳專戶中買權賣方或賣權買方可扣減之交割股數
7. 應撥轉股數 = 撥轉股數 - 可扣存券股數(交割專戶) - 可扣存券股數(抵繳專戶)

4.2.4.69. 訊息代號：D69

訊息名稱：撥轉名冊結果查詢(抵繳)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	35：撥轉名冊結果查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號，' 9999999' 表查詢所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	' 9999999' 表查詢所有商品資料
	買賣權別	X(1)	' 9' 表查詢所有買賣權別資料
	交割月份	X(6)	' 999999' 表查詢所有月份資料
	履約價格	X(5)	' 99999' 表查詢所有履約價格資料

	撥轉類別	X(1)	1：賣權履約扣帳撥轉(交割專戶) 2：買權指派扣帳撥轉(交割專戶) 3：賣權指派入帳撥轉(交割專戶) 4：買權履約入帳撥轉(交割專戶) 5：交割專戶匯入異常撥轉 6：交割專戶存券匯出申請 7：交割專戶匯出異常撥轉 C：買權賣方由 CoveredCall 專戶交割轉出至交割專戶 D：賣權買方由 CoveredCall 專戶交割轉出至交割專戶 E：CoveredCall 專戶存券匯出申請 H：CoveredCall 專戶處分 I：買權賣方由抵繳專戶交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) J：賣權買方由抵繳專戶交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) 9：全部資料
--	------	------	--

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。

4.2.4.70. 訊息代號：D70

訊息名稱：撥轉名冊明細查詢回覆(抵繳)

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	35：撥轉名冊明細查詢
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	
	結算會員代號	X(4)	為查詢資料之期貨商所對應之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：撥轉名冊明細資料
	01 資料群組內容 撥轉類別	X(1)	1：賣權履約扣帳撥轉 2：買權指派扣帳撥轉 3：賣權指派入帳撥轉 4：買權履約入帳撥轉 5：交割專戶匯入異常撥轉 6：交割專戶存券匯出申請 7：交割專戶匯出異常撥轉 C：買權賣方由 CoveredCall 專戶交割轉出至交割專戶 D：賣權買方由 CoveredCall 專戶交割轉出至交割專戶 E：CoveredCall 專戶存券匯出申請 H：CoveredCall 專戶處分 I：買權賣方由抵繳專戶交割轉出至交割專戶(抵繳專戶) J：賣權買方由抵繳專戶交割轉出至交割專戶(抵繳專戶)

欄位	屬性	欄位說明
結算會代號	X(7)	
期貨商代號	X(7)	
交易人交易帳號	X(7)	
商品代號	X(7)	
買賣權別	X(1)	
交割月份	X(6)	
履約價格	X(5)	
交易人證券商代號	X(7)	
交易人集保帳號	X(7)	
序號	9(8)	
證券代號	X(7)	
撥轉股數	9(8)	
交割專戶扣減存券股數	9(8)	
應撥轉股數	9(8)	
實際撥轉股數	9(8)	
異常原因	X(1)	1, 3：帳號 id 不符 2, 4：交易人帳號錯誤 5：證券餘額不足 6：因券商調整餘額不足 9：其他錯誤
CoveredCall 專戶扣減存券股數	9(8)	
抵繳專戶扣減存券股數	9(8)	

訊息說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 D69

訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

3. 期貨商(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. 期貨商(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：撥轉名冊明細資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 抵繳專戶扣減存券股數 = 抵繳專戶中買權賣方及賣權買方扣減之交割股數
7. 應撥轉股數 = 撥轉股數 - 交割專戶扣減存券股數 - CoveredCall 專戶扣減存券股數 - 抵繳專戶扣減存券股數

4.2.4.71. 訊息代號：D71

訊息名稱：交易人期貨轉現貨申請登錄

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	36：交易人期貨轉現貨申請登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為'C'，賣權為'P'
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	期貨商品輸入空白
	買賣方	X(1)	期貨/選擇權未平倉餘額之買賣方 "B"表買方，"S"表賣方
	申請口數	9(5)	多次登錄同一商品序列，以最後一筆資料認列(取消申請可輸入0)
	證券商代號	X(7)	現貨買方(期貨/買權買方、賣權賣方) 交易人證券之集保帳號
交易人集保帳號	X(7)	現貨賣方(期貨/買權賣方、賣權買方) 交易人輸入空白	

4.2.4.72. 訊息代號：D72

訊息名稱：交易人期貨轉現貨申請登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	36：交易人期貨轉現貨申請登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

格式說明：

1. 若交易人為綜合帳戶，或有委任期貨商擔任代理人之外資(不能實物交割)，回覆錯誤代號「26036 戶別錯誤，無法處理」。

4.2.4.73. 訊息代號：D73

訊息名稱：期貨轉現貨名冊查詢

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)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	37：期貨轉現貨名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為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
	現貨買賣方	X(1)	'B'：查詢現貨買方(期貨/買權買方、賣權賣方) 'S'：查詢現貨賣方(期貨/買權賣方、賣權買方) 'A'：查詢全部
	申請結果別	X(1)	'S'：查詢申請成功口數>0之資料 'F'：查詢申請失敗口數>0之資料 'A'：查詢全部

4.2.4.74. 訊息代號：D74

訊息名稱：期貨轉現貨名冊查詢回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	4：到期履約及實物交割作業	
	作業項目	9(2)	37：期貨轉現貨名冊查詢	
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號	
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0:未截止 1:申請截止(T日 17:45) 2:已產生申請成功/無效名冊(T日 17:45 後) 3:指派截止(T+1 日)	
	結算會員代號	X(4)		
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：期貨轉現貨名冊查詢回覆	
	01 資料 群組 內容	期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		買賣方	X(1)	期貨/選擇權未平倉餘額之買賣方 “B”表買方，“S”表賣方

欄位		屬性	欄位說明
	申請口數	9(5)	T 日申請口數
	申請成功口數	9(5)	T 日確認申請成功口數 (結帳記號為 1 時產生)
	申請無效口數	9(5)	T 日確認申請無效口數 (結帳記號為 1 時產生)
	預付現貨價款	9(12) v99	現貨買方依申請成功口數計算之預付現貨價款 現貨賣方為 0 (結帳記號為 1 時產生)
	指派口數	9(5)	T+1 日(結帳記號為 2 時)產生
	未受指派口數	9(5)	T+1 日(結帳記號為 2 時)產生
	到期轉現貨應付價款	9(12) v99	T+1 日(結帳記號為 2 時)產生 現貨買方應付價款 現貨賣方為 0
	到期轉現貨應收價款	9(12) v99	T+1 日(結帳記號為 2 時)產生 現貨賣方應收價款 現貨買方為 0
	撥轉序號	9(8)	可於 0805 交易查詢撥轉結果
	證券商代號	X(7)	現貨買方交易人:透過[MTS 0436 交易人期貨轉現貨申請登錄]登錄之證券集保
	交易人集保帳號	X(7)	帳號 現貨賣方交易人:空白

4.2.5. 部位管理作業

4.2.5.1. 訊息代號：E01

訊息名稱：交易人部位資料查詢通知

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)	01：交易人部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號，得為 '9999999' 以查詢所有交易人之資料
	商品代號	X(7)	如查詢單一交易人之部位資料，得為 '9999999' 查詢所有商品部位資料，餘者均須輸入商品代號
	買賣權別	X(1)	如查詢單一交易人部位資料，得為 '9' 查詢所有部位資料，餘額應輸入值，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	如查詢單一交易人之部位資料，得為 '999999' 查詢所有月份部位資料，餘者均須輸入交割月份
履約價格	X(5)	如查詢單一交易人之部位資料，得為 '99999' 查詢所有履約價格資料，餘者均須輸入履約價格，期貨商品輸入空白	

格式說明：(長度 62)

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號, 且總公司可查詢其分公司交易人之資料。
4. 履約價格需為 5 位文數字內容, 若履約價格不足 5 位數字應於前補零, 如 '07800' 。

4.2.5.2. 訊息代號：E02

訊息名稱：交易人部位資料查詢回覆

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)	01：交易人部位資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：交易人部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		前日買進部位餘額	9(5)	
		前日賣出部位餘額	9(5)	

欄位		屬性	欄位說明
	買進部位口數	9(5)	
	賣出部位口數	9(5)	
	撥入買進部位口數	9(5)	
	撥入賣出部位口數	9(5)	
	撥出/到期買進部位口數	9(5)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(5)	
	了結部位口數	9(5)	
	本日買進部位餘額	9(5)	
	本日賣出部位餘額	9(5)	
	本日買進組合部位餘額	9(5)	
	本日賣出組合部位餘額	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 E01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + Eurex 轉入買進部位口數 +

買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數

註:「Eurex 轉入買進部位口數」請查詢「0515 交易人部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)」交易

7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + Eurex 轉入賣出部位口數 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數

註:「Eurex 轉入賣出部位口數」請查詢「0515 交易人部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)」交易

8. 本日買進(賣出)組合部位餘額為該商品已形成組合部位之資料,若欲查詢各組合部位餘額,請執行「交易人組合部位資料查詢」(0111)交易。

9. 匯率商品於 T 日到期,於最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

10. T 日到期商品(匯率商品除外),不論盤別將於第一盤部位結帳記號後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

11. T+1 日到期商品則依其最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.5.3. 訊息代號：E03

訊息名稱：期貨商部位資料查詢通知

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)	02：期貨商部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢結算會員所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P' 得為 '9' 以查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有商品部位資料，查詢期貨商品時輸入空白

格式說明：

- 期貨商(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設定(Flag)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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.5.4. 訊息代號：E04

訊息名稱：期貨商部位資料查詢回覆

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)	02：期貨商部位資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：期貨商部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		前日買進部位餘額	9(7)	
		前日賣出部位餘額	9(7)	
		買進部位口數	9(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	賣出部位口數	9(7)	
	撥入買進部位口數	9(7)	
	撥入賣出部位口數	9(7)	
	撥出/到期買進部位口數	9(7)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(7)	
	了結部位口數	9(7)	
	本日買進部位餘額	9(7)	
	本日賣出部位餘額	9(7)	
	本日買進組合部位餘額	9(7)	
	本日賣出組合部位餘額	9(7)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)要求所回覆正常資料格式。
2. 期貨商(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 E03 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：期貨商部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式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. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + Eurex 轉入買進部位口數 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部

位口數

註：「Eurex 轉入買進部位口數」請查詢「0516 期貨商部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)」交易

7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + Eurex 轉入賣出部位口數 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數

註：「Eurex 轉入賣出部位口數」請查詢「0516 期貨商部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)」交易

8. 本日買進(賣出)組合部位餘額為該商品已形成組合部位之資料,若欲查詢各組合部位餘額,請執行「期貨商組合部位資料查詢」(0112)交易。

9. 匯率商品於 T 日到期,於最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

10. T 日到期商品(匯率商品除外),不論盤別將於第一盤部位結帳記號後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

11. T+1 日到期商品則依其最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.5.5. 訊息代號：E05

訊息名稱：結算會員部位資料查詢通知

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)	03：結算會員部位資料查詢
	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‘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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	商品代號	X(7)	得為‘9999999’以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為‘C’，賣權為‘P’得為‘9’以查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	得為‘9999999’以查詢所有商品部位資料
	履約價格	X(5)	得為‘99999’以查詢所有選擇權商品部位資料，查詢期貨商品時輸入空白

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。

4.2.5.6. 訊息代號：E06

訊息名稱：結算會員部位資料查詢回覆

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)	03：結算會員部位資料查詢	
	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：結算會員部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		前日買進部位餘額	9(7)	
		前日賣出部位餘額	9(7)	
		買進部位口數	9(7)	
		賣出部位口數	9(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	撥入買進部位口數	9(7)	
	撥入賣出部位口數	9(7)	
	撥出/到期買進部位口數	9(7)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(7)	
	了結部位口數	9(7)	
	本日買進部位餘額	9(7)	
	本日賣出部位餘額	9(7)	
	本日買進組合部位餘額	9(7)	
	本日賣出組合部位餘額	9(7)	

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 E05 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：結算會員部位資料)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 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(1 表有資料，0 表資料結束)。
6. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + Eurex 轉入買進部位口數 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數

註：「Eurex 轉入買進部位口數」請查詢「0517 結算會員部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)」交易

7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + Eurex 轉入賣出部位口數 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數

註:「Eurex 轉入賣出部位口數」請查詢「0517 結算會員部位資料查詢(含 Eurex 轉入部位明細)」交易

8. 本日買進(賣出)組合部位餘額為該商品已形成組合部位之資料,若欲查詢各組合部位餘額,請執行「期貨商組合部位資料查詢」(0112)交易。

9. 匯率商品於 T 日到期,於最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

10. T 日到期商品(匯率商品除外),不論盤別將於第一盤部位結帳記號後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

11. T+1 日到期商品則依其最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.5.7. 訊息代號：E07

訊息名稱：部位調整（互抵）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)	04：部位調整（互抵）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)	期貨為空白，買權為‘C’，賣權為‘P’
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	期貨商品為空白
	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. 履約價格需為 5 位文數字內容，若履約價格不足 5 位數字應於前補零，如 '07800'。
4. 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
5. 可申請辦理部位調整之部位餘額 = 本日買進(賣出)部位餘額 - 本日買進(賣出)組合部位餘額。
6. 台指期貨與小型台指期貨互抵作業說明
 - (1)撥入結算會員代號固定使用'0002000'
 - (2)撥入期貨商代號固定使用'0000000'
 - (3)撥入交易人帳號固定使用'0000000'
 - (4)商品代號、交割月份、買賣別、調整口數均以台指期貨為代表，結算系統自動會依 1：4 原則處理相對互抵之小型台指期貨。

4.2.5.8. 訊息代號：E08

訊息名稱：部位調整（互抵）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)	04：部位調整（互抵）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	
	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	
	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 E07 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)。

4.2.5.9. 訊息代號：E09

訊息名稱：部位調整（互抵）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：查詢移出申請記錄 1：查詢移入申請記錄 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）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

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。

4.2.5.11. 訊息代號：E11

訊息名稱：組合部位調整通知

訊息類別：多筆要求訊息

訊息格式：

欄位名稱		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)	06：組合部位調整
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	商品代號 1	X(7)	為登錄資料之組合商品代號
	買賣權別 1	X(1)	期貨為空白，買權為 ' C ' ，賣權為 ' P '
	交割月份 1	X(6)	
	履約價格 1	X(5)	期貨商品輸入空白
	組合種類	X(1)	
	商品代號 2	X(7)	為登錄資料之組合商品代號
	買賣權別 2	X(1)	期貨為空白，買權為 ' C ' ，賣權為 ' P '
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	期貨商品輸入空白
	買賣別	X(1)	B：買進，S：賣出

欄位名稱	屬性	欄位說明
組合部位口數	9(5)	正值：增加組合部位，負值：減少組合部位

格式說明：

1. 期貨商(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' (單筆傳送處理 或 多筆傳送處理之尾筆) 或 '1' (多筆傳送處理，尾筆除外)，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；每次多筆傳送時，上限為十筆。
2. 每筆傳輸訊息內容均包含訊息控制區及訊息資料區；第二筆以後之訊息控制區內容均須與首筆相同。
3. 來源單位代號須為期貨商代號。
4. 組合種類內容用以表示該組合部位之類別，說明如下：
 - '/' 若為“買進”表示一賣一買之組合，為“賣出”表示一買一賣之組合，
 - ':' 若為“買進”表示兩個買的組合，為“賣出”表示兩個賣的組合，
 - '-' 若為“買進”表示一賣一買之組合，為“賣出”表示一買一賣之組合，
 - '*' 為期貨部位與選擇權賣方部位之組合。
5. 此交易功能按商品群組 1 與商品群組 2，依指定之組合種類、買賣別及組合部位口數，形成組合部位；若輸入之組合部位為負值，將反向依組合部位口數拆解成商品群組 1 及 2 之口數。
6. 造市帳與自營帳號間形成跨帳號組合部位之功能
 - (1) 造市帳(888888X)商品與自營帳商品形成組合
 1. 期貨商代號後三碼為“999”，交易人帳號為“0000001”，商品代號第 1 組屬造市者，商品代號第 2 組屬自營商
 - (2) 自營帳商品與造市帳(888888X)商品形成組合
 1. 期貨商代號後三碼為“999”，交易人帳號為“0000002”，商品代號第 1

組屬自營商，商品代號第 2 組屬造市者

(3)增設 MYYYZZZ 編碼之特殊帳號，供其他造市帳戶(非 888888X)與期貨自營商間或所有造市帳戶間跨帳號組合部位。

1. YYY 表帳號 1：可為自營帳戶後 3 碼(000)或造市者帳戶 4~6 碼(如 881, 882, 883)

2. ZZZ 表帳號 2：可為自營帳戶後 3 碼(000)或造市者帳戶 4~6 碼(如 881, 882, 883)

例：M000881 表示 0000000 自營帳戶與 888881X 造市者帳戶

M883000 表示 888883X 造市者帳戶與 0000000 自營帳戶

M888882 表示 888888X 造市者帳戶與 888882X 造市帳戶

4.2.5.12. 訊息代號：E12

訊息名稱：組合部位調整回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位名稱		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)	06：組合部位調整
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常 26XXX：處理失敗之錯誤代碼

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 E11 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 1(即表示尚有資料) or 0(即表示尾筆資料)。
5. 多筆資料處理結果之回覆訊息依序對應於 E11 之多筆要求訊息。

4.2.5.13. 訊息代號：E13

訊息名稱：組合部位調整記錄通知

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)	07：組合部位調整記錄查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢結算會員所有期貨商資料
	交易人帳號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢所有交易人資料

格式說明：

- 期貨商(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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.5.14. 訊息代號：E14

訊息名稱：組合部位調整記錄查詢回覆

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)	07：組合部位調整記錄查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：組合部位調整資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		商品代號 1	X(7)	
		買賣權別 1	X(1)	
		交割月份 1	X(6)	
		履約價格 1	X(5)	
		組合種類	X(1)	
商品代號 2	X(7)			

欄位		屬性	欄位說明
	買賣權別 2	X(1)	
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	
	買賣別	X(1)	
	組合部位口數	9(5)	
	調整日期	9(8)	
	調整時間	9(8)	
	調整編號	9(8)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 E13 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：組合部位調整資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.5.15. 訊息代號：E15

訊息名稱：了結口數調整申請通知

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)	08：了結口數調整申請
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	
	期貨商代號	X(7)	
	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)	
	履約價格	X(5)	
	了結調整口數	9(5)	輸入欲了結調整口數

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. 將依輸入之了結調整口數修改原部位記錄，例如：欲調整真正之了結口數為

10 口之申請，可再輸入 00010 辦理調整

4. 可申請調整之了結口數 = 本日買進(賣出)部位餘額 - 本日買進(賣出)組合部位餘額。

5. 造市帳與自營帳號間跨帳號了結部位之功能

(1) 造市帳(888888X)商品與自營帳商品之了結

期貨商代號後三碼為' 999'，交易人帳號為' 0000001'，按輸入商品代號辦理造市者買方部位與自營商賣方部位之了結

(2) 自營帳商品與造市帳(888888X)商品之了結

期貨商代號後三碼為' 999'，交易人帳號為' 0000002'，按輸入商品代號辦理自營商買方部位與造市者賣方部位之了結

(3) 增設 MYYYZZZ 編碼之特殊帳號，供開設其他造市帳戶之期貨自營商使用跨帳號了結部位。

1. YYY 表帳號 1：可為自營帳戶後 3 碼(000)或造市者帳戶 4-6 碼(如 881, 882, 883)

2. ZZZ 表帳號 2：可為自營帳戶後 3 碼(000)或造市者帳戶 4-6 碼(如 881, 882, 883)

例：M000881 表示 0000000 自營帳戶買方部位與 888881X 造市者帳戶賣方部位之了結

M883000 表示 888883X 造市者帳戶買方部位與 0000000 自營帳戶賣方部位之了結

M888882 表示 888888X 造市者帳戶買方部位與 888882X 造市帳戶賣方部位之了結

4.2.5.16. 訊息代號：E16

訊息名稱：了結口數調整申請回覆

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)	08：了結口數調整申請
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆資料之時間
	訊息代碼	9(5)	'00000' 為正常回覆

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E15訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

4.2.5.17. 訊息代號：E17

訊息名稱：了結口數調整申請記錄查詢通知

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)	09：了結口數調整申請記錄查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	得為 '9999999' 以查詢結算會員所有期貨商資料
	交易人代號	X(7)	欲查詢之交易人代號，'9999999' 表查詢其全部交易人資料

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。

4.2.5.18. 訊息代號：E18

訊息名稱：了結口數調整申請記錄查詢回覆

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)	09：了結口數調整申請記錄查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：了結口數調整申請記錄	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		了結調整口數	9(5)	
		申請日期	9(8)	

欄位		屬性	欄位說明
	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 E17 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)。

4.2.5.19. 訊息代號：E19

訊息名稱：平倉錯誤資料查詢通知

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)	10：平倉錯誤資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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，'9999999' 表查詢其全部結算會員資料
	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
	查詢起時	X(6)	輸入查詢資料起時(可不輸入)
	查詢訖時	X(6)	輸入查詢資料訖時(需配合起時)

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. 輸入查詢區間時，總訊息長度為 44，不輸入區間則為 32

4.2.5.20. 訊息代號：E20

訊息名稱：平倉錯誤資料查詢回覆

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)	10：平倉錯誤資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：平倉錯誤資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		成交序號	X(8)	
		交易人帳號	X(7)	
		商品代號 1	X(7)	
		買賣權別 1	X(1)	
		交割月份 1	X(6)	
		履約價格 1	X(5)	
		組合種類	X(1)	

欄位		屬性	欄位說明
	商品代號 2	X(7)	
	買賣權別 2	X(1)	
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	
	買賣別	X(1)	
	委託方式	X(1)	
	成交口數	9(5)	
	委託書編號	X(5)	
	成交時間	9(8)	
	開倉平倉碼	X(1)	
	轉新倉口數	9(5)	

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 E19 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：平倉錯誤資料)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)。

4.2.5.21. 訊息代號：E21

訊息名稱：交易人組合部位資料查詢通知

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)	11：交易人組合部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號迄號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號終迄號碼
	商品代號	X(7)	若查詢單一交易人部位資料時，得為 '9999999' 查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	若查詢單一交易人部位資料時，得為 '9' 以查詢所有交易人部位資料，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	若查詢單一交易人部位資料時，得為 '999999' 查詢所有月份部位資料
	履約價格	X(5)	若查詢單一交易人部位資料時，得為 '99999' 查詢所有履約價格資料，期貨商品輸入空白

格式說明：

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料。
4. 履約價格需為 5 位文數字內容，若履約價格不足 5 位數字應於前補零，
如' 07800' 。
5. 輸入之商品代號、買賣權別、交割月份、履約價格表示查詢所有與此商品相關
之組合部位資料，此時所輸入之內容應不得為所有商品' 999999' 。

4.2.5.22. 訊息代號：E22

訊息名稱：交易人組合部位資料查詢回覆

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)	11：交易人組合部位資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：交易人組合部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		商品代號 1	X(7)	
		買賣權別 1	X(1)	
		交割月份 1	X(6)	
		履約價格 1	X(5)	
		組合種類	X(1)	
商品代號 2	X(7)			

欄位		屬性	欄位說明
	買賣權別 2	X(1)	
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	
	買進組合部位餘額	9(5)	
	賣出組合部位餘額	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 E21 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人組合部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.5.23. 訊息代號：E23

訊息名稱：期貨商組合部位資料查詢通知

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)	12：期貨商組合部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為 '9999999' 以查詢結算會員所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P' 得為 '9' 以查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有商品部位資料，期貨商品輸入空白

格式說明：

- 期貨商(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設定(Flag)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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.5.24. 訊息代號：E24

訊息名稱：期貨商組合部位資料查詢回覆

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)	12：期貨商組合部位資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：期貨商組合部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		商品代號 1	X(7)	
		買賣權別 1	X(1)	
		交割月份 1	X(6)	
		履約價格 1	X(5)	
		組合種類	X(1)	
		商品代號 2	X(7)	
		買賣權別 2	X(1)	

欄位		屬性	欄位說明
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	
	本日買進組合部位餘額	9(7)	
	本日賣出組合部位餘額	9(7)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)要求所回覆正常資料格式。
2. 期貨商(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 E23 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：期貨商組合部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式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)。

4.2.5.25. 訊息代號：E25

訊息名稱：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢通知

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)	13：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號迄號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號終迄號碼
	商品代號	X(7)	得為 '9999999' 查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	得為 '999999' 查詢所有月份部位資料

格式說明：

- 期貨商(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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
- 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料。

4.2.5.26. 訊息代號：E26

訊息名稱：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢回覆

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)	13：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：交易人期貨多空組合部位明細資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		買進商品代號	X(7)	
		買進交割月份	X(6)	
		賣出商品代號	X(7)	
		賣出交割月份	X(6)	
		期貨多空組合部位	9(5)	
		期貨多空減收之結算保證金	9(13)	

欄位		屬性	欄位說明
	期貨多空組合減收幣別	X(1)	
	交易人身分碼	X(1)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 E25 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人期貨多空組合部位明細資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.5.27. 訊息代號：E27

訊息名稱：現金股利買賣方名冊資料查詢通知

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)	14：現金股利買賣方名冊資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	契約調整生效日	X(8)	YYYYMMDD (可輸入次一營業日日期查詢契約調整預定生效日為次一營業日)
	結算會員代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起始號碼	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號截止號碼	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號截止號碼
	買賣別	X(1)	B:買方 S:賣方

