逐筆交易
TMP主機連線修改說明

107年11月
臺灣證券交易所
電腦規劃部

大綱

- 作業時程
- 修改內容
- 新種委託
- 訊息格式
- 交易委託狀況代碼
- 委託範例

作業時程

13:30
- 傳送交易相關檔案(T30等)
- 接受連線

14:30
- 開始接受委託

14:35
- 逐筆交易開盤

17:00
- 逐筆交易收盤

修改內容(1)

全面逐筆交易業務需求

- 委託新增「改價」功能
- 委託格式新增欄位
  - 委託方式欄位：“1” 市價， “2” 限價
  - 委託時效類別欄位：「ROD/IOC/FOK」
- 進入集合競價時段：系統刪除委託簿市價委託(回報T88)
- 瞬間價格穩定措施：採5分鐘滾動式計算加權平均價

修改內容(2)

配合價格欄位擴充案

- 價格相關選項由整數4位小數2位擴充為整數5位小數4位

提升服務品質並預留未來彈性

- 委託與成交回報時間精準度到秒下3位(毫秒)
- 數量欄位擴充為整數6位

新增委託種類

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

市價委託

市價委託限制

- 僅適用於逐筆交易時段
- 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)
- 受託買賣額度、預收款項等，以漲停價計算

IOC/FOK委託

業務說明

- IOC：委託立即成交，未能成交之剩餘委託由系統剔除
- FOK：委託立即全部成交，未能全部成交則系統全部剔除

IOC/FOK委託限制

- 僅適用於逐筆交易時段

委託回報狀態訊息碼

- 額度控管刪減、部分成交/未能成交、價格穩定措施等委託回報狀態訊息碼
- 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參考價之計算
- 瞬間價格穩定措施參考價之決定
- 各類委託觸動瞬間價格穩定措施之處理方式

委託種類	未達穩價部分	達穩價部分	進入穩價
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)

改價委託限制

- 僅可限價改限價，不可限價改市價，或市價改限價
- 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)，不提供改價功能

連線協定訊息HEADER

欄位名稱	長度	中文說明	備註
SUBSYSTEM-NAME	9(2)	系統別	30:普通交易系統 50:成交回報系統
FUNCTION-CODE	9(2)	功能	01:買進 02:賣出 03:減量 04:取消 05:查詢 06:改價
MESSAGE-TYPE	9(5)	訊息種類	
MESSAGE-TIME	9(6)	訊息時間	
STATUS-CODE	9(2)	狀態訊息碼	

TAIWAN STOCK EXCHANGE

委託輸入格式BODY（T010）

竭誠為您服務

欄位名稱	長度	中文說明	新格式	備註
BROKER-ID	X(4)	證券商代號		
PVC-ID	X(2)	連線ID		
ORDER-NO	X(5)	委託書編號		
IVACNO	X(7)	投資人帳號		
IVACNO-FLAG	X(1)	投資人下單類別		
STOCK-NO	X(6)	證券代號		
PRICE	9(4)V99	委託價格	9(5)v9(4)	價格欄位擴增
QUANTITY	9(3)	委託數量	9(6)	保留擴充彈性
BUY-SELL-CODE	X(1)	買賣別		
EXCHANGE-CODE	9(1)	交易種類		
ORDER-TYPE	X(1)	委託種類		
PRICE-TYPE		委託方式	X(1)	限價或市價
TIME-IN-FORCE		委託時效類別	X(1)	當日有效、FOK 或 IOC

委託回報格式BODY(T020)

欄位名稱	長度	中文說明	新格式	備註
STOCK-NO	X(6)	證券代號		
PRICE	9(4)V99	委託價格	9(5)v9(4)	價格欄位擴增
QUANTITY	9(3)	委託數量	9(6)	保留擴充彈性
BUY-SELL-CODE	X(1)	買賣別		
EXCHANGE-CODE	9(1)	交易別		
ORDER-TYPE	X(1)	委託種類		
PRICE-TYPE		委託方式	X(1)	限價或市價
TIME-IN-FORCE		委託時效類別	X(1)	當日有效、FOK 或 IOC
ORDER-DATE	9(6)	委託日期	9(8)	西元年月日
ORDER-TIME	9(6)	委託時間	9(9)	提升資訊品質
BEFORE-QUANTITY	9(3)	減量前有效數量	9(6)	保留擴充彈性
AFTER-QUANTITY	9(3)	減量後有效數量	9(6)	保留擴充彈性

成交回報格式BODY

欄位名稱	長度	中文說明	未來	備註
STOCK-NO	X(6)	證券代號		
MTHQTY	9(8)	成交數量		
MTHPR	9(4)V99	成交價格	9(5)v9(4)	保留擴充彈性
MTHTIME	9(8)	成交時間	9(9)	提升資訊品質
EXCHANGE-CODE	X(1)	交易種類		
BUY-SELL-CODE	X(1)	買賣別		
ORDER-NO	X(5)	委託書編號		
IVACNO	X(7)	投資人帳號		
ORDER-TYPE	X(1)	委託種類		
SEQNO	9(6)	流水號		
BROKER-ID	X(4)	證券商代號		
RECNO	9(8)	成交總檔編號		
MARK-S	X(1)	補送註記		

證交所主動取消之委託回報

檔案名稱：交易所端主動取消市價委託單資料檔
檔案長度：30　　檔案代號：T88

欄位名稱	屬性	位置-長度	項目說明	備註
BROKER-ID	X(4)	1 - 4	證券商代號	
ODRER-NO	X(5)	5 - 5	委託書編號	
STOCK-NO	X(6)	10 - 6	證券代號	
ORDER-TIME	9(9)	16 - 9	委託回報時間	
BEFORE-QUANTITY	9(6)	25 - 6	改前數量	

- 作業時間 09:00~14:00
- 以FT方式主動傳送予連線證券商
- 提供證券商要求補傳功能

交易委託狀況代碼修改說明

Status Code	訊息內容	訊息代號	證券商應辦理事項
31	QUANTITY WAS CUT	T020	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	PRICE-TYPE ERROR	T030	檢查並更正價格型態註記
47	TIME-IN-FORCE ERROR	T030	請檢查並更正委託有效期間資料
48	IOC、FOK委託未能成交，委託失敗	T030	請重新輸入委託
49	集合競價時段不可輸入市價、IOC、FOK委託	T030	請檢查並更正價格型態及委託有效期間欄位資料
51	委託觸及價格穩定措施上、下限價格，部分委託成功	T020	市價、IOC委託部分成功，其餘數量被刪減
52	委託觸及價格穩定措施上、下限價格，未能成交，委託失敗	T030	市價、IOC、FOK委託失敗，請重新輸入委託
53	該筆委託不接受改價	T030	僅可限價改限價，且異常股票不接受改價

TAIWAN
STOCK EXCHANGE

簡報結束

Thank you!

臺灣證券交易所