

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： 2022/03/25 第 1.1.0 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.....	3
1. 店頭衍生性商品集中結算網路 SFTP 檔案傳輸伺服器(sftp server).....	3
二、SFTP 報表清單.....	4
三、報表詳細資訊.....	5
1. 當日所有交易提交資料報表	5
2. 當日已接受交易提交資料報表	7
3. 當日未完成交易提交資料報表(交易狀態非接受及拒絕)	9
4. 當日已拒絕交易提交資料報表	11
5. 隔日部位互抵建議報表	13
6. 當日部位互抵結果報表	14
7. 單一結算契約結算報表	15
8. 單一結算帳戶結算報表	17
9. 結算會員結算報表	19
10. 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額	21
四、附錄.....	23
1. 版本差異說明	23

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	當日所有交易提交資料報表
2	F02_001_002	當日已接受交易提交資料報表
3	F02_001_003	當日未完成交易提交資料報表(交易狀態非接受及拒絕)
4	F02_001_004	當日已拒絕交易提交資料報表
5	F14_002_001	隔日部位互抵建議報表
6	F14_003_001	當日部位互抵結果報表
7	F08_001_001	單一結算契約結算報表
8	F08_002_001	單一結算帳戶結算報表
9	F08_003_001	結算會員結算報表
10	F09_015_001	結算帳戶實際抵繳金額及餘額查詢

三、報表詳細資訊

1. 當日所有交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_001_001 當日所有交易提交資料報表

■ 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	資料型態	範例
結算會員 ID	String		0960000
結算帳戶類型	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
唯一交易識別碼	String		IS2022021000000009
交易對手代號	String		0980000
契約交易日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/12
契約生效日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約集中結算日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約到期日	Date	YYYY/MM/DD	2023/2/14
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

欄位名稱	資料類別	資料型態	範例
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
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

2. 當日已接受交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_001_002 當日已接受交易提交資料報表

■ 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	資料型態	範例
結算會員 ID	String		0960000
結算帳戶類型	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
唯一交易識別碼	String		IS2022021000000009
交易對手代號	String		0980000
契約交易日			2022/2/12
契約生效日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約集中結算日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約到期日	Date	YYYY/MM/DD	2023/2/14
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

欄位名稱	資料類別	資料型態	範例
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

3. 當日未完成交易提交資料報表(交易狀態非接受及拒絕)

■ 報表名稱：

F02_001_003 當日未完成交易提交資料報表(交易狀態非接受及拒絕)

■ 檔案名稱：

F02_001_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	資料型態	範例
結算會員 ID	String		0960000
結算帳戶類型	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
唯一交易識別碼	String		IS2022021000000009
交易對手代號	String		0980000
契約交易日			2022/2/12
契約生效日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約集中結算日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約到期日	Date	YYYY/MM/DD	2023/2/14
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	資料型態	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		已接受

4. 當日已拒絕交易提交資料報表

■ 報表名稱：

F02_001_004 當日已拒絕交易提交資料報表

■ 檔案名稱：

F02_001_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	資料型態	範例
結算會員 ID	String		0960000
結算帳戶類型	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
唯一交易識別碼	String		IS2022021000000009
交易對手代號	String		0980000
契約交易日			2022/2/12
契約生效日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約集中結算日	Date	YYYY/MM/DD	2022/2/14
契約到期日	Date	YYYY/MM/DD	2023/2/14
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

欄位名稱	資料類別	資料型態	範例
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		已接受
拒絕原因	String		21 23

5. 隔日部位互抵建議報表

■ 報表名稱：

F05_001_001 隔日部位互抵建議報表

■ 檔案名稱：

F05_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	資料型態	範例
結算會員	String		0980000
結算帳戶類別	String		自有帳
結算帳戶	String		9000011
商品類型	String		IRS
UTI	String		IS052022030900000016 IS052022030900000019
互抵部位	Integer		IR20220309000030 IR20220309000041
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

6. 當日部位互抵結果報表

■ 報表名稱：

F05_002_001 當日部位互抵結果報表

■ 檔案名稱：

F05_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	資料型態	範例
結算會員	String		0980000
結算帳戶類別	String		自有帳
結算帳戶	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		

7. 單一結算契約結算報表

■ 報表名稱：

F08_001_001 單一結算契約結算報表

■ 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	資料型態	範例
結算會員代號	String		0960000
結算會員中文名稱	String		CCP 測試會員
結算帳戶類型	String		HOUSE
每日結算類型	String		CTM
結算帳戶代號	String		9000015
結算帳戶中文名稱	String		CCP 測試帳戶
商品類別	String		IRS
結算契約代號	String		IR2022022200001
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	Datetime 2		
結算款項收付日	String		2020/6/29
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
結算契約預付款	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
部位壓縮應收付款項	Decimal	(14, 2)	0
多邊提前終止損益	Decimal	(14, 2)	0

欄位名稱	資料類別	資料型態	範例
結算款項總金額	Decimal	(14, 2)	-50

8. 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	資料型態	範例
結算會員代號	String		0960000
結算會員中文名稱	String		CCP 測試會員
結算帳戶類型	String		HOUSE
每日結算類型	String		CTM
結算帳戶代號	String		9000015
結算帳戶中文名稱	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	Decimal	(14, 2)	0
現金提領	Decimal	(14, 2)	0
現金移入	Decimal	(14, 2)	0
現金移出	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
結算契約預付款	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

欄位名稱	資料類別	資料型態	範例
部位移入款項	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
淨應收結算款項調整項	Decimal	(14, 2)	0
次日應收付款項總額	Decimal	(14, 2)	0
有價證券評價價值	Decimal	(14, 2)	0
實際抵繳金額	Decimal	(14, 2)	0
現存有保證金餘額	Decimal	(14, 2)	0
應存有保證金	Decimal	(14, 2)	0
現金超額保證金加計 次日應收付款項	Decimal	(14, 2)	0
超額保證金	Decimal	(14, 2)	0
日終現金保證金追繳	Decimal	(14, 2)	0
日終保證金追繳	Decimal	(14, 2)	0

9. 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	資料型態	範例
結算會員代號	String		0960000
結算會員中文名稱	String		CCP 測試會員
結算帳戶類型	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	Decimal	(14, 2)	0
現金提領	Decimal	(14, 2)	0
現金移入	Decimal	(14, 2)	0. 00
現金移出	Decimal	(14, 2)	0. 00
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
結算契約預付款	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	資料型態	範例
淨應收結算款項調整項	Decimal	(14 , 2)	0
次日應收付款項總額	Decimal	(14 , 2)	0
有價證券評價價值	Decimal	(14, 2)	5, 305, 969
實際抵繳金額	Decimal	(14, 2)	3, 429, 695
現存有保證金餘額	Decimal	(14, 2)	31, 393, 136, 626. 4
應存有保證金	Decimal	(14, 2)	0
現金超額保證金加計次日應收付款項	Decimal	(14, 2)	0
超額保證金	Decimal	(14, 2)	0
日終現金保證金追繳	Decimal	(14, 2)	0
日終保證金追繳	Decimal	(14, 2)	0

10. 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額

■ 報表名稱：

F06_005_001 結算帳戶有價證券餘額查詢及實際抵繳金額

■ 檔案名稱：

F06_005_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	資料型態	範例
結算會員	String		0960000
結算會員名稱	String		CCP 測試會員
結算帳戶	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)	



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