

證券市場全面逐筆交易 電腦系統測試說明

電腦規劃部

109年2月20日

電腦系統調整說明

逐筆交易系統測試平台簡介

逐筆交易系統市場會測規劃

3月8日逐筆交易系統市場會測報告

價格欄位放寬為整數五位小數四位

增加「價格種類」與「委託有效期別」欄位

委託及成交時間精準度提高

委託數量預放為六位長度

增加改價功能

- 於民國106年8月11日發函公布規格草案
- 於民國107年10月8日發函公布正式版本
- 於民國108年7月23日微幅調整後再度發函公布修正內容

電腦系統調整-行情資訊系統竭誠為您服務

價格欄位放寬為整數五位小數四位

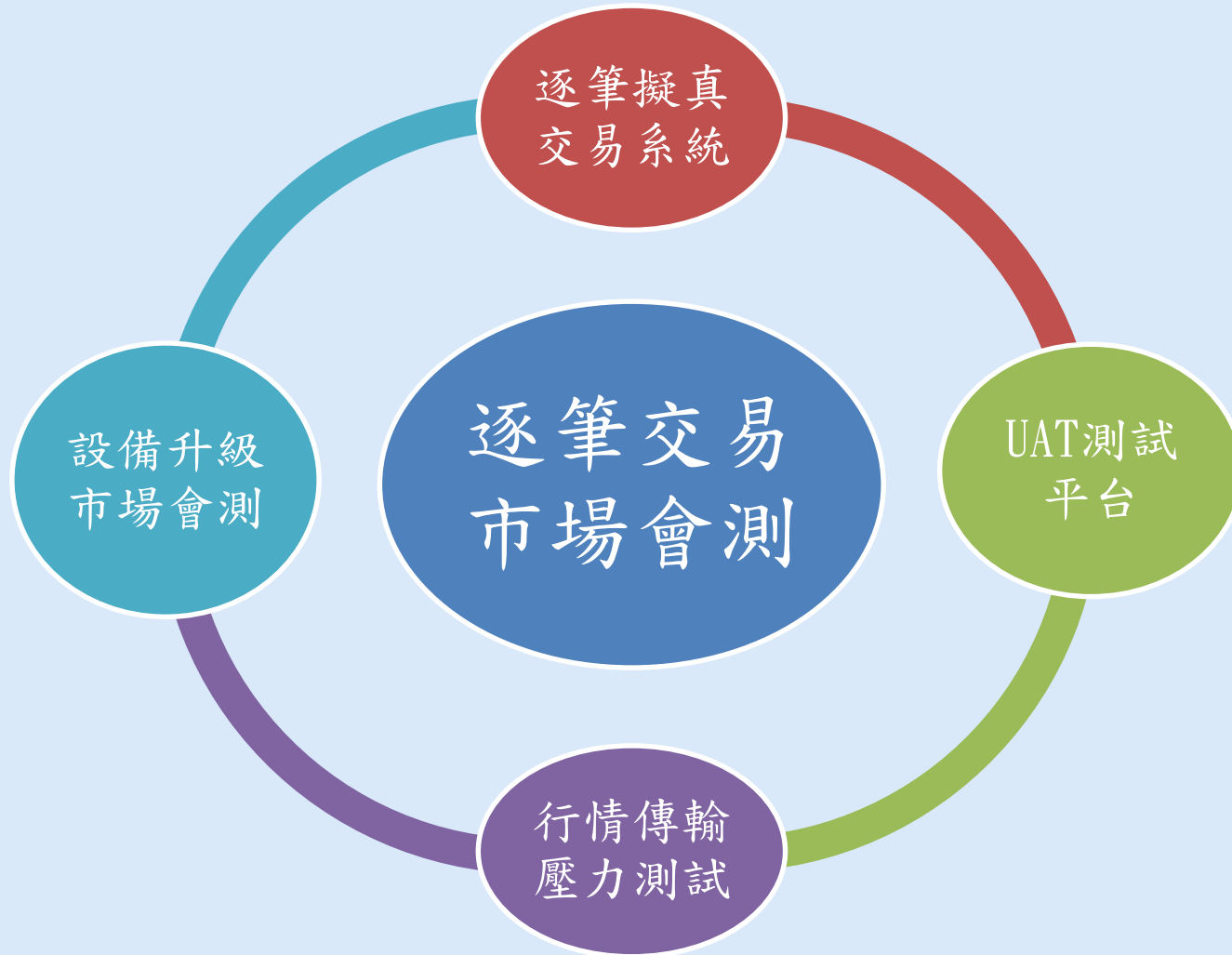
修改部分行情傳輸格式內容

增加五秒行情快照格式

規劃四種行情接收群組，供資訊用戶選擇訂閱

使用五筆行情封裝有效減少行情流量及封包數

- 於民國106年8月11日發函公布「行情傳輸作業手冊」草案
- 協調電信公司提供升速優惠價格
- 於民國107年7月11日發函公布「行情傳輸作業手冊」正式版本
- 於民國108年7月開始，於擬真系統提供多次行情流量壓力測試，使用五筆行情封裝傳輸



- 108年3月25日交易系統上線服務
- 交易時間：每營業日14:30~17:00
 - 避開大盤交易時間，預防投資人混淆
- 系統自動輸入大盤交易三倍數量委託單
- 投資人體驗：新種類委託、逐筆行情揭示
- 證券商功能性測試
- 造市商可驗證佈單策略
- 行情接收用戶功能性測試

- 108年7月1日行情流量壓力測試上線服務
- 壓測時間：每營業日17:10~17:30
