

免主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報格式說明

免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

| | 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|--------|-----------------|-------|--|-----------------------------|-------|
| HEADER | 檔案代號 | X(5) | | UAPR3 | |
| | 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 | 20140418 | |
| | 部位申報時間 | X(8) | HH:MM:SS | 20:10:00 | |
| | 交易日期 | 9(8) | YYYYMMDD | 20140417 | |
| | 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 | 固定填 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(39) | spaces | | |

註：所有欄位皆必填

2.Detail，共 144bytes，多筆

| | 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|--------|---------------------|-------------|----------------|---------------------------|----|
| Detail | 商品代號 | X(10) | (左靠右補空白) | TJFC6 or TXO06600U5 | |
| | 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 | |

| 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|--------|-------|--------|----|----|
| Filler | X(62) | spaces | | |

註：所有欄位皆必填

3.Trailer，共 144bytes，單筆

| 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|---------|--------------|--------|---------|----------|
| 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 | |

註：所有欄位皆必填。

(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

| 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|--------|---------|--------|----------|----------|
| HEADER | 檔案代號 | X(5) | | UAPR4 |
| | 部位申報日期 | 9(8) | YYYYMMDD | 20140418 |
| | 部位申報時間 | X(8) | HH:MM:SS | 20:10:00 |
| | 交易日期 | 9(8) | YYYYMMDD | 20140417 |
| | 國內期貨商代號 | X(7) | | |
| | 綜合帳戶帳號 | X(7) | | |
| | Filler | X(101) | spaces | |

註：所有欄位皆必填。

2.Detail，共 144bytes，多筆

| 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 | |
|--------|--------------|-------|-----------------------|-------|---|
| Detail | 綜合帳戶個別交易人帳號 | X(15) | (左靠右補空白) | A0001 | 個別交易人於該期貨商開戶之帳號，子帳基本資料申報檔之「綜合帳戶個別交易人帳號」 |
| | 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 | |

| 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|---------------------|-------------|---|----------------------------------|-----------------------------|
| 綜合帳戶個別交易人 ID | X(10) | (左靠右補空白) | F00000002 | 若該個別交易人已辦理 ID 登記，為必填，否則填充空白 |
| 商品代號 | X(10) | (左靠右補空白) | TJFC6 or TXO06600U 5 | |
| 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 | |
| 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(12) | spaces | | |

註 1：非參與到期結算契約除「綜合帳戶個別交易人 ID」及「當日損益」外，所有欄位皆必填；參與到期結算契約除「綜合帳戶個別交易人 ID」外，所有欄位皆必填。

註 2：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，應申報當日參與結算之部位數。

註 3：當日期到契約申報「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 4：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

| 欄位名稱 | 欄位型 | 欄位說明 | 範例 | 備註 |
|---------|--------------|-----------------|---------|----------|
| 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(<u>122</u>) | spaces | |

註：所有欄位皆必填。

時機：該綜合帳戶部位申報人應於本公司要求期限內，申報總帳戶及子帳戶部位明細資料。

注意事項：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。

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

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

※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

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

(二) 賣權

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

※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。