关于进一步加强会员单位金融期货业务系统技术要求的通知

中金所技字（2010）11号

各会员单位：

　　为进一步明确金融期货业务系统（以下简称业务系统）技术要求，促进会员单位控制业务系统风险，根据《关于进一步加强期货公司信息技术管理工作的指导意见》（证监会公告[2009]15号）和中国金融期货交易所（以下简称交易所）相关业务规则等规定，就会员单位业务系统有关事项通知如下，请遵照执行：

　　一、交易所全面结算会员的业务系统应当满足中国期货业协会发布的《期货公司信息技术管理指引》（以下简称《指引》）规定的三类要求，并且在交易系统性能、容量以及接入交易所的交易通信链路方面同时满足下列要求：

　　（一）交易系统在拥有10万个客户，10万个持仓记录的容量下，连续10分钟内的稳定处理能力达到300笔委托/秒；

　　（二）具有2条以上（含2条）不同运营商的通讯链路接入交易所，主备链路带宽均不低于2Mbps；

　　（三）采用应用托管方式运行的，具有与其他会员单位技术系统有效隔离的措施；

　　（四）中国证监会和交易所规定的其他要求。

　　二、交易所交易结算会员的业务系统应当满足《指引》规定的二类要求，并且在交易系统性能和容量以及接入交易所的交易通信链路方面同时满足下列要求：

　　（一）交易系统在拥有10万个客户，10万个持仓记录的容量条件下，连续10分钟内的稳定处理能力达到200笔委托/秒；

　　（二）具有2条以上（含2条）不同运营商的通讯链路接入交易所，主链路带宽不低于2Mbps，备份链路带宽不低于512Kbps；

　　（三）中国证监会和交易所规定的其他要求。

　　三、交易所交易会员的业务系统应当满足《指引》规定的一类要求，并且在交易系统性能和容量以及接入交易所的交易通信链路方面同时满足下列要求：

　　（一）交易系统在拥有10万个客户，10万个持仓记录的容量条件下，连续10分钟内的稳定处理能力达到100笔委托/秒；

　　（二）具有2条以上（含2条）不同运营商的通讯链路接入交易所，主链路带宽不低于512Kbps，备份链路带宽不低于128Kbps；

　　（三）中国证监会和交易所规定的其他要求。

　　四、全面结算会员和特别结算会员应当开发交易会员服务系统，向交易会员提供电子化出入金、结算参数和结算数据发布等服务。并向交易所提供软件架构说明书和相关的测试文档，保证所代理交易会员交易的柜台系统具有从单点故障中快速恢复的能力。

　　五、会员单位技术系统采用托管方式的，应当满足以下要求：

　　（一）与托管服务商明确链路保障要求，保证主备链路带宽均能够满足交易所对会员链路的要求；

　　（二）按照《指引》的要求建立健全技术管理制度，管理制度应当与托管服务商的具体规范做好衔接，保证自身对技术系统的管控；

　　（三）及时向托管服务商传达交易所的相关通知和技术要求，督促托管服务商按照要求执行；

　　（四）要求托管服务商定期提供服务报告，详细记录变更、日常运行等运维活动情况；

　　（五）建立对托管服务商服务质量的评估机制，定期评估托管服务商是否按照要求严格履行服务协议。

　　六、申请交易所会员资格以及后续申请与主系统独立的席位时，应当如实向交易所提供核心系统的设计文档、关键性技术指标和所使用交易系统通过接口适用性测试的证明材料，承诺遵守交易所的相关技术规范，并且按照下列要求参加交易所安排的相关测试：

　　（一）链路联通测试：在接收到交易所链路测试通知后，配合交易所做好链路的调试和测试工作；

　　（二）链路切换测试：在交易所技术部门的配合下，进行主链路与备份链路的切换测试；

　　（三）系统压力测试：按照《期货公司业务系统测试说明书》中压力测试相关内容的要求，在交易所系统上进行压力测试，并按照要求向交易所提供生产系统压力测试的详细资料；

　　（四）交易所安排的其他测试。

　　七、落实和加强业务系统的技术管理工作是一项长期系统工程，各会员单位除认真根据本通知的规定落实相关技术要求外，还应当切实加强其他技术细节的管理。

　　八、交易所会员单位无法满足上述系统或者测试要求的，交易所可以根据《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所会员管理办法》和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定进行处理。

　　九、本通知自发布之日起执行，原《中国金融期货交易所金融期货业务系统技术指引》同时废止。

　　特此通知。

中国金融期货交易所

二〇一〇年二月二十一日