

FIX連線服務管理規範

109年12月31日

臺灣證券交易所

電腦規劃部



- 放寬FIX Session線路數



- FIX流量管控機制



- 委託處理逾時取消機制

緣由

- 一般委託線路80，權證造市優惠線路20
- 證券商反應不敷使用

統計數據（109/08/20歷史最大量）

- 一般委託：券商下單最大量每秒1,147筆。80路每秒可下單量16,000筆($80*20*10$)，
- 權證造市：券商下單最大量FIX每秒2,005筆，TMP每秒3,110筆。20路每秒可下單量4,000筆($20*20*10$)

一般委託線路

- 建議：每秒下單量達可下單量50%(8,000筆)放寬10路。

權證造市優惠線路

- 建議：每秒最大委託達可下單量50%(即2,000筆)，放寬10路。

FIX一般委託線路

- 券商不斷提升網路與硬體設備，可在瞬間傳送大量委託，僅部分證券商之委託模式瞬間過於密集集中，就可能對交易系統之造成衝擊。
- 全球交易所對於異常之委託行為亦有採取必要之處置方式（如暫停或中止交易連線）

預計規範

- 單一FIX Session，每十分之一秒最多傳送20筆。
- 主機共置FIX Session，證券商應訂定投資人公平使用線路規則。
- 一般投資人，每千分之一秒最多傳送5筆。
- 專業機構投資人，每千分之一秒最多傳送10筆。
- 未來依系統容量擴充，再評估調整。
- 瞬間大量下單、不正常網路封包及持續斷連線等異常狀況，有阻斷式攻擊(DDOS)跡象，累積超過30次，暫停或中止部分或全部連線服務

緣由

- 逐筆交易後，委託時效性愈趨重要，證交所交易系統異常忙碌，委託過久未處理(超過5秒)，市場價格已偏離原先預期，是否有保留之必要？

預計規範

- 開放對象：權證造市商FIX下單，自行決定「處理逾時取消註記」設定值。
- 處理機制：造市單超過特定時間(5秒)未處理，證交所直接回覆「交易系統忙碌，此筆委託單無效」

簡報結束

敬請指教