

# 綜合帳戶申報制度調整說明



中華民國 113 年 1 月

# 目錄

壹、制度調整說明.....	3
貳、綜合帳戶申報制度.....	3
一、應主動揭露個別交易人之綜合帳戶(身分碼 f).....	3
二、免主動揭露個別交易人之綜合帳戶(身分碼 F).....	4
參、應主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報格式說明 .....	5
一、標準規格契約部位申報格式 .....	5
二、客製化契約部位申報格式 .....	8
三、綜合帳戶子帳基本資料申報格式 .....	12
四、申報期限及申報方式 .....	13
肆、免主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報格式說明 .....	14
一、標準規格契約部位申報格式 .....	14
二、客製化契約部位申報格式 .....	18
三、綜合帳戶子帳基本資料申報格式 .....	23
四、申報期限及申報方式 .....	26
附錄 1：到期契約最後結算日之次一營業日申報當日損益之計算說明 ...	27
附錄 2：綜合帳戶申報標準規格契約之商品代號編碼原則 .....	29
附錄 3：綜合帳戶申報客製化契約之商品代號編碼原則 .....	32

## 壹、制度調整說明

配合本公司建置客製化契約(FLEX)平臺，調整綜合帳戶申報相關制度，申報項目除現行標準規格契約資訊外，另新增客製化契約應申報資訊，申報期限仍維持於次一營業日上午 7 時 30 分前完成東證期貨相關部位資料申報，上午 8 時 15 分前完成非屬東證期貨相關部位資料(含盤後時段交易)申報，惟本公司另有要求時，應於本公司指定期限內申報。

標準規格契約申報作業(申報時間、內容及格式)維持現行作法，本次新增客製化契約申報項目，採獨立檔案申報方式，不影響現行標準規格契約申報作業，相關說明如后。

## 貳、綜合帳戶申報制度

### 一、應主動揭露個別交易人之綜合帳戶(身分證 f)

	標準規格契約 部位申報	客製化契約 部位申報	綜合帳戶子帳基本資料 申報
申報標準	應每日申報部位明細資料		該帳戶下標準規格契約及客製化契約之個別交易人異動或資料內容變更時
申報期限	<u>東證期貨</u> ：營業日收盤結帳後至次一營業日上午 7 時 30 分前 <u>非屬東證期貨(含盤後時段交易)</u> ：次一營業日上午 8 時 15 分前 惟本公司另有要求時，應於本公司指定期限內申報。		應於異動當日至次一營業日上午 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。
申報內容	1. 總帳戶部位申報檔 2. 子帳戶部位申報檔	1. 總帳戶部位申報檔 2. 子帳戶部位申報檔	應主動揭露個別交易人之綜合帳戶子帳基本資料申報檔
申報方式	期貨商管理系統或 SFTP		

## 二、免主動揭露個別交易人之綜合帳戶(身分碼 F)

	標準規格契約 部位申報	客製化契約 部位申報	綜合帳戶子帳基本資料 申報
申報標準	該帳戶逾越各契約交易規則部位限制或本公司認為必要時，依本公司要求申報。		該帳戶下標準規格契約及客製化契約之個別交易人異動或資料內容變更時
申報期限	依本公司指定期限內完成申報		應於異動當日至次一營業日上午 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。
申報內容	1. 總帳戶部位申報檔 2. 子帳戶部位申報檔	1. 總帳戶部位申報檔 2. 子帳戶部位申報檔	免主動揭露個別交易人之綜合帳戶子帳基本資料申報檔
申報方式	期貨商管理系統		

## 參、應主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報格式說明

### 一、標準規格契約部位申報格式

應主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報標準規格契約部位，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		格式	說明	範例
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	20230202
	部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00
	交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201
	國內期貨商代號	X(7)		
	綜合帳戶帳號	X(7)		
	綜合帳戶身分證	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(39)	spaces	

#### 2. Detail，共 144bytes，多筆

欄位名稱		格式	說明	範例
Detail	商品代號	X(10)	(左靠右補空白)	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—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交賣出口數—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交買進口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000

