

MTS 修改作業(2015/05/21)

- 一、MTS 各交易列示之結帳記號，約於 16:30 後，才會由[0：部位未結帳]變為[1：部位已結帳]。
- 二、MTS 各交易列示之成交損益，部位損益數額及保證金數額，除未到期商品以「每日結算價」計算之成交損益及部位損益數額外，另包含 T 日到期商品因資訊異常無法產生「最後結算價」者，以「最後成交價」併入計算。
- 三、MTS 各交易列示之到期損益數額，則為到期商品以「最後結算價」所計算之到期損益數額。
- 四、若有選擇權到期商品因資訊異常無法產生「最後結算價」，MTS 選擇權名冊相關交易亦改採分批到期作業。

五、MTS 交易修改項目

項次	交易代號	交易名稱	修改內容
1	0717	結算保證金追繳資料查詢回覆(多幣別)	新增電文 G32, G33
2	0718	結算保證金追繳資料查詢回覆(SPAN+多幣別)	新增電文 G34, G35
3	0719	盤中保證金追繳通告(多幣別)	新增電文 G36
4	0715	商品狀態查詢	新增電文 G28, G29
5	0716	各盤別保證金及商品損益	新增電文 G30, G31
6	0513	交易人期貨多空組合部位明細查詢	電文規格不需修改，唯系統上線後(無論人民幣商品是否上市)，查詢回覆之資料增列人民幣權益資料(幣別:8)。
7	0704	結算保證金餘額查詢	
8	0708	結算保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)	
9	0710	期貨商應存有暨原始保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)	
10	0711	結算保證金各幣別餘額查詢	
11	0713	期貨商應存有暨原始保證金查詢(外幣)	
12	0714	結算會員抵繳結算保證金資料查詢	
13	0814	交易人有價證券抵繳保證金明細查詢	電文規格不需修改，唯遇資訊異常時，改採分批到期作業，且若以'9999999'查詢所有商品名冊資料恐造成資料混淆，系統將回覆「26201 請以完整商品代號重新查詢」。
14	0401	自動履約名冊查詢(台指)	
15	0404	履約指派名冊查詢(台指)	電文規格不需修改，唯遇資訊異常時，改採分批到期作業。
16	0402	自動履約名冊登錄(台指)	
17	0403	自動履約名冊刪除(台指)	
18	0405	履約參考名冊查詢(個股)	
19	0416	自動履約名冊查詢(個股)	

20	0417	自動履約名冊登錄(個股)	
21	0418	自動履約名冊刪除(個股)	
22	0419	履約指派名冊查詢(個股)	
23	0303	公告資料查詢通知	新增結帳狀態訊息
註:	0702	結算保證金追繳資料查詢回覆(台幣+外幣)	規格不修改，且回覆之資料不含人民幣權益。
	0709	結算保證金追繳資料查詢回覆(依 SPAN 保證金計算)	
	0703	盤中保證金追繳通告(台幣+外幣)	

0717 結算保證金追繳資料查詢回覆(多幣別)

訊息代號：G32

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(多幣別)

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	17：結算保證金追繳資料查詢
	來源單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為 '000' 或 '999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為 '0' (0：單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

訊息代號：G33

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(多幣別)

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	17：結算保證金追繳資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
	目的地單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為' 000' 或' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位已結帳
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：結算保證金相關資料
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		幣別	X(1) 1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有結算保證金數額	9(12) v99 包含小數 2 位共 14 位，例“15.25”表示為“00000000001525”；
		原存有現金結算保證金權益	9(12) v99 共 14 位，可為負數。正數時“15.25”表示為“00000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-00000000001525”（幣別為 2 時為約當美元）
		補足前日追繳款項金額	9(12) v99 （幣別為 2 時為約當美元）
		本日存入/移入款項金額	9(12) v99 （幣別為 2 時為約當美元）

欄位		屬性	欄位說明
	本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
	本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
	本日成交差益數額	9(12) v99	
	本日成交差損數額	9(12) v99	
	本日部位差益數額	9(12) v99	
	本日部位差損數額	9(12) v99	
	本日到期差益數額	9(12) v99	
	本日到期差損數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	
	次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	現存有 <u>現金</u> 結算保證金權益	9(12) v99	共 14 位，可為負數。正數時“15.25”表示為“00000000001525”；負數時“-15.25”表示為“-00000000001525” (幣別為 2 時為約當美元)
	本日股票選擇權買方交割應收款項	9(12) v99	目前皆為 0
	本日股票選擇權買方交割應付款項	9(12) v99	目前皆為 0
	本日股票選擇權賣方交割應收款項	9(12) v99	目前皆為 0
	本日股票選擇權賣方交割應付款項	9(12) v99	目前皆為 0

