

「NIFTY50 指數期貨」、「歐元兌美元匯率期貨」、「美元兌日圓匯率

期貨」期貨結算系統 MTS 交易格式修改說明

未來 MTS 各交易列示之結帳記號，約於第三盤 Nifty50 交易結帳後(約 18:30)，才會由[0：部位未結帳]變為[1：部位已結帳]。

項次	交易代號	交易名稱	調整內容
1.	0303	公告資料查詢通知 C05、C06	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。
2.	0513	交易人期貨多空組合部位明細查詢 E25、E26	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4)
3.	0702	結算保證金追繳資料查詢回覆(台幣+外幣) G03、G04	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。 ●內容維持原狀(僅供台幣、美金權益商品使用)
4.	0703	盤中保證金追繳通告(台幣+外幣)G05	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●內容維持原狀(僅供台幣、美金權益商品使用)
5.	0704	結算保證金餘額查詢 G06、G07	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4)
6.	0708	結算保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)G14、G15	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●調整應存有結算保證金數額說明。 ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。
7.	0709	結算保證金追繳資料查詢回覆(依 SPAN 保證金計算)G16、G17	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。 ●內容維持原狀(僅供台幣、美金權益商品使用)
8.	0710	期貨商應存有暨原始保證金查詢(依 SPAN 保證金計算)G18、G19	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。
9.	0715	商品狀態查詢 G28、G29	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。
10.	0713	期貨商應存有暨原始保證金查詢(外幣)G24、G25	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。
11.	0714	結算會員抵繳結算保證金資料查詢 G26、G27	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字。

項次	交易代號	交易名稱	調整內容
12.	0716	各盤別保證金及商品損益查詢 G30, G31	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●配合 Nifty50 調整結帳盤別說明文字
13.	0717	結算保證金追繳資料查詢(多幣別) G32、G33	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●調整「境外外資台幣商品保證金」為「境外外資原幣別計價商品保證金」。 ●調整「可提領款項金額」、「應追繳款項金額」計算公式。
14.	0718	結算保證金追繳資料查詢 (SPAN+多幣別) G34, G35	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4) ●調整「境外外資台幣商品保證金」為「境外外資原幣別計價商品保證金」。 ●調整「可提領款項金額」、「應追繳款項金額」計算公式。
15.	0719	盤中保證金追繳通告(多幣別) G36	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●調整各幣別應追繳計算公式
16.	0814	交易人有價證券抵繳保證金明細查詢 H27、H28	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●增列日圓權益資料(輸入項目增列日圓幣別 4)
17.	0707	境外外資交易新台幣商品應有保證金 G12、G13	<ul style="list-style-type: none"> ●電文格式未修改 ●內容維持原狀
18.	0720	境外外資交易原幣別商品應有保證金(多幣別) G37、G38	<ul style="list-style-type: none"> ●新增交易，增加可按幣別查詢(台幣、日圓)

0303 公告資料查詢通知

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。
- X：表示文數字，9：表示數字

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，第 3 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：未結帳，第 3 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：已結帳，第 3 盤：未結帳
營業日期 (YYYYMMDD)	9999	第 1 盤：已結帳，第 2 盤：已結帳，第 3 盤：已結帳

0513 交易人期貨多空組合部位明細查詢

4.2.5.25. 訊息代號：E25

訊息名稱：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢通知

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)	5：部位管理作業
	作業項目	9(2)	13：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢
	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)	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)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號迄號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號終迄號碼
	商品代號	X(7)	得為 '9999999' 查詢所有商品部位資料
	交割月份	X(6)	得為 '999999' 查詢所有月份部位資料

格式說明：

1. 期貨商(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。
3. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司交易人之資料。

4.2.5.26. 訊息代號：E26

訊息名稱：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢回覆

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)	5：部位管理作業	
	作業項目	9(2)	13：交易人期貨多空組合部位明細資料查詢	
	來源單位代號	X(7)	期交所單位代號 ‘0001000’	
	目地單位代號	X(7)	期貨商代號	
	訊息時間	9(6)	回覆資料之時間	
	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：交易人期貨多空組合部位明細資料
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		買進商品代號	X(7)	
		買進交割月份	X(6)	
		賣出商品代號	X(7)	
		賣出交割月份	X(6)	
		期貨多空組合部位	9(5)	
		期貨多空減收之結算保證金	9(13)	
		期貨多空組合減收幣別	X(1)	
		交易人身分碼	X(1)	

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 E25 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：交易人期貨多空組合部位明細資料)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)。

