

台灣經濟新報文化事業(股)公司

**台指選擇權當日交易明細資料
(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**

台指選擇權分時資料庫 欄位說明

一、資料庫範圍：

資料由 2002 年開始。

二、資料庫分類：

1. 開盤前基本資訊--參考價、漲跌幅訊息
2. 商品別分時報價行情
3. 單一商品委託量累計
4. 商品類別累計總委託及成交量訊息(自 93 年起停止維護)
5. 其他--公告
6. 其他--現貨價分時資料
7. 收盤統計
8. 委託簿揭示訊息
9. 報價揭示訊息
10. 詢價揭示訊息
11. 理論價格訊息(尚未提供)
12. 盤中最(高)低價訊息
13. 股票選擇權與現貨標的對照表
14. 股票選擇權契約調整檔
15. 定時開盤價量揭示
16. 單筆成交資料

三、欄位說明

1. 開盤前基本資訊(TF1)--參考價、漲跌幅訊息

(1) 檔名：pYYMMDD1.ftm

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. 商品別分時報價行情(TF2)

(1) 檔名：pYYMMDD2.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	口數	
#7	累計成交數量	DEALQTY	D8	筆數	
#8	累計買進成交筆數	DEALBUY_N	D8	筆數	
#9	累計賣出成交筆數	DEALSEL_N	D8	筆數	
#10	成交價量筆數	MATCH_Q	I3		
#11	成交價格	PRC1	D10.3		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：pYYMMDD2.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	OP_ID	A10		
#2	日期	DATE	I8		
#3	成交時間	DEAL_HR	I8		格式:HHMMSSSS
#4	成交價格	PRC	D10.3	元/點	
#5	成交數量	QTY	D8	口數	
#6	累計成交數量	DEALQTY	D8	口數	
#6	累計買進成交筆數	DEALBUY_N	D8	筆數	
#7	累計賣出成交筆數	DEALSEL_N	D8	筆數	

註 1：資料傳送頻率：產生行情資料時

註 2：累計數量每日分三段時間計算(8:45 之前；8:45~13:45；13:45 之後)

3. 單一商品委託量累計 (TF3)

(1) 檔名：pYYMMDD3.ftm

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	商品代號	OP_ID	A10		
#3	資料日期(西元)	DATE	I8		
#4	資料時間	TIME1	I8		格式:HHMMSSSS
#5	買進累計委託筆數	BUY_ODR	D8		
#6	買進累計委託委託量	BUY_QTY	D8		
#7	賣出累計委託筆數	SEL_ODR	D8		
#8	賣出累計委託委託量	SEL_QTY	D8		

註 1：累計數量每日分三段時間計算(8:45 之前；8:45~13:45；13:45 之後)

4. 商品類別累計總委託及成交量訊息(TF4) [93/1/2~93/5/30 起停止維護]

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	商品代碼	OP_ID	A10		定為 ZZZZZ
#2	商品類別	OP_KIND	A3		台指選擇權:TXO
#3	資料日期(西元)	DATE	I8		
#4	資料時間	TIME1	I8		格式:HHMMSSSS
#5	買進累計委託筆數	BUY_ODR	D8		
#6	買進累計委託合約量	BUY_QTY	D8		
#7	賣出累計委託筆數	SEL_ODR	D8		

#8	賣出累計委託合約量	SEL_QTY	D8		
#9	累計成交合約量	DEAL_QTYA	D8		

註 1：累計數量每日分三段時間計算(8:45 之前；8:45~13:45；13:45 之後)

5. 其他--公告(TF5)

(1) 檔名：pYYMMDD5.ftm

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	資料日期(西元)	DATE	I8		
#2	資料時間	TIME1	I8		格式:HHMMSSSS
#3	公告內容	RMK	A80		

6. 其他--現貨價分時資料(TF6)

(1) 檔名：pYYMMDD6.ftm，93/10/01 以後適用

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	指數類別代碼	OP_KIND	A3		
#2	資料日期(西元)	DATE	I8		
#3	統計時間	IDX_HR	I8		格式:HHMMSSSS
#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：pYYMMDD6.ftm，93/9/30 以前適用

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	指數類別代碼	OP_KIND	A3		ID=TXO
#2	資料日期(西元)	DATE	I8		
#3	統計時間	IDX_HR	I8		格式:HHMMSSSS
#4	現貨標的指數	TAIEX	D8.2		

註 1：每分鐘統計一次

註 2：每日開盤前會先傳送一筆現貨標的前日收盤指數資料

註 3：每日收盤後會傳送一筆現貨標的收盤指數資料，惟調整掉尾差

7. 收盤統計(TF7)

