

FW, 期貨

*檔案使用Big-5編碼

[1. FWBTIN, 三大法人]

檔名：FWBTIN_西元年月.zip

解壓縮後有兩個txt檔，分別為日資料和週資料

日資料（WBOIVL3F_西元年月）

NO.	欄位名稱	欄位說明	長度
01	DATE	日期	8(YYYYMMDD)
02	PROD_NAME	商品名稱	(以'\t'區隔)
03	PROD_ID	商品代號	(以'\t'區隔)
04	ACC_TYPE	身份別 (A:自營商; B:投信; C:外資及陸資)	(以'\t'區隔)
05	TRANB_QNTY	交易多方--口數	(以'\t'區隔)
06	TRANB_VALUE	交易多方契約--金額	(以'\t'區隔)
07	TRANS_QNTY	交易空方--口數	(以'\t'區隔)
08	TRANS_VALUE	交易空方--契約金額	(以'\t'區隔)
09	TRAN_QNTY	交易多空淨額 ¹ --口數	(以'\t'區隔)
10	TRAN_VALUE	交易多空淨額--契約金額	(以'\t'區隔)
11	OIB_QNTY	未平倉餘額多方--口數	(以'\t'區隔)
12	OIB_VALUE	未平倉餘額多方--契約金額	(以'\t'區隔)
13	OIS_QNTY	未平倉餘額空方--口數	(以'\t'區隔)
14	OIS_VALUE	未平倉餘額空方--契約金額	(以'\t'區隔)
15	OI_QNTY	未平倉餘額多空淨額--口數	(以'\t'區隔)
16	OI_VALUE	未平倉餘額多空淨額--契約金額	(以'\t'區隔)

週資料（WBWEEKL3F_西元年月）

¹多空淨額：多方-空方(ex: 欄位09=05-07, 欄位10=06-08)

NO.	欄位名稱	欄位說明	長度
01	WEEK_NUM	週別	(以't'區隔)
02	PROD_NAME	商品名稱	(以't'區隔)
03	PROD_ID	商品代號	(以't'區隔)
04	ACC_TYPE	身份別 (A:自營商; B:投信; C:外資及陸資)	(以't'區隔)
05	TRANB_QNTY	交易多方--口數	(以't'區隔)
06	TRANB_VALUE	交易多方契約--金額	(以't'區隔)
07	TRANS_QNTY	交易空方--口數	(以't'區隔)
08	TRANS_VALUE	交易空方--契約金額	(以't'區隔)
09	TRAN_QNTY	交易多空淨額--口數	(以't'區隔)
10	TRAN_VALUE	交易多空淨額--契約金額	(以't'區隔)
11	OIB_QNTY	未平倉餘額多方--口數	(以't'區隔)
12	OIB_VALUE	未平倉餘額多方--契約金額	(以't'區隔)
13	OIS_QNTY	未平倉餘額空方--口數	(以't'區隔)
14	OIS_VALUE	未平倉餘額空方--契約金額	(以't'區隔)
15	OI_QNTY	未平倉餘額多空淨額--口數	(以't'區隔)
16	OI_VALUE	未平倉餘額多空淨額--契約金額	(以't'區隔)

[2. FWOSF, 委託檔]

檔名：FWOSF_西元年月.zip

解壓縮後有「n個txt檔」，看當月交易天數n天決定

以下用FWOSF_201701.zip為例

內有FWOSF_20170103/20170104/.../20170124

資料格式詳見網址：(期貨委託檔 [格式] <https://www.taifex.com.tw/chinese/3/files/file5.doc>)

NO.	欄位名稱	欄位說明	長度
01	OSF_DATE	日期	8(YYYYMMDD)

02	OSF_PROD_ID	<p>商品代號（單式）</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 前3碼-商品種類(TXF-台指,MXF-小型台指,EXF-電子, FXF-金融, GBF-公債, CPF-利率, T5F-台灣50, GDF-黃金, MSF-摩根, TGF-臺幣計價黃金, XIF-非金電, GTF-櫃買,其它皆屬於股票期貨) 2. 第4碼- A~L(1~12月) 3. 第5碼-年份(西元年最後一位數) <p>商品代號（複式） 跨月價差委託：不同月份契約組成，如：MXFA6/C6，表示2006年小型台指 1月3月價差商品</p>	20
03	OSF_BS_CODE	買賣別	1('B':Buy , 'S':Sell)
04	OSF_ORDER_QNTY	委託量	(以'\t'區隔)
05	OSF_UN_QNTY	未成交量	(以'\t'區隔)
06	OSF_ORDER_PRICE	委託價	(以'\t'區隔，市價單委託價為0)
07	OSF_ORDER_TYPE	委託方式	1('L':限價單,'M':市價單, '3': MWP一定範圍市價委託)
08	OSF_ORDER_COND	ROD IOC FOK	R:ROD(Rest of Day):當日有效單, I:IOC(Immediate-or-cancel):立即成交否則部分取消, F:FOK(Fill-or Kill):全部成交否則全部取消, Q ² :報價單的FOK, U:報價單的ROD
09	OSF_OC_CODE	開平倉碼	1('0':新倉, '1':平倉, '2':當沖, '9':造市)
10	OSF_ORIG_TIME	委託時間	HH:MM:SS.sss000