0702 結算保證金追繳資料查詢

訊息代號：G03

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(台幣+外幣)

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)	02：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：G04

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(台幣+外幣)

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)	02：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
	結算會員代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金
	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”；
	01 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）
	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	

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	
	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“-0000000001525” (幣別為 2 時為約當美元)
	本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項	9(12) v99	
	本日選擇權買權買方轉現貨應付款項	9(12) v99	
	本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項	9(12) v99	
	本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項	9(12) v99	
	本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
	本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
	期貨實物交割應收款項	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
		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
		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)
	資料群組代號		9(2) 02：結算保證金追繳資料
	02 資 料 群 組 內 容	台幣可提領款項金額	9(12) v99
		台幣應追繳款項金額	9(12) v99
		美金可提領款項金額	9(12) v99 (為約當美元)
		美金應追繳款項金額	9(12) v99 (為約當美元)
		參考匯率（美金兌台幣）	9(4)v 9(6)
		境外外資台幣商品保證金	9(12) v99

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 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項 + 本日選擇權買

$$\begin{aligned} & \text{權賣方轉現貨應收款項} + \text{本日期貨商品轉現貨應收款項} - \text{本日選擇權買權買} \\ & \text{方轉現貨應付款項} - \text{本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項} - \text{本日期貨商品轉} \\ & \text{現貨應收款項} + \text{期貨實物交割應收款項} + \text{期貨實物不足現金結算應收款項} \\ & - \text{期貨實物交割應付款項} - \text{期貨實物不足現金結算應付款項} - \text{次日申請} \\ & \text{提領款項金額} + \text{本日結匯存入金額} - \text{本日結匯提領金額} \end{aligned}$$

※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，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

4~9 不適用

10. 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。

11. 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。

12. 抵繳保證金：抵繳專戶中交易人存券餘額充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股數時，依充抵之買權賣方部位所應收保證金換算為抵繳保證金

【公式：充抵買權賣方部位之抵繳保證金 = 充抵買權賣方部位之應收保證金 * 充抵買權賣方部位口數】

13. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。

14. 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)。

15. 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 - (美金應存有不足之款項金額 * 參考匯率) > 0；美金應存有不足之款項金額

= 美金應追繳款項金額

16. 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 - (美金超額保證金(約當美元) * 參考匯率(美元對台幣)) > 0

17. 美金可提領款項金額(約當美元)：美金現存有總權益數(約當美元) - 美金應存有保證金 - (台幣應存有不足之款項金額 / 參考匯率) > 0；台幣應存有不足之款項金額 = 台幣應存有保證金 - 台幣現存有總權益數 > 0

18. 美金應追繳款項金額(約當美元)：美金應存有保證金 - 美金現存有總權益數(約當美元) > 0

19. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

0704 結算保證金餘額查詢

4.2.7.6. 訊息代號：G06

訊息名稱：結算保證金餘額查詢通知(台幣+外幣)

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)	04：結算保證金餘額查詢
	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。

4.2.7.7. 訊息代號：G07

訊息名稱：結算保證金餘額查詢回覆(台幣+外幣)

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)	04：結算保證金餘額查詢
	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)	3：款項未結帳 4：款項已結帳
	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：台幣結算保證金餘額資料
	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 4：日圓
		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"00000000001525"；負數時"-15.25"表示為"-00000000001525"
		補足前日追繳金額	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元) 包含小數2位共14位，例"15.25"表示為"00000000001525"；
		本日存入/移入款項金額	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元)
		本日提領/移出款項金額	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元)
		本日劃撥追繳款項金額	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	
	本日差益金額	9(12) v99	
	本日差損金額	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	(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“-0000000001525”
	結算手續費	9(12) v99	
	交割手續費	9(12) v99	
	調整手續費	9(12) v99	
	移轉手續費	9(12) v99	
	期交所代結匯手續費	9(12) v99	
	本日選擇權轉現貨應收款項	9(12) v99	
	本日選擇權轉現貨應付款項	9(12) v99	
	本日期貨商品轉現貨應收款項	9(12) v99	
	本日期貨商品轉現貨應付款項	9(12) v99	
	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	

欄位		屬性	欄位說明
	期貨實物不足現金結算應付款項	9(12) v99	
	實物交割轉帳費用	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)

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款項餘額 + 補足前日追繳金額 + 本日存入/移入款項金額 - 本日提領/移出款項金額 + 本日劃撥追繳金額 + 本日權利金應收款項金額 - 本日權利金應付款項金額 + 本日差益金額 - 本日差損金額 + 本日選擇權轉現貨應收款項 - 本日選擇權轉現貨應付款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日期貨商品轉現貨應付款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額 + 本日結匯存入金額 - 本日結匯提領金額