— 擬真交易系統結束後進行
- 提供50Mbps行情流量
- 提供證券商/資訊廠商等進行線路升級、主機硬體或資訊設備更新升級後，實施效能測試並確認其傳輸品質

- 108年10月29日開始提供逐筆交易系統測試
- 交易時間：每營業日09:30~21:30
 - 開放較長測試時間，提供證券商完整測試
- 證券商功能性測試
- 行情接收用戶功能性測試
- 包含帳務申報調整等盤後作業功能

- 規劃六次逐筆行情流量壓力測試
 - 提供50Mbps行情流量
 - 自108年7月14日至今已完成五次壓力測試
 - 109年2月23日將舉行第六次壓力測試
- 協助要求高品質傳輸之資訊用戶，確認其傳輸品質
- 提供證券商/資訊廠商等進行主機硬體或資訊設備更新升級後，實施效能測試
- 提供調校及優化其行傳接收系統的整體運作環境
- 測試後均會召開討論會議，邀請證券商、資訊公司及固網業者與會

- 提供證券商進行主機硬體或資訊設備更新升級後，實施效能測試
- 線上環境以現行集合競價方式進行測試
 - 確保所有證券商都能參加測試
 - 方便證券商進行效能比較
- 擬真系統配合開啟，提供逐筆交易測試
- 下次測試日期109年2月23日

- 規劃三次逐筆交易系統市場實況模擬測試
 - 109年2月9日 已順利完成
 - 109年3月8日
 - 109年3月22日
- 測試前一日：啟動交易系統，提供預先測試
- 測試範圍：普通交易、零股交易及盤後定價
- 系統還原測試：前兩次市場會測需還原系統，並辦理系統還原測試
- 測試當天：證交所啟動自動委託程式，進行委託撮合及行情傳輸加壓測試
- 109年3月22日會測後，3月23日系統上線實施

