

貳、交易市場業務

一、交易制度規劃及作業

- (一) 提昇除權息作業效率
為各發行公司設置收文專用信箱，以供查閱及核對。另於證券除權息交易日前一營業日收盤後，亦以前開方式告知發行公司該證券除權息參考價等資料，以利股東洽詢。
- (二) 開放證券商以綜合帳戶從事證券交易
開放證券商得以當日綜合交易帳戶全部成交數量及成交總金額進行均價分配予客戶，並得於成交日次一營業日申報部分調整分配，俾滿足投資人均價需求。
- (三) 開放臺灣存託憑證（TDR）得為融資融券交易，95年度已有泰金寶及福雷電取得信用交易資格。
- (四) 開放證券商辦理證券業務借貸款項。
- (五) 增進結算效率
開放證券商得以銀行保證或以中央登錄公債設定質權，抵繳辦理借券及補正手續應提之擔保金，及續行借券洗價後應補繳之擔保金。並實施「證交所、證金公司及證券商」間交割款及信用交易往來相關款項簡化撥付作業（簡稱：三方簡化撥付作業）。
- (六) 後續尚在規劃中的交易制度調整
包括規劃增加市價委託、推動標的指數為外國成分股指數之ETF上市交易、引進ETF造市商制度、調整鉅額交易制度、推展有價證券借貸業務、開放證券商從事有價證券借貸業務、推動證券商資本適足新制度、研議修正券商營業處所場地及設備標準、規劃於「中央銀行同業資金調撥清算作業系統」開立帳戶辦理交割作業等措施。

二、證券商管理與服務

- (一) 證券商查核作業
完成證券商例行查核82家次、一般選案及專案查核492家次、初審證券商募集與發行有價證券案件共17件、審閱證券商財務報告249件，審閱證券商月計表、自有資本適足明細申報表等財務資料計2,379件。
- (二) 加強對證券商風險管理作業
每日收盤後計算證券商待交割部位之風險值（VaR），以防範市場鉅額違約。並於進行證券商例行查核時，同時檢測其風險管理執行成效，95年度共計抽測16家。
- (三) 證券商網際網路委託買賣之管理
本年度網際網路等電子式交易委託買賣開戶數4,009,489戶，成交值占市場比例為17.42%；開辦網際網路等電子式交易委託業務之證券商計63家，其中58家開辦網際網路下單之證券商已完成認證機制。
- (四) 簡化外資申報作業，全年核准境內、外華僑及外國人投資案件計共2,424件。
- (五) 輔導證券商內部控制制度作業
審核證券商總公司對其分支機構之內部稽核作業3,275家次，並定期辦理說明會與證券商從業人員進行雙向溝通。

三、持續進行市場監視作業

為維護股市交易秩序，對於交易異常之有價證券，即公布其名稱及交易資訊，以提醒投資人注意。當異常情形持續時，要求證券商對於大額交易之委託人，採取預收部分（或全部）款券措施，俾降低違約風險，盤中對交易異常則通知證券商注意，另異常情形涉及違法時，即將相關資料，送請檢調機關處理。

參、電腦應用與資訊服務業務

- 一、開發錯帳、違約及第一手借戶賣出作業網路申報。
- 二、整合證券及期貨周邊單位相關申報業務網站之電子憑證系統，以達一證共用及提昇作業效率與降低成本。
- 三、完成ISO27001:2005版資安管理系統轉版認證作業。
- 四、建置「影音傳播網平台」，經由網際網路提供各項業務宣導會即時相關資訊，並提供多樣化的教育訓練課程。
- 五、交易資訊之管理
 - (一) 進行申請使用者訪查作業
對國內外資訊公司、新聞媒體機構及電信、網際網路、廣播電視業者等申請使用者進行選案訪查，本年度共訪查總公司7家、機房28處。
 - (二) 落實資訊之公開及普及
推動國內外資訊業者與本公司簽約傳輸使用交易資訊，簽訂「供給使用交易資訊契約」之申請使用者計有東森電視公司等3家，與本公司簽約申請使用者共計34家。

- (三) 與中央通訊社合作建置「新聞訊息發布平台」，協助上市櫃公司發布訊息至國內、外媒體。加入英國電信集團BT Radianz 公司之資訊共享平台，透過此網路平台與他國交易所做跨國交易及資訊交換之用。