欄位		屬性	欄位說明
	本日股票選擇權券不足現金結算應收款項	9(12) v99	目前皆為 0
	本日股票選擇權券不足現金結算應付款項	9(12) v99	目前皆為 0
	期貨實物交割應收款項	9(12) v99	
	期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
	到期部位結算保證金數額	9(12) v99	
	抵繳保證金	9(12) v99	Covered_call 保證金數額，目前皆為 0
	期貨多空減收之保證金	9(12) v99	
	本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	可提領款項金額	9(12) v99	註 12
	應追繳款項金額	9(12) v99	註 13
	兌台幣參考匯率	9(4)v 9(6)	幣別為台幣時，本欄位固定為 1
	境外外資台幣商品保證金	9(12) v99	幣別為人民幣時，本欄位固定為 0

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額

$$\begin{aligned}
 & - \text{本日成交差損數額} + \text{本日部位差益數額} - \text{本日部位差損數額} + \text{本日} \\
 & \text{到期差益數額} - \text{本日期到差損數額} + \text{本日選擇權到期差益數額} - \text{本日} \\
 & \text{選擇權到期差損數額} + \text{本日股票選擇權買方交割應收款項} + \text{本日股票選} \\
 & \text{擇權賣方交割應收款項} + \text{本日股票選擇權券不足現金結算應收款項} - \text{本} \\
 & \text{日股票選擇權買方交割應付款項} - \text{本日股票選擇權賣方交割應付款項} - \\
 & \text{本日股票選擇權券不足現金結算應付款項} + \text{期貨實物交割應收款項} + \text{期} \\
 & \text{貨實物不足現金結算應收款項} - \text{期貨實物交割應付款項} - \text{期貨實物不足} \\
 & \text{現金結算應付款項} - \text{次日申請提領款項金額} + \text{本日結匯存入金額} - \text{本} \\
 & \text{日結匯提領金額}
 \end{aligned}$$

※幣別為2時，原存有結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本日存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本日結匯存入金額及本日結匯提領金額均為約當美元^{附註(1)}，而現存有結算保證金權益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為2時，本日存入/移入款項金額為約當美元(即每一外幣之存入/移入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數2位後加總)，其餘約當美元之款項項目計算公式均相同。

2. 應存有結算保證金數額：包含到期部位結算保證金數額
3. 現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金額
4. 本日股票選擇權買方交割應收款項 = 賣權之買方應收款項 + 買權買方契約調整現金結算應收款項
5. 本日股票選擇權賣方交割應收款項 = 買權之賣方應收款項 + 賣權賣方契約調整現金結算應收款項
6. 本日股票選擇權買方交割應付款項 = 買權之買方應付款項 + 賣權買方契約調整現金結算應付款項
7. 本日股票選擇權賣方交割應付款項 = 賣權之賣方應付款項 + 買權賣方契

約調整現金結算應付款項

8. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。
9. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割價款。
10. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。
11. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及結匯郵電費)。

12. 台幣可提領款項金額：台幣現存有總權益數 — 台幣應存有保證金 — [(美元應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(2)} — 人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(3)} * 參考匯率(美元兌台幣)] — [(人民幣應存有不足之款項金額^{附註(4)} — 美元支應人民幣應存有不足之款項金額^{附註(5)} * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元可提領款項金額(約當美元)：美元現存有總權益數(約當美元) — 美元應存有保證金 — (台幣應存有不足之款項金額^{附註(6)} / 參考匯率(美元兌台幣)) — (人民幣應存有不足之款項金額 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣可提領款項金額：人民幣現存有總權益數 — 人民幣應存有保證金 — [(台幣應存有不足之款項金額 — 美元支應台幣應存有不足之款項金額^{附註(7)} / 參考匯率(人民幣兌台幣)] — (美元應存有不足之款項金額(約當美元) / 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

13. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 — 台幣現存有總權益數 — (美元超額保證金(約當美元) * 參考匯率(美元兌台幣)) — [(人民幣超額保證金 — 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(8)} * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元應追繳款項金額(約當美元)：美元應存有保證金 — 美元現存有總權益數(約當美元) — (人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣應追繳款項金額：人民幣應存有保證金 — 人民幣現存有總權益數 >

