

# 人民幣匯率期貨 交易資訊作業規劃

臺灣期貨交易所資訊規劃部  
2015年05月

## 大綱

- 契約規格
  - 與現有商品差異
  - 基本資料檔案傳輸 - TMP電文
  - 基本資料檔案傳輸 - 行情電文
- 交易資訊作業規劃
  - 延長交易時間(人民幣匯率期貨、陸股ETF期貨)
  - 最後結算日
  - 最後結算日遇標的資訊異常

## 契約規格與現有商品差異(一)

項目	美元兌人民幣期貨	小型美元兌人民幣期貨
英文代碼	■ RHF	■ RTF
交易時間	■ 營業日上午8:45~下午4:15 ■ 到期月份契約最後交易日為上午為上午8:45~上午11:00	
契約規模	■ 100,000美元	■ 20,000美元
到期月份	■ 自交易當月起連續2個月份 ■ 另加上3、6、9、12月中4個連續季月，總共6個月份契約	
每日漲跌幅	■ 前1交易日結算價上下7%	
報價方式	■ 每1美元兌人民幣(例如：6.2282)	
最小升降單位	■ 0.0001	

TAIFEX

2

## 契約規格與現有商品差異(二)

項目	美元兌人民幣期貨	小型美元兌人民幣期貨
最後交易日	■ 各該契約交割月份第3個星期3 ■ 其次1營業日為新契約的開始交易日	
最後結算日	■ 同最後交易日	
最後結算價	■ 香港財資市場公會在最後交易日上午11:15公布之美元兌人民幣(香港)即期匯率定盤價	■ 台北外匯市場發展基金會在最後交易日上午11:15公布之臺灣離岸人民幣定盤匯率

TAIFEX

3

## 基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(一)

### ■ P09(契約基本資料檔)

編號	欄位名稱	資料舉例
1	契約代碼	RHF
2	契約名稱	美元兌人民幣期貨
3	現貨股票代號(僅適用股票類契約)	
4	契約類別 (I：指數，R：利率， B：債券，C：商品， S：股票， <u>E：匯率</u> )	<u>E</u>
5	契約乘數 9(7)v9(4)	0100000 <u>0000</u>

## 基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(二)

### ■ P09(契約基本資料檔)

編號	欄位名稱	資料舉例
6	狀態碼(N：正常，P：暫停交易，U：未上市)	N
7	幣別(1：台幣，2：美元， <u>8：人民幣</u> )	<u>8</u>
8	履約價格小數位數	0
9	委託價格小數位數	<u>4</u>
⋮	⋮	
14	現貨類別(僅適用股票類)	E：ETF、S：個股
15	商品收盤時間群	1：13:45、5：16:15

## 基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(三)

### ■ P08(商品與時間流程群組定義檔)

編號	欄位名稱	資料舉例
1	商品代號	RHFA5
2	交割年月	201501
⋮	⋮	⋮
7	第一漲停價	000066641
8	第一跌停價	000057923
9	權利金(開盤參考價)	000062282
⋮	⋮	

## 基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(四)

### ■ P08(商品與時間流程群組定義檔)

編號	欄位名稱	資料舉例
14	契約種類 (I：指數，R：利率， B：債券，C：商品， S：股票，E：匯率)	E
15	是否可報價 (Y：可，N：不可) 註：依實際公告為準	Y
16	價格欄位小數位數	4
⋮	⋮	

## 基本資料檔案傳輸 - 行情電文舉例(一)

### ■ IO11(契約基本資料檔)

編號	欄位名稱	資料舉例
1	契約代碼	RHF
2	契約名稱	美元兌人民幣期貨
3	現貨股票代號(僅適用股票類契約)	
4	契約類別 (I：指數，R：利率， B：債券，C：商品， S：股票， <u>E：匯率</u> )	<u>E</u>
5	契約乘數 9(7)v9(4)	0100000 <u>0000</u>

