

台灣經濟新報文化事業(股)公司

期貨市場當日交易明細資料  
(INTRA\_DAY DATA)  
格式說明

台北市東興路 57 號 11 樓  
電話:02-87681088

## 期貨分時資料庫 欄位說明

## 目前使用格式：

## 1. 開盤前基本資訊(TF1)——參考價、漲跌幅漲跌幅訊息

(1)檔名：fYYYYMMDD\_010.ftm，96/10/08 以後適用 **關漏：f20100712\_010ftm、f20100803\_010.ftm**

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|-----|-----------|---------|-------|-----|-----------------|
| #1  | 商品代碼      | OP_ID   | A20   |     |                 |
| #2  | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |     |                 |
| #3  | 資料時間      | TIME1   | I8    |     | 00：00：0000(時分秒) |
| #4  | 第一漲停價     | HLMT_P1 | D15.4 | 元/點 |                 |
| #5  | 第一跌停價     | LLMT_P1 | D15.4 | 元/點 |                 |
| #6  | 第二漲停價     | HLMT_P2 | D15.4 | 元/點 |                 |
| #7  | 第二跌停價     | LLMT_P2 | D15.4 | 元/點 |                 |
| #8  | 第三漲停價     | HLMT_P3 | D15.4 | 元/點 |                 |
| #9  | 第三跌停價     | LLMT_P3 | D15.4 | 元/點 |                 |
| #10 | 參考價       | REF_P   | D15.4 | 元/點 |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDD1.ftm，93/10/01~96/10/07 適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名 | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|----|-----------|--------|-------|-----|-----------------|
| #1 | 商品代號      | OP_ID  | A10   |     |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE   | I8    |     |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1  | I8    |     | 00：00：0000(時分秒) |
| #4 | 漲停價       | HLMT_P | D10.3 | 元/點 |                 |
| #5 | 參考價       | REF_P  | D10.3 | 元/點 |                 |
| #6 | 跌停價       | LLMT_P | D10.3 | 元/點 |                 |

## 2. 商品別成交量揭示訊息(TF2)

(1)檔名：fYYYYMMDD\_020.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJ 欄名    | 長度    | 單位  | 說明   |
|-----|-----------|-----------|-------|-----|--|
| #1  | 商品代號      | OP_ID     | A20   |     |  |
| #2  | 資料日期(西元年) | DATE      | I8    |     |  |
| #3  | 資料時間      | TIME1     | I8    |     | 00：00：0000(時分秒)  |
| #4  | 成交時間      | DEAL_HR   | I8    |     | 00：00：0000(時分秒)  |
| #5  | 第一次成交價    | YPRC      | D16.4 | 元/點 |  |
| #6  | 第一次成交量    | YQTY      | D8    |     |  |
| #7  | 累計成交數量    | DEALQTY   | I8    |     |  |
| #8  | 累計買進成交筆數  | DEALBUY_N | I8    |     |  |
| #9  | 累計賣出成交筆數  | DEALSEL_N | I8    |     |  |
| #10 | 成交價量筆數    | MATCH_Q   | I3    |     |  |
| #11 | 成交價格      | YPRC1     | D16.4 | 元/點 | 此兩欄位呈現方式為(成交價 1，成交量 1)(成交價 2，成交量 2)(成交價 3，成交量 3)(成交價 4，成交量 4)... |
| #12 | 成交數量      | YQTY1     | D4    |     |  |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDD2.ftm，93/10/01 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度    | 單位  | 說明              |
|----|-----------|---------|-------|-----|-----------------|
| #1 | 商品代號      | OP_ID   | A10   |     |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |     |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1   | I8    |     | 00：00：0000(時分秒) |
| #4 | 成交時間      | DEAL_HR | I8    |     | 00：00：0000(時分秒) |
| #5 | 第一次成交價    | PRC     | D10.3 | 元/點 |                 |
| #6 | 第一次成交量    | QTY     | D8    |     |                 |
| #7 | 累計成交數量    | DEALQTY | D8    |     |                 |