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣外之外幣合計值

(2)美元應存有不足之款項金額(約當美元) = $\text{Max}(\text{美元應存有保證金} - \text{美元現存有總權益數(約當美元)}, 0)$

(3)人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元) = $\text{Min}(\text{美元應存有不足之款項金額(約當美元)}, \text{人民幣超額保證金} * \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

(4)人民幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{人民幣應存有保證金} - \text{人民幣現存有總權益數}, 0)$

(5)美元支應人民幣應存有不足之款項金額 = $\text{Min}(\text{人民幣應存有不足之款項金額}, \text{美元超額保證金} / \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

(6)台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{台幣應存有保證金} - \text{台幣現存有總權益數}, 0)$

(7)美元支應台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Min}(\text{台幣應存有不足之款項金額}, \text{美元超額保證金} * \text{參考匯率(美元兌台幣)})$

(8)人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額 = $\text{Min}(\text{人民幣超額保證金}, \text{美元應追繳款項金額} / \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

0718 結算保證金追繳資料查詢回覆(SPAN+多幣別)

訊息代號：G34

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(SPAN+多幣別)

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	18：結算保證金追繳資料查詢
	來源單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為 '000' 或 '999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為 '0' (0：單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

訊息代號：G35

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(SPAN+多幣別)

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	18：結算保證金追繳資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
	目的地單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為' 000' 或' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位已結帳
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：結算保證金相關資料
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		幣別	X(1) 1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有結算保證金數額	9(12) v99 SPAN 系統計算出之應存有保證金
		原存有現金結算保證金權益	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元) 共14位，可為負數。正數時"15.25" 表示為"0000000001525"；負數時 "-15.25"表示為"-0000000001525"
		補足前日追繳款項金額	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元)
		本日存入/移入款項金額	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元)

欄位		屬性	欄位說明
	本日提領/移出款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	本日權利金應收款項金額	9(12) v99	
	本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
	本日成交差益數額	9(12) v99	
	本日成交差損數額	9(12) v99	
	本日部位差益數額	9(12) v99	
	本日部位差損數額	9(12) v99	
	本日到期差益數額	9(12) v99	
	本日到期差損數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	
	次日申請提領款項金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	現存有現金結算保證金權益	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元) 共 14 位，可為負數。正數時“15.25” 表示為“00000000001525”；負數時 “-15.25”表示為“-00000000001525”
	本日股票選擇權買方交割 應收款項	9(12) v99	目前為 0
	本日股票選擇權買方交割 應付款項	9(12) v99	目前為 0
	本日股票選擇權賣方交割 應收款項	9(12) v99	目前為 0
	本日股票選擇權賣方交割 應付款項	9(12) v99	目前為 0

欄位		屬性	欄位說明
	本日股票選擇權券不足現金結算應收款項	9(12) v99	目前為 0
	本日股票選擇權券不足現金結算應付款項	9(12) v99	目前為 0
	期貨實物交割應收款項	9(12) v99	
	期貨實物交割應付款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應收款項	9(12) v99	
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
	到期部位結算保證金數額	9(12) v99	
	抵繳保證金	9(12) v99	coveredcall 保證金數額，目前為 0
	期貨多空減收之保證金	9(12) v99	依 SPAN 系統整戶計算，不另計算之
	本日結匯存入金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	本日結匯提領金額	9(12) v99	(幣別為 2 時為約當美元)
	可提領款項金額	9(12) v99	註 7
	應追繳款項金額	9(12) v99	註 8
	兌台幣參考匯率	9(4)v 9(6)	幣別為台幣時，本欄位固定為 1
	境外外資台幣商品保證金	9(12) v99	幣別為人民幣時，本欄位固定為 0