格式說明：

- 期貨商(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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
- 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料；本交易所提供之資料為部位結帳後於次營業日將以股票現金辦理契約調整之交易人部位餘額資料。

4.2.5.28. 訊息代號：E28

訊息名稱：現金股利買賣方名冊資料查詢回覆

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)	14：現金股利買賣方名冊資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)	回覆資料之時間	
	結帳記號	9(1)	此欄位值無須參考	
	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：現金股利買賣方名冊資料	
	01 資料 群組 內容	契約調整基準日	X(8)	為多筆之應用資料內容
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		交割月份	X(6)	
		買賣別	X(1)	
部位餘額	9(8)			

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。

2. 期貨商(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 E27 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(結算會員)應用程式再次收取之資料格式，為該資料群組之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.5.29. 訊息代號：E29

訊息名稱：交易人部位資料查詢通知(含 Eurex 轉入部位明細)

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)	15：交易人部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號，得為 '9999999' 以查詢所有交易人之資料
	商品代號	X(7)	如查詢單一交易人之部位資料，得為 '9999999' 查詢所有商品部位資料，餘者均須輸入商品代號
	買賣權別	X(1)	如查詢單一交易人部位資料，得為 '9' 查詢所有部位資料，餘額應輸入值，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	如查詢單一交易人之部位資料，得為 '999999' 查詢所有月份部位資料，餘者均須輸入交割月份
履約價格	X(5)	如查詢單一交易人之部位資料，得為 '99999' 查詢所有履約價格資料，餘者均須輸入履約價格，期貨商品輸入空白	

格式說明：(長度 62)

1. 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料。
4. 履約價格需為 5 位文數字內容，若履約價格不足 5 位數字應於前補零，如' 07800' 。

4.2.5.30. 訊息代號：E30

訊息名稱：交易人部位資料查詢回覆(含 Eurex 轉入部位明細)

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)	15：交易人部位資料查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'	
	目地單位代號	X(7)	期貨商代號	
	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：交易人部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		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)	
		履約價格	X(5)	
		前日買進部位餘額	9(5)	
		前日賣出部位餘額	9(5)	

欄位		屬性	欄位說明
	買進部位口數	9(5)	
	賣出部位口數	9(5)	
	撥入買進部位口數	9(5)	
	撥入賣出部位口數	9(5)	
	撥出/到期買進部位口數	9(5)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(5)	
	Eurex 轉入買進部位口數	9(5)	
	Eurex 轉入賣出部位口數	9(5)	
	了結部位口數	9(5)	
	本日買進部位餘額	9(5)	
	本日賣出部位餘額	9(5)	
	本日買進組合部位餘額	9(5)	
	本日賣出組合部位餘額	9(5)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 E29 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + Eurex 轉入買進部位口數 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數
7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + Eurex 轉入賣出部位口數 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數
8. 本日買進(賣出)組合部位餘額為該商品已形成組合部位之資料,若欲查詢各組合部位餘額,請執行「交易人組合部位資料查詢」(0111)交易。
9. 匯率商品於 T 日到期,於最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。
10. T 日到期商品(匯率商品除外),不論盤別將於第一盤部位結帳記號後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。
11. T+1 日到期商品則依其最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.5.3. 訊息代號：E31

訊息名稱：期貨商部位資料查詢通知(含 Eurex 轉入部位明細)

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)	16：期貨商部位資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢結算會員所有期貨商資料
	商品代號	X(7)	為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P' 得為 '9' 以查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有商品部位資料，查詢期貨商品時輸入空白

格式說明：

- 期貨商(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設定(Flag)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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.5.4. 訊息代號：E32

訊息名稱：期貨商部位資料查詢回覆(Eurex)

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)	16：期貨商部位資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：期貨商部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		前日買進部位餘額	9(7)	
		前日賣出部位餘額	9(7)	
		買進部位口數	9(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	賣出部位口數	9(7)	
	撥入買進部位口數	9(7)	
	撥入賣出部位口數	9(7)	
	撥出/到期買進部位口數	9(7)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(7)	
	Eurex 轉入買進部位口數	9(7)	
	Eurex 轉入賣出部位口數	9(7)	
	了結部位口數	9(7)	
	本日買進部位餘額	9(7)	
	本日賣出部位餘額	9(7)	
	本日買進組合部位餘額	9(7)	
	本日賣出組合部位餘額	9(7)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)要求所回覆正常資料格式。
2. 期貨商(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 E31 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：期貨商部位資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式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. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + Eurex 轉入買進部位口數 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數
7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + Eurex 轉入賣出部位口數 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數
8. 本日買進(賣出)組合部位餘額為該商品已形成組合部位之資料,若欲查詢各組合部位餘額,請執行「期貨商組合部位資料查詢」(0112)交易。
9. 匯率商品於 T 日到期,於最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。
10. T 日到期商品(匯率商品除外),不論盤別將於第一盤部位結帳記號後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。
11. T+1 日到期商品則依其最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.5.5. 訊息代號：E33

訊息名稱：結算會員部位資料查詢通知(含 Eurex 轉入部位明細)

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)	17：結算會員部位資料查詢
	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‘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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	商品代號	X(7)	得為‘9999999’以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	期貨為空白,買權為‘C’,賣權為‘P’得為‘9’以查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	得為‘9999999’以查詢所有商品部位資料
	履約價格	X(5)	得為‘99999’以查詢所有選擇權商品部位資料,查詢期貨商品時輸入空白

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。

4.2.5.6. 訊息代號：E34

訊息名稱：結算會員部位資料查詢回覆(Eurex)

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)	17：結算會員部位資料查詢	
	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：結算會員部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		前日買進部位餘額	9(7)	
		前日賣出部位餘額	9(7)	
		買進部位口數	9(7)	
		賣出部位口數	9(7)	

欄位		屬性	欄位說明
	撥入買進部位口數	9(7)	
	撥入賣出部位口數	9(7)	
	撥出/到期買進部位口數	9(7)	
	撥出/到期賣出部位口數	9(7)	
	Eurex 轉入買進部位口數	9(7)	
	Eurex 轉入賣出部位口數	9(7)	
	了結部位口數	9(7)	
	本日買進部位餘額	9(7)	
	本日賣出部位餘額	9(7)	
	本日買進組合部位餘額	9(7)	
	本日賣出組合部位餘額	9(7)	

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 E33 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：結算會員部位資料)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 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(1 表有資料，0 表資料結束)。
6. 本日買進部位餘額 = 前日買進部位餘額 + Eurex 轉入買進部位口數 + 買進部位口數 + 撥入買進部位口數 - 撥出/到期買進部位口數 - 了結部位口數

7. 本日賣出部位餘額 = 前日賣出部位餘額 + Eurex 轉入賣出部位口數 + 賣出部位口數 + 撥入賣出部位口數 - 撥出/到期賣出部位口數 - 了結部位口數
8. 本日買進(賣出)組合部位餘額為該商品已形成組合部位之資料,若欲查詢各組合部位餘額,請執行「期貨商組合部位資料查詢」(0112)交易。
9. 匯率商品於 T 日到期,於最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。
10. T 日到期商品(匯率商品除外),不論盤別將於第一盤部位結帳記號後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。
11. T+1 日到期商品則依其最後結算價公布後,將相關到期部位揭示於撥出/到期買進(或賣出)部位口數欄位。

4.2.6. 結算保證金作業(台幣商品)

4.2.6.1. 訊息代號：F01

訊息名稱：結算保證金查詢通知

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)	6：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	01：結算保證金查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.6.2. 訊息代號：F02

訊息名稱：結算保證金查詢回覆

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)	6：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	01：結算保證金查詢	
	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 '999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：部位結算會員部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位資料
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		買進部位餘額	9(7)	
		賣出部位餘額	9(7)	
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金資料	
	02	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位

欄位		屬性	欄位說明
資料 群 組 內 容	應存有結算保證金數額	9(12)	資料

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要求代碼(Request ID)，與傳送 F01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容，將陸續重覆收取直至另一資料群組代號(02)
5. 結算會員應用程式以 MTS 服務程式功能參數之長度區別再次收取之資料格式，為資料群組代號(02)，可由前後筆資料長度不同判別。
6. 結算會員應用程式陸續收取之資料格式，為 02 資料群組內容。
7. 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

4.2.6.3. 訊息代號：F03

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知

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)	6：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	02：結算保證金追繳資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.6.4. 訊息代號：F04

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆

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)	6：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	02：結算保證金追繳資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：結算保證金追繳資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		應存有結算保證金數額	9(12)	
		原存有現金結算保證金權益	9(12)	
		補足前日追繳款項金額	9(12)	
		本日存入/移入款項金額	9(12)	
		本日提領/移出款項金額	9(12)	
		本日權利金應收款項金額	9(12)	
		本日權利金應付款項金額	9(12)	
		本日成交差益數額	9(12)	

欄位	屬性	欄位說明
本日成交差損數額	9(12)	
本日部位差益數額	9(12)	
本日部位差損數額	9(12)	
本日到期差益數額	9(12)	
本日到期差損數額	9(12)	
本日選擇權到期差益數額	9(12)	
本日選擇權到期差損數額	9(12)	
次日申請提領款項金額	9(12)	
現存有現金結算保證金權益	9(12)	
可提領款項金額	9(12)	
應追繳款項金額	9(12)	
本日股票選擇權買方交割應收款項	9(12)	
本日股票選擇權買方交割應付款項	9(12)	
本日股票選擇權賣方交割應收款項	9(12)	
本日股票選擇權賣方交割應付款項	9(12)	
本日股票選擇權券不足現金結算應收款項	9(12)	
本日股票選擇權券不足現金結算應付款項	9(12)	
期貨實物交割應收款項	9(12)	
期貨實物交割應付款項	9(12)	
期貨實物不足現金結算應收款項	9(12)	
期貨實物不足現金結算應付款項	9(12)	

欄位		屬性	欄位說明
	到期部位結算保證金數額	9(12)	

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日股票選擇權買方交割應收款項 + 本日股票選擇權賣方交割應收款項 + 本日股票選擇權券不足現金結算應收款項 - 本日股票選擇權買方交割應付款項 - 本日股票選擇權賣方交割應付款項 - 本日股票選擇權券不足現金結算應付款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額
- 應存有結算保證金數額：包含到期部位結算保證金數額
- 應追繳款項金額 = 應存有結算保證金數額 - 現存有結算保證金權益數額 > 0
- 可提領款項金額 = 應存有結算保證金數額 - 現存有結算保證金權益數額 < 0
- 本日股票選擇權買方交割應收款項 = 賣權之買方應收款項 + 買權買方契約調整現金結算應收款項
- 本日股票選擇權賣方交割應收款項 = 買權之賣方應收款項 + 賣權賣方契約調整現金結算應收款項
- 本日股票選擇權買方交割應付款項 = 買權之買方應付款項 + 賣權買方契約調整現金結算應付款項

8. 本日股票選擇權賣方交割應付款項 = 賣權之賣方應付款項 + 買權賣方契約調整現金結算應付款項
9. 買權買方及賣權賣方應付款項計算為履約價格 * 1000
10. 買權賣方及賣權買方應付為標的證券 + 零股現金結算款項 + 現金股利 + 現金增資相對款項
11. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。
12. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割價款。

4.2.6.5. 訊息代號：F05

訊息名稱：盤中保證金追繳通告

訊息類別：廣播通告訊息

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)	6：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	03：盤中保證金追繳通告
	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 '999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	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：盤中保證金追繳
	01 期貨商代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商及自營商保證金追繳資料，並依 SPAN 系統提供之應存有保證金為計算基準
	應追繳數額	9(12)	

格式說明：

1. 為期交所主動傳送給結算會員之正常資料格式。
2. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式，得到一特定之要求代碼(Request ID)為 integer 99，用以代表此為廣播通告訊息。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。

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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

4.2.6.6. 訊息代號：F06

訊息名稱：結算保證金餘額查詢通知

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)	6：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	04：結算保證金餘額查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.6.7. 訊息代號：F07

訊息名稱：結算保證金餘額查詢回覆

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)	6：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	04：結算保證金餘額查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳	
	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：結算保證金餘額資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商保證金餘額資料
		原存有現金結算保證金權益	9(12)	
		補足前日追繳金額	9(12)	
		本日存入/移入款項金額	9(12)	
		本日提領/移出款項金額	9(12)	
		本日劃撥追繳款項金額	9(12)	
		本日權利金應收款項金額	9(12)	
		本日權利金應付款項金額	9(12)	
本日差益金額	9(12)			

欄位	屬性	欄位說明
本日差損金額	9(12)	
次日申請提領款項金額	9(12)	
現存有 <u>現金</u> 結算保證金權益	9(12)	
結算手續費	9(12)	
交割手續費	9(12)	
調整手續費	9(12)	
移轉手續費	9(12)	
本日股票選擇權交割應收款項金額	9(12)	
本日股票選擇權交割應付款項金額	9(12)	
本日股票選擇權券不足現金結算應收款項金額	9(12)	
本日股票選擇權券不足現金結算應付款項金額	9(12)	
期貨實物交割應收款項	9(12)	
期貨實物交割應付款項	9(12)	
期貨實物不足現金結算應收款項	9(12)	
期貨實物不足現金結算應付款項	9(12)	
實物交割轉帳費用	9(12)	

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金款項餘額 + 補足前日追繳金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日劃撥追繳金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日差益金額 - 本日差損金額 + 本日股票選擇權交割應收款項金額 - 本日股票選擇權交割應付款項金額 + 本日股票選擇權券不足現金結算應

收款項金額 - 本日股票選擇權券不足現金結算應付款項金額 + 期貨實物
交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款
項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額

2. 結算、交割、調整及移轉手續費等係為前一營業日之各項資料；其中股票選
擇權買權交割費用將於到期日次一日顯現，賣權交割費用將於到期日次日顯
現；實物交割轉帳費用為辦理公債實物交割所衍生出之銀行轉帳費用。

3. 本日股票選擇權交割應收(付)款項金額=本日股票選擇權交割買方應收(付)
款項金額+本日股票選擇權交割賣方應收(付)款項金額

4.2.6.8. 訊息代號：F08

訊息名稱：商品結算保證金資料查詢通知

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)	6：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	05：商品結算保證金資料查詢
	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'999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號'0001000'
訊息資料區	商品代號	X(7)	'9999999' 表查詢所有商品資料
	買賣權別	X(1)	'9' 表查詢全部資料
	交割月份	X(6)	'999999' 表查詢全部月份資料
	履約價格	X(5)	'99999' 表查詢全部價格資料
	查詢種類	9(1)	1：單一商品結算保證金 2：組合商品結算保證金 3：單一及組合商品結算保證金 4：股票選擇權每口交割價款資料

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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. 於部位結帳後提供各商品之結算保證金資料。

4.2.6.9. 訊息代號：F09

訊息名稱：商品結算保證金資料查詢回覆

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)	6：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	05：商品結算保證金資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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	01 資料群組代號	9(2)	01：單一商品結算保證金	
	01 資料群組內容	商品代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		結算價格	9(5)V 9(4)	
		結算保證金	9(9)	
	02 資料群組代號	9(2)	02：組合商品結算保證金	
	02 資料	商品代號 1	X(7)	為多筆之應用資料內容
		買賣權別 1	X(1)	

欄位		屬性	欄位說明
群組內容	交割月份 1	X(6)	
	履約價格 1	X(5)	
	組合種類	X(1)	
	商品代號 2	X(7)	
	買賣權別 2	X(1)	
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	
	買進組合結算保證金	9(9)	
	賣出組合結算保證金	9(9)	
03 資料群組代號		9(2)	03：個股交格價款
03 資料群組內容	商品代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
	買賣權別	X(1)	
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	
	買權買方應付款項	9(9)	
	賣權買方應付款項	9(9)	
	買權賣方應付款項	9(9)	
	賣權賣方應付款項	9(9)	
券不足現金結算應付款項		9(9)	

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要求代碼(Request ID)，與傳送 F08 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。

3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)；再次陸續收取 01 資料群組內容。
4. 若仍有資料群組(02)之資料，則先收取 02 資料群組代號再陸續收取 02 資料群組內容。
5. 結算會員應用程式以 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

4.2.6.10. 訊息代號：F10

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(coveredcall)

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)	6：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	06：結算保證金追繳資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.6.11. 訊息代號：F11

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(coveredcall)

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)	6：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	06：結算保證金追繳資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：結算保證金追繳資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		應存有結算保證金數額	9(12)	
		原存有現金結算保證金權益	9(12)	
		補足前日追繳款項金額	9(12)	
		本日存入/移入款項金額	9(12)	
		本日提領/移出款項金額	9(12)	
		本日權利金應收款項金額	9(12)	
		本日權利金應付款項金額	9(12)	
		本日成交差益數額	9(12)	

	欄位	屬性	欄位說明
	本日成交差損數額	9(12)	
	本日部位差益數額	9(12)	
	本日部位差損數額	9(12)	
	本日到期差益數額	9(12)	
	本日到期差損數額	9(12)	
	本日選擇權到期差益數額	9(12)	
	本日選擇權到期差損數額	9(12)	
	次日申請提領款項金額	9(12)	
	現存有現金結算保證金權益	9(12)	
	可提領款項金額	9(12)	
	應追繳款項金額	9(12)	
	本日股票選擇權買方交割應收款項	9(12)	
	本日股票選擇權買方交割應付款項	9(12)	
	本日股票選擇權賣方交割應收款項	9(12)	
	本日股票選擇權賣方交割應付款項	9(12)	
	本日股票選擇權券不足現金結算應收款項	9(12)	
	本日股票選擇權券不足現金結算應付款項	9(12)	
	期貨實物交割應收款項	9(12)	
	期貨實物交割應付款項	9(12)	
	期貨實物不足現金結算應收款項	9(12)	
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12)	

欄位		屬性	欄位說明
	到期部位結算保證金數額	9(12)	
	抵繳保證金	9(12)	
	期貨多空減收之保證金	9(12)	

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日股票選擇權買方交割應收款項 + 本日股票選擇權賣方交割應收款項 + 本日股票選擇權券不足現金結算應收款項 - 本日股票選擇權買方交割應付款項 - 本日股票選擇權賣方交割應付款項 - 本日股票選擇權券不足現金結算應付款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額
- 應存有結算保證金數額：包含到期部位結算保證金數額且扣除了股票選擇權買權賣方抵繳保證金
- 現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金額
- 應追繳款項金額 = 應存有結算保證金數額 - 現存有結算保證金總權益數
> 0
- 可提領款項金額 = 應存有結算保證金數額 - 現存有結算保證金總權益數
< 0
- 本日股票選擇權買方交割應收款項 = 賣權之買方應收款項 + 買權買方契

- 約調整現金結算應收款項
7. 本日股票選擇權賣方交割應收款項 = 買權之賣方應收款項 + 賣權賣方契約調整現金結算應收款項
8. 本日股票選擇權買方交割應付款項 = 買權之買方應付款項 + 賣權買方契約調整現金結算應付款項
9. 本日股票選擇權賣方交割應付款項 = 賣權之賣方應付款項 + 買權賣方契約調整現金結算應付款項
10. 買權買方及賣權賣方應付款項計算為履約價格 * 1000
11. 買權賣方及賣權買方應付為標的證券 + 零股現金結算款項 + 現金股利 + 現金增資相對款項
12. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。
13. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割價款。
14. 抵繳保證金：抵繳專戶中交易人存券餘額充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股數時，依充抵之買權賣方部位所應收保證金換算為抵繳保證金
- 【公式：充抵買權賣方部位之抵繳保證金 = 充抵買權賣方部位之應收保證金 * 充抵買權賣方部位口數】

4.2.7. 結算保證金作業

4.2.7.1. 訊息代號：G01

訊息名稱：結算保證金查詢通知(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	01：結算保證金查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.2. 訊息代號：G02

訊息名稱：結算保證金查詢回覆(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	01：結算保證金查詢	
	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 '999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：部位結算會員部位資料	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位資料
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		買進部位餘額	9(7)	
		賣出部位餘額	9(7)	
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金資料	
	02 結算會員代號	X(7)		

欄位		屬性	欄位說明
資料 群 組 內 容	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金
	應存有結算保證金數額	9(12) v99	

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要求代碼(Request ID)，與傳送 G01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容，將陸續重覆收取直至另一資料群組代號(02)
5. 結算會員應用程式以 MTS 服務程式功能參數之長度區別再次收取之資料格式，為資料群組代號(02)，可由前後筆資料長度不同判別。
6. 結算會員應用程式陸續收取之資料格式，為 02 資料群組內容。
7. 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
8. 應存有結算保證金數額：已扣除抵繳買權賣方之結算保證金及期貨商品多空減收之結算保證金

4.2.7.3. 訊息代號：G03

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	02：結算保證金追繳資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.4. 訊息代號：G04

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	02：結算保證金追繳資料查詢
	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' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	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：結算保證金相關資料
	結算會員代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金
	01 應存有結算保證金數額	9(12) v99	包含小數 2 位共 14 位，例“15.25”表示為“0000000001525”；
	01 原存有現金結算保證金權益	9(12) v99	共 14 位，可為負數。正數時“15.25”表示為“0000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-0000000001525” (幣別為 2 時為約當美元)
	01 補足前日追繳款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	01 本日存入/移入款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	01 本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)

欄位	屬性	欄位說明
本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
本日成交差益數額	9(12) v99	
本日成交差損數額	9(12) v99	
本日部位差益數額	9(12) v99	
本日部位差損數額	9(12) v99	
本日期到期差益數額	9(12) v99	
本日期到期差損數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	
次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
現存有現金結算保證金權益	9(12) v99	共 14 位，可為負數。正數時“15.25”表示為“00000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-00000000001525” (幣別為 2 時為約當美元)
本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權買權買方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
期貨實物交割應收款項	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
	到期部位結算保證金數額	9(12) v99	
	抵繳保證金	9(12) v99	
	期貨多空減收之保證金	9(12) v99	
	本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金追繳資料
02 資料 群 組 內 容	台幣可提領款項金額	9(12) v99	
	台幣應追繳款項金額	9(12) v99	
	美金可提領款項金額	9(12) v99	(為約當美元)
	美金應追繳款項金額	9(12) v99	(為約當美元)
	參考匯率(美金兌台幣)	9(4)v 9(6)	
	境外外資台幣商品保證金	9(12) v99	

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項 + 本日選擇權買

權賣方轉現貨應收款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日選擇權買權買方轉現貨應付款項 - 本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項 - 本日期貨商品轉現貨應收款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額 + 本日結匯存入金額 - 本日結匯提領金額

※幣別為 2 時，原存有結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本日存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本日結匯存入金額及本日結匯提領金額均為約當美元，而現存有結算保證金權益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為 2 時，本日存入/移入款項金額為約當美元(即每一外幣之存入/移入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數 2 位後加總)，其餘約當美元之款項項目計算公式均相同。

2. 應存有結算保證金數額：包含到期部位結算保證金數額
3. 現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金額
- 4~9 不適用
10. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。
11. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割價款。
12. 抵繳保證金：抵繳專戶中交易人存券餘額充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股數時，依充抵之買權賣方部位所應收保證金換算為抵繳保證金
【公式：充抵買權賣方部位之抵繳保證金 = 充抵買權賣方部位之應收保證金 * 充抵買權賣方部位口數】
13. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。
14. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及

結匯郵電費)。

15. 台幣可提領款項金額：台幣現存有總權益數 - 台幣應存有保證金 - (美金應存有不足之款項金額 * 參考匯率) > 0；美金應存有不足之款項金額 = 美金應追繳款項金額

16. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 - (美金超額保證金(約當美元) * 參考匯率(美元對台幣)) > 0

17. 美金可提領款項金額(約當美元)：美金現存有總權益數(約當美元) - 美金應存有保證金 - (台幣應存有不足之款項金額 / 參考匯率) > 0；台幣應存有不足之款項金額 = 台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 > 0

18. 美金應追繳款項金額(約當美元)：美金應存有保證金 - 美金現存有總權益數(約當美元) > 0

19. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

4.2.7.5. 訊息代號：G05

訊息名稱：盤中保證金追繳通告(台幣+外幣)

訊息類別：廣播通告訊息

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	03：盤中保證金追繳通告
	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 '999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位部位已結帳
	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：盤中保證金追繳
	01 期貨商代號	X(7)	
	資料群組內容		
	台幣應追繳數額 (NT)	9(12)	依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
	美金應追繳數額 (US)	9(12) v99	(約當美元) 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
參考匯率 (美金兌台幣)	9(4)v 9(6)		

格式說明：

1. 為期交所主動傳送給結算會員之正常資料格式。
2. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式，得到一特定之要求代碼(Request ID)為 integer 99，用以代表此為廣播通告訊息。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。

4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
6. 台幣應追繳數額(NT) = 台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 - (美金超額保證金(約當美元) * 美元對台幣參考匯率) > 0
7. 美金應追繳數額(約當美元) = 美金應存有保證金 - 美金現存有總權益數 (約當美元) > 0

4.2.7.6. 訊息代號：G06

訊息名稱：結算保證金餘額查詢通知(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	04：結算保證金餘額查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.7. 訊息代號：G07

訊息名稱：結算保證金餘額查詢回覆(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	04：結算保證金餘額查詢
	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' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳
	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：台幣結算保證金餘額資料
	結算會員代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
	01 資料群組內容	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元) 共14位，可為負數。正數時"15.25" 表示為"0000000001525"；負數時 "-15.25"表示為"-0000000001525"
	補足前日追繳金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元) 包含小數2位共14位，例"15.25"表 示為"0000000001525"；
	本日存入/移入款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)
	本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)
	本日劃撥追繳款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)

