

臺灣期貨交易所股份有限公司 函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓

聯絡人：王先生

聯絡電話：(02)2369-5678分機265

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國106年3月13日

發文字號：台期交字第10602002730號

速別：普通件

密等及解密條件或保密期限：普通

附件：如文

主旨：配合本公司建置盤後交易平台，爰修正期貨商、期貨交易輔助人之國內期貨交易量月報、期貨商電子式交易月交易量及期貨商錯帳及更正帳號申報之申報格式與說明內容，實施日期另行公告，請查照。

說明：

- 一、依前財政部證券暨期貨管理委員會87年6月10日(87)台財證(七)字第01481號函、期貨商管理規則第24條第3項、證券商經營期貨交易輔助業務管理規則第18條、本公司業務規則第20條、期貨商媒體申報作業辦法第4條第1項第3款、期貨商錯帳及更正帳號申報處理作業要點第5點辦理。
- 二、配合本公司建置盤後交易平台，爰修正期貨商、期貨交易輔助人之國內期貨交易量月報、期貨商電子式交易月交易量及期貨商錯帳及更正帳號申報之申報格式，新增交易時段之欄位並調整欄位說明，申報格式及說明內容詳附件。
- 三、相關最新表單，放置於本公司網站/期貨業專區/媒體申報系統上傳格式/項下之「國內期貨交易量申報檔案格式」、「期貨交易輔助人國內期貨交易量申報檔案格式」、「電子式委託月交易量申報檔案格式」、「期貨商錯帳申報檔案格式」與「期貨商更正帳號申報檔案格式」，請自行下載。未來辦理相關業務，亦請使用最新表單及格式。

四、原99年2月26日台期交字第09900022890號函有關期貨商電子式
交易月交易量申報格式部分，自本函實施日起停止適用。

正本：各期貨商、各期貨交易輔助人

副本：金融監督管理委員會證券期貨局、中華民國期貨業商業同業公會、中華民國證
券商業同業公會、資訊規劃部、本公司網站

總經理 邱文昌

裝

訂

線



國內期貨交易量申報檔案格式

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明
申報年月	1	6	char(6)	6 位文字，YYYYMM
期貨商品代碼	7	14	char(8)	8 位文字，不足右補空白 請參考 02-22-08 主管機關 核准交易所及商品表項下 查詢
期貨商品種類	15	15	char(1)	1 位文字 F, 期貨商品 C, 選擇權買權 P, 選擇權賣權
契約年月	16	21	char(6)	6 位文字，YYYYMM
交易方式	22	29	char(8)	8 位文字，不足右補空白 EFP, 期貨與現貨互換交易 REG, 一般交易 GLOX, GLOBEX PRJA, PROJECT A ACES, ACCESS APT, APT ATS, 自動交易系統 ETS, 電子交易系統 a/c/e, alliance/cbot/eurex eCBOT, e-cbot ICE, ICE QUEST, QUEST
客戶類別	30	33	char(4)	4 位數字， 9999, 公司客戶 證券商代號, 交易輔助人 客戶
買入契約數	34	40	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
賣出契約數	41	47	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
成交數	48	55	numeric(8,0)	8 位數字，不足左補 0
月底未沖銷量	56	62	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0 時段為一般交易時段時填 入，盤後交易時段填 0
時段	63	63	char(1)	1 位文字， N, 一般交易時段，E, 盤後 交易時段

期貨交易輔助人國內期貨交易量申報檔案格式

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明
申報年月	1	6	char(6)	6 位文字，YYYYMM
商品代碼	7	14	char(8)	8 位文字，不足右補空白 請參考線上輸入，新增功能，商品代號查詢
商品種類	15	15	char(1)	1 位文字 F, 期貨商品 C, 選擇權買權 P, 選擇權賣權
契約年月	16	21	char(6)	6 位文字，YYYYMM
交易方式	22	29	char(8)	8 位文字，不足右補空白 EFP, 期貨與現貨互換交易 REG, 一般交易 GLOX, GLOBEX PRJA, PROJECT A ACES, ACCESS APT, APT ATS, 自動交易系統 ETS, 電子交易系統 a/c/e, alliance/cbot/eurex eCBOT, e-cbot ICE, ICE QUEST, QUEST
買入契約數	30	36	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
賣出契約數	37	43	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
成交數	44	51	numeric(8,0)	8 位數字，不足左補 0
月底未沖銷量	52	58	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0 時段為一般交易時段時填入，盤後交易時段填 0
時段	59	59	char(1)	1 位文字， N, 一般交易時段，E, 盤後交易時段