※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，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(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

- 結算、交割、調整、移轉及期交所代結匯手續費等係為前一營業日之各項資料；其中股票選擇權買權交割費用將於到期日次一日顯現，賣權交割費用將於到期日次二日顯現；實物交割轉帳費用為辦理公債實物交割所衍生出之銀行轉

帳費用。

3. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。
4. 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)。

0708 結算保證金查詢(SPAN)

4.2.7.14. 訊息代號：G14

訊息名稱：結算保證金查詢通知(依 SPAN 保證金計算)

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)	08：結算保證金查詢
	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。

4.2.7.15. 訊息代號：G15

訊息名稱：結算保證金查詢回覆(依 SPAN 保證金計算)

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) 08：結算保證金查詢	
	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：部位結算會員部位資料	
	01 資料 群組 內容	結算會員代號	X(7)	包含回覆結算會員經紀商、自營商部位資料
		商品代號	X(7)	
		買賣權別	X(1)	
		交割月份	X(6)	
		履約價格	X(5)	
		買進部位餘額	9(7)	
		賣出部位餘額	9(7)	
	資料群組代號		9(2) 02：結算保證金資料	
	02 資料	結算會員代號	X(7)	
		幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓

欄位		屬性	欄位說明
群組內容	應存有結算保證金數額	9(12) v99	以 SPAN 系統計算出應存有保證金(包含公債到期部位結算保證金數額) <u>註 8</u>

格式說明：

1. 為期交所應結算會員之要求所回覆之正常資料格式。
2. 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 G14 訊息所得之要求代碼(Request ID)應相同。
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，將陸續重覆收取直至另一資料群組代號(02)
5. 結算會員應用程式以 MTS 服務程式功能參數之長度區別再次收取之資料格式，為資料群組代號(02)，可由前後筆資料長度不同判別。
6. 結算會員應用程式陸續收取之資料格式，為 02 資料群組內容。
7. 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)。
8. 應存有結算保證金數額：
 - (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)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及日圓商品保證金以美元匯率換算之美元)
 - (3)若日圓:則 SPAN 系統計算出之日圓應存有保證金(扣除境外外資日圓商品保證金)
9. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

0709 結算保證金追繳資料查詢

訊息代號：G16

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢通知(依 SPAN 保證金計算)

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)	09：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：G17

訊息名稱：結算保證金追繳資料查詢回覆(依 SPAN 保證金計算)

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)	09：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
		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 <u>現金</u> 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 "-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)
		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

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	
	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	(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“-0000000001525”
	本日選擇權賣權買方轉現 貨應收款項	9(12) v99	
	本日選擇權買權買方轉現 貨應付款項	9(12) v99	
	本日選擇權買權賣方轉現 貨應收款項	9(12) v99	
	本日選擇權賣權賣方轉現 貨應付款項	9(12) v99	
	本日期貨商品轉現貨應收 款項	9(12) v99	
	本日期貨商品轉現貨應付 款項	9(12) v99	
	期貨實物交割應收款項	9(12) v99	

欄位		屬性	欄位說明
	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	原保證金計算方式計算之 coveredcall 可抵繳保證金數額
	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)
	資料群組代號	9(2)	02：結算保證金追繳資料
	02 資 料 群 組 內 容	台幣可提領款項金額	9(12) v99 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
		台幣應追繳款項金額	9(12) v99 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
		美金可提領款項金額	9(12) v99 (約當美元) 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
		美金應追繳款項金額	9(12) v99 (約當美元) 依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準
		參考匯率 (美金兌台幣)	9(4)v 9(6)
		境外外資台幣商品保證金	9(12) v99 SPAN 系統計算之值

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 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日

選擇權到期差損數額 + 本日選擇權賣權買方轉現貨應收款項 + 本日選擇權買權賣方轉現貨應收款項 + 本日期貨商品轉現貨應收款項 - 本日選擇權買權賣方轉現貨應付款項 - 本日選擇權賣權賣方轉現貨應付款項 - 本日期貨商品轉現貨應收款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足現金結算應付款項 - 次日申請提領款項金額 + 本日結匯存入金額 - 本日結匯提領金額

※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，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(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(包含境外外資台幣及日圓商品保證金以美元匯率換算之美元)