欄位	屬性	欄位說明
本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
本日差益金額	9(12) v99	
本日差損金額	9(12) v99	
次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)
現存有現金結算保證金權益	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元) 共14位，可為負數。正數時“15.25”表示為“0000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-0000000001525”
結算手續費	9(12) v99	
交割手續費	9(12) v99	
調整手續費	9(12) v99	
移轉手續費	9(12) v99	
期交所代結匯手續費	9(12) v99	
本日選擇權轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
期貨實物交割應收款項	9(12) v99	
期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	實物交割轉帳費用	9(12) v99	
	本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)
	本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金款項餘額 + 補足前日追繳金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日劃撥追繳金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日差益金額 - 本日差損金額 + 本日選擇權轉現貨應收款項 - 本日選擇權轉現貨應付款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日期貨商品轉現貨應付款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額 + 本日結匯存入金額 - 本日結匯提領金額

※幣別為2時，原存有現金結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本日存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本日結匯存入金額及本日結匯提領金額均為約當美元，而現存有結算保證金總權益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為2時，本日存入/移入款項金額為約當美元(即每一外幣之存入/移入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數2位後加總)，其餘約當美元之款項項目計算公式均相同。

現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金額

- 結算、交割、調整、移轉及期交所代結匯手續費等係為前一營業日之各項資料；其中股票選擇權買權交割費用將於到期日次日顯現，賣權交割費用將於到期日次日顯現；實物交割轉帳費用為辦理公債實物交割所衍生出之銀行轉

帳費用。

3. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。
4. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及結匯郵電費)。

4.2.7.8. 訊息代號：G08

訊息名稱：商品結算保證金資料查詢通知(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	05：商品結算保證金資料查詢
	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'999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號'0001000'
訊息資料區	商品代號	X(7)	'9999999' 表查詢所有商品資料
	買賣權別	X(1)	'9' 表查詢全部資料
	交割月份	X(6)	'999999' 表查詢全部月份資料
	履約價格	X(5)	'99999' 表查詢全部價格資料
	查詢種類	9(1)	1:單一商品結算保證金 2:組合商品結算保證金 3:單一及組合商品結算保證金 4:股票選擇權每口交割價款資料

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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. 於部位結帳後提供各商品之結算保證金資料。

4.2.7.9. 訊息代號：G09

訊息名稱：商品結算保證金資料查詢回覆(台幣+外幣)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	05：商品結算保證金資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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	01 資料群組代號	9(2)	01：單一商品結算保證金	
	01 資料群組內容	商品代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		結算價格	9(5) V9999	
		結算保證金	9(9) v99	包含小數 2 位共 11 位，例 "15.25" 表示為 "00000001525"；
	02 資料群組代號	9(2)	02：組合商品結算保證金	
	02 資料	商品代號 1	X(7)	
		買賣權別 1	X(1)	

欄位		屬性	欄位說明
群組內容	交割月份 1	X(6)	
	履約價格 1	X(5)	
	組合種類	X(1)	
	商品代號 2	X(7)	
	買賣權別 2	X(1)	
	交割月份 2	X(6)	
	履約價格 2	X(5)	
	買進組合結算保證金	9(9) v99	包含小數 2 位共 11 位，例 "15.25" 表示為 "00000001525"；
	賣出組合結算保證金	9(9) v99	
03 資料群組代號		9(2)	03：個股交割價款
03 資料群組內容	商品代號	X(7)	
	買賣權別	X(1)	
	交割月份	X(6)	
	履約價格	X(5)	
	買權買方應付款項	9(9) v99	包含小數 2 位共 11 位，例 "15.25" 表示為 "00000001525"；
	賣權買方應付款項	9(9) v99	
	買權賣方應付款項	9(9) v99	
	賣權賣方應付款項	9(9) v99	
	券不足現金結算應付款項	9(9) v99	

格式說明：

6. 為期交所應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
7. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，

與傳送 G08 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。

8. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)；再次陸續收取 01 資料群組內容。
9. 若仍有資料群組(02)之資料，則先收取 02 資料群組代號再陸續收取 02 資料群組內容。
10. 結算會員應用程式以 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
11. 01、02 資料群組之結算保證金及 03 資料群組之應付款項之幣別，均以商品代號為準；即台幣商品為台幣結算保證金及台幣應付款項，美金商品則為美金結算保證金及美金應付款項。
12. 相關結算保證金及相關應付款項，均視該商品所屬之幣別種類而分別表示為台幣或美金。

4.2.7.10. 訊息代號：G10

訊息名稱：期交所代結匯資料查詢通知

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	06：期交所代結匯資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.11. 訊息代號：G11

訊息名稱：期交所代結匯資料查詢回覆

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	06：期交所代結匯資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	0：提領未結帳 1：提領已結帳	
	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：結匯資料 為多筆之應用資料內容	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		結匯種類	X(1)	1：台幣兌換美金 2：美金兌換台幣
		結匯時間	9(6)	hhmmss
		結匯匯率	9(6) v9999	
		結匯提領金額	9(12) v99	視結匯種類提領台幣或美金
		結匯存入金額	9(12) v99	視結匯種類存入美金或台幣
		結匯手續費(台幣)	9(12) v99	
		結匯手續費(美金)	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	結匯郵電費(台幣)	9(12) v99	
	結匯郵電費(美金)	9(12) v99	

格式說明：

1. 提供結算會員查詢當日期交所代為結匯之款項資料。

4.2.7.12. 訊息代號：G12

訊息名稱：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢通知

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	07：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號迄號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號終迄號碼

格式說明：

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4.2.7.13. 訊息代號：G13

訊息名稱：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢回覆

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	07：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：境外外資交易新台幣商品應有保證金	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		交易人身分碼	X(1)	
		台幣商品應有保證金	9(12) v99	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 G12 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

3. 期貨商(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. 期貨商(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：境外外資交易新台幣商品應有保證金資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.7.14. 訊息代號：G14

訊息名稱：結算保證金查詢通知(依 SPAN 保證金計算)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	08：結算保證金查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.15. 訊息代號：G15

訊息名稱：結算保證金查詢回覆(依 SPAN 保證金計算)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	08：結算保證金查詢	
	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 '999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：部位結算會員部位資料	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位資料
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		買進部位餘額	9(7)	
		賣出部位餘額	9(7)	
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金資料	
	02 結算會員代號	X(7)		

欄位		屬性	欄位說明
資料 群 組 內 容	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
	應存有結算保證金數額	9(12) v99	以 SPAN 系統計算出應存有保證金(包含公債到期部位結算保證金數額)

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要求代碼(Request ID)，與傳送 G14 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容，將陸續重覆收取直至另一資料群組代號(02)
5. 結算會員應用程式以 MTS 服務程式功能參數之長度區別再次收取之資料格式，為資料群組代號(02)，可由前後筆資料長度不同判別。
6. 結算會員應用程式陸續收取之資料格式，為 02 資料群組內容。
7. 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。
8. 應存有結算保證金數額：
 - 8.1. 若台幣：則 SPAN 系統計算出之台幣應存有保證金(扣除股票選擇權買權賣方抵繳保證金及扣除境外外資台幣商品保證金且包含到期部位結算保證金數額)
 - 8.2. 若美元：則 SPAN 系統計算出之美元應存有保證金(包含境外外資台幣商品保證金以美元匯率換算之美元)
9. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

4.2.7.16. 訊息代號：G16

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(依 SPAN 保證金計算)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	09：結算保證金追繳資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.17. 訊息代號：G17

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(依 SPAN 保證金計算)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	09：結算保證金追繳資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：結算保證金相關資料	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金
		應存有結算保證金數額	9(12) v99	SPAN 系統計算出之應存有保證金
		原存有現金結算保證金權益	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元) 共 14 位，可為負數。正數時 "15.25" 表示為 "0000000001525"；負數時 "-15.25" 表示為 "-0000000001525"
		補足前日追繳款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
		本日存入/移入款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)		

欄位	屬性	欄位說明
本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
本日成交差益數額	9(12) v99	
本日成交差損數額	9(12) v99	
本日部位差益數額	9(12) v99	
本日部位差損數額	9(12) v99	
本日期到差益數額	9(12) v99	
本日期到差損數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	
次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
現存有現金結算保證金權益	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元) 共 14 位，可為負數。正數時“15.25”表示為“0000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-0000000001525”
本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權買權買方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
期貨實物交割應收款項	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
	到期部位結算保證金數額	9(12) v99	
	抵繳保證金	9(12) v99	原保證金計算方式計算之 coveredcall 可抵繳保證金數額
	期貨多空減收之保證金	9(12) v99	依 SPAN 系統整戶計算，不另計算之
	本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金追繳資料
02 資料 群 組 內 容	台幣可提領款項金額	9(12) v99	依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
	台幣應追繳款項金額	9(12) v99	依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
	美金可提領款項金額	9(12) v99	(約當美元) 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
	美金應追繳款項金額	9(12) v99	(約當美元) 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
	參考匯率 (美金兌台幣)	9(4)v 9(6)	
	境外外資台幣商品保證金	9(12) v99	SPAN 系統計算之值

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項 + 本日選擇權買

權賣方轉現貨應收款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日選擇權買權買
方轉現貨應付款項 - 本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項 - 本日期貨商品轉
現貨應收款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項
- 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請
提領款項金額 + 本日結匯存入金額 - 本日結匯提領金額

※幣別為 2 時，原存有現金結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本
日存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本
日結匯存入金額及本日結匯提領金額均為約當美元，而現存有結算保證金總權
益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為 2 時，本日存入/移入款項金額為約當美元(即每一外幣之存入/移
入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數 2 位後加總)，其餘約當美
元之款項項目計算公式均相同。

現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金
額

2. 應存有結算保證金數額：

2.1. 若台幣：則 SPAN 系統計算出之台幣應存有保證金(扣除股票選擇權買權賣
方抵繳保證金及扣除境外外資台幣商品保證金且包含到期部位
結算保證金數額

2.2. 若美元：則 SPAN 系統計算出之美元應存有保證金(包含境外外資台幣商品
保證金以美元匯率換算之美元)

3~8. 不適用

9. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。

10. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交
割價款。

11. 抵繳保證金：抵繳專戶中交易人存券餘額充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股

數時，依充抵之買權賣方部位所應收保證金換算為抵繳保證金

【公式：充抵買權賣方部位之抵繳保證金 = 充抵買權賣方部位之應收保證金
* 充抵買權賣方部位口數】

12. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。
13. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及結匯郵電費)。
14. 台幣可提領款項金額：台幣現存有總權益數 - 台幣應存有保證金 - (美金應存有不足之款項金額(約當美元) * 台幣對美元參考匯率) > 0；美金應存有不足之款項金額(約當美元) = 美金應追繳款項金額(約當美元)
15. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 - (美金超額保證金(約當美元) * 台幣對美元參考匯率) > 0
16. 美金可提領款項金額(約當美元)：美金現存有總權益數(約當美元) - 美金應存有保證金 - (台幣應存有不足之款項金額 / 參考匯率) > 0；台幣應存有不足之款項金額 = 台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 > 0
17. 美金應追繳款項金額(約當美元)：美金應存有保證金 - 美金現存有總權益數(約當美元) > 0
18. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

4.2.7.18. 訊息代號：G18

訊息名稱：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢通知

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	10：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號

格式說明：

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4.2.7.19. 訊息代號：G19

訊息名稱：期貨商應存有暨原始保證金查詢回覆

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	10：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：期貨商應存有暨原始保證金	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有保證金	9(12) v99	SPAN 系統計算出之結算保證金數額(包含到期部位結算保證金數額)
		原始保證金	9(12) v99	SPAN 系統計算出之原始保證金數額(包含到期部位原始保證金數額)

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 G18 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

3. 期貨商(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. 期貨商(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 期貨商應存有暨原始保證金)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

4.2.7.20. 訊息代號：G20

訊息名稱：結算保證金各幣別餘額查詢通知

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	11：結算保證金各幣別餘額查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.21. 訊息代號：G21

訊息名稱：結算保證金各幣別餘額查詢回覆

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	11：結算保證金各幣別餘額查詢
	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' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	3：款項未結帳 4：款項已結帳
	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：結算保證金相關資料
	結算會員代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣、2：美金、3：歐元、4：日幣、5：英鎊、6：澳幣、7：港幣、8：人民幣
	01 原存有現金結算保證金權益	9(12) v99	
	本日存入/移入款項金額	9(12) v99	
	本日提領/移出款項金額	9(12) v99	
	次日申請提領款項金額	9(12) v99	
	本日應收付款項金額	9(12) v99	
本日結匯存入金額	9(12) v99		

欄位		屬性	欄位說明
	本日結匯提領金額	9(12) v99	
	現存有 <u>現金</u> 結算保證金權益	9(12) v99	共 14 位，可為負數。正數時“15.25”表示為“0000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-0000000001525”

格式說明：

- $$\begin{aligned} & \text{本日應收付款項金額} = \text{本日權利金應收款項金額} - \text{本日權利金應付款項} \\ & \text{金額} + \text{本日成交差益數額} - \text{本日成交差損數額} + \text{本日部位差益數額} \\ & - \text{本日部位差損數額} + \text{本日到期差益數額} - \text{本日到期差損數額} + \text{本} \\ & \text{日選擇權到期差益數額(含個股選擇權現金交割到期差益數額)} - \text{本日選擇} \\ & \text{權到期差損數額(含個股選擇權現金交割到期差損數額)} + \text{本日股票選擇權} \\ & \text{買方交割應收款項} + \text{本日股票選擇權賣方交割應收款項} + \text{本日股票選擇} \\ & \text{權券不足現金結算應收款項} - \text{本日股票選擇權買方交割應付款項} - \text{本日} \\ & \text{股票選擇權賣方交割應付款項} - \text{本日股票選擇權券不足現金結算應付款項} \\ & + \text{期貨實物交割應收款項} + \text{期貨實物不足現金結算應收款項} - \text{期貨實} \\ & \text{物交割應付款項} - \text{期貨實物不足現金結算應付款項} \end{aligned}$$
- $$\begin{aligned} & \text{現存有現金結算保證金權益} = \text{原存有現金結算保證金權益} + \text{本日存入/} \\ & \text{移入款項金額} - \text{本日提領/移出款項金額} - \text{次日申請提領款項金額} + \\ & \text{本日應收付款項金額} + \text{本日結匯存入金額} - \text{本日結匯提領金額} \end{aligned}$$

4.2.7.22. 訊息代號：G22

訊息名稱：期交所代結匯資料查詢通知(外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	12：期交所代結匯資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.23. 訊息代號：G23

訊息名稱：期交所代結匯資料查詢回覆(外幣)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	12：期交所代結匯資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	0：提領未結帳 1：提領已結帳	
	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：結匯資料 為多筆之應用資料內容	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		結匯提領幣別	X(1)	
		結匯存入幣別	X(1)	
		結匯時間	9(6)	hhmmss
		結匯匯率	9(6) v9(6)	
		結匯提領金額	9(12) v99	視結匯提領幣別提領對應幣值
		結匯存入金額	9(12) v99	視結匯存入幣別存入對應幣值
		銀行結匯手續費 1 幣別	X(1)	
		銀行結匯手續費 1	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	銀行結匯手續費 2 幣別	X(1)	
	銀行結匯手續費 2	9(12) v99	
	銀行結匯郵電費 1 幣別	X(1)	
	銀行結匯郵電費 1	9(12) v99	
	銀行結匯郵電費 2 幣別	X(1)	
	銀行結匯郵電費 2	9(12) v99	

格式說明：

1. 提供結算會員查詢當日期交所代為結匯之款項資料。

4.2.7.24. 訊息代號：G24

訊息名稱：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢通知(外幣)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	13：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號

格式說明：

1. 期貨商(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. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4.2.7.25. 訊息代號：G25

訊息名稱：期貨商應存有暨原始保證金查詢回覆(外幣)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	13：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢	
	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)	期貨商代號	
	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：期貨商應存有暨原始保證金	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有保證金	9(12) v99	SPAN 系統計算出之結算保證金數額(包含到期部位結算保證金數額)
		原始保證金	9(12) v99	SPAN 系統計算出之原始保證金數額(包含到期部位原始保證金數額)
	資料群組代號	9(2)	02：幣別商品保證金	
	02 資料群組	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		境外外資台幣計價商品應有保證金	9(12) v99	SPAN 系統計算之值

欄位		屬性	欄位說明
內容	非境外外資美金計價商品 應有保證金	9(12) v99	由 SPAN 系統計算之值

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 G24 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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 期貨商應存有暨原始保證金)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

4.2.7.26. 訊息代號：G26

訊息名稱：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	14：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)
	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 '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)	

格式說明：

- 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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.7.27. 訊息代號：G27

訊息名稱：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	14：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位已結帳 4：款項已結帳	
	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：結算保證金相關資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
		有價證券評價價值(約當台幣)	9(12)	
		有價證券抵繳金額	9(12) v99	有價證券抵繳 SPAN 應收保證金
		現存有結算保證金總權益數	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元) 指現存有現金結算保證金權益+有價證券抵繳金額
		未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)	9(12) v99	(約當台幣)

格式說明：

1. 現存有結算保證金總權益數=現存有現金結算保證金權益+有價證券抵繳金

額

2. 有價證券評價價值(約當台幣)：計算抵繳價值時，有價證券是以台幣為計算基礎，國際債券面額則依匯率換算方式以外幣(原發行幣別)→美金→台幣，並累計所有有價證券評價價值。

(1). 股票：依價格*繳交股數*(1-折扣比率)計算。

(2). 公債及國際債：由 OTC 提供資料，並依市價*(1-折扣比率)計算。

3. 未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)：

公式：未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)= 有價證券評價價值(約當台幣)-有價證券實際抵繳金額(約當台幣)

4. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

5. 有價證券抵繳金額計算公式

- 一段式抵繳：

實際抵繳金額公式= $\min((\text{結算會員客戶帳 span 應收保金}) * 0.5, \text{有價證券評價價值})$

- 客保有價證券抵繳：

實際抵繳金額公式= $\min((\text{存券期貨客戶帳新台幣 span 應收保證金} - \text{一階段抵繳金額} * 2) * 0.5, \text{客保公債評價價值})$

- 二階段抵繳：

實際抵繳金額公式= $\min((\text{結算會員客戶帳 span 應收保證金} - \text{一階段抵繳金額} * 2 - \text{客保公債抵繳} * 2) * 0.5, \text{二階段抵繳券評價價值})$

6. 客保有價證券只能抵台幣 SPAN 應收保證金。

4.2.7.28. 訊息代號：G28

訊息名稱：商品狀態查詢通知

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	15：商品狀態查詢
	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'999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號'0001000'
訊息資料區	商品代號	X(7)	'9999999' 表查詢當日所有商品狀態

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.29. 訊息代號：G29

訊息名稱：商品狀態查詢回覆

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	15：商品狀態查詢
	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' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	保留欄位	X(5)	
訊息 資料 區	01 資料群組代號	9(2)	
	01 商品代號	X(7)	
	01 結帳盤別	X(2)	'01' -第一盤(約 14:30) 結帳商品 '02' -第二盤(約 16:30) 結帳商品
	01 到期交割狀態	X(1)	'0' -尚未辦理到期作業 '1' -已辦理到期作業 '9' -本日無到期作業
	01 結帳狀態	X(1)	'0' -未結帳 '1' -已結帳

4.2.7.30. 訊息代號：G30

訊息名稱：各盤別保證金及商品損益查詢通知

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	16：各盤別保證金及商品損益查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號及迄號；若帳號起號及迄號同時填入7碼空白，表示查詢該期貨商之總計資料
	交易人帳號迄號	X(7)	
	盤別	X(2)	'01'：查詢第一盤商品之保證金及商品損益 '02'：查詢第一盤及第二盤商品之保證金及商品損益

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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. 於各盤部位結帳後提供各盤商品之保證金及損益資料。

4.2.7.31. 訊息代號：G31

訊息名稱：各盤別保證金及商品損益查詢回覆

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	16：商品到期交割狀態查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	保留欄位	X(5)		
訊息資料區	01 資料群組代號	9(2)	01：各盤別保證金及商品損益	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	查詢期貨商總計資料時，本欄位為 7 碼空白
		盤別	X(2)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有 SPAN 結算保證金數額	9(12) v99	SPAN 系統計算出之應存有保證金
		應存有策略結算保證金數額	9(12) v99	以策略方式算出之應存有保證金
		期貨多空減收之保證金	9(12) v99	
	本日權利金應收款項金額	9(12) v99		
本日權利金應付款項金額	9(12) v99			

欄位		屬性	欄位說明
	本日成交差益數額	9(12) v99	
	本日成交差損數額	9(12) v99	
	本日部位差益數額	9(12) v99	
	本日部位差損數額	9(12) v99	
	本日期到差益數額	9(12) v99	
	本日期到差損數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	

訊息說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 G30 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：各盤別保證金及商品損益)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 若尚未進行該盤結帳作業，則回覆[26007 無此資料]。
7. 回覆資料為任一金額(數額)欄位不為 0 之資料列。
8. 造市帳戶之[應存有 SPAN 結算保證金數額]皆為 0(合併計於自營帳戶下)。
9. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用

之參考匯率將有所不同。

4.2.7.32. 訊息代號：G32

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(多幣別)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	17：結算保證金追繳資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.33. 訊息代號：G33

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(多幣別)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	17：結算保證金追繳資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：結算保證金相關資料	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有結算保證金數額	9(12) v99	包含小數2位共14位，例"15.25"表示為"0000000001525"；
		原存有現金結算保證金權益	9(12) v99	共14位，可為負數。正數時"15.25"表示為"0000000001525"；負數時"-15.25"表示為"-0000000001525" (幣別為2時為約當美元)
		補足前日追繳款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)
		本日存入/移入款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)
		本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為2時為約當美元)

欄位	屬性	欄位說明
本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
本日成交差益數額	9(12) v99	
本日成交差損數額	9(12) v99	
本日部位差益數額	9(12) v99	
本日部位差損數額	9(12) v99	
本日期到差益數額	9(12) v99	
本日期到差損數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	
次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
現存有現金結算保證金權益	9(12) v99	共 14 位，可為負數。正數時 "15.25" 表示為 "00000000001525"；負數時 "-15.25" 表示為 "-00000000001525" (幣別為 2 時為約當美元)
本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權買權買方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
期貨實物交割應收款項	9(12) v99	

欄位	屬性	欄位說明
期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
到期部位結算保證金數額	9(12) v99	
抵繳保證金	9(12) v99	Covered_call 保證金數額，目前皆為 0
期貨多空減收之保證金	9(12) v99	
本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
可提領款項金額	9(12) v99	註 12
應追繳款項金額	9(12) v99	註 13
兌台幣參考匯率	9(4)v 9(6)	幣別為台幣時，本欄位固定為 1
境外外資台幣商品保證金	9(12) v99	幣別為人民幣時，本欄位固定為 0

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項 + 本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日選擇權買權買方轉現貨應付款項 - 本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項 - 本日期貨商品轉現貨應收款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項

— 期貨實物交割應付款項 — 期貨實物不足現金結算應付款項 — 次日申請
提領款項金額 + 本日結匯存入金額 — 本日結匯提領金額

※幣別為 2 時，原存有結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本日
存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本日
結匯存入金額及本日結匯提領金額均為 **約當美元^{附註(1)}**，而現存有結算保證金權
益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為 2 時，本日存入/移入款項金額為約當美元(即每一外幣之存入/移
入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數 2 位後加總)，其餘約當美
元之款項項目計算公式均相同。

2. 應存有結算保證金數額：包含到期部位結算保證金數額

3. 現存有結算保證金總權益數 = 現存有 現金 結算保證金權益 + 有價證券抵繳金
額

4~7. 不適用

8. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。

9. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割
價款。

10. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。

11. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及
結匯郵電費)。

12. 台幣可提領款項金額：台幣現存有總權益數 — 台幣應存有保證金 — [(美元
應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(2)} — 人民幣支應美元應存有不足之款項
金額(約當美元)^{附註(3)}] * 參考匯率(美元兌台幣)] — [(人民幣應存有不足之款
項金額^{附註(4)} — 美元支應人民幣應存有不足之款項金額^{附註(5)}] * 參考匯率(人民
幣兌台幣)] > 0

美元可提領款項金額(約當美元)：美元現存有總權益數(約當美元) — 美元應

存有保證金 - (台幣應存有不足之款項金額^{附註(6)} / 參考匯率(美元兌台幣)) - (人民幣應存有不足之款項金額 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣可提領款項金額 : 人民幣現存有總權益數 - 人民幣應存有保證金 - [(台幣應存有不足之款項金額 - 美元支應台幣應存有不足之款項金額^{附註(7)}) / 參考匯率(人民幣兌台幣)] - (美元應存有不足之款項金額(約當美元) / 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

13. 台幣應追繳款項金額 : 台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 - (美元超額保證金(約當美元) * 參考匯率(美元兌台幣)) - [(人民幣超額保證金 - 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(8)}) * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元應追繳款項金額(約當美元) : 美元應存有保證金 - 美元現存有總權益數 (約當美元) - (人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣應追繳款項金額 : 人民幣應存有保證金 - 人民幣現存有總權益數 > 0

14. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣外之外幣合計值

(2)美元應存有不足之款項金額(約當美元) = Max (美元應存有保證金 - 美元現存有總權益數(約當美元), 0)

