

105年度下半年推行商品 交易資訊作業規劃



臺灣期貨交易所資訊規劃部
2016年07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)

項目	印度50期貨 (N5F)	歐元兌美元 匯率期貨草案 (XEF)	美元兌日圓 匯率期貨草案 (XJF)
交易時間(一般)	8:45- <u>18:15</u>	8:45-16:15	8:45-16:15
交易時間(到期)	8:45- <u>18:00</u>	8:45- <u>14:00</u>	8:45- <u>14:00</u>
到期月份	2個近月 3個季月	<u>4個季月</u>	<u>4個季月</u>
契約乘數	50	20000	20000
最小升降單位	指數1點 (新 <u>台幣</u> 50元)	0.0001 <u>美元</u> /歐元	<u>0.01</u> <u>日圓</u> /美元

契約規格與現有商品差異(二)

項目	印度50期貨 (N5F)	歐元兌美元 匯率期貨草案 (XEF)	美元兌日圓 匯率期貨草案 (XJF)
每日漲跌幅	前1交易日 結算價± <u>10%</u> 、 <u>15%</u> 、 <u>20%</u>	前1交易日 結算價±7%	前1交易日 結算價±7%
最後交易日	<u>最後1個星期4</u>	第3個星期3	第3個星期3
最後結算日	<u>最後交易日之 次1營業日</u>	同最後交易日	同最後交易日
最後結算價	印度指數編製 公司計算之 Nifty50股價指 數收盤價	WM/Reuters台 北時間14:00歐 元兌美元即期 匯率中價	WM/Reuters台 北時間14:00美 元兌日圓即期 匯率中價

基本資料檔案傳輸(一) - 收盤時間 / 流程群組

項目	印度50期貨	歐元及日圓匯率期貨草案
交易時間(一般)	8:45- <u>18:15</u>	8:45-16:15
交易時間(到期)	8:45- <u>18:00</u>	8:45- <u>14:00</u>

■ 收盤時間群組

群組代碼	1	5	(新增)7
收盤時間	13:45	16:15	18:15

■ 流程群組

群組代碼	1	2	3	4	5	6	(新增)7	(新增)8	(新增)9
開盤時間	08:45	08:45	08:45	08:45	08:45	08:00	08:45	08:45	08:45
收盤時間	13:45	12:00	13:30	11:00	16:15	16:15	18:15	18:00	14:00

基本資料檔案傳輸(二) - 最後交易日、最後結算日

印度50期貨	最後1個 星期二	最後1個 星期三	最後1個 星期四	次1個 營業日	次2個 營業日
1) 最後1個星期四為本國與印度營業日			LTD IDX	FSD	
2) 最後1個星期四遇本國假日		LTD IDX		FSD	
3) 最後1個星期四遇本國假日，最後1個星期三遇印度假日	LTD IDX	FSD			
4) 最後交易日遇不可抗力因素休市				LTD IDX	FSD

LTD：最後交易日、FSD：最後結算日、IDX：Nifty 50指數收盤價

基本資料檔案傳輸(三) - TMP電文舉例

■ P09(契約基本資料檔)

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	N5F	XEF	XJF
2	契約名稱	印度50期貨	歐元兌美元匯率期貨	美元兌日圓匯率期貨
4	契約類別 (I:指數, C:商品, S:股票, E:匯率)	I	E	E
5	契約乘數 9(7)V9(4)	0000050 <u>0000</u>	0020000 <u>0000</u>	0020000 <u>0000</u>
7	幣別(1:台幣, 2:美元, 4:日幣)	1	<u>2</u>	<u>4</u>
9	委託價格小數位數	0	4	<u>2</u>
15	商品收盤時間群組 (5-16:15, <u>7-18:15</u>)	<u>7</u>	5	5

基本資料檔案傳輸(四) - TMP電文舉例

■ P08(商品與時間流程群組定義檔)

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	N5FG6	XEFH6	XJFH6
2	交割年月	201607	201608	201608
6	最後交易日	20160728	20160817	20160817
7	第一漲停價	000009308	00001 <u>1935</u>	0000108 <u>87</u>
8	第一跌停價	000007616	00001 <u>0375</u>	0000094 <u>63</u>
9	權利金(開盤參考價)	000008462	00001 <u>1155</u>	0000101 <u>75</u>
10	第二漲停價	000009731	000000000	000000000
11	第二跌停價	000007193	000000000	000000000
12	第三漲停價	000010154	000000000	000000000
13	第三跌停價	000006770	000000000	000000000

基本資料檔案傳輸(五) - TMP電文舉例

■ P08(商品與時間流程群組定義檔)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3
14	契約類別 (I:指數, C:商品, S:股票, E:匯率)	I	E	E
16	委託價格小數位數	0	4	<u>2</u>
18	流程群組(5-16:15, <u>7-18:15</u> , <u>8-18:00</u>)	<u>8</u> (假設本日為 20160728)	5	5
19	最後結算日	<u>20160729</u>	20160817	20160817