電子式委託月交易量申報檔案格式

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明
期貨商代號	1	7	char(7)	7 位文字，不足右補空白
申報年月	8	13	char(6)	6 位文字，YYYYMM
電子式類別	14	14	char(1)	1 位文字， 0, 網際網路下單 1, 語音下單 D, 專屬線路(DMA)下單【註 1】 A: 應用程式介面(API)下單【註 2】
本月開戶人數	15	21	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
商品代號	22	29	char(8)	8 位文字，不足右補空白 依據本公司提供之「期貨交易所及商品代碼查詢檔」
商品種類	30	30	char(1)	1 位文數字， F, 期貨商品 C, 選擇權買權 P, 選擇權賣權
本月電子式委託筆數	31	37	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
本月電子式委託口數	38	46	numeric(9,0)	9 位數字，不足左補 0
本月電子式成交筆數	47	53	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
本月電子式成交口數	54	62	numeric(9,0)	9 位數字，不足左補 0
本月電子式錯帳筆數	63	69	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
本月電子式錯帳口數	70	78	numeric(9,0)	9 位數字，不足左補 0
有效憑證張數	79	83	numeric(5,0)	5 位數字，不足左補 0
使用網際網路下單戶數	84	90	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
本月全市場成交總筆數	91	98	numeric(8,0)	8 位數字，不足左補 0
本月全市場成交總口數	99	106	numeric(8,0)	8 位數字，不足左補 0
本月份使用應用程式介面(API)總下單戶數	107	113	numeric(7,0)	7 位數字，不足左補 0
本月無電子式交易	114	114	char(1)	1 位文數字， Y, 本月無任何電子式交易 N, 其他
時段	115	115	char(1)	1 位文字， N, 一般交易時段，E, 盤後

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明
				交易時段

註 1：有關「期貨經紀商辦理電子式專屬線路下單(Direct Market Access)作業要點」詳見本公司 96 年 7 月 17 日台期交字第 09600053640 號公告，及本公司「業務規則」第 48 條條文。另辦理電子式專屬線路下單業務，依「期貨經紀商辦理電子式專屬線路下單作業要點」規定，將貴公司所採行之資訊傳輸架構、流程與安全管控機制，填具「期貨經紀商辦理電子式專屬線路下單(Direct Market Access)業務聲明暨申請書」。

註 2：有關期貨經紀商提供客戶使用應用程式介面(Application Programming Interface)服務之申請流程、核可標準及相關控管配套措施等相關內容，詳見本公司 99 年 10 月 25 日台期稽字第 09900112920 號函公告之期貨商及期貨交易輔助人內部控制制度標準規範。

0：網際網路下單(內含使用 API 下單者)

A：應用程式介面(API)下單(係指利用網際網路下單方式使用 API 下單者)

範例 1：於一般交易時段使用語音下單(紅、黑間隔各代表一不同欄位)

**F001...20030810005515TX.....C00000120000005130000013000000542000000
400000004508888000666600000569000016660000000NN**

範例 2：於一般交易時段使用應用程式介面(API)下單(紅、黑間隔各代表一不同欄位)

