|  |
| --- |
|  |
| **光 大 证 券** |
| **个股期权API接入工作指引**  **（V1.0）** |
| **光大证券股份有限公司 信息技术部**  **创建日期：2014-12-05** |

**文档控制**

|  |  |
| --- | --- |
| 拟制: |  |
| 审核: |  |
| 发 布: |  |
| 读者： |  |

**版本控制**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 版本 | 提交日期 | 相关组织和人员 | 版本描述 |
| V1.0 | 2014-12-05 | 李麟华 | 在原<API接入工作指引>的基础上补充各环节流程图、网络要求、接入口承诺书 |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

目录

[一、 前言 4](#_Toc405753718)

[二、 技术管理规范 4](#_Toc405753719)

[三、 工作指引 6](#_Toc405753720)

[3.1步骤一：需求收集及分析 6](#_Toc405753721)

[3.1.1接入系统信息 6](#_Toc405753722)

[3.1.2接入方式 6](#_Toc405753723)

[3.1.3结算文件需求及收发方式 7](#_Toc405753724)

[3.1.4明确各方沟通协调及应急机制 7](#_Toc405753725)

[3.1.5填写《API接入需求说明书》 7](#_Toc405753726)

[3.2步骤二：项目报批 8](#_Toc405753727)

[3.3步骤三：系统测试 8](#_Toc405753728)

[3.3步骤四：系统上线 8](#_Toc405753729)

[3.4步骤四：日常运维 9](#_Toc405753730)

[3.5 步骤五：项目终止 9](#_Toc405753731)

[附件一、API交易接入申请流程图 10](#_Toc405753732)