格式說明：

- 現存有現金結算保證金權益 = 原存有現金結算保證金權益 + 補足前日追繳款項金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日成交差益數額

$$\begin{aligned}
 & - \text{本日成交差損數額} + \text{本日部位差益數額} - \text{本日部位差損數額} + \text{本日} \\
 & \text{到期差益數額} - \text{本日到期差損數額} + \text{本日選擇權到期差益數額} - \text{本日} \\
 & \text{選擇權到期差損數額} + \text{本日股票選擇權買方交割應收款項} + \text{本日股票選} \\
 & \text{擇權賣方交割應收款項} + \text{本日股票選擇權券不足現金結算應收款項} - \text{本} \\
 & \text{日股票選擇權買方交割應付款項} - \text{本日股票選擇權賣方交割應付款項} - \\
 & \text{本日股票選擇權券不足現金結算應付款項} + \text{期貨實物交割應收款項} + \text{期} \\
 & \text{貨實物不足現金結算應收款項} - \text{期貨實物交割應付款項} - \text{期貨實物不足} \\
 & \text{現金結算應付款項} - \text{次日申請提領款項金額} + \text{本日結匯存入金額} - \text{本} \\
 & \text{日結匯提領金額}
 \end{aligned}$$

※幣別為 2 時，原存有現金結算保證金款項餘額、補足前日追繳款項金額、本
 日存入/移入款項金額、本日提領/移出款項金額、次日申請提領款項金額、本
 日結匯存入金額及本日結匯提領金額均為約當美元^{附註(1)}，而現存有結算保證金
 總權益數額(約當美元)則依上列之計算公式得知。

※如幣別為 2 時，本日存入/移入款項金額為約當美元^{附註(1)} (即每一外幣之存
 入/移入款項金額*對美元之參考匯率，經四捨五入至小數 2 位後加總)，其餘
 約當美元之款項項目計算公式均相同。

現存有結算保證金總權益數 = 現存有現金結算保證金權益 + 有價證券抵繳金
 額

2. 應存有結算保證金數額：

2.1. 若台幣：則 SPAN 系統計算出之台幣應存有保證金(扣除股票選擇權買權賣
 方抵繳保證金及扣除境外外資台幣商品保證金且包含到期部位
 結算保證金數額)

2.2. 若美元：則 SPAN 系統計算出之美元應存有保證金(包含境外外資台幣商品
 保證金以美元匯率換算之美元)

2.3. 若人民幣：則 SPAN 系統計算出所有人民幣商品之應存有保證金

3. 期貨實物交割應收(付)款項：為債券期貨實物交割應收(付)交割價款。

4. 期貨現金結算應收(付)款項：為債券期貨實物不足需現金結算之應收(付)交割價款。

5. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。

6. 本日結匯提領金額：為本日期交所代結匯所提領之總金額(包含結匯手續費及結匯郵電費)。

7. 台幣可提領款項金額：台幣現存有總權益數 — 台幣應存有保證金 — [(美元應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(2)} — 人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元)^{附註(3)} * 參考匯率(美元兌台幣)] — [(人民幣應存有不足之款項金額^{附註(4)} — 美元支應人民幣應存有不足之款項金額^{附註(5)} * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元可提領款項金額(約當美元)：美元現存有總權益數(約當美元) — 美元應存有保證金 — (台幣應存有不足之款項金額^{附註(6)} / 參考匯率(美元兌台幣)) — (人民幣應存有不足之款項金額 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣可提領款項金額：人民幣現存有總權益數 — 人民幣應存有保證金 — [(台幣應存有不足之款項金額 — 美元支應台幣應存有不足之款項金額^{附註(7)}) / 參考匯率(人民幣兌台幣)] — (美元應存有不足之款項金額(約當美元) / 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

8. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 — 台幣現存有總權益數 — (美元超額保證金(約當美元) * 參考匯率(美元兌台幣)) — [(人民幣超額保證金 — 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(8)}) * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元應追繳款項金額(約當美元)：美元應存有保證金 — 美元現存有總權益數(約當美元) — (人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣應追繳款項金額：人民幣應存有保證金 — 人民幣現存有總權益數 > 0

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣外之外幣合計值

(2)美元應存有不足之款項金額(約當美元) = $\text{Max}(\text{美元應存有保證金} - \text{美元現存有總權益數(約當美元)}, 0)$

(3)人民幣支應美元應存有不足之款項金額(約當美元) = $\text{Min}(\text{美元應存有不足之款項金額(約當美元)}, \text{人民幣超額保證金} * \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

(4)人民幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{人民幣應存有保證金} - \text{人民幣現存有總權益數}, 0)$

(5)美元支應人民幣應存有不足之款項金額 = $\text{Min}(\text{人民幣應存有不足之款項金額}, \text{美元超額保證金} / \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

(6)台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{台幣應存有保證金} - \text{台幣現存有總權益數}, 0)$