(3)人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元) = Min (美元應存有不足之款項金額(約當美元), 人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元))

(4)人民幣應存有不足之款項金額 = Max (人民幣應存有保證金 - 人民幣現存有總權益數, 0)

(5)美元支應人民幣應存有不足之款項金額 = Min (人民幣應存有不足之款項金

額，美元超額保證金 / 參考匯率(人民幣兌美元))

(6) 台幣應存有不足之款項金額 = Max (台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數, 0)

(7) 美元支應台幣應存有不足之款項金額 = Min (台幣應存有不足之款項金額, 美元超額保證金 * 參考匯率(美元兌台幣))

(8) 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額 = Min (人民幣超額保證金, 美元應追繳款項金額 / 參考匯率(人民幣兌美元))

4.2.7.34. 訊息代號：G34

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(SPAN+多幣別)

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	18：結算保證金追繳資料查詢
	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 '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)	

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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(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。

4.2.7.35. 訊息代號：G35

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(SPAN+多幣別)

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)	7：結算保證金作業	
	作業項目	9(2)	18：結算保證金追繳資料查詢	
	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' 999'	
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間	
	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：結算保證金相關資料	
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有結算保證金數額	9(12) v99	SPAN 系統計算出之應存有保證金
		原存有現金結算保證金權益	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元) 共 14 位，可為負數。正數時 "15.25" 表示為 "0000000001525"；負數時 "-15.25" 表示為 "-0000000001525"
		補足前日追繳款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
		本日存入/移入款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
		本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)

欄位	屬性	欄位說明
本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
本日成交差益數額	9(12) v99	
本日成交差損數額	9(12) v99	
本日部位差益數額	9(12) v99	
本日部位差損數額	9(12) v99	
本日期到差益數額	9(12) v99	
本日期到差損數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	
次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
現存有現金結算保證金權益	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元) 共 14 位，可為負數。正數時 "15.25" 表示為 "0000000001525"；負數時 "-15.25" 表示為 "-0000000001525"
本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權買權買方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日選擇權賣權買方轉現貨應付款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
期貨實物交割應收款項	9(12) v99	

欄位	屬性	欄位說明
期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
到期部位結算保證金數額	9(12) v99	
抵繳保證金	9(12) v99	coveredcall 保證金數額，目前為 0
期貨多空減收之保證金	9(12) v99	依 SPAN 系統整戶計算，不另計算之
本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
可提領款項金額	9(12) v99	註 7
應追繳款項金額	9(12) v99	註 8
兌台幣參考匯率	9(4)v 9(6)	幣別為台幣時，本欄位固定為 1
境外外資台幣商品保證金	9(12) v99	幣別為人民幣時，本欄位固定為 0

格式說明：

1. 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項 + 本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日選擇權買權買方轉現貨應付款項 - 本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項 - 本日期貨商品轉現貨應收款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項

— 期貨實物交割應付款項 — 期貨實物不足現金結算應付款項 — 次日申請
提領款項金額 + 本日結匯存入金額 — 本日結匯提領金額

※幣別為 2 時，原存有現金結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本日存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本日結匯存入金額及本日結匯提領金額均為約當美元^{附註(1)}，而現存有結算保證金總權益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為 2 時，本日存入/移入款項金額為約當美元^{附註(1)} (即每一外幣之存入/移入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數 2 位後加總)，其餘約當美元之款項項目計算公式均相同。

現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金額

2. 應存有結算保證金數額：

2.1. 若台幣：則 SPAN 系統計算出之台幣應存有保證金(扣除股票選擇權買權賣方抵繳保證金及扣除境外外資台幣商品保證金且包含到期部位結算保證金數額)

2.2. 若美元：則 SPAN 系統計算出之美元應存有保證金(包含境外外資台幣商品保證金以美元匯率換算之美元)

2.3. 若人民幣：則 SPAN 系統計算出所有人民幣商品之應存有保證金

3. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。

4. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割價款。

5. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。

6. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及結匯郵電費)。

7. 台幣可提領款項金額：台幣現存有總權益數 — 台幣應存有保證金 — [(美元

應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(2)} - 人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(3)} * 參考匯率(美元兌台幣)] - [(人民幣應存有不足之款項金額^{附註(4)} - 美元支應人民幣應存有不足之款項金額^{附註(5)} * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元可提領款項金額(約當美元)：美元現存有總權益數(約當美元) - 美元應存有保證金 - (台幣應存有不足之款項金額^{附註(6)} / 參考匯率(美元兌台幣)) - (人民幣應存有不足之款項金額 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣可提領款項金額：人民幣現存有總權益數 - 人民幣應存有保證金 - [(台幣應存有不足之款項金額 - 美元支應台幣應存有不足之款項金額^{附註(7)}) / 參考匯率(人民幣兌台幣)] - (美元應存有不足之款項金額(約當美元) / 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

8. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 - (美元超額保證金(約當美元) * 參考匯率(美元兌台幣)) - [(人民幣超額保證金 - 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(8)}) * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元應追繳款項金額(約當美元)：美元應存有保證金 - 美元現存有總權益數(約當美元) - (人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣應追繳款項金額：人民幣應存有保證金 - 人民幣現存有總權益數 > 0

9. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於第一盤及第二盤結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣外之外幣合計值

(2)美元應存有不足之款項金額(約當美元) = Max (美元應存有保證金 - 美元現存有總權益數(約當美元), 0)

(3)人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元) = $\text{Min}(\text{美元應存有不足之款項金額(約當美元)}, \text{人民幣超額保證金} * \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

(4)人民幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{人民幣應存有保證金} - \text{人民幣現存有總權益數}, 0)$

(5)美元支應人民幣應存有不足之款項金額 = $\text{Min}(\text{人民幣應存有不足之款項金額}, \text{美元超額保證金} / \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

(6)台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{台幣應存有保證金} - \text{台幣現存有總權益數}, 0)$

(7)美元支應台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Min}(\text{台幣應存有不足之款項金額}, \text{美元超額保證金} * \text{參考匯率(美元兌台幣)})$

(8)人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額 = $\text{Min}(\text{人民幣超額保證金}, \text{美元應追繳款項金額} / \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

4.2.7.36. 訊息代號：G36

訊息名稱：盤中保證金追繳通告(多幣別)

訊息類別：廣播通告訊息

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)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	19：盤中保證金追繳通告
	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 '999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位部位已結帳
	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：盤中保證金追繳
	01 期貨商代號	X(7)	
	資料群組內容	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
	應追繳數額	9(12)	依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準 (註 6)
	兌台幣參考匯率	9(4)v 9(6)	幣別為台幣時，本欄位固定為 1

格式說明：

8. 為期交所主動傳送給結算會員之正常資料格式。
9. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式，得到一特定之要求代碼(Request ID)為 integer 99，用以代表此為廣播通告訊息。
10. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號

(01)。

11. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
12. 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 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

6. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 - (美元超額保證金(約當美元^{附註(1)}) * 參考匯率(美元兌台幣)) - [(人民幣超額保證金 - 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(2)}) * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元應追繳款項金額(約當美元)：美元應存有保證金 - 美元現存有總權益數(約當美元) - (人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣應追繳款項金額：人民幣應存有保證金 - 人民幣現存有總權益數 > 0

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣外之外幣合計值

(2)人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額 = Min(人民幣超額保證金，美元應追繳款項金額 / 參考匯率(人民幣兌美元))

4.2.8. 標的證券抵繳保證金作業

4.2.8.1. 訊息代號：H01

訊息名稱：交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入明細查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	01：交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	證券代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有證券匯入資料
	專戶類別	X(1)	"3" -抵繳專戶 "4" -期貨轉現貨

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。

4.2.8.2. 訊息代號：H02

訊息名稱：交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入明細查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業	
	作業項目	9(2)	01：交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入明細查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳 (期貨轉現貨 T 日 16:30~17:30 為 0，其他時間為 7)	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入明細資料	
	01 資料群組內容	序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		匯出帳戶類別	X(1)	1-個人帳戶 2-期貨商抵繳帳戶 (期貨轉現貨，帳戶類別皆為 1)
		匯出證券商代號	X(7)	若匯出帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶，否則為個人匯出證券商代號
		匯出集保帳號	X(7)	若匯出帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶，否則為個人匯出集保帳號

欄位		屬性	欄位說明
	證券代號	X(7)	
	匯入股數(面額)	9(13) v99	
	匯撥時間	9(6)	交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入抵繳專戶之時間。
	匯撥交易序號	X(13)	
	匯撥日期	9(8)	交易人股票、國際債及期貨轉現貨匯入之日期。
	原匯出證券商代號	X(7)	若匯出帳戶類別為'1'者，為空白 若匯出帳戶類別為'2'者，為原交易人匯至期貨商抵繳帳戶之匯出證券商代號
	原匯出集保帳號	X(7)	若匯出帳戶類別為'1'者，為空白 若匯出帳戶類別為'2'者，為原交易人匯至期貨商抵繳帳戶之匯出帳號
	專戶類別	X(1)	"3"-抵繳專戶 "4"-期貨轉現貨

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：交易人標的證券匯入明細)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.8.3. 訊息代號：H03

訊息名稱：交易人股票、國際債及期貨轉現貨餘額查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	02：交易人股票、國際債及期貨轉現貨餘額查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員代號或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間起號
	交易人帳號訖號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間訖號
	證券代號	X(7)	得為' 9999999' 以查詢所有證券匯入資料
	專戶類別	X(1)	"3" - 抵繳專戶 "4" - 期貨轉現貨

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。

4.2.8.4. 訊息代號：H04

訊息名稱：交易人股票、國際債及期貨轉現貨餘額查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	02：交易人股票、國際債及期貨轉現貨餘額查詢
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
	目地單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳 (期貨轉現貨 T 日 16:30~17:30 為 0，其他時間為 7)
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	資料群組代號	9(2)	01：交易人股票、國際債及期貨轉現貨餘額資料
	01 資 料 群 組 內 容	結算會員代號	X(7)
期貨商代號		X(7)	
交易人帳號		X(7)	
證券代號		X(7)	
昨日餘額		9(13) V99	
本日匯入股數(面額)		9(13) V99	本日上午 8:30 至 15:30 匯入股數 專戶類別為 4(期貨轉現貨):本日匯入股數
昨日匯入本日生效股數(面額)		9(13) V99	昨日 15:30 至 18:00 匯入股數

欄位		屬性	欄位說明
	本日申請匯出股數(面額)	9(13) V99	交易人本日申請匯出期交所抵繳專戶之股數(含減資合併之契約調整返還及處分股數) 專戶類別為 4(期貨轉現貨):本日返還股數
	異常匯入調整轉入股數(面額)	9(13) V99	
	異常匯出調整轉入股數(面額)	9(13) V99	
	買權 及期貨 賣方交割轉出股數	9(13)	證券代號為國際債時，此值為 0
	賣權買方交割轉出股數	9(13)	證券代號為國際債時，此值為 0
	買權賣方&賣權買方申請交割扣減之股數	9(13)	證券代號為國際債時，此值為 0

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H03 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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(01 或 02)內容。
4. 期貨商(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：交易人股票抵繳專戶餘額；02：交易人國際債抵繳專戶餘額)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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. 專戶類別為 “3” — 抵繳專戶時：
 - A. 結帳記號：“0” — 抵繳專戶未結帳
“7” — 抵繳專戶已結帳

B. 交易人存券餘額 = 昨日餘額 + 本日申請匯入股數 + 昨日匯入本日生效
匯入股數 - 本日申請匯出股數 + 異常匯入調整轉入股數 + 異常匯出
調整轉入股數 - 買權賣方交割轉出股數 - 賣權買方交割轉出股數

7. 專戶類別為 “4” - 期貨轉現貨時

交易人存券餘額 = 昨日餘額 + 本日匯入股數 - 本日申請匯出股數(面額)
+ 異常匯出調整轉入股數 - 買權及期貨賣方交割轉出股數 - 賣權買方交割
轉出股數

4.2.8.5. 訊息代號：H05

訊息名稱：股票及國際債匯入異常資料查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	03：匯入異常資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	專戶類別	X(1)	"3" -抵繳專戶

格式說明：

- 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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.6.6. 訊息代號：H06

訊息名稱：股票及國際債匯入異常資料查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業	
	作業項目	9(2)	03：股票及國際債匯入異常資料查詢	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：匯入異常資料	
	01 資料 群組 內容	異常日期	9(8)	格式為 YYYYMMDD
		序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		交易人身分證字號	X(10)	
		匯出帳戶類別	X(1)	1-個人帳戶 2-期貨商抵繳帳戶
		匯出證券商代號	X(7)	若匯出帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶，否則為個人匯出證券商代號
		匯出集保帳號	X(7)	若匯出帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶，否則為個人匯出集保帳號

欄位		屬性	欄位說明
	證券代號	X(7)	
	匯入股數(面額)	9(13) V99	
	匯撥時間	9(6)	
	匯撥交易序號	X(13)	
	異常原因	X(1)	1：證券期貨身分證字號或營利事業編號不符 2：交易人期貨帳戶不存在 3：與交易人抵繳約定碼不符
	調整註記	X(1)	空白：尚未調整 1：調整入交易人存券帳 2：調整券返還原匯入證券帳號，交易成功 3：調整券返還原匯入證券帳號，交易待處理中 4：調整券返還原匯入證券帳號，交易失敗
	調整日期	X(8)	YYYYMMDD
	原匯出交易人證券商代號	X(7)	若匯入來源為'1'者，為空白 若匯入來源為'2'者，為原交易人匯至期貨商抵繳帳戶之匯出證券商代號
	原匯出交易人集保帳號	X(7)	若匯入來源為'1'者，為空白 若匯入來源為'2'者，為原交易人匯至期貨商抵繳帳戶之匯出帳號
	專戶類別	X(1)	"3"-抵繳專戶

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H05 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：匯

入異常資料)下之各筆資料群組內容。

5. 期貨商(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)。

4.2.8.7. 訊息代號：H07

訊息名稱：股票及國際債存券匯出申請通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	04：股票及國際債存券匯出申請
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲申請之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲申請之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為申請之交易人帳號
	證券代號	X(7)	須輸入單一證券代號
	股數(面額)	9(13) V99	可為原輸入股數之負值以沖正該筆申請資料
	匯入帳戶類別	X(1)	1-個人帳戶 2-期貨商抵繳帳戶
	匯入證券商代號	X(7)	若匯入帳戶類別為' 1' 者，為個人帳戶 若匯入帳戶類別為' 2' 者，為期貨商抵繳帳戶
	匯入集保帳號	X(7)	若匯入帳戶類別為' 1' 者，為個人帳戶 若匯入帳戶類別為' 2' 者，為期貨商抵繳帳戶
專戶類別	X(1)	"3"-抵繳專戶	

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。

4.2.8.8. 訊息代號：H08

訊息名稱：股票及國際債存券匯出申請回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	04：存券匯出申請
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 H07 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.8.9. 訊息代號：H09

訊息名稱：股票、國際債及期貨轉現貨存券匯出申請資料查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	05：股票、國際債及期貨轉現貨存券匯出申請資料查詢通知
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	專戶類別	X(1)	“3” - 抵繳專戶 “4” - 期貨轉現貨

格式說明：

- 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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.8.10. 訊息代號：H10

訊息名稱：股票、國際債及期貨轉現貨存券匯出申請資料查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業	
	作業項目	9(2)	05：股票、國際債及期貨轉現貨存券匯出申請資料查詢通知	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：匯出申請未截止 8：匯出申請已截止 (期貨轉現貨固定為8)	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：存券匯出申請資料	
	01 資料 群組 內容	序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		證券代號	X(7)	
		股數(面額)	9(13) V99	
		匯入帳戶類別	X(1)	1-個人帳戶 2-期貨商抵繳帳戶 (期貨轉現貨，帳戶類別皆為1)

欄位		屬性	欄位說明
	匯出類別	X(1)	E：申請匯出，R：減資合併之契約調整返還資料，h：處分申請匯出資料，b：期貨轉現貨撥轉至買方，s：期貨轉現貨返還賣方
	匯出狀態	X(1)	' '：未處理匯出 Y：已處理匯出，Q：因證券期貨身分證字號或營利事業編號不符匯出失敗，返還入交易人存券帳，R：因交易人證券帳戶不存在匯出失敗，返還入交易人存券帳，X：因權益數不足，返還入交易人存券帳，N：沖正
	匯入證券商代號	X(7)	若匯入帳戶類別為' 1' 者，為個人帳戶 若匯入帳戶類別為' 2' 者，為期貨商抵繳帳戶
	匯入集保帳號	X(7)	若匯入帳戶類別為' 1' 者，為個人帳戶 若匯入帳戶類別為' 2' 者，為期貨商抵繳帳戶
	專戶類別	X(1)	"3" - 抵繳專戶 "4" - 期貨轉現貨

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H09 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：存券匯出申請資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.8.11. 訊息代號：H11

訊息名稱：買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	06：買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數之登錄
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	證券代號	X(7)	
	申請交割可扣減之股數	9(10)	1. 買權賣方及賣權買方交易人申請由抵繳專戶交割可扣減之股數，但不可超過交易人抵繳專戶存券餘額 2. 以最後申請股數為準或該值為零時取消該筆申請資料
	專戶類別	X(1)	3-抵繳專戶

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. 此交易可辦理賣權買方由抵繳專戶申請交割扣減股數之登錄

4. 若欲更正已登錄之申請交割可扣減股數，則可再重新輸入欲申請交割扣減之股數。

4.2.8.12. 訊息代號：H12

訊息名稱：買權賣方及賣權買方申請交割扣減股數登錄回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	06：買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數之登錄
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 H11 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.8.13. 訊息代號：H13

訊息名稱：交易人公債餘額查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	07：交易人公債餘額查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員代號或期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間起號 起號為空白得查詢客保有價證券
	交易人帳號訖號	X(7)	為欲查詢之交易人帳號區間訖號 得為'9999999'以查詢所有交易人之資料 訖號為空白得查詢客保有價證券
	公債代號	X(7)	得為'9999999'以查詢所有公債匯入資料
	專戶類別	X(1)	"3"-抵繳專戶

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. 交易人帳號起號：0000000，交易人帳號訖號：9999999 得查全部交易人餘額；

交易人帳號起號：' '，交易人帳號訖號：' ' 得查客保有價

證券；交易人帳號起號：’ ’，交易人帳號訖號：9999999 得查所有

交易人及客保有價證券抵繳餘額資料。

4.2.8.14. 訊息代號：H14

訊息名稱：交易人公債餘額查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業	
	作業項目	9(2)	07：交易人公債餘額查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'	
	目地單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：期交所專戶未結帳 7：期交所專戶已結帳	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
	資料群組代號	9(2)	01：交易人公債抵繳專戶餘額資料	
	03 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	<u>空白表示為客保有價證券資料</u>
		公債代號	X(7)	
		期交所抵繳專戶銀行代號	X(7)	
昨日餘額		9(13)		
本日匯入面額		9(13)		
本日匯出面額	9(13)	交易人本日匯出期交所抵繳專戶之股數 (含減資合併之契約調整返還及處分股數)		

欄位		屬性	欄位說明
	匯出異常轉入面額	9(13)	
	交割轉出面額	9(13)	
	公債賣方交易人申請交割匯出面額	9(13)	
	到期還本轉出面額	9(13)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H13 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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(01)內容。
4. 期貨商(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)。
5. 專戶類別為 “3” — 抵繳專戶時：
 - A. 結帳記號：“0” — 抵繳專戶未結帳
“7” — 抵繳專戶已結帳
 - B. 交易人存券餘額 = 昨日餘額 + 本日匯入面額 - 本日匯出面額 + 異常匯出轉入面額 - 交割轉出面額 - 到期還本轉出面額

4.2.8.15. 訊息代號：H15

訊息名稱：交易人公債抵繳明細資料申報通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	08：交易人公債抵繳明細資料申報
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	欲登錄資料之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號， <u>申報客保有價證券應填空白</u>
	公債代號	X(7)	
	匯入面額	9(13)	
	期交所抵繳專戶銀行代號	X(7)	
	期交所抵繳專戶銀行帳號	X(21)	
	匯出帳戶類別	X(1)	1- 個人帳戶 2- 期貨商抵繳帳戶 4- <u>客保有價證券</u>
	匯出銀行代號	X(7)	1. 若匯出帳戶類別為' 1' 者，則為個人匯出銀行代號 2. 若匯出帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶 3. <u>若匯出帳戶類別為' 4' 者，則為客保有價證券</u>

	匯出銀行帳號	X(21)	1. 若匯出帳戶類別為' 1' 者, 則為個人匯出銀行帳號 2. 若匯出帳戶類別為' 2' 者, 則為期貨商抵繳帳戶 3. 若匯出帳戶類別為' 4' 者, 則為 <u>客保有價證券</u>
	匯撥日期	X(8)	

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。

4.2.8.16. 訊息代號：H16

訊息名稱：交易人公債抵繳明細資料申報回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	8：標的證券抵繳保證金作業	
	作業項目	9(2)	08：交易人公債抵繳明細資料申報	
	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)	期貨商代號	
	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：交易人公債抵繳明細資料申報	
	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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 H15 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表

示僅有此筆資料。

4.2.8.17. 訊息代號：H17

訊息名稱：交易人公債抵繳明細申報資料查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	09：交易人公債抵繳明細申報資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為查詢之交易人帳號 <u>得為空白查詢客保有價證券</u> 得為 '9999999' 以查詢所有交易人之資料
	查詢類別	X(1)	"1" -已確認 "2" -未確認 "9" -全部

格式說明：

- 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.8.18. 訊息代號：H18

訊息名稱：交易人公債抵繳申報資料查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業	
	作業項目	9(2)	09：交易人公債抵繳申報資料查詢回覆	
	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)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)		
	結帳記號	9(1)	0：公債匯入未截止 9：公債匯入已截止	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號	
	資料群組代號	9(2)	01：交易人公債抵繳申報資料	
	01 資料 群 組 內 容	序號	9(8)	
		結算會員代號	X(7)	欲登錄資料之結算會員代號
		期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
		交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號 空白表示客保有價證券資料
		公債代號	X(7)	
本日匯入面額		9(13)		
期交所抵繳專戶銀行代號		X(7)		
期交所抵繳專戶銀行帳號		X(21)		

欄位		屬性	欄位說明
	匯出帳戶類別	X(1)	1- 抵繳個人 2- 抵繳期貨商 4- 客保有價證券
	匯出銀行代號	X(7)	1. 若帳戶匯出類別為' 1' 者, 則為個人匯出銀行代號 2. 若帳戶匯出類別為' 2' 者, 則為期貨商抵繳帳戶 3. 若帳戶匯出類別為' 4' 者, 則為客保有價證券
	匯出銀行帳號	X(21)	1. 若帳戶匯出類別為' 1' 者, 則為個人匯出銀行帳號 2. 若帳戶匯出類別為' 2' 者, 則為期貨商抵繳帳戶 3. 若帳戶匯出類別為' 4' 者, 則為客保有價證券
	匯撥日期	X(8)	
	匯撥時間	X(6)	
	確認碼	X(1)	'Y' - 經期交所確認與清算銀行資料相符 ' ' - 為未確認
	申報日期	X(8)	

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。

4.2.8.19. 訊息代號：H19

訊息名稱：公債匯出申請/賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	10：公債匯出申請/賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶之通知
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
息資料區	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	空白表示客保有價證券資料
	公債代號	X(7)	
	期交所抵繳專戶銀行代號	X(7)	
	面額	9(13)	1. 匯入帳戶類別為' 1' 或' 2' 或' 4' 時，可為原輸入面額之負值以沖正該筆申請資料 2. 匯入帳戶類別為' 3' 時，以最後申請面額為準或該值為零時取消該筆申請資料
	匯入帳戶類別	X(1)	1-個人帳戶 2-期貨商抵繳帳戶 3-交割匯出 4-客保有價證券

	匯入銀行代號	X(7)	<ol style="list-style-type: none"> 1. 若匯入帳戶類別為' 1' 者，則為個人匯出銀行代號 2. 若匯入帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶 3. 若匯入帳戶類別為' 3' 者，則為空白 4. 若匯入帳戶類別為' 4' 者，則為客保有價證券
	匯入銀行帳號	X(21)	<ol style="list-style-type: none"> 1. 若匯入帳戶類別為' 1' 者，則為個人匯出銀行帳號 2. 若匯入帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶 3. 若匯入帳戶類別為' 3' 者，則為空白 4. 若匯入帳戶類別為' 4' 者，則為客保有價證券

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。

4.2.8.20. 訊息代號：H20

訊息名稱：公債匯出申請/賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	10：公債匯出申請/賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶之回覆
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 H19 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.8.21. 訊息代號：H21

訊息名稱：公債匯出資料查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	11：公債匯出資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號 <u>起號為空白得查詢客保有價證券</u>
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號 得為 '9999999' 以查詢所有交易人之資料 <u>迄號為空白得查詢客保有價證券</u>

格式說明：

- 期貨商(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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
- 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料。
- 交易人帳號起號：0000000，交易人帳號迄號：9999999 得查全部交易人餘額；
交易人帳號起號：' '，交易人帳號迄號：' ' 得查客保有價**

4.2.8.22. 訊息代號：H22

訊息名稱：公債匯出申請資料查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	11：公債匯出資料查詢
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	0：匯出申請未截止 8：匯出申請已截止
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
\ 訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：存券匯出申請資料
	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	<u>空白表示客保有價證券資料</u>
	公債代號	X(7)	
	期交所抵繳專戶銀行代號	X(7)	
	面額	9(13)	
	匯出類別	X(1)	(1-一般匯出、2-處分匯出)