TEJ 資料庫說明 指數分時檔說明

|     |          |           |       |     |  |
|-----|----------|-----------|-------|-----|--|
| #8  | 累計買進成交筆數 | DEALBUY_N | D8    |     |  |
| #9  | 累計賣出成交筆數 | DEALSEL_N | D8    |     |  |
| #10 | 成交價量筆數   | MATCH_Q   | I3    |     |  |
| #11 | 成交價格     | PRC1      | D10.3 | 元/點 | 此兩欄位呈現方式為(成交價 1，成交量 1)(成交價 2，成交量 2)(成交價 3，成交量 3)(成交價 4，成交量 4)... |
| #12 | 成交數量     | QTY1      | D4    |     |  |

3. 商品別累計委託及成交 (TF3)

(1)檔名：fYYYYMMDD\_030.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度  | 單位 | 欄位說明            |
|----|-----------|---------|-----|----|-----------------|
| #1 | 商品代碼      | OP_ID   | A20 |    |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8  |    |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1   | I8  |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #4 | 買進累計委託筆數  | BUY_ODR | D8  |    |                 |
| #5 | 買進累計委託合約數 | BUY_QTY | D8  |    |                 |
| #6 | 賣出累計委託筆數  | SEL_ODR | D8  |    |                 |
| #7 | 賣出累計委託合約數 | SEL_QTY | D8  |    |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDD3.ftm，93/10/01 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度  | 單位 | 欄位說明            |
|----|-----------|---------|-----|----|-----------------|
| #1 | 商品代號      | OP_ID   | A10 |    |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8  |    |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1   | I8  |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #4 | 買進累計委託筆數  | BUY_ODR | D8  |    |                 |
| #5 | 買進累計委託合約數 | BUY_QTY | D8  |    |                 |
| #6 | 賣出累計委託筆數  | SEL_ODR | D8  |    |                 |
| #7 | 賣出累計委託合約數 | SEL_QTY | D8  |    |                 |

5. 其他——公告(TF5)

(1) 檔名：fYYYYMMDD\_050.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名 | 長度  | 單位 | 欄位說明            |
|----|-----------|--------|-----|----|-----------------|
| #1 | 資料日期(西元年) | DATE   | I8  |    |                 |
| #2 | 資料時間      | TIME1  | I8  |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #3 | 公告資料      | RMK    | A80 |    |                 |

(2) 檔名：fYYMMDD5.ftm，93/10/01 以後適用 闕漏：f9402225.ftm

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJCODE | 長度  | 單位 | 說明              |
|----|-----------|---------|-----|----|-----------------|
| #1 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8  |    |                 |
| #2 | 資料時間      | TIME1   | I8  |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #3 | 公告資料      | RMK     | A80 |    |                 |

6. 其他——指數現貨價分時資料(TF6)

(1)檔名：fYYYYMMDD\_060.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度    | 單位 | 欄位說明 |
|----|-----------|---------|-------|----|------|
| #1 | 指數類別代碼    | OP_KIND | A3    |    |      |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |    |      |
| #3 | 指數統計時間    | IDX_HR  | I8    |    |      |
| #4 | 現貨標的指數    | TAIEX   | D10.3 |    |      |

(2)檔名：fYYMMDD6.ftm，93/10/01 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJCODE | 長度 | 單位 | 說明 |
|----|-----------|---------|----|----|----|
| #1 | 指數類別代號    | OP_KIND | A3 |    |    |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8 |    |    |
| #3 | 指數統計時間    | IDX_HR  | I8 |    |    |

| TEJ 資料庫說明 | 指數分時檔說明 |
|-----------|---------|
|-----------|---------|

|    |        |       |       |  |  |
|----|--------|-------|-------|--|--|
| #4 | 現貨標的指數 | TAIEX | D10.3 |  |  |
|----|--------|-------|-------|--|--|