肆、加強投資人服務

- 一、開放電子式專屬線路（DMA）下單。
- 二、規劃建置「投資人個人資料綜合查詢系統」，投資人可憑電子憑證，進行網路查詢。
- 三、維護投資人權益

投資人具名檢舉證券商或其從業人員違規情事，共查核135家次。另抽樣函查證券商有價證券集中保管劃撥帳戶未登摺記載情形、對帳單寄送作業、當日成交金額達五千萬元以上委託人及證券商申報鉅額錯帳等特殊帳戶，共函證4,469件。另提供投資人至本公司現場查詢其個人開戶資料之服務共2,385件。

貳、交易市場業務

一、交易制度規劃及作業

- (一) 提昇除權息作業效率
為各發行公司設置收文專用信箱，以供查閱及核對。另於證券除權息交易日前一營業日收盤後，亦以前開方式告知發行公司該證券除權息參考價等資料，以利股東洽詢。
- (二) 開放證券商以綜合帳戶從事證券交易
開放證券商得以當日綜合交易帳戶全部成交數量及成交總金額進行均價分配予客戶，並得於成交日次一營業日申報部分調整分配，俾滿足投資人均價需求。
- (三) 開放臺灣存託憑證（TDR）得為融資融券交易，95年度已有泰金寶及福雷電取得信用交易資格。
- (四) 開放證券商辦理證券業務借貸款項。
- (五) 增進結算效率
開放證券商得以銀行保證或以中央登錄公債設定質權，抵繳辦理借券及補正手續應提之擔保金，及續行借券洗價後應補繳之擔保金。並實施「證交所、證金公司及證券商」間交割款及信用交易往來相關款項簡化撥付作業（簡稱：三方簡化撥付作業）。
- (六) 後續尚在規劃中的交易制度調整
包括規劃增加市價委託、推動標的指數為外國成分股指數之ETF上市交易、引進ETF造市商制度、調整鉅額交易制度、推展有價證券借貸業務、開放證券商從事有價證券借貸業務、推動證券商資本適足新制度、研議修正券商營業處所場地及設備標準、規劃於「中央銀行同業資金調撥清算作業系統」開立帳戶辦理交割作業等措施。

二、證券商管理與服務

- (一) 證券商查核作業
完成證券商例行查核82家次、一般選案及專案查核492家次、初審證券商募集與發行有價證券案件共17件、審閱證券商財務報告249件，審閱證券商月計表、自有資本適足明細申報表等財務資料計2,379件。
- (二) 加強對證券商風險管理作業
每日收盤後計算證券商待交割部位之風險值（VaR），以防範市場鉅額違約。並於進行證券商例行查核時，同時檢測其風險管理執行成效，95年度共計抽測16家。
- (三) 證券商網際網路委託買賣之管理
本年度網際網路等電子式交易委託買賣開戶數4,009,489戶，成交值占市場比例為17.42%；開辦網際網路等電子式交易委託業務之證券商計63家，其中58家開辦網際網路下單之證券商已完成認證機制。
- (四) 簡化外資申報作業，全年核准境內、外華僑及外國人投資案件計共2,424件。
- (五) 輔導證券商內部控制制度作業
審核證券商總公司對其分支機構之內部稽核作業3,275家次，並定期辦理說明會與證券商從業人員進行雙向溝通。

三、持續進行市場監視作業

為維護股市交易秩序，對於交易異常之有價證券，即公布其名稱及交易資訊，以提醒投資人注意。當異常情形持續時，要求證券商對於大額交易之委託人，採取預收部分（或全部）款券措施，俾降低違約風險，盤中對交易異常則通知證券商注意，另異常情形涉及違法時，即將相關資料，送請檢調機關處理。