欄位名稱		格式	說明	範例
	本日成交賣出口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	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	

註：有關商品代號編碼原則詳附錄 2。

### 3. Trailer，共 144bytes，單筆

欄位名稱		格式	說明	範例
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

欄位名稱		格式	說明	範例
Header	檔案代號	X(5)		UAPR2
	部位申報日期	9(8)	YYYYMMDD	20230202
	部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00
	交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201
	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

欄位名稱		格式	說明	範例
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分碼	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)	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—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交賣出口數—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000

欄位名稱		格式	說明	範例
	本日成交買進口數一盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	本日成交賣出口數一盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
	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(9)	spaces		

註 1：有關商品代號編碼原則詳附錄 2。

註 2：各到期契約最後結算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，應申報最後交易日一般交易時段收盤後參與結算之部位數。

註 3：各到期契約最後結算日之次一營業日申報時，到期契約之「當日損益」申報須含最後交易日一般交易時段及最後交易日前一盤後交易時段(即交易歸屬日為最後交易日之交易時段)之損益，且係依各契約之計價幣別申報。例如 2023/3/16 上午 8:15 前申報 TXF 到期契約之「當日損益」，須含 3/14 盤後交易時段(15:00~5:00)及 3/15 一般交易時段(8:45~13:30)之損益。

註 4：有關到期契約最後結算日之次一營業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		格式	說明	範例
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、客製化契約部位申報格式

應主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報客製化契約部位，  
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 154bytes，單筆

欄位名稱	格式	說明	範例
檔案代號	X(5)		UAPR <u>5</u>
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	20230202
部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00
交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201
國內期貨商代號	X(7)		
綜合帳戶帳號	X(7)		
綜合帳戶身分碼	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(49)	spaces	

### 2. Detail，共 154bytes，多筆

欄位名稱	格式	說明	範例
商品代號	X(20)	(左靠右補空白)	<u>MXFFX230224</u> □□□□ □□□□□ or <u>TXOOX230224C15000</u> 00□ □表示空白
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—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000
本日成交賣出口數—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000



欄位名稱	格式	說明	範例
本日成交買進口數 —盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
本日成交賣出口數 —盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
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	

註：有關商品代號編碼原則詳附錄 3。

### 3. Trailer，共 154bytes，單筆

欄位名稱	格式	說明	範例
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(132)	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 154bytes，單筆

欄位名稱	格式	說明	範例
檔案代號	X(5)		UAPR <u>6</u>
部位申報日期	9(8)	YYYYMMDD	20230202
部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00
交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201
國內期貨商代號	X(7)		
綜合帳戶帳號	X(7)		
Filler	X(111)	spaces	

### 2. Detail，共 154bytes，多筆

欄位名稱	格式	說明	範例
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分碼	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

欄位名稱	格式	說明	範例
商品代號	X(20)	(左靠右補空白)	<u>MXFFX230224</u> □□□□ □□□□□ or <u>TXOOX230224C15000</u> 00□ □表示空白
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—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000
本日成交賣出口數—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000
本日成交買進口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
本日成交賣出口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000
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(9)	spaces	

註 1：有關商品代號編碼原則詳附錄 3。

註 2：各到期契約最後結算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，應申報最後交易日一般交易時段收盤後參與結算之部位數。

註 3：各到期契約最後結算日之次一營業日申報時，到期契約之「當日損益」申報須含最後交易日一般交易時段及最後交易日前一盤後交易時段(即交易歸屬

日為最後交易日之交易時段)之損益，且係依各契約之計價幣別申報。例如 2023/3/10 上午 8:15 前申報 MXFFX 到期契約之「當日損益」，須含 3/8 盤後交易時段(15:00~5:00)及 3/9 一般交易時段(8:45~13:30)之損益。(目前客製化契約尚未規劃盤後交易，惟先預留盤後交易口數之申報欄位及備註以因應未來需求)