(7)美元支應台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Min}(\text{台幣應存有不足之款項金額}, \text{美元超額保證金} * \text{參考匯率(美元兌台幣)})$

(8)人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額 = $\text{Min}(\text{人民幣超額保證金}, \text{美元應追繳款項金額} / \text{參考匯率(人民幣兌美元)})$

0719 結算保證金追繳資料查詢回覆(多幣別)

4.2.7.5. 訊息代號：G36

訊息名稱：盤中保證金追繳通告(多幣別)

訊息類別：廣播通告訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	19：盤中保證金追繳通告
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
	目的地單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為 '000' 或 '999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位部位已結帳
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號	9(2)	01：盤中保證金追繳
	01 期貨商代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣
	應追繳數額	9(12)	依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準 (註 6)
	參考匯率 (美金兌台幣)	9(4)v 9(6)	幣別為台幣時，本欄位固定為 1

格式說明：

1. 為期交所主動傳送給結算會員之正常資料格式。
2. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式，得到一特定之要求代碼(Request ID)為 integer 99，用以代表此為廣播通告訊息。

3. 結算會員應用程式第一次收取之資料格式為訊息控制區及資料群組代號(01)。
4. 結算會員應用程式再次收取之資料格式，為資料群組代號 01 之資料群組內容。
5. 結算會員應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

6. 台幣應追繳款項金額：台幣應存有保證金 — 台幣現存有總權益數 — (美元超額保證金(約當美元^{附註(1)}) * 參考匯率(美元兌台幣)) — [(人民幣超額保證金 — 人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(2)}) * 參考匯率(人民幣兌台幣)] > 0

美元應追繳款項金額(約當美元)：美元應存有保證金 — 美元現存有總權益數(約當美元) — (人民幣超額保證金 * 參考匯率(人民幣兌美元)) > 0

人民幣應追繳款項金額：人民幣應存有保證金 — 人民幣現存有總權益數 > 0

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣外之外幣合計值

(2)人民幣超額保證金支應美元應追繳款項金額 = Min (人民幣超額保證金，美元應追繳款項金額 / 參考匯率(人民幣兌美元))

0715 商品狀態查詢

4.2.7.15. 訊息代號：G28

訊息名稱：商品狀態查詢通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	15：商品狀態查詢
	來源單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為' 000' 或' 999'
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	商品代號	X(7)	'9999999' 表查詢當日所有商品狀態

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為 '0' (0:單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.7.15. 訊息代號：G29

訊息名稱：商品狀態查詢回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	15：商品狀態查詢
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
	目的地單位代號	X(7)	前四碼為結算會員代號 後三碼應為' 000' 或' 999'
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	保留欄位	X(5)	
訊息資料區	01 資料群組代號	9(2)	
	01 商品代號	X(7)	
	01 結帳盤別	X(2)	'01' -第一盤（約 14:30）結帳商品 '02' -第二盤（約 16:30）結帳商品
	到期交割狀態	X(1)	'0' -尚未辦理到期作業 '1' -已辦理到期作業 '9' -本日無到期作業
	結帳狀態	X(1)	'0' -未結帳 '1' -已結帳

0716 各盤別保證金及商品損益

4.2.7.16. 訊息代號：G30

訊息名稱：各盤別保證金及商品損益查詢通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	16：各盤別保證金及商品損益查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	
	期貨商代號	X(7)	
	交易人帳號起號	X(7)	為查詢之交易人帳號起號及迄號；若帳號起號及迄號同時填入7碼空白，表示
	交易人帳號迄號	X(7)	查詢該期貨商之總計資料
	盤別	X(2)	'01'：查詢第一盤商品之保證金及商品損益 '02'：查詢第一盤及第二盤商品之保證金及商品損益

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為 '0' (0:單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。
3. 於各盤部位結帳後提供各盤商品之保證金及損益資料。

4.2.7.16. 訊息代號：G31

訊息名稱：各盤別保證金及商品損益查詢回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	7：結算保證金作業
	作業項目	9(2)	16：商品到期交割狀態查詢
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
	目的地單位代號	X(7)	期貨商代號
	訊息時間	9(6)	回覆訊息之時間
	保留欄位	X(5)	
訊息資料區	01 資料群組代號	9(2)	01：各盤別保證金及商品損益
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		期貨商代號	X(7)
		交易人帳號	X(7) 查詢期貨商總計資料時，本欄位為 7 碼空白
		盤別	X(2)
		幣別	X(1) 1：台幣 2：美金 8：人民幣
		應存有 SPAN 結算保證金數額	9(12) v99 SPAN 系統計算出之應存有保證金
		應存有策略結算保證金數額	9(12) v99 以策略方式算出之應存有保證金
		期貨多空減收之保證金	9(12) v99
		本日權利金應收款項金額	9(12) v99