註：資料時間若為開盤前，該資料為前天收盤資料

### 7. 商品別期貨收盤統計(TF7)

(1)檔名：fYYYYMMDD\_072.ftm，96/10/08 起適用。

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJ 欄名   | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|-----|-----------|----------|-------|-----|-----------------|
| #1  | 商品代碼      | OP_ID    | A20   |     |                 |
| #2  | 資料日期(西元年) | DATE     | I8    |     |                 |
| #3  | 資料時間      | TIME1    | I8    |     | 00:00:0000(時分秒) |
| #4  | 該期最高價     | TH_PT    | D15.4 | 元/點 |                 |
| #5  | 該期最低價     | TL_PT    | D15.4 | 元/點 |                 |
| #6  | 該日最高價     | DH_PT    | D15.4 | 元/點 |                 |
| #7  | 該日最低價     | DL_PT    | D15.4 | 元/點 |                 |
| #8  | 開盤價       | OPEN_P   | D15.4 | 元/點 |                 |
| #9  | 最後買價      | BUY_P    | D15.4 | 元/點 |                 |
| #10 | 最後賣價      | SELL_P   | D15.4 | 元/點 |                 |
| #11 | 收盤價       | CLOSE_P  | D15.4 | 元/點 |                 |
| #12 | 委託買進總筆數   | BO_CT    | I8    |     |                 |
| #13 | 委託買進總口數   | BO_QT    | I8    |     |                 |
| #14 | 委託賣出總筆數   | SO_CT    | I8    |     |                 |
| #15 | 委託賣出總口數   | SO_QT    | I8    |     |                 |
| #16 | 總成交筆數     | TOT_CT   | I8    |     |                 |
| #17 | 總成交量      | TOT_QT   | I8    |     |                 |
| #18 | 合併委託買進總筆數 | COMBO_CT | I8    |     |                 |
| #19 | 合併委託買進總口數 | COMBO_QT | I8    |     |                 |
| #20 | 合併委託賣出總筆數 | COMSO_CT | I8    |     |                 |
| #21 | 合併委託賣出總口數 | COMSO_QT | I8    |     |                 |
| #22 | 合併總成交量    | COMTOT   | I8    |     |                 |
| #23 | 結算價       | YSET_PRC | D15.4 | 元/點 |                 |
| #24 | 未平倉合約數    | OPEN_INT | I8    |     |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDD7.ftm，93/10/01 起適用。 闕漏日：f9401137.ftm，f9402227.ftm

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJCODE  | 長度    | 單位  | 說明 |
|-----|-----------|----------|-------|-----|----|
| #1  | 商品代號      | OP_ID    | A10   |     |    |
| #2  | 資料日期(西元年) | DATE     | I8    |     |    |
| #3  | 資料時間      | TIME1    | I8    |     |    |
| #4  | 該期最高價     | HIGH_P_A | D10.3 | 元/點 |    |
| #5  | 該期最低價     | LOW_P_A  | D10.3 | 元/點 |    |
| #6  | 該日最高價     | HIGH_P   | D10.3 | 元/點 |    |
| #7  | 該日最低價     | LOW_P    | D10.3 | 元/點 |    |
| #8  | 開盤價       | OPEN_P   | D10.3 | 元/點 |    |
| #9  | 最後買價      | LASTBUY  | D10.3 | 元/點 |    |
| #10 | 最後賣價      | LASTSELL | D10.3 | 元/點 |    |
| #11 | 收盤價       | CLOSE_P  | D10.3 | 元/點 |    |
| #12 | 委託買進總筆數   | BUY_ODR  | D8    |     |    |
| #13 | 委託買進總口數   | BUY_QTY  | D8    |     |    |
| #14 | 委託賣出總筆數   | SEL_ODR  | D8    |     |    |
| #15 | 委託賣出總口數   | SEL_QTY  | D8    |     |    |
| #16 | 總成交筆數     | DEAL_ODR | D8    |     |    |
| #17 | 總成交量      | DEAL_QTY | D8    |     |    |
| #18 | 結算價       | SETT_P   | D10.3 | 元/點 |    |
| #19 | 未平倉合約數    | OPEN_INT | D8    |     |    |