3~8. 不適用

9. 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。

10. 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。

11. 抵繳保證金：抵繳專戶中交易人存券餘額充抵到買權賣方部位餘額之抵繳股數時，依充抵之買權賣方部位所應收保證金換算為抵繳保證金

【公式：充抵買權賣方部位之抵繳保證金 = 充抵買權賣方部位之應收保證金

＊ 充抵買權賣方部位口數】

12. 本日結匯存入金額：為本日期交所代結匯所存入之總金額。
13. 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)。
14. 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－(美金應存有不足之款項金額(約當美元)＊台幣對美元參考匯率)＞0；美金應存有不足之款項金額(約當美元)＝美金應追繳款項金額(約當美元)
15. 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－(美金超額保證金(約當美元)＊台幣對美元參考匯率)＞0
16. 美金可提領款項金額(約當美元)：美金現存有總權益數(約當美元)－美金應存有保證金－(台幣應存有不足之款項金額／參考匯率)＞0；台幣應存有不足之款項金額＝台幣應存有保證金－台幣現存有總權益數＞0
17. 美金應追繳款項金額(約當美元)：美金應存有保證金－美金現存有總權益數(約當美元)＞0
18. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

0710 貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢

4.2.7.18. 訊息代號：G18

訊息名稱：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢通知

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)	10：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢
	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)	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)	欲查詢資料之期貨商代號

格式說明：

1. 期貨商(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。
3. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4.2.7.19. 訊息代號：G19

訊息名稱：期貨商應存有暨原始保證金查詢回覆

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)	10：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢
	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)	回覆資料之時間
	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：期貨商應存有暨原始保證金
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		期貨商代號	X(7)
		幣別	X(1) 1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓
		應存有保證金	9(12) SPAN 系統計算出之結算保證金數額(包含到期部位結算保證金數額) v99
		原始保證金	9(12) SPAN 系統計算出之原始保證金數額(包含到期部位原始保證金數額) v99

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 G18 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 期貨商應存有暨原始保證金)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. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

0713 期貨商應存有暨原始保證金查詢(外幣)

4.2.7.24. 訊息代號：G24

訊息名稱：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢通知(外幣)

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)	13：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢
	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)	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)	欲查詢資料之期貨商代號

格式說明：

1. 期貨商(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。
3. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4.2.7.25. 訊息代號：G25

訊息名稱：期貨商應存有暨原始保證金查詢回覆(外幣)

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)	13：期貨商 SPAN 應存有暨原始保證金查詢
	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)	回覆資料之時間
	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：期貨商應存有暨原始保證金
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		期貨商代號	X(7)
		幣別	X(1) 1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓
		應存有保證金	9(12) SPAN 系統計算出之結算保證金數額(包含到期部位結算保證金數額) v99
		原始保證金	9(12) SPAN 系統計算出之原始保證金數額(包含到期部位原始保證金數額) v99
	資料群組代號		9(2) 02：幣別商品保證金
	02 資料群組內容	結算會員代號	X(7)
		期貨商代號	X(7)
		境外外資原幣別計價商品應有保證金	9(12) SPAN 系統計算之值 v99
		非境外外資美金計價商品應有保證金	9(12) 由 SPAN 系統計算之值 v99

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 G24 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 期貨商應存有暨原始保證金)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. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

0714 結算會員抵繳結算保證金資料查詢

4.2.7.26. 訊息代號：G26

訊息名稱：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)

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)	14：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)
	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：

- 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。
- 傳輸訊息內容包含訊息控制區及訊息資料區。

4.2.7.27. 訊息代號：G27

訊息名稱：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)

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)	14：結算會員抵繳結算保證金資料查詢(抵繳)
	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 4：款項已結帳
	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 4：日圓
		有價證券評價價值(約當台幣)	9(12)
		有價證券抵繳金額	9(12) v99 有價證券抵繳 SPAN 應收保證金
		現存有結算保證金總權益數	9(12) v99 (幣別為2時為約當美元) 指現存有現金結算保證金權益+有價證券抵繳金額
		未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)	9(12) v99 (約當台幣)

格式說明：

1. 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. 有價證券評價價值(約當台幣)：計算抵繳價值時，有價證券是以台幣為計算基礎，國際債券面額則依匯率換算方式以外幣（原發行幣別）→美金→台幣，並累計所有有價證券評價價值。

(1). 股票：依價格*繳交股數*(1-折扣比率)計算。

(2). 公債及國際債：由 OTC 提供資料，並依市價*(1-折扣比率) 計算。

3. 未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)：

公式：未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)= 有價證券評價價值(約當台幣)-有價證券實際抵繳金額(約當台幣)

4. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

5. 有價證券抵繳金額計算公式

- 一段式抵繳：

實際抵繳金額公式= $\min((\text{結算會員客戶帳 span 應收保金}) * 0.5, \text{有價證券評價價值})$

- 客保有價證券抵繳：

實際抵繳金額公式= $\min((\text{存券期貨客戶帳新台幣 span 應收保證金} - \text{一階段抵繳金額} * 2) * 0.5, \text{客保公債評價價值})$

- 二階段抵繳：

實際抵繳金額公式= $\min((\text{結算會員客戶帳 span 應收保證金} - \text{一階段抵繳金額} * 2 - \text{客保公債抵繳} * 2) * 0.5, \text{二階段抵繳券評價價值})$

6. 客保有價證券只能抵台幣 SPAN 應收保證金。

0715 商品狀態查詢

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。

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 資料群組內容	商品代號	X(7)
		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 '03' -第三盤 (約 18:30) 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

4.2.7.30. 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，表示查詢該期貨商之總計資料
	交易人帳號迄號	X(7)	
	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 '03'：查詢第一盤、第二盤及第三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。

4.2.7.31. 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 4：日圓
		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
		本日權利金應付款項金額	9(12) v99

欄位			屬性	欄位說明
		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)。
9. 參考匯率為交易系統發布之最新參考匯率，故於各盤別結帳後所使用之參考匯率將有所不同。

0717 結算保證金追繳資料查詢(多幣別)

4.2.7.32. 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。

4.2.7.33. 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
	結算會員代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓
	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）
	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	

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	
	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“-0000000001525”(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
	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	

欄位		屬性	欄位說明
	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
	境外外資原幣別計價商品 保證金	9(12) v99	註 14

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 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日股票選擇權買方交割應收款項 + 本日股票選擇權賣方交割應收款項 + 本日股票選擇權券不足現金結算應收款項 - 本日股票選擇權買方交割應付款項 - 本日股票選擇權賣方交割應付款項 - 本日股票選擇權券不足現金結算應付款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期貨實物不足現金結算應收款項 - 期貨實物交割應付款項 - 期貨實物不足

現金結算應付款項 — 次日申請提領款項金額 + 本日結匯存入金額 — 本日結匯提領金額

※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. 各幣別可提領款項金額：

(1) 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 — [各外

幣應存有不足之款項金額^{附註(2)} — 非台幣支應其他幣別應存有不足之款項金額^{附註(6)}] * 參考匯率(美元兌台幣) > 0

- (2) 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(7)} / 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)} / 參考匯率(美元兌人民幣)) — (日圓應存有不足之款項金額^{附註(5)} / 參考匯率(美元兌日圓)) > 0

- (3) 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 / 參考匯率(美元兌台幣)) + 日圓應存有不足之款項金額 / 參考匯率(美元兌日圓) + 美元應存有不足之款項金額 — 日圓及美元支應「台幣、日圓及美元應存有不足」之款項金額^{附註(8)}] * 參考匯率(美元兌人民幣) > 0

- (4) 日圓可提領款項金額：日圓現存有總權益數 — 日圓應存有保證金 — [(台幣應存有不足之款項金額^{附註(7)} / 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)} / 參考匯率(美元兌人民幣) + 美元應存有不足之款項金額^{附註(3)}] — 美元支應「台幣及人民幣應存有不足」之款項金額^{附註(9)}] * 參考匯率(美元兌日圓) > 0

13. 各幣別應追繳款項金額：

- (1) 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 / 參考匯率(美元兌人民幣)) + 日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓) — 人民幣及日圓超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(10)}] * 參考匯率(美元兌台幣) > 0

- (2) 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(美元兌人民幣)) — (日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)) > 0

- (3) 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

- (4) 日圓應追繳款項金額：日圓應存有保證金 — 日圓現存有總權益數 > 0

14. 境外外資原幣別計價商品保證金：

- (1) 幣別為人民幣時，本欄位固定為 0。
- (2) 幣別為台幣時，本欄位為境外外資台幣計價商品應收保證金。
- (3) 幣別為美金時，本欄位為[境外外資台幣計價商品應收保證金 / 參考匯率(美元兌台幣)] + [境外外資日圓計價商品應收保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)]。
- (4) 幣別為日圓時，本欄位為境外外資日圓計價商品應收保證金。

