

程序化交易系统功能标准符合性自评估表

大商所飞泰测试技术有限公司：

XXXX机构(机构全称)申请测试的 填写程序化交易终端名称+版本号+操作系统平台 对T/ZQX 0004—2025《期货程序化交易系统功能测试指引》中相关条款自我评价结果见下表：

填表说明：

- 1) “自评结果”一栏应根据“评价要点”进行自查，具备对应功能且有效，够勾选“是”，否则勾选“否”。
- 2) 认证委托方在自评价过程中，如**对检测项符合情况有待确定、因自身的技术限制无法完成自评价或无法判断等情况，请在“备注”栏中进行说明。**
- 3) “问题等级”为严重时，必须填写评估结果，且未达到要求时，整改后再进行测试提交。“问题等级”为建议时，可在“备注”栏中备注不适用。

序号	评价类型	评价指标	评价内容	问题等级	自评结果	备注
1	接口适应性	连通性	是否具备与交易系统系统的认证功能或认证功能错误	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			是否能正常登录系统并能正常登录期货公司交易信息系统	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
2		基础交易功能	是否能正常下开仓指令	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
3			是否能正常下平仓指令	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
4			是否能正常下撤单指令	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	

5	异常监测	系统连接状态异常监测功能	是否能正常监测到启动、正常运行、断开、重连的连接状态	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
6		重复报单监测功能	是否能正常监测单合约重复开仓交易指令数量	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
7			是否能正常监测单合约重复平仓交易指令数量	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
8			是否能正常监测单合约重复撤单交易指令数量	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
9		报撤单笔数监测功能	是否能正常监测同一账号的报单交易指令数量	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
10			是否能正常监测同一账号的撤单交易指令数量	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
11	阈值管理	阈值设置及预警功能	是否提供重复报单笔数的阈值设置功能	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			重复开仓单报单笔数等于或大于设置的阈值时, 是否能通过弹窗提示、声音提示、短信、邮件中的一种或多种进行警示	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			重复平仓单报单笔数等于或大于设置的阈值时, 是否能通过弹窗提示、声音提示、短信、邮件中的一种或多种进行警示	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			重复撤单报单笔数等于或大于设置的阈值时, 是否能通过弹窗提示、声音提示、短信、邮件中的一种或多种进行警示	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
12			是否提供报单总笔数的阈值设置功能	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			报单总笔数等于或大于设置的阈值时, 是否能通过弹窗提示、声音提示、短信、邮件中的一种或多种进行警示	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			是否提供撤单总笔数的阈值设置功能	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	

			撤单总笔数等于或大于设置的阈值时, 是否能够通过弹窗提示、声音提示、短信、邮件中的一种或多种进行警示	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
14	错误防范	交易指令检查功能	当合约代码错误时, 系统是否能检查出合约代码错误	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
15			当委托价格最小变动价位错误时, 系统是否能检查出委托价格最小变动价位错误	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
16			当委托数量超出单笔最大委托手数时, 系统是否能检查出委数量错误	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
17		错误提示功能	当资金不足时下达开仓指令, 系统是否能显示资金不足的错误提示信息	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
18			当持仓不足时下达平仓指令, 系统是否能显示持仓不足的错误提示信息	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
19			当市场状态不可用时下达交易指令, 系统是否能够显示非交易时间的错误提示信息	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
20	应急处置	暂停交易功能	是否能够通过限制账号权限、停止策略执行、强制退出账号等一种或多方式暂停交易	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
23		批量撤单功能	是否能提供部分撤单功能	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
24			是否能提供全部撤单功能	建议	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
25	日志记录	日志记录功能	是否能提供日志记录功能	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	
			日志信息是否包括交易日志、系统运行记录、监测记录、错误提示登信息	严重	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/>	