

興櫃股票交易系統主機連線注意事項

111/10/17

本文件說明證券商自行開發程式或購買第三方軟體與興櫃股票交易系統資訊伺服器連線交易時，應行注意事項。

一、連線異常排除後之處理機制

若證券商因設備、線路或程式發生異常而無法確認報價單、委託單及成交回報之狀況時，於異常排除後，應查詢斷線前之委託單、報價單及成交回報情形，以避免重複下單，查詢程序如下：

1. 重新進行連線登入。
2. 委託查詢。
若前次連線送出新增(001)、修改(002)或刪除(003)委託單後，發生因系統異常而未收到委託單回報訊息(020)時，須於以前次相同之使用者帳號重新登入系統後，送出**委託歷史查詢(C10)**，由回覆訊息 C11 取得本日委託歷史查詢檔(註 1)，以檢查委託單狀態。若有該委託單號則表示傳送成功；若無該委託單號則表示傳送失敗而應重送，以避免重複下單之情形。
3. 報價查詢。
若為推薦券商，應進行報價查詢。須於以前次之使用者帳號重新登入系統後，送出**本身報價查詢(C15)**，由回覆訊息 C16 取得本身證券商報價資料檔，檔案內容包含證券商目前所有推薦股票之報價資料。
4. 成交查詢。
上述流程完成後，送出**成交資料查詢(C22)**，由回覆訊息 C23 取得成交查詢資料檔(註 2)，以確認成交狀態。

註 1: 委託歷史查詢檔之內容依使用者權限不同而異：

- (1) 具分公司交易員或 KEY IN 人員權限者：僅能查詢本身之委託單歷史狀態。
- (2) 具分公司後台人員權限者：可查詢該分公司所有委託單歷史狀態。
- (3) 具總公司交易員或 KEY IN 人員權限者：僅能查詢本身之委託單歷史狀態。
- (4) 具總公司後台人員權限者：可查詢該總、分公司所有委託單歷史狀態。

註 2：成交查詢資料檔之內容依使用者權限不同而異：

- (1) 具分公司交易員或 KEY IN 人員權限者：僅能查詢本身之成交資料。
- (2) 具分公司後台人員權限者：可查詢該分公司所有成交資料。
- (3) 具總公司交易員或 KEY IN 人員權限者：僅能查詢本身之成交資料。
- (4) 具總公司後台人員權限者：可查詢該總、分公司所有成交資料。

註 3：證券商可使用本中心提供之興櫃證券商端應用軟體做為備援之用。於自行開發或購買之主機連線軟體發生異常期間，使用本中心軟體進行後續交易，相關作業說明如下：

1. 證券商需事前安裝本中心興櫃證券商端應用軟體，以利於異常發生時可切換使用。
2. 使用本中心軟體時，應使用與原主機連線下單時之帳號，登入成功後再依貴公司需求進行委託單查詢、修改及刪除等作業。（進行委託單修改或刪除時，須使用與委託單新增時之**使用者帳號**方可進行修改或刪除）

二、資訊伺服器與櫃買交易主機斷線之處理機制

1. 當資訊伺服器與交易主機斷線時，資訊伺服器會發送**中心端離線通知 (L98, Status Code=0000)** 通知，使用者之登入狀態改變為“部分登入”，此時客戶端若發送交易相關訊息（如委託單、報價單、交易單），資訊伺服器因無法傳送訊息至櫃買交易主機，系統會回覆**無法傳送屬完全登入狀態下之訊息(L99)**，表示此交易訊息傳送失敗。
2. 當資訊伺服器與櫃買交易主機恢復連線後，資訊伺服器會發送**中心端離線通知 (L98, Status Code=0001)** 通知，此時客戶端須先斷線，並依上述**連線異常排除後之處理機制**，重新連線登入及資料查詢。

三、自行開發或購買與資訊伺服器連線之軟體應具防錯警示機制

為避免因人為錯誤而造成價格或股數誤植情形，證券商自行開發程式或購買第三方軟體與興櫃股票交易系統資訊伺服器連線交易時，相關軟體應具備防錯警示功能，說明如下：

1. 證券商自行開發程式購買第三方軟體時，相關軟體應具防錯警示機制，包括「報價輸入」、「委託輸入」及「點選交易」等功能之檢核機制，以降低人為誤植價格或股數機率。
2. 本中心與櫃證券商端應用軟體提供防錯警示功能如下，貴公司相關軟體若無防錯警示機制，建議參考比照：

報價輸入	穿價警示	<ul style="list-style-type: none"> • 報買價\geq市場最佳報賣價 • 報賣價\leq市場最佳報買價
報價輸入	報價價格警示 (警示比例可自行調整)	<p>先比較市場最近成交價，若無市場最近成交價則比較前日均價 (08:30~09:00 無市場成交價格，則比較前日均價)</p> <ul style="list-style-type: none"> • 報買價 \geq 最近成交價 1.1 倍 • 報買價 \geq 前日均價 1.1 倍 • 報賣價 \leq 最近成交價 0.9 倍 • 報賣價 \leq 前日均價 0.9 倍
報價輸入	與前一筆報價價差警示 (警示比例可自行調整)	<p>範例：設定報價價差比例 5 %</p> <ul style="list-style-type: none"> • 報買(賣)價\geq前一筆報買(賣)價 X 1.05 或 報買(賣)價\leq前一筆報買(賣)價 X 0.95
點選交易	推薦股票點選交易價格與前一筆該股票報價價差警示 (警示比例可自行調整)	<p>範例：設定報價價差比例 5 %</p> <ul style="list-style-type: none"> • 點選交易買(賣)價\geq前一筆報買(賣)價 X 1.05 • 點選交易買(賣)價\leq前一筆報買(賣)價 X 0.95
委託輸入	委託數量警示	<ul style="list-style-type: none"> • 委託股票、基金數量超過 499 張或小於等於 100 股 • 黃金無限制
委託輸入	登錄一般板股票首五日委託價格警示	<ul style="list-style-type: none"> • 委託價格超過交易當時控管基準價(註)之上下 30%
委託輸入	基金委託價格警示	<p>正常單：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 委託價格超過交易當時控管基準價(註)之上下 30% <p>放行單：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 委託價格超過交易當時控管基準價(註)之上下 50% • 委託價格與交易當時控管基準價(註)之價格差距超過 50 元者

委託輸入	黃金委託價格警示	正常單： • 委託價格超過交易當時控管基準價(註)之上下5% 放行單： • 委託價格超過交易當時控管基準價(註)之上下10%
------	----------	---

註：控管基準價為「交易當時推薦證券商(造市商)最佳買進及賣出報價平均價」