欄位		屬性	欄位說明
	匯出狀態	X(1)	' -未處理匯出 Y：已處理匯出，Q：因證券期貨身分證字號或營利事業編號不符匯出失敗，返還入交易人存券帳，R：因交易人銀行帳戶不存在匯出失敗，返還入交易人存券帳，X：因權益數不足，返還入交易人存券帳，N：沖正
	匯入帳戶類別	X(1)	1- 個人帳戶 2- 期貨商抵繳帳戶 <u>4- 客保有價證券</u>
	匯入銀行代號	X(7)	1. 若匯入帳戶類別為' 1' 者，則為個人匯出銀行代號 2. 若匯入帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶 3. <u>若匯入帳戶類別為' 4' 者，則為客保有價證券</u>
	匯入銀行帳號	X(21)	1. 若匯入帳戶類別為' 1' 者，則為個人匯出銀行帳號 2. 若匯入帳戶類別為' 2' 者，則為期貨商抵繳帳戶 3. <u>若匯入帳戶類別為' 4' 者，則為客保有價證券</u>

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H21 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(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. 期貨商(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：存券匯出申請資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(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)。

4.2.8.23. 訊息代號：H23

訊息名稱：交易人公債利息滙款帳號申報通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	12：交易人公債利息滙款帳號申報
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	利息滙款銀行代號	X(7)	
	利息滙款銀行帳號	X(21)	

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。

4.2.8.24. 訊息代號：H24

訊息名稱：交易人公債利息滙款帳號申報回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	12：交易人公債利息滙款帳號申報
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 H23 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.8.25. 訊息代號：H25

訊息名稱：交易人公債利息明細資料查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	13：交易人公債利息明細資料
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號 起號為空白得查詢客保有價證券
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號， 得為 '9999999' 以查詢所有交易人之資料 迄號為空白得查詢客保有價證券
	查詢月份	X(6)	YYYYMM

格式說明：

- 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
- 交易人帳號起號：0000000，交易人帳號迄號：9999999 得查全部交易人餘額；
交易人帳號起號：' '，交易人帳號迄號：' ' 得查客保有價

4.2.8.26. 訊息代號：H26

訊息名稱：交易人公債利息明細資料查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	13：交易人公債利息明細資料回覆
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人公債利息明細資料
	還息日期	X(8)	
	公債代號	X(7)	
	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	空白表示客保有價證券資料
	面額	9(13)	
	利息	9(13)	
	稅額	9(13)	
利息滙款銀行代號	X(7)		

欄位		屬性	欄位說明
	利息滙款銀行帳號	X(21)	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H25 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

4.2.8.27. 訊息代號：H27

訊息名稱：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	14：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	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)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號，'9999999'以查詢所有期貨商之資料
	抵繳約定碼	X(1)	1-僅抵繳自身部位 2-同意抵繳他人部位 4-客保有價證券 9-全部
	交易人帳號起號	X(7)	若抵繳約定碼為1時，輸入交易人帳號
	交易人帳號迄號	X(7)	若抵繳約定碼為2、4時，輸入空白

格式說明：

- 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
- 抵繳約定碼：1-僅抵繳自身部位，交易人帳號起號：0000000，交易人帳號訖號：9999999 得查全部交易人餘額；抵繳約定碼：2-同意抵繳他人部位，交易人帳號起號：' '，交易人帳號訖號：' ' 得查全部抵繳期貨

4.2.8.28. 訊息代號：H28

訊息名稱：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	14：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢
	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)	期貨商代號
	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 4：款項已結帳
	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：交易人標的證券抵繳金額明細資料
	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	1. 期貨商代號：非空白 交易人帳號：非空白 表示抵繳至個人部位。 (一段式抵繳)
	01 資料群組內容 交易人帳號	X(7)	2. 期貨商代號：空白 交易人帳號：空白 表示為同意抵繳至結算會員部位。 (二段式抵繳) 3. 期貨商代號：非空白 交易人帳號：空白 表示為同意抵繳至期貨商部位。 (客保有價證券抵繳)

欄位		屬性	欄位說明
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
	應收保證金	9(13) V99	
	有價證券評價價值(約當台幣)	9(13) V99	幣別為 2 時此值為 0
	有價證券抵繳金額	9(13) V99	
	未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)	9(13) V99	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H27 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

4.2.8.29. 訊息代號：H29

訊息名稱：交易人抵繳約定碼申報通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	15：交易人抵繳約定碼申報
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號	X(7)	
	抵繳約定碼	X(1)	1-僅抵繳自身部位 2-同意抵繳他人部位

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。

4.2.8.30. 訊息代號：H30

訊息名稱：交易人抵繳約定碼申報回覆

訊息類別：單筆回覆訊息

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	15：交易人抵繳約定碼申報
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	00000：表接收正常

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. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼(Request ID)，與傳送 H29 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商應用程式收取之資料格式為訊息控制區。
4. 期貨商應用程式依 MTS 服務程式功能參數，取得之 RC 應為 integer 0，即表示僅有此筆資料。

4.2.8.31. 訊息代號：H31

訊息名稱：交易人公債利息滙款帳號及抵繳約定碼資料查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	16：交易人公債利息滙款帳號及抵繳約定碼資料
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	期貨商代號	X(7)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號
	交易人帳號迄號	X(7)	為查詢之交易人帳號迄號

格式說明：

- 期貨商(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 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.8.32. 訊息代號：H32

訊息名稱：交易人公債利息滙款帳號及抵繳約定碼資料查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	16：交易人公債利息滙款帳號及抵繳約定碼資料回覆
	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)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：交易人公債利息滙款帳號及抵繳資料
	期貨商代號	X(7)	欲登錄資料之期貨商代號
	交易人帳號	X(7)	為登錄資料之交易人帳號
	利息滙款銀行代號	X(7)	
	利息滙款銀行帳號	X(21)	
	抵繳約定碼	X(1)	1-僅抵繳自身部位 2-同意抵繳他人部位

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(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 H31 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

4.2.8. 訊息代號：E99

訊息名稱：異常訊息回覆訊息類別：單筆回覆訊息

訊息格式：

欄位名稱		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)	與原要求訊息之作業類別相同
	作業項目	9(2)	與原要求訊息之作業項目相同
	來源單位代號	X(7)	為期交所單位代號 '0001000'
	目的地單位代號	X(7)	為期貨商(結算會員)代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	訊息代碼	9(5)	不為 '00000' 之內容，詳見附錄三

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之異常資料格式，且為單筆之訊息資料。
2. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 界面功能所取得之要求代碼(Request ID)，連接接收之單筆回覆訊息資料。
3. 期貨商(結算會員)應用程式取得 MTS 服務程式功能參數之 RC 值應為 '0' (0：資料結束)。

5. 附錄

5.1. 訊息代號一覽表

交易代號	交易名稱	訊息代號	訊息名稱	備註
0101	交易人部位資料查詢	A01	交易人部位資料查詢通知	
		A02	交易人部位資料查詢回覆	
0102	期貨商部位資料查詢	A03	期貨商部位資料查詢通知	
		A04	期貨商部位資料查詢回覆	
0103	結算會員部位資料查詢	A05	結算會員部位資料查詢通知	
		A06	結算會員部位資料查詢回覆	
0104	部位調整(互抵)申請	A07	部位調整(互抵)申請通知	
		A08	部位調整(互抵)申請回覆	
0105	部位調整(互抵)申請記錄查詢	A09	部位調整(互抵)申請記錄查詢通知	
		A10	部位調整(互抵)申請記錄查詢回覆	
0201	結算保證金查詢	B01	結算保證金查詢通知	*
		B02	結算保證金查詢回覆	*
0202	結算保證金追繳資料查詢	B03	結算保證金追繳資料查詢通知	*
		B04	結算保證金追繳資料查詢回覆	*
0203	盤中保證金追繳通告	B05	盤中保證金追繳通告	*
0204	結算保證金餘額查詢	B06	結算保證金餘額查詢通知	*
		B07	結算保證金餘額查詢回覆	*
0301	交易人基本資料登錄(台指)	C01	交易人基本資料登錄通知	*
		C02	交易人基本資料登錄回覆	*

期貨結算系統期貨商(結算會員)資訊傳輸界面規範書

0302	交易人基本資料查詢(台指)	C03	交易人基本資料查詢通知	*
		C04	交易人基本資料查詢回覆	*
0303	公告資料查詢通知	C05	公告資料查詢通知	
		C06	公告資料查詢回覆	
0304	結算服務費查詢	C07	結算服務費查詢通知	
		C08	結算服務費查詢回覆	
0305	交易人基本資料登錄(個股)	C09	交易人基本資料登錄通知	#
		C10	交易人基本資料登錄回覆	
0306	交易人基本資料查詢(個股)	C11	交易人基本資料查詢通知	
		C12	交易人基本資料查詢回覆	#
0307	交易人公債帳戶登錄(公債)暨交易人集保帳號登錄(個股)	C13	交易人公債帳戶登錄暨交易人集保帳號登錄通知	
		C14	交易人公債帳戶登錄暨交易人集保帳號登錄回覆	
0308	交易人公債帳戶查詢(公債)	C15	交易人公債帳戶查詢通知	
		C16	交易人公債帳戶查詢回覆	
0309	期交稅資料查詢(台幣商品)	C17	期交稅資料查詢通知	
		C18	期交稅資料查詢回覆	
0310	交易人總開戶數查詢	C19	交易人總開戶數查詢通知	
		C20	交易人總開戶數查詢回覆	
0311	期交稅資料查詢	C21	期交稅資料查詢通知	
		C22	期交稅資料查詢回覆	
0312	匯率暨利率資料查詢	C23	匯率暨利率資料查詢通知	
		C24	匯率暨利率資料查詢回覆	
0401	自動履約名冊查詢(台指)	D01	自動履約名冊查詢通知	

		D02	自動履約名冊查詢回覆	
0402	自動履約名冊登錄(台指)	D03	自動履約名冊登錄通知	
		D04	自動履約名冊登錄回覆	
0403	自動履約名冊刪除(台指)	D05	自動履約名冊刪除通知	
		D06	自動履約名冊刪除回覆	
0404	履約指派名冊查詢(台指)	D07	履約指派名冊查詢通知	
		D08	履約指派名冊查詢回覆	
0405	履約參考名冊查詢(台股)	D09	履約參考名冊查詢通知	
		D10	履約參考名冊查詢回覆	
0406	交易人標的證券匯入明細查詢(台股)	D11	交易人標的證券匯入明細查詢通知	
		D12	交易人標的證券匯入明細查詢回覆	
0407	交易人標的證券餘額查詢(台股)	D13	交易人標的證券餘額查詢通知	
		D14	交易人標的證券餘額查詢回覆	
0408	匯入異常資料查詢(台股)	D15	匯入異常資料查詢通知	
		D16	匯入異常資料查詢回覆	
0409	存券匯出申請(台股)	D17	存券匯出申請通知	
		D18	存券匯出申請回覆	
0410	存券匯出申請查詢(台股)	D19	存券匯出申請查詢通知	
		D20	存券匯出申請查詢回覆	
0411	匯出異常資料查詢(台股)	D21	匯出異常資料查詢通知	
		D22	匯出異常資料查詢回覆	
0412	匯出異常集保帳號調整(台股)	D23	匯出異常集保帳號調整通知	
		D24	匯出異常集保帳號調整回覆	

0413	調整個股(1:履約、2:指派、3:履約參考)集保帳號暨調整公債(4:交割)銀行帳戶	D25	調整個股集保帳號 暨 調整公債銀行帳戶通知	
		D26	調整個股集保帳號 暨 調整公債銀行帳戶回覆	
0414	撥轉名冊查詢(個股)	D27	撥轉名冊查詢通知	
		D28	撥轉名冊查詢回覆	
0416	自動履約名冊查詢(個股)	D31	自動履約名冊查詢通知	
		D32	自動履約名冊查詢回覆	
0417	自動履約名冊登錄(個股)	D33	自動履約名冊登錄通知	
		D34	自動履約名冊登錄回覆	
0418	自動履約名冊刪除(個股)	D35	自動履約名冊刪除通知	
		D36	自動履約名冊刪除回覆	
0419	履約指派名冊查詢(個股)	D37	履約指派名冊查詢通知	
		D38	履約指派名冊查詢回覆	
0420	債券商品交割明細查詢(公債)	D39	債券商品交割明細查詢通知	
		D40	債券商品交割明細查詢回覆	
0421	賣方交割債券明細申報(公債)	D41	賣方交割債券明細申報通知	
		D42	賣方交割債券明細申報回覆	
0422	買賣方交割債券明細查詢(公債)	D43	買賣方交割債券明細查詢通知	
		D44	買賣方交割債券明細查詢回覆	
0423	交易人標的債券匯入明細查詢(公債)	D45	交易人標的債券匯入明細查詢通知	
		D46	交易人標的債券匯入明細查詢回覆	
0424	交割價款明細查詢(公債)	D47	交割價款明細查詢通知	
		D48	交割價款明細查詢回覆	
0425	交易人標的證券匯入明細查詢(CoveredCall)	D59	交易人標的證券匯入明細查詢通知	

		D50	交易人標的證券匯入明細查詢回覆	
0426	交易人標的證券餘額查詢 (CoveredCall)	D51	交易人標的證券餘額查詢通知	
		D52	交易人標的證券餘額查詢回覆	
0427	匯入異常資料查詢 (CoveredCall)	D53	匯入異常資料查詢通知	
		D54	匯入異常資料查詢回覆	
0428	存券匯出申請 (CoveredCall)	D55	存券匯出申請通知	
		D56	存券匯出申請回覆	
0429	存券匯出申請查詢 (CoveredCall)	D57	存券匯出申請查詢通知	
		D58	存券匯出申請查詢回覆	
0430	匯出異常資料查詢 (CoveredCall)	D59	匯出異常資料查詢通知	
		D60	匯出異常資料查詢回覆	
0431	匯出異常集保帳號調整 (CoveredCall)	D61	匯出異常集保帳號調整通知	
		D62	匯出異常集保帳號調整回覆	
0432	賣權買方申請交割扣減股數之登錄 (CoveredCall)	D63	賣權買方申請交割扣減股數之登錄通知	
		D64	賣權買方申請交割扣減股數之登錄回覆	
0433	交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢 (CoveredCall)	D65	交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢通知	
		D66	交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢回覆	
0434	撥轉名冊查詢 (CoveredCall)	D67	撥轉名冊查詢通知	
		D68	撥轉名冊查詢回覆	
0435	撥轉名冊查詢(抵繳)	D69	撥轉名冊查詢通知	
		D70	撥轉名冊查詢回覆	
0501	交易人部位資料查詢	E01	交易人部位資料查詢通知	
		E02	交易人部位資料查詢回覆	

0502	期貨商部位資料查詢	E03	期貨商部位資料查詢通知	
		E04	期貨商部位資料查詢回覆	
0503	結算會員部位資料查詢	E05	結算會員部位資料查詢通知	
		E06	結算會員部位資料查詢回覆	
0504	部位調整(互抵)申請	E07	部位調整(互抵)申請通知	
		E08	部位調整(互抵)申請回覆	
0505	部位調整(互抵)申請記錄查詢	E09	部位調整(互抵)申請記錄查詢通知	
		E10	部位調整(互抵)申請記錄查詢回覆	
0506	組合部位調整	E11	組合部位調整通知	
		E12	組合部位調整回覆	
0507	組合部位調整記錄查詢	E13	組合部位調整紀錄查詢通知	
		E14	組合部位調整紀錄查詢回覆	
0508	了結口數調整	E15	了結口數調整通知	
		E16	了結口數調整回覆	
0509	了結口數調整紀錄查詢	E17	了結口數調整紀錄查詢通知	
		E18	了結口數調整紀錄查詢回覆	
0510	平倉錯誤資料查詢	E19	平倉錯誤資料查詢通知	
		E20	平倉錯誤資料查詢回覆	
0511	交易人組合部位資料查詢	E21	交易人組合部位資料查詢通知	
		E22	交易人組合部位資料查詢回覆	
0512	期貨商組合部位資料查詢	E23	期貨商組合部位資料查詢通知	
		E24	期貨商組合部位資料查詢回覆	
0513	交易人期貨多空組合部位明細查詢	E25	交易人期貨多空組合部位明細查詢通知	

		E26	交易人期貨多空組合部位明細查詢回覆	
0514	現金股利買賣方名冊資料查詢	E27	現金股利買賣方名冊資料查詢通知	
		E28	現金股利買賣方名冊資料查詢回覆	
0515	交易人部位資料查詢(含Eurex 轉入部位明細)	E29	交易人部位資料查詢通知(含Eurex 轉入部位明細)	
		E30	交易人部位資料查詢回覆(含Eurex 轉入部位明細)	
0516	期貨商部位資料查詢(含Eurex 轉入部位明細)	E31	期貨商部位資料查詢通知(含Eurex 轉入部位明細)	
		E32	期貨商部位資料查詢回覆(含Eurex 轉入部位明細)	
0517	結算會員部位資料查詢(含Eurex 轉入部位明細)	E33	結算會員部位資料查詢通知(含Eurex 轉入部位明細)	
		E34	結算會員部位資料查詢回覆(含Eurex 轉入部位明細)	
0601	結算保證金查詢	F01	結算保證金查詢通知	
		F02	結算保證金查詢回覆	
0602	結算保證金追繳資料查詢	F03	結算保證金追繳資料查詢通知	
		F04	結算保證金追繳資料查詢回覆	
0603	盤中保證金追繳通告	F05	盤中保證金追繳通告	
0604	結算保證金餘額查詢	F06	結算保證金餘額查詢通知	
		F07	結算保證金餘額查詢回覆	
0605	商品結算保證金查詢	F08	商品結算保證金查詢通知	
		F09	商品結算保證金查詢回覆	
0606	結算保證金追繳資料查詢(CoveredCall)	F10	結算保證金追繳資料查詢通知	
		F11	結算保證金追繳資料查詢回覆	
0701	結算保證金查詢	G01	結算保證金查詢通知	
		G02	結算保證金查詢回覆	
0702	結算保證金追繳資料查詢	G03	結算保證金追繳資料查詢通知	

		G04	結算保證金追繳資料查詢回覆	
0703	盤中保證金追繳通告	G05	盤中保證金追繳通告	
0704	結算保證金餘額查詢	G06	結算保證金餘額查詢通知	
		G07	結算保證金餘額查詢回覆	
0705	商品結算保證金查詢	G08	商品結算保證金查詢通知	
		G09	商品結算保證金查詢回覆	
0706	期交所代結匯資料查詢	G10	期交所代結匯資料查詢通知	
		G11	期交所代結匯資料查詢回覆	
0707	境外外資交易新台幣商品 應有保證金查詢	G12	境外外資交易新台幣商品應有保 證金查詢通知	
		G13	境外外資交易新台幣商品應有保 證金查詢回覆	
0708	結算保證金查詢(依SPAN保 證金計算)	G14	結算保證金查詢通知	
		G15	結算保證金查詢回覆	
0709	結算保證金追繳資料查詢 (依SPAN保證金計算)	G16	結算保證金追繳資料查詢通知	
		G17	結算保證金追繳資料查詢回覆	
0710	期貨商應存有暨原始保證 金查詢(依SPAN保證金計 算)	G18	期貨商應存有暨原始保證金查詢 (依SPAN保證金計算)通知	
		G19	期貨商應存有暨原始保證金查詢 (依SPAN保證金計算)回覆	
0711	結算保證金各幣別餘額查 詢	G20	結算保證金各幣別餘額查詢通知	
		G21	結算保證金各幣別餘額查詢回覆	
0712	期交所代結匯資料查詢(外 幣)	G22	期交所代結匯資料查詢通知	
		G23	期交所代結匯資料查詢回覆	
0713	期貨商應存有暨原始保證 金查詢(外幣)	G24	期貨商應存有暨原始保證金查詢 通知	
		G25	期貨商應存有暨原始保證金查詢 回覆	
0714	結算會員抵繳結算保證金	G26	結算會員抵繳結算保證金資料查 詢	

	資料查詢	G27	結算會員抵繳結算保證金資料查詢	
0715	商品狀態查詢	G28	商品狀態查詢通知	
		G29	商品狀態查詢回覆	
0716	各盤別保證金及商品損益查詢	G30	各盤別保證金及商品損益查詢通知	
		G31	各盤別保證金及商品損益查詢回覆	
0717	結算保證金追繳資料查詢(多幣別)	G32	結算保證金追繳資料查詢通知(多幣別)	
		G33	結算保證金追繳資料查詢回覆(多幣別)	
0718	結算保證金追繳資料查詢(SPAN+多幣別)	G34	結算保證金追繳資料查詢通知(SPAN+多幣別)	
		G35	結算保證金追繳資料查詢回覆(SPAN+多幣別)	
0719	盤中保證金追繳通告(多幣別)	G36	盤中保證金追繳通告(多幣別)	
0801	交易人股票及國際債匯入明細查詢	H01	交易人股票及國際債匯入明細查詢通知	
		H02	交易人股票及國際債匯入明細查詢回覆	
0802	交易人股票及國際債餘額查詢	H03	交易人股票及國際債餘額查詢通知	
		H04	交易人股票及國際債餘額查詢回覆	
0803	股票及國際債匯入異常資料查詢	H05	股票及國際債匯入異常資料查詢通知	
		H06	股票及國際債匯入異常資料查詢回覆	
0804	股票及國際債存券匯出申請	H07	股票及國際債存券匯出申請通知	
		H08	股票及國際債存券匯出申請回覆	
0805	股票及國際債存券匯出申請資料查詢	H09	股票及國際債存券匯出申請資料查詢通知	
		H10	股票及國際債存券匯出申請資料查詢回覆	
0806	買權賣方及賣權買方交易	H11	買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄通知	

	人申請交割扣減股數登錄	H12	買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄回覆	
0807	交易人公債餘額查詢	H13	交易人公債餘額查詢通知	
		H14	交易人公債餘額查詢回覆	
0808	交易人公債抵繳明細資料申報	H15	交易人公債抵繳明細資料申報通知	
		H16	交易人公債抵繳明細資料申報	
0809	交易人公債抵繳明細申報資料查詢	H17	交易人公債抵繳明細申報資料查詢通知	
		H18	交易人公債抵繳明細申報資料查詢回覆	
0810	公債匯出申請及賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶登錄	H19	公債匯出申請及賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶登錄通知	
		H20	公債匯出申請及賣方申請由抵繳專戶轉交割專戶登錄回覆	
0811	交易人公債匯出資料查詢	H21	交易人公債匯出資料查詢通知	
		H22	交易人公債匯出資料查詢回覆	
0812	交易人公債利息匯款帳號申報	H23	交易人公債利息匯款帳號申報通知	
		H24	交易人公債利息匯款帳號申報回覆	
0813	交易人公債利息明細資料查詢	H25	交易人公債利息明細資料查詢通知	
		H26	交易人公債利息明細資料查詢回覆	
0814	交易人有價證券抵繳保證金明細查詢	H27	交易人有價證券抵繳保證金明細查詢通知	
		H28	交易人有價證券抵繳保證金明細查詢回覆	
0815	交易人抵繳約定碼申報	H29	交易人抵繳約定碼申報通知	
		H30	交易人抵繳約定碼申報回覆	
0816	交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢	H31	交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢通知	
		H32	交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢回覆	
	需顯示錯誤訊息之交易	E99	異常訊息回覆	

註：備註欄為 '@' 表新增之交易項目，'#' 表異動之交易項目，'*' 表停用之交易項目

5.2. 各項代碼對照表

(1) 系統代號：可提供 0-9 共 10 種

0：結算系統

(2) 作業類別：可提供 0-9 共 10 種

1：期貨部位管理作業

2：期貨結算保證金作業

3：其他連線作業

4：到期履約及實物交割作業

5：部位管理作業

6：結算保證金作業(台幣商品)

7：結算保證金作業

8：標的證券抵繳保證金作業

(3) 作業項目：係依上項各作業類別之作業性質區分其作業項目，代碼可提供

00-99 共 100 種

(a) 1：期貨部位管理作業

01：交易人部位資料查詢

02：期貨商部位資料查詢

03：結算會員部位資料查詢

04：部位調整(互抵)申請

05：部位調整申請記錄查詢

(b) 2：期貨結算保證金作業(台幣商品)

01：結算保證金查詢

02：結算保證金追繳資料查詢

03：盤中保證金追繳通告

04：結算保證金餘額查詢

(c) 3：其他連線作業

01：交易人基本資料登錄(台指)

02：查詢交易人基本資料(台指)

03：期交所的公告資料查詢

04：結算服務費資料查詢

05：交易人基本資料登錄(個股)

06：查詢交易人基本資料(個股)

07：交易人公債帳戶登錄 暨 交易人集保帳號登錄

08：交易人公債帳戶查詢(公債)

09：期交稅資料查詢(台幣商品)

10：交易人總開戶數查詢

11：期交稅資料查詢

12：匯率暨利率查詢

(d) 4：到期履約及實物交割作業

01：自動履約名冊查詢(台指)

02：自動履約名冊登錄(台指)

03：自動履約名冊刪除(台指)

04：履約指派名冊查詢(台指)

05：履約參考名冊查詢(個股)

06：交易人標的證券匯入明細資料查詢(個股)