## 8. 複式商品收盤行情

(1)檔名：fYYYYMMDD\_073.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|-----|-----------|---------|-------|-----|-----------------|
| #1  | 商品代碼      | OP_ID   | A20   |     |                 |
| #2  | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |     |                 |
| #3  | 資料時間      | TIME1   | I8    |     | 00:00:0000(時分秒) |
| #4  | 該期最高價     | TH_PT   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #5  | 該期最低價     | TL_PT   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #6  | 該日最高價     | DH_PT   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #7  | 該日最低價     | DL_PT   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #8  | 開盤價       | OPEN_P  | D16.4 | 元/點 |                 |
| #9  | 最後買價      | BUY_P   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #10 | 最後賣價      | SELL_P  | D16.4 | 元/點 |                 |
| #11 | 收盤價       | CLOSE_P | D16.4 | 元/點 |                 |
| #12 | 委託買進總筆數   | BO_CT   | I8    |     |                 |
| #13 | 委託買進總口數   | BO_QT   | I8    |     |                 |
| #14 | 委託賣出總筆數   | SO_CT   | I8    |     |                 |
| #15 | 委託賣出總口數   | SO_QT   | I8    |     |                 |
| #16 | 總成交筆數     | TOT_CT  | I8    |     |                 |
| #17 | 總成交量      | TOT_QT  | I8    |     |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

## 9. 委託簿揭示訊息

(1)檔名：fYYYYMMDD\_080.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號  | 欄位名稱        | TEJ 欄名  | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|-----|-------------|---------|-------|-----|-----------------|
| #1  | 商品代碼        | OP_ID   | A20   |     |                 |
| #2  | 資料日期(西元年)   | DATE    | I8    |     |                 |
| #3  | 資料時間        | TIME1   | I8    |     | 00:00:0000(時分秒) |
| #4  | 最佳買進價格 1    | YBUY_P1 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #5  | 最佳買進價格數量 1  | YBUY_Q1 | D10   | 口數  |                 |
| #6  | 最佳買進價格 2    | YBUY_P2 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #7  | 最佳買進價格數量 2  | YBUY_Q2 | D10   | 口數  |                 |
| #8  | 最佳買進價格 3    | YBUY_P3 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #9  | 最佳買進價格數量 3  | YBUY_Q3 | D10   | 口數  |                 |
| #10 | 最佳買進價格 4    | YBUY_P4 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #11 | 最佳買進價格數量 4  | YBUY_Q4 | D10   | 口數  |                 |
| #12 | 最佳買進價格 5    | YBUY_P5 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #13 | 最佳買進價格數量 5  | YBUY_Q5 | D10   | 口數  |                 |
| #14 | 最佳賣出價格 1    | YSEL_P1 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #15 | 最佳賣出價格數量 1  | YSEL_Q1 | D10   | 口數  |                 |
| #16 | 最佳賣出價格 2    | YSEL_P2 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #17 | 最佳賣出價格數量 2  | YSEL_Q2 | D10   | 口數  |                 |
| #18 | 最佳賣出價格 3    | YSEL_P3 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #19 | 最佳賣出價格數量 3  | YSEL_Q3 | D10   | 口數  |                 |
| #20 | 最佳賣出價格 4    | YSEL_P4 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #21 | 最佳賣出價格數量 4  | YSEL_Q4 | D10   | 口數  |                 |
| #22 | 最佳賣出價格 5    | YSEL_P5 | D16.4 | 元/點 |                 |
| #23 | 最佳賣出價格數量 5  | YSEL_Q5 | D10   | 口數  |                 |
| #24 | 衍生委託單第一檔買進價 | FST_BPR | D15.4 | 元/點 |                 |
| #25 | 衍生委託單第一檔買進量 | FST_BQT | D10   | 口數  |                 |
| #26 | 衍生委託單第一檔賣出價 | FST_SPR | D15.4 | 元/點 |                 |
| #27 | 衍生委託單第一檔賣出量 | FST_SQT | D10   | 口數  |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDD8.ftm，93/10/01 以後適用

