

## 行情電文異動說明

- 新增 I000 心跳訊息
- I010 與 I011 格式中契約種類欄位值新增 'E'代表匯率類。
- I010 新增 FLOW-GROUP 流程群組 欄位。
- I011  
 契約乘數欄位格式調整為 9(7)V9(4)  
 新增 UNDERLYING-TYPE 現貨類別 欄位  
 新增 MARKET-CLOSE-GROUP 商品收盤時間群組 欄位
- 調整 I060 I064 格式以傳送更多現貨數值

MESSAGE ID：I000

MESSAGE NAME：心跳訊息

	FIELD NAME	FORMAT	LENG	CONTENTS	COMMENT
HEADER	ESC-CODE	X(1)	1	(ASCII 27)	
	TRANSMISSION-CODE	X(1)	1	"0"：心跳訊息	
	MESSAGE-KIND	X(1)	1	"0"：心跳訊息	
	INFORMATION-TIME	9(8)	4	資料時間 PACK BCD	
	INFORMATION-SEQ	9(8)	4	I000 之傳送訊息流水序號 PACK BCD	
	VERSION-NO	9(2)	1	電文版本序號 PACK BCD 目前版本:1	
	BODY-LENGTH	9(4)	2	電文長度 PACK BCD	
	CHECK-SUM	X(01)	1	檢核碼	
	TERMINAL-CODE	X(02)	2	(HEXACODE:0D 0A)	

INFORMATION-SEQ：為心跳訊息之傳送訊息流水號，每一個 multicast group 各自編號。

CHECKSUM：將第二個 byte 起至 check-sum 欄位前一個 byte，每個 byte 中各 bit 之 XOR 值記錄至 check-sum 欄位。。

期交所週期性地對每一個 multicast group 送出心跳訊息，約每 30 秒傳送一次。

MESSAGE ID：I010

MESSAGE NAME：商品漲跌幅及基本資料訊息

	FIELD NAME	FORMAT	LENG	CONTENTS	COMMENT
HEADER	ESC-CODE	X(1)	1	(ASCII 27)	
	TRANSMISSION-CODE	X(1)	1	"1"：代表期貨 "4"：代表選擇權 之漲跌、參考價、委託量、 成交量、公告、指數揭示	
	MESSAGE-KIND	X(1)	1	"1"：商品漲跌幅及基本資 料訊息	
	INFORMATION-TIME	9(8)	4	資料時間 PACK BCD	
	INFORMATION-SEQ	9(8)	4	I010 之傳送訊息流水序號 PACK BCD	
	VERSION-NO	9(2)	1	電文版本序號 PACK BCD <u>目前版本:5</u>	
	BODY-LENGTH	9(4)	2	電文長度 PACK BCD	
BODY	PROD-ID-S	X(10) X(20)	10 20	商品代號 商品代號(與現貨代碼連 結)	
	RISE-LIMIT-PRICE1	9(9)	5	第一漲停價 PACK BCD	參考附錄四
	REFERENCE-PRICE	9(9)	5	參考價 PACK BCD	參考附錄四
	FALL-LIMIT-PRICE1	9(9)	5	第一跌停價 PACK BCD	參考附錄四
	RISE-LIMIT-PRICE2	9(9)	5	第二漲停價 PACK BCD	參考附錄四
	FALL-LIMIT-PRICE2	9(9)	5	第二跌停價 PACK BCD	參考附錄四
	RISE-LIMIT-PRICE3	9(9)	5	第三漲停價 PACK BCD	參考附錄四
	FALL-LIMIT-PRICE3	9(9)	5	第三跌停價 PACK BCD	參考附錄四
	PROD-KIND	X(1)	1	契約種類	
	DECIMAL-LOCATOR	9(1)	1	價格欄位小數位數 PACK BCD	參考附錄四
	STRIKE-PRICE-DECIMAL -LOCATOR	9(1)	1	選擇權商品代號之履約價 格小數位數 PACK BCD (期貨則固定為 0)	參考附錄五
	BEGIN-DATE	9(8)	4	上市日期 (YYYYMMDD) PACK BCD	
	END-DATE	9(8)	4	下市日期 (YYYYMMDD) PACK BCD	

	<u>FLOW-GROUP</u>	<u>9(2)</u>	<u>1</u>	<u>流程群組 PACK BCD</u>	
	CHECK-SUM	X(01)	1	檢核碼	
	TERMINAL-CODE	X(02)	2	(HEXACODE:0D 0A)	

INFORMATION-SEQ：為 I010 之傳送訊息流水序號，且依不同的市場（期貨或選擇權）、電文版本序號各自編號，從 1 號開始累增。

PROD-KIND：此商品屬於何種契約種類。

I:指數類 R:利率類 B:債券類 C:商品類 S:股票類 E:匯率類

DECIMAL-LOCATOR：請依據此欄位提供之小數位數值解析該商品相關之價格欄位，詳細說明與範例見附錄四。

STRIKE-PRICE-DECIMAL-LOCATOR：此欄位提供之選擇權商品代號之履約價格小數位數，用以解析選擇權 PROD-ID 中五碼履約價格，詳細說明與範例見附錄五。