- 07：交易人標的證券餘額查詢(個股)
- 08：匯入異常資料查詢(個股)
- 09：存券匯出申請(個股)
- 10：存券匯出申請查詢(個股)
- 11：匯出異常資料查詢(個股)
- 12：匯出異常集保帳號調整(個股)
- 13：調整個股集保帳號 暨 調整公債銀行帳戶
- 14：撥轉名冊查詢(個股)
- 16：自動履約名冊查詢(個股)
- 17：自動履約名冊登錄(個股)
- 18：自動履約名冊刪除(個股)
- 19：履約指派名冊查詢(個股)
- 20：債券商品交割明細查詢(公債)
- 21：賣方交割債券明細申報(公債)
- 22：買賣方交割債券明細查詢(公債)
- 23：交易人標的債券匯入明細查詢(公債)
- 24：交割價款明細查詢(公債)
- 25：交易人標的證券匯入明細資料查詢(CoveredCall)
- 26：交易人標的證券餘額查詢(CoveredCall)
- 27：匯入異常資料查詢(CoveredCall)
- 28：存券匯出申請(CoveredCall)
- 29：存券匯出申請查詢(CoveredCall)
- 30：匯出異常資料查詢(CoveredCall)
- 31：匯出異常集保帳號調整(CoveredCall)
- 32：賣權買方申請交割扣減股數之登錄(CoveredCall)

33：交易人標的證券抵繳買權賣方部位明細查詢(CoveredCall)

34：撥轉名冊查詢(CoveredCall)

35：撥轉名冊查詢(抵繳)

(e) 5：部位管理作業

01：交易人部位資料查詢

02：期貨商部位資料查詢

03：結算會員部位資料查詢

04：部位調整(互抵)申請

05：部位調整申請記錄查詢

06：組合部位調整

07：組合部位調整記錄查詢

08：了結口數調整

09：了結口數調整紀錄查詢

10：平倉錯誤資料查詢

11：交易人組合部位資料查詢

12：期貨商組合部位資料查詢

13：交易人期貨多空組合部位明細查詢

(f) 6：結算保證金作業(台幣商品)

01：結算保證金查詢

02：結算保證金追繳資料查詢

03：盤中保證金追繳通告

04：結算保證金餘額查詢

05：商品結算保證金查詢

06：結算保證金追繳資料查詢(CoveredCall)

(g) 7：結算保證金作業

01：結算保證金查詢

02：結算保證金追繳資料查詢

03：盤中保證金追繳通告

04：結算保證金餘額查詢

05：商品結算保證金查詢

06：期交所代結匯資料查詢

07：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢

08：結算保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)

09：結算保證金追繳資料查詢(依 SPAN 保證金計算)

10：期貨商應存有暨原始保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)

11：結算保證金各幣別餘額查詢

12：期交所代結匯資料查詢(外幣)

13：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢(外幣)

14：結算會員抵繳結算保證金資料查詢

15：商品狀態查詢

16：各盤別保證金及商品損益查詢

17：結算保證金追繳資料查詢(多幣別)

18：結算保證金追繳資料查詢(SPAN+多幣別)

19：盤中保證金追繳通告(多幣別)

(h) 8：標的證券抵繳保證金作業

01：交易人股票及國際債匯入明細查詢

- 02：交易人股票及國際債餘額查詢
- 03：股票及國際債匯入異常資料查詢
- 04：股票及國際債存券匯出申請
- 05：票及國際債存券匯出申請資料查詢
- 06：買權賣方及賣權買方交易人申請交割扣減股數登錄
- 07：交易人公債餘額查詢
- 08：交易人公債抵繳明細資料申報
- 09：交易人公債抵繳明細申報資料查詢
- 10：交易人股票及國際債匯入明細查詢
- 11：交易人公債匯出資料查詢
- 12：交易人公債利息匯款帳號申報
- 13：交易人公債利息明細資料查詢
- 14：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢
- 15：交易人抵繳約定碼申報
- 16：交易人公債利息匯款帳號及抵繳約定碼資料查詢

(4) 戶別：

保留欄位：空白

身份證欄位：依期交所訂定之編碼原則

5.3. 錯誤回覆代碼對照表

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
00000	資料完全收到	
26001	本交易輸入之資料總長度不正確	—
26002	來源單位代號為非結算會員總公司經紀部門或自營部門代號	—
26003	輸入之資料欄位中有空白	—
26004	輸入之資料欄位中為 0	—
26005	輸入之結算會員代號與來源單位代號不一致	—
26006	輸入之查詢類別不正確	—
26007	無此資料	—
26008	輸入之期貨商代號非委託此結算會員代號辦理結算	—
26009	輸入之結算會員代號為非結算會員	—
26010	輸入之買賣別不正確	—
26011	輸入之商品代號或交割月份不正確	—
26012	輸入之調整口數超過已有之部位口數	—
26013	資料未完全收到	△
26014	目的地單位代號不正確	—
26015	輸入之交易人帳號起號不可大於交易人帳號迄號	—
26016	尚未結帳，不可查詢	—
26017	輸入之交易人帳號起號不可為“9999999”	■
26018	不得查詢其他期貨商資料	—
26019	輸入之調整口數數值型態不正確	—
26020	交易人部位主檔中，無此撥出方交易人部位資料	—

期貨結算系統期貨商(結算會員)資訊傳輸界面規範書

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26021	撥出方與撥入方期貨商代號不相同	—
26022	撥出方與撥入方交易人，身分證字號或營利事業統一編號不一致	—
26023	部位調整申請通知，新增不成功	—
26024	客戶基本資料檔中，尚未建立撥入方交易人資料	△
26025	客戶基本資料檔中，尚未建立撥出方交易人資料	—
26026	撥出方之期貨商代號非委託撥出方之結算會員代號辦理結算	—
26027	撥入方之期貨商代號非委託撥入方之結算會員代號辦理結算	—
26028	本商品今日為最後交易日，不得申請移轉	—
26029	輸入之期貨商代號與來源單位代號不一致	—
26030	部位調整截止申請，無法處理	—
26031	來源單位代號為非期貨商總公司經紀部門代號及期貨商代號皆需相同	—
26032	錯帳調整時撥入方與撥出方之結算會員代號及期貨商代號皆需相同	—
26033	輸入之期貨商代號不可為”9999999”	—
26034	來源單位代號與結算會員代號及期貨商代號不一致	—
26035	撥入數額大於錯帳專戶欲沖銷數額，無法處理	—
26036	戶別錯誤，無法處理	—
26037	戶別保留欄位之值應為空白	—
26038	身分證代號錯誤	—
26039	營利事業編號錯誤	—
26040	關係期貨商代號錯誤	—
26041	日期格式錯誤	—
26042	與原身分證字號不符，無法變更交易人基本資料	—

期貨結算系統期貨商(結算會員)資訊傳輸界面規範書

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26043	交易人帳號錯誤，無法處理	—
26044	無此期貨商代號，無法處理	—
26045	交易人帳戶名稱長度不得小於 4	—
26046	本交易只能以單筆資料傳送處理	—
26047	撥入方交易人帳號不可為部位處理專戶	—
26048	撥出方與撥入方結算會員應相同	—
26049	撥出方結算會員代號與期貨商代號應相同	—
26050	交易人尚有部位餘額，無法註銷	—
26051	交易人帳戶已註銷，無法再次註銷	—
26052	交易人尚未開戶，無法註銷	—
26053	資料查詢筆數超過限制，請縮小查詢範圍	—
26054	資料庫作業異常，請聯絡系統人員	△
26055	部位已結帳，無法處理	—
26056	無此交易人部位資料，無法處理	—
26057	了結口數超過買進(賣出)餘額，無法處理	—
26058	了結口數調整申請通知，新增不成功	—
26059	申請部位為'負值'，應執行'拆解'程式	—
26060	商品 1 錯誤，無法處理	—
26061	商品 2 錯誤，無法處理	—
26062	無此商品組合關係，無法處理	—
26063	價差部位若價格相同，則交割月份 1 應小於交割月份 2	—
26064	無此商品 1 交易人部位資料，無法處理	—

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26065	無此商品 2 交易人部位資料，無法處理	—
26066	商品 1 之部位餘額不足，無法處理	—
26067	商品 2 之部位餘額不足，無法處理	—
26068	商品 1 之部位餘額不足，無法處理	—
26069	商品 2 之部位餘額不足，無法處理	—
26070	部位組合調整申請通知，新增不成功	—
26071	申請部位為'正值'，應執行'組合'程式，無法處理	—
26072	無此交易人組合部位資料，無法處理	—
26073	交易人組合部位餘額不足，無法處理	—
26074	自動履約名冊調整已截止，無法處理	—
26075	自動履約名冊刪除申請通知，不成功	—
26076	非到期商品，無法處理	—
26077	非價內契約，無法處理	—
26078	履約資料已存在，無法辦理登錄	—
26079	自動履約名冊登錄申請通知，不成功	—
26080	輸入之了結口數為負值，無法處理	—
26081	自營商不得申請部位調整作業，無法處理	—
26082	價差部位若買賣權別為'C'，則履約價格 1 應大於等於履約價格 2	—
26083	價差部位若買賣權別為'P'，則履約價格 1 應小於等於履約價格 2	—
26084	輸入之履約口數不等於昨日買進餘額 無該筆互抵資料，無法辦理沖正	—
26085	無資料，名冊尚未產生	—
26086	部位餘額不符，無法處理	—

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26087	輸入之履約口數不等於昨日買進餘額	—
26088	非選擇權商品，無法處理	—
26089	此組合商品組合種類錯誤，無法處理	—
26090	此組合商品買賣別錯誤，無法處理	—
26091	此組合商品交割月份錯誤，無法處理	—
26092	造市者及錯帳專戶不得申請部位指定沖正作業	—
26093	存券匯出申請通知，新增不成功	—
26094	補券分配申請通知，新增不成功	—
26095	股票履約申報記號已截止，無法處理	—
26096	集保帳號調整已截止，無法處理	—
26097	個股選擇權履約名冊調整已截止，無法處理	—
26098	無該筆資料，無法辦理刪除	—
26099	履約口數不符，無法處理	—
26100	集保帳號錯誤或必須輸入集保帳號	—
26101	匯出異常集保帳號調整，更正不成功	—
26102	輸入之履約口數不得為零或負值	—
26103	非股票選擇權商品，無法處理	—
26104	調整履約名冊證券帳號應為買權商品	—
26105	調整履約參考名冊證券帳號應為賣權商品	—
26106	調整履約名冊證券帳號，更正不成功	—
26107	調整指派名冊證券帳號，更正不成功	—
26108	調整履約參考名冊證券帳號，更正不成功	—

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26109	名冊資料尚未產生，無法處理	—
26110	撥轉名冊已結帳，無法處理	—
26111	無此交易人存券餘額資料，無法處理	—
26112	無此存券匯出資料，無法處理	—
26113	期貨選擇權履約，不可輸入集保帳號	—
26114	非期貨選擇權商品，無法處理	—
26115	違約未結案之客戶不得開戶	—
26116	已結案但未滿三年之違約客戶不得開戶	■
26117	銀行代號不是債券登錄銀行，無法處理	—
26118	銀行帳號有非數字內容，無法處理	—
26119	帳戶類別不為 B，無法處理	—
26120	輸入之賣方公債申報張數不得為負值	—
26121	賣方交割債券申報截止申請，無法處理	—
26122	非可交割公債，無法處理	—
26123	輸入交割債券大於可申報交割債券，無法處理	—
26124	輸入之賣方交割債券明細申報，帳號不得為空白，無法處理	—
26125	輸入之戶籍地址長度不得小於 10	—
26126	輸入之郵遞地址長度不得小於 10	—
26127	輸入之聯絡人長度不得小於 4	—
26128	輸入之聯絡人電話長度不得小於 5	—
26129	輸入之法人受任人/自然人代理人名稱長度不得小於 4	—
26130	全權委託戶必填全權委託業者代號	—

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26131	外資戶必填外資帳戶保管機構代號	—
26132	輸入的銀行代號長度大於 3 碼	—
26133	輸入的交易人銀行帳號長度大於 14 碼	—
26134	輸入的銀行代號不可為空白	—
26135	輸入的交易人銀行帳號不可為空白	—
26136	證券代號不存在, 無法處理	—
26137	輸入之申請股數不得為零或負值	—
26138	輸入之申請股數須為仟股之倍數	—
26139	抵繳專戶提領已截止, 無法處理	—
26140	領取作業已截止, 不可申請	—
26141	執行程式錯誤, 無法處理	—
26142	調整券返還原匯入證券帳號, 交易待處理中	—
26143	調整券返還原匯入證券帳號, 交易失敗	—
26145	交易人存券帳尚有餘額, 無法註銷	—
26146	交易人抵繳存券帳尚有餘額, 無法註銷	—
26147	交易人匯入異常檔尚有餘額, 無法註銷	—
26148	交易人匯出異常檔尚有餘額, 無法註銷	—
26149	證券代號為停止過戶期間, 不可入存券帳, 請轉出至指定帳戶	—
26150	多筆上傳資料筆數超過傳輸筆數限制	—
26151	多筆上傳時, 訊息控制區資料與首筆不一致	—
26152	履約名冊尚未開放	—
26153	尚未結帳! 不開放多筆查詢	—

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26154	綜合帳戶之統一編號須符合證交所 FINI 編碼規則	—
26155	綜合帳戶之期貨商應具結算會員資格	—
26156	綜合帳戶之申報義務人名稱長度不得小於 4	—
26157	綜合帳戶之申報義務人統編須符合 FINI 或法人統編規則	—
26158	法人受任人/自然人代理人統編須符合自然人、FINI、法人統編或外僑統編規則	—
26159	此交易已停用或交易代號錯誤，請聯絡系統人員	—
26160	法人受任人/自然人代理人電話長度不得小於 5	—
26161	法人受任人/自然人代理人戶籍地址長度不得小於 10	—
26162	法人受任人/自然人代理人通訊地址長度不得小於 10	—
26163	入金帳戶銀行名稱不得為空白	—
26164	入金帳戶銀行代號長度錯誤	—
26165	入金帳戶銀行帳號不得為空白	—
26166	入金帳戶幣別錯誤	—
26167	約定入金帳戶日期格式錯誤	—
26168	法人戶至少需輸入一組法人受任人資料	—
26169	輸入之電話長度不得小於 5	—
26170	輸入之電子郵件地址錯誤	—
26171	無資料，名冊已產生	—
26172	現金交割個股選擇權履約名冊，尚未開放	—
26173	現金交割個股選擇權履約名冊調整已截止，無法處理	—
26174	交易人為抵繳個人約定碼，匯入帳號應不為期貨商抵繳帳號	—
26175	交易人為抵繳期貨商約定碼，匯入帳號應為期貨商抵繳帳號	—

錯誤代碼	錯誤說明	處理方式
26176	當日入券已截止，無法處理	—
26177	抵繳約定碼錯誤，無法處理	—
26178	期貨自營商無須輸入抵繳約定碼	—
26179	交易人抵繳個人約定碼已為申報值，無須申報	—
26180	交易人抵繳存券帳尚有餘額，無法申報	—
26181	新增交易人抵繳約定碼失敗，無法處理	—
26182	有價證券抵繳最小登錄面額為零，無法處理	—
26183	交易人抵繳約定碼與專戶匯入類別不符，無法處理	—
26184	輸入之申請股數(面額)須為最小登錄股數(面額)之倍數	—
26185	專戶或帳戶類別錯誤，無法處理	—
26186	輸入之申請口數不得大於餘額	—
26187	銀行代號及帳號必需為空白	—
26188	輸入之匯出帳戶類別與匯出帳戶不符，無法處理	—
26189	輸入之匯出帳戶類別與約定碼不符，無法處理	—
26190	輸入之抵繳專戶錯誤，無法處理	—
26191	綜合帳戶之統一編號須符合陸資身分編碼規則	—
26192		■
26193	輸入之開戶營業據點代號不得為空白	—
26194	輸入之開戶營業據點代號錯誤	—

—：請查明並更正錯誤資料後，重新執行交易

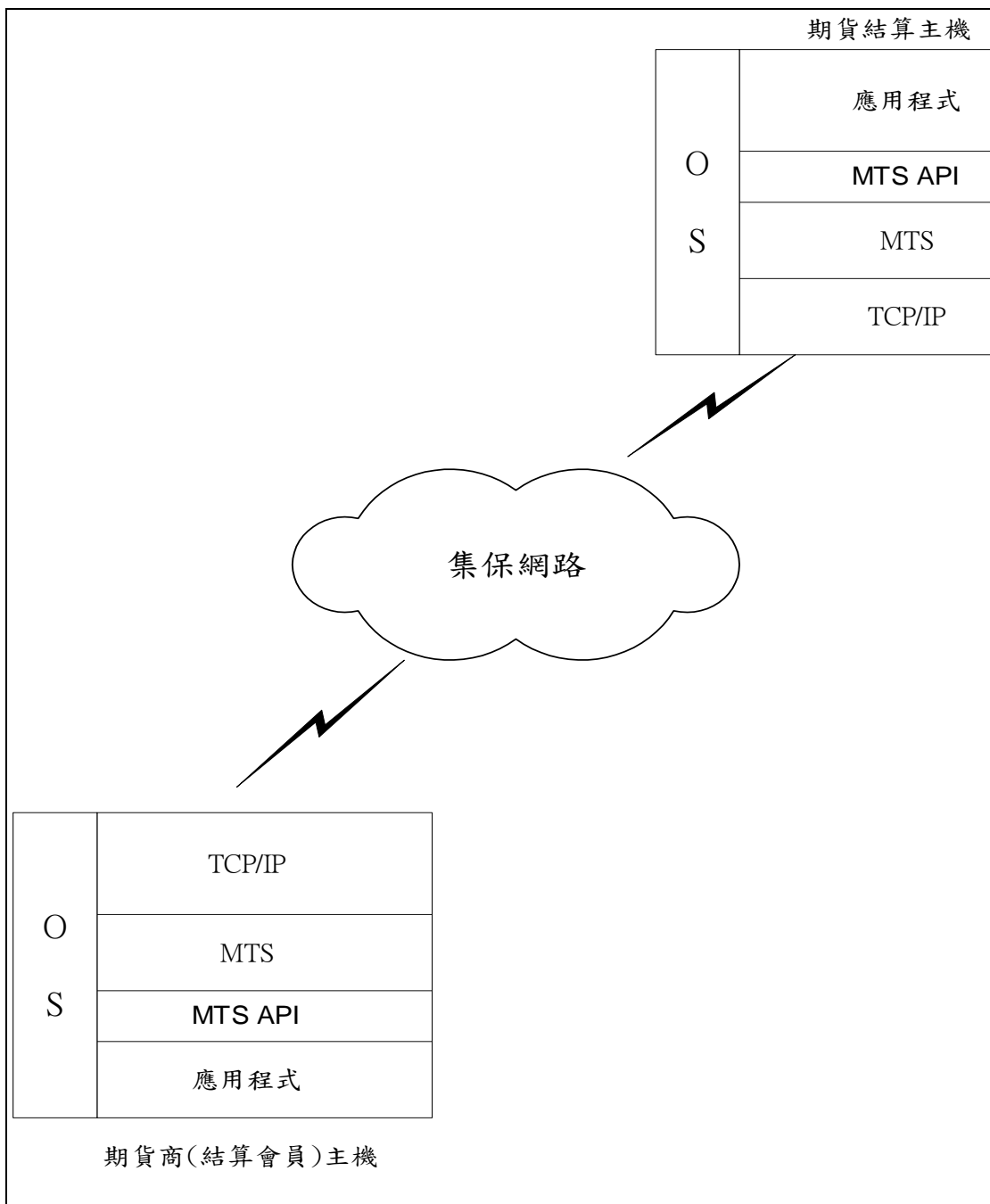
△：請連絡台灣集中保管結算所資訊規劃部期貨業務組人員

■：此訊息不再使用。

5.4. MTS 應用程式介面 API 使用說明

5.4.1. MTS 使用架構及功能：

5.4.1.1. MTS 使用架構圖



5.4.1.2. MTS 使用架構說明

為減輕期貨結算主機或期貨商(結算會員)主機應用程式編寫網路收送程式之複雜度，MTS 服務程式提供期貨結算主機及期貨商主機間連線之資訊傳輸有關功能，應用程式只需呼叫 MTS 應用程式介面 (API) 即可達到收送訊息目的，MTS 服務程式負責與 TCP/IP 網路溝通。

5.4.1.3. MTS 服務程式功能

- (1) 保障送達訊息 (guaranteed Delivery)
- (2) 自動追蹤訊息順序 (sequence)
- (3) 檢查訊息長度
- (4) 採 stored&forward 方式傳送，斷線後訊息將重傳
- (5) 主機之間，日期時間一致化 (Date/Time synchronization)
- (6) 提供高階語言程式介面 (如 c)
- (7) 自動負載平衡 (workload balance)
- (8) 多主機備援

5.4.2. 應用程式介面 (API) 函式

(1) integer mts_init(sid)

integer *sid

Return Code :

0 : 正常 sid 為 session number

-1 : 不正常

此函式為應用程式要求 mts 服務前必須呼叫之起啟函式。

(2) integer mts_close(sid)

integer *sid

Return Code :

0 : 正常 sid 為 session number

-1 : 不正常

此函式為應用程式結束 mts 服務前必須呼叫之函式。

(3) integer mts_get(sid, buffer, length)

integer sid 為 session number

char *buffer(為資料存放區)

integer *length (length 先設為 buffer 長度，函式呼叫結束後，length 為實際資料長度)

Return Code :

0 : 資料結束(No More Data, 此筆為最後一筆)

-1 : 不正常

1 : 還有資料可取

2 : 資料不完整

3 : 資料尚未來

此函式為應用程式向 mts 服務索取資料所呼叫之函式。

(4) integer mts_put(sid, flag, buffer, length)

integer sid 為 session number

char flag ('0' 表最後一筆資料送出, '1' 表後面還有資料需送出)

char *buffer(為資料存放區)

integer *length (length 先設為 buffer 長度, 函式呼叫結束後, length 為實際資料長度)

Return Code :

0 : 資料結束

-1 : 不正常

此函式為應用程式向 mts 服務要求資料傳送所呼叫之函式。

(5) integer mts_getreqid(sid , reqid)

integer sid

integer *reqid(request ID)

Return Code :

0 : 正常, 且傳回 reqid 為 request ID

-1 : 不正常

此函式為應用程式進行非同步程式設計時所使用之 mts 服務呼叫函式。

(6) integer mts_setreqid(sid , reqid)

integer sid

integer *reqid(request ID)

Return Code :