## 基本資料檔案傳輸 - 行情電文舉例(二)

### ■ IO11(契約基本資料檔)

編號	欄位名稱	資料舉例
6	狀態碼(N：正常，P：暫停交易，U：未上市)	N
7	幣別(1：台幣，2：美元， <u>8：人民幣</u> )	<u>8</u>
8	履約價格小數位數	0
9	價格欄位小數位數	<u>4</u>
⋮	⋮	
14	現貨類別(僅適用股票類)	E：ETF、S：個股
15	商品收盤時間群	1：13:45、5：16:15

# 基本資料檔案傳輸 - 行情電文舉例(三)

## ■ I010(商品漲跌幅及基本資料訊息)

編號	欄位名稱	資料舉例
1	商品代號	RHFA5
2	第一漲停價	00006 <u>6641</u>
3	參考價	00006 <u>2282</u>
4	第一跌停價	00005 <u>7923</u>
⋮	⋮	⋮
9	契約種類 (I：指數，R：利率， B：債券，C：商品， S：股票， <u>E：匯率</u> )	<u>E</u>
10	價格欄位小數位數	<u>4</u>
⋮	⋮	⋮

# 交易資訊作業 - 延長交易時間(一) (人民幣匯率期貨、陸股ETF期貨)

時間	現行檔案傳輸	延長交易後檔案傳輸
13:45	■ <u>所有商品</u> 收盤	■ <u>13:45收盤商品</u> 收盤
	■ P14(契約風險保證金檔， <u>所有商品</u> )	■ P14(契約風險保證金檔， <u>目前已收盤商品</u> )
	■ C10(第1次行情單檔， <u>所有商品</u> )	■ C10(第1次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )
	■ C20(複式商品行情單檔， <u>所有商品</u> )	■ C20(複式商品行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )
	■ C11(每日結算價檔， <u>所有商品</u> ，多次傳送)	■ C11(每日結算價檔， <u>目前已收盤商品</u> ，多次 傳送)

## 交易資訊作業 - 延長交易時間(二) (人民幣匯率期貨、陸股ETF期貨)

時間	現行檔案傳輸	延長交易後檔案傳輸
14:30	■ C10(第2次行情單檔， <u>所有商品</u> )	■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )
結算系統	■ 所有商品部位處理作業截止	■ 13:45收盤商品部位處理作業截止
	■ C10(第3次行情單檔， <u>所有商品</u> )	■ C10(第3次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )
	■ B10(鉅額成交量統計檔， <u>所有商品</u> )	■ B10(鉅額成交量統計檔， <u>目前已收盤商品</u> )
15:00	■ I14(契約調整預告檔)	■ I14(契約調整預告檔)
	■ I20(契約調整參考檔)	■ I20(契約調整參考檔)
	■ I16(有價證券抵繳一價格檔)	■ I16(有價證券抵繳一價格檔)

TAIFEX

12

## 交易資訊作業 - 延長交易時間(三) (人民幣匯率期貨、陸股ETF期貨)

時間	現行檔案傳輸	延長交易後檔案傳輸
16:15		■ <u>16:15收盤商品</u> 收盤
		■ P14(契約風險保證金檔， <u>目前已收盤商品</u> )
		■ C10(第1次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )
		■ C20(複式商品行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )
		■ C11(每日結算價 - <u>目前已收盤商品</u> ，1次傳送)
16:30		■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u> )

TAIFEX

13

## 交易資訊作業 - 延長交易時間(四) (人民幣匯率期貨、陸股ETF期貨)

時間	現行檔案傳輸	延長交易後檔案傳輸
結算系統		<ul style="list-style-type: none"> <li>■ 16:15收盤商品部位處理作業截止</li> <li>■ C10(第3次行情單檔，<u>目前已收盤商品</u>)</li> <li>■ B10(鉅額成交量統計檔，<u>目前已收盤商品</u>)</li> </ul>
17:00	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ I15(有價證券抵繳—證券基本資料檔)</li> <li>■ I17(有價證券抵繳—債券基本資料檔)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ I15(有價證券抵繳—證券基本資料檔)</li> <li>■ I17(有價證券抵繳—債券基本資料檔)</li> </ul>

## 交易資訊作業 - 最後結算日(一)

- 匯率期貨最後結算日為交割月份第三個星期三
- 與股價指數期貨等商品於同日不同時段結算
- 該日上午傳送匯率期貨到期契約最後結算價
- 下午則傳送匯率期貨、股價指數期貨及選擇權、股票期貨及選擇權到期契約最後結算價



