

臺灣期貨交易所

店頭衍生性商品集中結算 系統

SFTP 報表服務規範

版本： 2023/02/14 第 1.2.3 版

版權所有： 臺灣期貨交易所

店頭衍生性商品集中結算系統

SFTP 報表清單

目錄

一、SFTP 報表服務簡介.....	4
1. 店頭衍生性商品集中結算網路 SFTP 檔案傳輸伺服器(sftp server).....	4
二、SFTP 報表清單.....	5
三、報表詳細資訊.....	7
1. 當日所有 IRS 交易提交資料報表	7
2. 當日所有 NDF 交易提交資料報表	9
3. 當日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表	10
4. 當日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表	12
5. 前日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表	13
6. 前日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表	15
7. RFC 額度控管報表	16
8. 單一帳戶庫存部位明細表 IRS	17
9. 單一帳戶庫存部位明細表 NDF	19
10. 隔日部位互抵建議報表 IRS	20
11. 隔日部位互抵建議報表 NDF	21
12. 當日部位互抵結果報表	22
13. 單一結算契約結算報表 IRS	23
14. 單一結算契約結算報表 NDF	25
15. 單一結算帳戶結算報表	27
16. 結算會員結算報表	29
17. 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額	31
18. 歷史評價曲線查詢結果報表	32
19. Trade Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表	33
20. Account Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表	35
21. 結算會員日內例行保證金繳存通知	37
22. 結算會員日終例行保證金繳存通知	38
23. 結算會員日內 ad-hoc 保證金繳存通知	39
24. 結算會員 Backloading 保證金繳存通知	40
25. 結算帳戶日內例行保證金繳存通知	41
26. 結算帳戶日終例行保證金繳存通知	43

27.	結算帳戶日內 ad-hoc 保證金繳存通知	45
28.	結算帳戶 Backloading 保證金繳存通知	47
29.	訂價確認報表查詢 IRS	48
30.	訂價確認報表查詢 NDF	49
31.	有價證券抵繳手續費月報表	50
32.	結算服務費月報表	51
33.	結算帳戶結算服務費月報表	52
34.	結算會員結算保證金利息清單報表	53
35.	結算帳戶結算保證金利息清單報表	54
36.	結算保證金利息明細表	55
37.	結算帳戶結算保證金利息明細表	56
38.	結算服務費日報表-IRS 登記費	57
39.	結算服務費日報表-NDF 登記費	58
40.	結算服務費日報表-庫存部位維持費	59
41.	結算服務費日報表-部位互抵手續費	60
42.	結算服務費日報表-部位移轉手續費	61
43.	結算服務費日報表-結匯手續費	62
四、	附錄.....	63
1.	版本差異說明	63

一、SFTP 報表服務簡介

1. 店頭衍生性商品集中結算網路 SFTP 檔案傳輸伺服器(sftp server)

期交所為店頭衍生性商品集中結算網路建置 SFTP 檔案傳輸伺服器(以下簡稱 sftp server)供檔案收送使用。正式環境提供兩台 sftp server(sftpl.taifexccp:22999、sftp2.taifexccp:22999)進行檔案傳輸，兩台 Server 互為備援，檔案內容皆相同，請擇一使用即可。測試系統視情況提供一至兩台，為 ccpsftp.bq888.taifex.com.tw:22999，檔案內容亦皆相同。

SFTP 服務使用者密碼及公鑰需週期性更換，最長有效期為 90 天，使用者需於到期日前更新密碼及公鑰，且不可與前三次相同。密碼逾期將自動被重新設置一組新密碼，公鑰逾期則不可使用公鑰登入，直到重新設定使用者公鑰。SFTP 服務有鎖定機制，一段時間內登入錯誤三次會鎖定該 IP 15 分鐘。

當 client 端連線至 SFTP server，如出現 Host key verification failed 錯誤訊息，可能為 client 端記錄 server 端的 host key 不相同或已變更，可以將記錄的 host key 刪除後重新記錄，SFTP 服務使用者需自行處理該錯誤。

注意：市面上有許多免費或付費連線選項，期交所不對特定第三方 SFTP 連線軟體進行推薦，請考慮組織內部資訊安全選擇適當的連線方案。

二、SFTP 報表清單

項次	報表編號	報表名稱
1	F02_001_001	當日所有 IRS 交易提交資料報表
2	F02_001_002	當日所有 NDF 交易提交資料報表
3	F02_002_001	當日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表
4	F02_002_003	當日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表
5	F02_002_002	前日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表
6	F02_002_004	前日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表
7	F02_004_001	RFC 額度控管報表
8	F02_000_001	單一帳戶庫存部位明細表 IRS
9	F02_000_002	單一帳戶庫存部位明細表 NDF
10	F14_002_001	隔日部位互抵建議報表 IRS
11	F14_002_002	隔日部位互抵建議報表 NDF
12	F14_003_001	當日部位互抵結果報表
13	F08_001_001	單一結算契約結算報表
14	F08_001_002	單一結算契約結算報表 NDF
15	F08_002_001	單一結算帳戶結算報表
16	F08_003_001	結算會員結算報表
17	F09_015_001	結算帳戶實際抵繳金額及餘額查詢
18	F07_008	歷史評價曲線查詢結果報表
19	F07_014	Trade Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表
20	F07_015	Account Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表
21	F07_019_002	結算會員日內例行保證金繳存通知
22	F07_020_002	結算會員日終例行保證金繳存通知
23	F07_021_002	結算會員日內 ad-hoc 保證金繳存通知
24	F07_024_002	結算會員 Backloading 保證金繳存通知
25	F07_019_001	結算帳戶日內例行保證金繳存通知
26	F07_020_001	結算帳戶日終例行保證金繳存通知
27	F07_021_001	結算帳戶日內 ad-hoc 保證金繳存通知
28	F07_024_001	結算帳戶 Backloading 保證金繳存通知
29	F07_018_001	訂價確認報表查詢 IRS
30	F07_018_002	訂價確認報表查詢 NDF
31	F13_001	有價證券抵繳手續費月報表
32	F13_002	結算服務費月報表
33	F13_002_001	結算帳戶結算服務費月報表

