**中華民國證券櫃檯買賣中心**

|  |
| --- |
| **等價交易電腦作業手冊** |

等價交易作業手冊修改紀錄

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 修改日期 | 修 改 內 容 說 明 | 版本 |
| 990831 | 配合得不以1000受益權單位為限，未來證券可採非千股為交易單位之彈性，數量單位定義，取消張數/千股/仟股字眼，而以「交易單位」表示。  新增「第二上櫃外國股票暨非千股(受益權單位)交易單位有價證券資料檔」T32 | V2.0 |
| 990916 | FIX平台委託資料接收作業T72。 | V2.2 |
| 1000114 | 新增「當日無成交之調整參考價格檔(T73)」傳送作業，於收盤後傳送。  (實施日期：100/03/28)  因ETF樣本調整日盤中停止交易作業，新增Status Code:45  (實施日期：100/03/15) | V2.3 |
| 1000411 | 1. 修改T30檔案格式中LDC-PRICE項目說明為開始交易基準價。 2. 配合「盤中暫停/恢復交易案」，新增錯誤代碼”43”，代表該股票已暫停交易，不允許委託輸入作業。 3. 配合「盤中暫停/恢復交易案」，新增「暫停交易證券成交統計檔(T75)」傳送作業。 4. 配合「收盤前資訊揭露案」，新增錯誤代碼”45”，代表該股票已收盤，不允許委託輸入作業。 5. 配合「盤中暫停/恢復交易案」，新增「T74暫停/恢復交易證券明細及時間檔」。 | V2.4 |
| 1000517 | 新增「權證到期結算價資料檔(T77)」傳送作業。 | V2.5 |
| 1000822 | 配合「盤中暫停/恢復交易案」未成交委託改為有效：  1.刪除「暫停交易證券成交統計檔(T75)」傳送作業。  2.修改等價交易錯誤訊息代碼註1說明，當盤中暫停交易後，證券商可進行減量、取消及查詢等委託作業。 | V2.6 |
| 1001003 | 新增處置或通知注意證券資訊檔(T78) | V2.7 |
| 1001117 | 1. 配合「中華民國證券市場編碼原則」修訂，增加以存託憑證為轉換或履行標的之公司債商品，T30檔案格式中新增表二「證券種類及證券代號對照表」，以對照表方式說明。 2. 因應未來面額非10元證券上櫃掛牌，T30檔案格式新增面額註記欄位。 | V2.8 |
| 1020114 | 配合「中華民國證券市場編碼原則」修訂，修 改T30檔案格式中表二「證券種類及產業類別 代碼對照表」，修改轉換公司債、交換公司債及交換金融債編碼原則。 | V2.9 |
| 1020816 | 產業類別與分類碼對照表中增加「文化創意業」代碼對照。(預定實施日期：民國103年1月6日) | V3.0 |
| 1020909 | 因應擴大平盤下可融(借)賣出之標的，修改T30檔案格式中註七及註九之說明 | V3.1 |
| 1021104 | 因應現股當日沖銷交易制度實施，T30檔案格式新增可先買後賣現股當沖註記。  (實施日期：民國103年1月06日) | V3.2 |
| 1030408 | 開放「現股先賣後買當日沖銷」交易制度實施，增修T30檔案「現股當沖」欄位說明及內容值註記。 | V3.3 |
| 20140630 | 新增T81特別注意事項證券資訊檔。 | V3.4 |
| 20140707 | 特別注意事項證券資訊檔(T81)中「簽署類別代碼註記」欄位將定義新簽署類別代碼。  配合「中華民國證券市場編碼原則」修訂，修改T30檔案格式中表二「證券種類及產業類別 代碼對照表」，增加可展延型牛熊證、槓桿型ETF、反向型ETF及期信託ETF。 | V3.5 |
| 1031001 | 1. 新增錯誤代碼”50”，代表該筆委託已無剩餘委託量。 上線日期：103/12/29 2. 新增國際證券識別碼(ISIN code)資訊檔(T82)   上線日期：103/11/3 | V3.6 |
| 1040210 | 應券商公會需求，修改特別注意事項證券資訊檔(T81)中「簽署類別代碼註記」欄位將增定義專業機構投資人簽署類別代碼。  預訂上線日期為：104/04/13 | V3.7 |
| 1040630 | 配合證券簡稱位元組擴充方案，修改漲跌幅度資料檔(T30)格式中「股票中文名稱」欄位長度  (實施日期：民國104年10月19日) | V3.8 |
| 1040731 | 配合「證券商受理投資人使用應用程式介面(API)服務作業規範」，委託輸入訊息(T010)格式中投資人下單類別(IVACNO-FLAG) 新增定義“P”- API委託下單。  (實施日期：民國104年09月14日) | V3.9 |
| 1070925 | 1. 配合全面逐筆交易案及價格欄位擴充案之實施，新增「價格委託種類」與「委託時間有效期」欄位，及新增「改價委託」功能，並放寬時間、數量及價格欄位長度等相關調整項目，修訂一般委託訊息、成交回報訊息格式，及檔案傳輸格式。 2. 檔案傳輸子系統新增傳送「櫃買中心端主動取消市價委託單資料檔」(檔案代號T88)。   (實施日期：民國109年03月23日) | V5.0 |
| 1080628 | 1. . 配合全面逐筆交易案手冊修訂項目如下：    1. 調整status code “30”, “48”, “49”, “51”, “52”訊息內容說明。    2. 修正改價委託範例說明，改價委託成功BF-Qty欄位值以0回覆。 2. . 刪除status code “39”，投信不可買賣二類股相關說明。   (實施日期：民國109年3月23日) | V5.1 |
| 1100312 | 配合興櫃戰略新板，漲跌幅度資料檔(T30)格式中新增「板別註記」欄位；風險預告書或特別注意事項證券資訊檔(T81)中「簽署類別代碼註記」欄位新增定義說明。  (實施日期：民國110年06月28日) | V5.2 |
| 1110407 | 修改T30檔案格式中表二「證券種類及產業類別代碼對照表」，增加期權策略型指數投資證券ETN證券代號定義。 (實施日期：民國111年4月25日) | V5.3 |

