

檔 號：

保存年限：

臺灣證券交易所股份有限公司 公告

發文日期：中華民國109年2月26日
發文字號：臺證交字第1090200551號
附件：如文

主旨：因應盤中零股交易，修正本公司「上市股票零股交易辦法」部分條文及相關規章如附件一及附件二，並自109年10月26日起實施。

依據：金融監督管理委員會109年2月19日金管證交字第1090131464號函。

公告事項：

- 一、自109年10月26日起增加上午9:00至下午1:30零股交易買賣申報時段，既有盤後下午1:40至2:30之零股交易仍依現行機制維持運作。
- 二、盤中零股交易於上午9:10起第一次撮合，之後每3分鐘以集合競價撮合，依價格優先及時間優先原則成交，撮合後對外揭示成交價格及數量，以及未成交最佳5檔申報買賣價格、申報買賣數量等資訊，零股交易買賣申報應以限價為之，且限當日有效，未成交委託不保留至盤後零股交易時段。盤中零股交易買賣申報之優先順序依下列原則決定：
 - (一)價格優先原則：較高買進申報優先於較低買進申報，較低賣出申報優先於較高賣出申報。同價位之申報，依時間優先原則決定優先順序。
 - (二)時間優先原則：第一次撮合前輸入之申報，依電腦隨機排列方式決定優先順序；第一次撮合後輸入之申報，依輸入時序決定優先順序。
- 三、收受買賣申報期間實施試算行情資訊揭露，即自上午9:00起

裝

訂

線

第一次揭示，其後每隔10秒試算撮合後，揭露模擬成交價格、成交數量及最佳五檔申報買賣價格、申報買賣數量等資訊，至下午1:30止。

- 四、為避免因行情波動劇烈，致成交價超出投資人預期，除初次上市普通股採無升降幅度限制期間，依本公司章則規定施以延長撮合間隔時間之有價證券，及當市開盤競價基準低於一元者外，自第一次撮合成交後至申報時間截止前之一段時間(13:20)，實施價格穩定措施，如每次撮合前經試算成交價格漲跌超逾前一次成交價格之上下3.5%時，本公司立即對當次撮合延緩2分鐘，並繼續接受買賣申報之輸入、取消及變更，俟延緩撮合時間終了後依序撮合成交。價格穩定措施暫緩撮合期間，每10秒揭露模擬撮合成交價、量及最佳5檔買賣價量之訊息供投資人參考。
- 五、證券經紀商與委託人間就盤中零股交易之買賣委託及回報方式應依電子式交易型態之規定辦理，但委託人為專業機構投資人者，不在此限。
- 六、盤中零股交易預收款券方式同普通交易，惟為避免影響既有作業，爰變更交易方法之有價證券維持盤後零股交易不預收款券。
- 七、盤中零股交易由證券商自行選擇是否參與，參與證券商應向投資人清楚說明並揭示盤中零股交易手續費計收方式，其普通交易及盤中零股交易之電子式委託界面亦應有明顯區隔，暨加強證券從業人員與投資人宣導。

總經理 簡立忠