# 前言

光大证券网上交易API接入是指客户使用金仕达发布的API接口,自己开发终端或者使用购买的终端连接金仕达周边网关与金仕达个股期权系统进行交易对接。

# 技术管理规范

第一条 为规范公司各类客户采用API网上交易系统通过数据专线或者互联

网接入公司信息技术系统的行为，保障公司信息技术系统的稳定运行，减少技术

对接带来的风险，根据中国证券监督管理委员会《证券期货业信息系统运维管理

规范》和公司信息技术管理制度要求，制定本规范。

第二条 本规范所称API交易接入是指合作方使用自有系统与光大证

券系统进行对接，将交易指令由其系统直接申报至光大证券信息技术系统，并由

光大证券申报至交易所的合作形式。

第三条 本规范所称合作方所属业务部门是指因业务关系引入交易接入合

作方，并对合作方承担开户、交易、对账等持续服务的公司各业务部门。

第四条 本规范适用于光大证券各部门、各营业部。

第五条 API交易接入系统应具有明确标识的开发商名称、产品名称、

接口版本号。

第六条 API交易接入系统应按我司接口规范要求进行相关对接程序开

发。

第七条 API交易接入应经过需求分析、接口开发、系统对接联调测试，

测试通过后方可正式上线。

第八条 API交易接入合作方使用数字专线与光大证券网络对接的，原

则上建议使用不同运营商的双线联接进行互备，并明确发生线路中断时应采取的

应急交易方案。

第九条 测试通过后，合作方所属业务部门需与拟定正式开展交易日前至

少一周向信息技术部提交正式交易环境开通申请。

第十条 API交易接入合作方所属业务部门需向信息技术部报备合作方

接入系统对网关的功能号调用清单，并确保信息真实、准确、全面，以便评估上

线后系统升级对合作方系统的影响

第十一条 API交易接入系统需真实的将合作方下单所在工作站的MAC

地址和IP地址等设备特征信息传送至光大证券交易系统，此处信息包括但不限

于上述信息，所传信息以满足证监会的相关监管要求为标准。

第十二条 API交易接入系统应使用由交易形式相匹配的委托方式;专

线接入的应采用热键委托，互联网接入的应采用网上委托。采用「IX及其他特殊

类型对接的，应与信息技术部协商使用的委托方式。

第十三条 API交易接入合作方所属业务部门需向信息技术部报备接入

系统所使用的资金帐号清单，如有变更应先报备后使用。

第十四条 API交易接入合作方所属业务部门应充分做好合作方需求调

研，评估合作方委托并发量，并合理设置周边网关流速控制。

第十五条 API交易接入合作方所属业务部门应建立API接入合作方

业务、技术人员通讯录并及时更新相关信息。

第十六条 API交易接入系统部署在合作方所属业务部门现场的，合作

方所署业务部门应按公司相关制度要求建立系统软硬件档案及应急计划。

第十七条 如遇系统升级，合作方所属业务部门需将信息技术部发布的网

关升级变动明细和拟升级日期通知接入合作方，并协调合作方对其接入系统进行

评估，合作方如需进行适应性修改，需与信息技术部对修改后的接口进行测试后

方可使用。升级之日协调合作方配合进行业务测试，如未参加测试，在升级之后

出现因升级引致的技术故障责任由接入方自行承担。

第十八条 API接入系统上线后，合作方所属业务部门需通知合作方于

每日9: 00前对系统的联通性进行验证，有问题需及时反馈给信息技术部相关技

术联系人。

第十九条 正常交易日内如出现故障需在第一时间通知信息技术部，并记录

故障发生时间，故障现象，并准备交易应急措施。

第二十条 API交易接入合作方所属业务部门需指导客户填写《光大证券

API系统接入客户承诺书》，经书面签字后传真至信息技术部技术联系人。

第二十一条 本规范由光大证券信息技术部制定、解释和修订。

第二十二条 各全资及控股子公司API交易接入技术管理可参照本规范执行。

# 工作指引

## 3.1步骤一：需求收集及分析

### 3.1.1接入系统信息

营业部与客户沟通明确对方需接入我司的系统情况，包括开发商名称、产品名称、接口版本号、委托来源记录情况及对周边网关API接口调用清单等后，填写《光大证券外部交易接入信息预登记表》,并将该表格提交给衍生产品部。

附：《光大证券外部交易接入信息预登记表》



### 3.1.2接入方式

目前接入方式有两种：

1. VPN接入:

目前公司网络完全原因不允许API终端直接互联网接入,在终端商没有交易服务器的前提下,可以使用VPN的方式接入,鉴于此营业部必须让客户在《光大证券外部交易接入信息预登记表》写明通讯占用带宽预估值,由信息技术部网络组同事评估是否适用于VPN接入,如审核通过后,信息技术部将向客户提供VPN的连接方式。

1. 部署交易服务器

API交易系统开发商如果有交易服务器,可以讲交易服务器部署在我们公司内网,其服务器直接对接柜台系统的网关服务器,其客户端对接其交易服务器,开发商可以在填写《光大证券外部交易接入信息预登记表》后,由信息技术部网络组同事评估,通过审核后,提供服务器部署环境。

1. 专线直连。

对于占用带宽较大的API终端,需使用数字专线与光大证券进行对接，为保证交易连续性，原则上需使用电信、联通两家不同运营商专线互为备份，如使用单专线需与客户明确专线中断时的应急交易手段（柜台委托、电话委托、网上交易）。

目前总部在北京、上海、深圳三地机房均设有外联区，可以根据客户的地理位置，选择最近的专线接入点，节省费用；如客户机房处于该三地以外地区，且当地设有我司营业部，如对交易速度无特殊需求，可与当地营业部沟通采取专线接入当地营业部的方式接入。

线路费用以上海同城专线为例：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 线路种类 | 一次性费用 | 月租费用 |
| 电信2M SDH | 6000 | 1000 |
| 联通2M SDH | 4500 | 1400 |

**注意：**

1. **以上为上海地区运营商价格，各地运营商存在价格差异，最终费用以网络组报价为准**
2. **除已建外联区的北京、上海、深圳三地以外，如客户需需接入其他地区营业部，需增加外联区建设的网络设备费用，具体费用可咨询网络组同事**

### 3.1.3结算文件需求及收发方式

如客户需我司提供日终结算数据进行清算，营业部向衍生产品部进行申请,由衍生产品部再向运营管理总部申请结算数据，批准后向信息技术部申请传输通道。目前采用的清算数据交付方式有三种：

1. FTP方式。运营管理总部会将所需的清算文件存放到信息技术部指定的FTP目录下，客户可以通过公网登录以上指定地址自行下载文件。
2. 通过深圳通传输。如客户使用深证通模式接入或客户已开通FDEP文件传输服务，可通过深证通FDEP平台收发结算数据。运营管理总部将所需的清算文件放到指定目录下，深证通平台直接将文件发送至客户端。
3. 营业部自行在新意法人结算系统中下载客户所需的结算数据，通过邮件方式加密后发送至客户指定邮箱。

### 3.1.4明确各方沟通协调及应急机制

需明确客户所属部门部门或营业部与客户、开发商、信息技术部等各方角色的责任和义务，并确定各方对口联系人，分为业务联系人和技术联系人。明确当API接入系统发生故障时的通知流程及应急处置手段，应急委托方式包括但不限于网上交易、电话委托、柜台委托等。

