

109 年度上半年證券商資訊主管  
業務座談會意見彙整表

# 109 年度上半年證券商資訊主管業務座談會意見彙整表

(最後更新日期：109.6.5)

## 壹、 線上報名及滿意度問卷提問

| 提問單位   | 提問內容                                                 | 回應內容                                                                                                                                          | 回應單位<br>(權責單位) |
|--------|------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| 逐筆交易議題 |                                                      |                                                                                                                                               |                |
| 證券商公會  | 請問證交所 FIX 委託線路未來支援特殊交易之規劃。                           | FIX 委託線路目前提供普通交易、盤後定價交易及盤後零股交易等業務，另預計 10 月 26 日提供盤中零股交易業務，各證券商可視需要將 TMP 委託線路轉換至 FIX 委託線路。另本公司已著手規劃 FIX 委託線路提供其餘特殊交易業務之系統建置時程。                 | 證交所            |
|        | 考量大型證券商因兼有經紀商及自營商之業務，現有 FIX 線路上限是否可放寬，或各別計算。         | 未來將視業務需要及系統效能整體評估研議。                                                                                                                          | 證交所            |
|        | 有關業者使用本公司基本市況報導網站「借券賣出可用餘額查詢網頁」，經常性遭拒絕存取，請證交所研議放寬限制。 | 為維持網路及主機資源之可用性，證交所針對資訊揭露網頁，設有頻率偵測規則，以減少因機器人爬網，導致一般使用者無法正常存取網頁之風險。<br>如業者因內部使用者，藉由少量外部 IP 存取本公司網頁，觸發頻率偵測規則，考量與一般使用者使用行為不同，需請業者自行調整外部 IP 之使用情形。 | 證交所            |
|        | 承上，請證交所規劃提供借券賣出可用餘額相關資訊之替代方案。                        | 現已有提供主機連線 File Transfer 方式取得借券賣出可用餘額之資訊。再行規劃使用者付費機制的資料傳輸方案。                                                                                   | 證交所            |

| 提問單位            | 提問內容                                                                 | 回應內容                                                                                                                   | 回應單位<br>(權責單位) |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| 元大證券            | 一般投資人因為不知道開盤後的第一盤撮合價格，開盤時以市價委託單不易成功。請問證交所是否可以提供相關解決方式。               | 依業務規定個股開盤後始可輸入市價委託，系統於 09:00 後啟動開盤作業，個股開盤後，即時以格式六(集中市場普通股競價交易即時行情資訊)傳送開盤資訊，格式六之「狀態註記」欄位會註明個股開盤訊息，以表示該股票已開盤，亦即可輸入市價委託單。 | 證交所            |
| 富邦證券            | 請問以原價進行委託單改價時，為何委託線路會被證交所斷線並暫停使用。                                    | 改價委託單之業務規定不得以原價格進行委託修改，否則本公司系統會回覆錯誤代碼”21”表示價格錯誤，並累加該線路之錯誤次數，若錯誤次數達限制次數後，會暫停該線路之使用，是以證券商進行改價委託，委託系統需檢核價格欄位不得以原價格輸入。     | 證交所            |
| <b>盤中零股交易議題</b> |                                                                      |                                                                                                                        |                |
| 台新證券            | 建議針對盤中零股交易新制加開討論會議                                                   | 本公司將配合參加券商公會召開之討論會議。                                                                                                   | 證交所            |
| 奇唯科技、大慶證券       | 1. 想要了解零股現股當沖的做法。<br>2. 零股當沖需要簽風險預告書？<br>3. 普通與零股可混合當沖？              | 有關盤中零股交易當沖時程及規劃，經主管機關核定於實施後一段時間再行評估，相關作法及辦法，本公司俟奉核後公告市場。                                                               | 證交所            |
| 全曜財經            | 1. 針對說明盤中零股的交易狀況跟案例太少，希望可以直接在文件上就有其說明。<br>2. 盤中零股交易是否也會有證券商分點買賣超的統計。 | 1. 盤中零股交易案例及作法，原則比照盤後零股採集合競價交易。<br>2. 如所稱「證券商分點買賣超」係指買賣日報表，盤中零股交易將納入統計。                                                | 證交所            |

| 提問單位              | 提問內容                                                                                                                                                 | 回應內容                                                          | 回應單位<br>(權責單位) |
|-------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|----------------|
| 大慶證券              | 是否在 040 加零股當沖欄位取代 060?                                                                                                                               | 為盤中零股需與盤後零股有所區隔，及預留未來業務彈性運用，系統規劃新增 060 檔案傳送。                  | 證交所            |
| 元富證券              | 若錯過零股市場會測時間，台北測試中心仍可持續測試?                                                                                                                            | 台北測試環境仍持續提供測試服務。                                              | 證交所            |
| 國票證券、奇唯科技         | 新種業務要推出時，能提前多一點時間公告相關系統規格文件讓證券商有比較充足的時程進行系統開發。同時能針對新種業務能召開說明會，讓證券商能了解業務的實際運作規範與執行方式，以便進行系統規劃，例如正在進行的零股盤中交易業務就沒有開相關的說明會，這對我們的電腦系統開發很多細節無法確認造成開發時程的延遲。 | 制度宣導說明會，一般於新制上線前一至兩個月前舉辦，盤中零股交易宣導說明會刻正規劃中，屆時將公布場次資訊，請證券商派員參加。 | 證交所            |
| <b>競價設備申請平台議題</b> |                                                                                                                                                      |                                                               |                |
| 元富證券              | 競價設備申請平台系統權限是否能分自營商及經紀商                                                                                                                              | 本公司將配合證券商之業務需求調整系統。                                           | 證交所            |