註 4：有關到期契約最後結算日之次一營業日申報當日損益之計算方式詳附錄 1。

### 3. Trailer，共 154bytes，單筆

	欄位名稱	格式	說明	範例
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(132)	spaces	

### 三、綜合帳戶子帳基本資料申報格式

應主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報子帳基本資料，應包含交易**標準規格契約及客製化契約**之個別交易人名稱及 ID 等資訊，申報檔內容及格式如下：

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明
期貨商代號	1	7	Char (7)	7 位文字
期貨商帳號	8	14	Char (7)	7 位文字
綜合帳戶總帳 ID	15	24	Char (10)	10 位文字，不足 10 位右補空白
綜合帳戶總帳名稱	25	104	Char (80)	80 位文字，不足 80 位右補空白
綜合帳戶子帳 ID	105	114	Char (10)	10 位文字，不足 10 位右補空白
綜合帳戶子帳名稱	115	194	Char (80)	80 位文字，不足 80 位右補空白

#### 四、申報期限及申報方式

申報項目	商品別	申報期限	申報方式	
			期貨商管理系統	期貨商專屬目錄 SFTP 路徑：/期貨商代號4碼 /upload/OMNIBUS
部位申報	標準規格契約	東證期貨：營業日收盤結帳後至次一營業日上午7時30分前	08-04 當日部位申報資料上傳	<u>總帳戶部位申報檔：</u> <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_OAMF.txt <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_OAMF.txt.ready  <u>子帳戶部位申報檔：</u> <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_OASF.txt <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_OASF.txt.ready
	客製化契約	非屬東證期貨(含盤後時段交易)：次一營業日上午8時15分前		<u>總帳戶部位申報檔：</u> <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_FOAMF.txt <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_FOAMF.txt.ready  <u>子帳戶部位申報檔：</u> <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_FOASF.txt <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_FOASF.txt.ready
子帳基本資料申報	標準規格契約及客製化契約	<u>異動或資料內容變更時：</u> 應於異動當日至次一營業日上午8時15分前 <u>本公司另有要求時：</u> 應於本公司指定期限內	08-18-01 子帳ID申報作業	<期貨商代號7碼>_<交易日日期>_OAIF.txt <期貨商代號7碼>_<交易日日期>_OAIF.txt.ready

**注意事項：**期貨商管理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期貨商管理系統線上回覆確認後，始完成當日之部位申報作業。

## 肆、免主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報格式說明

### 一、標準規格契約部位申報格式

免主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報標準規格契約部位，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	格式	說明	範例	備註
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	20230202	
部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00	
交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201	
國內期貨商代號	X(7)			
綜合帳戶帳號	X(7)			
綜合帳戶身分碼	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#11 1	
Filler	X(39)	spaces		

註：所有欄位皆必填

2. Detail，共 144bytes，多筆

欄位名稱	格式	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—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
	本日成交賣出口數—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
	本日成交買進口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
	本日成交賣出口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
	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		

註 1：所有欄位皆必填。

註 2：有關商品代號編碼原則詳附錄 2。

3. Trailer，共 144bytes，單筆

欄位名稱	格式	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	格式	說明	範例	備註	
Header	檔案代號	X(5)		UAPR4	
	部位申報日期	9(8)	YYYYMMDD	20230202	
	部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00	
	交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201	
	國內期貨商代號	X(7)			
	綜合帳戶帳號	X(7)			

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
Filler	X(101)	spaces		

註：所有欄位皆必填。

## 2. Detail，共 144bytes，多筆

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
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 人身分碼	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)	F00000002	若該個別 交易人已 辦理 ID 登 記，為必 填，否則 填空白
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 —一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
本日成交 賣出口數 —一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
本日成交 買進口數 —盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
本日成交 賣出口數 —盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000	



欄位名稱	格式	說明	範例	備註
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(9)	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：有關商品代號編碼原則詳附錄 2。

註 3：各到期契約最後結算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，應申報最後交易日一般交易時段收盤後參與結算之部位數。