參、電腦應用與資訊服務業務

- 一、開發錯帳、違約及第一手借戶賣出作業網路申報。
- 二、整合證券及期貨周邊單位相關申報業務網站之電子憑證系統，以達一證共用及提昇作業效率與降低成本。
- 三、完成ISO27001:2005版資安管理系統轉版認證作業。
- 四、建置「影音傳播網平台」，經由網際網路提供各項業務宣導會即時相關資訊，並提供多樣化的教育訓練課程。
- 五、交易資訊之管理
 - (一) 進行申請使用者訪查作業
對國內外資訊公司、新聞媒體機構及電信、網際網路、廣播電視業者等申請使用者進行選案訪查，本年度共訪查總公司7家、機房28處。
 - (二) 落實資訊之公開及普及
推動國內外資訊業者與本公司簽約傳輸使用交易資訊，簽訂「供給使用交易資訊契約」之申請使用者計有東森電視公司等3家，與本公司簽約申請使用者共計34家。

- (三) 與中央通訊社合作建置「新聞訊息發布平台」，協助上市櫃公司發布訊息至國內、外媒體。加入英國電信集團BT Radianz 公司之資訊共享平台，透過此網路平台與他國交易所做跨國交易及資訊交換之用。



肆、加強投資人服務

- 一、開放電子式專屬線路（DMA）下單。
- 二、規劃建置「投資人個人資料綜合查詢系統」，投資人可憑電子憑證，進行網路查詢。
- 三、維護投資人權益

投資人具名檢舉證券商或其從業人員違規情事，共查核135家次。另抽樣函查證券商有價證券集中保管劃撥帳戶未登摺記載情形、對帳單寄送作業、當日成交金額達五千萬元以上委託人及證券商申報鉅額錯帳等特殊帳戶，共函證4,469件。另提供投資人至本公司現場查詢其個人開戶資料之服務共2,385件。

伍、其他業務

一、編製新指數

推出「電子類發行量加權股價指數之報酬指數」及「金融保險類發行量加權股價指數之報酬指數」，以建構本公司發行量加權指數系列之完整性。

二、加強國際宣導

針對鉅額交易、證券借貸、綜合交易帳戶、外資登記以及公司治理等改革之具體內容，製作英文詳細版（Booklet型式）及簡明版（Fact sheet型式）之說帖，並寄送予富時國家分類委員會委員，以加強對外資宣傳。

三、證券市場國際化之推展

（一）與摩根士丹利資本國際公司、富時指數公司簽訂「使用即時交易資訊編製指數契約」案，提昇本公司即時交易資訊國際化。

（二）積極參與世界交易所聯合會（WFE）、亞洲及大洋洲證券交易所聯合會（AOSEF）、國際證券管理機構組織（IOSCO）等國際證券組織舉辦之會議；主辦AOSEF第25屆台北年會、工作委員會會議及亞太監視業務論壇；又為加強與外國證券機構之資訊交換及交流合作，95年度分別與新加坡交易所簽署「補充備忘錄」、與蒙古結算所暨集中保管公司簽訂「合作備忘錄」、與泛歐交易所簽署備忘錄、與東京證券交易所簽署「市場聯盟計畫備忘錄」；另為增加外國機構投資人對我市場的瞭解，本公司首度赴東京舉辦臺灣投資說明會，另接待來訪外賓共18個國家39團次共112人。



四、推動證券投資宣導事宜

- （一）舉辦證券知識校際競賽與校園宣導活動、於電視媒體以財經專題、插播卡，證交所重大訊息看板、財經瞭望等方式，加強證券投資宣導教育、編印宣導小冊與海報、辦理學校等機關團體之參觀訪問共計30個單位約1118人次。另擴大本公司投資人閱覽室服務項目（增加臺灣證券交易所投資人閱覽室資料導覽系統、公開資訊觀測站及證券商財務資料查詢系統）。
- （二）辦理證券商交割實務、綜合交易帳戶、融資融券業務等業務宣導說明會，及證券商負責人業務座談、有價證券借貸業務人員教育訓練、ETF種子講師培訓課程，全年共計109場次。另以網路教學方式辦理證券交易電腦作業、財務報表申報及網路認證申報安控系統操作講習。



五、研究發展

- （一）完成「無票面金額股票制度之研究」、「我國指數股票型基金（ETF）市場引進造市商制度之可行性分析」、「我國綜合券商轉型投資銀行之可行性分析」等多項專題研究。
- （二）委外完成「股價升降單位變動對投資人下單與市場績效之影響分析」、「建立評價資料庫之可行性研究」及「臺灣證券交易所鉅額新制之評估」等多件專題研究案。
- （三）蒐集證券及產業相關資訊、統計與出版證券刊物。