

105年度上半年推行商品 交易資訊作業規劃草案

臺灣期貨交易所資訊規劃部
2016年03月

大綱

- 契約規格
 - 與現有商品差異
 - 基本資料檔案傳輸
- 交易資訊作業規劃
 - 一般交易日
 - 最後結算日

契約規格與現有商品差異(一)

中文簡稱	英文代碼	交易時間 (一般)	交易時間 (到期)
櫃買生技期貨	BTF	8:45-13:45	8:45-13:30
小立光期貨(舉例)	OLF	8:45-13:45	8:45-13:30
黃金期貨	GDF	8:45- <u>16:15</u>	8:45- <u>16:15</u>
臺幣黃金期貨	TGF	8:45- <u>16:15</u>	8:45- <u>16:15</u>
臺幣黃金選擇權	TGO	8:45- <u>16:15</u>	8:45- <u>16:15</u>
美元兌人民幣選擇權	RHO	8:45-16:15	8:45- <u>11:00</u>
小型美元兌人民幣選擇權	RTO	8:45-16:15	8:45- <u>11:00</u>

契約規格與現有商品差異(二)

英文代碼	到期月份	契約序列
BTF(生技期貨)	2個近月・3個季月	N/A
OLF(小型股期)	2個近月・3個季月	N/A
GDF(黃金期貨)	6個偶數月	N/A
TGF(臺黃期貨)	6個偶數月	N/A
TGO(臺黃選)	6個偶數月	■ 同標的最近月期貨結算價為基準
RHO(匯率選)	2個近月・4個季月	■ <u>同標的同月份期貨結算價</u> 為基準 ■ <u>近月契約</u> 最高及最低履約價涵蓋基準價上下 <u>2%</u> ・履約價間距 <u>0.02</u> 元 ■ <u>季月契約</u> 最高及最低履約價涵蓋基準價上下 <u>4%</u> ・履約價間距 <u>0.04</u> 元
RTO(小型匯率選)	2個近月・4個季月	(掛牌規則同RHO)

契約規格與現有商品差異(三)

英文代碼	契約乘數	升降(報價)單位	每日漲跌幅
BTF(生技期貨)	2000	0.05	前1交易日結算價上下10%
OLF(小型股期)	<u>100</u>	級距式 同現行股票期貨	前1交易日結算價上下10%
GDF(黃金期貨)	<u>10</u>	0.1	前1交易日結算價上下15%
TGF(臺黃期貨)	100	0.5	前1交易日結算價上下15%
TGO(臺黃選)	50	0.5	前1交易日同標的最近月 期貨結算價上下15%
RHO(匯率選)	100000	<u>0.0001</u>	前1交易日 <u>同標的同月份</u> <u>期貨結算價</u> 上下7%
RTO(小型匯率選)	20000	<u>0.0001</u>	前1交易日 <u>同標的同月份</u> <u>期貨結算價</u> 上下7%

TAIFEX

4

契約規格與現有商品差異(四)

英文代碼	最後交易日	最後結算日	最後結算價
BTF(生技期貨)	第3個星期三	同最後交易日	櫃買中心收盤前30分鐘內 標的指數算術平均價
OLF(小型股期)	第3個星期三	同最後交易日	證券市場收盤前60分鐘內 標的證券算術平均價
GDF(黃金期貨)	到期月份最後1 個營業日前之第 2個營業日	最後交易日之次 1營業日	LBMA黃金早盤價
TGF(臺黃期貨)	(同GDF)	(同GDF)	LBMA黃金早盤價轉換重 量與成色× <u>上午11:00</u> 新 臺幣兌美元匯率
TGO(臺黃選)	(同GDF)	(同GDF)	(同TGF)
RHO(匯率選)	第3個星期三	同最後交易日	上午11:15美元兌人民幣 (香港)即期匯率定盤價
RTO(小型匯率選)	第3個星期三	同最後交易日	上午11:15臺灣離岸人 民幣定盤匯率

5

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(一)

■ P09(契約基本資料檔 - 期貨)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3
1	契約代碼	BTF	OLF	GDF
2	契約名稱	櫃買生技期貨	小立光期貨	黃金期貨
3	現貨股票代號 (僅適用股票類)		3008	
4	契約類別 (I:指數, C:商品, S:股票, E:匯率)	I	S	C
5	契約乘數 9(7)V9(4)	<u>000200000000</u>	<u>000010000000</u>	<u>000001000000</u>
7	幣別(1:台幣, 2:美元, 8:人民幣)	1	1	2
9	委託價格小數位數	2	2	3
15	商品收盤時間群組 (1-13:45, 5-16:15)	1	1	5

TAIFEX

6

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(二)

■ P09(契約基本資料檔 - 選擇權)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3
1	契約代碼	RHO	RTO	TGO
2	契約名稱	美元兌人民幣選擇權	小型美元兌人民幣選擇權	臺幣黃金選擇權
4	契約類別 (I:指數, C:商品, S:股票, E:匯率)	E	E	C
5	契約乘數 9(7)V9(4)	<u>010000000000</u>	<u>002000000000</u>	<u>000005000000</u>
7	幣別(1:台幣, 2:美元, 8:人民幣)	8	8	1
8	履約價格小數位數	2	2	0
9	委託價格小數位數	4	4	3
15	商品收盤時間群組 (1-13:45, 5-16:15)	5	5	5

