正本

臺灣期貨交易所股份有限公司　函

地址：100 台北市羅斯福路2段100號14樓
聯絡人：郭先生
聯絡電話：(02)2369-5678分機3368

受文者：本公司網站

發文日期：中華民國109年1月22日
發文字號：台期規字第10906000500號
速別：普通件
密等及解密條件或保密期限：普通
附件：交易系統測試計畫

主旨：配合本公司「期貨市場逐筆行情揭示」乙案，訂於109年2月9日舉辦「期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試」，請查照。

說明：

一、本公司訂於109年2月9日提供期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試，並模擬行情資料傳送行情流量，提供申請P6行情群組之相關業者進行流量測試、確認網路傳輸品質暨評估未來所需頻寬。

二、為確保次一營業日之市場正常交易，與測單位請務必落實測試前資料備份，並確認貴公司系統測試後資料回復作業無誤。

三、檢附「期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試計畫」1份，如有疑義請聯繫郭先生(02)2369-5678分機3368。

正本：各期貨商、前後台資訊廠商、行情資訊廠商、資訊作業部、本公司網站
副本：中華民國期貨業商業同業公會、臺灣集中保管結算所股份有限公司、台北國際金融資訊協會、中華民國證券商業同業公會、臺灣證券交易所股份有限公司

總經理 黃炳鈞

「期貨市場逐筆行情揭示」

交易系統測試計畫

臺灣期貨交易所

中華民國 109 年 1 月

目錄

壹、前言 1

貳、測試日期、時間及內容 1

參、測試對象 4

肆、行情資料播送 4

伍、測試設備 6

陸、其它事項 6

附件 1、逐筆行情回補連線申請使用注意事項 7

附表 1：測試紀錄表 9

附表 2：交易系統測試檢核項目 10

附表 3：逐筆行情壓力測試接收觀察項目 11

壹、前言

配合「期貨市場逐筆行情揭示」乙案，本公司訂於 109 年 02 月 09 日進行交易系統測試，提供資訊廠商、期貨商進行逐筆行情資料接收測試作業，並以正式環境模擬行情資料傳送行情流量約 10Mbps 至 40Mbps 之壓力，提供申請 P6 行情群組之資訊廠商、期貨商進行流量測試、確認網路傳輸品質暨評估未來頻寬之相關作業。

有關測試紀錄表(附表 1)，若測試過程正常無須回傳，倘有任何問題，請於測試完畢後，再將結果填寫於測試紀錄表並 email 至資訊規劃部(tradesys@taifex.com.tw)。

有關逐筆行情壓力測試接收觀察項目(附表 3)，請於測試完畢後，務必填寫逐筆行情壓力測試接收觀察項目(附表 3)並 email 回傳至資訊規劃部(tradesys@taifex.com.tw)。

貳、測試日期、時間及內容

一、測試日期

109 年 02 月 09 日

二、測試時間

臺灣時間	日盤作業事項	夜盤作業事項
08:00	盤前行情傳送	
08:15	TAIFEX 收單(東證期貨)	
08:20	TAIFEX 開盤(東證期貨)	
08:30	TAIFEX 收單(國內股價指數期貨暨選擇權、股票期貨暨選擇權、陸股 ETF 期貨暨選擇權、匯率期貨暨選擇權、黃金期貨暨選擇權、布蘭特原油期貨、美國道瓊期貨、美國標普 500 期貨、美國那斯達克 100 指數期貨)	
08:45	TAIFEX 開盤(國內股價指數期貨暨選擇權、股票期貨暨選擇權、陸股 ETF 期貨暨選擇權、匯率期貨暨選擇權、黃金期貨暨選擇權、布蘭特原油期貨、美國道瓊期貨、美國標普	

