

DESTINATAIRES: Participants et fournisseurs de la Bourse de Montréal

EXPÉDITEUR: Le gestionnaire de l'accès aux marchés

OBJET: Changements touchant le flux de données multicast - Lancement du protocole D5 pour le HSVF et mise hors service du protocole D3

DATE: Le 24 juillet, 2017

Bourse de Montréal Inc. (la Bourse) annonce qu'elle mettra à niveau son flux de données UDP multicast (multidiffusion) du Service de données de marché à grande vitesse (HSVF) grâce au lancement du protocole D5 pour le HSVF en novembre 2017. Le protocole D5 sera offert dans l'environnement d'essai général (GTE) en août 2017. Les organisations qui utilisent le protocole multicast et unicast D3 sont fortement encouragées à migrer au protocole D4 ou D5 à l'occasion de cette mise à niveau. Le protocole D4 du HSVF continuera d'être offert.

Il est à noter que la Bourse n'acceptera plus les demandes de connexion à l'égard du protocole D3 après août 2017 et qu'elle n'effectuera plus aucun développement connexe à ce protocole. Le tableau ci-dessous fait état des changements à venir en ce qui concerne les différentes versions des protocoles du HSVF.

Sommaire

Protocole	Version HSVF	Notes - GTE	Notes - Environnement de production
Multicast	D3	Mise hors service en août 2017	Mise hors service en février 2018
Unicast	D3	Mise hors service en février 2018	Mise hors service en février 2018
Multicast	D4	Aucune incidence ni aucun changement	Aucune incidence ni aucun changement
Multicast	D5*	Déploiement en août 2017	Déploiement en novembre 2017

* Voir la liste des améliorations ci-dessous.

Le présent avis fournit aux participants un survol des améliorations qu'offrira le protocole D5 au chapitre des spécifications techniques.

Le protocole D5 offrira de nouvelles fonctionnalités, dont les suivantes :

- Inclusion de renseignements sur la table des échelons de cotation dans le flux de données du HSVF
- Renseignements supplémentaires permettant de faire le lien entre les messages d'annulation d'opération et l'opération concernée
- Diffusion séparée du prix de règlement précédent (PreviousSettlementPrice), du prix de règlement (SettlementPrice) et du dernier cours (LastPrice)
- Diffusion de l'état de groupe « intervention avant l'ouverture » (Intervention Before Opening)
- Inclusion des millisecondes dans le message de négociation (Trade)
- Inclusion d'un message « Timebeat »
- Ajout du type de livraison au message de clé d'instrument
- Ajout d'une raison au message de sommaire
- Diffusion du sous-jacent pour les produits pertinents seulement
- Ajout de champs d'information pour les produits connexes qui seront créés ultérieurement

Les participants et les fournisseurs doivent prendre en charge le protocole D5 avec UDP multicast du HSVF pour profiter de ces nouvelles fonctionnalités.

Incidence sur le HSVF multicast

Le tableau qui suit fait état des messages touchés par le passage au protocole D5.

Type de message	Nom du champ	Longueur du champ (en octets)	Type de données
Type de message : C- Option Trade - 87 octets	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphabétique
Type de message : CB- Future Option Trade - 78 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphabétique
Type de message : CF- Future Trade - 71 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Delivery Month	2	Alphabétique
	Delivery Year	2	Numérique
	Delivery Day	2	Numérique
	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique
Type de message : CS- Strategy Trade - 90 octets	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique
Type de message : CW - SWAP Future Trade - 60 octets	Root Symbol	6	Alphanumérique
	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique

Type de message : DB - Future Options Request for Quote (RFQ) - 41 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
Type de message : DF - Futures Request for Quote (RFQ) - 32 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Delivery Year	2	Numérique
	Delivery Day	2	Numérique
Type de message : DW - Swap Future Request for Quote (RFQ) - 40 octets	Root Symbol	6	Alphanumérique
Type de message : FB - Future Options Quote - 58 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
Type de message : FF - Futures Quote - 48 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Delivery Year	2	Numérique
	Delivery Day	2	Numérique
Type de message : FW - Swap Future Quote - 56 octets	Root Symbol	6	Alphanumérique
Type de message : HB - Future Options Market Depth - Jusqu'à 179 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
Type de message : HF - Futures Market Depth - Jusqu'à 170 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Delivery Year	2	Numérique
	Delivery Day	2	Numérique
Type de message : HW - Swap Future Market Depth - Jusqu'à 178 octets	Root Symbol	6	Alphanumérique
Type de message : I - Option Trade Cancellation - 79 octets	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique
Type de message : IB - Futures Options Trade Cancellation - 80 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique

Type de message : IF - Futures Trade Cancellation - 62 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Delivery Year	2	Numérique
	Delivery Day	2	Numérique
	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique
Type de message : IS - Strategy Trade Cancellation - 82 octets	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique
Type de message : IW - Swap Future Trade Cancellation - 64 octets	Root Symbol	6	Alphanumérique
	Timestamp	9	Numérique
	Trade Number	8	Alphanumérique
Type de message : J - Option Instrument Keys - 138 octets	Tick Increment	6	Alphanumérique
	Delivery Type	1	Alphanumérique
Type de message : JB - Future Options Instrument Keys - 125 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
	Tick Increment	6	Alphanumérique
	Delivery Type	1	Alphanumérique
Type de message : JF - Futures Instrument Keys - 132 octets	Symbol - Root Symbol	6	Alphabétique
	Symbol - Deliver Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
	Delivery Type	1	Alphanumérique
	Underlying Symbol	10	Alphabétique
	Associated product - Root Symbol	6	Alphabétique
	Associated Product - Delivery Month	1	Alphabétique
	Associated Product - Delivery Year	2	Numérique
Type de message : JS - Strategy Instrument Keys - 119 octets	Expiry Year	2	Numérique

Type de message : JW - Swap Future Instrument Keys - 182 octets	Symbol - Root Symbol	6	Alphabétique
	Notional Principal Amount	8	Numérique
	Notional Principal Amount Fraction Indicator	1	Alphanumérique
	Delivery Type	1	Alphanumérique
Type de message : N - Option Summary - 135 octets	Settlement Price	6+1	Numérique
	Previous Settlement Price	6+1	Numérique
	Reason	1	Alphanumérique
Type de message : NB - Future Options Summary - 130 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Expiry Year	2	Numérique
	Expiry Day	2	Numérique
	Settlement Price	6+1	Numérique
	Previous Settlement Price	6+1	Numérique
	Reason	1	Alphanumérique
Type de message : NF - Future Summary - 120 octets	Root Symbol	6	Alphabétique
	Delivery Year	2	Numérique
	Delivery Day	2	Numérique
	Reason	1	Alphanumérique
	External Price at Source	6	Numérique
	External Price Fraction Indicator	1	Alphanumérique

Type de message : NS - Strategy Summary - Min. 185 octets / Max. 779 octets	Reason	1	Alphanumérique
Type de message : NW - Swap Future Summary (164 octets)	Root Symbol	6	Alphabétique
	Reason	1	Alphanumérique
Type de message : TT - Tick Table - 79 octets	Message Header	11	
	Tick Table Name	50	Alphanumérique
	Tick Table short name	2	Alphanumérique
	Nb. Entries	2	Numérique
	Entries (max. 30 blocks) - Min Price	6+1	Numérique
	Entries (Max. 30 blocks) - Tick Price	6+1	Numérique
Type de message : Z - Timebeat - 20 octets	Message Header	11	
	Time	9	Numérique

Renseignements

Pour toute question ou toute demande de renseignement, veuillez communiquer avec le centre d'assistance technique.

Centre d'assistance technique

Numéro sans frais : 1 877 588-8489

Appels locaux : 514 871-7872

Courriel : samsupport@tmx.com

Nous vous remercions de votre collaboration.

Le gestionnaire de l'accès aux marchés