TAIFEX

7

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(三)

■ PA9(契約基本資料檔 - 股票期貨)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3	資料舉例4
1	契約代碼(8)	3008 SF	3008 S1	3008 MF	3008 M1
2	契約名稱	大立光期貨	大立光期貨	小立光期貨	小立光期貨
3	現貨股票代號	3008	3008	3008	3008
4	契約類別 (S:股票)	S	S	S	S
5	契約乘數	00020000000	00030000000	00001000000	00001500000
7	幣別(1:台幣)	1	1	1	1
9	委託價格小數位數	2	2	2	2
15	商品收盤時間 群組(1-13:45)	1	1	1	1

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 - 期貨)

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	BTFI6	OLFL6	GDFJ6
2	交割年月	201609	201612	201610
7	第一漲停價	000013985	000223500	001220700
8	第一跌停價	000011445	000245500	000902300
9	權利金(開盤參考價)	000012715	000201500	001061500
14	契約類別 (I:指數, C:商品, S:股票, E:匯率)	I	S	C
16	委託價格小數位數	2	2	3
18	流程群組 (1-13:45, 3-13:30, 5-16:15)	3 (假設本日為 20160921)	1	5
19	最後結算日	20160921	20161216	20161028

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(五)

■ P08(商品與時間流程群組定義檔 - 選擇權)

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	RH00 <u>0696</u> U6	RT00 <u>0692</u> X6	TG005000V6
2	交割年月	201609	201612	201610
7	第一漲停價	00000 <u>9548</u>	00000 <u>4942</u>	001385 <u>500</u>
8	第一跌停價	00000 <u>0112</u>	00000 <u>9689</u>	000111 <u>500</u>
9	權利金(開盤參考價)	00000 <u>4830</u>	00000 <u>4830</u>	000748 <u>500</u>
14	契約類別 (I:指數·C:商品· S:股票· <u>E:匯率</u>)	E	E	C
16	委託價格小數位數	4	4	3
18	流程群組 (<u>4-11:00</u> ·5-16:15)	4(假設本日為 20160921)	5	5
19	最後結算日	20160921	20161216	20161028

TAIFEX

10

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(六)

■ PA8(商品與時間流程群組定義檔 - 股票期貨)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3	資料舉例4
1	商品代號(20)	<u>3008</u> SFL6	<u>3008</u> S1L6	<u>3008</u> MFL6	<u>3008</u> M1L6
2	交割年月	201612	201612	201612	201612
7	第一漲停價	0002235 <u>00</u>	0002235 <u>00</u>	0002235 <u>00</u>	0002235 <u>00</u>
8	第一跌停價	0002455 <u>00</u>	0002455 <u>00</u>	0002455 <u>00</u>	0002455 <u>00</u>
9	開盤參考價	0002015 <u>00</u>	0002015 <u>00</u>	0002015 <u>00</u>	0002015 <u>00</u>
14	契約類別 (S:股票)	S	S	S	S
16	價格小數位數	2	2	2	2
18	流程群組 (1-13:45)	1	1	1	1
19	最後結算日	20161216	20161216	20161216	20161216

TAIFEX

11

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(七)

■ P04(一定範圍市價委託點數檔 - 期貨)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3
1	契約代碼	BTF	OLF	GDF
2	單式委託一定範圍點數	0000 <u>6452500</u>	0022 <u>7000000</u>	0005 <u>3290000</u>
3	價差委託一定範圍點數	0000 <u>3226250</u>	0011 <u>3500000</u>	0002 <u>6645000</u>
4	(新增)到期年月			
5	(新增)空白(32)			

基本資料檔案傳輸 - TMP電文舉例(八)

■ P04(一定範圍市價委託點數檔 - 選擇權)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3
1	契約代碼	RHO	RHO	TGO
2	單式委託一定範圍點數	0000 <u>0067404</u>	0000 <u>0067819</u>	0008 <u>4940000</u>
3	價差委託一定範圍點數	000000000000	000000000000	000000000000
4	(新增)到期年月	<u>201609</u>	<u>201610</u>	
5	(新增)空白(32)			

交易資訊作業 - 一般交易日(一)

時間	現行檔案傳輸	增加商品	減少商品
13:45	■ <u>13:45收盤商品</u> 收盤	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨暨選擇權 (GDF, TGF, TGO)
	■ P14(契約風險保證金檔 <u>目前已收盤商品</u>)	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨暨選擇權 (GDF, TGF, TGO)
	■ C10(第1次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>)	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨暨選擇權 (GDF, TGF, TGO)
	■ C20(複式商品行情單檔 <u>目前已收盤商品</u>)	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨 (GDF, TGF)
	■ C11(每日結算價檔， <u>目前已收盤商品</u> ， 多次傳送)	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨暨選擇權 (GDF, TGF, TGO)

TAIFEX

14

交易資訊作業 - 一般交易日(二)