欄位		屬性	欄位說明
	本日權利金應付款項金額	9(12) v99	
	本日成交差益數額	9(12) v99	
	本日成交差損數額	9(12) v99	
	本日部位差益數額	9(12) v99	
	本日部位差損數額	9(12) v99	
	本日到期差益數額	9(12) v99	
	本日到期差損數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差益數額	9(12) v99	
	本日選擇權到期差損數額	9(12) v99	

訊息說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息資料與傳送 G30 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(結算會員)應用程式第一次收取之資料格式為資料控制區及資料群組代號內容。
4. 期貨商(結算會員)應用程式再次收取之資料格式，為該資料群組代號(01：各盤別保證金及商品損益)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 1 表仍有資料，為 integer 0 表資料結束)。
6. 若尚未進行該盤結帳作業，則回覆[26007 無此資料]。

7. 回覆資料為任一金額(數額)欄位不為 0 之資料列。

8. 造市帳戶之[應存有 SPAN 結算保證金數額]皆為 0(合併計於自營帳戶下)。

0401 到期履約及實物交割作業

4.2.4.1. 訊息代號：D01

訊息名稱：自動履約名冊查詢通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	01：自動履約名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為 '9' 查詢所有商品資料，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	得為 '999999' 以查詢所有商品資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有商品資料，期貨商品輸入空白

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為 '0' (0：單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得惟一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.4.2. 訊息代號：D02

訊息名稱：自動履約名冊查詢回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	01：自動履約名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	5：履約調整未截止 6：履約調整已截止
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號		9(2) 01：履約指派名冊資料
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		期貨商代號	X(7)
		交易人帳號	X(7)
		商品代號	X(7)
		買賣權別	X(1)
		交割月份	X(6)
		履約價格	X(5)
		履約口數	9(5)
	為多筆之應用資料內容		

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。

2. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息資料與傳送 D01 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(結算會員)應用程式第一次收取之資料格式為資料控制區及資料群組代號內容。
4. 期貨商(結算會員)應用程式再次收取之資料格式，為該資料群組代號(01：履約指派名冊資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 1 表仍有資料，為 integer 0 表資料結束)。
6. 遇同日進行「黃金選擇權(TGO)」與「短天期台指選擇權」履約作業，**或遇資訊異常改採分批到期作業時**，以' 9999999' 查詢所有商品名冊資料恐造成資料混淆，系統將回覆「26201 請以完整商品代號重新查詢」；建議取消 MTS0401 及 0404 交易，改以 0416 交易查詢履約名冊資料及 0419 交易查詢履約指派名冊。
7. 因應「短天期台指選擇權」上市，為避免本日及次日皆遇商品到期，原提供兩日名冊資料之查詢方式恐造成資料混淆，故本交易改為只提供當日名冊查詢。

0404 履約指派名冊查詢

4.2.4.7. 訊息代號：D07

訊息名稱：履約指派名冊查詢通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	04：履約指派名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	結算會員或期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
訊息資料區	結算會員代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商對應之結算會員代號
	期貨商代號	X(7)	為欲查詢資料之期貨商代號
	商品代號	X(7)	得為 '9999999' 以查詢所有商品部位資料
	買賣權別	X(1)	得為 '9' 以查詢所有買賣權別資料，期貨為空白，買權為 'C'，賣權為 'P'
	交割月份	X(6)	得為 '999999' 以查詢所有交割月份資料
	履約價格	X(5)	得為 '99999' 以查詢所有履約價格資料，期貨商品輸入空白

格式說明：

1. 結算會員應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為 '0' (0：單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給期交所，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得惟一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
2. 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.4.8. 訊息代號：D08