註 4：各到期契約最後結算日之次一營業日申報時，到期契約之「當日損益」申報須含最後交易日一般交易時段及最後交易日前一盤後交易時段(即交易歸屬日為最後交易日之交易時段)之損益，且係依各契約之計價幣別申報。例如 2023/3/16 上午 8:15 前申報 TXF 到期契約之「當日損益」，須含 3/14 盤後交易時段(15:00~5:00)及 3/15 一般交易時段(8:45~13:30)之損益。

註 5：有關到期契約最後結算日之次一營業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	格式	說明	範例	備註
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、客製化契約部位申報格式

免主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報客製化契約部位，  
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 154bytes，單筆

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
檔案代號	X(5)		UAPR7	
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	20230202	
部位申報 時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00	
交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201	
國內期貨 商代號	X(7)			
綜合帳戶 帳號	X(7)			
綜合帳戶 身分碼	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(49)	spaces		

註：所有欄位皆必填

2. Detail，共 154bytes，多筆

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
Detail	商品代號	X(20) (左靠右補空白)	MXFFX230224□ □□□□□□□□ or TXOOX230224C 150000□ □表示空白	
	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—一般	9(8) (右靠左補零)	00001000	
	本日成交賣出 口數—一般	9(8) (右靠左補零)	00001000	
	本日成交買進 口數—盤後	9(8) (右靠左補零)	00001000	
	本日成交賣出 口數—盤後	9(8) (右靠左補零)	00001000	
	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	

註 1：所有欄位皆必填。

註 2：有關商品代號編碼原則詳附錄 3。

3. Trailer，共 154bytes，單筆

欄位名稱	格式	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(132)	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 154bytes，單筆

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
Header	檔案代號	X(5)		UAPR8
	部位申報日期	9(8)	YYYYMMDD	20230202

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
部位申報時間	X(8)	HH:MM:SS	08:10:00	
交易日期	9(8)	YYYYMMDD	20230201	
國內期貨商代號	X(7)			
綜合帳戶帳號	X(7)			
Filler	X(111)	spaces		

註：所有欄位皆必填。

## 2. Detail，共 154bytes，多筆

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
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分碼	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)	F00000002	若該個別交易人已辦理 ID 登記，為必填，否則填空白
商品代號	X(20)	(左靠右補空白)	<u>MXFFX230224</u> <u>□□□□□□□□</u> or <u>TXOOX230224C</u> <u>1500000</u> <u>□表示空白</u>	
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—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
本日成交賣出口數—一般	9(8)	(右靠左補零)	00001000	

欄位名稱	格式	說明	範例	備註
本日成交買進口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
本日成交賣出口數—盤後	9(8)	(右靠左補零)	00001000	
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(9)	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：有關商品代號編碼原則詳附錄 3。

註 3：各到期契約最後結算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，應申報最後交易日一般交易時段收盤後參與結算之部位數。

註 4：各到期契約最後結算日之次一營業日申報時，到期契約之「當日損益」申報須含最後交易日一般交易時段及最後交易日前一盤後交易時段(即交易歸屬日為最後交易日之交易時段)之損益，且係依各契約之計價幣別申報。例如 2023/3/10 上午 8:15 前申報 MXFFX 到期契約之「當日損益」，須含 3/8 盤後交易時段(15:00~5:00)及 3/9 一般交易時段(8:45~13:30)之損益。(目前客製化契約尚未規劃盤後交易，惟先預留盤後交易口數之申報欄位及備註以因應未來需求)。