34	F13_005	結算會員結算保證金利息清單
35	F13_005_001	結算帳戶結算保證金利息清單
36	F13_012	結算保證金利息明細表
37	F13_012_001	結算帳戶結算保證金利息明細表
38	F13_025	結算服務費日報表-IRS 登記費
39	F13_025_001	結算服務費日報表-NDF 登記費
40	F13_026	結算服務費日報表-庫存部位維持費
41	F13_027	結算服務費日報表-部位互抵手續費
42	F13_028	結算服務費日報表-部位移轉手續費
43	F13_029	結算服務費日報表-結匯手續費

三、報表詳細資訊

1. 當日所有 IRS 交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_001_001 當日所有 IRS 交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_001_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/13
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	H
商品類別	String	IRS
提交平台	String	MarkitWire TR
結算契約代碼	String	IR2022030100001
UTI	String	IS2022021000000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/12
契約生效日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約到期日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/14
固定利率收付方向(我方)	String	付固定利率
固定利率端名目本金幣別	String	TWD
固定利率端名目本金金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
固定利率(%)	Numeric(7, 4)	1.0000
固定利率端計息天數	String	Actual/Actual
固定利率端付息週期	String	3M
浮動利率收付方向(我方)	String	收浮動利率

欄位名稱	資料類別	範例
浮動利率端名目本金幣別	String	TWD
浮動利率端名目本金金額	Numeric(14, 2)	6,200,000.00
浮動利率指標	String	TAIBOR
浮動利率指標天期	String	3M
利率加減碼(%)	Numeric(7, 4)	0.5
浮動利率端付息週期	String	3M
浮動利率指標重設週期	String	3M
浮動利率端計息天數	String	Actual/365 (Fixed)
營業日原則	String	Modified Following Business Day
結算契約狀態	String	已結算
拒絕原因	String	21 23

2. 當日所有 NDF 交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_001_002 當日所有 NDF 交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_001_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	自有帳
商品類別	String	NDF
提交平台	String	Tradeserv TR
結算契約代碼	String	NF2023020600001
UTI	String	IS2023020600000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/06
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
契約定價日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/22
契約最後結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/24
報價貨幣	String	TWD
基礎貨幣	String	USD
結算幣別	String	USD
基礎貨幣買賣方向	String	B
基礎貨幣金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
遠期匯率	Numeric(7, 4)	30.1
結算契約狀態	String	已結算
拒絕原因	String	21 23

3. 當日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_002_001 當日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_002_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/13
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	H
商品類別	String	IRS
提交平台	String	MarkitWire TR
結算契約代碼	String	IR2022030100001
UTI	String	IS2022021000000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/12
契約生效日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約到期日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/14
固定利率收付方向(我方)	String	付固定利率
固定利率端名目本金幣別	String	TWD
固定利率端名目本金金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
固定利率(%)	Numeric(7, 4)	1.0000
固定利率端計息天數	String	Actual/Actual
固定利率端付息週期	String	3M
浮動利率收付方向(我方)	String	收浮動利率
浮動利率端名目本金幣別	String	TWD
浮動利率端名目本金金額	Numeric(14, 2)	6,200,000.00
浮動利率指標	String	TAIBOR

欄位名稱	資料類別	範例
浮動利率指標天期	String	3M
利率加減碼(%)	Numeric(7, 4)	0.5
浮動利率端付息週期	String	3M
浮動利率指標重設週期	String	3M
浮動利率端計息天數	String	Actual/365 (Fixed)
營業日原則	String	Modified Following Business Day
結算契約狀態	String	已結算
拒絕原因	String	21 23

4. 當日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_002_003 當日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_002_003_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	自有帳
商品類別	String	NDF
提交平台	String	Tradeserv TR
結算契約代碼	String	NF2023020600001
UTI	String	IS2023020600000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/06
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
契約定價日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/22
契約最後結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/24
報價貨幣	String	TWD
基礎貨幣	String	USD
結算幣別	String	USD
基礎貨幣買賣方向	String	B
基礎貨幣金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
遠期匯率	Numeric(7, 4)	30.1
結算契約狀態	String	已拒絕
拒絕原因	String	21 23

5. 前日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_002_002 前日所有 IRS Backloading 交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_002_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/12
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	H
商品類別	String	IRS
提交平台	String	MarkitWire TR
結算契約代碼	String	IR2022030100001
UTI	String	IS2022021000000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/12
契約生效日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約到期日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/14
固定利率收付方向(我方)	String	付固定利率
固定利率端名目本金幣別	String	TWD
固定利率端名目本金金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
固定利率(%)	Numeric(7, 4)	1.0000
固定利率端計息天數	String	Actual/Actual
固定利率端付息週期	String	3M
浮動利率收付方向(我方)	String	收浮動利率
浮動利率端名目本金幣別	String	TWD
浮動利率端名目本金金額	Numeric(14, 2)	6,200,000.00
浮動利率指標	String	TAIBOR

欄位名稱	資料類別	範例
浮動利率指標天期	String	3M
利率加減碼(%)	Numeric(7, 4)	0.5
浮動利率端付息週期	String	3M
浮動利率指標重設週期	String	3M
浮動利率端計息天數	String	Actual/365 (Fixed)
營業日原則	String	Modified Following Business Day
結算契約狀態	String	已結算
拒絕原因	String	21 23

