

應主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報格式說明

應主動揭露個別交易人之綜合帳戶部位申報，應申報下列二個檔(總帳戶、子帳戶)

(一) 綜合帳戶 總帳戶 部位申報檔，申報檔應包括下列三部份：

1. Header，共 144bytes，單筆

	FIELD NAME	FORMAT	Validation	Example
HEADER	檔案代號	X(5)		UAPR1
	部位申報人類別	X(1)	外國期貨商：A 國內代理人：B 國內期貨商：C	A or B or C
	綜合帳戶部位申報人 ID	X(10)	外國期貨商：ID 國內代理人、國內期貨商：統一編號 (左靠右補空白)	F00000001 or 12345678
	部位申報日期	9(8)	YYYYMMDD	20050101
	部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	20:10:00
	交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20050101
	國內期貨商代號	X(7)		
	綜合帳戶帳號	X(7)		
	綜合帳戶身份碼	X(1)	綜合帳戶：f	f
	持有綜合帳戶之外國期貨商 ID	X(10)	(左靠右補空白)	F00000001
	部位申報人連絡人	X(20)	(左靠右補空白)	王大明
	部位申報人連絡電話	X(20)	(左靠右補空白)	02-23695678#111
	Filler	X(<u>39</u>)	spaces	

2. Detail，共 144bytes，多筆

	FIELD NAME	FORMAT	CONTENTS	Example
Detail	商品代號	X(10)	(左靠右補空白)	TX006600U5
	昨日買進部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	昨日賣出部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交買進口數— <u>一般</u>	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交賣出口數— <u>一般</u>	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	<u>本日成交買進口數—盤後</u>	<u>9(8)</u>	<u>(右靠左補零)</u>	<u>00001000</u>
	<u>本日成交賣出口數—盤後</u>	<u>9(8)</u>	<u>(右靠左補零)</u>	<u>00001000</u>
	本日買進部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日賣出部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	平倉口數	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	Filler	X(62)	spaces	

3. Trailer, 共 144bytes, 單筆

FIELD NAME		FORMAT	Validation	Example
Trailer	Prefix	X(7)	BBBBBBB	BBBBBBB
	Detail 申報總筆數	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	Suffix	X(7)	EEEEEEE	EEEEEEE
	Filler	X(122)	spaces	

(二) 綜合帳戶 子帳戶 部位申報檔, 申報檔應包括下列三部份:

1. Header, 共 144bytes, 單筆

FIELD NAME		FORMAT	Validation	Example
HEADER	檔案代號	X(5)		UAPR2
	部位申報日期	9(8)	YYYYMMDD	20050101
	部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	20:10:00
	交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20050101
	國內期貨商代號	X(7)		
	綜合帳戶帳號	X(7)		
	Filler	X(101)	spaces	

2. Detail, 共 144bytes, 多筆

FIELD NAME		FORMAT	CONTENTS	Example
Detail	綜合帳戶個別交易人帳號	X(15)	(左靠右補空白)	
	綜合帳戶個別交易人身份碼	X(1)	境外外國法人: A 境外外國自然人: J	A 或 J
	綜合帳戶個別交易人 ID	X(10)	(左靠右補空白)	F00000001
	商品代號	X(10)	(左靠右補空白)	TX006600U5
	昨日買進部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	昨日賣出部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交買進口數— <u>一般</u>	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交賣出口數— <u>一般</u>	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	<u>本日成交買進口數—盤後</u>	<u>9(8)</u>	<u>(右靠左補零)</u>	<u>00001000</u>
	<u>本日成交賣出口數—盤後</u>	<u>9(8)</u>	<u>(右靠左補零)</u>	<u>00001000</u>
	本日買進部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日賣出部位餘額	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	平倉口數	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日買進部位餘額參與到期結算口數	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日賣出部位餘額參與到期結算口數	9(8)	(右靠左補零)	00001000