臺灣時間	日盤作業事項	夜盤作業事項
	500 期貨、美國那斯達克 100 指數期貨)	
11:15		盤前行情傳送
11:30	TAIFEX 收盤(國內股價指數期貨暨選擇權、股票期貨暨選擇權、布蘭特原油期貨、美國道瓊期貨、美國標普 500 期貨、美國那斯達克 100 指數期貨)	
12:00		TAIFEX 收單(臺指期貨暨選擇權、電子期貨、布蘭特原油期貨、美國道瓊期貨、美國標普 500 期貨、美國那斯達克 100 指數期貨)
12:15	TAIFEX 收盤(東證期貨、陸股 ETF 期貨暨選擇權、匯率期貨暨選擇權、黃金期貨暨選擇權)	TAIFEX 開盤(臺指期貨暨選擇權、電子期貨、布蘭特原油期貨、美國道瓊期貨、美國標普 500 期貨、美國那斯達克 100 指數期貨)
12:45		TAIFEX 收單(匯率期貨暨選擇權、黃金期貨暨選擇權)
13:00		TAIFEX 開盤(匯率期貨暨選擇權、黃金期貨暨選擇權)
14:00		TAIFEX 收盤(所有商品)

三、測試內容

(一) 測試商品包含股價指數期貨暨選擇權、股票期貨暨選擇權、匯率期貨暨選擇權、商品期貨暨選擇權，測試資料(商品代號、合約月份、最後交易日等)以本公司編定資料為準。

(二) 行情將同時播送「逐筆行情揭示行情」暨「每秒 8 次間隔揭示行情」；行情電文詳「臺灣期貨交易所資訊傳輸作業手冊」與「臺灣期貨交易所逐筆行情資訊傳輸作業手冊」。

(三) 本次測試僅於交易時間內測試即時行情，不開放盤後作業、結算系統、媒體申報系統、鉅額申報網站、整批撤銷備援等相關機制。

(四) 本次測試擬於下列時段進行壓力測試，供申請 P6 行情群組之業者進行容量測試、確認網路傳輸品質暨評估未來頻寬之相關作業。

案例梯次	壓力測試時段	P6 群組預估流量(期貨+選擇權)
日盤第 1 梯次	10:30~10:50	10~40 Mbps
日盤第 2 梯次	11:10~11:30	10~40 Mbps
夜盤第 1 梯次	13:00~13:20	10~40 Mbps
夜盤第 2 梯次	13:40~14:00	10~40 Mbps

叁、測試對象

專(兼)營期貨商、前後台資訊廠商及行情資訊廠商。

肆、行情資料播送

一、行情播送群組

(一)日盤即時行情 Multicast 群組設定如下:

系統別	日盤期貨	日盤選擇權
資訊別	Multicast IP & Port	Multicast IP & Port
非連結：一般交易	225.0.100.100:10000	225.0.30.30:3000
非連結：鉅額交易	225.0.200.200:20000	225.0.60.60:6000
連結：一般交易	225.0.150.150:15000	225.0.35.35:3500
連結：鉅額交易	225.0.250.250:25000	225.0.65.65:6500
逐筆行情揭示群組(P6 群組)		
即時行情	225.0.140.140:14000	225.0.40.40:4000
基本資料	225.0.140.141:14100	225.0.40.41:4100
文字公告	225.0.140.142:14200	225.0.40.42:4200
統計資訊	225.0.140.143:14300	225.0.40.43:4300
詢價訊息	225.0.140.144:14400	225.0.40.44:4400
現貨資訊	225.0.140.146:14600	225.0.40.46:4600
快照更新	225.0.140.147:14700	225.0.40.47:4700

行情回補伺服器位址設定如下:

系統別	主服務	備援服務
日盤期貨	192.168.6.111: 20091	192.168.6.112: 20092
日盤選擇權	192.168.8.111: 20291	192.168.8.112: 20292

(二)夜盤即時行情 Multicast 群組設定如下:

系統別	夜盤期貨	夜盤選擇權
資訊別	Multicast IP & Port	Multicast IP & Port
非連結：一般交易	225.10.100.100:10000	225.10.30.30:3000
非連結：鉅額交易	225.10.200.200:20000	225.10.60.60:6000
連結：一般交易	225.10.150.150:15000	225.10.35.35:3500
連結：鉅額交易	225.10.250.250:25000	225.10.65.65:6500
逐筆行情揭示群組(P6 群組)		