20.檔案名稱︰漲跌幅度資料檔

檔案長度︰100　　檔案代號︰T30

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 階層碼/項目名稱 | 屬性 | 位置-長度 | 項目說明 | 備註 |
| 01 STOCK-NO | X(6) | 1 - 6 | 股票代號 |  |
| 01 BULL-PRICE | 9(5)V9(4) | 7 - 9 | 漲停價 |  |
| 01 LDC-PRICE | 9(5)V9(4) | 16 - 9 | 開始交易基準價 |  |
| 01 BEAR-PRICE | 9(5)V9(4) | 25 - 9 | 跌停價 |  |
| 01 LAST-MTH-DATE | 9(8) | 34 - 8 | 上次成交日 |  |
| 01 SETTYPE | X(01) | 42 - 1 | 交易方式 | 註1 |
| 01 MARK-W | X(01) | 43 - 1 | 處置股票註記 | 註2 |
| 01 MARK-P | X(01) | 44 - 1 | 注意股票註記 | 註3 |
| 01 MARK-L | X(01) | 45 - 1 | 委託限制註記 | 註4 |
| 01 IND-CODE | X(02) | 46– 2 | 產業別代碼 | 註5 |
| 01 IND-SUB-CODE | X(02) | 48– 2 | 證券別代碼 | 註6 |
| 01 MARK-M | X(01) | 50– 1 | 豁免平盤下融券賣出註記 | 註7 |
| 01 STOCK-NAME | X(16) | 51–16 | 股票中文名稱 |  |
| 01 MARK-W-DETAILS |  |  | 處置股票資訊 | 註8 |
| 02 MATCH-INTERVAL | 9(03) | 67---3 | 撮合循環時間（分） |
| 02 ORDER-LIMIT | 9(06) | 70---6 | 單筆委託限制（張） |
| 02 ORDERS-LIMIT | 9(06) | 76---6 | 多筆委託限制（張） |
| 02 PREPAY-RATE | 9(03) | 82---3 | 款券預收成數（%） |
| 01 MARK-S | X(01) | 85---1 | 豁免平盤下借券賣出註記 | 註9 |
| 01 STK-MARK | X(01) | 86---1 | 類股註記 | 註10 |
| 01 MARK-F | X(01) | 87---1 | 面額註記 | 註11 |
| 01 MARK-DAY-TRADE | X(01) | 88---1 | 可現股當沖註記 | 註12 |
| 01 STK-CTGCD | X(01) | 89---1 | 板別註記 | 註13 |
| 01 FILLER | X(11) | 90--11 | 空白 |  |