基本資料檔案傳輸(六) - TMP電文舉例

■ C01(匯率檔)

編號	欄位名稱	資料舉例1	資料舉例2	資料舉例3
1	換匯前幣別(1:台幣， 2:美元，4:日幣)	2	4	<u>4</u>
2	時間(YYYYMMDD)	20160715	20160715	20160715
3	時間(HHMMSS)	093000	093000	093000
4	匯率 9(4)V9(6)	0032 <u>160000</u>	00000 <u>09510</u>	0000 <u>305900</u>
5	換匯後幣別	1	2	<u>1</u>

交易資訊作業 - 一般交易日(一)

時間	現行檔案傳輸
13:45	■ <u>13:45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(每日結算價檔， <u>目前已收盤商品</u> ，多次傳送)
約14:30	■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>)
結算系統	■ <u>13:45收盤商品</u> 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>)
	■ B10(鉅額成交量統計檔， <u>目前已收盤商品</u>)
約15:00	■ I14(契約調整預告檔) 、I20(契約調整參考檔)
	■ I16(有價證券抵繳價格檔)

交易資訊作業 - 一般交易日(二)

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"> ■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)
	<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"> ■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)
	<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"> ■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)
	<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"> ■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)
	<ul style="list-style-type: none"> ■ C11(每日結算價檔，<u>目前已收盤商品</u>，多次傳送) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)

交易資訊作業 - 一般交易日(三)

時間	現行檔案傳輸	增加商品
約16:40	■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>)	■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)
結算系統	■ <u>16:15收盤商品</u> 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>)	■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) 美元兌日圓匯率期貨(XJF)
	■ B10(鉅額成交量統計檔， <u>目前已收盤商品</u>)	■ 依實際公告鉅額交易商品 為準
約17:00	■ I15(有價證券抵繳-證券 基本資料檔)	-
	■ I17(有價證券抵繳-債券 基本資料檔)	-

交易資訊作業 - 一般交易日(四)

時間	增加檔案傳輸	增加商品
18:15	■ <u>18:15收盤商品收盤</u>	■ 印度50期貨(N5F)
	■ <u>P14(契約風險保證金檔， 目前已收盤商品)</u>	■ 印度50期貨(N5F)
	■ <u>C10(第1次行情單檔， 目前已收盤商品)</u>	■ 印度50期貨(N5F)
	■ <u>C20(複式商品行情單檔， 目前已收盤商品)</u>	■ 印度50期貨(N5F)
	■ <u>C11(每日結算價檔， 目前已收盤商品)</u>	■ 印度50期貨(N5F)

交易資訊作業 - 一般交易日(五)

時間	增加檔案傳輸	增加商品
約18:30	■ C10(第2次行情單檔， <u>目前已收盤商品</u>)	■ 印度50期貨(N5F)
結算 系統	■ <u>18:15收盤商品</u> 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>)	■ 印度50期貨(N5F)
	■ B10(鉅額成交量統計檔， <u>目前已收盤商品</u>)	■ 依實際公告鉅額交易商品 為準
申報 系統	■ 期貨商ANC、交易人權益 數等申報截止時點19:30； 新增規定詳附件3-5	-

交易資訊作業 - 最後結算日(一)

■ 股價指數、股票及匯率期貨(到期月份第3個星期3)

時間	現行(增加)檔案傳輸	增加商品
11:30	■ T90(最後結算價參考檔，人民幣匯率)	
13:50	■ T90(最後結算價參考檔，人民幣匯率、股價指數及股票)	
14:30	■ T90(最後結算價參考檔，人民幣、歐元及日圓匯率、股價指數及股票)	■ 歐元兌美元匯率期貨(XEF) ■ 美元兌日圓匯率期貨(XJF)

■ 印度50期貨(到期月份最後1個星期4之次1營業日)

時間	增加檔案傳輸	增加商品
08:30	■ T90(最後結算價參考檔)	■ 印度50期貨(N5F)

交易資訊作業 - 最後結算日(二)

■ T90(最後結算價參考檔)資料舉例

假設1：上午11:22送出人民幣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	資料舉例4
1	商品代號	RHF	RTF		
2	最後結算價	000066073	000066072		
3	到期年月	201607	201607		

假設2：下午13:38送出股價指數期貨、股票期貨最後結算價，包含上午送出之人民幣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	資料舉例4	
1	商品代號	RHF	RTF	TXF	CAF	...
2	最後結算價	000066073	000066072	000899400	000006816	...
3	到期年月	201607	201607	201607	201607	...

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3：下午14:30送出歐元及日圓匯率期貨最後結算價，包含前次送出之股價指數期貨、股票期貨及人民幣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	資料舉例4
1	商品代號	RHF	RTF	...	XEF	XJF
2	最後結算價	00006 <u>6073</u>	00006 <u>6072</u>	...	00001 <u>1155</u>	0000101<u>75</u>
3	到期年月	201607	201607	...	201607	201607



臺灣期貨交易所

TAIWAN FUTURES EXCHANGE

敬請指教

www.taifex.com.tw