6. 前日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_002_004 前日所有 NDF Backloading 交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_002_004_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/06
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	自有帳
商品類別	String	NDF
提交平台	String	Tradeserv TR
結算契約代碼	String	NF2023020600001
UTI	String	IS2023020600000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/06
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
契約定價日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/22
契約最後結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/24
報價貨幣	String	TWD
基礎貨幣	String	USD
結算幣別	String	USD
基礎貨幣買賣方向	String	B
基礎貨幣金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
遠期匯率	Numeric(7, 4)	30.1
結算契約狀態	String	已接受
拒絕原因	String	21 23

7. RFC 額度控管報表

■ 報表名稱：

F02_004_001 RFC 額度控管報表

■ 檔案名稱：

F02_004_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/06
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
基礎貨幣	String	TWD
可使用額度	Numeric(14, 0)	1,000,000
已使用額度	Numeric(14, 0)	800,000
額度使用率(%)	Numeric(7, 4)	80
自動作為 RFC 結果	String	Y

8. 單一帳戶庫存部位明細表 IRS

■ 報表名稱：

F02_000_001 單一帳戶庫存部位明細表 IRS

■ 檔案名稱：

F02_000_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/13
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	自有帳
商品類別	String	IRS
提交平台	String	MarkitWire TR
結算契約代碼	String	IR2022030100001
UTI	String	IS2022021000000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/12
契約生效日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/14
契約到期日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/14
固定利率收付方向(我方)	String	付固定利率
固定利率端名目本金幣別	String	TWD
固定利率端名目本金金額	Numeric (14, 2)	1,000,000.00
固定利率(%)	Numeric(7,4)	1.0000
固定利率端計息天數	String	Actual/Actual
固定利率端付息週期	String	3M
浮動利率收付方向(我方)	String	收浮動利率
浮動利率端名目本金幣別	String	TWD
浮動利率端名目本金金額	Numeric (14, 2)	6,200,000.00
浮動利率指標	String	TAIBOR

欄位名稱	資料類別	範例
浮動利率指標天期	String	3M
利率加減碼(%)	Numeric(7, 4)	0.5
浮動利率端付息週期	String	3M
浮動利率指標重設週期	String	3M
浮動利率端計息天數	String	Actual/365 (Fixed)
先期費幣別	String	TWD
先期費金額	Numeric (14, 2)	-100,000*
先期費收付日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/15
營業日原則	String	Modified Following Business Day
畸零天期種類	String	None
畸零天期利率(%)	Numeric(7, 4)	
畸零天期指標利率 1	String	
畸零天期指標利率 2	String	
結算契約狀態	String	已結算

*先期費金額欄位可能為正、負號

9. 單一帳戶庫存部位明細表 NDF

■ 報表名稱：

F02_000_002 單一帳戶庫存部位明細表 NDF

■ 檔案名稱：

F02_000_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

提交作業截止後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶帳號	String	0130000
結算帳戶類別	String	自有帳
商品類別	String	NDF
提交平台	String	Tradeserv TR
結算契約代碼	String	NF20230206000001
UTI	String	IS20230206000000009
交易對手代號	String	0980000
契約交易日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/06
契約集中結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/07
契約定價日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/22
契約最後結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/24
報價貨幣	String	TWD
基礎貨幣	String	USD
結算幣別	String	USD
基礎貨幣買賣方向	String	B
基礎貨幣金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
遠期匯率	Numeric(7, 4)	30.1
結算契約狀態	String	已結算

10. 隔日部位互抵建議報表 IRS

■ 報表名稱：

F14_002_001 隔日部位互抵建議報表 IRS

■ 檔案名稱：

F14_002_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0980000
結算帳戶類別	String	自有帳
結算帳戶帳號	String	9000011
商品類別	String	IRS
UTI	String	IS052022030900000016 IS052022030900000019
互抵部位	String	IR2022030900030 IR2022030900041
契約到期日	Date	2027/03/11
建議申請時間	Date	2022/03/24
Pay/Rec	String	FIXED
固定利率(%)	Numeric(7, 4)	1.05%
付方本金幣別	String	TWD
付方本金	Numeric	19,000,000.00
Pay/Rec	String	FLOAT
收方本金幣別	String	TWD
收方本金	Numeric (14, 2)	19,000,000.00

11. 隔日部位互抵建議報表 NDF

■ 報表名稱：

F14_002_001 隔日部位互抵建議報表 NDF

■ 檔案名稱：

F14_002_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0980000
結算帳戶類別	String	自有帳
結算帳戶帳號	String	9000011
商品類別	String	NDF
UTI	String	TNN20230130151909737 TNN20230130151909738
互抵部位	String	NF2023011600033 NF2023011600034
契約最後結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/02/24
建議申請時間	Date(yyyy/MM/dd)	2022/02/08
報價貨幣	String	TWD
基礎貨幣	String	USD
基礎貨幣金額	Numeric(14, 2)	1,000,000.00
基礎貨幣買賣方向	String	B
遠期匯率	Numeric(7, 4)	30.1

12. 當日部位互抵結果報表

■ 報表名稱：

F14_003_001 當日部位互抵結果報表

■ 檔案名稱：

F14_003_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0980000
結算帳戶類別	String	自有帳
結算帳戶帳號	String	9000011
商品類別	String	IRS
申請序號	String	202103300105001
申請日期	Date	2022/03/24
互抵成功筆數	Integer	2
UTI	String	IS052022030900000016 IS052022030900000019
互抵部位	String	IR20220309000030 IR20220309000041
互抵成功部位	String	IR20220309000030 IR20220309000041
幣別	String	TWD
新互抵部位	String	IR20220309000042
互抵失敗筆數	Integer	2
互抵失敗部位	String	IR20220309000043 IR20220309000044
互抵方式	String	
申請狀態	String	