說明︰

註1︰SETTYPE值為0時，表示此股票為一般股票

SETTYPE值為1時，表示此股票為變更交易股票（需收足款券）

SETTYPE值為2時，表示此股票為變更交易（需收足款券）且採分盤交易（分盤撮合時間參考「註8」MATCH-INTERVAL欄位說明）

SETTYPE值為3時，表示此股票為管理股票（需收足款券），依規定須採分盤交易（分盤撮合時間參考「註8」MATCH-INTERVAL欄位說明）

註2︰依據本中心「公布或通知注意交易資訊暨處置作業要點」第六點：

MARK-W值為0時，表示此股票狀態正常

MARK-W值為1時，表示此股票為處置股票  
MARK-W值為2時，表示此股票為再次處置股票  
MARK-W值為3時，表示此股票為其他處置股票，須依本中心公告內容為準。

註3︰依據本中心「公布或通知注意交易資訊暨處置作業要點」第四點：

MARK-P值為0時，表示此股票狀態正常

MARK-P值為1時，表示此股票為注意股票

註4：依據本中心「公布或通知注意交易資訊暨處置作業要點」第六條第三項：

MARK-L值為0時，表示此股票狀態正常

MARK-L值為1時，表示此股票為證券商委託申報受限股票

註5︰代表該證券之所屬產業別代碼，產業別代碼請參考表一說明。

* + 1. 因應新制證券編碼規則，證券所屬產業類別將無法再從證券代碼前兩碼直接判斷，因此所有具有產業特性的一般股票及其所屬特別股，請改由本欄位判斷其所屬產業別。
    2. 前項所指特別股包含特別股、附認股權特別股及附認股權股款繳納憑證、換股權利證書等，須特別注意的是本欄位僅提供產業別代碼，至於該證券為特別股或是附認股權特別股等判斷，仍須依照原證券編碼規則自行判斷(請參照表二)。
    3. 其餘不具產業屬性的證券如受益憑證(封閉式基金)、認購(售)權證、存託憑證、外國股票、附認股權公司債履約後之公司債、轉換公司債及附認股權公司債等，本欄位值皆為”00”，並請依照原證券編碼規則自行判斷本項各類證券(請參照表二)。

註6︰代表該證券之所屬證券別代碼，證券別代碼請參考表三說明。因為有些證券具有無法從證券代碼直接判斷的特殊意義(例如認購售權證等比例/不等比例發行)，本欄位將提供用於判斷這類特殊性質。

註7：代表該證券「融券賣出價格」是否得低於當日開盤參考價。所含證券種類為經主管機關同意豁免平盤下融券賣出之各類證券。

MARK-M值為0時，表示該證券融券賣出價格受限制，不得低於當日開盤參考價。  
MARK-M值為1時，表示該證券融券賣出價格得低於當日開盤參考價。

註8：「處置股票資訊」各項欄位僅為該有價證券之處置措施，如有其他限制規定(如變更交易股票、委託申報受限股票等)，仍須符合該項業務規定。  
本項各欄位『除MATCH-INTERVAL欄位外』，在「處置股票註記」MARK-W不為0時才有資料，否則皆為初始值0。