早上傳送 I010 時，即傳送包含各階段漲跌幅之資訊，若無該階段漲跌幅，以 0 表示。

目前期交所各月份及各序列收盤時間依 FLOW-GROUP 定義如下：

<u>FLOW-GROUP</u>	<u>收盤時間</u>
<u>1</u>	<u>13:45</u>
<u>2</u>	<u>12:00</u>
<u>3</u>	<u>13:30</u>
<u>4</u>	<u>11:00</u>
<u>5</u>	<u>16:15</u>

CHECKSUM：請參考四、檢核碼 PROD-ID(check-sum) 產生說明。

MESSAGE ID：I011

MESSAGE NAME：契約基本資料

FIELD NAME		FORMAT	LENG	CONTENTS	COMMENT
HEADER	ESC-CODE	X(1)	1	(ASCII 27)	
	TRANSMISSION-CODE	X(1)	1	"1"：代表期貨 "4"：代表選擇權 之漲跌、參考價、委託量、 成交量、公告、指數揭示	
	MESSAGE-KIND	X(1)	1	"3"：契約基本資料	
	INFORMATION-TIME	9(8)	4	資料時間 PACK BCD	
	INFORMATION-SEQ	9(8)	4	I011 之傳送訊息流水序號 PACK BCD	
	VERSION-NO	9(2)	1	電文版本序號 PACK BCD <u>目前版本:3</u>	
	BODY-LENGTH	9(4)	2	電文長度 PACK BCD	
BODY	KIND-ID	X(4) X(8)	4 8	契約代碼 契約代碼(與現貨代碼連 結)	
	NAME	X(30)	30	契約名稱	契約中文名稱
	STOCK-ID	X(6)	6	現貨股票代碼	
	SUBTYPE	X(1)	1	契約類別	
	CONTRACT-SIZE	<u>9(7)V9(4)</u>	<u>6</u>	契約乘數 PACK BCD	
	STATUS-CODE	X(1)	1	狀態碼	N：正常 P：暫停交易 U：即將上市
	CURRENCY-TYPE	X(1)	1	幣別	參考附錄
	DECIMAL-LOCATOR	9(1)	1	價格欄位小數位數 PACK BCD	同 I010 商品價 格小數位數
	STRIKE-PRICE-DECIMAL-LOCATOR	9(1)	1	選擇權商品代號之履約價 格小數位數 PACK BCD (期貨則固定為 0)	同 I010 選擇權 商品代號之履 約價格小數位 數
	ACCEPT-QUOTE-FLAG	X(1)	1	是否可報價	Y:可報價 N:不可報價
	BEGIN-DATE	X(8)	8	上市日期	日期格式為

					YYYYMMDD 僅適用股票類 契約
	BLOCK-TRADE-FLAG	X(1)	1	是否可鉅額交易	Y:可 N:不可
	EXPIRY-TYPE	X(1)	1	到期別	S:標準 W:週
	<u>UNDERLYING-TYPE</u>	<u>X(1)</u>	<u>1</u>	<u>現貨類別</u>	<u>E:ETF</u> <u>S:個股</u> <u>僅適用股票類</u> <u>契約</u>
	<u>MARKET-CLOSE-GROUP</u>	<u>9(2)</u>	<u>1</u>	<u>商品收盤時間群組 PACK</u> <u>BCD</u>	
	CHECK-SUM	X(01)	1	檢核碼	
	TERMINAL-CODE	X(02)	2	(HEXACODE:OD OA)	

說明:

1.I011 內容包含當日有效及即將上市契約。

2.STOCK-ID 與 BEGIN-DATE 欄位僅適用於股票類契約，其他類契約則此二欄位值為空白。

欄位說明:

INFORMATION-SEQ：為 I011 之傳送訊息流水序號，且依不同的市場（期貨或選擇權）、電文版本序號各自編號，從 1 號開始累增。

KIND-ID：雖目前契約代碼均為 3 碼，此欄位長度設 4 保留未來擴充彈性。

SUBTYPE:

I:指數類 R:利率類 B:債券類 C:商品類 S:股票類 E:匯率類

STATUS-CODE:

N：正常

P：暫停交易

U：即將上市

DECIMAL-LOCATOR：請依據此欄位提供之小數位數值解析該契約類別商品相關之價格欄位，詳細說明與範例見附錄四。

STRIKE-PRICE-DECIMAL-LOCATOR：此欄位提供之選擇權商品代號之履約價格小數位數，

用以解析該契約類別選擇權商品 PROD-ID 中五碼履約價格，詳細說明與範例見附錄五。

**MARKET-CLOSE-GROUP:**

目前期交所定義各商品收盤時間群組如下：

MARKET-CLOSE-GROUP	收盤時間
1	13:45
5	16:15

CHECKSUM：請參考四、檢核碼 PROD-ID(check-sum) 產生說明。

# MESSAGE ID：I060

MESSAGE NAME：現貨標的資訊

	FIELD NAME	FORMAT	LENG	CONTENTS	COMMENT
HEADER	ESC-CODE	X(1)	1	(ASCII 27)	
	TRANSMISSION-CODE	X(1)	1	"1"：代表期貨 "4"：代表選擇權 之行情訊息	
	MESSAGE-KIND	X(1)	1	"5"：現貨標的資訊	
	INFORMATION-TIME	9(8)	4	資料時間 PACK BCD	
	INFORMATION-SEQ	9(8)	4	I060 之傳送訊息流水序號 PACK BCD	
	VERSION-NO	9(2)	1	電文版本序號 PACK BCD <u>目前版本：3</u>	
	BODY-LENGTH	9(4)	2	電文長度 PACK BCD	
BODY	KIND	X(3) X(8)	3 8	類別代碼 類別代碼(與現貨代碼連結)	
	STATUS-ITEM	<u>X(2)</u>	<u>2</u>	狀態項目註記 (BIT MAP)	
	<u>依據 STATUS-ITEM 衍生 VALUE、TIME、DATE 資料</u>				
	<u>VALUE</u>	<u>9(7)V999999</u>	<u>6</u>	<u>價格 PACK BCD</u>	
	<u>TIME</u>	<u>9(12)</u>	<u>6</u>	<u>時間 PACK BCD</u>	<u>時、分、秒、3 位毫秒、3 位微 秒</u>
	<u>DATE</u>	<u>X(8)</u>	<u>8</u>	<u>日期</u>	<u>YYYYMMDD</u>
	CHECK-SUM	X(01)	1	檢核碼	
	TERMINAL-CODE	X(02)	2	(HEXACODE:0D 0A)	

INFORMATION-SEQ：為 I060 之傳送訊息流水序號，且依不同的市場（期貨或選擇權）、電文版本序號各自編號，從 1 號開始累增。

CHECKSUM：請參考四、檢核碼 PROD-ID(check-sum)產生說明。

STATUS-ITEM：使用 bit 值 0 或 1 代表該資料是否存在，各資料並依 bit 0 至 15 之順序擺放

Bit 6-15 = 0 保留

Bit 5: DATE 日期 1:有 0:無

Bit 4: TIME 時間 1:有 0:無 時間內容皆為 0 代表價格為參考價

Bit 3: VALUE 定盤價 1:有 0:無

Bit 2: VALUE 賣價 1:有 0:無

Bit 1: VALUE 買價 1:有 0:無

Bit 0: VALUE 成交價 1:有 0:無

舉例說明：

STATUS-ITEM Bit 0、1、2、4 值為 1，其餘 Bit 值為 0 代表要依序解譯

VALUE 成交價 (Bit 0)

VALUE 買價 (Bit 1)

VALUE 賣價 (Bit 2)

TIME 時間 (Bit 4)

附註：1. 無台灣 50、黃金、公債

2. 買價、賣價、定盤價、日期目前為匯率類商品使用，其他現貨商品無使用



## MESSAGE ID：I064

MESSAGE NAME：現貨標的試撮與狀態資訊

	FIELD NAME	FORMAT	LENG	CONTENTS	COMMENT
HEADER	ESC-CODE	X(1)	1	(ASCII 27)	
	TRANSMISSION-CODE	X(1)	1	"1"：代表期貨 "4"：代表選擇權 之行情訊息	
	MESSAGE-KIND	X(1)	1	"8"：現貨標的試撮與狀態資訊	
	INFORMATION-TIME	9(8)	4	資料時間 PACK BCD	
	INFORMATION-SEQ	9(8)	4	I064 之傳送訊息流水序號 PACK BCD	
	VERSION-NO	9(2)	1	電文版本序號 PACK BCD <u>目前版本：2</u>	
	BODY-LENGTH	9(4)	2	電文長度 PACK BCD	
BODY	KIND	X(3)	3	契約代碼	
	TIME	<u>9(12)</u>	<u>6</u>	時間 PACK BCD	<u>時、分、秒、</u> <u>3 位毫秒、3</u> <u>位微秒</u>
	VALUE	9(5)V999	4	標的價格 PACK BCD	
	STATUS-ITEM	X(1)	1	狀態項目註記 (BIT MAP)	
	CHECK-SUM	X(01)	1	檢核碼	
	TERMINAL-CODE	X(02)	2	(HEXACODE:0D 0A)	

INFORMATION-SEQ：為 I064 之傳送訊息流水序號，且依不同的市場（期貨或選擇權）、電文版本序號各自編號，從 1 號開始累增。

CHECKSUM：請參考四、檢核碼 PROD-ID(check-sum)產生說明。

STATUS-ITEM：

Bit 7-3 = 0 保留

Bit 2: 上市與上櫃個股試撮後延後開盤註記 0:否 1:是

Bit 1: 上市與上櫃個股試撮後延後收盤註記 0:否 1:是

Bit 0 = 0 保留

附註：僅傳送上市與上櫃個股有試撮資訊且為本公司標的之現貨。