**F001...200308A0005515TX.....C00000120000005130000013000000542000000
400000004508888000666600000569000016660000128NN**

各商品代號，請依媒體申報系統之

02.業務申報\22.業務資料報表\08.主管機關核准交易所及商品表 項下查詢

期貨商錯帳申報檔案格式

欄位名稱	性質	位置	備註
1 期貨商代號	X(07)	[01:07]	7 位文字
2 委託人帳號	X(07)	[08:14]	7 位文字，不足右補空白
3 委託人戶名	X(30)	[15:44]	30 位文字，不足右補空白
4 委託人身分證字號	X(10)	[45:54]	10 位文字，不足右補空白
5 錯帳發生日	X(08)	[55:62]	8 位文字，YYYYMMDD
6. 錯帳發生交易時段	X(01)	[63]	1 位文字，N, 一般交易時段，E, 盤後交易時段
7 錯帳申報日	X(08)	[64:71]	8 位文字，YYYYMMDD
8 錯帳發生原因 1(交易人帳號錯誤)	X(01)	[72]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
9 錯帳發生原因 2(交易價格錯誤)	X(01)	[73]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
10 錯帳發生原因 3(單別錯誤)	X(01)	[74]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
11 錯帳發生原因 4(買賣方向錯誤)	X(01)	[75]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
12 錯帳發生原因 5(交易商品錯誤)	X(01)	[76]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
13 錯帳發生原因 6(合約月份錯誤)	X(01)	[77]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
14 錯帳發生原因 7(交易數量錯誤)	X(01)	[78]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
15 錯帳發生原因 8(重複輸單)	X(01)	[79]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
16 錯帳發生原因 9(其他原因)	X(01)	[80]	1 位文字，錯帳發生原因只能唯一 1, 此錯帳原因 0, 非此錯帳原因
17 委託單編號	X(10)	[81:90]	10 位文字，不足右補空白 限一筆
18 成交回報序號	X(200)	[91:290]	200 位文字，不足右補空白 可多筆，多筆成交回報序號間請以逗號“,” 隔開
19 錯帳處理數量	9(03)	[291:293]	3 位數字，不足右補空白
20 交易商品代號	X(20)	[294:313]	20 位文字，不足右補空白 選擇權填寫代號、履約價(五位數)
21 合約月份	X(13)	[314:326]	13 位文字，不足右補空白
22 錯帳損益金額	X(11)	[327:337]	第一位為“+”或“-”，再接 10 位數字，不足右補空白
23 詳述處理流程	X(200)	[338:537]	200 位文字，不足右補空白
24 主管姓名	X(30)	[538:567]	30 位文字，不足右補空白
25 承辦人姓名	X(30)	[568:597]	30 位文字，不足右補空白

期貨商更正帳號申報檔案格式

欄位名稱	性質	位置	備註
1 期貨商代號	X(07)	[01:07]	7 位文字
2 更正前帳號	X(07)	[08:14]	7 位文字，不足右補空白
3 更正轉入帳號	X(07)	[15:21]	7 位文字，不足右補空白
4 委託人戶名	X(30)	[22:51]	30 位文字，不足右補空白
5 委託人身分證字號	X(10)	[52:61]	10 位文字，不足右補空白
6 交易發生日	X(08)	[62:69]	8 位文字，YYYYMMDD
7 交易發生時段	X(01)	[70]	1 位文字，N, 一般交易時段，E, 盤後交易時段
8 更正帳號申報日	X(08)	[71:78]	8 位文字，YYYYMMDD
9 委託單編號	X(10)	[79:88]	10 位文字，不足右補空白 限一筆
10 成交回報序號	X(200)	[89:288]	200 位文字，不足右補空白 可多筆，多筆成交回報序號間請以逗號“,” 隔開
11 更正帳號處理數量	9(03)	[289:291]	3 位數字，不足右補空白
12 交易商品代號	X(20)	[292:311]	20 位文字，不足右補空白 選擇權填寫代號、履約價(五位數)
13 合約月份	X(13)	[312:324]	13 位文字，不足右補空白
14 更正帳號已平倉損益金額	X(11)	[325:335]	第一位為“+”或“-”，再接 10 位數字，不足右補空白
15 主管姓名	X(30)	[336:365]	30 位文字，不足右補空白
16 承辦人姓名	X(30)	[366:395]	30 位文字，不足右補空白