**中華民國證券櫃檯買賣中心**

|  |
| --- |
| **標借電腦作業手冊** |

標借電腦作業手冊

壹、系統功能 3

貳、訊息格式說明 5

參、錯誤訊息處理說明 24

肆、電腦作業注意事項 26

標借電腦作業手冊修改紀錄

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 修改日期 |  修 改 內 容 說 明 | 版本 |
| 991018 | 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。 | V2.0 |
| 1030407 | 配合先賣後買現股當沖案，當沖缺券時可委由證金代為標借當沖券差部位 | V2.1 |
| 1030708 | 增加每日傳送證金標借服務費資料(V09) | V2.2 |
| 1050118 | 配合擴大券源案，證金公司借貸專戶、融資融券專戶得參與出借，新增「證金公司出借委託輸入(V10)」檔案格式，供證金公司輸入出借委託資料。 | V2.3 |
| 1080606 | 配合價格欄位擴充案：1. 價格欄位由9(4)V9(2)擴充為9(5)V9(4)
2. 標借價格欄位由9(3)V9(4)擴充為9(4)V9(4)。
3. 委託日期由9(6)改為9(8)，委託時間由9(6)改為9(8)。
 | V2.4 |

 **壹、系統功能**

一、架構說明︰

連線通訊協定

單筆訊息與檔案

傳輸通訊協定

補 成

送 交

作 回

業 報

︰::︰

︰標︰

︰借︰

︰交︰

︰易︰

︰作︰

︰業︰

︰::︰

作 交

業 易

　 報

　 表

管 證

理 券

作 商

業

結

算

作

業

TCP/IPIP

成交回報通訊協定

委託輸入通訊協定

標借交易作業包括下列二項︰

1. 證券商利用委託輸入通訊協定進行出借交易委託輸入作業;證金公司則透過檔案傳輸通訊協定進行出借交易委託輸入作業。

(二)利用單筆訊息與檔案傳輸通訊協定進行報表資料接收。證券商的標借交易作業，透過連線通訊協定，與櫃買中心的標借交易作業建立連線後，經TCP/IP協定，進行標借之交易。交易時間結束後，也必須透過連線通訊協定達到離線的狀態。交易報表與得標回報作業則利用單筆訊息與檔案傳輸通訊協定，和櫃買中心進行報表資料的接收作業。

二、業務範圍
標借交易之業務共有以下幾項︰

(一)標借委託輸入及回報

 1.標借委託出借申報。

 2.標借委託查詢申報。

 3.標借委託改量申報。(證金公司出借時不提供此功能)

 4.標借委託取消申報。

 5.標借委託回報。

(二)確定連線作業。

(三)重新連線後查詢作業。

(四)標借成交報表檔接收作業。

(五)單筆訊息傳送作業。

(六)單筆訊息接收作業。

# 貳、訊息格式說明

由前面之說明可知櫃買中心與證商或證金公司之間的資料傳遞必定是以事先約好的格式相互傳送，在送出任何訊息前都必須檢查每一個欄位。櫃買中心電腦會累計欄位錯誤的次數，若超過規定次數，該PVC將被給予離線作業的處理。

本章將對各約定之格式逐一說明。

一、代碼系統

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄　位　名　稱 | 長　度 | 說明 |
| SUBSYSTEM-NAME | 9(02) | 90 表示標借交易子系統10 表示連線子系統XX 其它皆為不明訊息 |
| FUNCTION-CODE | 9(02) | 01 出借02 取消03 改量04 查詢 |
| MESSAGE-TYPE | 9(02) | 00 委託輸入訊息02 確認連線訊息04 重新連線後查詢訊息01 委託回報訊息03 錯誤發生回覆訊息05 確認連線回覆訊息 |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄　位　名　稱 | 長　度 | 說明 |
| MESSAGE-TIME | 9(06) | 請輸入訊息傳出之時間(HHMMSS) |
| STATUS-CODE | 9(02) | =00 無誤>00 錯誤代碼 |
| BORKER-ID | X(04) | 證券商代號.第一碼:0-9第二碼:0-9，A-Z第三碼:0-9總分公司代號　Ｔ︰自營商　 0︰總公司　>0︰分公司 |
| PVC-ID | X(02) | PVC代號 |
| ORDER-NO | X(05) | 委託書編號 |
| IVACNO | 9(07) | 投資人帳號 |
| STOCK-NO | X(06) | 股票代號 |
| PRICE | 9(04)V9(4) | 每股標借價格 |
| QUANTITY | 9(06) | 出借數量 |
| ORDER-DATE | 9(08) | 委託輸入完成的日期：西元年月日。 |
| ORDER-TIME | 9(08) | 委託輸入完成的時間(HHMMSSmm) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄　位　名　稱 | 長　度 | 說明 |
| BEFORE-QUANTITY | 9(06) | 改量前數量 |
| AFTER-QUANTITY | 9(06) | 改量後數量 |
| AP-CODE | X(01) |  4 表示為標借交易子系統 |
| KEEP | X(01) | 集中保管碼 |