FIELD NAME	FORMAT	CONTENTS	Example
當日損益	S9(8)V99	10 位數字，右靠左補零(含小數點以下 2 位，小數點不占位數)，加上正負號 1 位(第 1 個位數)，共 11 位數	收益 100 元表示如下： +0000010000
Filler	X(9)	spaces	

註 1：週、月到期契約到期日之次一營業日申報時，到期契約之「本日買進部位餘額參與到期結算口數」及「本日賣出部位餘額參與到期結算口數」欄位，應申報當日一般交易時段收盤後參與結算之部位數。

註 2：當日到期契約申報「當日損益」，須含當日一般交易時段及前 1 日盤後交易時段之損益，且係依各契約之計價幣別申報。

註 3：有關到期契約於最後結算日申報當日損益之計算方式詳附錄 1。

3. Trailer，共 144bytes，單筆

FIELD NAME	FORMAT	Validation	Example
Prefix	X(7)	BBBBBBB	BBBBBBB
Detail 申報總筆數	9(8)	(右靠左補零)	00001000
Suffix	X(7)	EEEEEEE	EEEEEEE
Filler	X(122)	spaces	

時機：該帳戶部位申報人應針對東證期貨部位相關資料於營業日收盤結帳後至次一營業日上午 7 時 30 分前完成申報；另非屬東證期貨(含盤後時段交易)相關資料申報截止時間維持於次一營業日上午 8 時 15 分前完成申報。惟本公司另有要求時，應於本公司指定期限內申報。

注意事項：

1. 媒體申報系統接收每筆部位申報資料後，於線上執行檢核，若檢核後發現資料不完整或有錯誤，將回應錯誤訊息並要求重新申報。綜合帳戶部位申報人應俟期交所媒體申報系統線上回覆確認後，始表示完成當日之部位申報作業。
2. 「應主動揭露個別交易人之綜合帳戶」部位申報作業線上自動檢核項目包括以下 3 項：
 - (1) 申報總部位是否與當日結帳資料相符？
 - (2) 申報明細部位加總是否與總部位相符？
 - (3) 申報個別交易人 ID 是否有效？

附錄 1 到期契約於最後結算日申報當日損益之計算說明

壹、股價指數期貨契約與股票期貨契約

到期月份損益 = Σ 到期月份成交損益 + Σ 到期月份部位損益

一、股價指數期貨契約

到期月份成交損益

$$= \Sigma \{(\text{最後結算價} - \text{當日成交價格}) \times \text{契約乘數} \times \text{成交口數}\}$$

到期月份部位損益

$$= \Sigma \{(\text{最後結算價} - \text{前一日結算價}) \times \text{契約乘數} \times \text{前一日未沖銷部位數}\}$$

※成交口數：買進之成交口數為正值，賣出之成交口數為負值。

※前一日未沖銷部位數：多方未沖銷部位為正值，空方未沖銷部位為負值。

二、股票期貨契約

$$\text{到期月份成交損益} = \Sigma \{[\text{最後結算價計算之約定標的物價值} - (\text{當日成交價格} \times \text{當日契約乘數})] \times \text{成交口數}\}$$

$$\text{到期月份部位損益} = \Sigma \{[\text{最後結算價計算之約定標的物價值} - \text{前一日結算價計算之約定標的物價值}] \times \text{前一日未沖銷部位數}\}$$

※成交口數：買進之成交口數為正值，賣出之成交口數為負值。

※前一日未沖銷部位數：多方未沖銷部位為正值，空方未沖銷部位為負值。

※最後結算價計算之約定標的物價值由本公司交易系統公告。

※前一日結算價計算之約定標的物價值 = (前一日結算價格 \times 前一日契約乘數) - (當日股票期貨契約調整之現金股利)，元以下無條件捨去。

貳、股價指數選擇權契約與股票選擇權契約

一、股價指數選擇權契約

(一) 買權

$$\text{到期月份損益} = \Sigma \{[\text{MAX}(\text{最後結算價} - \text{履約價格}, 0)] \times \text{契約乘數} \times \text{參與到期口數}\}$$