0 : 正常, 且傳回 reqid 為 request ID

-1 : 不正常

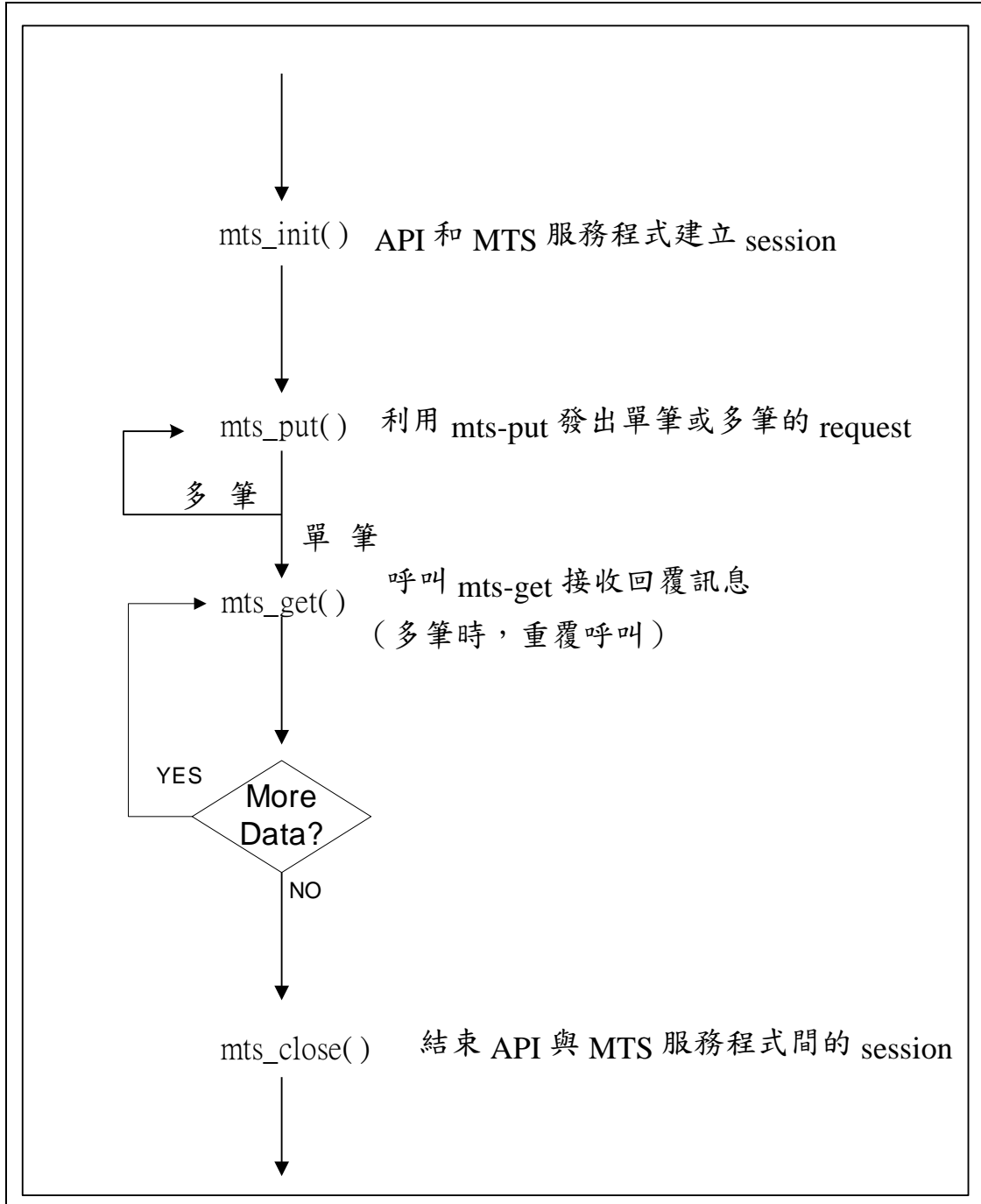
此函式為應用程式進行非同步程式設計時所使用之 mts 服務呼叫函式。

5.4.3. 應用程式介面 (API) 編碼順序

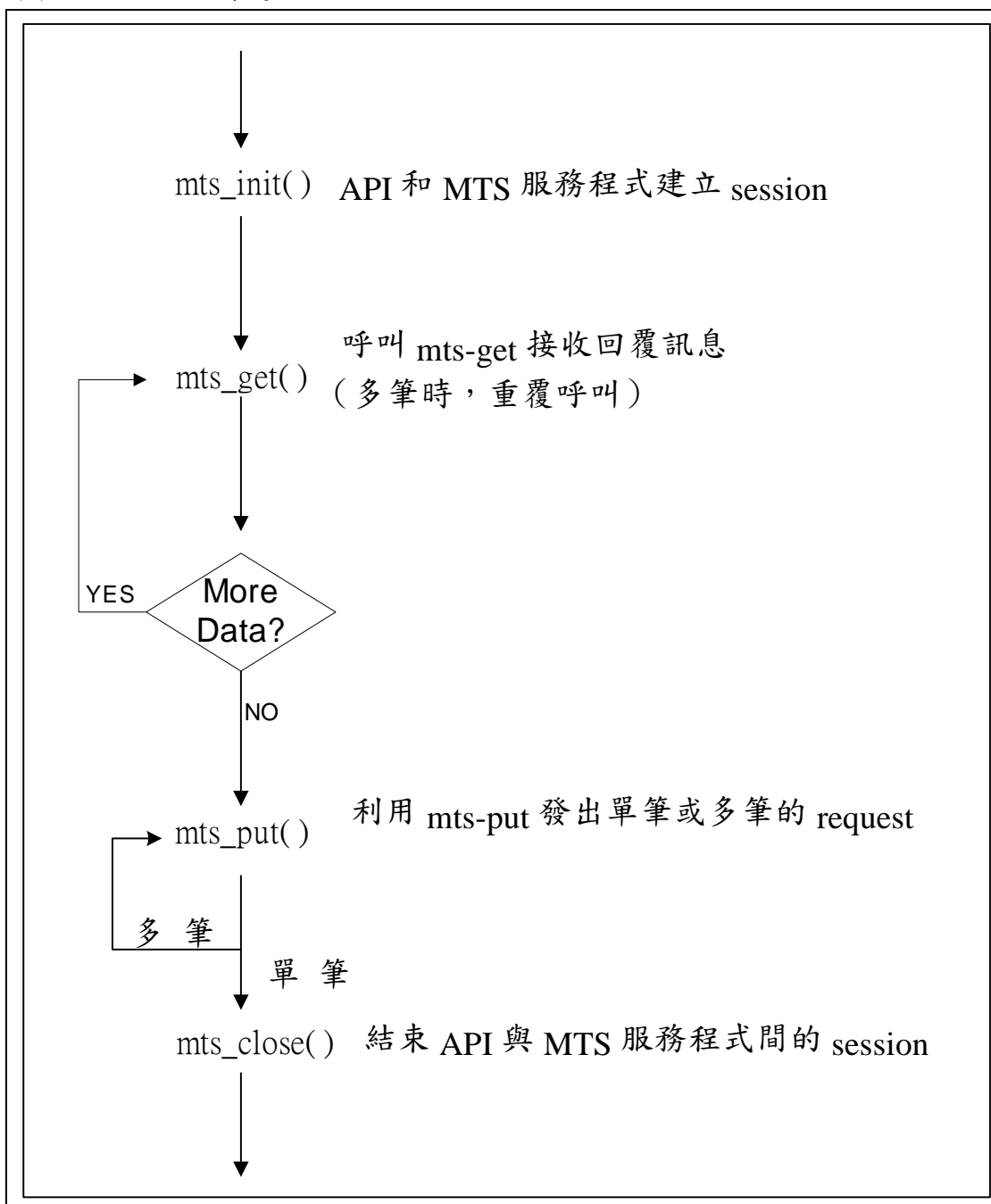
本單元介紹應用程式呼叫 API 函式的順序，分 synchronous 及 asynchronous 說明，分述如下：

5.4.3.1. 同步方式(synchronous)

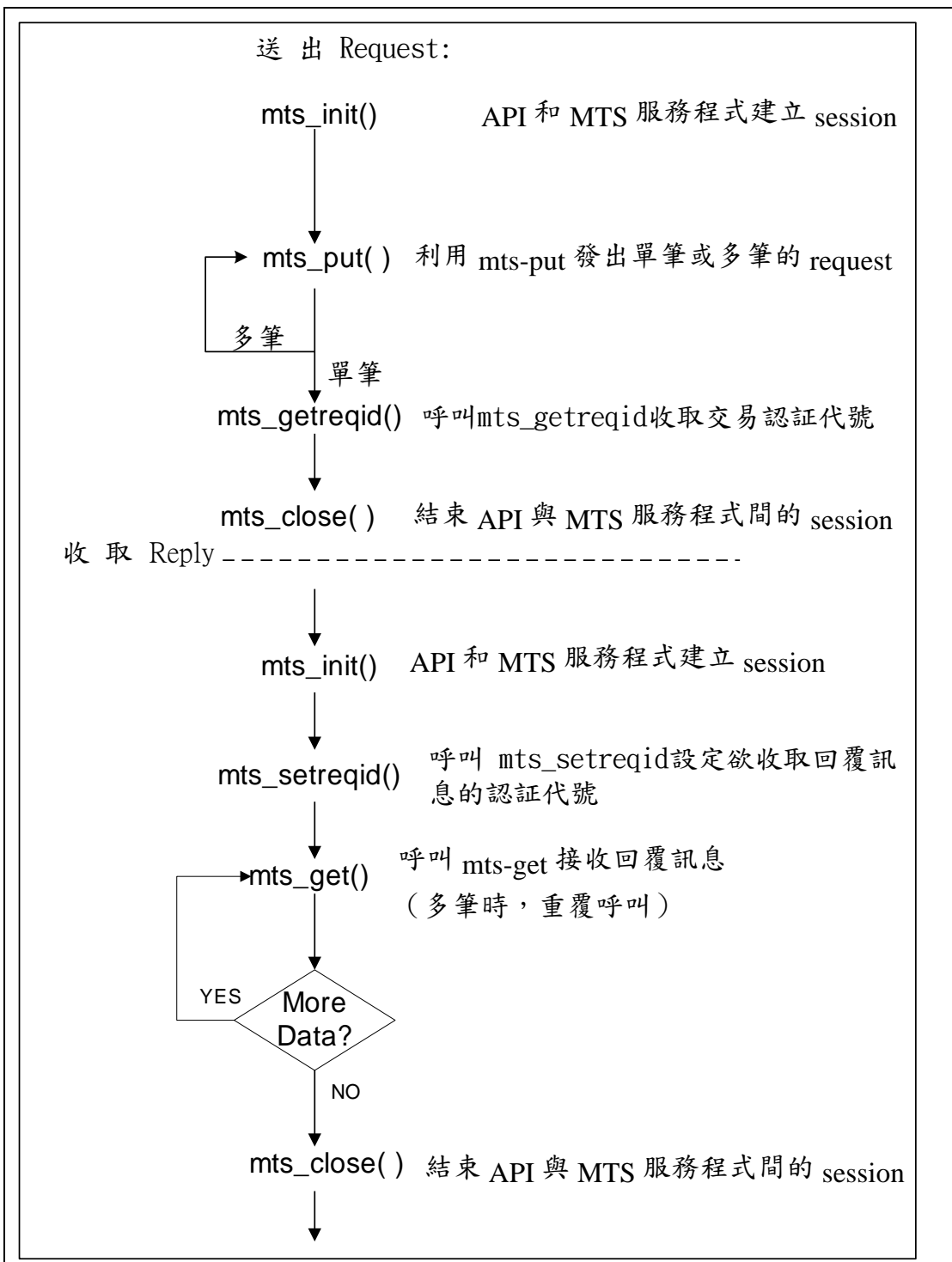
(1) Client 端交易處理



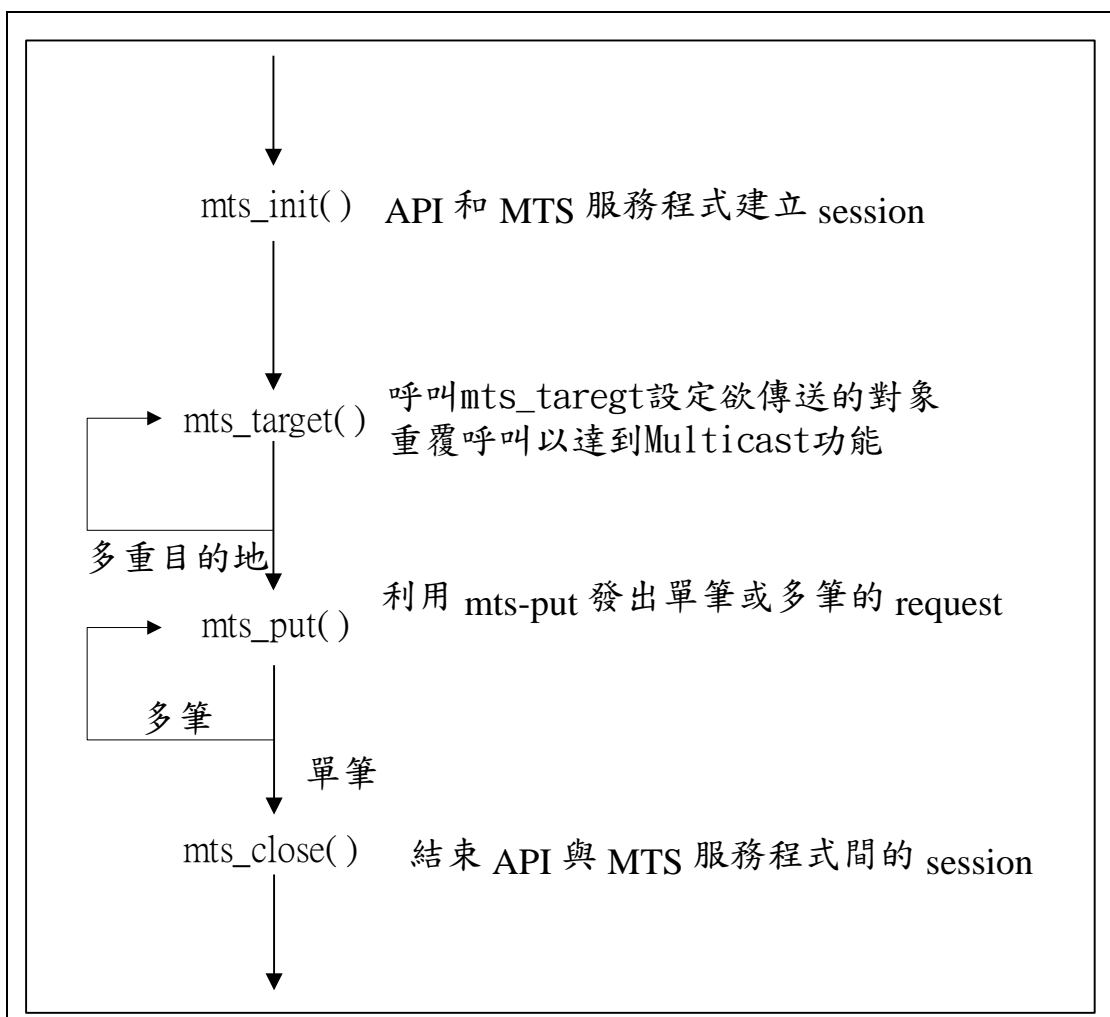
(2) Server 端交易處理



5.4.3.2. 非同步方式交易(asynchronous)



5.4.3.3. one-way 訊息傳送



5.4.4. 程式範例說明

5.4.4.1. 單筆交易 (synchronous)

```
#include      <mts.h>

main (argc , argv)

integer argc ;

char *argv[ ] ;

{

integer sid , rci

char buffer [ ] , flag ;

integer length , reqid ;

        •

        •

        •

/*程式啟始區*/

        •

        •

        •

if (mts_init (&sid) !=0)

    {

clean_job ( ) ;

exit (-1) ;

    }

        •

        •

        •
```

```
/*產生 request*/
/*送出 request*/
flag= '0' /*單筆送出*/
length = 欲送出訊息之長度；

    if (mts_put (sid, &flag, buffer, & length) !=0) {
        clean_job ( );
        mts_close (&sid);
        exit (-1);
    }

/*接收回應*/
rc=3;
while (rc==1 || rc==3)
    {
length = sizeof (buffer)
rc = mts_get (sid, buffer, &length);
switch (rc)
case 2: /*incomplete message*/
clean_job ( );
mts_close (&sid);
exit (-1);
case 3: continue; /*no data yet*/
case -1: 部位 clean_job ( );
mts_close (&sid);
```

```
exit (-1);  
case0 : 部位  
case1 : 部位/*處理回應資料*/  
        •  
        •  
        •  
continue ;  
}/*of switch*/  
}/*of while*/  
        •  
• /*後續處理*/  
        •  
clean_job ( ) ;  
mts_close (&sid ) ;  
exit (0)  
}
```

5.4.4.2. 多筆交易 (synchronous)

```
#include <mts.h>

•

•

•

main (argc , argv)

integer argc ;

char *argv [ ] ;

{

integer sid , rc , length , reqid ;

char buffer [ ] , flag ;

•

•

•

/*程式啟始區*/

•

•

•

if (mts_init (&sid) !=0) {

clean_job ( ) ;

exit (-1) ;

}

•
```

```
/*產生第一筆 request*/  
  
    •  
  
flag= '1' ; /*多筆送出*/  
while (flag== '1' ) {  
length = 欲送出訊息之長度;  
if (mts_put (sid , &flag , buffer , &length) !=0)  
    {  
clean_job ( );  
mts_close (&sid);  
exit (-1);  
    }  
/*產生下一筆資料*/  
  
    •  
    •  
    •  
  
if (最後一筆) flag= '0' ;  
}/*of while*/  
if (flag== '0' )  
length = 欲送出訊息之長度;  
if (mts_put (sid , &flag , buffer , &length) !=0)  
    {  
clean-job ( );  
mts_close (&sid);  
exit (-1);  
    }
```

```
/*接收回應*/
rc=3
while (rc==1||rc==3) {
length = sizeof (buffer) ;
rc = mts_get (sid , buffer , &length);
switch (rc) {
case 2 : /*incomplete message*/
clean_job ( ) ;
mts_close (&sid);
exit (-1);
case 3 : continue ; /*nodata yet*/
case -1 : 部位 clean_job ( ) ;
mts_close (&sid);
exit (-1);
case 0 : 部位
case1 : 部位/*處理回應資料*/
        •
        •
        •
continue ;
}/*of switch*/
}/*of while*/
•
```

```
• /*後續處理*/  
    •  
clean_job ( );  
mts_close (&sid);  
exit (0)  
}
```

5.4.4.3. 單筆、多筆交易 (asynchronous)

(1) asynchronous 方式的交易和 synchronous 方式類似，差別在應用程式發完 request 後，直接結束，不等 reply (即不呼叫 mts_get)，此時應用程式必須讀取 req-id，並將之存放起來，供後讀程式處理。

```
#include <mts.h>  
  
•  
•  
•  
  
main (argc, argv)  
  
integer argc;  
  
char *argv [ ];  
  
{  
  
integer sid, rc, length, reqid;  
  
char buffer [ ], flag;  
  
/*程式啟始及送出 request 同 synchronous 部份*/
```

```
/*不呼叫 mts_get*/
```

```
/*以呼叫 mts_reqid 代替，並將 reqid 存放*/
```

```
if (mts_getreqid (sid, &reqid) !=0) {
```

```
clean_job ( );
```

```
mts_close (&sid);
```

```
exit (-1);
```

```
}
```

```
/*儲存 reqid 於檔案中或用其他方式交給後續處理程式*/
```

```
mts_close (&sid);
```

```
exit (0);
```

```
}
```

(2) Asynchronous 方式發出交易訊息，則以 asynchronous 方式處理回覆訊息，處理程式必須先知道當初的 reqid 為何

```
#include <mts.h>

•
•
•

main (argc , argv)
integer argc ;
char *argv [ ] ;
{
integer sid , rc , length , reqid ;
char buffer [ ] , flag ;

/*程式啟始區*/
•
•
•

if (mts-job (&sid) !=0) {
clean-job ( ) ;
exit (-1) ;
}

/*從檔案讀取或其他方式取 req-id*/
if (mts_put (sid , &flag , buffer , &length) !=0) {
```

```
clean-job ( );
mts_close (&sid);
exit (-1);
    }

/*接收回應*/
rc=3
while (rc==1||rc==3) {
length = sizeof (buffer)
rc=mts_get (sid, buffer, &length);
switch (rc)
case 2 : /*incomplete message*/
clean_job ( );
mts_close (&sid);
exit (-1);
case 3 : continue ; /*no data yet*/
case -1 : 部位 clean-job ( );
mts_close (&sid);
exit (-1);
case 0 : 部位
case 1 : 部位/*處理回應資料*/
        •
        •
        •
continue ;
```

```
}/*of switch*/
```

```
}/*of while*/
```

-

```
/*後續處理*/
```

-

```
clean_job ( );
```

```
mts_close (&sid);
```

```
exit (0)
```

```
}
```

5.4.5. 編譯程式

C 程式編譯

```
cc source.c -lmts -lsocket -lnsl -o executable
```

source.c 為應用程式

需 Link 的 Library 為 libmts.a

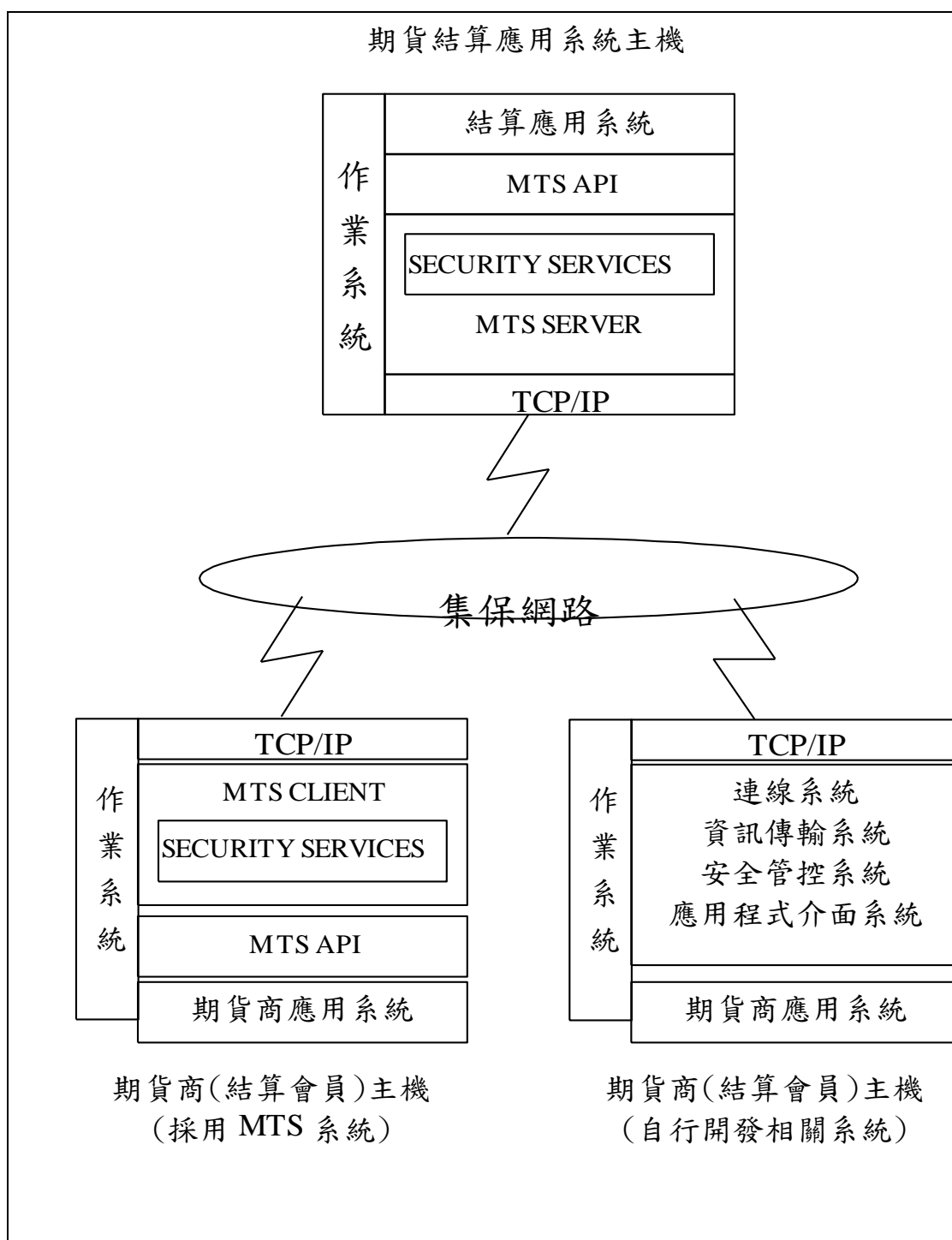
libsocket.a

libnsl.a

executable 為編譯後產生的執行檔

5.5. MTS 資訊傳輸界面規範說明

5.5.1. MTS 系統架構



5.5.2. 資訊傳輸介面規範總則

5.5.2.1. 一般格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	控制碼	2
5.	Request Number	2
6.	Sequence Number	2
7.	資料	n

資訊格式說明：

1. 身份辨識代號：為各期貨商代號。
2. 控制參數：請參考附件「控制參數對照表」
3. 資料長度：為「加密封包」之長度。
4. 控制碼：請參考附件「控制碼對照表」
5. Request Number：交易序號 RN(當營業日唯一)，RN>100
6. Sequence Number：同一交易序號之交易筆數。
7. 資料：
 - (1) 應用程式相關部份參照 4.2. 各項訊息傳輸格式規定。
 - (2) 應用程式以外部份參照「控制碼」說明。

5.5.2.2. 資料加解密原則

- (1) 期貨商身份辨識金匙於開業時向期交所書面申報註冊。
- (2) 一次密碼由期貨商金匙及期交所金匙共同產生，於每次開機連線時建立。
- (3) 資料加解密金匙於每次身份辨識作業中重新建置。
- (4) 資料加解密模式依期交所控制參數值規定。
- (5) 每次資料傳輸以期交所時間為交易監控基準。
- (6) 期貨商安全控管系統參考架構
 - (a) 金匙產製之儲存應具備 1.44MB 媒體(申報用)，另依各期貨商對安全度之要求，亦可選購 IC Card 方式(具備 ISO 7816 Standard, 如 Gemplus card 等)。
 - (b) 由於目前與期交所結算系統連線速率僅為 19.2 kbps，資料之加解密應以硬體完成以確保系統整體效率。對於具有多營業點之期貨商(例：北中南總分公司)運用硬體資料加解密模式應為必要配備。
 - (c) 資料加解密亂數產生器效率參考數值為：1024 bits RSA 電子簽章運算小於 0.2 秒。
 - (d) 資料加解密金匙於連線建置完成後不建議存放於 Main Memory 或 Disk 中而應存放於 Secure Module Memory 中以確保資料之安全。為確保交易資料安全，安控系統之加解密程序宜於硬體內完成。
- (7) 有關數值方面的欄位，於 Secure Server 方面均先轉為字元方式傳遞。

5.5.3. 資訊傳輸介面規範細目

5.5.3.1. 開業申請作業

(1) 書面申報註冊金匙(書面程序另訂)。

(2) 申報媒體：3 1/2 “ 磁碟片

(a) 檔名：initkey.cm

(b) 檔案格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	期貨商代號	7
2.	期貨商 Public Key	264
3.	驗證明文	127
4.	驗證密文	128

(c) 格式說明：

—期貨商代號：

—期貨商 Public Key：採 RSA 1024 bit 產生。

—驗證明文：期貨商自選。

—驗證密文：由「驗證明文」經期貨商 Private Key 加密產生。

(3) 審查期貨商金匙程序：

(a) 電腦比對及人工比對「驗證明文」。

(b) 驗證通過後列印期貨商 Public Key 及明文。

(c) 期貨商及期交所交互簽章確認。

(d) 期交所告知該「期貨商 IP Address」及「期交所 IP Address & Port Number」。

(4)期交所 Public Key 交付

(a) 媒體：3 1/2 “ 磁碟片

(b) 檔名：timeskey.hq

(c) 檔案格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	期交所 Public Key	264
2.	驗證明文	127
3.	驗證密文	128