| 欄號  | 欄位名稱       | TEJ 欄名 | 長度    | 單位  | 欄位說明 |
|-----|------------|--------|-------|-----|------|
| #1  | 商品代號       | OP_ID  | A10   |     |      |
| #2  | 資料日期(西元年)  | DATE   | I8    |     |      |
| #3  | 資料時間       | TIME1  | I8    |     |      |
| #4  | 最佳買進價格 1   | BUY_P1 | D10.3 | 元/點 |      |
| #5  | 最佳買進價格數量 1 | BUY_Q1 | D8    | 口數  |      |
| #6  | 最佳買進價格 2   | BUY_P2 | D10.3 | 元/點 |      |
| #7  | 最佳買進價格數量 2 | BUY_Q2 | D8    | 口數  |      |
| #8  | 最佳買進價格 3   | BUY_P3 | D10.3 | 元/點 |      |
| #9  | 最佳買進價格數量 3 | BUY_Q3 | D8    | 口數  |      |
| #10 | 最佳買進價格 4   | BUY_P4 | D10.3 | 元/點 |      |
| #11 | 最佳買進價格數量 4 | BUY_Q4 | D8    | 口數  |      |
| #12 | 最佳買進價格 5   | BUY_P5 | D10.3 | 元/點 |      |
| #13 | 最佳買進價格數量 5 | BUY_Q5 | D8    | 口數  |      |
| #14 | 最佳賣出價格 1   | SEL_P1 | D10.3 | 元/點 |      |
| #15 | 最佳賣出價格數量 1 | SEL_Q1 | D8    | 口數  |      |
| #16 | 最佳賣出價格 2   | SEL_P2 | D10.3 | 元/點 |      |
| #17 | 最佳賣出價格數量 2 | SEL_Q2 | D8    | 口數  |      |
| #18 | 最佳賣出價格 3   | SEL_P3 | D10.3 | 元/點 |      |
| #19 | 最佳賣出價格數量 3 | SEL_Q3 | D8    | 口數  |      |
| #20 | 最佳賣出價格 4   | SEL_P4 | D10.3 | 元/點 |      |
| #21 | 最佳賣出價格數量 4 | SEL_Q4 | D8    | 口數  |      |
| #22 | 最佳賣出價格 5   | SEL_P5 | D10.3 | 元/點 |      |
| #23 | 最佳賣出價格數量 5 | SEL_Q5 | D8    | 口數  |      |

## 10. 盤中最(高)低價訊息

(1)檔名：fYYYYMMDD\_021.ftm，96/10/08 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名 | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|----|-----------|--------|-------|-----|-----------------|
| #1 | 商品代碼      | OP_ID  | A20   |     |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE   | I8    |     |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1  | I8    |     | 00:00:0000(時分秒) |
| #4 | 當日最高成交价格  | H_PT   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #5 | 當日最低成交价格  | L_PT   | D16.4 | 元/點 |                 |
| #6 | 最後價格穿越時間  | S_TIME | I8    |     |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDD9.ftm，93/10/01 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJCODE | 長度    | 單位  | 說明 |
|----|-----------|---------|-------|-----|----|
| #1 | 商品代號      | OP_ID   | A10   |     |    |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |     |    |
| #3 | 資料時間      | TIMES   | I8    |     |    |
| #4 | 當日最高成交价格  | H_PT    | D10.3 | 元/點 |    |
| #5 | 當日最低成交价格  | L_PT    | D10.3 | 元/點 |    |
| #6 | 最後價格穿越時間  | S_TIME  | I8    |     |    |

## 11. 定時開盤價量揭示

(1)檔名：fYYYYMMDD\_023.ftm，自 96/10/08 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度    | 單位  | 欄位說明            |
|----|-----------|---------|-------|-----|-----------------|
| #1 | 商品代碼      | OP_ID   | A20   |     |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |     |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1   | I8    |     | 00:00:0000(時分秒) |
| #4 | 成交時間      | DEAL_HR | I8    |     |                 |
| #5 | 開盤價       | OPEN_P  | D16.4 | 元/點 |                 |
| #6 | 開盤量       | OPEN_Q  | D10   |     |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

(2)檔名：fYYMMDDa.ftm，自 94/1/1 以後適用

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJCODE | 長度    | 單位 | 說明              |
|----|-----------|---------|-------|----|-----------------|
| #1 | 商品代號      | OP_ID   | A10   |    |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE    | I8    |    |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1   | I8    |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #4 | 成交時間      | DEAL_HR | I8    |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #5 | 開盤價       | OPEN_P  | D10.3 |    |                 |
| #6 | 開盤量       | OPEN_Q  | I8    |    |                 |