| 提問單位   | 提問內容                                                                       | 回應內容                                                                                                                                          | 回應單位<br>(權責單位) |
|--------|----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| 其他議題   |                                                                            |                                                                                                                                               |                |
| 永興證券   | 表示仍希望交易所能提供證券商可透過線上查詢歷屆資訊主管座談會提問與後續處理紀錄。                                   | 歷屆資訊主管座談會提問與後續處理紀錄，其內容可能會隨著法規變動調整作法及處理方式，為確保資訊的有效性，並避免證券商取得過時資訊造成誤會。證券商可隨時向證交所洽詢，以獲得即時且正確後續處理說明。                                              | 證交所            |
| 永興證券   | 新冠肺炎疫情帶動線上課程趨勢，請考慮全面採線上課程方式進行定期在職訓練。                                       | 前因疫情考量暫停辦理教育訓練課程之際，主管機關曾囑證券、期貨與投信顧等三個公會研議疫情期間視訊課程之可行性(但僅限疫情期間)，惟因目前疫情已趨緩和，且證券、期貨與投信顧等三個公會已自6月1日起恢復辦理所有教育訓練，採用實體課程方式授課，爰暫無規劃全面採線上課程方式進行定期在職訓練。 | 證券商公會          |
| 港商法國興業 | 周邊單位與相關測試環境是否未來有整合的機會，讓券商能有完整的測試模擬環境，如集保SMART，圈款圈券等。                       | 考量盤後結算交割業務繁多，進行集保相關作業完整的測試時間過於冗長，將洽證券商公會進一步研議是否合宜。                                                                                            | 證交所            |
| 中國信託證券 | 興櫃交易是否可提供單筆委託書的查詢，比照上市櫃FUN="05"的作業以提供快速確認該筆委託書是否已正常傳送至興櫃市場(如果查詢同時有成交數量更好)。 | 目前興櫃並無類似上市櫃FUN="05"查詢單筆委託單狀態之功能。本中心將會研擬於興櫃FIX通訊協定中增加單筆委託單與成交狀態查詢之功能。<br>現行興櫃交易系統可參考〔附件一〕查詢委託單狀態。                                              | 櫃買中心           |

## 附件一

親愛的證券業先進您好：

現行興櫃交易系統可藉由以下方式查詢委託單狀態，貴公司若有相關問題，可聯絡本中心。感謝您提供寶貴意見。

櫃買中心 邱先生 (02)2366-5933

### 1. 主機連線：

可經由 C10/C11 訊息來查詢，訊息格式資訊如下：

#### ● C10 查詢委託單歷史

| Standard Header  |    |        |       |                            |
|------------------|----|--------|-------|----------------------------|
| Body 格式如下        |    |        |       |                            |
| 欄位名稱             | 長度 | 格式     | Tag   | 說明                         |
| System Type      | 2  | 03     | 80001 | 系統別                        |
| Function ID      | 2  | 05     | 80002 | 功能代號                       |
| Message Type     | 2  | 10     | 80003 | 訊息代號                       |
| User Defined     | 8  | X(8)   | 80014 | 使用者自訂                      |
| Message Time     | 6  | HHMMSS | 80024 | 訊息時間                       |
| Status Code      | 4  | 0000   | 80004 | 狀態碼                        |
| Stock ID         | 6  | X(6)   | 55    | 股票代號<br>"???????" - 全部股票   |
| Broker ID        | 4  | X(4)   | 76    | 分公司券商代號<br>"?????" - 全公司   |
| Trader Number    | 5  | 9(5)   | 109   | 交易員編號<br>"?????" - 全部交易員   |
| Investor ID      | 7  | 9(7)   | 1     | 投資人帳號<br>"???????" - 全部投資人 |
| Start Time       | 6  | HHMMSS | 81006 | 起始時間<br>"???????" - 所有時間   |
| End Time         | 6  | HHMMSS | 81007 | 結束時間<br>"???????" - 所有時間   |
| Standard Trailer |    |        |       |                            |

● C11 查詢委託單歷史回覆

| Standard Header  |    |        |       |                                             |
|------------------|----|--------|-------|---------------------------------------------|
| Body 格式如下        |    |        |       |                                             |
| 欄位名稱             | 長度 | 格式     | Tag   | 說明                                          |
| System Type      | 2  | 03     | 80001 | 系統別                                         |
| Function ID      | 2  | 05     | 80002 | 功能代號                                        |
| Message Type     | 2  | 11     | 80003 | 訊息代號                                        |
| User Defined     | 8  | X(8)   | 80014 | 使用者自訂                                       |
| Message Time     | 6  | HHMMSS | 80024 | 訊息時間                                        |
| Status Code      | 4  | 9(4)   | 80004 | “0000” - 正常<br>“0001” - 無資料<br>“0002” - 無權限 |
| File Code        | 3  | X(3)   | 80008 | 結果檔案碼                                       |
| Standard Trailer |    |        |       |                                             |