MATCH-INTERVAL：該有價證券以人工管制撮合終端機執行撮合作業時間間距，資料單位：（分鐘）。

8.1 若MARK-W為0且SETTYPE值為2時， 此欄位為變更交易且採分盤交易股票之撮合循環時間。

8.2若MARK-W不為0且SETTYPE值為0或1時，此欄位為處置股票之撮合循環時間。

8.3若MARK-W不為0且SETTYPE值為2時，此欄位為處置股票或分盤交易之撮合循環時間較大者。

8.4若MARK-W不為0且SETTYPE值為3時，此欄位為處置股票或管理股票分盤交易之撮合循環時間較大者。

ORDER-LIMIT ：該有價證券委託單筆達此張數時，應向投資人依PREPAY-RATE預收款券，資料單位：（張）。

ORDERS-LIMIT ：該有價證券委託多筆累積達此張數時，應向投資人依PREPAY-RATE預收款券，資料單位：（張）。

PREPAY-RATE ：款券預收成數，資料單位：（百分比）。例：五成，資料為050。

註9：代表該證券「借券賣出價格」是否得低於當日開盤參考價。所含證券種類為經主管機關同意豁免平盤下借券賣出之各類證券。

MARK-S值為0時，表示該證券借券賣出價格受限制，不得低於當日開盤參考價。

MARK-S值為1時，表示該證券借券賣出價格得低於當日開盤參考價。

註10：代表該證券是否為中小企業股票。預設值為”0”。紀錄值為”1”時表示個股為中小企業股票（名稱暫定，認定標準本中心正式公告為準）。

註11：MARK-F值為0時，表示該證券面額正常。  
 MARK-F值為1時，表示該證券面額非10元。

註**12：**代表該證券得否現股當日沖銷。  
MARK-DAY-TRADE值為Y時，表示該證券可先買後賣現股當沖。  
MARK-DAY-TRADE值為X時，表該證券可先買後賣或先賣後買現股當沖。  
MARK-DAY-TRADE值為空白時，表示該證券不可現股當沖。

註13：代表該證券是否為興櫃戰略新板證券。預設值為”0”。值為”3”時表示為興櫃戰略新板證券。**表一：產業類別與分類碼對照表** \*保留代號07、13

|  |  |
| --- | --- |
| **上櫃公司產業類別** | **編碼** |
| -- | 01 |
| 食品工業 | 02 |
| 塑膠工業 | 03 |
| 紡織纖維 | 04 |
| 電機機械 | 05 |
| 電器電纜 | 06 |
| 化學工業 | 21 |
| 生技醫療業 | 22 |
| 玻璃陶瓷 | 08 |
| -- | 09 |
| 鋼鐵工業 | 10 |
| 橡膠工業 | 11 |
| -- | 12 |
| 半導體業 | 24 |
| 電腦及週邊設備業 | 25 |
| 光電業 | 26 |
| 通信網路業 | 27 |
| 電子零組件業 | 28 |
| 電子通路業 | 29 |
| 資訊服務業 | 30 |
| 其他電子業 | 31 |
| 建材營造 | 14 |
| 航運業 | 15 |
| 觀光事業 | 16 |
| 金融業 | 17 |
| 貿易百貨 | 18 |
| 油電燃氣業 | 23 |
| -- | 19 |
| 其他 | 20 |
| 文化創意業 | 32 |
| 農業科技 | 33 |
| 電子商務 | 34 |
| 管理股票 | 80 |