(d) 格式說明：

—期貨商代號：

—期交所 Public Key：採 RSA 1024 bit 產生。

—驗證明文：期交所自定。

—驗證密文：由「驗證明文」經期交所 Private Key 加密產生。

(e) 列印期交所 Public Key 及明文經期貨商及期交所交互簽章確認。

(5) 金匙線上驗證

(a) 期貨商用「期貨商 Private Key」將期交所「驗證明文」加密後傳送期交所進行比對。傳輸格式依總則辦理。

(b) 期交所用「期交所 Private Key」將期交所「驗證明文」加密後傳送期貨商進行比對。傳輸格式依總則辦理。

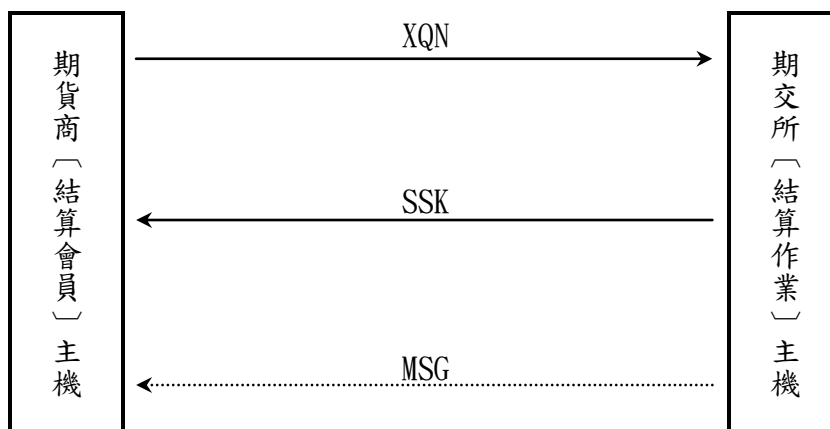
(6) 期貨商停業、復業或註銷：

(a) 復業用書面申報註冊新金匙(書面程序另訂)；申報媒體、審核及驗證程序依本節(2)至(5)規定辦理。

(b) 停業、註銷用書面申報註銷金匙(書面程序另訂)。

5.5.3.2. 開機連線作業

(1) 作業名稱：身份辨識作業



(a) XQN 期貨商身份辨識

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	XQN 控制碼	2
5.	資料	256

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- XQN 控制碼：(參照總則)
- 資料：一次密碼(M₁)，其產生方式如下：

$$Mc = \text{期貨商代號} + \text{期貨商目前時間} + \text{亂數值}$$

期貨商代號：7 byte

期貨商目前時間：4 byte

亂數值：8 byte

M1=用「期貨商 Private Key」對「SHA-1(Mc)」加密，再經「期交所 Public Key」對「Mc 與「SHA-1(Mc)加密結果」」加密之結果。

註：1. Public Key 格式如下：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	模數	128
2.	指數	128
3.	模數長度	4
4.	指數長度	4

2. 時間格式為 long，為 00：00：00 GMT，January 1, 1970 到現在所歷經的秒數

3. 將 Mc 內容加上「簽章」補滿小於金匙長度的內容，用期交所 public-key 加密；剩餘「簽章」長度的內容用期交所 public-key 加密，兩者再相加傳出。

(b) SSK 建立 SESSION KEY

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7

項次	項 目	長度(Byte)
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	SSK 控制碼	2
5.	資料	256

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- SSK 控制碼：(參照總則)
- 資料： M_2 ，其產生方式如下：

M_s =期貨商代號+期交所目前時間+亂數值

期貨商代號：7 byte

期交所目前時間：4 byte

亂數值：8 byte

M_2 =用「期交所 Private Key」對「SHA-1(M_s)」加密，再經「期貨商 Public Key」對「 M_s 與「SHA-1(M_s)加密結果」」加密之結果。

- ①由期貨商 M_1 及期交所 M_2 依安控標準程序組成 Session Key。
- ②Session Key 建議存放於 Secure Module Memory 中。
- ③資訊密文皆用 Session Key 進行加解密。

註：1. Public Key 格式如下：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	模數	128

項次	項 目	長度(Byte)
2.	指數	128
3.	模數長度	4
4.	指數長度	4

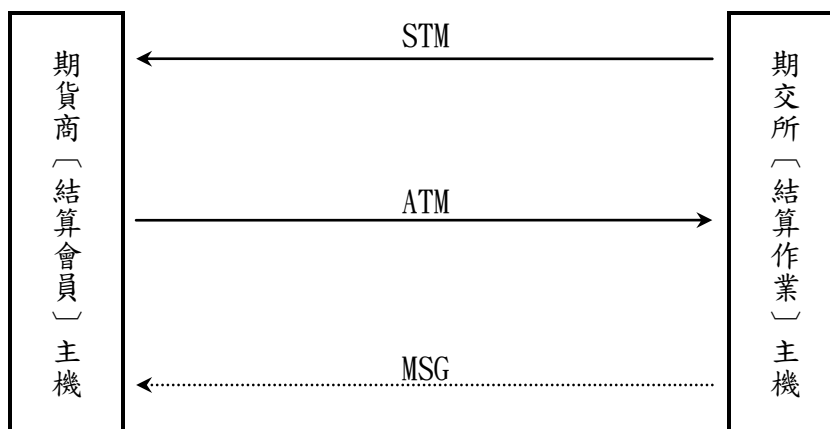
2. 時間格式為 long, 為 00:00:00 GMT, January 1, 1970 到現在所歷經的秒數

3. 將 Mc 內容加上「簽章」補滿小於金匙長度的內容, 用期交所 public-key 加密; 剩餘「簽章」長度的內容用期交所 public-key 加密, 兩者再相加傳出。

4. M1 與 M2 中分別有亂數值 R1, R2; $R1 \oplus R2 = \text{Session Key}$

5. 當 Session Key 建立後, 爾後加解密金匙均用 Session Key 作運算處理; IDEA key length 仍傳入 8 bytes 長度, 內部仍以 16 bytes 處理, 將 key double 變為 16 bytes 長度

(2) 作業名稱：主機日期及時間中央基準化作業(Date/Time Synchronization)



(a) STM 建立主機日期及時間中央基準化

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	STM 控制碼	2
5.	資料	4

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- STM 控制碼：(參照總則)
- 資料：結算主機目前之日期及時間。

(b) ATM 回覆主機日期及時間中央基準化

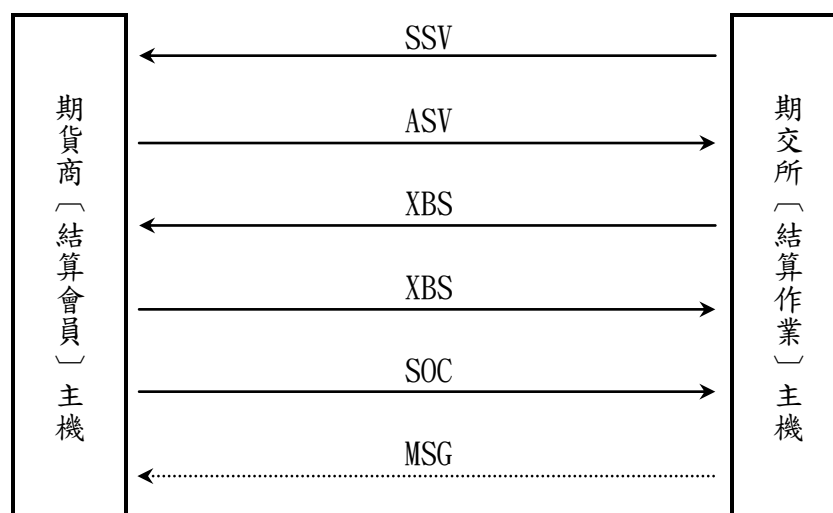
資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	ATM 控制碼	2
5.	資料	4

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- ATM 控制碼：(參照總則)
- 資料：期貨商主機調校後之日期及時間。

(3)作業名稱：分配伺服主機服務作業



(a) SSV 分配伺服主機

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	SSV 控制碼	2
5.	資料	8

資訊格式說明：

—身份辨識代號：(參照總則)

—控制參數：(參照總則)

—資料長度：(參照總則)

—SSV 控制碼：(參照總則)

—資料：期交所 IP Address： 4 byte

Send Port： 2 byte

Receive Port： 2 byte

(b) ASV 回覆伺服主機分配

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	ASV 控制碼	2
5.	資料	4

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- ASV 控制碼：(參照總則)
- 資料：期貨商 IP Address： 4 byte

(c) XBS 交換資料收送區大小

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	XBS 控制碼	2
5.	資料	2

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- XBS 控制碼：(參照總則)
- 資料：資料收送區大小。

(d) SOC 確認伺服主機服務並完成開機

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	SOC 控制碼	2
5.	資料	7

資訊格式說明：

— 身份辨識代號：(參照總則)

— 控制參數：(參照總則)

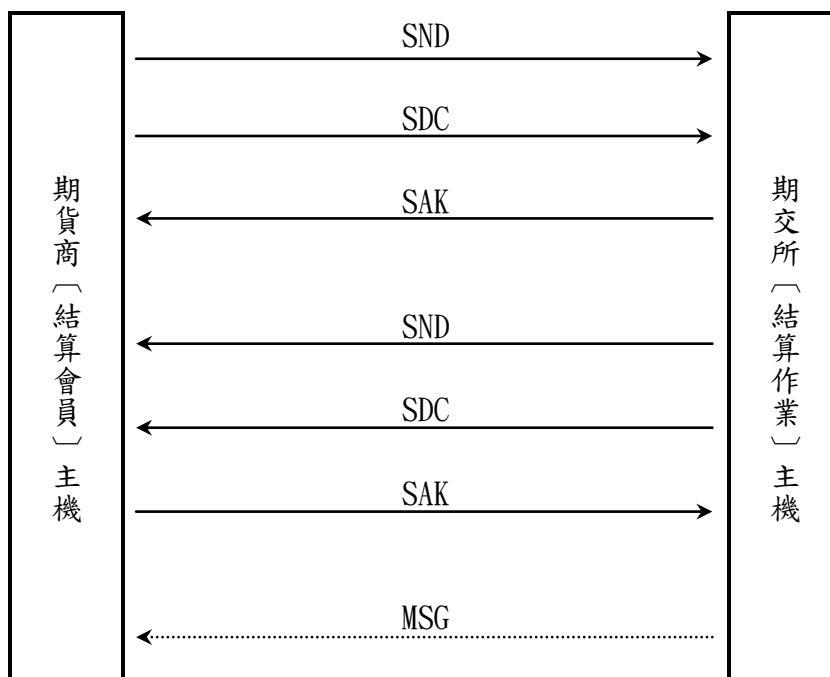
— 資料長度：(參照總則)

— SOC 控制碼：(參照總則)

— 資料：期貨商代號

5.5.3.3. 資訊傳輸作業

(1)作業名稱：資訊傳輸作業



(a) SND 資料傳輸

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	SND 控制碼	2
5.	Request Number	2
6.	Sequence Number	2
7.	資料	n

資訊格式說明：

— 身份辨識代號：(參照總則)

- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- SND 控制碼：(參照總則)
- Request Number：(參照總則)
- Sequence Number：(參照總則)
- 資料：依「期貨交易所訊息傳輸格式」規定。

(b) SDC 資料傳輸筆數控制

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	SDC 控制碼	2
5.	資料	2

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- SDC 控制碼：(參照總則)
- 資料：資料筆數。

(c) SAK 確認資料傳輸

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	SAK 控制碼	2
5.	資料	2

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- SAK 控制碼：(參照總則)
- 資料：收到筆數。

(d) UCD 無條件中斷連線

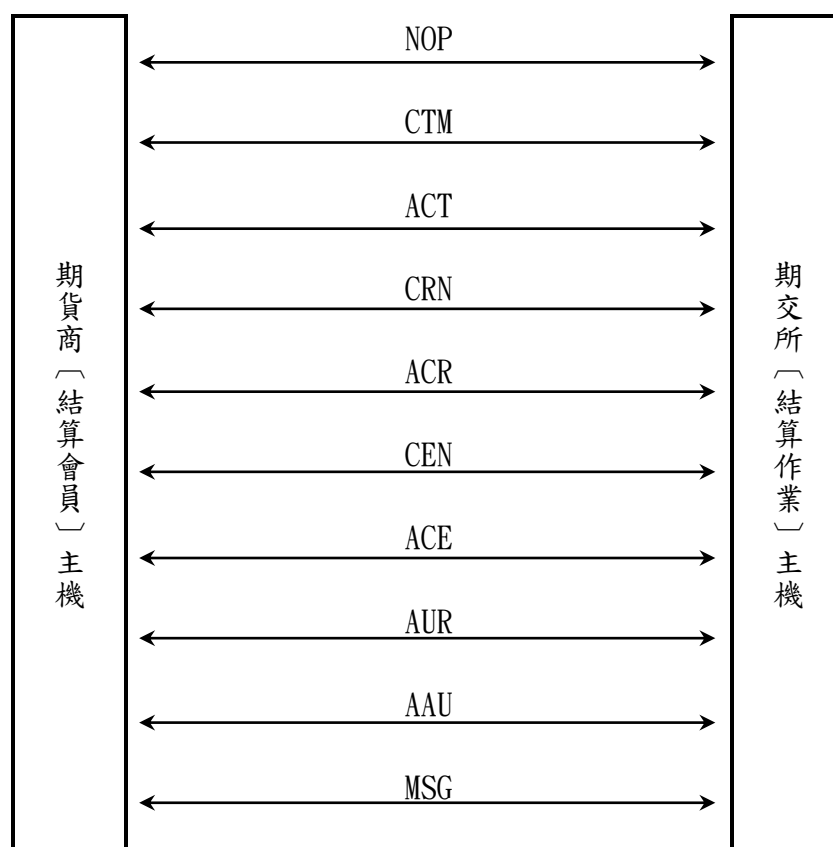
資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	UCD 控制碼	2
5.	資料	0

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- UCD 控制碼：(參照總則)
- 資料：無

(2)作業名稱：一般系統作業



(a) NOP 註解訊息

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
----	-----	----------

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	NOP 控制碼	2
5.	資料	n

資訊格式說明：

—身份辨識代號：(參照總則)

—控制參數：(參照總則)

—資料長度：(參照總則)

—NOP 控制碼：(參照總則)

—資料：n < 65532 Bytes

(b) CTM 要求連線時間

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	CTM 控制碼	2
5.	資料	n/a

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- CTM 控制碼：(參照總則)
- 資料：無

(c) ACT 回覆連線時間

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	ACT 控制碼	2
5.	資料	4

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- ACT 控制碼：(參照總則)
- 資料：連線時間。

(c) CRN 要求目前交易序號

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	CRN 控制碼	2
5.	資料	n/a

資訊格式說明：

—身份辨識代號：(參照總則)

—控制參數：(參照總則)

—資料長度：(參照總則)

—CRN 控制碼：(參照總則)

—資料：無

(d) ACR 回覆目前交易序號

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	ACR 控制碼	2
5.	資料	2

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- CTM 控制碼：(參照總則)
- 資料：目前交易序號

(d) CEN 要求訊息傳送錯誤次數

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	CEN 控制碼	2
5.	資料	n/a

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- CEN 控制碼：(參照總則)
- 資料：無

(e) ACE 回覆訊息傳送錯誤次數

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	ACE 控制碼	2
5.	資料	2

資訊格式說明：

—身份辨識代號：(參照總則)

—控制參數：(參照總則)

—資料長度：(參照總則)

—ACE 控制碼：(參照總則)

—資料：訊息傳送錯誤次數

(f) AUR 要求系統使用率

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	AUR 控制碼	2
5.	資料	n/a

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- AUR 控制碼：(參照總則)
- 資料：無

(g) AAU 回覆系統使用率

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	AAU 控制碼	2
5.	資料	5

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- AAU 控制碼：(參照總則)
- 資料：系統使用率(999V99)

(h) CKT 日期時間檢查

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	CKT 控制碼	2
5.	資料	4

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- CKT 控制碼：(參照總則)
- 資料：期貨商目前系統日期及時間

(i) MSG 系統訊息作業

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	MSG 控制碼	2
5.	資料	2

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- MSG 控制碼：(參照總則)
- 資料：請參考「MSG ID 對照表」

5.5.3.4. 關機連線作業

(1)作業名稱：關機作業



(a) EOD 關機請求

資訊格式：

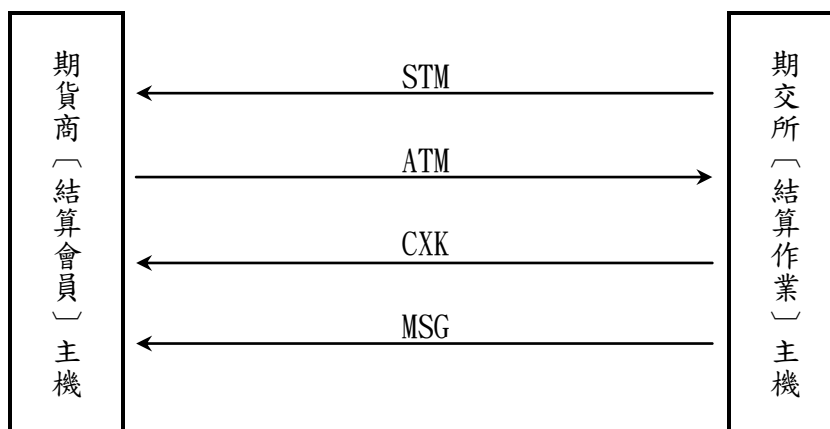
項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	EOD 控制碼	2
5.	資料	n/a

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- EOD 控制碼：(參照總則)
- 資料：無

5.5.3.5. 期交所新金匙(Public Key) 發佈交換作業

(1)作業名稱：期交所新金匙(Public Key) 發佈交換作業



(a) XKY 線上金匙更換作業

書面程序：期交所採書面程序通告新金匙更換以供存證。

- ①新金匙開始交換日期。
- ②新金匙與舊金匙共用期限。
- ③新金匙生效日期。
- ④新金匙開始交換日起進行線上金匙發佈作業

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	XKY 控制碼	2
5.	資料	655

資訊格式說明：

—身份辨識代號：(參照總則)

- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)
- XKY 控制碼：(參照總則)
- 資料：期交所新 Public Key

經由期交所原 Private Key 加密

註：資料欄長度為 655 bytes, 其格式如下：

項次	欄位	說明	長度(Byte)
1	ID	期貨商代碼	7
2	新公開金匙	新產生的 RSA 1024 bit Public key	264
3	密文	以期貨商 RSA 原 Private key 對新的公開金匙加密	384

(b) AXK 回覆金匙更換作業

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	AXK 控制碼	2
5.	資料	655

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)

- 資料長度：(參照總則)
- AXK 控制碼：(參照總則)
- 資料：期交所新 Public Key

經由期交所新 Public Key 加密

註：資料欄長度為 655 bytes, 其格式如下：

項次	欄位	說明	長度(Byte)
1	ID	期貨商代碼	7
2	新公開金匙	新產生的 RSA 1024 bit Public key	264
3	密文	以期貨商 RSA 原 Private key 對新的公開金匙加密	384

(c) CXK 確認金匙更換作業

資訊格式：

項次	項 目	長度(Byte)
1.	身份辨識代號	7
2.	控制參數	3
3.	資料長度	2
4.	CXK 控制碼	2
5.	資料	1

資訊格式說明：

- 身份辨識代號：(參照總則)
- 控制參數：(參照總則)
- 資料長度：(參照總則)

—CXK 控制碼：(參照總則)

—資料：資料值為 0 表確認；

資料值為 1 表未能確認。

5.5.4. 「控制參數對照表」

Byte1&2	Byte3	Description
16 ~ 23	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, No Security
32 ~ 39	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, No Security
48 ~ 55	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, No Security
64 ~ 71	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, No Security
96 ~ 103	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, No Security
1280 ~ 1287	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, RSA 1024
1296 ~ 1303	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, RSA 1024
1312 ~ 1319	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, RSA 1024
1328 ~ 1335	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, RSA 1024
1344 ~ 1351	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, RSA 1024
1376 ~ 1383	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, RSA 1024
2048 ~ 2055	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, DES ECB
2064 ~ 2071	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, DES ECB
2080 ~ 2087	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, DES ECB
2096 ~ 2103	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, DES ECB
2112 ~ 2119	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, DES ECB
2144 ~ 2151	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, DES ECB
2304 ~ 2311	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, DES CBC
2320 ~ 2327	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, DES CBC
2336 ~ 2343	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, DES CBC
2352 ~ 2359	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, DES CBC

期貨結算系統期貨商(結算會員)資訊傳輸界面規範書

Byte1&2	Byte3	Description
2368 ~ 2375	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, DES CBC
2400 ~ 2407	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, DES CBC
2560 ~ 2567	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, DES CFB
2576 ~ 2583	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, DES CFB
2592 ~ 2599	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, DES CFB
2608 ~ 2615	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, DES CFB
2624 ~ 2631	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, DES CFB
2656 ~ 2663	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, DES CFB
2816 ~ 2823	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, DES OFB
2832 ~ 2839	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, DES OFB
2848 ~ 2855	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, DES OFB
2864 ~ 2871	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, DES OFB
2880 ~ 2887	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, DES OFB
2912 ~ 2919	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, DES OFB
3072 ~ 3079	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA ECB
3088 ~ 3095	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA ECB
3104 ~ 3111	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA ECB
3120 ~ 3127	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA ECB
3136 ~ 3143	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, IDEA ECB
3168 ~ 3175	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, IDEA ECB
3328 ~ 3335	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA CBC
3344 ~ 3351	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA CBC

Byte1&2	Byte3	Description
3360 ~ 3367	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA CBC
3376 ~ 3383	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA CBC
3392 ~ 3399	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, IDEA CBC
3424 ~ 3431	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, IDEA CBC
3584 ~ 3591	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA CFB
3600 ~ 3607	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA CFB
3616 ~ 3623	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA CFB
3632 ~ 3639	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA CFB
3648 ~ 3655	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, IDEA CFB
3680 ~ 3687	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, IDEA CFB
3840 ~ 3847	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA OFB
3856 ~ 3863	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, No Respond Immediately, No Resend, IDEA OFB
3872 ~ 3879	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA OFB
3888 ~ 3895	0 ~ 255	Window Counter=0~7, Check, Respond Immediately, No Resend, IDEA OFB
3904 ~ 3911	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, No Respond Immediately, Resend, IDEA OFB
3936 ~ 3943	0 ~ 255	Window Counter=0~7, No Check, Respond Immediately, Resend, IDEA OFB

註：1. 資料長度未滿 8 的倍數時，以剩餘長度標記補滿 8 的長度；當資料長度滿 8 的倍數時，則多加 8 bytes 資料，資料內容為 00000000。

2. CBC, CFB 與 OFB 之 IV 值為 NULL。

3. CFB 與 OFB 在 encrypt 後選 8 的倍數長度。

4. 控制參數說明範例

(1) 0~7, 0~255 Window Counter = 0~7, No Check, No
Respond Immediately No Resend, No Security

00000000 Window Counter = 0

00000001 Window Counter = 1

(2)16~23, 0~255 Check

16=00010000 Window Counter = 0, Check

17=00010001 Window Counter = 1, Check

(3)1280~1287 RSA 1024

1280 =10100000000 Window Counter = 0, RSA 1024

1281 =10100000001 Window Counter = 1, RSA 1024

(4)Byte 3 Seq Number 0~255

5.5.5. 「控制碼對照表」

控制碼	Code	說明
AAU	X 'E7D7'	Ack Average Utilization Rate
ACE	X 'E7D5'	Ack Collect Error Number
ACR	X 'E7D3'	Ack Current Request Number
ACT	X 'E7D1'	Ack Connection Time
ASV	X 'D6C4'	Ack Server
ATM	X 'D6B4'	Ack Time
AUR	X 'E7C7'	Average Utilization Rate
AXK	X 'D6E5'	Ack Exchange Key
CEN	X 'E7C5'	Collect Error Number
CKT	X 'E7C9'	Check Time
CRN	X 'E7C3'	Current Request Number
CTM	X 'E7C1'	Connection Time
CXK	X 'D6E7'	Confirm Exchange Key
EOD	X 'D6A9'	End Of Day
MSG	X 'D69F'	Message
NOP	X 'D693'	No Operation
SAK	X 'C587'	Ack Send Data
SDC	X 'D68C'	Set Data Control
SND	X 'C583'	Send Data
SOC	X 'D6A7'	Start Of Connection
SSK	X 'D6C1'	Set Session Key

控制碼	Code	說明
SSV	X 'D6C3'	Set Server
STM	X 'D6B3'	Set Time
UCD	X 'D6F1'	Unconditional Disconnect
XBS	X 'D673'	Exchange Buffer Size
XKY	X 'D6E3'	Exchange Key
XQN	X 'D6B1'	Exchange ID

5.5.6. 「MSG ID 對照表」

資料值	說 明
000	Success
001	General Connection Error
002	General Security Error
003	General Data Error
004	General Packing Error
005	General Format Error
006 ~ 099	Reserved
100	Authentication Error
101	Session Key Error
102	Security Mode Error
103 ~ 109	Reserved
110	Time Synchronization Error
111	Time Format Error
112	Buffer Size Error
113	Communication Session Error
114	Unauthorized Connection
115	Data Length Error
116	Unknown Control Flag
117	Unknown Command
118	Duplicated Request Number
119	Sequence Error

120	Incomplete Data
121	Time Out
122	Disconnect
123	Invalid Acknowledge
124	Unknown Message
125	Unmatched Service Level
126	Computer Busy
127	Services Not Available
128	Please Call TIME Center
129 ~	Reserved