13. 單一結算契約結算報表 IRS

■ 報表名稱：

F08_001_001 單一結算契約結算報表 IRS

■ 檔案名稱：

F08_001_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算會員名稱	String	CCP 測試會員
結算帳戶類別	String	HOUSE
每日結算類型	String	CTM
結算帳戶帳號	String	9000015
結算帳戶名稱	String	CCP 測試帳戶
商品類別	String	IRS
結算契約代碼	String	IR2022022200001
UTI	String	IS052022022200000001
結算契約狀態	String	CLEARED
結算契約異動	String	New Trade
結算契約終止時間	Datetime2	
結算款項收付日	Date(yyyy/MM/dd)	2020/06/29
結算幣別	String	TWD
變動保證金	Decimal(14, 2)	0
洗價損益	Decimal(14, 2)	-50
價格校正利息	Decimal(14, 2)	0
價格校正金額	Decimal(14, 2)	0
IRS 應收付利息金額	Decimal(14, 2)	0
先期費	Decimal(14, 2)	0
變動保證金調整款項	Decimal(14, 2)	0
洗價損益調整款項	Decimal(14, 2)	0
提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
部位移入款項	Decimal(14, 2)	0
部位互抵款項	Decimal(14, 2)	0

欄位名稱	資料類別	範例
部位壓縮調整款項	Decimal(14, 2)	0
多邊提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
淨額結算損益	Decimal(14, 2)	0
其他應收付款項	Decimal(14, 2)	0
結算款項總金額	Decimal(14, 2)	-50

14. 單一結算契約結算報表 NDF

■ 報表名稱：

F08_001_002 單一結算契約結算報表 NDF

■ 檔案名稱：

F08_001_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算會員名稱	String	CCP 測試會員
結算帳戶類別	String	HOUSE
每日結算類型	String	CTM
結算帳戶帳號	String	9000015
結算帳戶名稱	String	CCP 測試帳戶
商品類別	String	NDF
結算契約代碼	String	ND2022022200001
UTI	String	FS052022022200000001
報價貨幣	String	TWD
基礎貨幣	String	USD
結算契約狀態	String	CLEARED
結算契約異動	String	New Trade
結算契約終止時間	Datetime2	
結算款項收付日	Date(yyyy/MM/dd)	2020/06/29
結算幣別	String	TWD
變動保證金	Decimal(14, 2)	0
洗價損益	Decimal(14, 2)	-50
價格校正利息	Decimal(14, 2)	0
價格校正金額	Decimal(14, 2)	0
NDF 到期結算損益金額	Decimal(14, 2)	0
變動保證金調整款項	Decimal(14, 2)	0
洗價損益調整款項	Decimal(14, 2)	0
提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
部位移入款項	Decimal(14, 2)	0

欄位名稱	資料類別	範例
部位互抵款項	Decimal(14, 2)	0
部位壓縮調整款項	Decimal(14, 2)	0
多邊提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
淨額結算損益	Decimal(14, 2)	
其他應收付款項	Decimal(14, 2)	0
結算款項總金額	Decimal(14, 2)	-50

15. 單一結算帳戶結算報表

■ 報表名稱：

F08_002_001 單一結算帳戶結算報表

■ 檔案名稱：

F08_002_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算會員名稱	String	CCP 測試會員
結算帳戶類別	String	HOUSE
每日結算類型	String	CTM
結算帳戶帳號	String	9000015
結算帳戶名稱	String	CCP 測試帳戶
結算幣別	String	TWD
原存有現金餘額	Decimal(14, 2)	1,004,665,684.73
本日結算款項	Decimal(14, 2)	-157,508
現金存入\移入	Decimal(14, 2)	0
現金提領\移出	Decimal(14, 2)	0
本日現金餘額	Decimal(14, 2)	1,004,508,176.73
變動保證金	Decimal(14, 2)	0
洗價損益	Decimal(14, 2)	0
價格校正利息	Decimal(14, 2)	0
價格校正金額	Decimal(14, 2)	0
IRS 應收付利息金額	Decimal(14, 2)	0
NDF 到期結算款項	Decimal(14, 2)	0
先期費	Decimal(14, 2)	0
變動保證金調整款項	Decimal(14, 2)	0
洗價損益調整款項	Decimal(14, 2)	0
提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
部位移入款項	Decimal(14, 2)	0
部位互抵款項	Decimal(14, 2)	0
部位壓縮調整款項	Decimal(14, 2)	

欄位名稱	資料類別	範例
部位壓縮應收付款項	Decimal(14, 2)	0
多邊提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
拍賣損益	Decimal(14, 2)	0
淨應收結算款項調整項	Decimal(14, 2)	0
淨額結算損益	Decimal(14, 2)	
其他應收付款項	Decimal(14, 2)	0
次日應收付結算款項	Decimal(14, 2)	0(次日應收付款項總額)
有價證券評價價值	Decimal(14, 2)	0
有價證券實際抵繳金額	Decimal(14, 2)	0(實際抵繳金額)
有價證券未抵繳金額	Decimal(14, 2)	0
現存有保證金	Decimal(14, 2)	0(現存有保證金餘額)
現存有保證金加計有價證券未抵繳金額	Decimal(14, 2)	
應繳結算保證金	Decimal(14, 2)	0(應存有保證金)
超額	Decimal(14, 2)	0(超額保證金)
超額結算保證金(現金)	Decimal(14, 2)	0
結算/客戶保證金不足應繳存金額-現金	Decimal(14, 2)	0(日終現金保證金追繳)
結算保證金不足應繳存金額-現金或有價證券	Decimal(14, 2)	0(日終保證金追繳)
應繳客戶保證金	Decimal(14, 2)	
超額客戶保證金	Decimal(14, 2)	
客戶保證金不足應繳存金額-現金或有價證券	Decimal(14, 2)	
部位集中度加收金額(參考)	Decimal(14, 2)	