逐筆交易系統市場會測規劃 竭誠為您服務

日期	撮合方式	行傳 壓測	擬真 平台	設備 升級	備註	完成
108年07月14		◎			行情流量壓力測試	√
108年09月22		◎			行情流量壓力測試	√
108年11月24	集合競價	◎		◎	設備升級暨行情流量壓力測試	√
108年12月15	集合競價	◎		◎	設備升級暨行情流量壓力測試	√
109年01月12	集合競價	◎	◎	◎	設備升級暨行情流量壓力測試	√
109年01月29	集合競價		◎	◎	新春開紅盤	√
109年02月09	逐筆交易				逐筆交易第一次市場會測	√
109年02月23	集合競價	◎	◎	◎	設備升級暨行情流量壓力測試	
109年02月28	集合競價			◎	配合特殊交易價格欄位擴充	
109年03月08	逐筆交易				逐筆交易第二次市場會測	
109年03月22	逐筆交易				逐筆交易第三次市場會測	
109年03月23	逐筆交易				逐筆交易系統上線	

- 證券商60家(符合資訊換版補助資格58家)
- 直接連線行傳用戶58家
 - 證券商38家、資訊公司18家、網路服務業者2家
- 參加權證造市測試12家
- 委託筆數：4,780,362
- 成交筆數：507,294
- 揭示筆數：4,129,379
 - 股票：880,860筆
 - 權證：3,248,493筆

- TMP改價委託回報的Before_Qty為0?
 - 108年7月發布修改版本
 - 請於測試系統及市場會測再次確認
- 第一階段零股或盤後定價成交無回報?
 - 證交所零股及盤後定價成交併檔程序調整
 - 周邊單位成交回報線路於收盤後30分鐘再行中斷
- 第二階段盤後定價T33價格錯誤?
 - 下次會測將預先轉檔

- 逐筆會測次數可否增加?
 - 會測前一日啟動交易系統，提供預先測試(約3小時)
- 逐筆交易行情資訊量可否增加?
 - 自動委託:股票三倍量、權證委託後立即取消
 - 委託撮合及行情傳輸加壓測試
- 逐筆馬上就成交，來不及改價?
 - 先以漲停賣或跌停買輸入新單後再改價
- 逐筆IOC立刻全部成交，無法測試部分成交?
 - 觀察買賣最佳一檔的價位及數量

- 測試當日沒有收到成交統計、委託統計、指數、盤後定價及零股行情資料
 - 統計、公告類、盤後定價及零股行情資料已移至第四IP傳送。

各通道傳輸格式列表

行情格式 \ 通道	第一IP	第二IP	第三IP	第四IP
格式1 個股基本資料	✓	✓	✓	✓
格式2 成交統計				✓
格式3 指數統計				✓
格式4 委託統計				✓
格式5 市場公告				✓
格式6 股票即時行情	✓			
格式7 定價成交統計				✓
格式8 定價委託統計				✓
格式9 定價個股成交資料				✓
格式10 新編臺灣指數				✓
格式12 股票開收盤價資料	✓			✓
格式13 零股行情				✓
格式14 權證全稱				✓
格式15 停止交易股票資料				✓
格式16 HeartBeat資料				✓
格式17 權證即時行情		✓		
格式18 權證開收盤價資料		✓		✓
格式19 暫停恢復交易股票資料				✓
格式20 五秒行情快照			✓	
格式21 指數基本資料				✓

逐筆行傳測試接收設定 竭誠為您服務

市場	通道	行情格式	Multicast Group	port
集中市場	第一IP	股票即時行情-1	224.0.100.100	10000
		股票即時行情-2	224.0.200.200	20000
	第二IP	權證即時行情-1	224.2.100.100	10002
		權證即時行情-2	224.2.200.200	20002
	第三IP	五秒快照行情-1	224.4.100.100	10004
		五秒快照行情-2	224.4.200.200	20004
	第四IP	其他行情-1	224.6.100.100	10006
		其他行情-2	224.6.200.200	20006
櫃買市場	第一IP	股票即時行情-1	224.0.30.30	3000
		股票即時行情-2	224.0.130.130	13000
	第二IP	權證即時行情-1	224.2.30.30	3002
		權證即時行情-2	224.2.130.130	13002
	第三IP	五秒快照行情-1	224.4.30.30	3004
		五秒快照行情-2	224.4.130.130	13004
	第四IP	其他行情-1	224.6.30.30	3006
		其他行情-2	224.6.130.130	13006



簡報完畢

敬請指教