註 5：有關到期契約最後結算日之次一營業日申報當日損益之計算方式詳附錄 1。

3. Trailer，共 154bytes，單筆

	欄位名稱	格式	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(132)	spaces		

註：所有欄位皆必填。

### 三、綜合帳戶子帳基本資料申報格式

免主動揭露個別交易人之綜合帳戶申報子帳基本資料，應包含交易**標準規格契約及客製化契約**之個別交易人名稱等資訊，申報檔內容及格式如下：

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明	備註
期貨商代號	1	7	X(7)	7位文字	必填
期貨商帳號	8	14	X(7)	7位文字	必填
綜合帳戶總帳ID	15	24	X(10)	(左靠右補空白)	必填
綜合帳戶總帳名稱	25	104	X(80)	(左靠右補空白)	必填
綜合帳戶個別交易人ID	105	114	X(10)	(左靠右補空白)	該個別交易人已辦理ID登記者必填
綜合帳戶個別交易人帳號	115	129	X(15)	(左靠右補空白)	必填，個別交易人於該期貨商開戶之帳號，同子帳戶部位申報2.Detail之「綜合帳戶個別交易人帳號」
綜合帳戶個別交易人中文名稱	130	209	X(80)	(左靠右補空白)	必填，應填入該個別交易人完整開戶名稱
綜合帳戶個別交易人英文名稱	210	289	X(80)	(左靠右補空白)	必填，應填入該個別交易人完整開戶名稱
綜合帳戶個別交易人身分別	290	290	X(1)	境外外國法人：A 境外外國自然人：J	必填
綜合帳戶個別交易人成立/出生日期	291	298	9(8)	YYYYMMDD	必填
綜合帳戶個別交易人國別	299	299	X(1)	日本：1 美國：2 英國：3 其他歐洲國家：4(請敘明國名) 香港：5 澳門：6 紐西蘭：7	必填

欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明	備註
				澳洲：8 其他：9(請敘明國名)	
國名	300	379	X(80)	(左靠右補空白)	綜合帳戶個別交易人國別填「4」或「9」者必填
綜合帳戶個別交易人型態	380	380	X(1)	基金：1 非基金：2	綜合帳戶個別交易人身分別填「A」者必填
綜合帳戶個別交易人類別	381	382	X(2)	<u>境外外國法人如為基金</u> 公司型基金：01 信託型基金：02 合夥型基金：03 退休型基金：04 共同基金：05 單位信託：06 其他型基金：49 <u>境外外國法人如非基金</u> 銀行：51 保險公司：52 證券商或期貨商：53 上市(櫃)及興櫃公司海外子公司或分公司或第一上市(櫃)及興櫃之外國公司員工集合專戶：54 第一或第二上市(櫃)外國公司：55(請敘明上市(櫃)證券代號及扣繳單位統一編號) 其他：99	綜合帳戶個別交易人身分別填「A」者必填
上市(櫃)證券代號	383	386	X(4)		綜合帳戶個別交易人類別填「55」(第一



欄位名稱	起	迄	欄位型態	欄位說明	備註
					或第二上市 (櫃)外國公司) 必填
扣繳單位統一編號	387	394	X(8)		綜合帳戶個別 交易人類別填 「55」(第一 或第二上市 (櫃)外國公司) 必填
綜合帳戶個別交易人 目的	395	395	X(1)	投資：1 避險：2	綜合帳戶個別 交易人型態填 「1」必填

#### 四、申報期限及申報方式

申報項目	商品別	申報期限	申報方式
			期貨商管理系統
部位申報	標準規格契約	本公司指定期限內完成申報	08-19-01 部位申報資料上傳
	客製化契約		
子帳基本資料申報	標準規格契約 及 客製化契約	<u>異動或資料內容變更時：</u> 應於異動當日至次一營業日上午8時15分前  <u>本公司另有要求時：</u> 應於本公司指定期限內	08-19-03 子帳基本資料申報

**注意事項：**期貨商管理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期貨商管理系統線上回覆確認後，始完成當日之部位申報作業。

## 附錄 1：到期契約最後結算日之次一營業日申報當日損益之計算說明

### 一、股價指數期貨契約與股票期貨契約

到期契約損益 =  $\Sigma$  到期契約成交損益 +  $\Sigma$  到期契約部位損益

#### (一) 股價指數期貨契約

到期契約成交損益

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

到期契約部位損益

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

※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

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

到期契約部位損益 =  $\Sigma \{ (\text{最後結算價計算之約定標的物價值} - \text{前一日結算價計算之約定標的物價值}) \times \text{前一日未沖銷部位數} \}$