16. 結算會員結算報表

■ 報表名稱：

F08_003_001 結算會員結算報表

■ 檔案名稱：

F08_003_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算會員名稱	String	CCP 測試會員
結算帳戶類別	String	HOUSE
結算幣別	String	TWD
原存有現金餘額	Decimal(14, 2)	1, 901, 416, 715. 08
本日結算款項	Decimal(14, 2)	4, 135, 120
現金存入/移入	Decimal(14, 2)	0
現金提領/移出	Decimal(14, 2)	0
本日現金餘額	Decimal(14, 2)	1, 905, 545, 835. 08
變動保證金	Decimal(14, 2)	0
洗價損益	Decimal(14, 2)	0
價格校正利息	Decimal(14, 2)	0
價格校正金額	Decimal(14, 2)	0
IRS 應收付利息金額	Decimal(14, 2)	0
NDF 到期結算款項	Decimal(14, 2)	0
先期費	Decimal(14, 2)	0
變動保證金調整款項	Decimal(14, 2)	0
洗價損益調整款項	Decimal(14, 2)	0
提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
部位移入款項	Decimal(14, 2)	0
部位互抵款項	Decimal(14, 2)	0
部位壓縮調整款項	Decimal(14, 2)	0
部位壓縮應收付款項	Decimal(14, 2)	0
多邊提前終止損益	Decimal(14, 2)	0
拍賣損益	Decimal(14, 2)	0

欄位名稱	資料類別	範例
淨應收結算款項調整項	Decimal(14, 2)	0
淨額結算損益	Decimal(14, 2)	0
其他應收付款項	Decimal(14, 2)	0
次日應收付結算款項	Decimal(14, 2)	0(次日應收付款項總額)
有價證券評價價值	Decimal(14, 2)	5,305,969
有價證券實際抵繳金額	Decimal(14, 2)	3,429,695(實際抵繳金額)
有價證券未抵繳金額	Decimal(14, 2)	0
現存有保證金	Decimal(14, 2)	31,393,136,626.4(現存有保證金餘額)
現存有保證金加計有價證券未抵繳金額	Decimal(14, 2)	0
應繳結算保證金	Decimal(14, 2)	0(應存有保證金)
超額	Decimal(14, 2)	0(超額保證金)
超額結算保證金(現金)	Decimal(14, 2)	0(現金超額保證金加計次日應收付款項)
結算保證金不足應繳存金額-現金	Decimal(14, 2)	0(日終現金保證金追繳)
結算保證金不足應繳存金額-現金或有價證券	Decimal(14, 2)	0(日終保證金追繳)
部位集中度加收金額(參考)	Decimal(14, 2)	

17. 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額

■ 報表名稱：

F09_015_001 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額

■ 檔案名稱：

F09_015_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算會員名稱	String	CCP 測試會員
結算帳戶帳號	String	9000015
結算帳戶名稱	String	CCP 測試帳戶
結算帳戶類別	String	HOUSE
公債代號	Integer	
銀行代碼	Integer	013
昨日有價證券餘額	Decimal(14, 2)	
有價證券存入	Decimal(14, 2)	
有價證券提領	Decimal(14, 2)	
有價證券撥入	Decimal(14, 2)	
有價證券撥出	Decimal(14, 2)	
有價證券餘額	Decimal(14, 2)	
基礎幣別	String	
市價	Decimal(14, 2)	
折扣比率	Decimal(7, 4)	
評價價值	Decimal(14, 2)	
整戶評價價值	Decimal(14, 2)	
實際抵繳金額	Decimal(14, 2)	
應繳保證金	Decimal(14, 2)	

18. 歷史評價曲線查詢結果報表

■ 報表名稱：

F07_008 歷史評價曲線查詢結果報表

■ 檔案名稱：

F07_008_結算會員代號 X.csv

(X=1、2、3、4 或 5，1=Intra Day，2=EOD，3=Ad-hoc 1，4=Ad-hoc2，5=Ad-hoc3)

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
商品類別	String	IRS
天期	String	1W
IRS Curve/NDF Curve	Decimal(9,6)	0.5

19. Trade Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表

■ 報表名稱：

F07_014 Trade Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表

■ 檔案名稱：

F07_014_001_結算會員代號 X.csv

(X=1 或 2，1=Intra Day，2=EOD)

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
評價曲線	String	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
結算幣別	String	
帳戶結算狀態	String	
每日結算類型	String	
身分碼	String	
UTI	String	
結算契約代碼	String	
契約計價幣別	String	
商品類別	String	
結算契約狀態產生緣由	String	
昨日日終淨現值	Decimal(19,2)	
昨日日終調整後淨現值	Decimal(19,2)	
今日日終淨現值	Decimal(19,2)	
今日日終調整後淨現值	Decimal(19,2)	

欄位名稱	資料類別	範例
變動保證金/洗價損益	Decimal(19, 2)	
PAI/PAA rate	Decimal(9, 6)	
PAI/PAA 金額	Decimal(19, 2)	
PV01/Delta Shift Up	Decimal(19, 2)	
PV01/Delta Shift Down	Decimal(19, 2)	