(1) 檔名：pYYMMDD7.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)	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	LAST_BUY	D10.3	元/點	
#10	最後賣價	LAST_SELL	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 1：若當日該商品無交易則收盤價帶前日結算價

註 2：p9401137.ftm、p9401207.ftm、p9402227.ftm 闕漏

8.委託簿揭示訊息(TF8)

(1) 檔名：pYYMMDD8.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)	DATE	I8		
#3	資料時間	TIME1	I8		格式:HHMMSSSS
#4	最佳買進價格 1	BUY_P1	D10.3	元/點	
#5	最佳買進數量 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	最佳賣出數量 5	SEL_Q5	D8	口數	

9.報價揭示訊息(TF9) [自 93 年起停止維護]

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	商品代號	FUTR_ID	A10		
#2	資料日期(西元)	DATE	I8		
#3	資料時間	TIME1	I8		格式:HHMMSSSS
#4	最佳買進價格	BUY_P	D10.3	元/點	
#5	最佳買進數量	BUY_Q	D8	口數	
#6	最佳賣出價格	SEL_P	D10.3	元/點	
#7	最佳賣出數量	SEL_Q	D8	口數	

10.詢價揭示訊息(TF10)

(1) 檔名：pYYMMDDa.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)	DATE	I8		
#3	資料時間	TIME1	I8		格式:HHMMSSSS
#4	詢價揭示時間	DIS_TIME	I8		
#5	詢價持續時間	DURA_TIME	I3	秒	

11.理論價格訊息(TF11) [pYYMMDDb.FTM] [自 93 年 10 月起停止維護]

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	商品代號	FUTR_ID	A10		
#2	資料日期(西元)	DATE	I8		
#3	公告日期	DATE1	I8		
#4	理論價格	REF_P	D10.3	元/點	
#5	參考時間	REF_TIME	I8	口數	

12.盤中最(高)低價訊息

(1) 檔名：pYYMMDDc.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		

13.股票選擇權與現貨標的對照表

檔名：pYYMMDDf.ftm，93/10/01 以後適用

欄號	欄位名稱	TEJCODE	長度	單位	說明
#1	股票選擇權代碼	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	股票代碼	STK_ID	A7		
#5	現貨標的開盤參考價	S_O_P	D10.3	元/股	

14.股票選擇權契約調整檔

檔名：pYYMMDDg.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	調整基準日	ADJ_B_D	I8		
#4	調整前契約代碼	BA_KIND1	A4		
#5	調整前約定標的物 1-證券代號	BA_ID1	A6		
#6	調整前約定標的物 1-股數	BA_QTY1	D12.4	股	

#7	調整前約定標的物 2-現金	BA_CASH1	D12.4		
#8	調整前約定標的物 3-現增價值	BA_CASH_I	D12.4		
#9	調整前約定標的物 4-證券代號	BA_ID4	A6		
#10	調整前約定標的物 4-股數	BA_QTY4	D12.4	股	
#11	調整後契約代碼	AA_KIND	A4		
#12	調整後約定標的物 1-證券代號	AA_ID1	A6		
#13	調整後約定標的物 1-增減股數	AA_QTY1	D12.4	股	
#14	調整後約定標的物 2-現金	AA_CASH	D12.4		
#15	調整後約定標的物 3-認購價	AA_CASH_P	D12.4		
#16	調整後約定標的物 3-認購股數	AA_CASH_Q	D12.4	股	
#17	現金增資繳款截止日	AA_DATE	I8		
#18	調整後約定標的物 4-證券代號	AA_ID4	A6		
#19	調整後約定標的物 4-股數	AA_QTY4	D12.4	股	
#20	除權除息交易日	EX_DATE	I8		

15.定時開盤價量揭示

檔名：pYMMDDh.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	元/點	
#6	開盤量	OPEN_Q	I8		

16.單筆成交資料

檔名：pYMMDD.csv

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

四、補充說明：

1. 原 94Be 中，94 年 6 月 13 日、15 日、16 日、17 日、20 日、21 日資料有誤，故以 94Bf 補齊。
2. 原 94Ab 中，94 年 1 月 20 日資料有誤，以及原 94Ba 中，闕漏 94 年 04 月 20 日，故以 94Cf 補齊。
由於系統設定，此二日之 csv 檔已被系統清理，無法復原。

附件

選擇權商品代號說明(以 TXO04700P2 為例)：

TXO：商品代碼(TXO 為台指選擇權)

04700：履約價(04700：4700 點)

P：買賣權與交割月分代碼，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
買權	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L
賣權	M	N	O	P	Q	R	S	T	U	V	W	X

2：交割年度(2 為 2002 年)