說明: 每一數量為一股票交易單位

二、訊息格式與欄位說明

 1.委託輸入訊息(V010)
委託輸入時，證券商之電腦會用以下之格式資料傳至櫃買中心電腦主機，證券商在送出任何訊息前都必須檢查每一個欄位，檢查無誤後再傳至櫃買中心電腦主機，櫃買中心會累計欄位錯誤的次數，若超過限制次數，該PVC將被給予停止作業的處分。各欄位之檢查說明如下︰
MESSAGE ID︰V010
MESSAGE NAME︰委託輸入訊息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  90 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  00 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) |  00 |
| BODY | BROKER-ID | X(4) |  |
| PVC-ID | X(2) |  |
| ORDER-NO | X(5) |  |
| IVACNO | 9(7) |  |
| STOCK-NO | X(6) |  |
| PRICE | 9(4)V9(4) |  |
| QUANTITY | 9(6) |  |
| KEEP | X(1) |  |

FUNCTION-DODE　　　︰須註明交易別，可參考代碼系統

BROKER-ID　　　　　︰必須有此總分公司代號

PVC-ID　　　　　　 ︰PVC代號(LOGICAL NAME)

ORDER-NO ：委託書編號，供證券商自由規劃彈性 運用。輸入範圍為0~9、A~Z、a~z，委託書編號不得重複。

IVACNO　　　　　　 ︰必須為正確且存在的投資帳號(檢查方法請參照投資人開戶作業手冊)︰

STOCK-NO　　　　　 ︰必須為證券金融公司所要標借之股票

PRICE　　　　　　　︰單價必須落在每股最高標借價內

QUANTITY　　　　 　︰數量必須大於0，小於等於證券金融公司所要標借之數量

作改量時，此欄位為更改後之委託數量。資料單位：交易單位。

KEEP 　　　︰是否為送存集保之股票，若是，請給Y值

 2.委託回報訊息格式及代碼(V020)
櫃買中心電腦主機於收到證券商電腦所傳來之委託資料後，會將委託回報資料傳回至證券商，委託回報之資料格式如下︰

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  90 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  01 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) |  00 |
| BODY | BROKER-ID | X(4) |  |
| PVC-ID | X(2) |  |
| ORDER-NO | X(5) |  |
| IVACNO | 9(7) |  |
| STOCK-NO | X(6) |  |
| PRICE | 9(4)V9(4) |  |
| QUANTITY | 9(6) |  |
| KEEP | X(1) |  |
| ORDER-DATE | 9(8) |  |
| ORDER-TIME | 9(8) |  |
| BEFORE-QUANTITY | 9(6) |  |
| AFTER-QUANTITY | 9(6) |  |

 3.錯誤發生回覆訊息(V030)
如果櫃買中心與證券商間之資料傳遞有異常時，會用以下之訊息回覆，其格式如下︰
MESSAGE ID︰V030
MESSAGE NAME︰錯誤發生回覆訊息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  90 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  00 |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  03 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) | 參考錯誤訊息一覽表 |

 4.確定連線訊息格式及代碼(V040)
MESSAGE ID︰V040
MESSAGE NAME︰確定連線訊息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  90 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  00 |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  02 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) |  00 |

 5.確定連線回覆訊息格式及代碼(V050)
MESSAGE ID︰V050
MESSAGE NAME︰確定連線回覆訊息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  90 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  00 |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  05 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) |  00 |