² Q, U單僅造市者可下

02	MTF_PROD_ID	<p>商品代號（單式）</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 前3碼-商品種類(TXF-台指,MXF-小型台指,EXF-電子, FXF-金融, GBF-公債,CPF-利率,T5F-台灣50,GDF-黃金,MSF-摩根, TGF-臺幣計價黃金, XIF-非金電, GTF-櫃買,其它皆屬於股票期貨) 2. 第4碼-A~L(1~12月) 3. 第5碼-年份(西元年最後一位數) <p>商品代號（複式）</p> <p>跨月價差委託：不同月份契約組成，如：MXFA6/C6，表示2006年小型台指 1月3月價差商品</p>	20
03	MTF_PROD_ID1	第一支腳商品代碼1	10
04	MTF_BS_CODE1	第一支腳買賣別1	1('B':Buy , 'S':Sell)
05	MTF_M_PRICE1	第一支腳成交價格1	(以'\t'區隔)
06	MTF_M_QNTY1	第一支腳成交數量1	(以'\t'區隔)
07	MTF_PROD_ID2	第二支腳商品代碼2	10
08	MTF_BS_CODE2	第二支腳買賣別2	1('B':Buy , 'S':Sell)
09	MTF_M_PRICE2	第二支腳成交價格2	(以'\t'區隔)
10	MTF_M_QNTY2	第二支腳成交數量2	(以'\t'區隔)
11	MTF_BS_CODE	買賣別	1('B':Buy , 'S':Sell)
12	MTF_PRICE	成交價格	(以'\t'區隔)
13	MTF_QNTY	成交數量	(以'\t'區隔)
14	MTF_OC_CODE	開平倉碼	1('0':新倉, '1':平倉, '2':當沖, '9':造市者單)
15	MTF_M_INST	搓合標記	(以'\t'區隔)
16	MTF_ORIG_TIME	原始成交時間	HH:MM:SS.sss000
17	MTF_SC_CODE	單複式碼	1('S':單式商品,'C':組合式商品)
18	MTF_ORDER_TY PE	委託方式	1('L':限價單,'M':市價單)

19	FCM_NO+ORDE R_NO+ OQ_CODE	交易與委託報價檔連結代碼	
----	---------------------------------	--------------	--

經簡單處理後以DataFrame形式表示如下：

Index	日期	商品代號	第一支腳商品代碼	第一支腳買賣別	第一支腳成交價格	第一支腳成交數量	第二支腳商品代碼	第二支腳買賣別	第二支腳成交價格	第二支腳成交數量
0	20170103	TXFA7								
1	20170103	TXFA7								
2	20170103	TXFA7								
3	20170103	TXFA7								
4	20170103	MXFA7								
5	20170103	MXFA7								
6	20170103	MXFA7								
7	20170103	MXFA7								
8	20170103	MXFA7								
9	20170103	MXFA7								
10	20170103	MXFA7								
11	20170103	MXFA7								
12	20170103	MXFA7								
13	20170103	MXFA7								
14	20170103	MXFA7								
15	20170103	MXFA7								

買賣別	成交價格	成交數量	開平倉碼	撮合標記	原始成交時間	單複式碼	委託方式	與委託報價檔連結
S	9263	1	0	1420942	11:08:26.331000	S	L	e0e65b4ca0...
S	9263	1	0	1420942	11:08:26.331000	S	L	0336ff39e6...
S	9263	1	1	1420942	11:08:26.331000	S	L	c7e3463768...
S	9263	12	1	1420942	11:08:26.331000	S	L	adb1aedec2...
B	9263	16	0	1420948	11:08:26.413000	S	L	8644942e9d...
S	9263	1	0	1420948	11:08:26.413000	S	L	ac0c107225...
S	9263	1	0	1420948	11:08:26.413000	S	L	0a472067fb...
S	9263	1	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	de4cd814b4...
S	9263	1	0	1420948	11:08:26.413000	S	L	f649c403c3...
S	9263	1	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	5b759c45d4...
S	9263	1	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	fcd946dd5a...
S	9263	1	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	09263d745e...
S	9263	1	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	e621f3a198...
S	9263	1	0	1420948	11:08:26.413000	S	L	a081066a3e...
S	9263	2	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	90a78cdbcd...
S	9263	1	1	1420948	11:08:26.413000	S	L	87498519b6...

[4. FWI080, 揭示檔]

檔名：FWI080_西元年月.zip/ I080_西元年月日.gz

NO.	欄位名稱	欄位說明	長度
-----	------	------	----

01	I080_DATE	日期 盤後交易時段為首筆揭示資料當天日期，如： 2017/7/3下午15:00開始交易至2017/7/4凌晨5:00之揭示資料，其日期皆為20170703	8(YYYYMMDD)
02	I080_PROD_ID	商品代號（單式） 1. 前3碼-商品種類(TXF-台指,MXF-小型台指,EXF-電子,FXF-金融,GBF-公債,CPF-利率,T5F-台灣50,GDF-黃金,MSF-摩根,TGF-臺幣計價黃金,XIF-非金電,GTF-櫃買,其它皆屬於股票期貨) 2. 第4碼-A~L(1~12月) 3. 第5碼-年份(西元年最後一位數) 商品代號（複式） 跨月價差委託：不同月份契約組成，如： MXFA6/C6，表示2006年小型台指1月3月價差商品	20
03	I080_W_TIME	時間	(以'\t'區隔)
04	I080_BUY_PQ	最佳買進五檔價量	(以'\t'區隔)
05	I080_SELL_PQ	最佳賣出五檔價量	(以'\t'區隔)
06	I080_DBUY_PQ	衍生委託單第一檔買進價量（2010/3/15後新增欄位）	(以'\t'區隔)
07	I080_DSELL_PQ	衍生委託單第一檔賣出價量（2010/3/15後新增欄位）	(以'\t'區隔)