(二) 賣權

到期月份損益 = $\sum \{[\text{MAX}(\text{履約價格} - \text{最後結算價}, 0)] \times \text{契約乘數} \times \text{參與到期口數}\}$

※參與到期口數：買方部位口數為正值，賣方部位口數為負值。

二、股票選擇權契約

(一) 買權

到期月份損益 = $\sum \{[\text{MAX}(\text{最後結算價計算之約定標的物價值} - \text{履約價款}, 0)] \times \text{參與到期口數}\}$

(二) 賣權

到期月份損益 = $\sum \{[\text{MAX}(\text{履約價款} - \text{最後結算價計算之約定標的物價值}, 0)] \times \text{參與到期口數}\}$

※履約價款 = 履約價格 × 履約價格乘數。

※參與到期口數：買方部位口數為正值，賣方部位口數為負值。

※最後結算價計算之約定標的物價值由本公司交易系統公告。

附錄二、綜合帳戶申報之商品編碼原則

一、期貨契約(F₁₂₃M₄Y₅)

商品編碼原則：3碼「期貨商品簡碼」+1碼「到期月」+1碼「到期年」，長度共五碼。例如TXF到期月份201701之期貨商品即為「TXFA7」。

(一)F₁₂₃為「期貨商品簡碼」，與期貨商品中文簡稱對照如下表

期貨商品中文簡稱	期貨商品簡碼(3碼文字)
臺股期貨	TXF
電子期貨	EXF
金融期貨	FXF
小型臺指期貨	MXF
週小型臺指期貨	MX1/MX2/MX4/MX5
臺灣50期貨	T5F
櫃買期貨	GTF
非金電期貨	XIF
東證期貨	TJF
印度50期貨	I5F
十年期公債期貨	GBF
黃金期貨	GDF
臺幣黃金期貨	TGF
小型美元兌人民幣期貨	RTF
美元兌人民幣期貨	RHF
歐元兌美元期貨	XEF
美元兌日圓期貨	XJF

註：未來新期貨商品上市，則以其商品簡稱作為簡碼

(二)M₄為「到期月」，其資料取「到期月份」之月份，與月份對照如下表，如11之「到期月」為K。

「到期月份」之月份	「到期月」(1碼文字)
01	A
02	B
03	C
04	D
05	E
06	F
07	G
08	H
09	I
10	J
11	K
12	L

(三)Y₅為「到期年」1碼數字，其資料取「到期月份」之年度最後1碼，如2017之「到期年」為7。

二、選擇權契約(O₁₂₃S₁₂₃₄₅M₄Y₅)

商品編碼原則：3碼「選擇權商品簡碼」+5碼「履約價格」+1碼「到期月」+1碼「到期年」，長度共十碼。例如 TXO 到期月份 201701 之 CALL 履約價 9200，編碼為「TXO09200A7」。

(一) O₁₂₃ 為「選擇權商品簡碼」，與選擇權商品中文簡稱對照如下表

選擇權商品中文簡稱	選擇權商品簡碼(3碼文字)
臺指選擇權	TXO
週臺指選擇權	TX1/TX2/TX4/TX5
電子選擇權	TEO
金融選擇權	TFO
櫃買選擇權	GTO
非金電選擇權	XIO
黃金選擇權	TGO
小型美元兌人民幣選擇權	RTO
美元兌人民幣選擇權	RHO

註：未來新選擇權商品上市，則以其商品簡稱作為簡碼

(二) M₄ 為「到期月」，其資料取「到期月份」之月份，與月份對照如下表，如 11 之賣權「到期月」為 W。

「到期月份」之月份	「到期月」(1碼文字)	
	買權	賣權
01	A	M
02	B	N
03	C	O
04	D	P
05	E	Q
06	F	R
07	G	S
08	H	T
09	I	U
10	J	V
11	K	W
12	L	X

(三) Y₅ 為「到期年」1碼數字，其資料取「到期月份」之年度最後 1 碼，如 2017 之「到期年」為 7。