### 3.1.5填写《API接入需求说明书》

客户所属业务部门或营业部根据收集到的API接入客户以上所述基本情况、接入方式、结算文件收发、联系方式等填写《API交易接入需求说明书》递交给信息技术部门，信息技术部门就接入的可行性、项目存在的风险等，进行评估。

附：《API接入需求说明书》



## 3.2步骤二：项目报批

客户所属业务部门或营业部通过公文流转形式上报相关部门审批，同时将己填写的《光大证券外部交易接入信息预登记表》、《API交易接入需求说明书》作为附件提交。公文内容需包含但不限于项目基本情况介绍、网络对接申请、服务器设备购买申请、托管设备机房资源申请、接入授权购买申请以及其他相关部门需要的内容。

## 3.3步骤三：系统测试

客户所属业务部门与信息技术部相关负责人进行沟通，确认测试的时间、测试的接入方式（现场、外网接入等）、测试的案例以及应覆盖到的范围。为保证测试效率，如条件允许，可由对方系统开发商提供人员来我司现场进行测试；如条件不允许，可通过互联网接入我司测试环境进行测试。

测试分为三阶段：

1. 接口测试：调试对方系统与我司周边网关接口对接。以接口对接成功，客户资金帐号能成功登陆并实现委托、查询等基本功能，并且对周边网关及后台无较大冲击为通过标准。
2. 功能测试：验证各系统功能是否正常，包括相关边界测试。功能测试要求必须覆盖项目日后所需的所有操作及委托品种。
3. 压力测试：以上测试完成后，需进行大批量委托以验证系统稳定性、满负荷状态下的网络开销情况以评估目前部署环境是否满足客户接入需要。

测试完成后，客户需向所属业务部门/营业部提交测试报告。所属业务部门/营业部核对无误后，向信息技术部递交系统测试报告并发起上线申请。

附：测试报告文档



## 3.3步骤四：系统上线

客户所属业务部门或营业部应至少提前一周通过内部公函形式向信息技术部发起正式接入上线申请，公函内容包含但不限于上线日期、客户使用资金帐号、API接口调用清单、周边网关每秒请求流量数、对方上线联系人等信息，同时将测试报告及签署后的《光大证券API交易系统接入客户承诺书》扫描件作为附件提交。信息技术部将根据公文内容配置周边网关资金帐号、功能号白名单以及流速限制。

信息技术部经评估符合上线要求后，按申请要求时间完成正式环境相关程序部署、配置，通知客户进行连通性测试，连通性测试通过后，通知客户所属业务部门/营业部可正式上线交易。

上线当日建议客户尽量采用小额交易，验证系统的正确性和稳定性。同时做好应急准备，如有问题，立即启用应急以保证交易的正常进行。

附:光大证券API交易系统接入客户承诺书



## 3.4步骤四：日常运维

客户需于每日9：00前对系统的联通性进行验证，并完成同步操作，如有问题需及时联系信息技术部相关技术联系人，以查明问题原因，保证当日交易。

API交易接入系统部署在总部的如交易时间内发生我司系统故障或交易线路中断等情况，信息技术部会在第一时间通知客户所属业务部门/营业部，并及时知会客户相关技术联系人。判断故障严重程度，采取相关应急措施。

API交易接入系统部署在客户所属业务部门/营业部现场的如出现故障需在第一时间通知信息技术部，并记录故障发生时间，故障现象，并准备交易应急措施。

如遇金仕达个股期权系统进行升级，客户所属业务部门需将周边网关升级变动明细和拟升级日期通知接入客户，客户如需进行适应性修改，需与信息技术部对修改后的接口进行测试后方可使用。升级之日客户需配合进行业务测试，如不参加测试，在升级之后出现因升级引致的技术故障责任自负。

如API接入客户需我司提供相关日志时，需由客户提出正式申请（邮件形式），并做好发送留痕，原则上日志只提供给API接入客户而不直接提供给客户系统开发商。如日志中包含其他客户接入信息且无法进行有效的拆分或屏蔽，我司可拒绝向对方提供日志，由我司运维人员负责配合客户工作。

如客户因业务扩展或系统改进，需升级部署在我端的程序如前置机等，需提前一周由客户所属业务部门/营业部向信息技术部提出申请，并在测试环境经过测试提交测试报告后，方可生产环境升级更新。

## 3.5 步骤五：项目终止

第三方接入项目终止后，客户所属业务部门或营业部应通过公文流转形式，通知信息技术部停用相关程序、撤销专线、撤销深证通服务、服务器下架等工作。

## 附件一、API交易接入申请流程图