## 12.詢價揭示訊息(TF10)

(1) 檔名：fYYMMDD\_100.ftm，(96/10/08 以後適用)

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名    | 長度  | 單位 | 欄位說明            |
|----|-----------|-----------|-----|----|-----------------|
| #1 | 商品代碼      | OP_ID     | A20 |    |                 |
| #2 | 資料日期(西元年) | DATE      | I8  |    |                 |
| #3 | 資料時間      | TIME1     | I8  |    | 00：00：0000(時分秒) |
| #4 | 詢價揭示時間    | DIS_TIME  | I8  |    |                 |
| #5 | 詢價持續時間    | DURA_TIME | I4  |    |                 |

註：黃金期貨、MSCI 臺指期貨單位以美元計價

## 13.單筆成交資料

檔名：fYYMMDD.csv

| 欄號 | 欄位名稱 | TEJCODE | 說明  |
|----|------|---------|-----|
| #1 | 交易日期 | DATE    |     |
| #2 | 商品代號 | OP_ID   |     |
| #3 | 交割年月 | DATE1   |     |
| #4 | 成交時間 | TIME    |     |
| #5 | 成交價格 | PRC     |     |
| #6 | 成交數量 | VOL     | B+S |
| #7 | 近月價格 | L_PRC   |     |
| #8 | 遠月價格 | F_PRC   |     |

註：組合式委託範例

為跨月價差委託(或稱時間價差委託)係指同一商品下,同時買進(賣出)較近月份契約並同時賣出(買進)相同數量較遠月份契約,兩契約必須同時成交,亦即同商品不同月份契約間同時一買一賣之組合式委託。(表一)

表一、下筆交易資料表示同時買進(賣出)1 月份台指期貨並賣出(買進)2 月份台指期貨

| 交易日期     | 商品代號 | 交割年月          | 成交時間    | 成交價格 | 成交數量(B+S) | 近月價格 | 遠月價格 |
|----------|------|---------------|---------|------|-----------|------|------|
| 20080102 | TXF  | 200801/200802 | 8450700 | 2    | 8         | 8451 | 8453 |

## 93/09/30 以前

1. 開盤前基本資訊(TF1)——參考價、漲跌幅漲跌幅訊息,檔名:fYYMMDD1.ftm,93/9/30 以前:

闕漏:f8805041、f8810291、f8901121、f8910131

| 欄號 | 欄位名稱      | TEJ 欄名  | 長度   | 單位  | 說明 |
|----|-----------|---------|------|-----|----|
| #1 | 商品代號      | FUTR_ID | A7   |     |    |
| #2 | 商品中文名稱    | NAME    | A20  |     |    |
| #3 | 交割年月(西元年) | SETT_YM | I6   |     |    |
| #4 | 資料日期(西元)  | DATE    | I8   |     |    |
| #5 | 履約價格      | STRIKE  | D9.2 | 元/點 |    |
| #6 | 漲停價       | HLMT_P  | D9.2 | 元/點 |    |
| #7 | 參考價       | REF_P   | D9.2 | 元/點 |    |
| #8 | 跌停價       | LLMT_P  | D9.2 | 元/點 |    |