即時行情	225.10.140.140:14000	225.10.40.40:4000
基本資料	225.10.140.141:14100	225.10.40.41:4100
文字公告	225.10.140.142:14200	225.10.40.42:4200
統計資訊	225.10.140.143:14300	225.10.40.43:4300
詢價訊息	225.10.140.144:14400	225.10.40.44:4400
現貨資訊	225.10.140.146:14600	225.10.40.46:4600
快照更新	225.10.140.147:14700	225.10.40.47:4700

行情回補伺服器位址設定如下:

系統別	主服務	備援服務
夜盤期貨	192.168.51.111: 20091	192.168.51.112: 20092
夜盤選擇權	192.168.53.111: 20291	192.168.53.112: 20292

二、行情回補線路

行情回補線路申請開放媒體申報系統(測試環境)供期貨商申請正式環境測試之行情回補線路，若欲驗證行情回補相關機制，請於2月7日下午**15:00**以前申請行情回補線路，網址如下：

1. 日盤 https://reportbq888.taifex.com.tw/FMS/login.html

   【31-02. 一般交易時段行情回補線路】

2. 夜盤 https://reportbq888.taifex.com.tw/FMS/login.html

   【31-03. 盤後交易時段行情回補線路】

3. 相關資訊請參考附件1【逐筆行情回補連線申請使用注意事項】

三、聯絡窗口

項目	聯絡電話
線路申請業務	資作部 02-8071-8000 分機 8036
行情回補線路	資作部 02-8071-8000 分機 8037
技術相關問題	資作部 02-8071-8000 分機 8025

伍、測試設備

一、期貨商、行情資訊廠商使用正式系統與期交所正式環境進行交易系統測試。

二、交易系統：日(夜)盤 DNS 為 192.168.46.66、192.168.48.66。

陸、其它事項

一、本測試計畫係為配合 109 年期貨市場逐筆行情揭示之實施，故請於測試期間檢核各項執行結果是否正確。

二、假日測試係使用正式系統進行測試故請於測試前確實執行資料備份，並於測試結束後進行資料還原與確認。

三、本次假日測試係壓力測試，預期於正式環境產生大量行情資料，故請於確實評估壓力測試對於系統容量影響。

四、聯絡方式

項目	聯絡電話
交易系統測試作業	板橋機房 02-8964-9300 分機 9331、9301、9302
測試內容相關問題	資規部 02-2369-5678 分機 3368

附件 1、逐筆行情回補連線申請使用注意事項

申請對象：與本公司「訂閱逐筆行情 P6 群組」並「直接連線」之業者(包含期貨商、IB 及資訊公司)

每日申請時間

1. 逐筆行情回補連線申請功能，提供業者於一般交易時段之交易日上午 8:30 至下午 5:00(GMT+8)，於媒體申報系統線上申請。
2. 當日異動之行情回補連線，於次一交易日生效。

   例：假設 5 日、6 日、7 日皆為交易日，倘業者在 5 日上午 8:30 至下午 3:00 間於線上進行盤後交易時段之行情回補連線申請，該行情回補連線申請將於日曆日 6 日之盤後交易時段(即 7 日盤後交易)生效。

申請注意事項

1. 業者申請人員以**四碼**業者代號為登入帳號(Username)，登入系統後，可進行行情回補連線異動申請。
2. 於逐筆行情回補連線申請介面(日盤期貨、日盤選擇權、夜盤期貨、夜盤選擇權)輸入【Session ID】、【IP】、【Local Port】、【密碼】，每 Session ID 於各系統別可重複出現(例如 Session ID = 1 都可以在日盤期貨、日盤選擇權、夜盤期貨、夜盤選擇權出現)

   使用帳號/密碼登入後即可申請，不檢核憑證。

期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試計畫

個資法權利告知事項

臺灣期貨交易所股份有限公司(以下稱「本公司」)為辦理「**期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試**」，蒐集、處理與利用您的個人資料，為了保障您的權益，請務必詳細閱讀以下各項說明內容。

