

附錄2

SASB準則索引



揭露主題	指標代碼	性質	揭露指標	對應章節/ 補充說明	頁碼
提倡透明與有效的資本市場	FN-EX-410a.1	量化	<ul style="list-style-type: none"> 因公開發布資訊導致交易中斷的 (1) 次數與 (2) 平均時間 因異常波動導致交易暫停的 (1) 次數與 (2) 平均時間 	附錄	104
	FN-EX-410a.2	量化	透過自動交易系統的交易佔比	無使用自動交易系統	-
	FN-EX-410a.3	質化	說明有關公開發布資訊時間與性質的警示政策	1-2 永續	56
	FN-EX-410a.4	質化	說明鼓勵或要求公開發行企業公開揭露ESG資訊的政策	2-1 強化企業參與	65
利益衝突管理	FN-EX-510a.1	量化	說明因詐欺、內線交易、反托拉斯、反競爭行為、市場操縱、舞弊或其他與金融產業相關法規或規範相關的財務損失總額	2-2 營運治理	68
	FN-EX-510a.2	質化	討論鑑別與評估利益衝突的過程	2-2 營運治理	68
營運持續與技術風險管理	FN-EX-550a.1	量化	(1) 重大市場干擾次數、(2) 停機時間	附錄	104
	FN-EX-550a.2	量化	(1) 資訊洩漏次數、(2) 涉及洩露可辨識個人資料的次數佔比、(3) 受資料洩漏影響的客戶數	2-2 營運治理	68
	FN-EX-550a.3	質化	說明防範技術性錯誤、安全漏洞、市場干擾的相關措施	2-2 營運治理	68
交易所活動	FN-EX-000.A	量化	按產品與資產類別執行的每日平均交易次數	附錄	104
	FN-EX-000.B	量化	按產品與資產類別執行的每日平均交易金額	附錄	104

櫃買中心2020年發生交易中斷與交易暫停的時間以及次數

(SASB FN-EX-410a.1)

	發生次數	時間
因興櫃公司公開發布資訊導致的暫停交易	4	4 個交易日
因上櫃公司公開發布資訊導致的暫停交易	19 次	19 個交易日
上櫃個股異常波動導致的交易暫停-瞬間價格穩定措施	21,031 次	42,062 分鐘
興櫃個股異常波動導致的交易暫停-股價異常波動之暫停交易機制	38 次	9,845 分鐘

櫃買中心2020年按產品與資產類別執行的每日平均交易次數與金額

(SASB FN-EX-000.A、FN-EX-000.B)

商品/資產分類	2020年每日平均交易次數 (次數)	2020年每日平均交易金額 (新臺幣元)
股票相關商品		
股票	378,485	49,334,971,118
認購(售)權證	25,110	631,019,696
指數股票型基金(ETF)	2,350	1,695,314,128
轉(交)換公司債	2,105	1,052,829,601
指數投資證券(ETN)	141	7,942,170
商品/資產分類	2020年每日平均成交筆數 (筆數)	2020年每日平均交易金額 (新臺幣元)
債券相關商品		
新臺幣債券(公債、公司債、金融債)	2,143	159,934,916,952
國際債券	51	6,772,303,774
債券ETF	1,563	1,635,924,510

櫃買中心2020年重大市場干擾發生次數與停機時間 (SASB指標 FN-EX-550a.1)

2020年7月20日興櫃股票市場因交易系統主機發生記憶體異常致74分鐘之暫停交易，櫃買中心於第一時間召開緊急應變小組會議並切換至備援系統。後續改善措施則包含強化記憶體監控機制、強化CPU使用情況監控機制及合約增訂廠商應告知事項(如系統特性、系統限制及系統漏洞)等。