20. Account Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表

■ 報表名稱：

F07_015 Account Level 淨現值、保證金計算作業結果查詢報表

■ 檔案名稱：

F07_015_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

1. 日終結帳作業完成後
2. 營業日換日作業及完成應存有保證金與追繳計算後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
評價曲線	String	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
結算幣別	String	
帳戶結算狀態	String	
每日結算類型	String	
身分碼	String	
昨日日終淨現值	Decimal(20, 4)	
昨日日終調整後淨現值	Decimal(20, 4)	
今日日終淨現值	Decimal(20, 4)	
今日日終調整後淨現值	Decimal(20, 4)	
變動保證金/洗價損益	Decimal(20, 4)	
PAI/PAA 金額	Decimal(20, 4)	
TWD IRS PV01_ShiftUp	Decimal(20, 4)	
TWD NDF Delta_ShiftUp	Decimal(20, 4)	
原始保證金	Decimal(20, 4)	
流動性風險加收保證金	Decimal(20, 4)	
額外保證金(長假加收)	Decimal(20, 4)	

欄位名稱	資料類別	範例
額外保證金(結算會員未符財務資格)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(本公司認為之必要狀況)	Decimal(20, 4)	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	
結算保證金維持率	Decimal(9, 6)	
應繳客戶保證金	Decimal(20, 4)	
超額客戶保證金	Decimal(20, 4)	
客戶保證金維持率	Decimal(9, 6)	

21. 結算會員日內例行保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_019_002 結算會員日內例行保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_019_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日內例行洗價作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
基礎貨幣	String	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	
結算保證金不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	

22. 結算會員日終例行保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_020_002 結算會員日終例行保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_020_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

營業日換日作業及完成應存有保證金與追繳計算後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算幣別	String	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	
結算保證金不足應繳存金額-現金	Decimal(20, 4)	
結算保證金不足應繳存金額-現金或有價證券	Decimal(20, 4)	
部位集中度加收金額	Decimal(20, 4)	

23. 結算會員日內 ad-hoc 保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_021_002 結算會員日內 ad-hoc 保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_021_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日內 ad-hoc 保證金繳存通知送審通過時

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
基礎貨幣	String	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	
結算保證金不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	

24. 結算會員 Backloading 保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_024_002 結算會員 Backloading 保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_024_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

營業日換日作業及完成應存有保證金與追繳計算後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
基礎貨幣	String	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
Backloading 結算保證金 不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	

25. 結算帳戶日內例行保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_019_001 結算帳戶日內例行保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_019_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日內例行洗價作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
結算幣別	String	
原始保證金	Decimal(20, 4)	
流動性風險加收保證金	Decimal(20, 4)	
額外保證金(長假加收)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(結算會員未 符財務資格)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(本公司認為 之必要狀況)	Decimal(20, 4)	
變動保證金/洗價損益	Decimal(20, 4)	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	

欄位名稱	資料類別	範例
結算保證金不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	
應繳客戶保證金	Decimal(20, 4)	
超額客戶保證金	Decimal(20, 4)	
客戶保證金不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	

26. 結算帳戶日終例行保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_020_001 結算帳戶日終例行保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_020_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

營業日換日作業及完成應存有保證金與追繳計算後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
結算幣別	String	
原始保證金	Decimal(20, 4)	
流動性風險加收保證金	Decimal(20, 4)	
額外保證金(長假加收)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(結算會員未 符合財務資格)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(本公司認為 之必要狀況)	Decimal(20, 4)	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	
結算/客戶保證金不足應 繳存金額-現金	Decimal(20, 4)	

欄位名稱	資料類別	範例
結算保證金不足應繳存金額-現金或有價證券	Decimal(20, 4)	
應繳客戶保證金	Decimal(20, 4)	
超額客戶保證金	Decimal(20, 4)	
客戶保證金不足應繳存金額-現金或有價證券	Decimal(20, 4)	
部位集中度加收金額(參考)	Decimal(20, 4)	

27. 結算帳戶日內 ad-hoc 保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_021_001 結算帳戶日內 ad-hoc 保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_021_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日內 ad-hoc 保證金繳存通知送審通過時

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
結算幣別	String	
原始保證金	Decimal(20, 4)	
流動性風險加收保證金	Decimal(20, 4)	
額外保證金(長假加收)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(結算會員未 符財務資格)	Decimal(20, 4)	
額外保證金(本公司認為 之必要狀況)	Decimal(20, 4)	
變動保證金/洗價損益	Decimal(20, 4)	
現金餘額	Decimal(20, 4)	
有價證券評價價值	Decimal(20, 4)	
有價證券實際抵繳金額	Decimal(20, 4)	
有價證券未抵繳金額	Decimal(20, 4)	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
超額結算保證金	Decimal(20, 4)	

欄位名稱	資料類別	範例
結算保證金不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	
應繳客戶保證金	Decimal(20, 4)	
超額客戶保證金	Decimal(20, 4)	
客戶保證金不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	

28. 結算帳戶 Backloading 保證金繳存通知

■ 報表名稱：

F07_024_001 結算帳戶 Backloading 保證金繳存通知

■ 檔案名稱：

F07_024_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

營業日換日作業及完成應存有保證金與追繳計算後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
資料日期	Date(yyyy/MM/dd)	
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶類別	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
結算幣別	String	
現存有保證金	Decimal(20, 4)	
次日應收付結算款項	Decimal(20, 4)	
應繳結算保證金	Decimal(20, 4)	
Backloading 結算保證金 不足應繳存金額	Decimal(20, 4)	

29. 訂價確認報表查詢 IRS

■ 報表名稱：

F07_018_001 訂價確認報表 IRS

■ 檔案名稱：

F07_018_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
商品類別	String	
交易單號	String	
交易狀態	String	
結算契約狀態產生緣由	String	
訂價日	String	
訂價指標	String	
訂價價格	Decimal(9, 6)	
支付日	String	
計息開始日	String	
計息結束日	String	
IRS 付息金額	Decimal(20, 4)	
訂價價格設定日	String	
是否已訂價	String	