附註：

- (1)[約當美元]為本公司公告除人民幣及日圓外之外幣合計值
- (2)各外幣應存有不足之款項金額：美元應存有不足之款項金額(約當美元) + 人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)
- (3)美元應存有不足之款項金額(約當美元) = $\text{Max}(\text{美元應存有保證金} - \text{美元現存有總權益數(約當美元)}, 0)$
- (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)日圓應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{日圓應存有保證金} - \text{日圓現存有總權益數}, 0)$
- (6) 非台幣支應其他幣別應存有不足之款項金額： $\text{Min}[\text{各外幣應存有不足之款項金額(約當美元)}, \text{非台幣超額保證金(約當美元)}] = \text{Min}[\text{美元應存有不足之款項金額(約當美元)} + \text{人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣)} + \text{日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)}, \text{美元超額保證金(約當美元)} + \text{人民幣超額保證金 / 參考匯率(美元兌人民幣)} + \text{日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)}]$
- (7)台幣應存有不足之款項金額 = $\text{Max}(\text{台幣應存有保證金} - \text{台幣現存有總權益數}, 0)$
- (8)日圓及美元支應「台幣、日圓及美元應存有不足」之款項金額： $\text{Min}[\text{台幣、日圓及美元應存有不足之款項金額(約當美元)}, \text{日圓及美元超額保證金(約當美元)}]$

美元))=Min[台幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌台幣) + 日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)+美元應存有不足之款項金額(約當美元) , 日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓) + 美元超額保證金(約當美元)]

(9) 美元支應「台幣及人民幣應存有不足」之款項金額：Min[台幣及人民幣應存有不足之款項金額(約當美元),美元超額保證金(約當美元)] =Min[台幣應存有不足之款項金額/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(美元兌人民幣) ,美元超額保證金(約當美元)]

(10)人民幣及日圓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/參考匯率(美元兌人民幣)+日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓) , 美元應追繳款項金額)

0718 結算保證金追繳資料查詢(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
	結算會員代號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓
	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"00000000001525"；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)
	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	

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	
	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	(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“-0000000001525”
	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
	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	

欄位		屬性	欄位說明
	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
	境外外資原幣別計價商品 保證金	9(12) v99	註 9

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 - 本日成交差損數額 + 本日部位差益數額 - 本日部位差損數額 + 本日到期差益數額 - 本日到期差損數額 + 本日選擇權到期差益數額 - 本日選擇權到期差損數額 + 本日股票選擇權買方交割應收款項 + 本日股票選擇權賣方交割應收款項 + 本日股票選擇權券不足現金結算應收款項 - 本日股票選擇權買方交割應付款項 - 本日股票選擇權賣方交割應付款項 - 本日股票選擇權券不足現金結算應付款項 + 期貨實物交割應收款項 + 期

貨實物不足現金結算應收款項 — 期貨實物交割應付款項 — 期貨實物不足
現金結算應付款項 — 次日申請提領款項金額 + 本日結匯存入金額 — 本
日結匯提領金額

※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. 各幣別可提領款項金額：

(1) 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 — [各外
幣應存有不足之款項金額^{附註(2)} — 非台幣支應其他幣別應存有不足之款項

金額^{附註(6)}] * 參考匯率(美元兌台幣) > 0

(2) 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(7)} / 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)} / 參考匯率(美元兌人民幣)) - (日圓應存有不足之款項金額^{附註(5)} / 參考匯率(美元兌日圓)) > 0

(3) 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 / 參考匯率(美元兌台幣) + 日圓應存有不足之款項金額 / 參考匯率(美元兌日圓) + 美元應存有不足之款項金額 - 日圓及美元支應「台幣、日圓及美元應存有不足」之款項金額^{附註(8)})] * 參考匯率(美元兌人民幣) > 0

(4) 日圓可提領款項金額：日圓現存有總權益數 - 日圓應存有保證金 - [(台幣應存有不足之款項金額^{附註(7)} / 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)} / 參考匯率(美元兌人民幣) + 美元應存有不足之款項金額^{附註(9)}] - 美元支應「台幣及人民幣應存有不足」之款項金額^{附註(9)}] * 參考匯率(美元兌日圓) > 0

8. 各幣別應追繳款項金額：

(1) 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 / 參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)) - 人民幣及日圓超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(10)}] * 參考匯率(美元兌台幣) > 0

(2) 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(美元兌人民幣)) - (日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)) > 0

(3) 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

(4) 日圓應追繳款項金額：日圓應存有保證金 - 日圓現存有總權益數 > 0

9. 境外外資原幣別計價商品保證金：

- (5) 幣別為人民幣時，本欄位固定為 0。
- (6) 幣別為台幣時，本欄位為境外外資台幣計價商品應收保證金。
- (7) 幣別為美金時，本欄位為[境外外資台幣計價商品應收保證金 / 參考匯率(美元兌台幣)] + [境外外資日圓計價商品應收保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)]。
- (8) 幣別為日圓時，本欄位為境外外資日圓計價商品應收保證金。

