**《期货公司交易信息系统测试指引》**

**编制说明**

**一、背景及意义**

为落实《中华人民共和国期货和衍生品法》、《关于加强监管防范风险促进期货市场高质量发展的意见》（国办发〔2024〕47 号）要求，加强程序化交易监管，规范程序化交易发展，维护期货交易秩序和市场公平，中国证监会全面总结期货市场程序化交易监管实践经验，起草了《期货市场程序化交易管理规定（试行）》（以下简称《管理规定》）。《管理规定》明确要求，期货公司交易信息系统应当符合中国证监会及期货交易所规定，具备有效的认证管理、验资验仓、权限控制、异常监测、阈值管理、错误处理、应急处置等功能，并在从事程序化交易前，按照期货交易所规定，建立仿真环境开展测试。

交易信息系统是期货公司开展业务的基础技术系统，为指导期货公司规范开展交易信息系统测试工作，维护期货市场正常交易秩序，保护交易者合法权益，中国期货业协会（以下简称“协会”）组织相关单位开展了本标准的研制工作。

本文件针对期货公司交易信息系统测试的合规要求、性能容量两方面，提出了测试准备、测试数据、测试项建议，明确了测试指标与通过标准，旨在统一的交易信息系统测试工作标准，提升交易信息系统测试工作质量，防范交易信息系统风险，保障期货市场平稳运行。

**二、工作简况**

**（一）起草单位**

根据协会2024年团体标准制定计划，由协会牵头，组织大商所飞泰测试技术有限公司联合上海期货信息技术有限公司、国泰君安期货有限公司、浙商期货有限公司、中粮期货有限公司、银河期货有限公司、上海东证期货有限公司、郑州易盛信息技术有限公司、大连飞创信息技术有限公司、中金所数据有限公司、恒生电子股份有限公司、盛立安元科技（杭州）股份有限公司等单位成立标准编制工作组，共同起草了《期货公司交易信息系统测试指引》。

**（二）主要工作过程**

1.2024年6-9月，通过标准立项，对交易信息系统合规来源进行调研梳理，对验资验仓等合规问题进行分析并制定解决方案。

2.2024年10月，召开启动会，确定标准起草计划及标准起草思路。

3.2024年11月，完成标准初稿起草，组织第一轮评审，收集评审意见开展讨论形成修改稿。

4.2024年12月，组织第二轮评审，收集评审意见并完成意见处理。

5.2025年4月，根据监管规定，完成标准初稿内容调整，收集评审意见并完成意见处理，合稿校验形成初稿。

6.2025年5月，经协会2025年第13期会长办公会审议通过，标准形成征求意见稿。

**三、编制主要内容**

本标准针对期货公司交易信息系统，结合交易信息系统的实际业务场景与技术特性，从合规要求和性能容量两个维度出发，制定明确的测试准备、测试指标与通过标准。具体测试指标如下：

**（一）合规性功能测试**

测试指标围绕交易信息系统认证管理、验资验仓、权限控制、异常监测、阈值管理、错误处理、应急处置和日志记录八方面，提出20项合规性功能测试指标与通过标准，旨在测试交易信息系统功能是否满足各项合规要求。

**（二）性能容量测试**

测试指标从时间特性、容量、资源利用率、容错能力和稳定运行能力五个方面，提出14项性能容量测试指标与通过标准，旨在检查交易信息系统是否能够满足期货公司展业需求。

**四、主要实验（或验证）分析**

本标准在撰写过程中，严格遵循监管要求，紧扣行业发展实践，为期货公司交易信息系统制定详尽的测试指标与通过标准。

**五、与有关的现行法律、法规和国家标准的关系**

本标准为推荐性团体标准，符合《期货公司监督管理办法》《证券期货业网络和信息安全管理办法》《期货市场程序化交易管理规定（试行）》等要求，并参考《期货公司客户交易终端信息采集及接入认证技术规范》《证券期货经营机构信息系统备份能力标准》等行业标准。

**六、与行业数据模型的关系**

本标准暂不涉及与行业数据模型的关系。

**七、重大分歧意见的处理经过和依据**

无。

**八、贯彻标准的要求和建议措施**

本标准作为推荐性团体标准，对期货公司交易信息系统测试起到指导作用，助力期货公司加强风险管理，进一步提升交易信息系统安全性与稳定性，降低系统风险。

**九、国家/行业标准属性的建议**

鉴于本标准的内容未涉及强制性标准或强制性条文的内容及要求，如有必要可上升作为推荐性行业标准。

**十、废止有关现行标准的建议**

无

**十一、其他说明项**

无