 6.重新連線查詢訊息格式及代碼(V060)
MESSAGE ID︰V060
MESSAGE NAME︰重新連線查詢訊息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  90 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  00 |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  04 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) |  00 |

 7.要求傳送資料訊息格式及代碼(F050)
MESSAGE ID︰F050
MESSAGE NAME︰要求傳送資料訊息

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| FIELD NAME | FORMAT | CONTENTS |
| CONTROLHEADER | SUBSYSTEM-NAME | 9(2) |  20 |
| FUNCTION-CODE | 9(2) |  02 |
| MESSAGE-TYPE | 9(2) |  04 |
| MESSAGE-TIME | 9(6) |  |
| STATUS-CODE | 9(2) |  |
| F.T.HEADER | SOURCE-ID | X(4) |  ---- |
| OBJECT-ID | X(4) |  0000 |
| BODY-LENGTH | 9(4) |  |
| BODY | FILE-CODE | X(3) | V01,V02,V03,V04,V05,V06 |
|  |  |  |

CONTROL-HEADER與F.T.HEADER部分請參考單筆訊息與檔案傳輸通訊協定

 8.本項說明利用單筆訊息與檔案通訊協定進行報表作業，其所包含之相關傳輸檔案格式內容

(1)標借股票檔

FILE-CODE：V01　　　　　長度：30

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| LOANQTY | 9(6) | 標借數量  |
| PRICE | 9(4)V9(4) | 每股最高標借價 |
| FILLER | X(10) | 空白 |

說明：

1此檔案將於作業時間內不定時傳送，證券商須保

留每次接收之檔案，證券商主動要求V01時，將接收到今日目前所有之標借股票。

2每一數量為一股票交易單位。

(2)證券商與證金公司標借成交回報通知表

FILE-CODE：V02　　　　　長度：60

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| ODRNO | X(5) | 委託書編號 |
| IVACNO | 9(7) | 投資人帳號 |
| KEEP | X(1) | 是否為送存集保之股票 |
| LOANQTY | 9(6) | 出借數量  |
| MTHQTY | 9(6) | 得標數量  |
| PRICE | 9(4)V9(4) | 每股出借價格 |
| LOANTIME | 9(8) | 投標時間 |
| SFCID | X(4) | 證金公司代號 |
| BROKER-ID | X(4) | 證券商代號 |
| FILLER | X(5) | 空白 |

說明：

1此檔案將於開標後，交易所主動傳送證券商與證

 金公司，證券商與證金公司亦可要求傳送

2每一數量為一股票交易單位。

(3)證金公司標借資料輸入檔

FILE-CODE：V03　　　　　長度：40

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| SFCID | X(4) | 證金公司代號 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| LOANQTY | 9(6) | 標借數量 |
| LOANQTY-1 | 9(6) | 標借數量1 |
| PRICE | 9(4)V9(4) | 每股最高標借價 |
| UPA-CODE | X(1) | 異動別 |
| FILLER | X(9) | 空白 |

說明：

1. 此檔案為證券金融公司之作業

UPA-CODE；異動別 -> “1” – 新增

　　　　　　　 　　 “2” – 修改

　　　　　　　　　 “3” – 刪除

1. 每一數量為一股票交易單位。
2. LOANQTY為融資融券券差數量。

 LOANQTY-1為先賣後買當沖券差數量。

(4)證金公司標借資料輸入正確錯誤訊息檔

FILE-CODE：V03　　　　　長度：8

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| ERROR-CODE | 9(6) | 錯誤代碼 |

說明：

1.此檔案為回覆證券金融公司錯誤訊息之作業

2.ERROR-CODE 內容

 “00” ：輸入資料正確

 “24” ：該股票暫停標借

 “30” ：股票代號錯誤

 “46” ：標借數量或價格欄位含非數字

 “47” ：標借數量不得為零

 “54” ：該股票已有標借資料

 “55” ：異動別錯誤(須 1 OR 2 OR 3)