● 查詢之結果檔案格式

| 欄位名稱          | 格式       | 說明        | 備註                                                                   |
|---------------|----------|-----------|----------------------------------------------------------------------|
| ID            | Char(6)  | 股票代號      |                                                                      |
| Order Number  | Char(5)  | 委託單號      |                                                                      |
| Broker ID     | Char(4)  | 委託證券商代號   |                                                                      |
| Order_Seq     | Char(7)  | 委託序號      |                                                                      |
| Inverstor ID  | Char(7)  | 投資人帳號     | 推薦券商為"0000000"                                                       |
| Order_Kind    | Char(1)  | 委託類別      | "1"-張<br>"2"-股                                                       |
| BuyOrSell     | Char(1)  | 買賣別       | "1"-買<br>"2"-賣                                                       |
| Price         | Char(10) | 價格        | 9(5).9(4)                                                            |
| Volume        | Char(8)  | 數量(股)     | 9(8)，扣除已成交的數量                                                        |
| Trader Number | Char(5)  | 交易員代碼     |                                                                      |
| Status        | Char(1)  | 委託狀況      | "1"-新增<br>"2"-修改結算方式<br>"3"-部分刪除<br>"4"-全部刪除<br>"5"-部分成交<br>"6"-全部成交 |
| Order Time    | Char(9)  | 委託時間      | HHMMSSmmm                                                            |
| Delimiter     | Char(2)  | 0x0D+0x0A | 換行符號                                                                 |

2. 可經由本中心提供的興櫃議價點選軟體提供的「委託明細查詢功能」查詢委託單目前的狀態：

- 開啟「委託明細查詢」視窗後，點選查詢，未指定查詢條件時，顯示所有成交明細資料。

中華民國證券櫃檯買賣中心 證券商: 8Y00 使用者: 8Y00前站01

檔案 成交查詢 委託 行情 標表檔案 系統維護 公告訊息 視窗 版本[2.02]版 專屬網路VPN

行情揭示 成交查詢 委託 報價 點燈成交

委託明細查詢 委託明細查詢 Ctrl+X

證券商: 全公司 交易代號: 全部 查詢起始時間: 查詢 列印 數量: 股票(股數)、基金(受益權單位)  
黃金(台兩) 價格: 黃金(元/每台錢)

交易員: 全部人員 投資人帳號: 查詢結束時間:

| 時間           | 交易代號 | 委託單號  | 市場序號    | 投資人帳號   | 買賣 | 價格       | 數量    | 交易員      | 券商   | 狀態   |
|--------------|------|-------|---------|---------|----|----------|-------|----------|------|------|
| 14:48:36.107 | 1240 | 10001 | 0000001 | 0000013 | 買  | 355.0000 | 2,000 | 8Y00前站01 | 8Y00 | 部分成交 |
| 14:45:00.189 | 1260 | 10002 | 0000002 | 0000013 | 買  | 12.0000  | 5,000 | 8Y00前站01 | 8Y00 | 新增   |
| 14:43:00.996 | 1240 | 10001 | 0000001 | 0000013 | 買  | 355.0000 | 5,000 | 8Y00前站01 | 8Y00 | 新增   |

查詢委託明細資料完成!

- 設定查詢條件後，點選查詢後進行資料篩選。目前提供「證券商」、「交易員」、「交易代號」、「投資人帳號」、「查詢起始時間」、「查詢結束時間」等篩選方式，使用者可同時設定多項條件進行資料篩選。

中華民國證券櫃檯買賣中心 證券商: 8Y00 使用者: 8Y00前站01

檔案 成交查詢 委託 行情 標表檔案 系統維護 公告訊息 視窗 版本[2.02]版 專屬網路VPN

行情揭示 成交查詢 委託 報價 點燈成交

委託明細查詢

證券商: 全公司 交易代號: 1240 查詢起始時間: 查詢 列印 數量: 股票(股數)、基金(受益權單位)  
黃金(台兩) 價格: 黃金(元/每台錢)

交易員: 全部人員 投資人帳號: 0000013 查詢結束時間:

| 時間           | 交易代號 | 委託單號  | 市場序號    | 投資人帳號   | 買賣 | 價格       | 數量    | 交易員      | 券商   | 狀態   |
|--------------|------|-------|---------|---------|----|----------|-------|----------|------|------|
| 14:48:36.107 | 1240 | 10001 | 0000001 | 0000013 | 買  | 355.0000 | 2,000 | 8Y00前站01 | 8Y00 | 部分成交 |
| 14:43:00.996 | 1240 | 10001 | 0000001 | 0000013 | 買  | 355.0000 | 5,000 | 8Y00前站01 | 8Y00 | 新增   |

查詢委託明細資料完成!