

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

台北市長安東路二段 173 號 10 樓

電話: 0 2 - 2 7 5 2 9 7 7 7

期貨分時資料庫 欄位說明

一、資料庫範圍：在台灣期貨交易所掛牌之商品，起自 1999/4/1

二、資料庫小類：

1. 開盤前商品別基本資訊 參考價、漲跌幅
2. 商品別分時報價行情
3. 商品別累計委託及成交
4. 總委託及成交(自 93 年起停止維護)
5. 其他 公告
6. 其他 指數現貨價分時資料
7. 商品別期貨收盤統計
8. 盤中最(高)低價訊息
9. 定時開盤價量揭示
10. 單筆成交資料

三、欄位說明

1. 開盤前基本資訊(TF1) 參考價、漲跌幅漲跌幅訊息

(1) 檔名：fYYMMDD1.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	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) 檔名：fYYMMDD1.ftm，僅用於 93/9/30 以前之資料

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)

(1) 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		
#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		

(2)檔名：fYYMMDD8.ftm，93/10/01 以後適用

欄號	欄位名稱	TEJ 欄名	長度		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	

(3) 檔名：fYYMMDD2.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	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	成交價格	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)

(1) 檔名：fYYMMDD3.ftm，93/10/01 以後適用

欄號	欄位名稱	TEJ 欄名	長度		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		

(2) 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	買進累計委託合約量	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) [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		
#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)

(1) 檔名：fYYMMDD5.ftm，93/10/01 以後適用

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		

(2) 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)

(1) 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		
#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

(2) 檔名：fYYMMDD6.ftm，93/9/30 以前適用

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)

(1) 檔名：fYYMMDD7.ftm，93/10/01 起適用。

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		
#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		

註:f9401137.ftm、f9402227.ftm 闕漏

(2) 檔名：fYYMMDD7.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	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		

註:TF7 商品別期貨收盤統計缺漏甚多，較完整約從 89/09/01 起

f9304067.ftm 資料缺漏。

8. 盤中最(高)低價訊息

(1) 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	當日最高成交價格	H_PT	D10.3	元/點	
#5	當日最低成交價格	L_PT	D10.3	元/點	
#6	最後價格穿越時間	S_TIME	I8		

9. 定時開盤價量揭示

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		

10. 單筆成交資料

檔名：fYYMMDD.csv

欄號	欄位名稱	說明
#1	交易日期	
#2	商品代號	
#3	交割年月	
#4	成交時間	
#5	成交價格	
#6	成交數量	B+S

四、資料闕漏部分說明

1. 原 F94B 中，94 年 6 月 13 日、15 日、16 日、17 日、20 日、21 日原檔有誤，且闕漏 6 月 1 日至 3 日之資料，於 94 年 10 月 11 日以 94Bb 一片補齊。
2. 缺 94/01/13 資料

附件：

期貨商品代號

1.第一碼至第三碼為契約代號(契約代號未必都是三碼)

新代號	商品名	舊代號
EXF	電子期貨	FITE
FXF	金融期貨	FITF
MXF	小型台指期貨	FIMTX
TXF	台指期貨	FITX
CPF	三十天期利率期貨	FICP
GBF	十年期公債期貨	FIGB
T5F	台灣 50 指數期貨	FIT5

2.倒數第二碼：到期月

	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
代碼	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L

3.倒數第一碼：到期年份，西元年末位數，如：2003 則為 3，2004 則為 4。

4.例：EXFL4，EXF 指電子期貨，L 為到期月 12 月，4 為到期年 2004 年。