 “56” ：該股票標借資料不存在

 “71” ：每股最高標借價格錯誤

 “72” ：該股票標借已確認

 “99” ：輸入欄位錯誤超過50次

(5)證金公司標借成交回報通知表

FILE-CODE：V04　　　　　長度：70

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| DATA-1 | GROUP |  格式一 |
|  STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
|  BROKER-ID | X(4) | 證券商(含出借證金)代號 |
|  IVACNO | 9(7) | 投資人帳號 |
|  IVAC-NAME | X(16) | 投資人姓名 |
|  PRICE | 9(4)V9(4) | 每股出借價格 |
|  ODRQTY | 9(6) | 出借數量  |
|  MTHQTY | 9(6) | 得標數量  |
|  KEEP | X(1) | 集中保管 |
|  SFCID | X(4) | 證金公司代號 |
|  KIND | X(1) | 標借種類 |
|  FILLER | X(11) | 空白 |
| DATA-2 | GROUP |  格式二 |
|  STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
|  BROKER-ID | X(4) | 證券商代號 🡪 “9999” |
|  TOTAL-MTHQTY | 9(6) | 得標總數量  |
|  TOTAL-LOANFEE | 9(12) | 借券總費用 |
|  FILLER | X(42) | 空白 |

說明：

1. 此檔案為證券金融公司之作業，本檔案包含二種格式。
2. 每一數量為一股票交易單位。
3. 標借種類：0為融資融券券差標借。

 1為先賣後買當沖券差標借。

(6)證金公司標借費用分配表

FILE-CODE：V05　　　　　長度：60

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| SFCID | X(4) | 證金公司代號 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| BROKER-ID | X(4) | 證券商代號 |
| IVACNO | 9(7) | 投資人帳號 |
| PRICE | 9(4)V9(4) | 每股出借價格 |
| MTHQTY | 9(6) | 得標數量  |
| MTHAMT | 9(10)V9(2) | 借券費用 |
| FILLER | X(13) | 空白 |

說明：

1. 此檔案為證券金融公司之作業

2每一數量為一股票交易單位。

(7)證券商出借證券費用明細表

FILE-CODE：V06　　　　　長度：60

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| BROKER-ID | X(4) | 證券商(含出借證金)代號 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| IVACNO | 9(7) | 投資人帳號 |
| PRICE | 9(4)V9(4) | 每股出借價格 |
| MTHQTY | 9(6) | 得標數量(交易單位) |
| MTHAMT | 9(10)V9(2) | 借券費用 |
| SFCID | X(4) | 證金公司代號 |
| FILLER | X(13) | 空白 |

說明：

1.此檔案為證券公司之作業

(8)證金公司標借手續費用表

FILE-CODE：V09　　　　　長度：60

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| SFCID | X(4) | 證金公司代號 |
| STOCK-NO | X(6) | 股票代號 |
| MTHQTY | 9(6) | 信用券差標借成交量 |
| MTHQTY-DT | 9(6) | 當沖券差標借成交量 |
| MTHQTY-SUM | 9(8) | 總成交量 |
| PRICE | 9(5)V9(4) | 前日收盤價 |
| LOAN-FEE | 9(10) | 借券費用 |
| FEE | 9(10) | 電腦服務手續費用 |
| FILLER | X(1) | 空白 |

說明：

1. 此檔案為證券金融公司之作業
2. 每一數量為一股票交易單位。
3. 每日開標後傳送各證金今日手續費用與各檔股票標借開標後彙整資料。
4. 當STOCK-NO等於”000000”時，表示欄位FEE為證金今日應付電腦服務手續費用，其餘欄位為0。
5. 當STOCK-NO不等於”000000”時，為個股標借彙整資料，欄位FEE為0。

(9)證金公司出借委託輸入(檔案傳輸)

FILE-CODE：V10　　　　　長度：40

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| BROKER-ID | X(04) | 證金公司代號 |
| ORDER-NO  | X(05)  | 委託書編號 |
| IVACNO  | 9(07)  | 出借帳號 |
| STOCK-NO  | X(06)  | 股票代號 |
| QUANTITY  | 9(06)  | 出借數量 |
| PRICE  | 9(04)V9(04)  | 每股出借價格 |
| TXCD  | X(01)  | 交易別 |
| FILLER  | X(03)  | 空白 |

說明：

1此檔案為證金公司之作業;

2 BROKER-ID : 證金公司代號

TXCD : 新增 ‘1’: 所有欄位須輸入;

刪除 ‘2’: 僅輸入BROKER-ID / ODRNO

查詢 ‘4’: 僅輸入BROKER-ID / ODRNO

(其餘欄位參考 V010)