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣及日圓外之外幣合計值

(2)各外幣應存有不足之款項金額：美元應存有不足之款項金額(約當美元) + 人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)

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

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

(5)日圓應存有不足之款項金額 = Max (日圓應存有保證金－日圓現存有總權益數, 0)

(6) 非台幣支應其他幣別應存有不足之款項金額：Min[各外幣應存有不足之款項金額(約當美元), 非台幣超額保證金(約當美元)] = Min[美元應存有不足之款項金額(約當美元) + 人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓) , 美元超額保證金(約當美元) + 人民幣超額保證金 / 參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)]

(7)台幣應存有不足之款項金額 = Max (台幣應存有保證金－台幣現存有總權益數, 0)

(8)日圓及美元支應「台幣、日圓及美元應存有不足」之款項金額：Min[台幣、日圓及美元應存有不足之款項金額(約當美元), 日圓及美元超額保證金(約當美元)] = Min[台幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌台幣) + 日圓應

存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)+美元應存有不足之款項金額
(約當美元), 日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓) + 美元超額保證金(約
當美元)]

(9) 美元支應「台幣及人民幣應存有不足」之款項金額： $\text{Min}[\text{台幣及人民幣應存有不足之款項金額(約當美元), 美元超額保證金(約當美元)}] = \text{Min}[\text{台幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌台幣)} + \text{人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣)}, \text{美元超額保證金(約當美元)}]$

(10) 人民幣及日圓超額保證金支應美元應追繳款項金額： $\text{Min}[(\text{人民幣超額保證金/參考匯率(美元兌人民幣)} + \text{日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓)}), \text{美元應追繳款項金額}]$

0719 盤中保證金追繳通告(多幣別)

4.2.7.36. 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)	
	資料群組內容	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓
	應追繳數額	9(12)	依 SPAN 系統提供之應存有為計算基準 (註 6)
	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

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. 各幣別應追繳款項金額：

(9) 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/參考匯率(美元兌人民幣)+日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓))—人民幣及日圓超額保證金支應美元應追繳款項金額^{附註(10)}] * 參考匯率(美元兌台幣) > 0

(10) 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(美元兌人民幣)) — (日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓)) > 0

(11) 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

(12) 日圓應追繳款項金額：日圓應存有保證金 — 日圓現存有總權益數 > 0

附註：

(1)[約當美元]為本公司公告除人民幣及日圓外之外幣合計值

(2) 各外幣應存有不足之款項金額：美元應存有不足之款項金額(約當美元) + 人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣)+日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)

(3) 美元應存有不足之款項金額(約當美元) = Max (美元應存有保證金—美元現存有總權益數(約當美元), 0)

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

(5) 日圓應存有不足之款項金額 = Max (日圓應存有保證金—日圓現存有總權益數, 0)

(6) 非台幣支應其他幣別應存有不足之款項金額：Min[各外幣應存有不足之款項

金額(約當美元),非台幣超額保證金(約當美元)]=Min[美元應存有不足之款項金額(約當美元) + 人民幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓) , 美元超額保證金(約當美元) + 人民幣超額保證金 / 參考匯率(美元兌人民幣) + 日圓超額保證金 / 參考匯率(美元兌日圓)]

(7)台幣應存有不足之款項金額 = Max (台幣應存有保證金－台幣現存有總權益數 , 0)

(8)日圓及美元支應「台幣、日圓及美元應存有不足」之款項金額：Min[台幣、日圓及美元應存有不足之款項金額(約當美元), 日圓及美元超額保證金(約當美元)]=Min[台幣應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌台幣) + 日圓應存有不足之款項金額/參考匯率(美元兌日圓)+美元應存有不足之款項金額(約當美元) , 日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓) + 美元超額保證金(約當美元)]

(9) 美元支應「台幣及人民幣應存有不足」之款項金額：Min[台幣及人民幣應存有不足之款項金額(約當美元),美元超額保證金(約當美元)] =Min[台幣應存有不足之款項金額/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(美元兌人民幣) ,美元超額保證金(約當美元)]

(10)人民幣及日圓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/參考匯率(美元兌人民幣)+日圓超額保證金/參考匯率(美元兌日圓) , 美元應追繳款項金額)