## 2. 商品別分時報價行情(TF2)——檔名：fYYMMDD2.ftm

93/9/30 以前

| 欄號  | 欄位名稱       | TEJCODE   | 長度   | 單位  | 說明                                  |
|-----|------------|-----------|------|-----|-------------------------------------|
| #1  | 商品代號       | FUTR_ID   | A7   |     |                                     |
| #2  | 商品中文名稱     | NAME      | A20  |     |                                     |
| #3  | 交割年月(西元年)  | SETT_YM   | I6   |     |                                     |
| #4  | 資料日期(西元)   | DATE      | I8   |     |                                     |
| #5  | 成交時間       | DEAK_HR   | I8   |     | 自 91/7/29 起，若該時段無成交，則日期空白，不再顯示該時段時間 |
| #6  | 履約價格(選擇權)  | STRIKE    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #7  | 成交价格       | PRC       | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #8  | 成交數量       | QTY       | D8   | 口數  |                                     |
| #9  | 最佳買進價格 1   | BUY_P1    | D9.2 | 元/點 | 列出最佳的 5 筆買進價                        |
| #10 | 最佳買進價格數量 1 | BUY_Q1    | D8   | 口數  |                                     |
| #11 | 最佳買進價格 2   | BUY_P2    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #12 | 最佳買進價格數量 2 | BUY_Q2    | D8   | 口數  |                                     |
| #13 | 最佳買進價格 3   | BUY_P3    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #14 | 最佳買進價格數量 3 | BUY_Q3    | D8   | 口數  |                                     |
| #15 | 最佳買進價格 4   | BUY_P4    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #16 | 最佳買進價格數量 4 | BUY_Q4    | D8   | 口數  |                                     |
| #17 | 最佳買進價格 5   | BUY_P5    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #18 | 最佳買進價格數量 5 | BUY_Q5    | D8   | 口數  |                                     |
| #19 | 最佳賣出價格 1   | SEL_P1    | D9.2 | 元/點 | 列出最佳的 5 筆賣出價                        |
| #20 | 最佳賣出價格數量 1 | SEL_Q1    | D8   | 口數  |                                     |
| #21 | 最佳賣出價格 2   | SEL_P2    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #22 | 最佳賣出價格數量 2 | SEL_Q2    | D8   | 口數  |                                     |
| #23 | 最佳賣出價格 3   | SEL_P3    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #24 | 最佳賣出價格數量 3 | SEL_Q3    | D8   | 口數  |                                     |
| #25 | 最佳賣出價格 4   | SEL_P4    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #26 | 最佳賣出價格數量 4 | SEL_Q4    | D8   | 口數  |                                     |
| #27 | 最佳賣出價格 5   | SEL_P5    | D9.2 | 元/點 |                                     |
| #28 | 最佳賣出價格數量 5 | SEL_Q5    | D8   | 口數  |                                     |
| #29 | 累計成交合約數    | DEALQTY   | D8   | 口數  |                                     |
| #30 | 累計買進成交筆數   | DEALBUY_N | D8   | 筆數  |                                     |
| #31 | 累計賣出成交筆數   | DEALSEL_N | D8   | 筆數  |                                     |

## 3. 商品別累計委託及成交 (TF3)

檔名：fYYMMDD3.ftm，93/9/30 以前適用

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJCODE   | 長度   | 單位  | 說明 |
|-----|-----------|-----------|------|-----|----|
| #1  | 商品代號      | FUTR_ID   | A7   |     |    |
| #2  | 商品中文名稱    | NAME      | A20  |     |    |
| #3  | 交割年月(西元年) | SETT_YM   | I6   |     |    |
| #4  | 資料日期(西元)  | DATE      | I8   |     |    |
| #5  | 資料時間      | TIME1     | I8   |     |    |
| #6  | 履約價格(選擇權) | STRIKE    | D9.2 | 元/點 |    |
| #7  | 買進累計委託筆數  | BUY_ODR   | D8   |     |    |
| #8  | 買進累計委託合託量 | BUY_QTY   | D8   |     |    |
| #9  | 賣出累計委託筆數  | SEL_ODR   | D8   |     |    |
| #10 | 賣出累計委託合託量 | SEL_QTY   | D8   |     |    |
| #11 | 累計成交合約量   | DEAL_QTYA | D8   |     |    |

## 4. 總委託及成交(TF4) (檔名：fYYMMDD4.ftm，自 93 年起停止提供)

| 欄號 | 欄位名稱     | TEJCODE | 長度 | 單位 | 說明       |
|----|----------|---------|----|----|----------|
| #1 | 商品代號     | FUTR_ID | A7 |    | 定為 ZZZZZ |
| #2 | 資料日期(西元) | DATE    | I8 |    |          |