※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。

### 二、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

##### 1. 買權

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

## 2. 賣權

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

※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

### 1. 買權

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

### 2. 賣權

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

※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 2：綜合帳戶申報標準規格契約之商品代號編碼原則

### 一、期貨契約((F<sub>123</sub>M<sub>4</sub>Y<sub>5</sub>))

商品代號編碼原則：3 碼「期貨商品簡碼」+1 碼「到期月」+1 碼「到期年」，長度共 5 碼。例如 TXF 到期月份 202302 之商品代號即為「TXFB3」。

(一) F<sub>123</sub> 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
小型電子期貨	ZEF
金融期貨	FXF
小型金融期貨	ZFF
小型臺指期貨	MXF
週小型臺指期貨	MX1/MX2/MX4/MX5
櫃買期貨	GTF
富櫃 200 期貨	G2F
臺灣永續期貨	E4F
臺灣生技期貨	BTF
半導體 30 期貨	SOF
航運期貨	SHF
非金電期貨	XIF
東證期貨	TJF
美國道瓊期貨	UDF
美國標普 500 期貨	SPF
美國那斯達克 100 期貨	UNF
美國費城半導體期貨	SXF
英國富時 100 期貨	F1F
黃金期貨	GDF
臺幣黃金期貨	TGF
布蘭特原油期貨	BRF
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
英鎊兌美元期貨	XBF
澳幣兌美元期貨	XAF

註：未來新期貨商品上市，則以其商品簡稱作為簡碼

(二) M<sub>4</sub> 為「到期月」，其資料取「到期月份」之月份，與月份對照如下表，如 2 之「到期月」為 B。

「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) Y<sub>5</sub> 為「到期年」1 碼數字，其資料取「到期月份」之年度最後 1 碼，如 2023 之「到期年」為 3。

## 二、選擇權契約(O<sub>123</sub>S<sub>45678</sub>M<sub>9</sub>Y<sub>10</sub>)

商品代號編碼原則：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 10 碼。例如 TXO 到期月份 202302 之 PUT 履約價 15,000，商品代號為「TXO15000N3」。

(一) O<sub>123</sub> 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
黃金選擇權	TGO

註：未來新選擇權商品上市，則以其商品簡稱作為簡碼

(二) M<sub>9</sub> 為「到期月」，其資料取「到期月份」之月份，與月份對照如下表，如 2 之賣權「到期月」為 N。

「到期月份」之月份	「到期月」(1 碼文字)	
	買權	賣權
01	A	M
02	B	N

「到期月份」之月份	「到期月」(1碼文字)	
	買權	賣權
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)Y<sub>10</sub> 為「到期年」1碼數字，其資料取「到期月份」之年度最後1碼，  
如 2023 之「到期年」為 3。

### 附錄 3：綜合帳戶申報客製化契約之商品代號編碼原則

商品代號編碼原則：3 碼「契約代碼」+1 碼「契約版號」+1 碼「契約型別」+6 碼「交割日」+1 碼「買賣權別」+7 碼「履約價格」+1 碼「保留欄位」，長度共 20 碼。例如 MXFFX 交割日 20230224 之商品代號為「MXFFX230224□□□□□□□□」；TXOOX 交割日 20230224、履約價 15,000 之買權之商品代號為「TXOOX230224C1500000□」，□表示空白。

商品代號組成項目格式說明如下：

項目	格式	說明
契約代碼	X(3)	(左靠右補空白)
契約版號	X(1)	期貨：F 選擇權：O 股票期貨調整型：1,2... 股票選擇權調整型： A,B...
契約型別	X(1)	客製歐式現金交割：X
交割日	X(6)	yymmdd
買賣權別	X(1)	期貨：空白 買權：C 賣權：P
履約價格	X(7)	預設 2 位小數 (右靠左補 0)
保留欄位	X(1)	空白