訊息名稱：履約指派名冊查詢回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	4：到期履約及實物交割作業
	作業項目	9(2)	04：履約指派名冊查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號 '0001000'
	訊息時間	9(6)	
	結帳記號	9(1)	5：履約調整未截止 6：履約調整已截止
	結算會員代號	X(4)	為欲登錄資料之期貨商對應之結算會員代號
訊息資料區	資料群組代號		9(2) 01：履約指派名冊資料
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		期貨商代號	X(7)
		交易人帳號	X(7)
		商品代號	X(7)
		買賣權別	X(1)
		交割月份	X(6)
		履約價格	X(5)
		履約口數	9(5)
		不需履約口數	9(5)
		為多筆之應用資料內容	

格式說明：

1. 為期交所應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息資料與傳送 D07 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。
3. 期貨商(結算會員)應用程式第一次收取之資料格式為資料控制區及資料群組代號內容。
4. 期貨商(結算會員)應用程式再次收取之資料格式，為該資料群組代號(01：履約指派名冊資料)下之各筆資料群組內容。
5. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料群組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 1 表仍有資料，為 integer 0 表資料結束)。
6. 遇同日進行「黃金選擇權(TGO)」與「短天期台指選擇權」履約作業，**或遇資訊異常改採分批到期作業時**，以' 9999999' 查詢所有商品名冊資料恐造成資料混淆，系統將回覆「26201 請以完整商品代號重新查詢」；建議取消 MTS0401 及 0404 交易，改以 0416 交易查詢履約名冊資料及 0419 交易查詢履約指派名冊。
7. 因應「短天期台指選擇權」上市，為避免本日及次日皆遇商品到期，原提供兩日名冊資料之查詢方式恐造成資料混淆，故本交易改為只提供當日名冊查詢。

0303 公告資料查詢通知

4.2.3.5. 訊息代號：C05

訊息名稱：公告資料查詢通知

訊息類別：單筆要求訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	03：公告資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期貨商代號(或結算會員)
	目的地單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
訊息資料區	日期	X(8)	欲查詢公告之日期： 日期：採西元年月日 YYYYMMDD 如輸入 99999999 表示欲查詢目前最新公告資料 如輸入 88888888 表示欲查詢目前錯誤訊息代碼對照資料 如輸入 11111111 表示欲查詢目前結帳狀態資料

格式說明：

- 期貨商(結算會員)之應用程式需配合 MTS 服務程式，將 PUT 功能參數之傳送類別(Flag)設定為' 0' (0：單次傳送處理)，傳送該訊息格式內容給結算系統，傳送後透過 MTS 服務程式可獲得唯一之要求代碼(Request ID)，可與回覆訊息相連接。
- 期貨商(結算會員)應用程式傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區，如上

所述。

3. X：表示文數字，9：表示數字

4.2.3.6. 訊息代號：C06

訊息名稱：公告資料查詢回覆

訊息類別：多筆回覆訊息

訊息格式：

欄位		屬性	欄位說明
訊息控制區	系統代號	9(1)	0：結算系統
	作業類別	9(1)	3：其他連線作業
	作業項目	9(2)	03：公告資料查詢
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號' 0001000'
	目的地單位代號	X(7)	為期貨商代號(或結算會員)
	訊息時間	9(6)	回覆訊息時間
	訊息代碼	9(5)	"00000"
訊息資料區	公告時間	X(8)	採西元年月日 YYYYMMDD
	公告序號	9(4)	序號："0001" to "9999"
	公告資料內容	X(80)	
	公告時間	X(8)	採西元年月日 YYYYMMDD
	公告序號	9(4)	序號："0001" to "9999"
	公告資料內容	X(80)	
	• • • • •	• •	• • • • •

格式說明：

1. 為結算系統應期貨商(結算會員)之要求所回覆之正常資料格式。
2. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式接收之回覆訊息要求代碼 (Request ID)，與傳送 C05 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
3. 期貨商(結算會員)應用程式收取之資料格式為訊息控制區及訊息資料區，如上

所述，訊息資料區內容為 [公告時間 + 公告序號 + 公告資料內容]、[公告時間 + 公告序號 + 公告資料內容]…，並以公告序號小到大依序送出。

4. 期貨商(結算會員)應用程式依 MTS 服務程式功能參數取得之 RC，判斷該資料組內容是否為最後一筆資料(即 RC 為 integer 0 表資料結束，為 integer 1 表仍有資料)。

5. X：表示文數字，9：表示數字

6. 如輸入 11111111 查詢，依結帳狀態回覆之內容為：

公告時間	公告序號	公告資料內容
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：未結帳，第 2 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：已結帳