**TEJ 資料庫說明** **指數分時檔說明**

|    |           |           |    |  |  |
|----|-----------|-----------|----|--|--|
| #3 | 資料時間      | TIME1     | I8 |  |  |
| #4 | 買進累計委託筆數  | BUY_ODR   | D8 |  |  |
| #5 | 買進累計委託合託量 | BUY_QTY   | D8 |  |  |
| #6 | 賣出累計委託筆數  | SEL_ODR   | D8 |  |  |
| #7 | 賣出累計委託合託量 | SEL_QTY   | D8 |  |  |
| #8 | 累計成交合約量   | DEAL_QTYA | D8 |  |  |

5. 其他——公告(TF5)

檔名：fYYMMDD5.ftm，93/9/30 以前適用

| 欄號 | 欄位名稱     | TEJCODE | 長度  | 單位 | 說明 |
|----|----------|---------|-----|----|----|
| #1 | 商品代號     | FUTR_ID | A7  |    |    |
| #2 | 資料日期(西元) | DATE    | I8  |    |    |
| #3 | 資料時間     | TIME1   | I8  |    |    |
| #4 | 公告內容     | RMK     | D60 |    |    |

6. 其他——指數現貨價分時資料(TF6)

檔名：fYYMMDD6.ftm，93/9/30 以前適用 **闕漏：f8803246、f8803266**

| 欄號 | 欄位名稱     | TEJCODE | 長度   | 單位 | 說明       |
|----|----------|---------|------|----|----------|
| #1 | 指數代號     | STK_ID  | A7   |    | ID=Y9999 |
| #2 | 商品中文名稱   | NAME    | A20  |    |          |
| #3 | 資料日期(西元) | DATE    | I8   |    |          |
| #4 | 統計時間     | IDX_HR  | D8   |    |          |
| #5 | 指數/現貨價   | TAIEX   | D8.2 |    |          |

7. 商品別期貨收盤統計(TF7)

檔名：fYYMMDD7.ftm，93/9/30 以前適用。

**此資料闕漏甚多，較完整約從 89/10/01 開始，缺 f9304067、f9401137、f9402227。**

| 欄號  | 欄位名稱      | TEJCODE   | 長度   | 單位  | 說明 |
|-----|-----------|-----------|------|-----|----|
| #1  | 商品代號      | FUTR_ID   | A7   |     |    |
| #2  | 商品中文名稱    | NAME      | A20  |     |    |
| #3  | 交割年月(西元年) | SETT_YM   | I6   |     |    |
| #4  | 資料日期(西元)  | DATE      | I8   |     |    |
| #5  | 成交時間      | DEAL_HR   | I8   |     |    |
| #6  | 履約價格(選擇權) | STRIKE    | D9.2 | 元/點 |    |
| #7  | 該期最高價     | HIGH_P_A  | D9.2 | 元/點 |    |
| #8  | 讓期最低價     | LOW_P_A   | D9.2 | 元/點 |    |
| #9  | 該日最高價     | HIGH_P    | D9.2 | 元/點 |    |
| #10 | 該日最低價     | LOW_P     | D9.2 | 元/點 |    |
| #11 | 開盤價       | OPEN_P    | D9.2 | 元/點 |    |
| #12 | 最後買價      | LAST_BUY  | D9.2 | 元/點 |    |
| #13 | 最後賣價      | LAST_SELL | D9.2 | 元/點 |    |
| #14 | 收盤價       | CLOSE_P   | D9.2 | 元/點 |    |
| #15 | 買進成交筆數    | BUY_N     | D8   |     |    |
| #16 | 賣出成交筆數    | SEL_N     | D8   |     |    |
| #17 | 成交合約數     | DEAL_QTY  | D8   |     |    |
| #18 | 結算價       | SETT_P    | D9.2 | 元/點 |    |
| #19 | 未平倉合約數    | OPEN_INT  | D8   |     |    |

附件

期貨商品代碼說明(以 TXFC3 為例)：

TXF：商品代碼(TXF 為台指期貨)

C：期貨交割月分代碼，代碼明細如下：

|    | 一月 | 二月 | 三月 | 四月 | 五月 | 六月 | 七月 | 八月 | 九月 | 十月 | 十一月 | 十二月 |
|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|----|-----|-----|
| 期貨 | A  | B  | C  | D  | E  | F  | G  | H  | I  | J  | K   | L   |

3：交割年度(3 為 2013 年)