**表二：證券種類及產業類別代碼對照表**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **證券種類名稱** | | **證券代號** | **產業別代碼** |
| 一般股票 | | 1000-9999 | XX  （註1） |
| 一般特別股 | | 股票 + 第五碼 A ~ W |
| 換股權利證書 | | 股票 + 第五碼 X ~ Z |
| 附認股權特別股 | | 股票 + 第五碼 G +第六碼A ~ C |
| 受益憑證 (封閉式基金) | | 000101-004999 (註3) | 00  （註2） |
| ETF | | 00501-00999+第六碼空白 (註4) |
| ETF(外幣計價） | | 00501-00999+第六碼K |
| 債券ETF | | 00501-00999+第六碼B |
| 債券ETF(外幣計價） | | 00501-00999+第六碼C |
| 槓桿型ETF | | 00501-00999+第六碼L |
| 槓桿型ETF(外幣計價） | | 00501-00999+第六碼M |
| 反向型ETF | | 00501-00999+第六碼R |
| 反向型ETF(外幣計價） | | 00501-00999+第六碼S |
| 期信託ETF | | 00501-00999+第六碼U |
| 期信託ETF(外幣計價） | | 00501-00999+第六碼V |
| 不動產資產信託受益證券 | | 01000-01999+第六碼P |
| 金融資產證券化受益證券 | | 01000-01999+第六碼S |
| 不動產投資信託受益證券 | | 01000-01999+第六碼T |
| ETN | | 020000-029999 |
| 債券型ETN | | 02000-02999+第六碼B |
| 槓桿型ETN | | 02000-02999+第六碼L |
| 反向型ETN | | 02000-02999+第六碼R |
| 期權型ETN | | 02000-02999+第六碼S |
| 集  中  市  場  權  證 | 國內標的認購權證 | 030000-089999 |
| 國內標的認售權證 | 03000-08999+第六碼P |
| 外國標的認購權證 | 03000-08999+第六碼F |
| 外國標的認售權證 | 03000-08999+第六碼Q |
| 下限型認購權證 | 03000-08999+第六碼C |
| 上限型認售權證 | 03000-08999+第六碼B |
| 可展延型下限型認購權證 | 03000-08999+第六碼X |
| 可展延型上限型認售權證 | 03000-08999+第六碼Y |
| 櫃  買  中  心  權  證 | 國內標的認購權證 | 700000-739999 |
| 國內標的認售權證 | 70000-73999+第六碼P |
| 外國標的認購權證 | 70000-73999+第六碼F |
| 外國標的認售權證 | 70000-73999+第六碼Q |
| 下限型認購權證 | 70000-73999+第六碼C |
| 上限型認售權證 | 70000-73999+第六碼B |
| 可展延型下限型認購權證 | 70000-73999+第六碼X |
| 可展延型上限型認售權證 | 70000-73999+第六碼Y |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **證券種類名稱** | **證券代號** | **產業別代碼** |
| 存託憑證TDR | 910001-919999 (註3) |  |
| 存託憑證可轉換公司債 | 9100-9199+第五碼C+第六碼1~9 |
| 存託憑證附認股權公司債 | 9100-9199+第五碼G+第六碼D~L |
| 存託憑證附認股權公司債履約後之公司債 | 9100-9199+第五碼F+第六碼1~9 |
| 存託憑證認股權憑證 | 9100-9199+第五碼G+第六碼1~9 |
| (保留) | 9201-9299 |
| 外國股票 | 9301-9499 |
| 轉換公司債 | 股票+第五碼1~9+第六碼空白,0~9 |
| 交換公司債及交換金融債 | 股票 + 第五碼0 +第六碼1 ~ 9 |
| 認股權憑證 | 股票 + 第五碼G +第六碼1 ~ 9 |
| 附認股權公司債 | 股票 + 第五碼G +第六碼D ~ L |
| 附認股權公司債履約後之公司債 | 股票 + 第五碼F +第六碼1 ~ 9 |

註1：一般證券及特別股之產業類別代碼以該所屬產業分類碼表示，請參考表一。

註2：不屬產業之特殊證券不設產業類別，以”00”表示，可由證券代號判斷分類。

註3：所訂之受益憑證(封閉式基金)、存託憑證(TDR)六碼編碼原則，適用於 98年12月15日以後新上櫃之證券，以前編定之證券代號仍以維持4碼為原則。

註4：所訂之ETF編碼原則，適用於103年6月24日以後新上櫃之證券，以前編定之證券代號仍以維持4碼或6碼為原則。

註 5：09開頭證券編碼保留。

**表三：證券別代碼表**

|  |  |
| --- | --- |
| **代碼** | **意義** |
| W1 | 認購權證、等比例發行(公開發行時原始轉換標的股數為1000) |
| W2 | 認購權證、不等比例發行(公開發行時原始轉換標的股數不為1000) |
| W3 | 認售權證、等比例發行(公開發行時原始轉換標的股數為1000) |
| W4 | 認售權證、不等比例發行(公開發行時原始轉換標的股數不為1000) |
| BS | 本國企業上櫃屬證券股 |
| FB | 本國企業上櫃屬銀行股 |
| 空白 | 其他本國企業上櫃證券 |
| RR | 其它外國企業上櫃證券 |
| RS | 外國企業上櫃屬證券股 |
| RB | 外國企業上櫃屬銀行股 |