0814 交易人有價證券抵繳保證金明細查詢

4.2.8.27. 訊息代號：H27

訊息名稱：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢通知

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	14：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢
	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)	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)	欲查詢資料之期貨商代號，'9999999'以查詢所有期貨商之資料
	抵繳約定碼	X(1)	1-僅抵繳自身部位 2-同意抵繳他人部位 4-客保有價證券 9-全部
	交易人帳號起號	X(7)	若抵繳約定碼為1時，輸入交易人帳號
	交易人帳號迄號	X(7)	若抵繳約定碼為2、4時，輸入空白

格式說明：

1. 期貨商(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。
3. 抵繳約定碼：1-僅抵繳自身部位，交易人帳號起號：0000000，交易人帳號訖

號：9999999 得查全部交易人餘額；抵繳約定碼：2-同意抵繳他人部位，交易人帳號起號：' '，交易人帳號訖號：' ' 得查全部抵繳期貨商；抵繳約定碼：4-客保有價證券，交易人帳號起號：' '，交易人帳號訖號：' ' 得全部客保有價證券資料；抵繳約定碼：9 - 全部，交易人帳號起號：' '，交易人帳號訖號：9999999 得查全部資料。

4.2.8.28. 訊息代號：H28

訊息名稱：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢回覆

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)	8：標的證券抵繳保證金作業
	作業項目	9(2)	14：交易人有價證券抵繳保證金明細查詢
	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)	回覆資料之時間
	結帳記號	9(1)	0：部位未結帳 1：部位已結帳 4：款項已結帳
	結算會員代號	X(4)	回覆資料之結算會員代號
訊息資料	資料群組代號		9(2) 01：交易人標的證券抵繳金額明細資料
	01 資料	結算會員代號	X(7)
	期貨商代號	X(7)	1. 期貨商代號：非空白

欄位		屬性	欄位說明
區	群組內容		交易人帳號：非空白 表示抵繳至個人部位。 (一段式抵繳) 2. 期貨商代號：空白 交易人帳號：空白 表示為同意抵繳至結算會員部位。 (二段式抵繳) 3. 期貨商代號：非空白 交易人帳號：空白 表示為同意抵繳至期貨商部位。 (客保有價證券抵繳)
	交易人帳號	X(7)	
	幣別	X(1)	1：台幣 2：美金 8：人民幣 4：日圓
	應收保證金	9(13) V99	
	有價證券評價價值(約當台幣)	9(13) V99	幣別為 2 時此值為 0
	有價證券抵繳金額	9(13) V99	
	未抵繳剩餘有價證券價值(約當台幣)	9(13) V99	

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 H27 訊息所得之要求代碼(Request ID)應為相同。

0707 境外外資交易新台幣商品應有保證金

4.2.7.12. 訊息代號：G12

訊息名稱：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢通知

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)	07：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢
	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)	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)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號迄號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號終迄號碼

格式說明：

1. 期貨商(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。
3. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4.2.7.13. 訊息代號：G13

訊息名稱：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢回覆

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)	07：境外外資交易新台幣商品應有保證金查詢
	來源單位代號		X(7)	期交所單位代號 ‘0001000’
	目地單位代號		X(7)	期貨商代號
	訊息時間		9(6)	回覆資料之時間
	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：境外外資交易新台幣商品應有保證金
	01 資料群組內容	結算會員代號	X(7)	為多筆之應用資料內容
		期貨商代號	X(7)	
		交易人帳號	X(7)	
		交易人身分碼	X(1)	
		台幣商品應有保證金	9(12) v99	

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 G12

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：境外外資交易新台幣商品應有保證金資料)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)。

0720 境外外資交易原幣別商品應有保證金(多幣別)

4.2.7.36. 訊息代號：G37

訊息名稱：境外外資交易原幣別商品應有保證金查詢通知

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)	20：境外外資交易原幣別商品應有保證金查詢
	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)	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)	欲查詢資料之期貨商代號
	交易人帳號起號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號起始號碼
	交易人帳號迄號	X(7)	欲查詢資料之交易人帳號終迄號碼

格式說明：

1. 期貨商(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。
3. 來源單位代號須為期貨商代號，且總公司可查詢其分公司或下手交易人之資料。

4. 2. 7. 38. 訊息代號：G38

訊息名稱：境外外資交易原幣別商品應有保證金查詢回覆

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)	20：境外外資交易原幣別商品應有保證金查詢
	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)	回覆資料之時間
	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：境外外資交易原幣別商品應有保證金
	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)
		交易人身分碼	X(1)
		幣別	X(1) 1：台幣 4：日圓
		原幣商品應有保證金	9(12) v99

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 G37

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：境外外資交易多幣別商品應有保證金資料)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)。