30. 訂價確認報表查詢 NDF

■ 報表名稱：

F07_018_002 訂價確認報表 NDF

■ 檔案名稱：

F07_018_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	
結算會員名稱	String	
結算帳戶帳號	String	
結算帳戶名稱	String	
商品類別	String	
交易單號	String	
交易狀態	String	
結算契約狀態產生緣由	String	
訂價日	String	
訂價指標	String	
訂價價格	Decimal(9, 6)	
支付日	String	
到期結算損益金額	Decimal(20, 4)	
訂價價格設定日	String	
是否已訂價	String	

31. 有價證券抵繳手續費月報表

■ 報表名稱：

F13_001 有價證券抵繳手續費月報表

■ 檔案名稱：

F13_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
結算帳戶帳號	String	9000017
日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
帳戶實際抵繳金額	Decimal(19,4)	25,714,309
帳戶管理費率	Decimal(19,8)	0.05%
帳戶管理費	Decimal(19,4)	35
中央登錄公債跨行轉帳金額	Decimal(19,4)	
中央登錄公債跨行轉帳手續費	Decimal(19,4)	
中央登錄公債餘額	Decimal(19,4)	42,000,000
中央登錄公債帳戶維護費率	Decimal(19,8)	0.007%
中央登錄公債帳戶維護費	Decimal(19,4)	8
有價證券抵繳收費合計金額	Decimal(19,4)	43

32. 結算服務費月報表

■ 報表名稱：

F13_002 結算服務費月報表

■ 檔案名稱：

F13_002_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算帳戶類別	String	H
日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
登記費	Decimal(19,4)	0
維持費	Decimal(19,4)	0
部位互抵手續費	Decimal(19,4)	0
部位壓縮手續費	Decimal(19,4)	0
部位移轉手續費	Decimal(19,4)	0
結匯手續費	Decimal(19,4)	0
本月合計	Decimal(19,4)	0

33. 結算帳戶結算服務費月報表

■ 報表名稱：

F13_002_001 結算帳戶結算服務費月報表

■ 檔案名稱：

F13_002_001_結算帳戶代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算帳戶類別	String	H
日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
登記費	Decimal(19,4)	0
維持費	Decimal(19,4)	0
部位互抵手續費	Decimal(19,4)	0
部位壓縮手續費	Decimal(19,4)	0
部位移轉手續費	Decimal(19,4)	0
結匯手續費	Decimal(19,4)	0
本月合計	Decimal(19,4)	0

34. 結算會員結算保證金利息清單報表

■ 報表名稱：

F13_005 結算會員結算保證金利息清單報表

■ 檔案名稱：

F13_005_結算會員代號_YYYY_FH.csv (上半年)

F13_005_結算會員代號_YYYY_SH.csv (下半年)

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每半年，傳送日期為本部確認完資料後傳送, 約為 1 月 15 日及 7 月 15 日前，結算會員可以透過 SFTP 收到報表

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
幣別	String	TWD
日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
計息利率(%)	Decimal(12,4)	0.0400
結算會員現金餘額(元)	Decimal(20,4)	100
結算保證金利息(幣別/元)	Decimal(19,4)	0.005

35. 結算帳戶結算保證金利息清單報表

■ 報表名稱：

F13_005_001 結算帳戶結算保證金利息清單報表

■ 檔案名稱：

F13_005_001_結算帳戶代號_YYYY_FH.csv (上半年)

F13_005_001_結算帳戶代號_YYYY_SH.csv (下半年)

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每半年，傳送日期為本部確認完資料後傳送, 約為 1 月 15 日及 7 月 15

日前，結算會員可以透過 SFTP 收到報表

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
幣別	String	TWD
日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
計息利率(%)	Decimal(12,4)	0.0400
結算帳戶現金餘額(元)	Decimal(20,4)	100
結算保證金利息(幣別/元)	Decimal(19,4)	0.005

36. 結算保證金利息明細表

■ 報表名稱：

F13_012 結算保證金利息明細表

■ 檔案名稱：

F13_012_結算會員代號_YYYY_FH.csv (上半年)

F13_012_結算會員代號_YYYY_SH.csv (下半年)

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每半年，傳送日期為本部確認完資料後傳送, 約為 1 月 15 日及 7 月 15

日前，結算會員可以透過 SFTP 收到報表

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算帳戶類別	String	H
幣別	String	TWD
匯率	Decimal(12,6)	29.656635
計息迄日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
結算會員約定出金指定帳號	String	
應收利息總額	Decimal(19,4)	4820.91
應收利息總額(台幣)	Decimal(19,4)	142972
扣繳稅額	Decimal(19,4)	482.09
扣繳稅額(台幣)	Decimal(19,4)	14297
應收利息淨額	Decimal(19,4)	4338.82
應收利息淨額(台幣)	Decimal(19,4)	128675

37. 結算帳戶結算保證金利息明細表

■ 報表名稱：

F13_012_001 結算帳戶結算保證金利息明細表

■ 檔案名稱：

F13_012_001_結算帳戶代號_YYYY_FH.csv (上半年)

F13_012_001_結算帳戶代號_YYYY_SH.csv (下半年)

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每半年，傳送日期為本部確認完資料後傳送, 約為 1 月 15 日及 7 月 15

日前，結算會員可以透過 SFTP 收到報表

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
結算帳戶類別	String	H
幣別	String	TWD
匯率	Decimal(12,6)	29.656635
計息迄日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
結算會員約定出金指定帳號	String	
應收利息總額	Decimal(19,4)	4820.91
應收利息總額(台幣)	Decimal(19,4)	142972
扣繳稅額	Decimal(19,4)	482.09
扣繳稅額(台幣)	Decimal(19,4)	14297
應收利息淨額	Decimal(19,4)	4338.82
應收利息淨額(台幣)	Decimal(19,4)	128675

