中泰证券股份有限公司

极速交易系统接入使用技术指引

信息技术总部

2017年1月11日

1. **总则**

**第一条** 为加强公司信息系统的风险管理，维护公司信息系统安全、稳定运行，有效防范风险，保护投资者合法权益，从技术上规范明确极速交易系统接入使用上的可行性范围，根据《上海证券交易所程序化交易管理实施细则(征求意见稿)》、《证券公司融资融券业务试点管理办法》、《证券公司网上证券信息系统技术指引》、《关于加强证券公司信息系统外部接入管理的通知》、《证券公司外部接入信息系统评估认证规范》以及《公司信息技术管理制度》等监管规定、行业规范和公司制度，特制定本指引。本指引适用于公司总部及各分支机构。

**第二条** 极速交易系统是指为满足部分或特定投资者需求而开发的，拥有速度优势的类柜台交易系统。

**第三条** 极速交易系统的客户接入方式可采用以下四种

方式：

1. 采用已有的PB系统对接极速交易系统的接入方式：此种方式由公司已经采购的或自主开发完成上线的PB系统通过API开发接口库对接极速交易系统，然后客户通过此PB系统提供的专用客户端程序完成一系列的交易指令发送及接收完成交易操作。
2. 采用定制化交易系统对接极速交易系统的接入方式：定制化是指有别于现已有PB系统，根据使用客户的需求出发，为实现部分特殊功能而特别开发的交易系统，系统通过API开发接口库对接极速交易系统，完成一系列的交易指令发送及接收完成交易操作。
3. 使用极速交易系统提供的专用客户端程序，进行手工或批量下单操作，完成一系列的交易指令发送及接收完成交易操作。
4. 使用基于开源平台自建的策略交易客户端，加载客户自行编写的策略并运行，运行过程中完成一系列的交易指令发送及接收完成交易操作。

**第四条** 根据业务要求签署《中泰证券极速交易系统（XTP系统）使用协议》的客户应选择一种方式接入使用极速交易系统，但不论使用何种方式与极速交易系统进行对接使用，都应该保证交易全过程的技术可控。

**第五条** 采用已有的PB系统对接极速交易系统的接入方式时，需确认已有的PB系统的服务器为托管在我公司机房内，仅可将其支持交易策略加载功能的客户端提供给客户。由客户通过专线方式或互联网VPN接入，将其发出的下单指令传输到服务器的报单程序上，再由报单程序完成接口交互下单操作。整个过程中，策略加载程序或报单程序都需使用指定、可控的用户账户登录，并全程记录交易操作的日志文件，对客户全程的交易下单等操作都进行完整记录。

**第六条** 采用定制化交易系统对接极速交易系统的接入方式时，需将定制化交易系统的服务器托管在我公司机房内，此托管服务器上应部署完整的交易策略加载程序及报单程序部分。客户的交易策略通过交易策略加载程序进行加载，然后通过报单程序部分与极速交易系统进行API接口交互完成下单。此外，为方便客户使用，还可采用直接将交易策略加载部分使用专线接入的方式，将其置于专线另一端的客户环境下来运行。交易策略加载程序通过专线将其发出的下单指令传输到托管服务器的报单程序上，再由报单程序完成接口交互下单操作。整个过程中，策略加载程序或报单程序都需使用指定、可控的用户账户登录，并全程记录交易操作的日志文件，对客户全程的交易下单等操作都进行完整记录。

**第七条** 使用极速交易系统提供的专用客户端程序完成手工或批量下单操作，完成一系列的交易指令发送及接收完成交易操作时，客户可在营业部局域网环境下或专线方式或互联网VPN接入执行客户端程序的操作。整个过程中，都需使用极速交易系统指定、可控的用户帐户登录，并全程记录交易操作的日志文件，对客户全程的交易下单等操作都进行完整记录。

**第八条** 使用基于开源平台自建的策略交易客户端，加载客户自行编写的策略并运行，完成一系列的交易指令发送及接收完成交易操作时，客户可在营业部局域网环境下或专线方式或互联网VPN接入执行客户端程序的操作。整个过程中，都需使用极速交易系统指定、可控的用户帐户登录，并全程记录交易操作的日志文件，对客户全程的交易下单等操作都进行完整记录。

**第九条** 采用已有的PB系统对接极速交易系统及定制化交易系统对接极速交易系统的接入方式时，需确认该系统提供券商端管理功能。券商管理端必须提供：所使用客户的一一对应控制管理权限功能（IP地址，MAC地址，硬盘序列号记录及客户账户的启用停用）及交易日志的记录功能。

**第十条** 采用已有的PB系统对接极速交易系统及定制化交易系统对接极速交易系统的接入方式，在申请接入时，需编写完整的《技术功能说明书》，说明清楚系统支持的技术功能、各系统组件的结构、部署方式及通讯方式等。此外还需明确，除交易策略加载程序，报单程序外，还必须包含券商端管理程序，及可以包含交易风控管理程序、中间通讯、监控程序或其他辅助程序。凡与系统相关的这些程序，都需将其部署在我公司托管机房内。

**第十一条** 原则上，对接极速交易系统的定制化交易系统的运维工作由我公司信息技术总部或运营管理部进行。在运维过程中，有权通过极速交易系统本身的管理端程序或定制化交易系统所开发的专用券商管理端程序，对存在异常操作的客户执行临时或永久限制账户的操作。

**第十二条** 对于采用定制的定制化交易系统对接极速交易系统的接入方式及采用已有的定制化交易系统对接极速交易系统的接入方式，都需要根据公司信息技术总部的技术规范性要求，完成功能连通性测试、安全性测试、性能测试等相关测试工作，生成单项测试报告，并汇总编写**附件1《测试总结报告》**后，还需提交公司部门内部的生产系统上线/变更流程，并完成后，方可正式部署上线。

**第十三条** 如接入极速交易系统的定制化交易系统发生需要升级程序的情况，则可能分为服务器程序完整升级，服务器程序补丁提交升级，客户端程序完整升级及策略文件升级四种升级方式。只要牵涉修改或调整我部托管服务器上的程序文件、策略文件的情况，就需由客户提交程序文件的升级申请，经信息技术总部批准后，由网络安全部专人对补丁及完整升级包进行安全扫描。之后由专职运维极速交易系统的人员来执行程序升级的相关操作**。详见附件2《系统升级申请》**。

**附件１：**

|  |  |
| --- | --- |
| 测试总结报告 | |
| 测试机构： |  |
| 公司类别： |  |
| 测试人员： |  |
| 测试时间： | 年 月 日—— 年 月 日 |
| 测试环境： |  |
| 测试系统： |  |
| 测试内容： |  |
| 测试反馈： |  |
| 测试人员签字： |  |
| 机构用印 |  |

**附件２：**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 系统升级申请 | | | |
| 升级系统： |  | | |
| 升级内容： |  | | |
| 升级方名称： |  | | |
| 升级方人员： |  | | |
| 升级方式 | □服务器程序完整升级 □服务器程序补丁升级  □客户端程序完整升级 | | |
| 升级时间： | 年 月 日 | | |
| 升级前版本： |  | 升级后版本： |  |
| 申请人签字： |  | | |
| 执行人签字： |  | | |
| 机构用印 |  | | |