(10)證金公司出借委託回報(檔案傳輸)

FILE-CODE：V10　　　　　長度：50

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 欄 位 名 稱 | 長 度 | 說 明 |
| STATUS-CODE  | X(02)  | 處理結果碼 |
| BROKER-ID  | X(04)  | 證金公司代號 |
| ORDER-NO  | X(05)  | 委託書編號 |
| IVACNO  | X(07)  | 出借帳號 |
| STOCK-NO  | X(06)  | 股票代號 |
| QUANTITY  | 9(06)  | 出借數量 |
| PRICE  | 9(04)V9(04)  | 每股出借價格 |
| TXCD  | X(01)  | 交易別 |
| TIME | 9(08) | 回報時間 |
| FILLER  | X(03)  | 空白 |

說明：

1此檔案為證金公司之作業;

2 STATUS-CODE : 處理結果碼,

請參考 ‘參、錯誤訊息處理說明’.

 (其餘欄位參考 V010)

# 參、錯誤訊息處理說明

主機連線因證券商端之畫面及報表皆是由提供系統之資訊公司或證券商之電腦部門所設計，所以畫面及訊息各家不同，由前面之介紹可了解櫃買中心與證券商之間資料傳遞之基本架構及格式，如果有異常情況發生時，請先依提供系統之資訊公司或證券商電腦部門所編之使用手冊處理，如果狀況仍無法排除，請記住當時的狀況及訊息，並與櫃買中心連絡。以下訊息是由櫃買中心電腦主機傳給證券商，證券商終端機所看到的訊息不一定與下表完全相同(因所採用之電腦系統而有所差別)，在此僅將櫃買中心電腦主機所產生之訊息及處理方式說明如下，以供參考。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| STATUSCODE | 訊息內容 | MESSAGEID | 證券商應處理事項 |
| 00 | SUCCEED | V020 | 輸入下一筆訊息 |
| 01 | TIME IS OVER | V030 | 結束委託程式 |
| 02 | TIME IS TOO EARLY | V030 | 稍待再輸入 |
| 11 | FUNCTION-CODE INVALID | V030 | 檢查並更正功能碼 |
| 12 | BROKER-NO ERROR | V030 | 檢查並更正證券商代號 |
| 13 | BRANCH-NO ERROR | V030 | 檢查並更正分公司代號 |
| 14 | IVACNO ERROR | V030 | 檢查並更正投資人帳號 |
| 15 | PVC-ID ERROR | V030 | 檢查並更正PVC代號 |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| STATUSCODE | 訊息內容 | MESSAGEID | 證券商應處理事項 |
| 16 | TERM-ID ERROR | V030 | 檢查並更正終端機代號 |
| 17 | SEQ-NO ERROR | V030 | 檢查並更正委託書編號 |
| 18 | STOCK-NO ERROR | V030 | 檢查並更正股票代號 |
| 19 | PRICE ERROR | V030 | 檢查並更正單價 |
| 20 | QUANTITY ERROR | V030 | 檢查並更正出借數量 |
| 21 | THIS STOCK CAN’T LOAN TRANSACTION | V030 | 檢查並更正股票代號 |
| 22 | DATA DUPLICATE | V030 | 檢查並更正委託書編號 |
| 23 | KEEP ERROR | V030 | 檢查並更正集中保管欄位 |
| 25  | LENGTH ERROR  | V10 | 資料長度錯誤 |
| 89 | ERROR OVER LIMIT | V030 | 欄位錯誤次數超過設定次數回連線通訊協定 |
| 99 | CALL COMPUTER CENTER | V030 | 查詢委託是否已輸入成功或打電話到櫃買中心詢問 |

# 肆、電腦作業注意事項

一、主機連線證商在接受標借委託時依照委託書編號依次輸入電腦，每筆委託輸入都必須有相對應之委託書，委託書編號不可重複。

二、請檢查櫃買中心傳回來的每一筆委託回報資料是否正確。

三、斷線時或是對委託回報資料有疑問時，請先查詢該筆委託是否存在，若是還有疑問，請連絡櫃買中心。

四、證券商或證券金融公司若收到連線訊息或其它不明訊息時，都必須重新進行連線作業，方能繼續標借作業。