38. 結算服務費日報表-IRS 登記費

■ 報表名稱：

F13_025 結算服務費日報表-IRS 登記費

■ 檔案名稱：

F13_025_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
契約結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/02
契約生效日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
結算帳戶帳號	String	9000015
結算契約代碼	String	IR2022090200009
商品代號	String	IRS_TWD
幣別	String	TWD
固定利率端名目本金	Decimal(19, 2)	500,000,000
契約到期日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/09/06
交易狀態	String	N
登記費率	Decimal(19, 8)	5.00
匯率	Decimal(12, 6)	1
登記費	Decimal(19, 4)	2500

39. 結算服務費日報表-NDF 登記費

■ 報表名稱：

F13_025_001 結算服務費日報表-NDF 登記費

■ 檔案名稱：

F13_025_001_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
契約結算日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/02
契約生效日	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/06
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	TWD
結算帳戶帳號	String	9000015
結算契約代碼	String	NF2022090200009
商品代號	String	NDF_USD_TWD
基礎貨幣	String	USD
基礎貨幣金額	Decimal(20, 4)	1,000,000
契約到期日	Date(yyyy/MM/dd)	2023/09/06
交易狀態	String	N
登記費率	Decimal(19, 8)	5.00
匯率	Decimal(12, 6)	1
登記費	Decimal(19, 4)	2500

40. 結算服務費日報表-庫存部位維持費

■ 報表名稱：

F13_026 結算服務費日報表-庫存部位維持費

■ 檔案名稱：

F13_026_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/02
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
結算帳戶帳號	String	9000015
結算契約代碼	String	IR2022090200009
商品代號	String	IRS_TWD
幣別	String	TWD
固定利率端名目本金	Decimal(19, 2)	500,000,000
維持費率(元/百萬)	Decimal(19, 8)	5.00
維持費	Decimal(19, 4)	2500

41. 結算服務費日報表-部位互抵手續費

■ 報表名稱：

F13_027 結算服務費日報表-部位互抵手續費

■ 檔案名稱：

F13_027_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
部位互抵生效日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/02
部位互抵類別	String	標準法
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
結算帳戶帳號	String	9000015
舊結算契約代碼	String	IR2022090200009
舊契約提前終止筆數	String	1
新增結算契約代碼	String	IR2022091500009
新增契約名目本金	Decimal(19, 2)	500,000,000
部位互抵手續費	Decimal(19, 4)	0

42. 結算服務費日報表-部位移轉手續費

■ 報表名稱：

F13_028 結算服務費日報表-部位移轉手續費

■ 檔案名稱：

F13_028_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
部位移轉生效日期	Date(yyyy/MM/dd)	2022/09/02
移出結算會員代號	String	9999999
移出方結算帳戶類別	String	H
移出方結算帳戶帳號	String	V13T000
移入結算會員代號	String	0960000
移入方結算帳戶類別	String	H
移入方結算帳戶帳號	String	9000015
移出結算契約代碼	String	IR2022090200009
部位移轉契約數	String	1
部位移轉類別	String	7
新增結算契約代碼	String	IR2022091500009
部位移轉手續費	Decimal(19, 4)	0

43. 結算服務費日報表-結匯手續費

■ 報表名稱：

F13_029 結算服務費日報表-結匯手續費

■ 檔案名稱：

F13_029_結算會員代號.csv

■ 產製時間：

日終結帳作業完成後

■ 產製頻率：

每日

■ 格式說明：

欄位名稱	資料類別	範例
日期	Date(yyyy/mm/dd)	2022/09/02
結算會員代號	String	0960000
結算帳戶類別	String	H
結算帳戶帳號	String	9000015
生效結匯筆數	String	1
結匯費率	Decimal(19, 8)	0
結匯手續費	Decimal(19, 4)	0

四、附錄

1. 版本差異說明

110.2.23 第 1.0.0 版

111.3.23 第 1.1.0 版 新增 SFTP 報表服務簡介、更新下列報表格式：F02_001_001、F02_001_002、F02_001_003、F02_001_004、F08_001_001、F08_002_001、F08_003_001、F09_015_001

111.9.15 第 1.1.1 版 更新下列報表格式：F07_008、F07_014、F08_001_001，新增下列報表格式：F02_002_001、F02_002_002、F02_003_003、F02_003_004、F02_003_005、F02_003_007

111.10.28 第 1.1.2 版 更新下列報表格式：F02_001_001、F02_001_002、F02_001_003、F02_001_004、F02_002_001、F02_002_002、F02_003_003、F02_003_004、F02_003_005、F02_003_007，新增下列報表格式：F13_001、F13_002、F13_005、F13_012、F13_025、F13_026、F13_027、F13_028、F13_029

111.12.20 第 1.1.3 版 更新下列報表格式：F02_001_001、F02_002_001 及 F02_002_002，刪除下列報表格式：F02_001_002、F02_001_003、F02_001_004、F02_003_003、F02_003_004、F02_003_005、F02_003_007，新增下列報表格式：F02_004_001

112.1.5 第 1.2.1 版 新增下列報表格式：F13_002_001、F13_005_001、F13_012_001 及 F13_025_001

112.1.30 第 1.2.2 版 新增下列報表格式：F02_001_002、F02_002_003、F02_002_004、F02_000_001、F02_000_002、F14_002_002

112.2.14 第 1.2.3 版 新增下列報表格式：F07_019_002、F07_020_002、F07_021_002、F07_024_002、F07_019_001、F07_020_001、F07_021_001、F07_024_001、F07_015、F07_018_001、F07_018_002，F08_001_002 更新下列報表格式：F08_001_001、F08_002_001、F08_003_001