時間	現行檔案傳輸	增加商品	減少商品
14:30	■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>)	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨暨選擇權 (GDF, TGF, TGO)
結算 系統	■ 13:45收盤商品部位處 理作業截止		
	■ C10(第3次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>)	生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)	黃金期貨暨選擇權 (GDF, TGF, TGO)
	■ B10(鉅額成交量統計檔 <u>目前已收盤商品</u>)	小型股期(如:OLF)	-
15:00	■ I14(契約調整預告檔)	小型股期(如:OLF)	-
	■ I20(契約調整參考檔)	小型股期(如:OLF)	-
	■ I16(有價證券抵繳價格檔)	-	-

TAIFEX

15

交易資訊作業 - 一般交易日(三)

時間	現行檔案傳輸	增加商品
16:15	<ul style="list-style-type: none"> ■ <u>16:15收盤商品</u>收盤 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨暨選擇權(GDF, TGF, TGO) 匯率選擇權(RHO, RTO)
	<ul style="list-style-type: none"> ■ P14(契約風險保證金檔 <u>目前已收盤商品</u>) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨暨選擇權(GDF, TGF, TGO) 匯率選擇權(RHO, RTO)
	<ul style="list-style-type: none"> ■ C10(第1次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨暨選擇權(GDF, TGF, TGO) 匯率選擇權(RHO, RTO)
	<ul style="list-style-type: none"> ■ C20(複式商品行情單檔 <u>目前已收盤商品</u>) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨(GDF, TGF)
	<ul style="list-style-type: none"> ■ C11(每日結算價， <u>目前已收盤商品</u>， 多次傳送) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨暨選擇權(GDF, TGF, TGO) 匯率選擇權(RHO, RTO)

TAIFEX

16

交易資訊作業 - 一般交易日(四)

時間	現行檔案傳輸	增加商品
16:30	<ul style="list-style-type: none"> ■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨暨選擇權(GDF, TGF, TGO) 匯率選擇權(RHO, RTO)
結算 系統	<ul style="list-style-type: none"> ■ 16:15收盤商品部位處 理作業截止 	
	<ul style="list-style-type: none"> ■ C10(第3次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 黃金期貨暨選擇權(GDF, TGF, TGO) 匯率選擇權(RHO, RTO)
	<ul style="list-style-type: none"> ■ B10(鉅額成交量統計檔 <u>目前已收盤商品</u>) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 匯率選擇權(RHO, RTO)
17:00	<ul style="list-style-type: none"> ■ I15(有價證券抵繳-證 券基本資料檔) 	-
	<ul style="list-style-type: none"> ■ I17(有價證券抵繳-債 券基本資料檔) 	-

TAIFEX

17

交易資訊作業 - 最後結算日(一)

■ 股價指數、股票及匯率類商品(到期月份第3個星期3)

時間	現行檔案傳輸	增加商品
11:30	■ T90(最後結算價參考檔，匯率期貨)	■ 匯率選擇權(RHO, RTO)
13:50	■ T90(最後結算價參考檔，匯率期貨、股價指數期貨及選擇權、股票期貨及選擇權)	■ 匯率選擇權(RHO, RTO) 生技期貨(BTF) 小型股期(如:OLF)
	■ T92(股票選擇權/股票期貨最後結算約定標的物價值檔)	■ 小型股期(如:OLF)
	■ T95(股票選擇權/股票期貨最後結算價檔)	■ 小型股期(如:OLF)

交易資訊作業 - 最後結算日(二)

■ 臺幣黃金期貨暨選擇權

最後交易日：到期月份最後1個營業日前之第2個營業日

時間	現行檔案傳輸	增加檔案傳輸
16:30	-	■ T96(現貨預付價款)

最後結算日：最後交易日之次1營業日

時間	現行檔案傳輸	增加檔案傳輸
09:00 08:30	■ T90(最後結算價參考檔，黃金期貨及選擇權)	■ T96(到期轉現貨價款)

交易資訊作業 - 最後結算日(三)

■ 新增TMP電文 - T96(實務交割價款檔)

最後交易日：傳送臺幣黃金期貨現貨預付價款

編號	欄位名稱	資料舉例
1	商品代號	TGFF6
2	價款類別(0:預付, 1:實際)	0
3	實務交割價款 9(8)	00497450

最後交易日：傳送臺幣黃金選擇權現貨預付價款

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2
1	商品代號	TG003800F6	TG003850F6
2	價款類別(0:預付, 1:實際)	0	0
3	實務交割價款 9(8)	00190000	00192500

交易資訊作業 - 最後結算日(四)

■ 新增TMP電文 - T96(實務交割價款檔)

最後結算日：傳送臺幣黃金期貨到期轉現貨價款

編號	欄位名稱	資料舉例
1	商品代號	TGFF6
2	價款類別(0:預付, 1:實際)	1
3	實務交割價款 9(8)	00489500

最後結算日：傳送臺幣黃金選擇權到期轉現貨價款

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2
1	商品代號	TG003800F6	TG003850F6
2	價款類別(0:預付, 1:實際)	1	1
3	實務交割價款 9(8)	00190000	00192500



敬請指教

www.taifex.com.tw