|  |  |
| --- | --- |
| 臺灣期貨交易所101年度研究報告提要表 | 填表人：鄭春蓮填表日期：101年11月19日 |
| 研究項目 | 期貨商資訊共用平台建置研究 |
| 研究單位及人員 | 研究單位：臺灣期貨交易所研究人員：鄭春蓮 | 研究時間 | 自101年1月1日至101年11 月30日 |
| 報告內容提要 |
| 壹、研究內容重點 1. 本公司共用平台過去研究結果分析
2. 國內外平台發展案例分析
3. 預期效益及需求訪談
4. 相關技術簡介
5. 初步規劃之可行性及期貨商系統資訊現狀問卷調查
6. 國內各資訊廠商可行性建議
7. 完成系統雛型架構及規格設計
8. 結論與建議

貳、結論與建議事項1. 本公司為考量期貨商面臨期貨市場新的變化及新商品上市時，能使其資訊系統快速反應以滿足市場需求，因此研擬期貨商共用平台建置研究，並在符合市場期待及軟體發展自由度的情境下，提出期貨商資訊共用平台系統架構，透過問卷調查方法確認其可行性,其中有77%期貨商有意願及會考慮使用共用平台，並認同初步規劃架構之可行性。
2. 期貨商對於共用平台所提之意見如下，
3. 使用共用平台上應負擔的成本問題
4. 期望平台可做為系統備援或交易人可使用的電子交易
5. 封閉性系統整合議題
6. 業者已建置系統功能，平台應該要有其獨特性，較能吸引業者使用
7. 業者內部集團已自行整合資訊系統以提供內部人員或交易人使用
8. 佣金問題及客製化問題

針對以上業者所提之問題及建議，本研究在設計上，以雲端服務架構為基礎，期望透過完善的基礎建設、彈性成本、開放性整合機制、多方參與的創意資源及用戶資訊分享等特性，解決業者所提之成本及跨平台整合，並提升平台吸引力。同時規劃了期貨商主機專區，以整合其佣金、客製化、備援系統或電子系統認證需求。1. 研究發現，平台若只考量本公司與期貨商間系統整合及建置，還是無法完全確保新商品或新制度能在預期時間內市場上呈現或全面性上線。因此在規劃後期加入了交易人服務及交易平台，期望能縮短期貨商對其網際網路客戶之系統的建置時間，以達到本公司建置平台之主要目的。
2. 共用平台上每一個服務模組，配合期貨市場保證金制度，即使分散但彼此間關係還是很密切，任一個訊息延遲，皆可能導致用戶錯帳及交易糾紛。尤其當平台涉及交易人服務時，原本期貨商與交易人間的風險協議，可能會因系統提供者為本公司而轉移。
3. 建議在本公司資本支出及人力資源許可的條件下，針對報告中技術缺口部分，包括完整交易人資料、公用模組資料存取及訊息交換、各服務模組效能，建置測試系統並進行可行性驗證。而有關期貨商及平台用戶各項作業及管理規則，可邀集有意願的期貨商共同參與訂定或合作開發。
4. 若技術驗證可行，未來正式建置時應先確認首要服務對象及業者類型，循序漸進，訂定平台各用戶使用辦法及程序，開放用戶服務體驗，以建立符合市場期待、敏捷、穩定及安全的共用平台。
 |

附註：一、報告內容提要應包括下列二部分：

（一）研究內容重點

（二）結論與建議事項

二、本提要表須附電子檔