一、 蒐集、處理與利用資料之相關部門：

部門：本公司資訊規劃部

地址：臺北市中正區羅斯福路二段 100 號 2 樓

電話：(02)2369-5678

傳真：(02)2365-9821

二、 蒐集之目的：

期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試相關事宜。

特定目的
（090） 消費者、客戶管理與服務
（135） 資(通)訊服務

註：本表依據個人資料保護法之特定目的及個人資料之類別訂定。

三、 個人資料之類別：

資料類別
（C001）辨識個人者：姓名、電話及電子郵件。

註：本表依據個人資料保護法之特定目的及個人資料之類別訂定。

四、 個人資料利用之期間、地區、對象及方式：

(1) 期間：自本公司辦理測試作業起至測試作業無問題結束止。相關紀錄表單將於個人資料利用期間屆滿後，依本公司規定程序辦理銷毀。

(2) 地區：本公司。

(3) 對象：本公司辦理期貨市場逐筆行情揭示交易系統測試之人員。

(4) 方式：您之個人資料以紙本方式蒐集，並於測試期間或測試有問題以電話或傳真與您聯繫。

五、 當事人得行使之權利及方式：

您得於資料利用期間，針對說明三之資料，依個人資料保護法第三條針對您個人資料與說明一部門之受理人員以電話聯繫，並請求以下之權利：

(1) 查詢或閱覽

(2) 製給複製本

(3) 補充或更正

(4) 停止蒐集、處理或利用

(5) 刪除。

六、 行使當事人權利事項時，請利用免付費服務專線（0800-075-566）或服務信箱（service@taifex.com.tw）向資規部申請辦理，若有疑問、建議、申訴或抱怨時亦同。

七、 不提供個人資料時對權益之影響：

基於以上特定目的，您需提供以上個人資料予本公司。若您未能或無法提供，導致無法順利完成您所屬公司之期貨市場逐筆行情揭示上線，您及所屬公司須自行負責，概與本公司無關。

附表 1：測試紀錄表

臺灣期貨交易所

期貨市場逐筆行情揭示測試紀錄表

期貨商代號		公司名稱	
聯絡人員		聯絡電話	
測試日期		測試結果	□正常 □異常
意見反應			

※請參照交易系統測試檢核項目(附表 2)，若測試過程有任何問題，請於測試完畢後，填寫本表並 e-mail 至 tradesys@taifex.com.tw

附表 2：交易系統測試檢核項目

交易系統逐筆揭示行情接收測試檢核項目

序號	檢核項目	日盤		夜盤	
		期貨	選擇權	期貨	選擇權
1	漲跌幅資料訊息(I010)	V	V	V	V
2	契約基本資料(I011)	V	V	V	V
3	成交價量揭示訊息(I024)	V	V	V	V
4	盤中最高低價揭示訊息(I025)	V	V	V	V
5	單一商品累計委託量訊息(I030)	V	V	V	V
6	委託簿揭示訊息(I081)	V	V	V	V
7	委託簿快照訊息(I083)	V	V	V	V
8	股票期貨與現貨標的對照表(I120)	V	V	V	V
9	系統訊息(I140)	V	V	V	V
10	心跳訊息(I001)	V	V	V	V
11	快照更新訊息(I084)	V	V	V	V
12	請求行情資料回補回覆訊息(102)	V	V	V	V

附表 3：逐筆行情壓力測試接收觀察項目

交易系統逐筆揭示行情接收測試觀察項目

公司名稱		申請頻寬(Mbps)	
固網業者		是否與接收證交所行情共線	□是 □否
接收項目	□期貨 P6 群組 □選擇權 P6 群組 □期貨 P1 群組 □選擇權 P1 群組 □期貨 P2 群組 □選擇權 P2 群組		

	序號	觀察項目	期貨	選擇權
日盤第1梯次	1	行情錯序比例(%)		
	2	行情遺失比例(%)		
日盤第2梯次	3	行情錯序比例(%)		
	4	行情遺失比例(%)		
夜盤第1梯次	5	行情錯序比例(%)		
	6	行情遺失比例(%)		
夜盤第2梯次	7	行情錯序比例(%)		
	8	行情遺失比例(%)		