


# 逐筆交易 電腦修改說明

108年4月  
臺灣證券交易所  
電腦規劃部


# 大綱



- 修改內容



- 新種委託



- 瞬間價格穩定措施



- 改價委託



- 交易委託狀況代碼

# 修改內容說明

## 配合全面逐筆交易業務需求

- 委託格式新增
  - 「市價/限價」價格選項欄位
  - 「ROD/IOC/FOK」委託有效期欄位
  - 「改價」功能
- 進入集合競價階段，系統主動刪除市價委託單之回報作業
- 盤中瞬間價格穩定措施調整採5分鐘滾動式加權平均價計算

## 提升服務品質

- 委託與成交回報時間精準度提升至秒下3位

# 新種委託

除限價委託  
外，新增市  
價委託



除當日有效  
(ROD)委託外，  
新增IOC與  
FOK委託

## 委託種類組合

- 限價ROD
- 市價ROD
- 限價IOC
- 市價IOC
- 限價FOK
- 市價FOK

# 市價委託

## 業務說明

- 投資人以市價單委託無須指定價格
- 撮合順序優先於限價委託
- 受託買賣額度、預收款項等，以漲停價計算

## 輸入限制

- 僅適用於逐筆交易時段，集合競價時段不可輸入
- 平盤以下不得放空之證券，不可使用市價委託融券或借券賣出(不受限之避險帳號除外)
- 首五日及無漲跌幅之有價證券不適用
- 處置及變更交易方法證券不適用(採集合競價)
- 委託價格欄位必須輸入0

# IOC/FOK委託

## 業務說明

- IOC指委託必須立即成交，未能立即成交之剩餘委託由系統剔除
- FOK指委託必須立即全數成交，未能立即全數成交立即由系統剔除

## 輸入限制

- 僅適用於逐筆交易時段，集合競價時段不可輸入

## 委託回報

- 增加部分成交、未能成交、碰觸價格穩定措施等委託回報狀況註記碼
- 詳電腦作業手冊範例說明

# 瞬間價格穩定措施

- 5分鐘滾動式加權平均價之計算
  - 5分鐘內之每筆成交價以成交量加權後，除以總成交量得到平均價
- 瞬間價格穩定措施參考價之決定順序
  - 以5分鐘內集合競價成交價為參考價。
  - 以5分鐘滾動式加權平均價為參考價
  - 以最近一次成交價為參考價

## ● 各類委託觸動瞬間價格穩定措施之處理方式

委託種類	成交價格未達穩價部分	成交價格超過穩價部分	個股是否進入價格穩定
一般限價	成交	留存委託簿	是
FOK委託	整筆委託取消不成交		否
IOC委託	成交	自動取消	否
一般市價	成交	自動取消	否



# 改價委託

## 業務說明

- 新增委託後，投資人可直接改價，原委託時間調整為改價後時間(撮合順序改變)

## 輸入限制

- 僅可限價改限價，不可限價改市價，或市價改限價
- 新價格不可與原價格相同
- 平盤下不得賣出限制之個股，不可改價為平盤以下價格
- 限制各證券商申報買進或賣出金額之處置證券(T30之委託限制註記)，考量額度計算，不提供改價功能
- 信用交易種類選項必須與原委託相同

# 委託回報代碼

Status Code	訊息內容	證券商應辦理事項
31	委託數量扣減	外資買進、借券賣出委託數量被刪減 IOC委託部分成功，其餘數量被刪減
46	價格選項錯誤	請檢查並更正價格選項欄位
47	委託有效期欄位錯誤	請檢查並更正委託有效期間資料
48	IOC/FOK無對象成交	請重新輸入委託
49	集合競價時段不接受 IOC/FOK/市價	修改委託價格種類/委託有效期等欄位
51	該委託觸及價格穩定措施上下限，委託數量扣減	市價/IOC 因部分觸及價格穩定措施而被刪減數量，價格穩定措施範圍內之數量委託成功
52	該委託觸及價格穩定措施上下限，委託失敗	市價/IOC/FOK 因觸及價格穩定措施而無法成交
53	該筆委託不接受改價	改價僅可限價改限價，或委託申報受限證券不接受改價，請取消原委託後再重新輸入



**TAIWAN**  
STOCK EXCHANGE

簡報結束

**Thank you!**

臺灣證券交易所