## 交易資訊作業 - 最後結算日(二)

時間	現行檔案傳輸	新增匯率期貨後檔案傳輸
11:30		■ T90(最後結算價參考檔， <u>僅匯率期貨</u> )
13:50	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ T90(最後結算價參考檔)</li> <li>■ T92(股票選擇權/股票期貨最後結算約定標的物價值檔，含所有ETF契約)</li> <li>■ T95(股票選擇權/股票期貨最後結算價檔，含所有ETF契約)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>■ T90(最後結算價參考檔，<u>含匯率期貨</u>)</li> <li>■ T92(股票選擇權/股票期貨最後結算約定標的物價值檔，含所有ETF契約)</li> <li>■ T95(股票選擇權/股票期貨最後結算價檔，含所有ETF契約)</li> </ul>

## 交易資訊作業 - 最後結算日(三)

### ■ T90(最後結算價參考檔)資料舉例

假設1：上午11:22送出匯率期貨最後結算價

編號	欄位名稱	資料舉例
1	商品代號	RHF
2	最後結算價	00006 <u>2282</u>
3	到期年月	201501

假設2：下午13:38送出股價指數期貨、股票期貨最後結算價，包含上午送出之匯率期貨最後結算價

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3	
1	商品代號	RHF	TXF	CAF	...
2	最後結算價	00006 <u>2282</u>	000899400	000006816	...
3	到期年月	201501	201501	201501	...

## 交易資訊作業 - 最後結算日遇標的資訊異常(一)

- 股價指數期貨及選擇權、股票期貨及選擇權、即將上市之人民幣匯率期貨最後結算日為交割月份第三個星期三
- 本公司交易系統於最後結算日傳送最後結算價檔
  - T90股價指數期貨及選擇權最後結算價檔
  - T92股票期貨及選擇權最後結算約定標的物價值檔
  - T95股票期貨及選擇權最後結算價檔

## 交易資訊作業 - 最後結算日遇標的資訊異常(二)

- 假設情境1：
  - 證券市場13:30發生收盤資訊傳送異常
  - 當日14:15資訊傳輸恢復正常

時間	現行檔案傳輸	商品分批結算之檔案傳輸
13:30	■ 到期商品收盤	■ 到期商品收盤
13:50	■ 等待證券市場資訊傳輸恢復正常	■ T90、T92、T95 ( <u>標的資訊正常</u> 到期商品)
14:15	■ T90、T92、T95 (所有到期商品)	■ T90、T92、T95 (所有到期商品)

## 交易資訊作業 - 最後結算日遇標的資訊異常(三)

### ■ 假設情境2：

■ 證券市場13:30發生收盤資訊傳送異常

■ 當日20:00資訊傳輸未恢復正常

時間	現行檔案傳輸	商品分批結算之檔案傳輸
13:30	■ 到期商品收盤	■ 到期商品收盤
13:50	■ 等待證券市場資訊傳輸恢復正常	■ T90、T92、T95 ( <u>標的資訊正常</u> 到期商品)
20:00		■ F06(最後結算日順延) ( <u>標的資訊異常</u> 到期商品)

## 交易資訊作業 - 最後結算日遇標的資訊異常(四)

### ■ 新增 TMP電文 - F06(最後結算日順延)

編號	欄位名稱	資料舉例
1	商品代號	CAFA5
2	交割年月	201501
3	異動類別 (1:最後結算日順延)	<u>1</u>
4	最後交易日	20150121
5	最後結算日	<u>20150122</u>
6	當日結算價	0000064 <u>20</u>

## 交易資訊作業 - 最後結算日遇標的資訊異常(五)

### ■ 假設情境3：

■ 順延商品於順延後之最後結算日傳送最後結算價檔

時間	現行檔案傳輸	商品分批結算之檔案傳輸
		■ T90、T92、T95 ( <u>順延商品</u> )



臺灣期貨交易所  
TAIWAN FUTURES EXCHANGE

敬請指教

[www.taifex.com.tw](http://www.taifex.com.tw)